

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年9月8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 大関 洋
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託企画部 茶木 健
【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】	FWニッセイ国内株インデックス FWニッセイ先進国株インデックス FWニッセイ新興国株インデックス FWニッセイ国内債インデックス FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり） FWニッセイ外国債インデックス FWニッセイ新興国債インデックス FWニッセイ国内リートインデックス FWニッセイ先進国リートインデックス
【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】	継続募集額 各ファンドにつき、1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

F Wニッセイ国内株インデックス
 F Wニッセイ先進国株インデックス
 F Wニッセイ新興国株インデックス
 F Wニッセイ国内債インデックス
 F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）
 F Wニッセイ外国債インデックス
 F Wニッセイ新興国債インデックス
 F Wニッセイ国内リートインデックス
 F Wニッセイ先進国リートインデックス

以下、上記のそれぞれをまたは総称して「ファンド」、「ベビーファンド」または「ファンドラップ専用ファンド」ということがあります。また、下記の略称で記載することがあります。

ファンド名称	略称
F Wニッセイ国内株インデックス	国内株インデックス
F Wニッセイ先進国株インデックス	先進国株インデックス
F Wニッセイ新興国株インデックス	新興国株インデックス
F Wニッセイ国内債インデックス	国内債インデックス
F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）	外国債インデックス（ヘッジあり）
F Wニッセイ外国債インデックス	外国債インデックス
F Wニッセイ新興国債インデックス	新興国債インデックス
F Wニッセイ国内リートインデックス	国内リートインデックス
F Wニッセイ先進国リートインデックス	先進国リートインデックス

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

「国内株インデックス／国内債インデックス／国内リートインデックス」
取得申込受付日の基準価額です。

「先進国株インデックス/新興国株インデックス/外国債インデックス/新興国債インデックス/先進国リートインデックス」

取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

「外国債インデックス(ヘッジあり)」

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に信託財産留保額を加算した額とします(以下「販売基準価額」ということがあります)。

基準価額は日々変動します。なお、便宜上1万口当りに換算した価額で表示されます。

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

なお、委託会社へは後記「(8) 申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

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

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2023年9月9日から2024年3月8日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

各ファンドは、投資一任契約に基づき、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。

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】

基本方針

「国内株インデックス」

ファンドは、T O P I X（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

「先進国株インデックス」

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

「新興国株インデックス」

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

「国内債インデックス」

ファンドは、N O M U R A - B P I 総合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。

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

ファンドは、F T S E 世界国債インデックス（除く日本）（円ヘッジベース）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。

「外国債インデックス」

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。

「新興国債インデックス」

ファンドは、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）（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。

「国内リートインデックス」

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

「先進国リートインデックス」

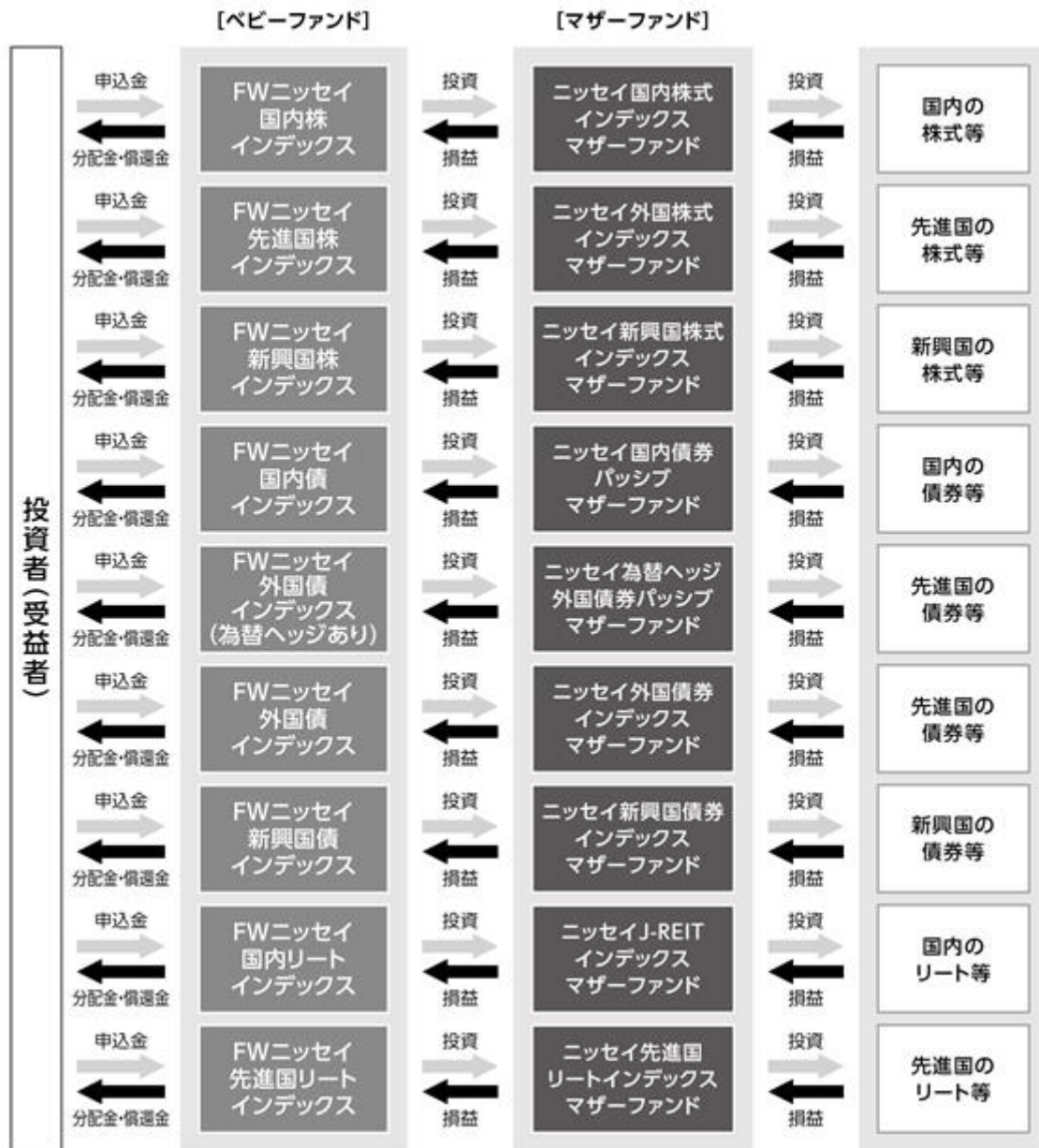
ファンドは、S & P 先進国R E I T インデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



ファンドの特色

- 1**「ファンドラップ専用ファンド」は、投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。
- 2**「ファンドラップ専用ファンド」を構成する各ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて実質的な運用を行います。
- 3**各ファンドの運用方針は以下の通りです。

〈FWニッセイ国内株インデックス〉

日本の株式に投資することにより、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざします。

●TOPIX（東証株価指数）

TOPIX（東証株価指数）とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により株式会社JPX総研が算出する株価指数です。

TOPIX（東証株価指数）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

〈FWニッセイ先進国株インデックス〉

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）の動きに連動する投資成果をめざします。

・原則として、対円での為替ヘッジ*は行いません。

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

●MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

〈FWニッセイ新興国株インデックス〉

新興国の株式等に投資することにより、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざします。

・原則として、対円での為替ヘッジ*は行いません。

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

・投資対象には、DR（預託証券）*もしくは株式等と同等の投資効果が得られる証券および証書等を含みます。

*DR（預託証券）とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し海外で発行される証券をいい、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

〈FWニッセイ国内債インデックス〉

日本の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざします。

●NOMURA-BPI総合

日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

〈FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)〉

日本を除く世界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)(円ヘッジベース)の動きに連動する投資成果をめざします。

・組入外貨建資産について、原則として対円での為替ヘッジ*を行い為替変動リスクの低減を図ります。

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

●FTSE世界国債インデックス(除く日本)(円ヘッジベース)

当インデックスは、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。

〈FWニッセイ外国債インデックス〉

日本を除く世界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)の動きに連動する投資成果をめざします。

・原則として、対円での為替ヘッジ*は行いません。

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

●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

当インデックスは、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。

〈FWニッセイ新興国債インデックス〉

新興国の米ドル建て公社債に投資することにより、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)(円換算ベース)の動きに連動する投資成果をめざします。

・原則として、対円での為替ヘッジ*は行いません。

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

●JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)(円換算ベース)

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)はJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(以下「EMBI+」といいます)から格付がB格以下の債券等を除いたものです。

EMBI+は時価総額加重型の米ドル建て新興国債券インデックスであり、インデックスが対象とする新興国によって発行された確定・変動利付債券等やローンを対象としています。

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)の情報は信頼性が高いとみなす情報源から得られたものですが、J.P.モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。ニッセイアセットマネジメント株式会社は、同インデックスの使用許諾を得て使用しています。J.P.モルガンからの書面による事前の承諾なく同インデックスを複製、使用、頒布することは禁じられています。Copyright ©2016 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複製・転載を禁じます。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。

〈FWニッセイ国内リートインデックス〉

日本のリート(不動産投資信託証券)に投資することにより、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざします。

●東証REIT指数

東証REIT指数とは、東証市場に上場する不動産投資信託(Real Estate Investment Trust)全銘柄を対象とした浮動株ベースの時価総額加重方式により株式会社JPX総研が算出する株価指数です。

東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

〈FWニッセイ先進国リートインデックス〉

日本を除く先進国のリート（不動産投資信託証券）に投資することにより、S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざします。

・原則として、対円での為替ヘッジ[®]は行いません。

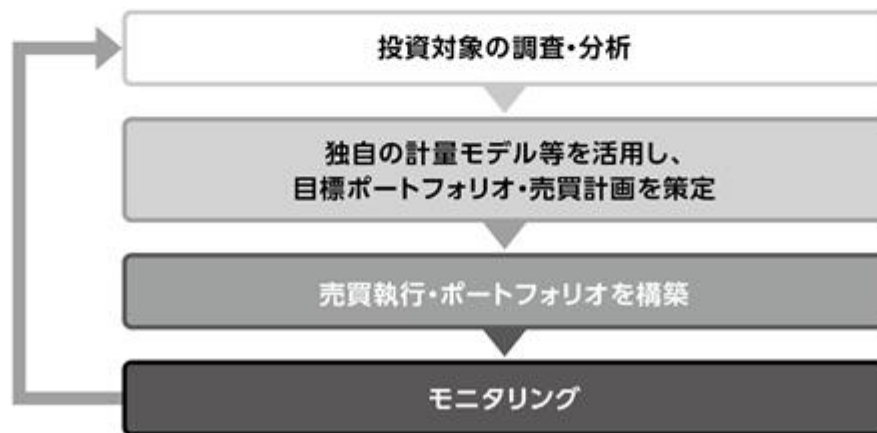
※為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

●S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

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

【各ファンドにおける基準価額と指数の連動性に関する留意点】

ファンドは指数の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。

〈運用プロセスのイメージ〉

<MSCI指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

各ファンドにつき、次の額を限度とします。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	限度額
国内株インデックス	2,000億円とします。
先進国株インデックス	各ファンドにつき、3,000億円とします。
新興国株インデックス	
国内債インデックス	2,000億円とします。
外国債インデックス（ヘッジあり）	各ファンドにつき、3,000億円とします。
外国債インデックス	
新興国債インデックス	
国内リートインデックス	各ファンドにつき、1,000億円とします。
先進国リートインデックス	

ファンドの分類

「国内株インデックス」

追加型投信 / 国内 / 株式 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グローバル 日 本		日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔月)	北 米 欧 州 ア ジ ア オセアニア	ファミリー ファンド	TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米		
その他資産 (投資信託証券 (株式 (一般)))	日 々 その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマー ジ ング	ファンド・ オブ・ ファンズ	その他 ()
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

「先進国株インデックス」

追加型投信 / 海外 / 株式 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グローバル (日本除く)			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔月)	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 ()	TOPIX
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 (MSCI コクサイ・ インデックス)
その他資産 (投資信託証券 (株式(一般)))	日 々 その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマー ジング			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

「新興国株インデックス」

追加型投信 / 海外 / 株式 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グロ-バル 日 本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔月)	北 米 欧 州 アジ-ア オセアニア	ファミリー ファンド	あ り ()	TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し	その他 (MSCI エマ-ジ-ング・ マーケット・ インデックス)
その他資産 (投資信託証券 (株式(一般)))	日 々 その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマ- ジ-ング			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

「国内債インデックス」

追加型投信 / 国内 / 債券 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グローバル 日 本		日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔月)	北 米 欧 州 ア ジ ア オセアニア	ファミリー ファンド	TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	その他 (NOMURA - BPI総合)
その他資産 (投資信託証券 (債券(一般)))	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		

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

追加型投信 / 海外 / 債券 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グロ-バル (日本除く)			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔月)	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 (フルヘッジ)	TOPIX
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 (FTSE 世界国債 インデックス (除く日本) (円ヘッジ ベース))
その他資産 (投資信託証券 (債券(公債)))	日 々 その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマー ジング			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

「外国債インデックス」

追加型投信 / 海外 / 債券 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グローバル (日本除く)			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔月)	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 ()	TOPIX
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 (FTSE 世界国債 インデックス (除く日本、 円換算 ベース))
その他資産 (投資信託証券 (債券(公債)))	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			

「新興国債インデックス」

追加型投信 / 海外 / 債券 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グローバル 日 本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔月)	北 米 欧 州 アジヤ オセアニア	ファミリー ファンド	あ り ()	TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し	その他 (JPモルガン・ エマージング・ マーケット・ ボンド・ インデックス・ プラス (除くB格以下))
その他資産 (投資信託証券 (債券(一般)))	日 々 その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマ- ジ- ン- グ			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

「国内リートインデックス」

追加型投信 / 国内 / 不動産投信 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単 位 型 追 加 型	国 内 海 外 内 外	株 式 債 券 不 動 産 投 信 そ の 他 資 産 () 資 産 複 合	インデックス型 特 殊 型

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グロ ー バ ル 日 本		日 経 2 2 5
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔 月)	北 米 欧 州 ア ジ ア オ セ ア ニ ア	ファミリ ー ファン ド	T O P I X
不動産投信	年 1 2 回 (毎 月)	中 南 米	ファン ド ・ オ ブ ・ ファン ズ	そ の 他 (東 証 R E I T 指 数)
その他資産 (投 資 信 託 証 券 (不 動 産 投 信))	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		

「先進国リートインデックス」

追加型投信 / 海外 / 不動産投信 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単 位 型 追 加 型	国 内 海 外 内 外	株 式 債 券 不 動 産 投 信 そ の 他 資 産 () 資 産 複 合	インデックス型 特 殊 型

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グロ-バル (日本除く) 日 本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 2 回 年 4 回 年 6 回 (隔月)	北 米 欧 州 ア ジ ア オセアニア	ファミリー ファンド	あ り ()	TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し	その他 (S&P先進国 REIT インデックス (除く日本))
その他資産 (投資信託証券 (不動産投信))	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- 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。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
海外	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
株式	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
債券	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
不動産投信（リート）	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 （投資信託証券 （株式（一般）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
その他資産 （投資信託証券 （債券（一般）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、公社債等に主として投資する旨の記載があるものをいう。
その他資産 （投資信託証券 （債券（公債）））	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、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む）に主として投資する旨の記載があるものをいう。
その他資産 （投資信託証券 （不動産投信））	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、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
年1回 日本	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。 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の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本除く）	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
エマージング	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エマージング地域（新興成長国（地域））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。
為替ヘッジあり （フルヘッジ）	目論見書または約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
TOPIX	目論見書または約款において、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。
その他の指数 （MSCI コクサイ・ インデックス）	目論見書または約款において、MSCIコクサイ・インデックスの動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。
その他の指数 （MSCI エマージング・ マーケット・ インデックス）	目論見書または約款において、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。
その他の指数 （NOMURA - BPI総合）	目論見書または約款において、NOMURA - BPI総合の動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。

その他の指数 (F T S E 世界国債 インデックス (除く日本) (円ヘッジベース))	目論見書または約款において、 F T S E 世界国債インデックス (除く日本) (円ヘッジベース) の動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載がある ものをいう。
その他の指数 (F T S E 世界国債 インデックス (除く日本、 円換算ベース))	目論見書または約款において、 F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円 換算ベース) の動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものを いう。
その他の指数 (J P モルガン・ エマージング・ マーケット・ ボンド・イン デックス・プラス (除く B 格以下))	目論見書または約款において、 J P モルガン・エマージング・マーケット・ボ ンド・インデックス・プラス (除く B 格以下) の動きに連動することを目標に 運用を行う旨の記載があるものをいう。
その他の指数 (東証 R E I T 指数)	目論見書または約款において、東証 R E I T 指数の動きに連動することを目標 に運用を行う旨の記載があるものをいう。
その他の指数 (S & P 先進国 R E I T インデック ス (除く日本))	目論見書または約款において、 S & P 先進国 R E I T インデックス (除く日 本) の動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。

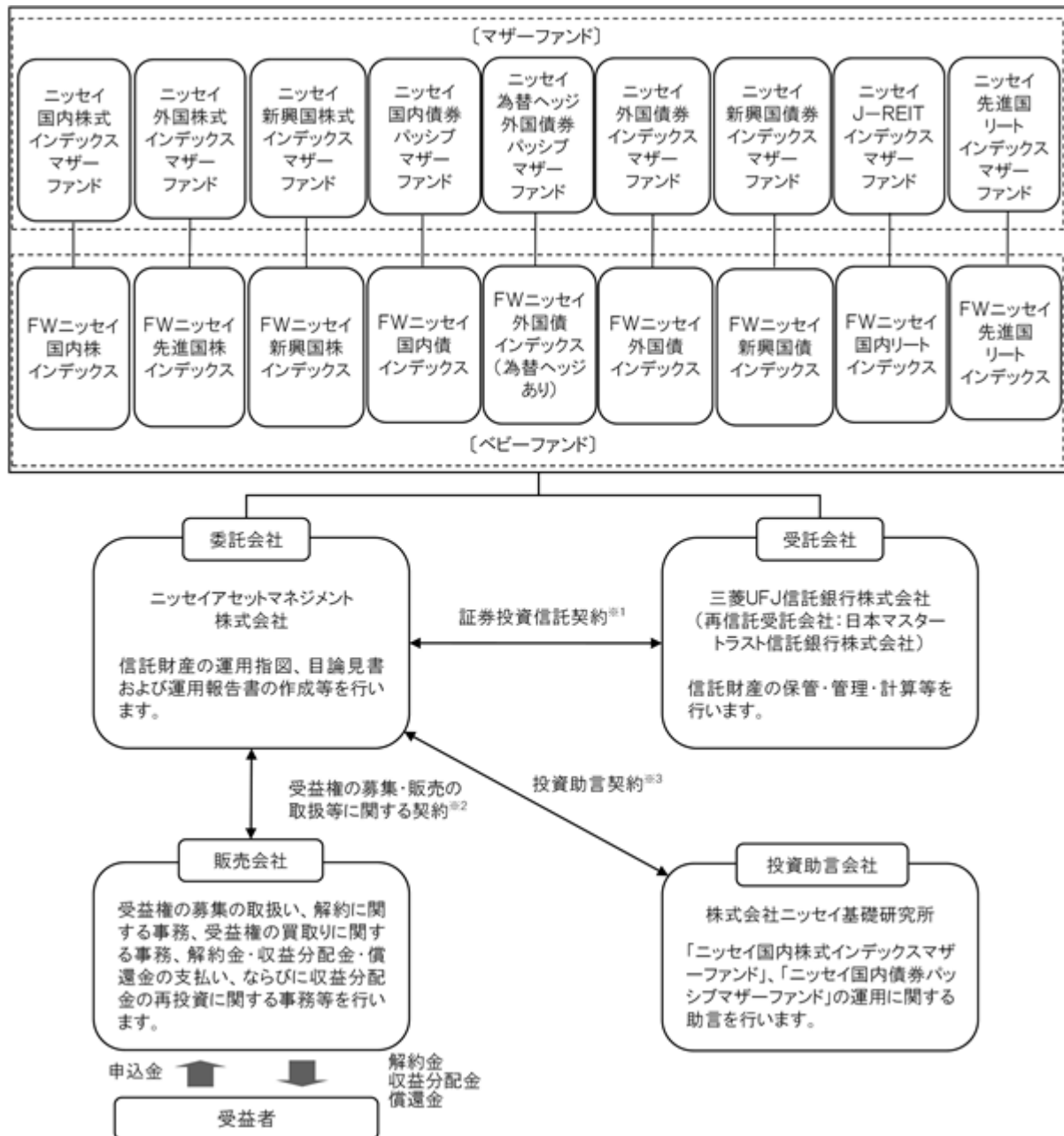
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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

(2) 【ファンドの沿革】

2021年11月30日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 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（2023年6月末現在）

- ・金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第369号
- ・設立年月日：1995年4月4日
- ・資本金の額：100億円
- ・沿革
 - 1985年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
 - 1995年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
 - 1998年7月1日 ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
 - 2000年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。
- ・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

「国内株インデックス」

主としてニッセイ国内株式インデックスマザーファンドに投資を行い、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。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

主として上記マザーファンドに投資を行いますが、追加設定・一部解約にともなう資金フローに対応するため株価指数先物等にも投資します。

株式以外の資産（上記マザーファンドを通じて投資する場合は、当該マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、このファンドの信託財産に属するとみなした部分を含みます）への投資は、原則として信託財産総額の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。

(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

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。

「先進国株インデックス」

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

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに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。

「新興国株インデックス」

主として、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンドを通じて、実質的に新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

株式の実質組入比率の維持のために株価指数先物取引等を活用することがあります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(参考) マザーファンドの概要

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

新興国の株式等(DR(預託証券)を含みます)を主要投資対象とします。

b 投資態度

主として新興国の株式等(DR(預託証券)を含みます)に投資することにより、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

株式の実質組入比率の維持のために株価指数先物取引等を活用することがあります。

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。

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、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。

「国内債インデックス」

主として、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドを通じて、実質的に国内の公社債に投資し、N MURA - BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

上記マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ちますが、追加設定・一部解約に伴う資金フローに対応するため、直接、公社債等に投資を行う場合があります。

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

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、

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。

「外国債インデックス(ヘッジあり)」

主として、ニッセイが替ヘッジ外国債券パッシブマザーファンドを通じて、実質的に日本を除く世界主要先進国の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)(円ヘッジベース)に連動する投資成果をめざします。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(参考) マザーファンドの概要

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブマザーファンド

(1) 基本方針

マザーファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標とした運用を行います。

(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)(円ヘッジベース)に連動する投資成果をめざします。

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きましては、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合には、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。

「外国債インデックス」

主として、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドを通じて、実質的に日本を除く世界主要先進国の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めざします。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(参考) マザーファンドの概要

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

マザーファンドは、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。

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。

「新興国債インデックス」

主として、ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンドを通じて、実質的に新興国の米ドル建て公社債に投資することにより、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)(円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(参考) マザーファンドの概要

ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

マザーファンドは、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

(2) 運用方法

a 投資対象

新興国の米ドル建て公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

主として新興国の米ドル建て公社債に投資することにより、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下)(円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。

公社債の組入比率は、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。

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10%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(上場投資信託証券等を除きます)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、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。

「国内リートインデックス」

主として、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンドへの投資を行い、東証REIT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。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

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J - R E I Tインデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a 投資対象

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

b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（3）投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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。

「先進国リートインデックス」

主として、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドを通じて、実質的に世界各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）している日本を除く先進国の不動産投資信託証券に投資することにより、S & P先進国R E I Tインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

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いいます。以下同じ。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(参考) マザーファンドの概要

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

(1) 基本方針

マザーファンドは、S & P先進国REITインデックス(除く日本、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

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

b 投資態度

主として、世界各国の金融商品取引所に上場(これに準ずる市場で取引されているものを含まず)している日本を除く先進国の不動産投資信託証券に投資することにより、S & P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

株式、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30%以下とします。

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10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

「国内株インデックス」

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます）を主要投資対象とします。なお直接、株式等に投資を行う場合があります。

「先進国株インデックス」

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます）を主要投資対象とします。なお直接、株式等に投資を行う場合があります。

「新興国株インデックス」

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます）を主要投資対象とします。なお直接、株式等に投資を行う場合があります。

「国内債インデックス」

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます）を主要投資対象とします。なお直接、公社債等に投資を行う場合があります。

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます）を主要投資対象とします。なお直接、公社債等に投資を行う場合があります。

「外国債インデックス」

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）を主要投資対象とします。なお直接、公社債等に投資を行う場合があります。

「新興国債インデックス」

ニッセイ新興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）を主要投資対象とします。なお直接、公社債等に投資を行う場合があります。

「国内リートインデックス」

ニッセイJ-REIT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）を主要投資対象とします。

「先進国リートインデックス」

ニッセイ先進国リート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）を主要投資対象とします。

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）

「国内株インデックス」および「国内リートインデックス」は、国内の通貨建て表示のものに限ります。

「国内株インデックス／先進国株インデックス／新興国株インデックス／国内債インデックス／外国債インデックス（ヘッジあり）／外国債インデックス／新興国債インデックス／先進国リートインデックス」

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あるいは金利先渡取引および為替先渡取引」に定めるものに限ります）

ハ．約束手形

二．金銭債権

「国内リートインデックス」

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券

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

「国内株インデックス」および「国内リートインデックス」は、国内の通貨建て表示のものに限ります。

「国内株インデックス／先進国株インデックス／新興国株インデックス／先進国リートインデックス」

1．株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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。

「国内債インデックス/外国債インデックス(ヘッジあり)/外国債インデックス/新興国債インデックス」

1. 国債証券
 2. 地方債証券
 3. 特別の法律により法人の発行する債券
 4. 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)
 5. 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)
 6. 転換社債の転換および新株予約権の行使により取得した株券(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)
 7. コマーシャル・ペーパー
 8. 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7.までの証券または証書の性質を有するもの
 9. 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)
 10. 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)
 11. 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)
 12. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 13. 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)
 14. 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)
 15. 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
 16. 金銭を信託する信託の受益権および金銭債権を信託する信託の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
 17. 外国の者に対する権利で15.および16.の有価証券の性質を有するもの
- ただし、9.および10.の証券については、株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券に投資するものを除きます。

なお、6.の証券および8.の証券または証書のうち6.の証券の性質を有するものを以下「株式」といい、1.から5.までの証券および8.の証券または証書のうち1.から5.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、9.および10.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

「国内リートインデックス」

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.の証券の性質を有するもの
3. 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および社債券（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の新株引受権証券および短期社債等を除きます）
4. 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）

なお、3.の証券を以下「公社債」といい、公社債にかかる運用は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

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。

「国内株インデックス / 先進国株インデックス / 新興国株インデックス / 先進国リートインデックス」

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

「国内債インデックス / 外国債インデックス（ヘッジあり） / 外国債インデックス / 新興国債インデックス」

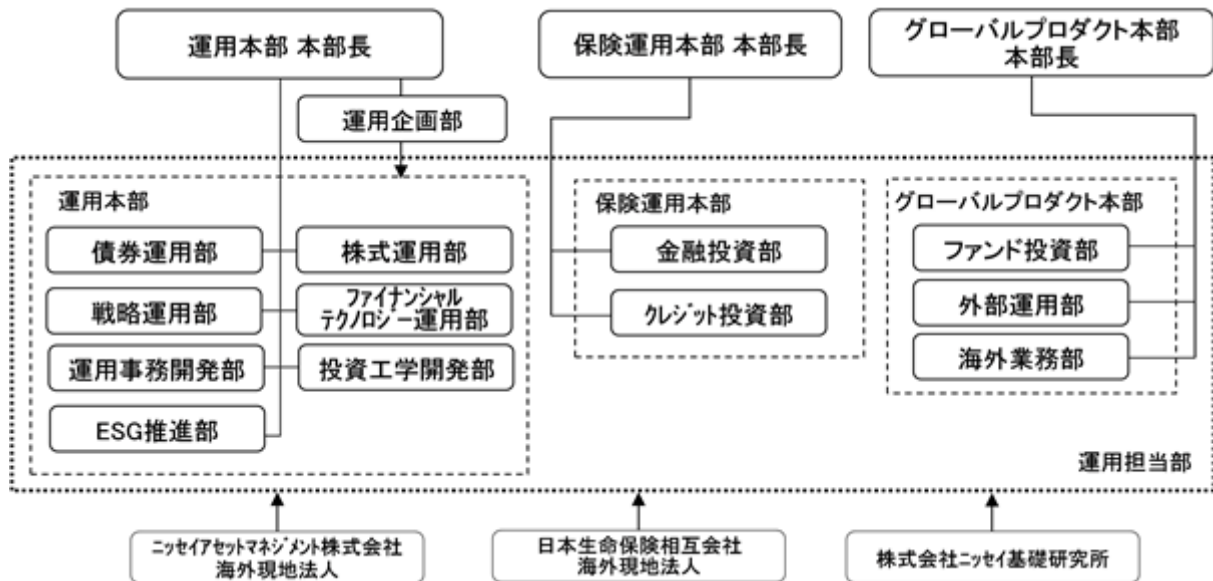
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの
7. 金銭を信託する信託の受益権および金銭債権を信託する信託の受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号または第2号で定めるもの

「国内リートインデックス」

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

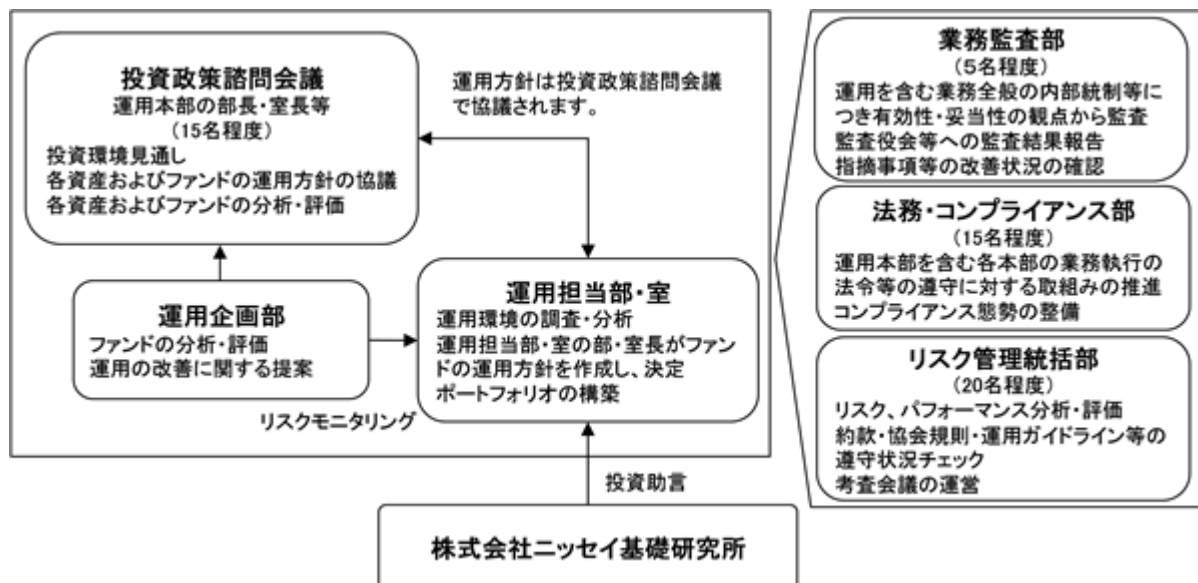
前記 にかかわらず、このファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記 に掲げる金融商品により運用することができます。

(3) 【運用体制】
委託会社の組織体制

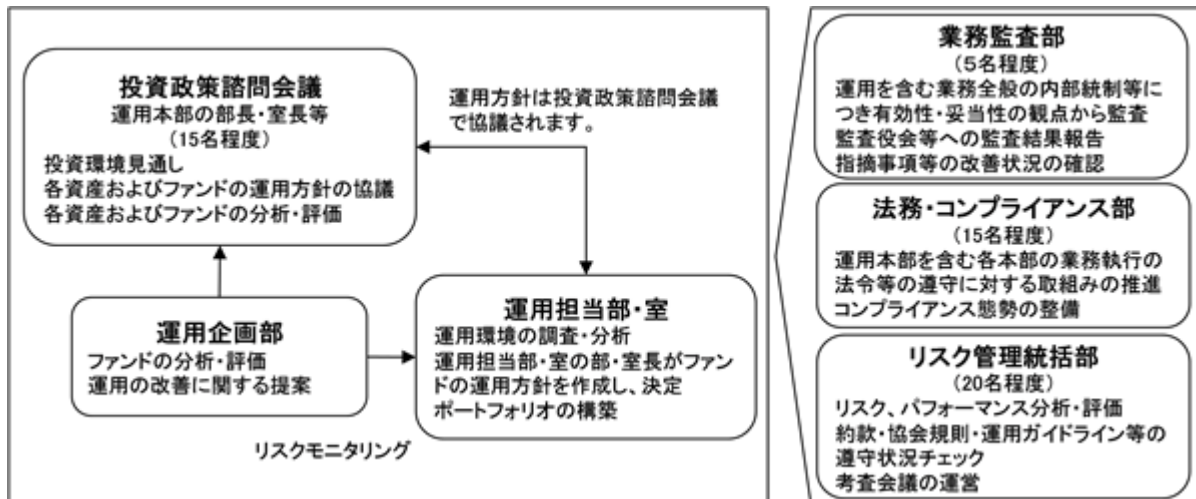


社内規程として、投資信託財産及び投資法人資産に係る運用業務規程およびポートフォリオ・マネジャー／アナリスト服務規程を定めています。また、各投資対象の適切な利用、リスク管理の推進を目的として、各投資対象の取扱いに関して規程を設けています。

内部管理体制および意思決定を監督する組織
「国内株インデックス／国内債インデックス」



「先進国株インデックス／新興国株インデックス／外国債インデックス（ヘッジあり）／外国債インデックス／新興国債インデックス／国内リートインデックス／先進国リートインデックス」



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

１．分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

２．分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

信託財産の十分な成長に資することに配慮し、分配を抑制する方針です。

３．留保益の運用方針

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

分配時期

毎決算日とし、決算日は12月10日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

支払方法

< 分配金受取コースの場合 >

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

< 分配金再投資コースの場合 >

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

「国内株インデックス」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

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

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

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

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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。

「先進国株インデックス」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

「新興国株インデックス」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

「国内債インデックス」

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、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

「外国債インデックス(ヘッジあり)」

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、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることと

なった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「外国債インデックス」

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、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

「新興国債インデックス」

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、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

「国内リートインデックス」

投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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。

「先進国リートインデックス」

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

株式、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

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

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限

「国内株インデックス」

投資する株式等の範囲

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

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

信用取引の範囲

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

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

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

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

金利先渡取引

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

有価証券の貸付けおよび範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。
 - ・株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとし、
 - ・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとし、
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとし、
3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとし、

有価証券の空売り

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

有価証券の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとし、
2. 前記1.は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。
4. 前記1.の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。
資金の借入れ
 1. 信託財産を効率的に運用するため、ならびに信託財産を安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て（一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます）を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 2. 一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
 3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 4. 借入金の利息は信託財産中より支払われます。

「先進国株インデックス/新興国株インデックス/先進国リートインデックス」

投資する株式等の範囲

1. 投資する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
2. 前記1.にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、投資することができます。

信用取引の範囲

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

先物取引等

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

スワップ取引

1. 異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。
2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。
 4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
 5. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 6. スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。
- 金利先渡取引および為替先渡取引
1. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
 2. 金利先渡取引および為替先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 4. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。
- 有価証券の貸付けおよび範囲
1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けすることができます。
 - ・株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。
 3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとします。
- 有価証券の空売り
1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
 2. 前記1.の売付けは、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。
- 有価証券の借入れ
1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとします。
 2. 前記1.は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。
 4. 前記1.の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。
- 外国為替予約等
1. 外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

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

資金の借入れ

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

「国内債インデックス」

投資する株式等の範囲

投資する株式は、国内の金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

信用取引の範囲

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

先物取引等

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

スワップ取引

1. 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。

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

金利先渡取引

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

有価証券の貸付けおよび範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。
 - ・株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとし、
 - ・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとし、
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとし、
3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとし、

有価証券の空売り

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

有価証券の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとし、
2. 前記1.は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとし、

4. 前記1. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

資金の借入れ

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

「外国債インデックス（ヘッジあり）/新興国債インデックス」

投資する株式等の範囲

投資する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

信用取引の範囲

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

先物取引等

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

スワップ取引

1. 異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。
2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が

信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。

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

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

6．スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引

1．金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

4．金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

有価証券の貸付けおよび範囲

1．信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。

．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

3．有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとします。

有価証券の空売り

1．信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

2．前記1．の売付けは、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

有価証券の借入れ

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

2．前記1．は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

3．信託財産の一部解約等の事由により、前記2．の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。

4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

外国為替予約等

1．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

2．前記1．の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。

3. 前記2.の限度額を超えることとなった場合には、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引を行うものとします。
4. 予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。
5. 外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

資金の借入れ

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

「外国債インデックス」

投資する株式等の範囲

投資する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

信用取引の範囲

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

先物取引等

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

スワップ取引

1. 異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます)を行うことができます。
2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3. スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該3.において同じ)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。
 4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
 5. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 6. スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。
- 金利先渡取引および為替先渡取引
1. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
 2. 金利先渡取引および為替先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 4. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。
- 有価証券の貸付けおよび範囲
1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けすることができます。
 - ・株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。
 3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとします。
- 有価証券の空売り
1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
 2. 前記1.の売付けは、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。
- 有価証券の借入れ
1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとします。
 2. 前記1.は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するものとします。
 4. 前記1.の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。
- 外国為替予約等
1. 外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

2. 前記1.の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。
 3. 前記2.の限度額を超えることとなった場合には、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引を行うものとします。
 4. 予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。
 5. 外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 資金の借入れ
1. 信託財産を効率的に運用するため、ならびに信託財産を安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て(一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます)を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 2. 一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
 3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 4. 借入金の利息は信託財産中より支払われます。

「国内リートインデックス」

公社債の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用するため、公社債の借入れを行うことができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行います。
2. 前記1.は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還します。
4. 前記1.の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

資金の借入れ

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

c 法令に定める投資制限

「国内株インデックス／先進国株インデックス／新興国株インデックス／国内債インデックス／外国債インデックス（ヘッジあり）／外国債インデックス／新興国債インデックス／先進国リートインデックス」

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するデリバティブ取引をいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます）を行い、または継続することを内容とした運用を行わないものとします。

信用リスク集中回避（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）

信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを内容とした運用を行わないものとします。

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社が指図を行うすべてのファンドで、同一法人の発行する株式の過半数の議決権を取得するような運用を行わないものとします。

「国内リートインデックス」

信用リスク集中回避（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）

信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを内容とした運用を行わないものとします。

3【投資リスク】

（１）投資リスクおよび留意事項

「国内株インデックス」

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に投資しますので、基準価額は変動します。また、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動することを目標に運用しますので、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

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。

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2022年12月12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2.0%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

- ・流動性に関する留意点

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

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

「先進国株インデックス」

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。また、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動することを目標に運用しますので、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

- ・株式投資リスク

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

- ・為替変動リスク

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

- ・カントリーリスク

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

- ・流動性リスク

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

- ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。

- ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

- ・短期金融資産の運用に関する留意点
 コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。
- ・ファミリーファンド方式に関する留意点
 ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。
- ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点
 委託会社は2022年12月12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1.7%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。
- ・流動性に関する留意点
 ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。
 これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付けを取消する可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

「新興国株インデックス」

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。また、MSCIEマーキング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動することを目標に運用しますので、MSCIEマーキング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

- ・株式投資リスク
 株式は国内および国際的な景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、また業績悪化（倒産に至る場合も含む）等により、価格が下落することがあります。
- ・為替変動リスク
 原則として対円での為替ヘッジを行わないため、外貨建資産については、為替変動の影響を直接的に受けます。一般に円高局面ではファンドの資産価値が減少します。
- ・カントリーリスク
 外国の資産に投資するため、各国の政治・経済情勢、外国為替規制、資本規制等による影響を受け、ファンドの資産価値が減少する可能性があります。特に、新興国の経済状況は先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があり、ファンドの資産価値が大きく減少したり、運用方針にそった運用が困難になる可能性があります。
- ・流動性リスク
 市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。
- ・新興国の株式投資に関する留意点
 金融商品取引所の取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます）、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情（投資対象国・地域における非常事態の発生による市場の閉鎖、流動性の著しい低下あるいは資金の受渡しに関する障害等）があるときには、ファンドの購

入・換金の申込みの受付を中止すること、および既に受付けた購入・換金の申込みの受け取りを取消すことがあります。

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはMSCIEマーキング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。

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

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2022年12月12日現在、ファンドを0.9百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の13.9%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

・流動性に関する留意点

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

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

「国内債インデックス」

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に投資しますので、基準価額は変動します。また、NOMURA - B P I 総合の動きに連動することを目標に運用しますので、NOMURA - B P I 総合の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

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。

・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。

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはNOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2022年12月12日現在、ファンドを0.9百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の3.5%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

- ・流動性に関する留意点

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

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

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。また、F T S E 世界国債インデックス（除く日本）（円ヘッジベース）の動きに連動することを目標に運用しますので、F T S E 世界国債インデックス（除く日本）（円ヘッジベース）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

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。

- ・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。

- ・為替変動リスク

外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替ヘッジを完全に行うことができないとは限らないため、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、円の金利が為替ヘッジを行う当該外貨の金利より低い場合などには、ヘッジコストが発生することがあります。

- ・カントリーリスク

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

- ・流動性リスク

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

- ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはF T S E 世界国債インデックス（除く日本）（円ヘッジベース）の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。

- ・収益分配金に関する留意点

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

収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日

と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

- ・短期金融資産の運用に関する留意点
 コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。
- ・ファミリーファンド方式に関する留意点
 ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。
- ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点
 委託会社は2022年12月12日現在、ファンドを0.8百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の9.2%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。
- ・流動性に関する留意点
 ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。
 これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付けを取消しする可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

「外国債インデックス」

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。また、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動することを目標に運用しますので、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

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。

- ・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。
- ・為替変動リスク
 原則として対円での為替ヘッジを行わないため、外貨建資産については、為替変動の影響を直接的に受けます。一般に円高局面ではファンドの資産価値が減少します。
- ・カントリーリスク
 外国の資産に投資するため、各国の政治・経済情勢、外国為替規制、資本規制等による影響を受け、ファンドの資産価値が減少する可能性があります。

- ・流動性リスク
市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。
- ・基準価額と指数の連動性に関する留意点
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めざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。
- ・収益分配金に関する留意点
収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
- ・短期金融資産の運用に関する留意点
コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。
- ・ファミリーファンド方式に関する留意点
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。
- ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点
委託会社は2022年12月12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4.6%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。
- ・流動性に関する留意点
ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。
これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付けを取消する可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

「新興国債インデックス」

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。また、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）（円換算ベース）の動きに連動することを目標に運用しますので、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）（円換算ベース）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

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。

・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。

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

・流動性リスク

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

・新興国の債券投資に関する留意点

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

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くB格以下）（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。

・収益分配金に関する留意点

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

収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日

と比べて下落することになります。また、収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2022年12月12日現在、ファンドを0.9百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の7.5%）保有しています。また、2022年11月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に76.9%保有しています。

当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

・流動性に関する留意点

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

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

「国内リートインデックス」

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に投資しますので、基準価額は変動します。また、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動することを目標に運用しますので、東証REIT指数（配当込み）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

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。

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

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

金利変動リスク

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

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

信用リスク

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

J - R E I Tの税制に関するリスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドは東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2022年12月12日現在、ファンドを0.9百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の36.1%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

・流動性に関する留意点

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

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

「先進国リートインデックス」

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。また、S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動することを目標に運用しますので、S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

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。

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

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

金利変動リスク

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

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

信用リスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・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せん。一般に円高局面ではファンドの資産価値が減少します。

・カントリーリスク

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

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドはS & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2022年12月12日現在、ファンドを0.9百万円(受益権口数1百万口、ファンド全体の20.2%)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2022年11月末現在、ファンドの主要投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に41.4%保有しています。

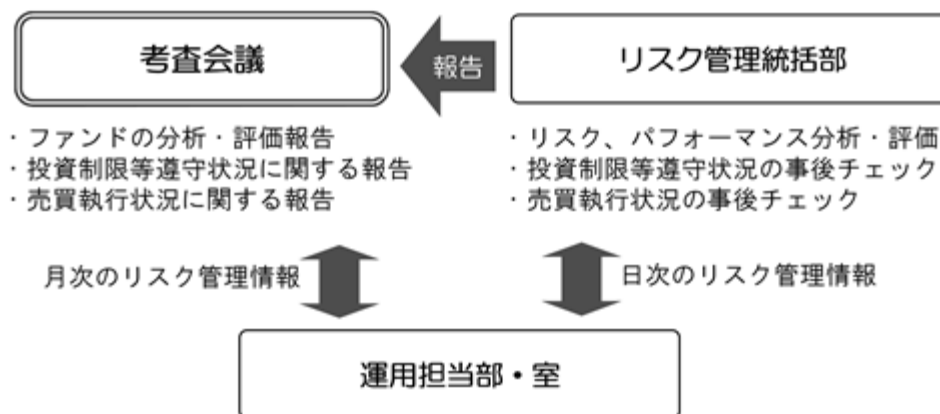
当該保有分は委託会社または日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

・流動性に関する留意点

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

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

(2) 投資リスク管理体制



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

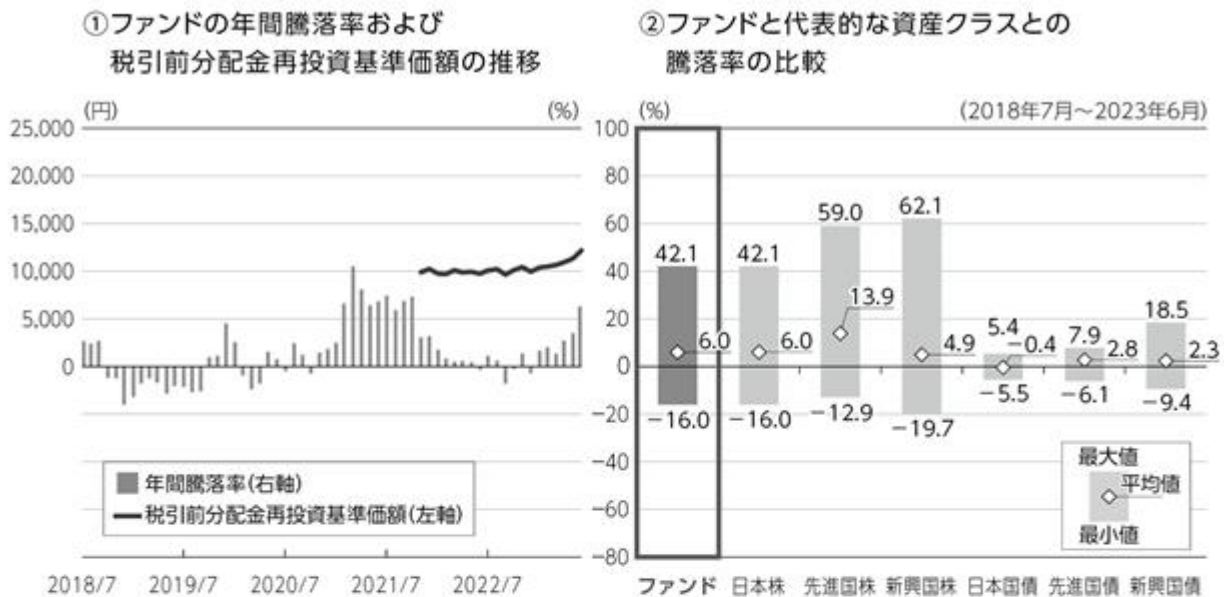
上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

< 流動性リスクに関する管理体制 >

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

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

●FWニッセイ国内株インデックス



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

- ・グラフにおけるファンドに関する記載は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額によるものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額の推移とは異なる場合があります。ファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率です。
- ・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間に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 … 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 … 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・ディバースファイド(円ベース)
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

- ・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、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。

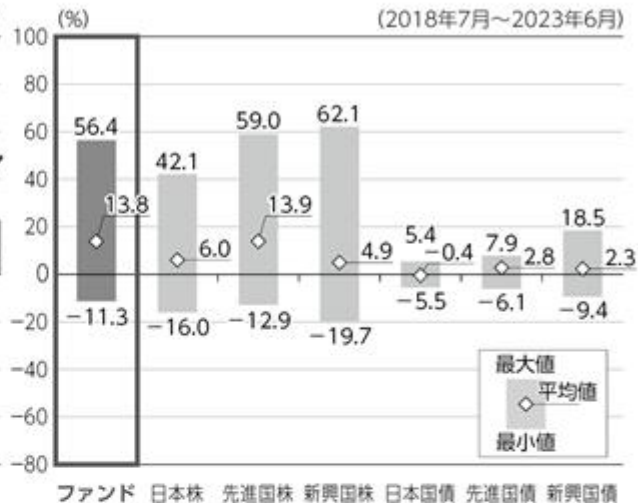
(参考情報) 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

●FWニッセイ先進国株インデックス

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



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

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

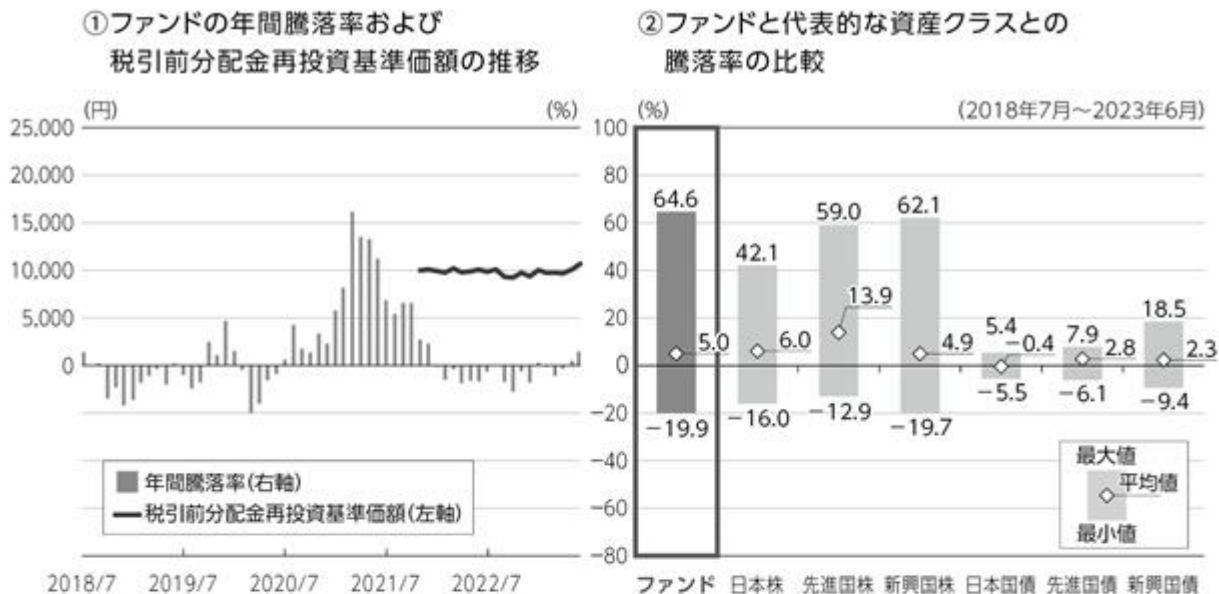
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

! 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)の指数値および同指数にかかる商標または高標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる商標または高標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイドは、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財産権は同社に帰属します。

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

●FWニッセイ新興国株インデックス



グラフは次に記載の基準で作成していますが、ファンドについては設定日以降の年間騰落率のデータが5年分に満たないため、不足するデータに関してはファンドのベンチマーク(MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース))を用いて算出しています。したがって、グラフにおけるファンドの騰落率は、すべてがファンドの実績ではありませんのでご注意ください。

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間に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)

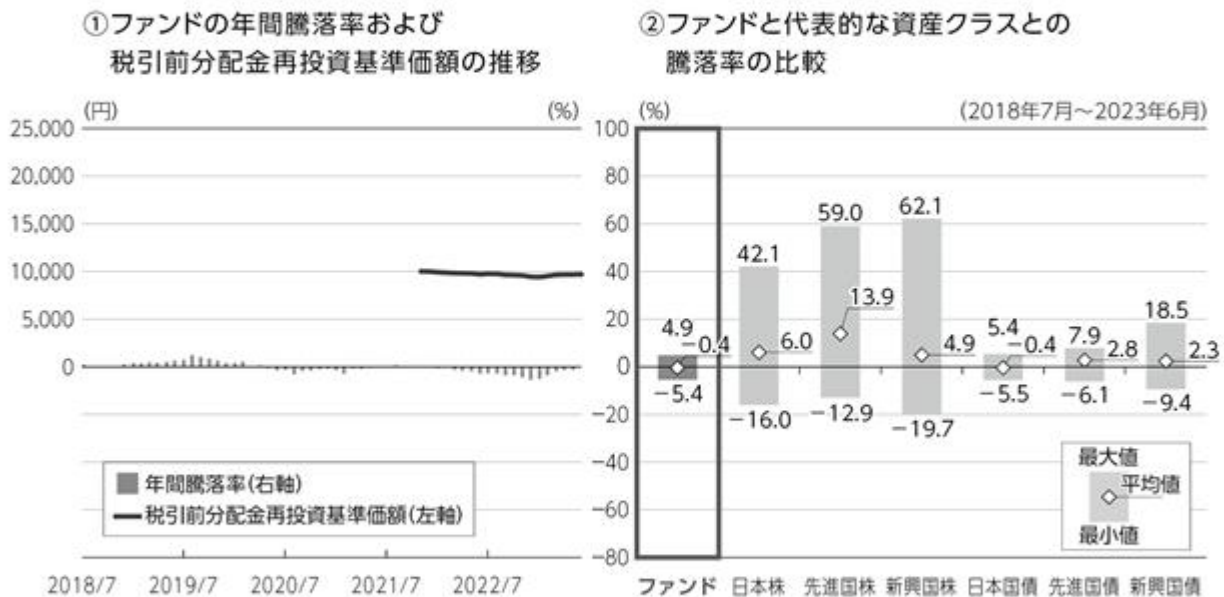
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

■ 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)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイドは、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。

(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。

●FWニッセイ国内債インデックス



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

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

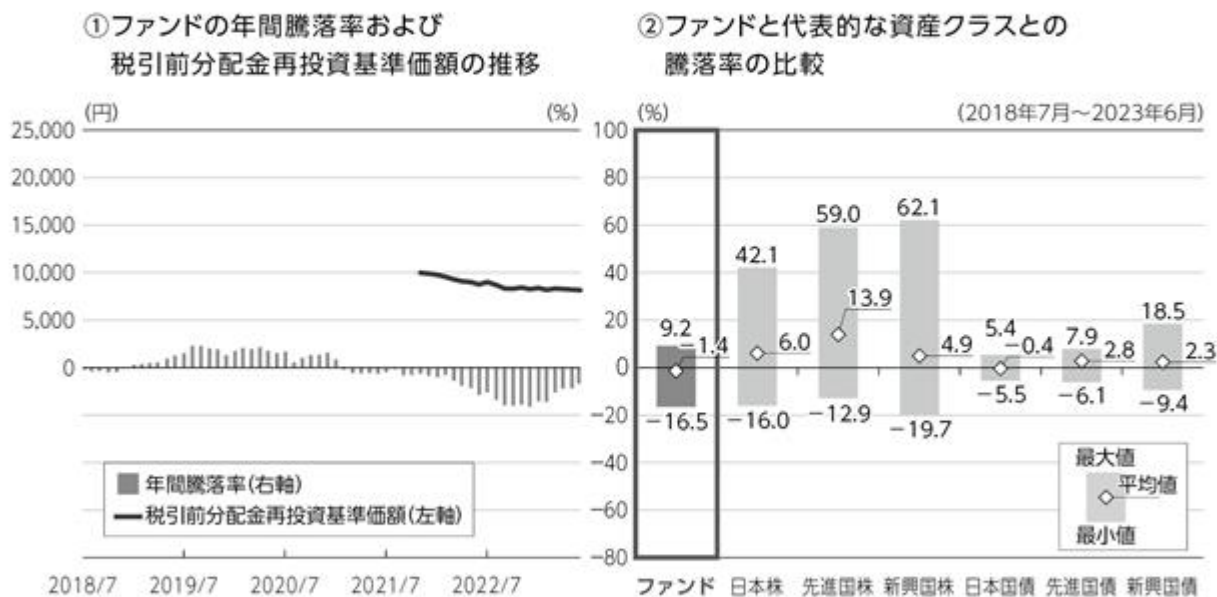
- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIEマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

- ・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、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。

(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。

●FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)



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

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間に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・ディバースファイド(円ベース)

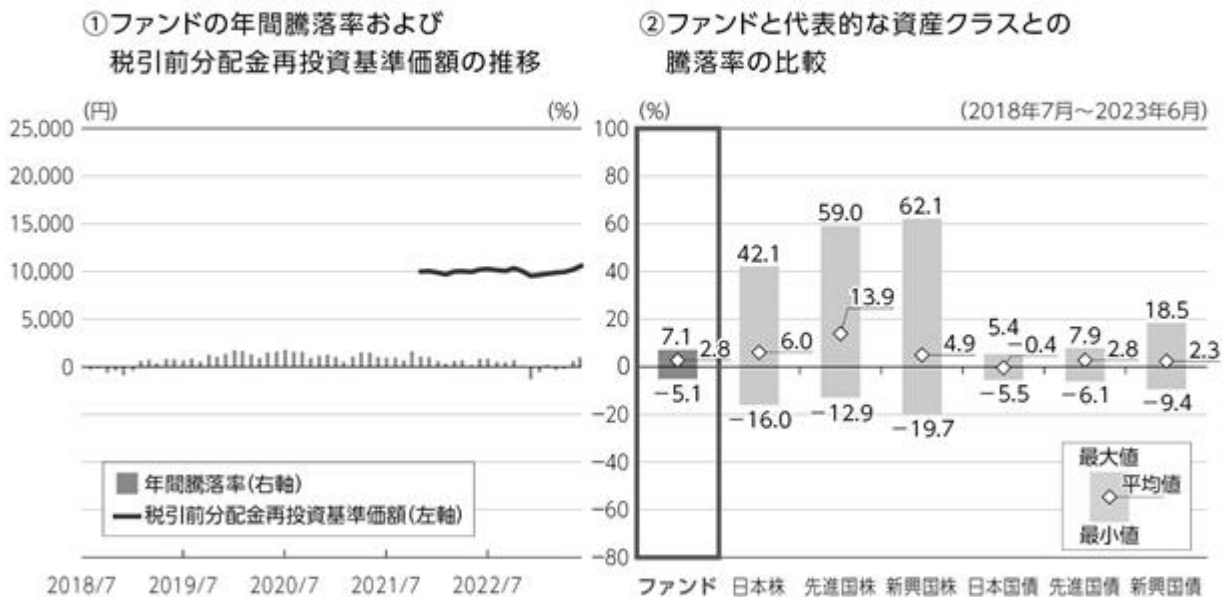
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

- ・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、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。

(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。

●FWニッセイ外国債インデックス



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

- ・グラフにおけるファンドに関する記載は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額によるものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額の推移とは異なる場合があります。ファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率です。
- ・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間に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 … 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 … 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・ディバースファイド(円ベース)
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

- ・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、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。

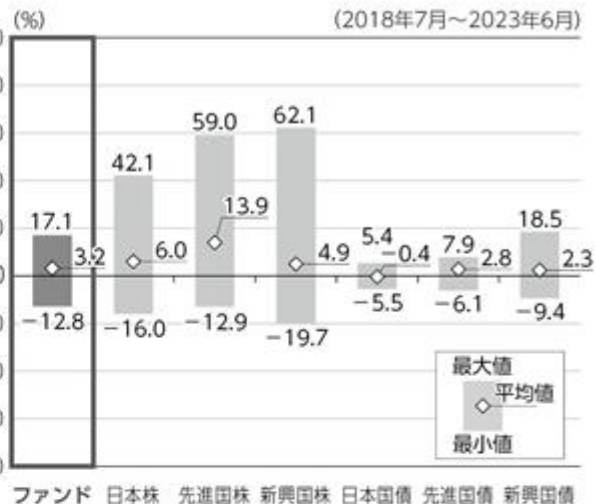
(参考情報) 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

●FWニッセイ新興国債インデックス

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



グラフは次に記載の基準で作成していますが、ファンドについては設定日以降の年間騰落率のデータが5年分に満たないため、不足するデータに関してはファンドのベンチマーク(JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(除くB格以下、円換算ベース))を用いて算出しています。したがって、グラフにおけるファンドの騰落率は、すべてがファンドの実績ではありませんのでご注意ください。

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間に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 … 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 … 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・ディバースファイド(円ベース)

- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

- ・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、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。

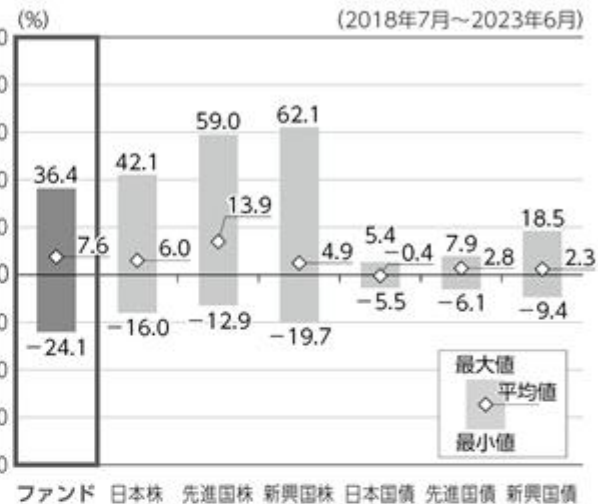
(参考情報) 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

●FWニッセイ国内リートインデックス

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数) (配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(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)の指数値および同指数にかかる商標または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる商標または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、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。

(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。

●FWニッセイ先進国リートインデックス

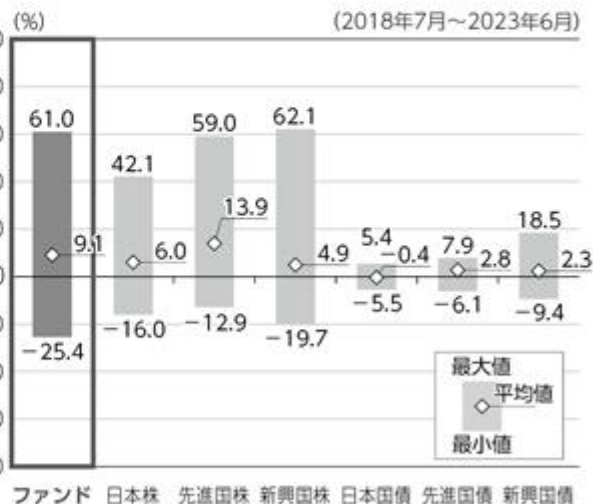
①ファンドの年間騰落率および

税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの

騰落率の比較



グラフは次に記載の基準で作成していますが、ファンドについては設定日以降の年間騰落率のデータが5年分に満たないため、不足するデータに関してはファンドのベンチマーク(S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース))を用いて算出しています。したがって、グラフにおけるファンドの騰落率は、すべてがファンドの実績ではありませんのでご注意ください。

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間に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・ディバースファイド(円ベース)

- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

- ・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- ・NOMURA-BPI 国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している指数で、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- ・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、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。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

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

[FWニッセイ国内株インデックス]

信託報酬率	配分(税抜)		
	委託会社	販売会社	受託会社
0.286% (税抜0.26%)	0.22%	0.02%	0.02%

[FWニッセイ先進国株インデックス]

信託報酬率	配分(税抜)		
	委託会社	販売会社	受託会社
0.319% (税抜0.29%)	0.25%	0.02%	0.02%

[FWニッセイ新興国株インデックス]

信託報酬率	配分(税抜)		
	委託会社	販売会社	受託会社
0.33% (税抜0.3%)	0.26%	0.02%	0.02%

[FWニッセイ国内債インデックス]

信託報酬率	配分(税抜)		
	委託会社	販売会社	受託会社
0.198% (税抜0.18%)	0.14%	0.02%	0.02%

[FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)]

信託報酬率	配分(税抜)		
	委託会社	販売会社	受託会社
0.242% (税抜0.22%)	0.18%	0.02%	0.02%

[FWニッセイ外国債インデックス]

信託報酬率	配分(税抜)		
	委託会社	販売会社	受託会社
0.286% (税抜0.26%)	0.22%	0.02%	0.02%

[FWニッセイ新興国債インデックス]

信託報酬率	配分(税抜)		
	委託会社	販売会社	受託会社
0.297% (税抜0.27%)	0.23%	0.02%	0.02%

[FWニッセイ国内リートインデックス]

信託報酬率	配分(税抜)		
	委託会社	販売会社	受託会社
0.286% (税抜0.26%)	0.22%	0.02%	0.02%

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

[FWニッセイ先進国リートインデックス]

信託報酬率	配分(税抜)		
	委託会社	販売会社	受託会社
0.319% (税抜0.29%)	0.25%	0.02%	0.02%

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

・上記すべての表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

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

(4) 【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

「国内株インデックス / 先進国株インデックス / 新興国株インデックス / 国内債インデックス / 外国債インデックス（ヘッジあり） / 外国債インデックス / 新興国債インデックス / 先進国リートインデックス」

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

「国内リートインデックス」

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および税金等は、信託財産中から支払います。

監査費用

「国内株インデックス / 国内債インデックス / 国内リートインデックス」

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

純資産総額	監査報酬率
100億円超 の部分	年 0.0022% (税抜0.002%)
50億円超 100億円以下 の部分	年 0.0033% (税抜0.003%)
10億円超 50億円以下 の部分	年 0.0055% (税抜0.005%)
10億円以下 の部分	年 0.0110% (税抜0.010%)

「先進国株インデックス / 新興国株インデックス / 外国債インデックス（ヘッジあり） / 外国債インデックス / 新興国債インデックス / 先進国リートインデックス」

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

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

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

「国内株インデックス / 先進国株インデックス / 新興国株インデックス / 国内債インデックス / 外国債インデックス / 新興国債インデックス / 国内リートインデックス / 先進国リートインデックス」

ありません。

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

購入時：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に0.03%をかけた額とします。

換金時：換金請求受付日の翌営業日の基準価額に0.03%をかけた額とします。

また、ファンドが「ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブマザーファンド」を購入ならびに換金する際には、信託財産留保額（当該マザーファンドの基準価額に0.03%をかけた額）をファンドからご負担いただきます。

上記の、およびの費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「4 手数料等及び税

金」に記載している費用と税金の合計額、その上限額、計算方法についても、運用状況および保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

<ご参考>

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税対象

- 分 配 時 : 分配時の「普通分配金」に対して課税されます。
「元本払戻金（特別分配金）」は非課税です。
- 解約請求・償還時 : 個人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額と取得価額の差益に対して課税されます。
法人の場合：解約請求時の解約価額または償還時の償還価額の個別元本超過額に対して課税されます。
- 買 取 請 求 時 : 買取請求時の買取価額と取得価額の差益に対して課税されます。
- 申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

- 分 配 時 : 分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収 され申告不要制度が適用されます。
なお、確定申告を行い、総合課税（「国内株インデックス」のみ配当控除の適用があります）または申告分離課税を選択することもできます。
外国税額控除の適用となった場合には、当該分配時の税額が異なる場合があります。
- 解約請求・償還・
買 取 請 求 時 : 解約請求、償還および買取請求時の差益は、上場株式等の譲渡所得として、以下の税率による申告分離課税の対象となり確定申告を行う必要があります。ただし、源泉徴収選択口座（特定口座）を選択した場合、申告不要制度が適用されます。

税率（個人）

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

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

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

< 少額投資非課税制度について >

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の対象です。

NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。

ただし、2024年1月1日の税法の改正により、以降は一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。対象は税法上の要件を満たしたファンドを購入した場合に限られ、それぞれのファンドは2024年1月1日以降、以下の取扱いとなります。

- ・「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ファンド
国内債インデックス、外国債インデックス（ヘッジあり）、外国債インデックス、新興国債インデックス、国内リートインデックス、先進国リートインデックス
 - ・「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）および成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ファンド
国内株インデックス、先進国株インデックス、新興国株インデックス
- 詳しくは、販売会社にお問合せください。

法人の課税の取扱い（分配時・解約請求・償還時）

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

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

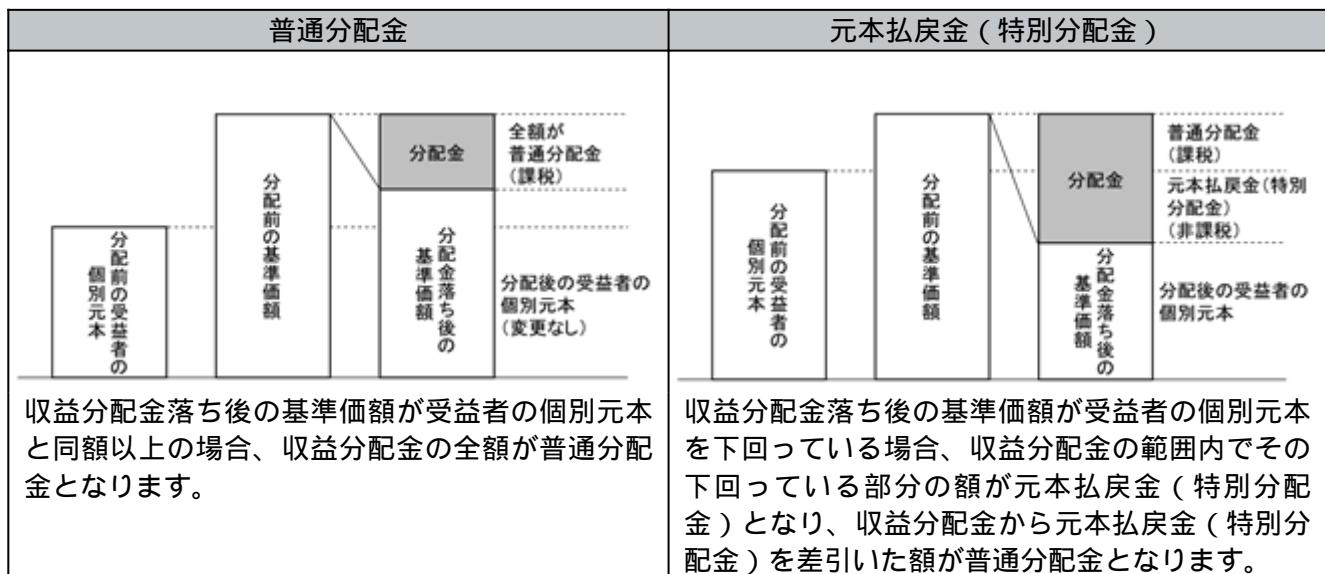
個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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



投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

F Wニッセイ国内株インデックス

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	113,995,049	100.00
内 日本	113,995,049	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	919	0.00
純資産総額	113,994,130	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ先進国株インデックス

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	148,780,788	100.00
内 日本	148,780,788	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,328	0.00
純資産総額	148,779,460	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ新興国株インデックス

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	10,413,379	100.00
内 日本	10,413,379	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	97	0.00
純資産総額	10,413,282	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ国内債インデックス

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	36,971,485	100.00
内 日本	36,971,485	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	211	0.00
純資産総額	36,971,274	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	23,630,891	100.00
内 日本	23,630,891	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	163	0.00
純資産総額	23,630,728	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ外国債インデックス

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	45,159,632	100.00
内 日本	45,159,632	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	362	0.00
純資産総額	45,159,270	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ新興国債インデックス

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	35,594,692	100.00
内 日本	35,594,692	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	295	0.00
純資産総額	35,594,397	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ国内リートインデックス

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	8,008,756	100.00
内 日本	8,008,756	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	64	0.00
純資産総額	8,008,692	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ先進国リートインデックス

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	10,987,746	100.00
内 日本	10,987,746	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	95	0.00
純資産総額	10,987,651	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	182,326,870,450	97.20
内 日本	182,326,870,450	97.20
新株予約権証券	3,038,500	0.00
内 日本	3,038,500	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,245,840,107	2.80
純資産総額	187,575,749,057	100.00

その他資産の投資状況

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	5,216,640,000	2.78
内 日本	5,216,640,000	2.78

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	696,854,907,186	94.27
内 アメリカ	500,358,536,057	67.69
内 イギリス	29,549,489,435	4.00
内 カナダ	24,702,256,335	3.34
内 フランス	23,604,918,002	3.19
内 スイス	23,145,386,284	3.13
内 ドイツ	17,563,378,160	2.38
内 オーストラリア	14,294,672,561	1.93
内 オランダ	13,189,878,277	1.78
内 アイルランド	9,857,745,368	1.33
内 スウェーデン	6,717,341,955	0.91
内 デンマーク	6,269,803,502	0.85
内 スペイン	5,440,949,990	0.74
内 香港	4,597,884,864	0.62
内 イタリア	4,338,302,204	0.59
内 シンガポール	2,280,790,630	0.31
内 ベルギー	1,843,575,704	0.25
内 フィンランド	1,829,251,787	0.25
内 ジャージー	1,317,081,133	0.18
内 ノルウェー	1,315,532,116	0.18
内 イスラエル	1,043,082,797	0.14
内 オランダ領キュラソー	930,153,668	0.13
内 パミュータ	692,328,927	0.09
内 ケイマン諸島	472,481,188	0.06
内 ポルトガル	441,590,654	0.06
内 ニュージーランド	422,499,087	0.06
内 オーストリア	367,915,282	0.05
内 ルクセンブルグ	268,081,219	0.04
投資証券	14,333,705,614	1.94
内 アメリカ	12,366,578,650	1.67
内 オーストラリア	847,996,242	0.11
内 シンガポール	287,028,551	0.04
内 イギリス	260,216,913	0.04
内 フランス	248,378,064	0.03
内 香港	190,229,471	0.03
内 カナダ	73,831,974	0.01
内 ベルギー	59,445,749	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	28,042,979,088	3.79
純資産総額	739,231,591,888	100.00

その他資産の投資状況

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	25,859,063,839	3.50
内 アメリカ	19,165,553,896	2.59
内 ドイツ	4,818,210,240	0.65
内 イギリス	1,875,299,703	0.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	6,260,660,299	83.07
内 台湾	1,058,138,041	14.04
内 インド	986,043,058	13.08
内 韓国	830,848,581	11.02
内 香港	792,303,179	10.51
内 中国	696,574,532	9.24
内 ケイマン諸島	380,247,748	5.05
内 ブラジル	372,497,532	4.94
内 南アフリカ	211,319,080	2.80
内 メキシコ	184,999,656	2.45
内 アメリカ	136,635,344	1.81
内 インドネシア	135,193,768	1.79
内 タイ	128,251,699	1.70
内 マレーシア	89,553,488	1.19
内 ポーランド	57,900,762	0.77
内 フィリピン	44,142,275	0.59
内 トルコ	36,302,803	0.48
内 ギリシャ	32,594,829	0.43
内 チリ	31,988,389	0.42
内 バミューダ	20,172,422	0.27
内 ハンガリー	14,753,366	0.20
内 チェコ	9,468,300	0.13
内 コロンビア	7,355,464	0.10
内 オランダ	2,819,509	0.04
内 ペルー	554,868	0.01
内 ロシア	1,549	0.00
内 イギリス	53	0.00
内 イギリス領バージン諸島	4	0.00
投資信託受益証券	517,409,997	6.87
内 アメリカ	517,409,997	6.87
投資証券	5,718,932	0.08
内 メキシコ	3,997,660	0.05
内 南アフリカ	1,721,272	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	752,373,384	9.98
純資産総額	7,536,162,612	100.00

その他資産の投資状況

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	739,455,524	9.81
内 アメリカ	739,455,524	9.81

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	51,563,963,180	77.25
内 日本	51,563,963,180	77.25
地方債証券	4,016,634,140	6.02
内 日本	4,016,634,140	6.02
特殊債券	5,496,369,047	8.23
内 日本	5,496,369,047	8.23
社債券	5,327,459,900	7.98
内 日本	5,034,340,800	7.54
内 フランス	293,119,100	0.44
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	345,177,851	0.52
純資産総額	66,749,604,118	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	106,811,701,768	104.04
内 アメリカ	52,394,930,444	51.04
内 フランス	8,854,379,891	8.62
内 イタリア	8,160,665,602	7.95
内 ドイツ	7,046,940,164	6.86
内 中国	5,811,393,732	5.66
内 スペイン	5,420,333,653	5.28
内 イギリス	5,125,980,758	4.99
内 カナダ	2,184,289,273	2.13
内 ベルギー	2,050,564,402	2.00
内 オランダ	1,702,094,919	1.66
内 オーストラリア	1,623,998,726	1.58
内 オーストリア	1,357,329,694	1.32
内 シンガポール	1,054,037,304	1.03
内 メキシコ	1,040,349,078	1.01
内 アイルランド	634,349,310	0.62
内 フィンランド	564,346,478	0.55
内 ポーランド	525,133,036	0.51
内 デンマーク	338,858,648	0.33
内 イスラエル	315,170,601	0.31
内 ニュージーランド	222,880,099	0.22
内 スウェーデン	213,325,459	0.21
内 ノルウェー	170,350,497	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,149,425,666	4.04
純資産総額	102,662,276,102	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	66,210,464,983	98.91
内 アメリカ	32,570,226,228	48.66
内 フランス	5,486,433,178	8.20
内 イタリア	5,055,076,443	7.55
内 ドイツ	4,371,492,941	6.53
内 中国	3,496,009,067	5.22
内 スペイン	3,360,598,055	5.02
内 イギリス	3,180,351,221	4.75
内 カナダ	1,357,425,550	2.03
内 ベルギー	1,273,607,269	1.90
内 オランダ	1,052,789,486	1.57
内 オーストラリア	1,003,961,762	1.50
内 オーストリア	842,082,129	1.26
内 メキシコ	655,518,165	0.98
内 アイルランド	397,423,458	0.59
内 フィンランド	349,635,655	0.52
内 マレーシア	345,689,529	0.52
内 ポーランド	325,695,775	0.49
内 シンガポール	296,868,007	0.44
内 デンマーク	210,322,745	0.31
内 イスラエル	199,888,013	0.30
内 ニュージーランド	141,725,827	0.21
内 スウェーデン	131,853,417	0.20
内 ノルウェー	105,791,063	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	728,307,513	1.09
純資産総額	66,938,772,496	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	2,182,455,454	93.01
内 メキシコ	224,060,002	9.55
内 アラブ首長国連邦	200,424,894	8.54
内 カタール	193,587,456	8.25
内 サウジアラビア	186,079,001	7.93
内 ブラジル	148,958,374	6.35
内 ドミニカ共和国	148,253,432	6.32
内 コロンビア	142,851,974	6.09
内 チリ	138,926,226	5.92
内 パナマ	113,403,637	4.83
内 中国	102,210,699	4.36
内 ハンガリー	98,357,155	4.19
内 オマーン	87,680,961	3.74
内 ベルギー	82,909,340	3.53
内 ポーランド	79,133,698	3.37
内 インドネシア	77,563,849	3.31
内 南アフリカ	69,973,623	2.98
内 フィリピン	41,246,465	1.76
内 ルーマニア	26,853,539	1.14
内 ウルグアイ	19,981,129	0.85
特殊債券	80,331,418	3.42
内 ケイマン諸島	80,331,418	3.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	83,703,936	3.57
純資産総額	2,346,490,808	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	30,719,507,500	98.45
内 日本	30,719,507,500	98.45
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	482,191,958	1.55
純資産総額	31,201,699,458	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		1,036,142	0.01
	内 アメリカ	1,036,142	0.01
投資証券		7,475,812,912	97.87
	内 アメリカ	5,865,894,813	76.79
	内 オーストラリア	490,395,367	6.42
	内 イギリス	334,341,138	4.38
	内 シンガポール	273,032,780	3.57
	内 フランス	128,882,156	1.69
	内 カナダ	118,425,152	1.55
	内 香港	103,946,875	1.36
	内 ベルギー	69,440,045	0.91
	内 スペイン	29,507,751	0.39
	内 ニュージーランド	29,147,330	0.38
	内 オランダ	13,402,647	0.18
	内 イスラエル	9,817,985	0.13
	内 ドイツ	4,191,015	0.05
	内 アイルランド	3,025,336	0.04
	内 ガーンジー	1,933,962	0.03
	内 イタリア	428,560	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		161,682,701	2.12
純資産総額		7,638,531,755	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

F Wニッセイ国内株インデックス

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	42,583,134	2.3152 98,589,859	2.6770 113,995,049	- -	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ先進国株インデックス

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	42,106,976	3.0339 127,749,494	3.5334 148,780,788	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ新興国株インデックス

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	8,243,651	1.1581 9,547,580	1.2632 10,413,379	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ国内債インデックス

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	38,665,013	0.9434 36,479,401	0.9562 36,971,485	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ為替ヘッジ外国債 券パッシブ マザーファン ド 日本	親投資 信託受 益証券	23,790,286	1.0135	0.9933	-	100.00
				24,111,702	23,630,891	-	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ外国債インデックス

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国債券インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	27,945,317	1.5208	1.6160	-	100.00
				42,500,816	45,159,632	-	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ新興国債インデックス

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ新興国債イン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	28,344,237	1.1686 33,124,599	1.2558 35,594,692	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ国内リートインデックス

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイJ-REITイン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,283,903	1.8533 7,939,742	1.8695 8,008,756	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

F Wニッセイ先進国リートインデックス

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ先進国リートイン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,400,651	1.3894 10,282,842	1.4847 10,987,746	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	3,058,700	1,902.21 5,818,311,025	2,308.50 7,061,008,950	- -	3.76
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	394,000	11,442.29 4,508,264,553	12,965.00 5,108,210,000	- -	2.72
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,700	58,272.60 3,245,784,321	67,850.00 3,779,245,000	- -	2.01
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	3,435,800	998.09 3,429,257,788	1,065.00 3,659,127,000	- -	1.95
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	17,895,000	158.88 2,843,296,011	170.50 3,051,097,500	- -	1.63
6	三菱商事 日本	株式 卸売業	364,500	4,674.91 1,704,006,720	6,930.00 2,525,985,000	- -	1.35
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	400,900	5,997.39 2,404,355,468	6,159.00 2,469,143,100	- -	1.32
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	273,600	7,050.88 1,929,120,844	8,896.00 2,433,945,600	- -	1.30
9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	117,900	15,163.30 1,787,753,257	20,560.00 2,424,024,000	- -	1.29
10	任天堂 日本	株式 その他製品	351,700	5,463.19 1,921,404,670	6,542.00 2,300,821,400	- -	1.23
11	三井物産 日本	株式 卸売業	418,300	3,907.76 1,634,618,464	5,411.00 2,263,421,300	- -	1.21
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	494,400	4,263.49 2,107,874,355	4,527.00 2,238,148,800	- -	1.19
13	第一三共 日本	株式 医薬品	486,700	4,278.94 2,082,564,199	4,550.00 2,214,485,000	- -	1.18
14	信越化学工業 日本	株式 化学	463,800	3,842.30 1,782,061,861	4,768.00 2,211,398,400	- -	1.18
15	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	363,200	4,109.01 1,492,393,458	5,687.00 2,065,518,400	- -	1.10
16	HOYA 日本	株式 精密機器	119,000	13,413.31 1,596,184,414	17,075.00 2,031,925,000	- -	1.08

17	ダイキン工業 日本	株式 機械	67,200	23,351.46 1,569,218,377	29,265.00 1,966,608,000	- -	1.05
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	452,800	3,460.11 1,566,739,125	4,341.00 1,965,604,800	- -	1.05
19	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	423,900	3,808.36 1,614,366,019	4,563.00 1,934,255,700	- -	1.03
20	KDDI 日本	株式 情報・通信業	431,700	4,039.29 1,743,763,869	4,450.00 1,921,065,000	- -	1.02
21	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	275,600	5,727.26 1,578,433,125	6,773.00 1,866,638,800	- -	1.00
22	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	542,300	2,865.49 1,553,960,461	3,315.00 1,797,724,500	- -	0.96
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	793,400	2,143.98 1,701,041,475	2,199.00 1,744,686,600	- -	0.93
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	303,000	4,296.18 1,301,744,336	5,601.00 1,697,103,000	- -	0.90
25	S M C 日本	株式 機械	18,200	66,940.00 1,218,308,000	79,480.00 1,446,536,000	- -	0.77
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	168,900	7,404.75 1,250,662,576	8,236.00 1,391,060,400	- -	0.74
27	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	897,500	1,532.45 1,375,375,510	1,540.00 1,382,150,000	- -	0.74
28	ファナック 日本	株式 電気機器	273,400	4,540.47 1,241,365,488	5,032.00 1,375,748,800	- -	0.73
29	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	203,100	6,133.23 1,245,660,399	6,205.00 1,260,235,500	- -	0.67
30	三菱電機 日本	株式 電気機器	581,500	1,549.74 901,175,628	2,027.00 1,178,700,500	- -	0.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	17.79
		情報・通信業	8.01
		輸送用機器	7.73
		卸売業	6.68
		銀行業	5.92
		化学	5.87
		機械	5.42
		医薬品	5.04
		サービス業	4.72
		小売業	4.21
		食料品	3.29
		陸運業	2.84
		精密機器	2.51
		その他製品	2.29
		保険業	2.23
		建設業	1.96
		不動産業	1.75
		電気・ガス業	1.24
		その他金融業	1.10
		鉄鋼	0.85
		ゴム製品	0.74
		証券、商品先物取引業	0.69
		ガラス・土石製品	0.66
		非鉄金属	0.64
		海運業	0.53
		金属製品	0.51
		空運業	0.50
		繊維製品	0.42
		石油・石炭製品	0.41
		鉱業	0.29
パルプ・紙	0.16		
倉庫・運輸関連業	0.13		
水産・農林業	0.08		
	小計		97.20
新株予約権証券	国内	建設業	0.00
	小計		0.00
合 計（対純資産総額比）			97.20

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハード ウェアおよび機器	1,474,698	25,397.30 37,453,360,007	27,488.65 40,537,463,223	- -	5.48
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	659,114	46,168.71 30,430,445,104	48,578.89 32,019,032,765	- -	4.33
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	860,496	16,865.77 14,512,931,842	18,544.22 15,957,227,993	- -	2.16
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	230,216	45,485.81 10,471,561,394	59,187.81 13,625,982,662	- -	1.84
5	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部 品	265,862	26,321.79 6,997,965,206	37,334.92 9,925,937,830	- -	1.34
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	555,005	17,799.66 9,878,901,551	17,268.30 9,583,997,836	- -	1.30
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	500,747	17,870.01 8,948,357,653	17,400.24 8,713,122,936	- -	1.18
8	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	206,426	35,615.34 7,351,932,917	40,819.03 8,426,110,056	- -	1.14
9	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ サービス	86,952	69,425.10 6,036,651,587	69,079.03 6,006,560,303	- -	0.81
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	121,005	47,896.91 5,795,766,045	48,848.58 5,910,922,531	- -	0.80
11	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネル ギー	378,346	15,406.63 5,829,039,633	15,470.43 5,853,176,443	- -	0.79

12	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	242,208	23,039.01 5,580,234,776	23,792.85 5,762,820,792	- -	0.78
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	273,217	20,177.81 5,512,923,440	20,795.91 5,681,797,699	- -	0.77
14	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サー ビス	151,460	33,817.09 5,121,937,566	33,974.05 5,145,710,642	- -	0.70
15	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	75,288	64,122.52 4,827,656,423	67,346.40 5,070,376,147	- -	0.69
16	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	38,861	99,059.04 3,849,533,654	125,064.02 4,860,113,048	- -	0.66
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用 品・パー ソナル用 品	219,908	22,202.73 4,882,558,386	21,658.60 4,762,900,772	- -	0.64
18	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 金融サー ビス	79,337	55,903.79 4,435,239,328	56,208.27 4,459,395,778	- -	0.60
19	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲 料・タバ コ	256,327	18,339.39 4,700,882,021	17,234.43 4,417,650,968	- -	0.60
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	94,392	42,175.09 3,980,991,282	44,630.82 4,212,792,531	- -	0.57
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	37,575	101,450.97 3,812,020,461	105,339.84 3,958,144,488	- -	0.54
22	MERCK & CO INC アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	236,529	16,736.60 3,958,692,093	16,462.16 3,893,779,330	- -	0.53

23	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	167,770	22,506.79 3,775,965,450	22,653.23 3,800,533,672	- -	0.51
24	NOVO-NORDISK A/S デンマーク	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	154,297	24,328.13 3,753,758,736	22,573.48 3,483,021,477	- -	0.47
25	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 耐久消費 財・アパ レル	25,738	137,757.03 3,545,590,693	134,748.00 3,468,144,024	- -	0.47
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 食品・飲 料・タバ コ	128,392	27,803.19 3,569,707,765	26,660.76 3,423,028,451	- -	0.46
27	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲 料・タバ コ	383,156	9,105.89 3,488,978,701	8,702.29 3,334,338,382	- -	0.45
28	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	41,337	72,007.40 2,976,570,133	77,089.73 3,186,658,297	- -	0.43
29	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	164,444	21,032.30 3,458,635,576	19,317.01 3,176,567,658	- -	0.43
30	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	138,192	21,734.70 3,003,561,681	22,369.05 3,091,224,752	- -	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	ソフトウェア・サービス	9.14
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.08
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.85
		資本財	6.48
		金融サービス	6.24
		半導体・半導体製造装置	5.79
		メディア・娯楽	5.54
		銀行	5.10
		エネルギー	4.65
		ヘルスケア機器・サービス	4.46
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.25
		素材	3.94
		食品・飲料・タバコ	3.84
		保険	2.94
		公益事業	2.79
		自動車・自動車部品	2.22
		消費者サービス	2.07
		運輸	1.80
		生活必需品流通・小売り	1.68
		家庭用品・パーソナル用品	1.66
		耐久消費財・アパレル	1.66
		商業・専門サービス	1.57
		電気通信サービス	1.19
不動産管理・開発	0.27		
エクイティ不動産投資信託(REIT)	0.04		
その他	0.03		
	小計		94.27
投資証券	外国		1.94
	小計		1.94
合計(対純資産総額比)			96.21

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	173,000	2,300.04 397,908,323	2,670.98 462,079,920	- -	6.13
2	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	49,612	5,815.54 288,520,782	5,963.43 295,858,120	- -	3.93
3	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディ ア・娯楽	43,800	5,193.59 227,479,663	6,171.60 270,316,080	- -	3.59
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 テクノ ロジー・ ハード ウェアお よび機器	33,467	6,858.92 229,547,718	7,964.00 266,531,188	- -	3.54
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	116,500	1,481.78 172,627,813	1,520.70 177,161,550	- -	2.35
6	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	45,708	2,239.76 102,375,132	2,138.60 97,751,243	- -	1.30
7	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネル ギー	21,528	4,588.29 98,776,912	4,502.50 96,930,035	- -	1.29
8	MEITUAN-B 香港	株式 消費者 サービス	35,960	2,847.48 102,395,693	2,306.95 82,957,922	- -	1.10
9	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	678,000	84.80 57,494,497	93.42 63,342,150	- -	0.84
10	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	24,403	2,979.02 72,697,246	2,579.37 62,944,417	- -	0.84
11	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	36,691	1,636.07 60,029,082	1,668.66 61,224,840	- -	0.81

12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE インド	株式 金融サー ビス	12,308	4,738.57 58,322,375	4,946.61 60,882,998	- -	0.81
13	ISHARES MSCI KUWAIT ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	13,035	5,130.39 66,874,697	4,668.67 60,856,217	- -	0.81
14	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフト ウェア・ サービス	23,559	2,800.41 65,974,997	2,302.16 54,236,658	- -	0.72
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	3,876	9,848.77 38,173,846	12,782.00 49,543,032	- -	0.66
16	VALE SA ブラジル	株式 素材	25,154	2,423.86 60,969,855	1,954.43 49,161,944	- -	0.65
17	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 テクノ ロジー・ ハード ウェアお よび機器	88,200	470.24 41,475,487	526.73 46,458,309	- -	0.62
18	JD.COM INC - CL A 香港	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	16,907	3,732.83 63,111,105	2,458.64 41,568,395	- -	0.55
19	BAIDU INC-CLASS A 香港	株式 メディア ア・娯楽	16,400	1,839.22 30,163,235	2,490.10 40,837,640	- -	0.54
20	NETEASE INC 香港	株式 メディア ア・娯楽	14,300	2,043.72 29,225,337	2,823.10 40,370,330	- -	0.54
21	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	43,500	809.61 35,218,341	924.07 40,197,262	- -	0.53
22	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 テクノ ロジー・ ハード ウェアお よび機器	5,950	6,265.62 37,280,447	6,655.00 39,597,250	- -	0.53
23	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 電気通信 サービス	234,400	163.10 38,232,439	159.20 37,317,867	- -	0.50

24	TATA CONSULTANCY SVCS LTD インド	株式 ソフト ウェア・ サービス	6,496	5,954.59 38,681,026	5,723.50 37,179,862	- -	0.49
25	NASPERS LTD-N SHS 南アフリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	1,432	20,198.24 28,923,889	25,593.96 36,650,553	- -	0.49
26	PDD HOLDINGS INC(ADR) アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	3,652	10,395.48 37,964,301	9,989.81 36,482,789	- -	0.48
27	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	409,400	85.62 35,054,821	88.75 36,336,297	- -	0.48
28	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	11,000	3,322.45 36,547,026	3,244.33 35,687,678	- -	0.47
29	BYD CO LTD 香港	株式 自動車・ 自動車部 品	7,000	3,667.18 25,670,283	4,584.30 32,090,100	- -	0.43
30	BANK OF CHINA LTD - H 中国	株式 銀行	545,000	49.67 27,071,438	57.90 31,558,225	- -	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	銀行	11.16
		半導体・半導体製造装置	8.96
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.16
		素材	6.41
		メディア・娯楽	5.96
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.82
		エネルギー	4.13
		資本財	3.47
		食品・飲料・タバコ	3.24
		自動車・自動車部品	3.24
		金融サービス	3.16
		保険	2.40
		消費者サービス	2.36
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.26
		電気通信サービス	2.14
		公益事業	2.11
		ソフトウェア・サービス	2.00
		運輸	1.65
		生活必需品流通・小売り	1.30
		耐久消費財・アパレル	1.20
		不動産管理・開発	1.16
ヘルスケア機器・サービス	0.87		
家庭用品・パーソナル用品	0.72		
その他	0.17		
商業・専門サービス	0.03		
	小計		83.07
投資信託受益証券	外国		6.87
	小計		6.87
投資証券	外国		0.08
	小計		0.08
合計(対純資産総額比)			90.02

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

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	第350回 利付国債(10年) 日本	国債証券	602,000,000	99.45 598,707,060	100.23 603,414,700	0.1 2028/3/20	0.90
2	第364回 利付国債(10年) 日本	国債証券	579,000,000	96.73 560,066,700	98.51 570,396,060	0.1 2031/9/20	0.85
3	第365回 利付国債(10年) 日本	国債証券	562,000,000	96.63 543,105,560	98.34 552,715,760	0.1 2031/12/20	0.83
4	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	540,000,000	100.11 540,621,180	100.52 542,808,000	0.1 2027/3/20	0.81
5	第368回 利付国債(10年) 日本	国債証券	535,000,000	101.61 543,613,500	98.70 528,066,400	0.2 2032/9/20	0.79
6	第349回 利付国債(10年) 日本	国債証券	519,000,000	99.60 516,943,640	100.35 520,847,640	0.1 2027/12/20	0.78
7	第360回 利付国債(10年) 日本	国債証券	522,000,000	97.59 509,445,900	99.25 518,100,660	0.1 2030/9/20	0.78
8	第338回 利付国債(10年) 日本	国債証券	506,000,000	100.89 510,548,940	100.84 510,250,400	0.4 2025/3/20	0.76
9	第361回 利付国債(10年) 日本	国債証券	514,000,000	97.37 500,482,460	99.08 509,281,480	0.1 2030/12/20	0.76
10	第359回 利付国債(10年) 日本	国債証券	508,000,000	97.91 497,403,120	99.44 505,200,920	0.1 2030/6/20	0.76
11	第363回 利付国債(10年) 日本	国債証券	499,000,000	96.89 483,526,010	98.67 492,383,260	0.1 2031/6/20	0.74
12	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	480,000,000	100.30 481,452,360	100.48 482,347,200	0.1 2026/3/20	0.72
13	第345回 利付国債(10年) 日本	国債証券	472,000,000	100.07 472,354,000	100.52 474,454,400	0.1 2026/12/20	0.71
14	第357回 利付国債(10年) 日本	国債証券	474,000,000	98.44 466,605,600	99.71 472,630,140	0.1 2029/12/20	0.71
15	第340回 利付国債(10年) 日本	国債証券	458,000,000	101.07 462,914,340	101.07 462,932,660	0.4 2025/9/20	0.69

16	第362回 利付国債（10年） 日本	国債証券	466,000,000	97.14 452,672,400	98.86 460,710,900	0.1 2031/3/20	0.69
17	第341回 利付国債（10年） 日本	国債証券	455,000,000	100.87 458,958,500	100.95 459,327,050	0.3 2025/12/20	0.69
18	第149回 利付国債（5年） 日本	国債証券	456,000,000	99.82 455,197,440	100.20 456,953,040	0.005 2026/9/20	0.68
19	第358回 利付国債（10年） 日本	国債証券	428,000,000	98.28 420,668,360	99.60 426,292,280	0.1 2030/3/20	0.64
20	第144回 利付国債（5年） 日本	国債証券	424,000,000	100.30 425,297,440	100.36 425,543,360	0.1 2025/6/20	0.64
21	第351回 利付国債（10年） 日本	国債証券	423,000,000	99.32 420,123,600	100.17 423,731,790	0.1 2028/6/20	0.63
22	第150回 利付国債（5年） 日本	国債証券	421,000,000	99.81 420,206,550	100.19 421,799,900	0.005 2026/12/20	0.63
23	第153回 利付国債（5年） 日本	国債証券	408,000,000	99.46 405,833,520	100.11 408,485,520	0.005 2027/6/20	0.61
24	第5回 電通グループ 日本	社債券	400,000,000	99.49 397,994,800	100.20 400,811,600	0.32 2027/7/8	0.60
25	第339回 利付国債（10年） 日本	国債証券	377,000,000	100.98 380,724,760	100.95 380,596,580	0.4 2025/6/20	0.57
26	第356回 利付国債（10年） 日本	国債証券	380,000,000	98.59 374,657,200	99.84 379,411,000	0.1 2029/9/20	0.57
27	第352回 利付国債（10年） 日本	国債証券	370,000,000	99.15 366,873,500	100.10 370,381,100	0.1 2028/9/20	0.55
28	第143回 利付国債（5年） 日本	国債証券	367,000,000	100.29 368,075,310	100.32 368,192,750	0.1 2025/3/20	0.55
29	第156回 利付国債（5年） 日本	国債証券	365,000,000	100.53 366,934,500	100.78 367,847,000	0.2 2027/12/20	0.55
30	第370回 利付国債（10年） 日本	国債証券	358,000,000	100.65 360,355,640	100.98 361,515,560	0.5 2033/3/20	0.54

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	国内	国債証券	77.25
		特殊債券	8.23
		社債券	7.54
		地方債証券	6.02
	小計		99.04
	外国	社債券	0.44
	小計		0.44
合計(対純資産総額比)			99.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	3,743,641,800	96.54 3,614,148,226	96.67 3,619,315,455	2.375 2024/8/15	3.53
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,840,354,100	95.69 2,718,139,536	95.97 2,726,171,865	2.25 2024/11/15	2.66
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,445,981,300	94.73 2,317,089,757	95.14 2,327,204,448	2 2025/2/15	2.27
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,160,351,000	95.13 2,055,277,821	94.92 2,050,713,186	2.125 2025/5/15	2.00
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,132,802,900	92.28 1,968,343,889	92.63 1,975,657,982	1.625 2026/2/15	1.92
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,041,459,200	93.84 1,915,760,471	94.29 1,925,096,025	2 2025/8/15	1.88
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,002,311,900	94.22 1,886,599,481	93.88 1,879,970,642	2.75 2028/2/15	1.83
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,931,266,800	94.04 1,816,327,195	94.45 1,824,139,430	2.25 2025/11/15	1.78
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,837,023,300	91.66 1,683,989,086	91.35 1,678,286,116	2.75 2032/8/15	1.63
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,803,675,600	91.50 1,650,451,909	92.03 1,659,940,691	2.25 2027/11/15	1.62
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,638,387,000	91.72 1,502,826,859	92.37 1,513,459,991	2.25 2027/8/15	1.47
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,532,544,300	90.62 1,388,899,430	91.34 1,399,871,939	1.5 2026/8/15	1.36
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,499,196,600	91.42 1,370,580,523	92.19 1,382,184,305	1.625 2026/5/15	1.35
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,409,302,800	92.32 1,301,181,089	92.93 1,309,707,371	2.25 2027/2/15	1.28
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,362,906,000	92.50 1,260,765,184	93.06 1,268,347,581	2.375 2027/5/15	1.24
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,371,605,400	91.73 1,258,228,497	92.42 1,267,761,155	2 2026/11/15	1.23
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,259,963,100	94.03 1,184,763,707	94.08 1,185,486,681	2.875 2028/8/15	1.15

18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,252,713,600	93.98 1,177,389,729	94.25 1,180,770,257	2.875 2028/5/15	1.15
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,220,815,800	94.60 1,154,952,787	95.13 1,161,435,319	3.125 2028/11/15	1.13
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,271,562,300	84.62 1,076,059,596	85.37 1,085,596,313	1.875 2032/2/15	1.06
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,136,721,600	92.02 1,046,108,794	92.51 1,051,683,457	2.625 2029/2/15	1.02
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,416,552,300	67.67 958,651,769	67.24 952,631,421	2 2051/8/15	0.93
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,139,621,400	81.24 925,851,217	82.02 934,751,660	1.125 2031/2/15	0.91
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,103,373,900	84.61 933,617,839	83.95 926,392,726	3 2052/8/15	0.90
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,109,173,500	80.96 898,075,599	81.82 907,614,491	1.25 2031/8/15	0.88
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,471,648,500	57.71 849,412,002	57.28 842,974,977	1.375 2050/8/15	0.82
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	920,686,500	90.42 832,526,691	91.02 838,073,300	2.375 2029/5/15	0.82
28	WI TREASURY SEC. アメリカ	国債証券	1,000,431,000	80.49 805,320,856	79.92 799,634,493	0.625 2030/5/15	0.78
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	956,934,000	83.98 803,709,727	83.42 798,283,912	3 2048/8/15	0.78
30	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	909,352,000	85.82 780,490,895	87.41 794,946,424	0.5 2029/5/25	0.77

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	外国	国債証券	104.04
	小計		104.04
合計(対純資産総額比)			104.04

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,531,094,400	97.07 1,486,378,835	96.67 1,480,246,754	2.375 2024/8/15	2.21
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,172,969,100	96.64 1,133,604,257	95.97 1,125,815,742	2.25 2024/11/15	1.68
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,151,220,600	95.94 1,104,593,597	95.14 1,095,317,327	2 2025/2/15	1.64
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,007,680,500	95.62 963,554,170	94.45 951,784,462	2.25 2025/11/15	1.42
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,025,079,300	93.79 961,442,377	92.63 949,551,457	1.625 2026/2/15	1.42
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	865,590,300	93.58 810,053,808	92.03 796,611,408	2.25 2027/11/15	1.19
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	832,242,600	95.51 794,918,302	93.88 781,392,577	2.75 2028/2/15	1.17
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	787,295,700	95.28 750,136,737	94.29 742,419,845	2 2025/8/15	1.11
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	769,896,900	95.87 738,127,082	94.92 730,824,632	2.125 2025/5/15	1.09
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	765,547,200	93.89 718,802,887	92.37 707,174,226	2.25 2027/8/15	1.06
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	658,254,600	94.06 619,167,441	92.51 609,010,573	2.625 2029/2/15	0.91
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	636,506,100	93.31 593,965,253	92.19 586,826,798	1.625 2026/5/15	0.88
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	622,007,100	94.55 588,149,594	93.06 578,852,247	2.375 2027/5/15	0.86
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	603,158,400	95.65 576,934,589	94.08 567,505,706	2.875 2028/8/15	0.85
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	594,459,000	93.79 557,578,763	92.42 549,452,509	2 2026/11/15	0.82
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	574,160,400	94.50 542,621,769	94.17 540,715,556	0.375 2024/9/15	0.81
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	553,861,800	92.57 512,732,022	91.02 504,163,780	2.375 2029/5/15	0.75
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	548,062,200	92.60 507,545,048	91.34 500,616,455	1.5 2026/8/15	0.75
19	WI TREASURY SEC. アメリカ	国債証 券	620,557,200	81.22 504,052,210	79.92 496,005,164	0.625 2030/5/15	0.74
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	513,264,600	94.38 484,449,925	92.93 476,992,190	2.25 2027/2/15	0.71
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	491,516,100	95.73 470,546,631	94.25 463,288,330	2.875 2028/5/15	0.69
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	481,366,800	96.47 464,422,688	95.70 460,716,164	2.25 2024/12/31	0.69
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	536,463,000	86.87 466,056,311	85.49 458,632,947	1.5 2030/2/15	0.69

24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	526,313,700	88.43 465,457,989	87.04 458,135,023	1.625 2029/8/15	0.68
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	452,368,800	96.95 438,591,212	95.89 433,812,631	2.75 2025/6/30	0.65
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	471,217,500	88.94 419,141,708	87.54 412,513,223	1.75 2029/11/15	0.62
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	374,074,200	95.34 356,653,564	94.06 351,861,674	2.25 2026/3/31	0.53
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	355,225,500	96.94 344,373,360	95.94 340,835,314	2.625 2025/3/31	0.51
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	313,178,400	103.27 323,448,824	101.85 319,000,386	4.125 2032/11/15	0.48
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	313,178,400	98.35 308,018,552	97.07 304,027,327	3.5 2033/2/15	0.45

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	外国	国債証券	98.91
	小計		98.91
合 計（対純資産総額比）			98.91

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	STATE OF QATAR カタール	国債証 券	57,996,000	94.48 54,798,390	96.36 55,889,005	4.817 2049/3/14	2.38
2	STATE OF QATAR カタール	国債証 券	57,996,000	90.43 52,448,392	91.43 53,027,482	4.4 2050/4/16	2.26
3	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証 券	57,996,000	72.00 41,757,989	73.24 42,476,850	4.75 2050/1/14	1.81
4	DOMINICAN REPUBLIC ドミニカ共和国	国債証 券	43,497,000	83.34 36,252,574	84.63 36,813,250	4.875 2032/9/23	1.57
5	REPUBLIC OF PERU ペルー	国債証 券	40,597,200	83.32 33,827,935	85.13 34,563,644	2.783 2031/1/23	1.47
6	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証 券	28,998,000	106.94 31,011,331	105.20 30,506,765	5.5 2032/10/25	1.30
7	REPUBLIC OF PANAMA パナマ	国債証 券	28,998,000	105.70 30,650,886	103.67 30,065,126	6.4 2035/2/14	1.28
8	KSA SUKUK LTD ケイマン諸島	特殊債 券	28,998,000	102.80 29,809,944	102.37 29,687,862	5.268 2028/10/25	1.27
9	HUNGARY ハンガリー	国債証 券	28,998,000	104.42 30,281,161	101.77 29,511,554	6.125 2028/5/22	1.26
10	OMAN GOV INTERNTL BOND オマーン	国債証 券	28,998,000	101.72 29,499,665	101.75 29,506,044	6.25 2031/1/25	1.26
11	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証 券	28,998,000	99.70 28,911,006	101.20 29,348,875	8 2033/4/20	1.25
12	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証 券	28,998,000	100.40 29,113,992	101.10 29,316,978	6.338 2053/5/4	1.25
13	OMAN GOV INTERNTL BOND オマーン	国債証 券	28,998,000	99.36 28,815,022	100.44 29,126,171	6 2029/8/1	1.24
14	OMAN SOVEREIGN SUKUK オマーン	国債証 券	28,998,000	100.50 29,142,990	100.17 29,048,746	4.875 2030/6/15	1.24
15	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証 券	28,998,000	103.09 29,894,618	100.08 29,021,778	4.875 2033/7/18	1.24
16	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN インドネシア	国債証 券	28,998,000	99.62 28,889,257	99.64 28,895,637	4.7 2032/6/6	1.23
17	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証 券	28,998,000	101.75 29,505,465	99.40 28,824,591	4.75 2028/1/18	1.23
18	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証 券	28,998,000	97.78 28,357,144	98.38 28,531,132	6 2033/10/20	1.22
19	STATE OF QATAR カタール	国債証 券	28,998,000	97.26 28,204,904	98.05 28,432,539	4 2029/3/14	1.21
20	HUNGARY ハンガリー	国債証 券	28,998,000	100.10 29,029,897	97.62 28,309,587	5.25 2029/6/16	1.21
21	STATE OF QATAR カタール	国債証 券	28,998,000	97.77 28,354,244	97.31 28,218,533	3.4 2025/4/16	1.20
22	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証 券	28,998,000	94.92 27,526,351	97.17 28,177,646	7.5 2034/2/2	1.20
23	STATE OF QATAR カタール	国債証 券	28,998,000	95.42 27,670,471	96.62 28,019,897	3.75 2030/4/16	1.19

24	ABU DHABI GOVT INT'L アラブ首長国連邦	国債証券	28,998,000	95.91 27,814,591	95.64 27,734,267	2.5 2025/4/16	1.18
25	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	28,998,000	94.34 27,357,293	94.99 27,547,520	4.75 2032/4/27	1.17
26	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	28,998,000	93.10 26,997,138	94.95 27,536,500	4.875 2033/5/19	1.17
27	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	28,998,000	91.02 26,396,879	94.36 27,365,122	4.5 2029/5/30	1.17
28	REPUBLIC OF INDONESIA インドネシア	国債証券	28,998,000	97.00 28,128,060	93.85 27,216,072	3.85 2030/10/15	1.16
29	ABU DHABI GOVT INT'L アラブ首長国連邦	国債証券	28,998,000	92.15 26,723,686	93.00 26,968,140	3.125 2030/4/16	1.15
30	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証券	28,998,000	96.32 27,933,193	92.96 26,959,440	5 2053/1/18	1.15

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
公社債券	外国	国債証券	93.01
		特殊債券	3.42
	小計		96.43
合計(対純資産総額比)			96.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,408	546,948.44 1,864,000,290	566,000.00 1,928,928,000	- -	6.18
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	2,995	528,990.29 1,584,325,948	548,000.00 1,641,260,000	- -	5.26
3	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	9,446	158,956.42 1,501,502,389	166,100.00 1,568,980,600	- -	5.03
4	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	5,079	312,558.80 1,587,486,165	289,300.00 1,469,354,700	- -	4.71
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	14,738	98,289.30 1,448,587,826	96,300.00 1,419,269,400	- -	4.55
6	GLP投資法人 日本	投資証券	9,848	152,392.51 1,500,761,497	142,100.00 1,399,400,800	- -	4.49
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,403	288,468.43 1,270,126,538	276,200.00 1,216,108,600	- -	3.90
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,820	174,038.69 1,012,905,225	177,400.00 1,032,468,000	- -	3.31
9	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	2,921	351,443.19 1,026,565,565	344,000.00 1,004,824,000	- -	3.22
10	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	6,534	149,074.97 974,055,891	145,400.00 950,043,600	- -	3.04
11	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	8,778	77,931.22 684,080,310	83,900.00 736,474,200	- -	2.36
12	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	12,857	56,708.94 729,106,926	57,200.00 735,420,400	- -	2.36
13	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	1,998	345,973.62 691,255,300	348,500.00 696,303,000	- -	2.23
14	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証券	9,420	77,703.98 731,971,530	73,500.00 692,370,000	- -	2.22
15	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,457	154,592.63 689,019,366	151,600.00 675,681,200	- -	2.17
16	日本アコモデーションファ ンド投資法人 日本	投資証券	1,009	649,952.47 655,802,045	649,000.00 654,841,000	- -	2.10
17	アクティブピア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証券	1,542	396,597.35 611,553,119	402,500.00 620,655,000	- -	1.99
18	日本ロジスティクスファン ド投資法人 日本	投資証券	1,970	319,445.97 629,308,574	312,500.00 615,625,000	- -	1.97

19	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,700	301,497.04 512,544,974	346,500.00 589,050,000	- -	1.89
20	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	1,154	509,856.78 588,374,729	500,000.00 577,000,000	- -	1.85
21	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,576	162,085.25 579,616,867	151,100.00 540,333,600	- -	1.73
22	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,353	155,707.13 522,086,012	155,400.00 521,056,200	- -	1.67
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,084	484,486.63 525,183,509	468,000.00 507,312,000	- -	1.63
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,435	150,569.71 517,206,985	147,400.00 506,319,000	- -	1.62
25	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	2,142	210,977.75 451,914,354	234,300.00 501,870,600	- -	1.61
26	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,397	340,392.52 475,528,362	345,000.00 481,965,000	- -	1.54
27	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	4,048	113,494.63 459,426,275	114,400.00 463,091,200	- -	1.48
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,733	153,353.78 419,115,885	161,000.00 440,013,000	- -	1.41
29	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	1,004	420,523.69 422,205,792	413,000.00 414,652,000	- -	1.33
30	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	5,437	70,492.00 383,265,022	72,000.00 391,464,000	- -	1.25

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
投資証券	国内		98.45
	小計		98.45
合計(対純資産総額比)			98.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	37,725	16,875.92 636,644,401	17,616.28 664,574,351	- -	8.70
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	3,820	96,270.47 367,753,223	112,661.57 430,367,234	- -	5.63
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	6,463	42,524.16 274,833,666	41,842.66 270,429,138	- -	3.54
4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	27,498	9,281.43 255,220,893	8,731.29 240,093,226	- -	3.14
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	20,302	10,082.61 204,697,341	11,655.74 236,634,957	- -	3.10
6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	13,363	16,933.92 226,288,075	16,639.05 222,347,657	- -	2.91
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	11,901	15,705.34 186,909,336	16,221.48 193,051,847	- -	2.53
8	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	41,074	4,685.29 192,443,652	4,549.78 186,877,918	- -	2.45
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	5,908	24,721.12 146,052,392	27,263.91 161,075,236	- -	2.11
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	69,988	1,779.81 124,565,568	1,926.89 134,859,345	- -	1.77
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	13,886	9,092.00 126,251,648	9,485.24 131,712,123	- -	1.72
12	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	5,519	22,720.75 125,395,867	21,454.17 118,405,565	- -	1.55
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	23,705	4,576.29 108,481,019	4,948.50 117,304,398	- -	1.54
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	16,304	6,456.01 105,258,844	6,904.42 112,569,725	- -	1.47
15	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	4,865	22,840.59 111,119,471	22,048.62 107,266,581	- -	1.40
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	6,419	20,950.51 134,481,330	16,437.51 105,512,417	- -	1.38
17	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	11,943	7,633.52 91,167,216	8,142.63 97,247,530	- -	1.27
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	5,071	20,560.05 104,260,050	18,641.36 94,530,358	- -	1.24
19	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	9,038	11,390.63 102,948,580	9,794.07 88,518,845	- -	1.16
20	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	2,611	30,936.34 80,774,784	33,792.81 88,233,051	- -	1.16
21	LINK REIT 香港	投資証券	104,400	980.90 102,406,644	807.52 84,305,610	- -	1.10
22	UDR INC アメリカ	投資証券	13,025	5,853.87 76,246,666	6,217.17 80,978,654	- -	1.06

23	GAMING AND LEISURE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	10,791	7,290.54 78,672,258	7,040.71 75,976,349	- -	0.99
24	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証 券	26,164	3,129.38 81,877,237	2,856.30 74,732,311	- -	0.98
25	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証 券	29,097	2,608.32 75,894,289	2,419.88 70,411,338	- -	0.92
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	7,126	9,501.36 67,706,761	9,624.43 68,583,732	- -	0.90
27	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証 券	4,345	16,503.99 71,709,847	15,747.36 68,422,296	- -	0.90
28	SEGRO PLC イギリス	投資証 券	51,603	1,509.47 77,893,265	1,300.77 67,123,866	- -	0.88
29	LIFE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	3,479	16,140.96 56,154,412	19,177.82 66,719,661	- -	0.87
30	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	22,998	3,501.82 80,534,959	2,896.90 66,622,910	- -	0.87

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エクイティ不動産投資信託(REIT)	0.01
	小計		0.01
投資証券	外国		97.87
	小計		97.87
合計(対純資産総額比)			97.88

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

F Wニッセイ国内株インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ先進国株インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ新興国株インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ国内債インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

F Wニッセイ外国債インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ新興国債インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ国内リートインデックス
該当事項はありません。

F Wニッセイ先進国リートインデックス
該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイJ - R E I Tインデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

F Wニッセイ国内株インデックス
該当事項はありません。

F Wニッセイ先進国株インデックス
該当事項はありません。

F Wニッセイ新興国株インデックス
該当事項はありません。

F Wニッセイ国内債インデックス
該当事項はありません。

F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）
該当事項はありません。

F Wニッセイ外国債インデックス
該当事項はありません。

F Wニッセイ新興国債インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ国内リートインデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ先進国リートインデックス

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物 0 509月	買建	228	5,110,830,400	5,216,640,000	2.78

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P 500 EMINI FUTURE 202309	買建	596	18,978,865,134	19,165,553,896	2.59
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 202309	買建	698	4,811,870,937	4,818,210,240	0.65
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE 202309	買建	137	1,905,716,238	1,875,299,703	0.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	NYSE LIFE EUS	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202309	買建	103	756,625,747	739,455,524	9.81

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

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

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

F Wニッセイ国内株インデックス

直近日(2023年6月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2022年12月12日)	52,583,023	52,583,023	1.0277	1.0277
2022年6月末日	5,401,023	-	0.9730	-
7月末日	6,554,384	-	1.0089	-
8月末日	7,294,158	-	1.0209	-
9月末日	9,923,319	-	0.9645	-
10月末日	23,834,314	-	1.0132	-
11月末日	47,142,211	-	1.0427	-
12月末日	68,737,373	-	0.9949	-
2023年1月末日	84,193,944	-	1.0386	-
2月末日	90,218,314	-	1.0482	-
3月末日	96,442,629	-	1.0655	-
4月末日	97,147,902	-	1.0939	-
5月末日	104,998,280	-	1.1331	-
6月末日	113,994,130	-	1.2183	-

F Wニッセイ先進国株インデックス

直近日(2023年6月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2022年12月12日)	62,822,639	62,822,639	1.0404	1.0404
2022年6月末日	6,184,019	-	0.9993	-
7月末日	7,211,890	-	1.0383	-
8月末日	7,901,661	-	1.0450	-
9月末日	11,243,597	-	0.9935	-
10月末日	28,218,733	-	1.0883	-
11月末日	56,228,126	-	1.0562	-
12月末日	88,400,027	-	0.9914	-
2023年1月末日	105,684,391	-	1.0286	-
2月末日	117,800,695	-	1.0646	-
3月末日	124,216,068	-	1.0591	-
4月末日	125,399,657	-	1.0878	-
5月末日	135,400,966	-	1.1381	-
6月末日	148,779,460	-	1.2273	-

F Wニッセイ新興国株インデックス

直近日（2023年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2022年12月12日）	7,064,013	7,064,013	0.9851	0.9851
2022年6月末日	1,732,079	-	1.0092	-
7月末日	1,888,247	-	0.9855	-
8月末日	2,057,803	-	1.0082	-
9月末日	2,335,504	-	0.9316	-
10月末日	3,887,760	-	0.9243	-
11月末日	6,407,023	-	0.9751	-
12月末日	7,236,854	-	0.9378	-
2023年1月末日	8,887,261	-	1.0036	-
2月末日	8,939,210	-	0.9736	-
3月末日	9,429,215	-	0.9762	-
4月末日	9,042,256	-	0.9674	-
5月末日	9,720,325	-	1.0084	-
6月末日	10,413,282	-	1.0688	-

F Wニッセイ国内債インデックス

直近日（2023年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2022年12月12日）	27,363,939	27,363,939	0.9601	0.9601
2022年6月末日	2,215,372	-	0.9704	-
7月末日	2,211,226	-	0.9766	-
8月末日	2,468,661	-	0.9743	-
9月末日	4,656,934	-	0.9638	-
10月末日	10,113,924	-	0.9625	-
11月末日	22,604,617	-	0.9576	-
12月末日	21,185,904	-	0.9449	-
2023年1月末日	24,207,669	-	0.9420	-
2月末日	27,667,030	-	0.9523	-
3月末日	30,026,161	-	0.9657	-
4月末日	30,401,740	-	0.9681	-
5月末日	34,849,561	-	0.9671	-
6月末日	36,971,274	-	0.9694	-

F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

直近日（2023年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2022年12月12日）	9,243,339	9,243,339	0.8478	0.8478
2022年6月末日	1,058,381	-	0.8749	-
7月末日	1,055,866	-	0.9005	-
8月末日	1,045,003	-	0.8690	-
9月末日	3,028,775	-	0.8323	-
10月末日	3,699,510	-	0.8303	-
11月末日	5,578,911	-	0.8425	-
12月末日	13,420,400	-	0.8258	-
2023年1月末日	16,122,338	-	0.8381	-
2月末日	17,560,664	-	0.8179	-
3月末日	19,085,255	-	0.8323	-
4月末日	19,059,295	-	0.8285	-
5月末日	20,224,771	-	0.8210	-
6月末日	23,630,728	-	0.8157	-

F Wニッセイ外国債インデックス

直近日（2023年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2022年12月12日）	21,934,050	21,934,050	1.0030	1.0030
2022年6月末日	2,202,994	-	1.0197	-
7月末日	2,302,118	-	1.0265	-
8月末日	2,478,803	-	1.0138	-
9月末日	3,668,761	-	1.0046	-
10月末日	7,607,805	-	1.0339	-
11月末日	18,171,323	-	1.0028	-
12月末日	24,737,320	-	0.9532	-
2023年1月末日	29,929,520	-	0.9643	-
2月末日	33,294,804	-	0.9757	-
3月末日	35,656,359	-	0.9877	-
4月末日	35,861,583	-	0.9946	-
5月末日	38,620,288	-	1.0196	-
6月末日	45,159,270	-	1.0603	-

F Wニッセイ新興国債インデックス

直近日（2023年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2022年12月12日)	12,573,266	12,573,266	0.9479	0.9479
2022年6月末日	1,582,713	-	0.9163	-
7月末日	1,690,501	-	0.9423	-
8月末日	1,824,620	-	0.9558	-
9月末日	2,226,876	-	0.9207	-
10月末日	4,471,857	-	0.9448	-
11月末日	10,675,121	-	0.9415	-
12月末日	19,297,741	-	0.8991	-
2023年1月末日	23,450,588	-	0.9097	-
2月末日	26,059,543	-	0.9270	-
3月末日	27,843,155	-	0.9274	-
4月末日	28,216,830	-	0.9426	-
5月末日	30,470,062	-	0.9695	-
6月末日	35,594,397	-	1.0127	-

F Wニッセイ国内リートインデックス

直近日（2023年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2022年12月12日)	2,746,990	2,746,990	0.9911	0.9911
2022年6月末日	1,087,527	-	0.9926	-
7月末日	1,123,268	-	1.0232	-
8月末日	1,150,550	-	1.0347	-
9月末日	1,195,680	-	0.9922	-
10月末日	1,604,891	-	1.0087	-
11月末日	2,533,196	-	1.0086	-
12月末日	4,742,664	-	0.9731	-
2023年1月末日	5,377,617	-	0.9425	-
2月末日	6,089,200	-	0.9568	-
3月末日	6,456,500	-	0.9292	-
4月末日	6,797,378	-	0.9757	-
5月末日	7,395,869	-	0.9817	-
6月末日	8,008,692	-	0.9753	-

F Wニッセイ先進国リートインデックス

直近日（2023年6月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2022年12月12日）	4,875,541	4,875,541	0.9855	0.9855
2022年6月末日	1,272,097	-	1.0235	-
7月末日	1,373,930	-	1.0781	-
8月末日	1,376,492	-	1.0539	-
9月末日	1,351,298	-	0.9386	-
10月末日	2,269,170	-	1.0229	-
11月末日	4,358,357	-	0.9993	-
12月末日	6,590,496	-	0.9373	-
2023年1月末日	8,185,962	-	0.9993	-
2月末日	8,655,283	-	1.0098	-
3月末日	8,677,635	-	0.9415	-
4月末日	8,821,465	-	0.9629	-
5月末日	9,098,173	-	0.9764	-
6月末日	10,987,651	-	1.0461	-

【分配の推移】

F Wニッセイ国内株インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
2022年12月13日～2023年6月12日	-

F Wニッセイ先進国株インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
2022年12月13日～2023年6月12日	-

F Wニッセイ新興国株インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
2022年12月13日～2023年6月12日	-

F Wニッセイ国内債インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
2022年12月13日～2023年6月12日	-

F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
2022年12月13日～2023年6月12日	-

F Wニッセイ外国債インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
2022年12月13日～2023年6月12日	-

F Wニッセイ新興国債インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
2022年12月13日～2023年6月12日	-

F Wニッセイ国内リートインデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
2022年12月13日～2023年6月12日	-

F Wニッセイ先進国リートインデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
2022年12月13日～2023年6月12日	-

【収益率の推移】

F Wニッセイ国内株インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	2.8
2022年12月13日～2023年6月12日	15.8

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

F Wニッセイ先進国株インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	4.0
2022年12月13日～2023年6月12日	11.4

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

F Wニッセイ新興国株インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	1.5
2022年12月13日～2023年6月12日	5.6

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

F Wニッセイ国内債インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	4.0
2022年12月13日～2023年6月12日	0.7

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

F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

	収益率（％）
第1計算期間	15.2
2022年12月13日～2023年6月12日	3.3

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

F Wニッセイ外国債インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	0.3
2022年12月13日～2023年6月12日	1.6

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

F Wニッセイ新興国債インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	5.2
2022年12月13日～2023年6月12日	2.5

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

F Wニッセイ国内リートインデックス

	収益率（％）
第1計算期間	0.9
2022年12月13日～2023年6月12日	1.7

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

F Wニッセイ先進国リートインデックス

	収益率(%)
第1計算期間	1.5
2022年12月13日～2023年6月12日	2.2

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

(4)【設定及び解約の実績】

F Wニッセイ国内株インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	51,780,776	616,588	51,164,188
2022年12月13日～ 2023年6月12日	57,902,810	15,153,479	93,913,519

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

F Wニッセイ先進国株インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	61,354,529	973,328	60,381,201
2022年12月13日～ 2023年6月12日	78,456,829	15,582,985	123,255,045

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

F Wニッセイ新興国株インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	7,343,377	172,577	7,170,800
2022年12月13日～ 2023年6月12日	5,572,599	3,270,254	9,473,145

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

F Wニッセイ国内債インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	29,556,858	1,054,389	28,502,469
2022年12月13日～ 2023年6月12日	24,519,341	18,887,554	34,134,256

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

F Wニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	11,592,565	689,960	10,902,605
2022年12月13日～ 2023年6月12日	23,241,355	8,648,743	25,495,217

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

F Wニッセイ外国債インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	22,471,963	602,774	21,869,189
2022年12月13日～ 2023年6月12日	23,706,067	5,693,833	39,881,423

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

F Wニッセイ新興国債インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	13,564,095	299,277	13,264,818
2022年12月13日～ 2023年6月12日	23,181,145	3,252,385	33,193,578

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

F Wニッセイ国内リートインデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	2,840,503	68,822	2,771,681
2022年12月13日～ 2023年6月12日	5,424,867	679,553	7,516,995

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

F Wニッセイ先進国リートインデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	5,033,936	86,474	4,947,462
2022年12月13日～ 2023年6月12日	6,438,884	1,246,576	10,139,770

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

< 参考情報 >

3.運用実績

2023年6月末現在

FWニッセイ国内株インデックス

●基準価額・純資産の推移



基準価額	12,183円
純資産総額	113百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

●組入上位業種(マザーファンド)

順位	業種	比率
1	電気機器	18.3%
2	情報・通信業	8.2%
3	輸送用機器	8.0%
4	卸売業	6.9%
5	銀行業	6.1%
6	化学	6.0%
7	機械	5.6%
8	医薬品	5.2%
9	サービス業	4.9%
10	小売業	4.3%

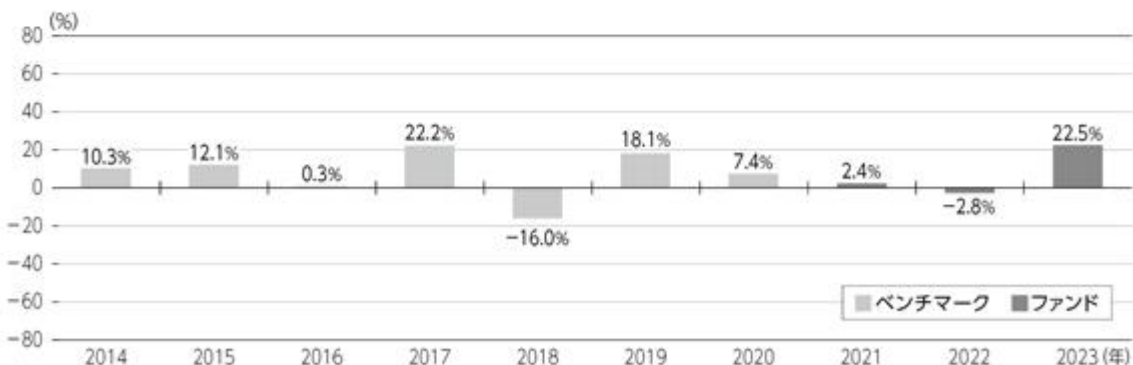
・比率は対組入株式評価額比です。

●組入上位銘柄(マザーファンド)

順位	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.9%
2	ソニーグループ	2.8%
3	キーエンス	2.1%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.0%
5	日本電信電話	1.7%
6	三菱商事	1.4%
7	三井住友フィナンシャルグループ	1.4%
8	日立製作所	1.3%
9	東京エレクトロン	1.3%
10	任天堂	1.3%

・比率は対組入株式評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2023年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2020年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

2023年6月末現在

FWニッセイ先進国株インデックス

●基準価額・純資産の推移



基準価額	12,273円
純資産総額	148百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

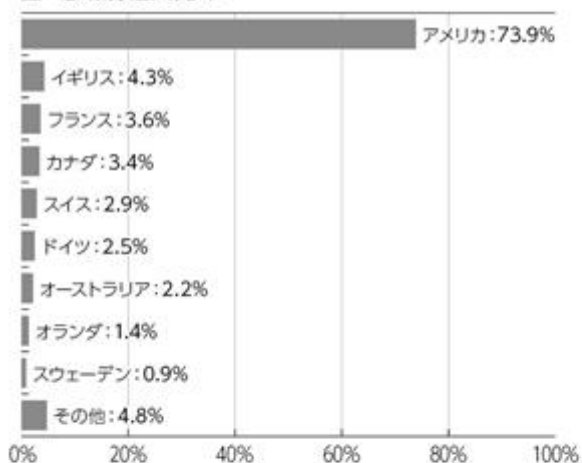
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

●主要な資産の状況(マザーファンド)

国・地域別組入比率



業種別組入比率



・上記グラフはすべて対組入株式等評価額比です。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2023年6月末現在

3.運用実績

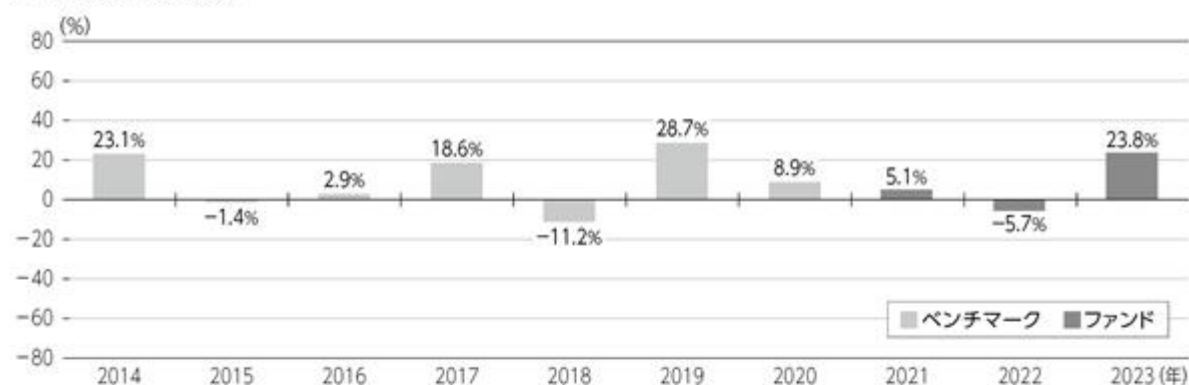
●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	5.7%
2	マイクロソフト	情報技術	4.5%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.2%
4	エヌビディア	情報技術	1.9%
5	テスラ	一般消費財・サービス	1.4%
6	アルファベット(A)	コミュニケーション・サービス	1.3%
7	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.2%
8	メタ・プラットフォームズ	コミュニケーション・サービス	1.2%
9	ユナイテッドヘルス・グループ	ヘルスケア	0.8%
10	パークシャー・ハサウェイ	金融	0.8%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2023年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2020年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

2023年6月末現在

FWニッセイ新興国株インデックス

●基準価額・純資産の推移



基準価額	10.688円
純資産総額	10百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

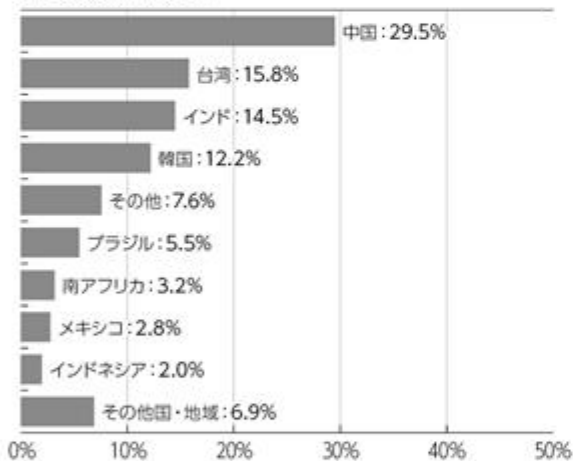
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

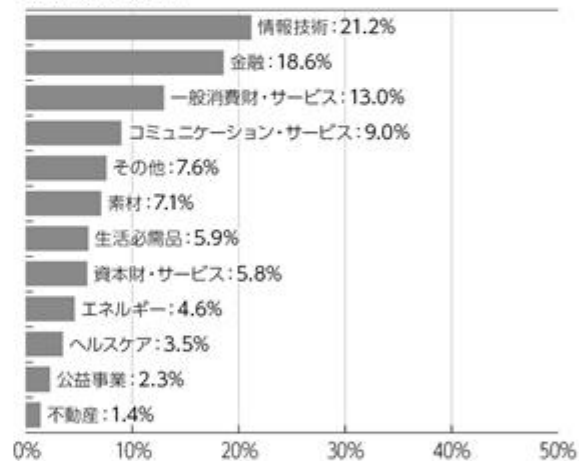
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

●主要な資産の状況(マザーファンド)

国・地域別組入比率



業種別組入比率



・上記グラフはすべて対組入株式等評価額比です。「その他」にはETFを含みます。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2023年6月末現在

3.運用実績

●組入上位銘柄(マザーファンド)

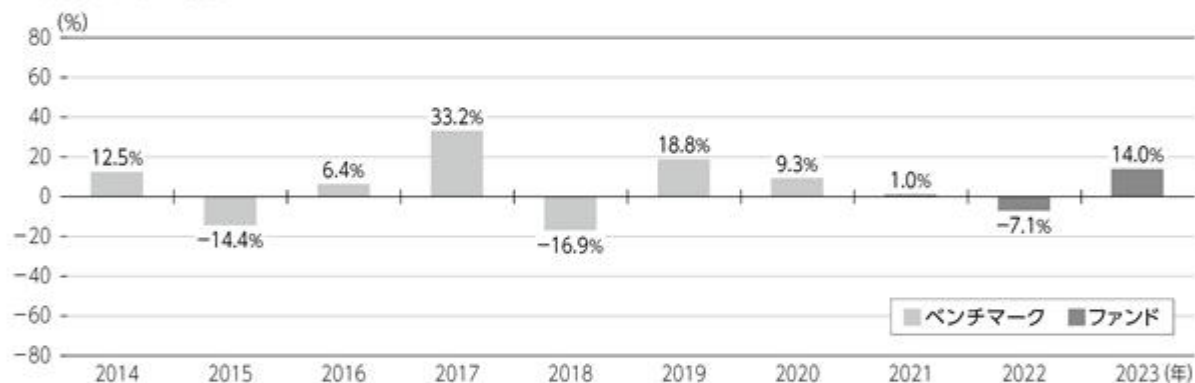
	銘柄	業種	比率
1	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	6.8%
2	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	4.4%
3	騰訊控股[テンセント・ホールディングス]	コミュニケーション・サービス	4.0%
4	サムスン電子	情報技術	3.9%
5	アリババ・グループ・ホールディング	一般消費財・サービス	2.6%
6	iシェアーズMSCI UAEキャップETF	その他	1.4%
7	リライアンス・インダストリーズ	エネルギー	1.4%
8	Meituan	一般消費財・サービス	1.2%
9	チャイナ・コンストラクション・バンク(中国建設銀行)	金融	0.9%
10	iシェアーズMSCIカタールETF	その他	0.9%

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

「その他」にはETFを含みます。

・比率は対組入株式等評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2023年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2020年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

2023年6月末現在

FWニッセイ国内債インデックス

●基準価額・純資産の推移



基準価額	9,694円
純資産総額	36百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

●資産別投資比率(マザーファンド)

債券	99.5%
債券先物	-
現金、その他	0.5%

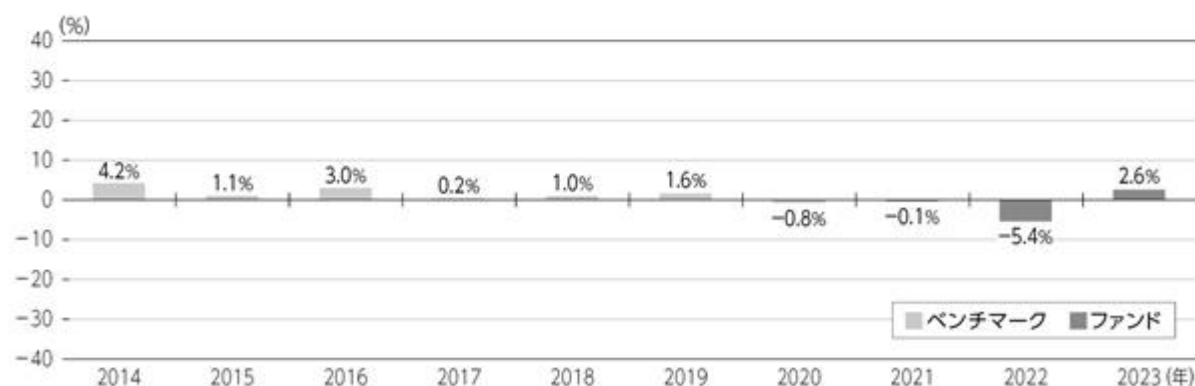
・比率は対純資産総額比です。

●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	種別	償還日	クーポン	比率
1	第350回 利付国債(10年)	国債	2028/03/20	0.100%	0.9%
2	第364回 利付国債(10年)	国債	2031/09/20	0.100%	0.9%
3	第365回 利付国債(10年)	国債	2031/12/20	0.100%	0.8%
4	第346回 利付国債(10年)	国債	2027/03/20	0.100%	0.8%
5	第368回 利付国債(10年)	国債	2032/09/20	0.200%	0.8%
6	第349回 利付国債(10年)	国債	2027/12/20	0.100%	0.8%
7	第360回 利付国債(10年)	国債	2030/09/20	0.100%	0.8%
8	第338回 利付国債(10年)	国債	2025/03/20	0.400%	0.8%
9	第361回 利付国債(10年)	国債	2030/12/20	0.100%	0.8%
10	第359回 利付国債(10年)	国債	2030/06/20	0.100%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2023年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2020年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2023年6月末現在

3.運用実績

FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)

●基準価額・純資産の推移



基準価額	8,157円
純資産総額	23百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

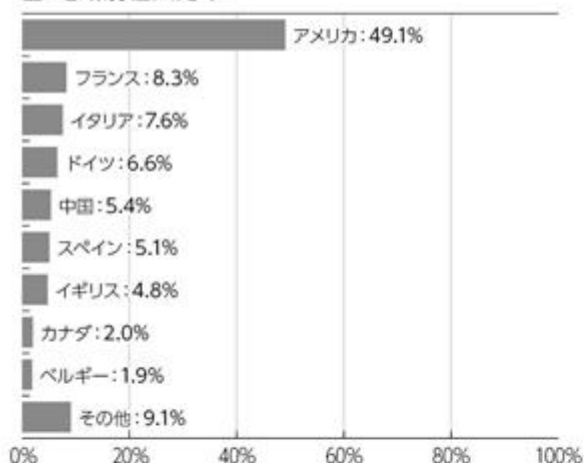
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

●主要な資産の状況(マザーファンド)

国・地域別組入比率



・比率は対組入債券評価額比です。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

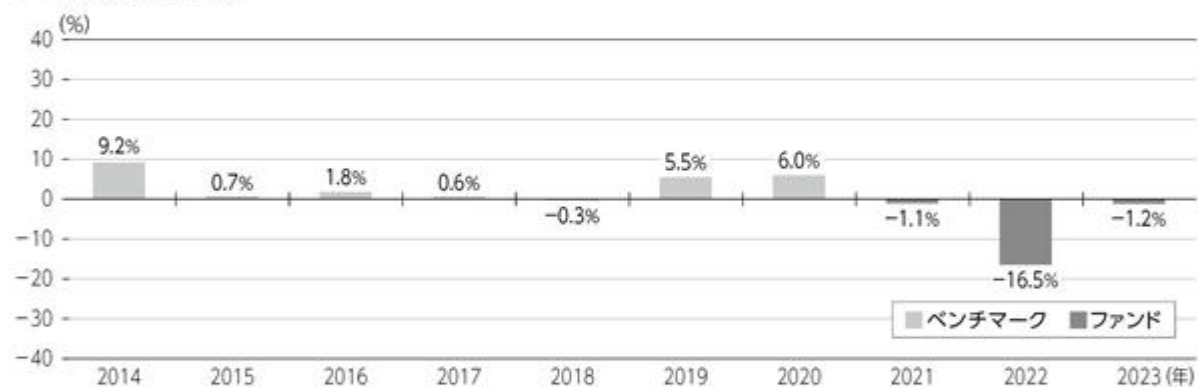
2023年6月末現在

●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	米ドル	2024/08/15	2.375%	3.4%
2	アメリカ国債	米ドル	2024/11/15	2.250%	2.6%
3	アメリカ国債	米ドル	2025/02/15	2.000%	2.2%
4	アメリカ国債	米ドル	2025/05/15	2.125%	1.9%
5	アメリカ国債	米ドル	2026/02/15	1.625%	1.9%
6	アメリカ国債	米ドル	2025/08/15	2.000%	1.8%
7	アメリカ国債	米ドル	2028/02/15	2.750%	1.8%
8	アメリカ国債	米ドル	2025/11/15	2.250%	1.7%
9	アメリカ国債	米ドル	2032/08/15	2.750%	1.6%
10	アメリカ国債	米ドル	2027/11/15	2.250%	1.6%

・比率は対組入債券評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2023年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2020年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

2023年6月末現在

3.運用実績

FWニッセイ外国債インデックス

●基準価額・純資産の推移



基準価額	10,603円
純資産総額	45百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

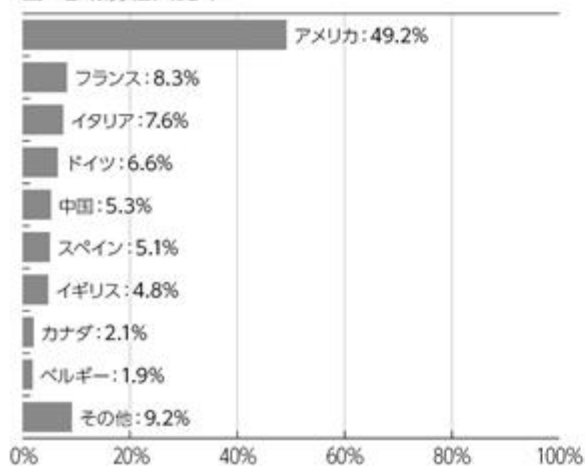
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

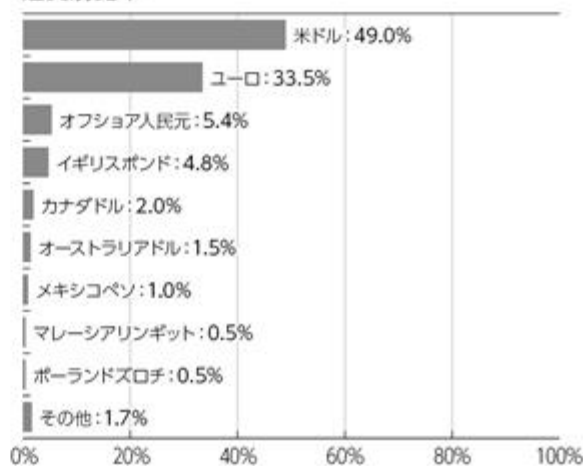
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

●主要な資産の状況(マザーファンド)

国・地域別組入比率



通貨別比率



・国・地域別組入比率は対組入債券評価額比、通貨別比率は対純資産総額比です。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

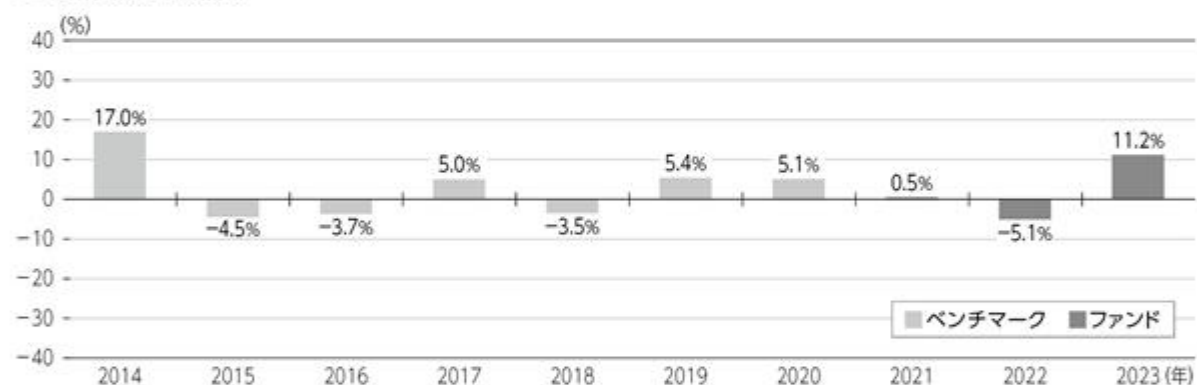
2023年6月末現在

●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	米ドル	2024/08/15	2.375%	2.2%
2	アメリカ国債	米ドル	2024/11/15	2.250%	1.7%
3	アメリカ国債	米ドル	2025/02/15	2.000%	1.7%
4	アメリカ国債	米ドル	2025/11/15	2.250%	1.4%
5	アメリカ国債	米ドル	2026/02/15	1.625%	1.4%
6	アメリカ国債	米ドル	2027/11/15	2.250%	1.2%
7	アメリカ国債	米ドル	2028/02/15	2.750%	1.2%
8	アメリカ国債	米ドル	2025/08/15	2.000%	1.1%
9	アメリカ国債	米ドル	2025/05/15	2.125%	1.1%
10	アメリカ国債	米ドル	2027/08/15	2.250%	1.1%

・比率は対組入債券評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2023年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2020年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2023年6月末現在

3.運用実績

FWニッセイ新興国債インデックス

●基準価額・純資産の推移



基準価額	10,127円
純資産総額	35百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

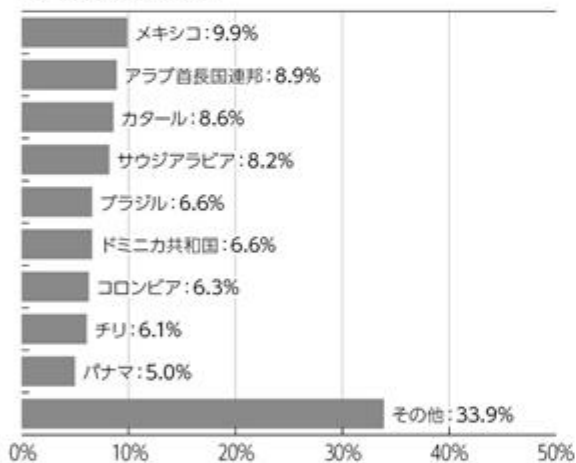
2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

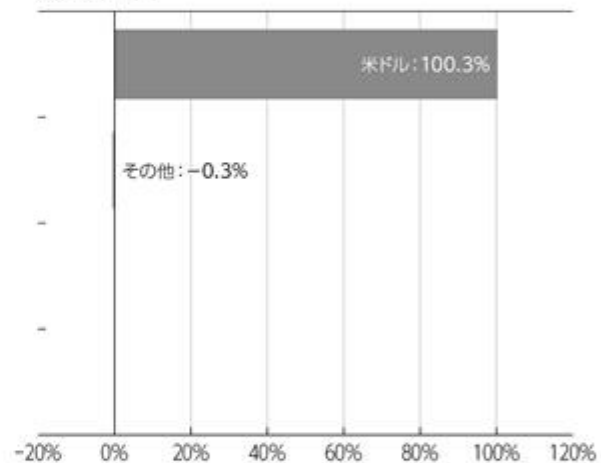
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

●主要な資産の状況(マザーファンド)

国・地域別組入比率



通貨別比率



・国・地域別組入比率は対組入債券評価額比、通貨別比率は対純資産総額比です。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

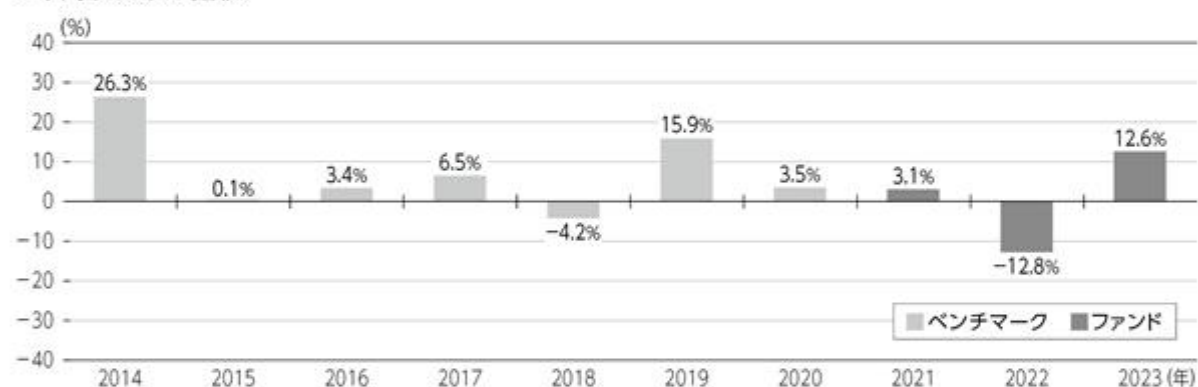
2023年6月末現在

●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	カタール国債	米ドル	2049/03/14	4.817%	2.5%
2	カタール国債	米ドル	2050/04/16	4.400%	2.3%
3	ブラジル国債	米ドル	2050/01/14	4.750%	1.9%
4	ドミニカ共和国国債	米ドル	2032/09/23	4.875%	1.6%
5	ペルー国債	米ドル	2031/01/23	2.783%	1.5%
6	サウジアラビア国債	米ドル	2032/10/25	5.500%	1.3%
7	パナマ国債	米ドル	2035/02/14	6.400%	1.3%
8	KSAスクーク	米ドル	2028/10/25	5.268%	1.3%
9	ハンガリー国債	米ドル	2028/05/22	6.125%	1.3%
10	オマーン国債	米ドル	2031/01/25	6.250%	1.3%

・比率は対組入債券評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2023年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2020年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2023年6月末現在

3.運用実績

FWニッセイ国内リートインデックス

●基準価額・純資産の推移



基準価額	9,753円
純資産総額	800万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

●資産別投資比率(マザーファンド)

不動産投資信託証券	98.5%
短期金融資産等	1.5%

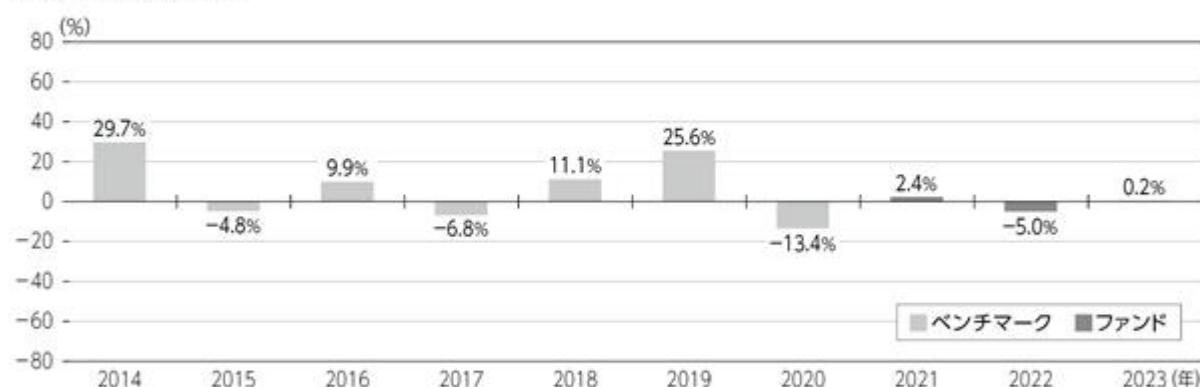
・比率は対純資産総額比です。

●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	6.3%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.3%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.1%
4	日本プロロジスリート投資法人	4.8%
5	日本都市ファンド投資法人	4.6%
6	GLP投資法人	4.6%
7	大和ハウスリート投資法人	4.0%
8	オリックス不動産投資法人	3.4%
9	アドバンス・レジデンス投資法人	3.3%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	3.1%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2023年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2020年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

3.運用実績

2023年6月末現在

FWニッセイ先進国リートインデックス

●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

基準価額	10.461円
純資産総額	10百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

●資産別投資比率(マザーファンド)

不動産投資信託証券	97.9%
現金、その他	2.1%

・比率は対純資産総額比です。

●国・地域別投資比率(マザーファンド)



・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2023年6月末現在

3.運用実績

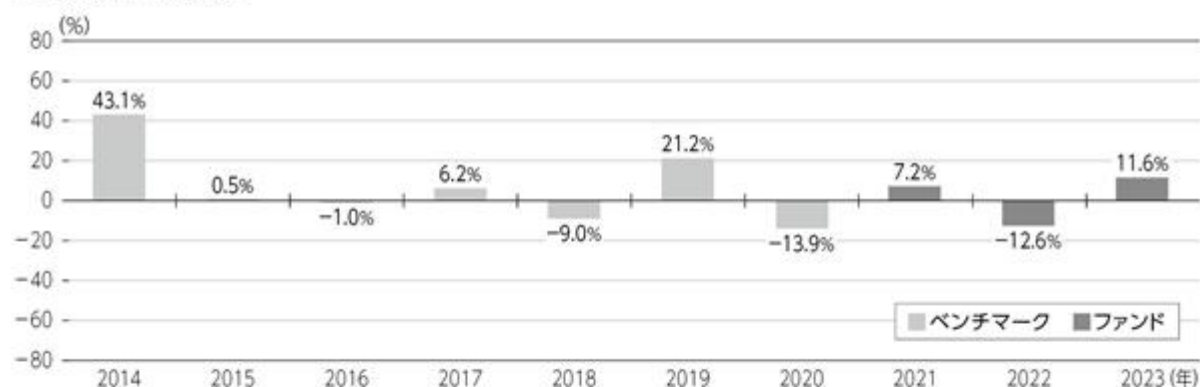
●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	国・地域	比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	8.9%
2	EQUINIX INC	アメリカ	5.8%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.6%
4	REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.2%
5	WELLTOWER INC	アメリカ	3.2%
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.0%
7	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.6%
8	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	2.5%
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.2%
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	1.8%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2023年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

・2020年以前はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

「国内株インデックス／国内債インデックス／国内リートインデックス」

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

「先進国株インデックス」

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

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

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

「新興国株インデックス」

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

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

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

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

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

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

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

「外国債インデックス」

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

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

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

「新興国債インデックス」

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

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

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

「先進国リートインデックス」

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

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

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

各ファンドは、投資一任契約に基づき、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。

取扱コース

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

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

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

「国内株インデックス／国内債インデックス／国内リートインデックス」

取得申込受付日の基準価額とします。

「先進国株インデックス／新興国株インデックス／外国債インデックス／新興国債インデックス／先進国リートインデックス」

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に信託財産留保額を加算した額とします（以下「販売基準価額」ということがあります）。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、「外国債インデックス（ヘッジあり）」のみ各計算期間終了日の販売基準価額とします。その他のファンドは、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

信託財産留保額

「外国債インデックス（ヘッジあり）」のみ、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に0.03%をかけた額とします。その他のファンドにはありません。

その他

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター 0120-762-506
(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)
ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

2【換金(解約)手続等】

換金受付

「国内株インデックス/国内債インデックス/国内リートインデックス」

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

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

「先進国株インデックス」

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

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

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

「新興国株インデックス」

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

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

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

「外国債インデックス(ヘッジあり)」

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

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

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

「外国債インデックス」

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

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

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

「新興国債インデックス」

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

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

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

「先進国リートインデックス」

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

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

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

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

「国内株インデックス/国内債インデックス/国内リートインデックス」

<解約請求の場合>

解約価額：解約請求受付日の基準価額とします。

<買取請求の場合>

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

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

換金手数料はありません。

「先進国株インデックス/新興国株インデックス/外国債インデックス/新興国債インデックス/先進国リートインデックス」

<解約請求の場合>

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

<買取請求の場合>

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

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

換金手数料はありません。

「外国債インデックス(ヘッジあり)」

<解約請求の場合>

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた額とします。

<買取請求の場合>

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

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

換金手数料はありません。

信託財産留保額

「外国債インデックス（ヘッジあり）」のみ、換金請求受付日の翌営業日の基準価額に0.03%をかけた額とします。その他のファンドにはありません。

支払開始日

「国内株インデックス / 国内債インデックス / 外国債インデックス（ヘッジあり） / 国内リートインデックス」

解約請求受付日または買取請求受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。

「先進国株インデックス / 外国債インデックス / 新興国債インデックス / 先進国リートインデックス」

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

「新興国株インデックス」

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

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社
 コールセンター 0120-762-506
 （9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）
 ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限です。

(4)【計算期間】

毎年12月11日から翌年12月10日までとします。

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

(5) 【その他】

繰上償還

1. 委託会社は、信託期間中において、下記の理由により、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、ファンドを終了させることができます。この場合、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
 - ・ 受益権の口数が30億口または純資産総額が30億円を下回っている場合
 - ・ この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき
 - ・ やむを得ない事情が発生したとき
2. 委託会社は、前記1.により解約するときには、書面による決議（以下「書面決議」といいます）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までにこの信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前記2.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前記2.から5.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前記1.から6.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記1.から7.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

FWニッセイ国内株インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2021年11月30日から2022年12月12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。

FWニッセイ先進国株インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2021年11月30日から2022年12月12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。

FWニッセイ新興国株インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2021年11月30日から2022年12月12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。

FWニッセイ国内債インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2021年11月30日から2022年12月12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。

F Wニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2021年11月30日から2022年12月12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。

F Wニッセイ外国債インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2021年11月30日から2022年12月12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。

F Wニッセイ新興国債インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2021年11月30日から2022年12月12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。

F Wニッセイ国内リートインデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2021年11月30日から2022年12月12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。

F Wニッセイ先進国リートインデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2021年11月30日から2022年12月12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】

【FWニッセイ国内株インデックス】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		676
コール・ローン		21,398
親投資信託受益証券		52,584,304
未収入金		1,253
流動資産合計		52,607,631
資産合計		52,607,631
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		1,791
未払委託者報酬		21,999
その他未払費用		818
流動負債合計		24,608
負債合計		24,608
純資産の部		
元本等		
元本		51,164,188
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		1,418,835
(分配準備積立金)		907,935
元本等合計		52,583,023
純資産合計		52,583,023
負債純資産合計		52,607,631

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	930,967
営業収益合計	930,967
営業費用	
受託者報酬	2,000
委託者報酬	24,861
その他費用	878
営業費用合計	27,739
営業利益又は営業損失（ ）	903,228
経常利益又は経常損失（ ）	903,228
当期純利益又は当期純損失（ ）	903,228
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（ ）	4,707
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	510,900
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,693
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	509,207
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,418,835

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2021年11月30日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	2022年12月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	50,780,776円
期中一部解約元本額	616,588円
2. 受益権の総数	51,164,188口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12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(907,935円)、収益調整金(510,900円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は1,418,835円(1万口当たり277.31円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年12月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	934,804
合計	934,804

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0277円 (10,277円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデック ス マザーファンド	23,323,119	52,584,304	
親投資信託受益証券	合計	23,323,119	52,584,304	
合計			52,584,304	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【FWニッセイ先進国株インデックス】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		881
コール・ローン		27,875
親投資信託受益証券		62,824,349
未収入金		1,677
流動資産合計		62,854,782
資産合計		62,854,782
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		2,109
未払委託者報酬		29,065
その他未払費用		969
流動負債合計		32,143
負債合計		32,143
純資産の部		
元本等		
元本		60,381,201
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（　）		2,441,438
（分配準備積立金）		-
元本等合計		62,822,639
純資産合計		62,822,639
負債純資産合計		62,854,782

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	665,600
営業収益合計	665,600
営業費用	
受託者報酬	2,311
委託者報酬	32,481
その他費用	1,029
営業費用合計	35,821
営業利益又は営業損失（ ）	701,421
経常利益又は経常損失（ ）	701,421
当期純利益又は当期純損失（ ）	701,421
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（ ）	11,757
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,141,697
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,141,697
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,595
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,595
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（ ）	2,441,438

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2021年11月30日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 2022年12月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	60,354,529円
期中一部解約元本額	973,328円
2. 受益権の総数	60,381,201口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12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(2,441,438円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は2,441,438円(1万円当たり404.34円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年12月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
親投資信託受益証券		654,759
合計		654,759

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		1.0404円 (10,404円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド	21,011,488	62,824,349	
親投資信託受益証券	合計	21,011,488	62,824,349	
合計			62,824,349	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【FWニッセイ新興国株インデックス】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2022年12月12日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	139
コール・ローン	4,411
親投資信託受益証券	7,064,208
未収入金	639
流動資産合計	7,069,397
資産合計	7,069,397
負債の部	
流動負債	
未払解約金	211
未払受託者報酬	304
未払委託者報酬	4,816
その他未払費用	53
流動負債合計	5,384
負債合計	5,384
純資産の部	
元本等	
元本	7,170,800
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	106,787
(分配準備積立金)	174,200
元本等合計	7,064,013
純資産合計	7,064,013
負債純資産合計	7,069,397

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	181,428
営業収益合計	181,428
営業費用	
受託者報酬	403
委託者報酬	6,660
その他費用	53
営業費用合計	7,116
営業利益又は営業損失（ ）	174,312
経常利益又は経常損失（ ）	174,312
当期純利益又は当期純損失（ ）	174,312
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（ ）	112
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,048
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,048
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	282,035
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	282,035
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	106,787

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2021年11月30日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	2022年12月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	6,343,377円
期中一部解約元本額	172,577円
2. 受益権の総数	7,170,800口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は106,787円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12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（174,200円）、収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は174,200円（1万口当たり242.93円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年12月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
親投資信託受益証券		181,101
合計		181,101

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		0.9851円 (9,851円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	6,078,830	7,064,208	
親投資信託受益証券	合計	6,078,830	7,064,208	
合計			7,064,208	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【FWニッセイ国内債インデックス】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年12月12日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	200
コール・ローン	6,334
親投資信託受益証券	27,364,407
未収入金	15,650
流動資産合計	27,386,591
資産合計	27,386,591
負債の部	
流動負債	
未払解約金	15,188
未払受託者報酬	753
未払委託者報酬	6,426
その他未払費用	285
流動負債合計	22,652
負債合計	22,652
純資産の部	
元本等	
元本	28,502,469
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,138,530
（分配準備積立金）	-
元本等合計	27,363,939
純資産合計	27,363,939
負債純資産合計	27,386,591

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	79,264
営業収益合計	79,264
営業費用	
受託者報酬	844
委託者報酬	7,460
その他費用	285
営業費用合計	8,589
営業利益又は営業損失（ ）	87,853
経常利益又は経常損失（ ）	87,853
当期純利益又は当期純損失（ ）	87,853
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（ ）	8,927
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	16,930
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,930
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,076,534
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,076,534
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,138,530

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2021年11月30日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	2022年12月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	28,556,858円
期中一部解約元本額	1,054,389円
2. 受益権の総数	28,502,469口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,138,530円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は0円(1万口当たり0円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年12月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	70,728
合計	70,728

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9601円 (9,601円)

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	28,929,493	27,364,407	
親投資信託受益証券	合計	28,929,493	27,364,407	
合計			27,364,407	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)】
(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2022年12月12日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	87
コール・ローン	2,763
親投資信託受益証券	9,243,528
未収入金	5,024
流動資産合計	9,251,402
資産合計	9,251,402
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,898
未払受託者報酬	240
未払委託者報酬	2,873
その他未払費用	52
流動負債合計	8,063
負債合計	8,063
純資産の部	
元本等	
元本	10,902,605
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	1,659,266
(分配準備積立金)	-
元本等合計	9,243,339
純資産合計	9,243,339
負債純資産合計	9,251,402

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	124,918
営業収益合計	124,918
営業費用	
受託者報酬	246
委託者報酬	3,976
その他費用	52
営業費用合計	4,274
営業利益又は営業損失（ ）	129,192
経常利益又は経常損失（ ）	129,192
当期純利益又は当期純損失（ ）	129,192
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（ ）	20,793
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	22,866
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,866
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,573,733
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,573,733
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,659,266

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2021年11月30日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	2022年12月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	10,592,565円
期中一部解約元本額	689,960円
2. 受益権の総数	10,902,605口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,659,266円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12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(775円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は775円(1万口当たり0.71円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年12月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
親投資信託受益証券		104,226
合計		104,226

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		0.8478円 (8,478円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ為替ヘッジ外国債券 パッシブ マザーファンド	8,964,726	9,243,528	
親投資信託受益証券	合計	8,964,726	9,243,528	
合計			9,243,528	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【FWニッセイ外国債インデックス】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		239
コール・ローン		7,552
親投資信託受益証券		21,934,587
未収入金		505
流動資産合計		21,942,883
資産合計		21,942,883
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		614
未払委託者報酬		8,005
その他未払費用		214
流動負債合計		8,833
負債合計		8,833
純資産の部		
元本等		
元本		21,869,189
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（　）		64,861
（分配準備積立金）		-
元本等合計		21,934,050
純資産合計		21,934,050
負債純資産合計		21,942,883

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	191,588
営業収益合計	191,588
営業費用	
受託者報酬	682
委託者報酬	9,534
その他費用	214
営業費用合計	10,430
営業利益又は営業損失（ ）	202,018
経常利益又は経常損失（ ）	202,018
当期純利益又は当期純損失（ ）	202,018
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,151
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	267,983
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	267,983
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,255
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,255
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（ ）	64,861

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2021年11月30日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	2022年12月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	21,471,963円
期中一部解約元本額	602,774円
2. 受益権の総数	21,869,189口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12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(64,861円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は64,861円(1万口当たり29.66円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年12月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
親投資信託受益証券		190,726
合計		190,726

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		1.0030円 (10,030円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	14,372,027	21,934,587	
親投資信託受益証券	合計	14,372,027	21,934,587	
合計			21,934,587	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【FWニッセイ新興国債インデックス】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		153
コール・ローン		4,838
親投資信託受益証券		12,573,581
未収入金		297
流動資産合計		12,578,869
資産合計		12,578,869
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		390
未払委託者報酬		5,109
その他未払費用		104
流動負債合計		5,603
負債合計		5,603
純資産の部		
元本等		
元本		13,264,818
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（　）		691,552
（分配準備積立金）		120,861
元本等合計		12,573,266
純資産合計		12,573,266
負債純資産合計		12,578,869

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	119,547
営業収益合計	119,547
営業費用	
受託者報酬	440
委託者報酬	6,543
その他費用	104
営業費用合計	7,087
営業利益又は営業損失（ ）	112,460
経常利益又は経常損失（ ）	112,460
当期純利益又は当期純損失（ ）	112,460
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（ ）	8,401
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	11,077
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,077
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	823,490
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	823,490
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	691,552

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2021年11月30日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	2022年12月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	12,564,095円
期中一部解約元本額	299,277円
2. 受益権の総数	13,264,818口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は691,552円であり ます。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12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(120,861円)、収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は120,861円(1万口当たり91.11円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年12月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
親投資信託受益証券		127,819
合計		127,819

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		0.9479円 (9,479円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド	10,715,512	12,573,581	
親投資信託受益証券	合計	10,715,512	12,573,581	
合計			12,573,581	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【FWニッセイ国内リートインデックス】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		59
コール・ローン		1,867
親投資信託受益証券		2,747,053
未収入金		428
流動資産合計		2,749,407
資産合計		2,749,407
負債の部		
流動負債		
未払解約金		365
未払受託者報酬		101
未払委託者報酬		1,951
流動負債合計		2,417
負債合計		2,417
純資産の部		
元本等		
元本		2,771,681
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（　）		24,691
（分配準備積立金）		-
元本等合計		2,746,990
純資産合計		2,746,990
負債純資産合計		2,749,407

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	20,583
営業収益合計	20,583
営業費用	
受託者報酬	149
委託者報酬	3,236
営業費用合計	3,385
営業利益又は営業損失（ ）	23,968
経常利益又は経常損失（ ）	23,968
当期純利益又は当期純損失（ ）	23,968
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	1,965
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	41
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	41
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,729
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,729
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	24,691

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2021年11月30日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	2022年12月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,840,503円
期中一部解約元本額	68,822円
2. 受益権の総数	2,771,681口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は24,691円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は0円(1万口当たり0円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年12月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
親投資信託受益証券		18,575
合計		18,575

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		0.9911円 (9,911円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	1,448,333	2,747,053	
親投資信託受益証券	合計	1,448,333	2,747,053	
合計			2,747,053	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【FWニッセイ先進国リートインデックス】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		91
コール・ローン		2,885
親投資信託受益証券		4,875,670
未収入金		123
流動資産合計		4,878,769
資産合計		4,878,769
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		192
未払委託者報酬		3,004
その他未払費用		32
流動負債合計		3,228
負債合計		3,228
純資産の部		
元本等		
元本		4,947,462
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		71,921
（分配準備積立金）		-
元本等合計		4,875,541
純資産合計		4,875,541
負債純資産合計		4,878,769

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	77,459
営業収益合計	77,459
営業費用	
受託者報酬	232
委託者報酬	4,580
その他費用	32
営業費用合計	4,844
営業利益又は営業損失（ ）	82,303
経常利益又は経常損失（ ）	82,303
当期純利益又は当期純損失（ ）	82,303
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（ ）	177
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	10,943
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	10,943
剰余金減少額又は欠損金増加額	384
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	384
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（ ）	71,921

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間末日が休業日のため、2021年11月30日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	2022年12月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	4,033,936円
期中一部解約元本額	86,474円
2. 受益権の総数	4,947,462口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は71,921円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は0円(1万口当たり0円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年12月12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 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年12月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
親投資信託受益証券		77,774
合計		77,774

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）		0.9855円 (9,855円)

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	3,492,100	4,875,670	
親投資信託受益証券	合計	3,492,100	4,875,670	
合計			4,875,670	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「FWニッセイ国内株インデックス」、「FWニッセイ先進国株インデックス」、「FWニッセイ新興国株インデックス」、「FWニッセイ国内債インデックス」、「FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）」、「FWニッセイ外国債インデックス」、「FWニッセイ新興国債インデックス」、「FWニッセイ国内リートインデックス」、「FWニッセイ先進国リートインデックス」は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における同親投資信託の状況は以下の通りであります。それらは監査意見の対象外であります。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2022年12月12日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	170,936,754
コール・ローン	5,408,649,222
株式	176,655,224,340
派生商品評価勘定	14,157,000
未収配当金	134,690,345
差入委託証拠金	214,500,000
流動資産合計	182,598,157,661
資産合計	182,598,157,661
負債の部	
流動負債	
前受金	31,200,000
未払解約金	825,702,790
その他未払費用	10,442
流動負債合計	856,913,232
負債合計	856,913,232
純資産の部	
元本等	
元本	80,607,445,865
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	101,133,798,564
元本等合計	181,741,244,429
純資産合計	181,741,244,429
負債純資産合計	182,598,157,661

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	52,343,603,221円
同期中追加設定元本額	54,265,066,001円
同期中一部解約元本額	26,001,223,357円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,626,891,816円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	3,316,238,441円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,479,840円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,225,858,146円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,570,612,088円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,798,101,363円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	3,788,488円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	13,809,648円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	13,308,131円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,681,301,537円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	23,104,837,346円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	2,856,045,171円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	282,386,157円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	241,725,069円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	324,640,260円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	606,109,680円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	54,707,471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)	119,369,846円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	8,719,683円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	12,166,672円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	5,222,028円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	8,587,722円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	28,782,258円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	206,208,594円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	136,154,844円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	296,640,356円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	240,015,143円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	25,762,245,724円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット)	20,778,982円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)	73,548円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)	157,551円
FWニッセイ国内株インデックス	23,323,119円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	15,159,143円
計	80,607,445,865円
2. 受益権の総数	80,607,445,865口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	5,738,255,557	
合計	5,738,255,557	

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年2月22日から2022年12月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年12月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	5,059,600,000	-	5,073,900,000	14,300,000
合計	5,059,600,000	-	5,073,900,000	14,300,000

（注）株価指数先物取引

1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年12月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2546円 (22,546円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年12月12日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,300	3,625.00	11,962,500	
ニッセイ	87,500	523.00	45,762,500	
マルハニチロ	13,500	2,381.00	32,143,500	
雪国まいたけ	7,500	995.00	7,462,500	
カネコ種苗	3,400	1,415.00	4,811,000	
サカタのタネ	11,100	4,470.00	49,617,000	
ホクト	7,800	1,875.00	14,625,000	
ショーボンドホールディングス	11,900	5,770.00	68,663,000	
ミライト・ワン	30,400	1,532.00	46,572,800	
タマホーム	6,200	2,573.00	15,952,600	
ファーストコーポレーション	1,300	713.00	926,900	
住石ホールディングス	14,000	410.00	5,740,000	
日鉄鉱業	3,500	3,050.00	10,675,000	
三井松島ホールディングス	4,000	3,245.00	12,980,000	
I N P E X	323,800	1,429.00	462,710,200	
石油資源開発	10,100	3,905.00	39,440,500	
K & O エナジーグループ	4,000	2,273.00	9,092,000	
安藤・間	50,700	839.00	42,537,300	
東急建設	24,900	631.00	15,711,900	
コムシスホールディングス	29,600	2,428.00	71,868,800	
ビーアールホールディングス	14,000	333.00	4,662,000	
高松コンストラクショングループ	5,700	1,904.00	10,852,800	
東建コーポレーション	2,800	7,400.00	20,720,000	
ソネック	4,800	960.00	4,608,000	
ヤマウラ	4,900	992.00	4,860,800	
オリエンタル白石	31,500	275.00	8,662,500	
大成建設	61,000	4,160.00	253,760,000	
大林組	219,000	1,005.00	220,095,000	
清水建設	184,100	715.00	131,631,500	
飛島建設	6,800	997.00	6,779,600	
長谷工コーポレーション	63,200	1,494.00	94,420,800	
松井建設	8,700	556.00	4,837,200	
銭高組	1,500	2,631.00	3,946,500	
鹿島建設	135,800	1,532.00	208,045,600	
不動テトラ	4,200	1,468.00	6,165,600	
鉄建建設	4,400	1,755.00	7,722,000	
西松建設	10,400	3,940.00	40,976,000	
三井住友建設	49,400	415.00	20,501,000	
大豊建設	2,500	4,095.00	10,237,500	
佐田建設	10,800	459.00	4,957,200	
ナカノフドー建設	15,100	319.00	4,816,900	
奥村組	9,900	2,935.00	29,056,500	
東鉄工業	8,400	2,525.00	21,210,000	
浅沼組	4,900	2,937.00	14,391,300	

戸田建設	75,300	722.00	54,366,600
熊谷組	10,600	2,566.00	27,199,600
植木組	3,500	1,297.00	4,539,500
矢作建設工業	8,300	753.00	6,249,900
ピーエス三菱	7,900	610.00	4,819,000
日本ハウスホールディングス	12,100	399.00	4,827,900
大東建託	22,500	14,300.00	321,750,000
新日本建設	8,600	731.00	6,286,600
東亜道路工業	1,200	5,800.00	6,960,000
日本道路	1,200	5,910.00	7,092,000
東亜建設工業	5,300	2,259.00	11,972,700
日本国土開発	18,400	563.00	10,359,200
若築建設	2,700	2,755.00	7,438,500
東洋建設	19,800	832.00	16,473,600
五洋建設	86,800	634.00	55,031,200
世紀東急工業	8,100	768.00	6,220,800
福田組	2,300	4,655.00	10,706,500
住友林業	47,000	2,407.00	113,129,000
日本基礎技術	8,100	506.00	4,098,600
巴コーポレーション	10,600	395.00	4,187,000
大和ハウス工業	171,200	3,104.00	531,404,800
ライト工業	11,700	1,931.00	22,592,700
積水ハウス	191,900	2,395.00	459,600,500
日特建設	5,800	904.00	5,243,200
北陸電気工事	7,200	666.00	4,795,200
ユアテック	13,500	720.00	9,720,000
日本リーテック	6,600	770.00	5,082,000
四電工	2,900	1,707.00	4,950,300
中電工	9,500	2,058.00	19,551,000
関電工	33,600	856.00	28,761,600
きんでん	43,100	1,445.00	62,279,500
東京エネシス	6,000	911.00	5,466,000
トーエネック	2,000	3,430.00	6,860,000
住友電設	5,800	2,410.00	13,978,000
日本電設工業	10,100	1,629.00	16,452,900
エクシオグループ	30,000	2,150.00	64,500,000
新日本空調	3,400	1,869.00	6,354,600
日本工営	4,600	3,430.00	15,778,000
九電工	14,900	3,235.00	48,201,500
三機工業	13,600	1,546.00	21,025,600
日揮ホールディングス	60,600	1,730.00	104,838,000
中外炉工業	3,100	1,604.00	4,972,400
ヤマト	6,200	711.00	4,408,200
太平電業	3,800	3,045.00	11,571,000
高砂熱学工業	14,800	1,748.00	25,870,400
三晃金属工業	1,700	2,985.00	5,074,500
NECネットエスアイ	20,900	1,617.00	33,795,300
朝日工業社	2,500	2,075.00	5,187,500
明星工業	10,500	738.00	7,749,000
大気社	7,400	3,460.00	25,604,000

ダイダン	4,000	2,152.00	8,608,000
日比谷総合設備	5,300	1,901.00	10,075,300
ニッポン	16,600	1,594.00	26,460,400
日清製粉グループ本社	56,900	1,562.00	88,877,800
日東富士製粉	1,100	4,365.00	4,801,500
昭和産業	5,400	2,412.00	13,024,800
中部飼料	8,500	1,027.00	8,729,500
フィード・ワン	9,000	668.00	6,012,000
日本甜菜製糖	3,600	1,619.00	5,828,400
D M三井製糖ホールディングス	6,100	1,967.00	11,998,700
塩水港精糖	23,200	196.00	4,547,200
日新製糖	3,200	1,734.00	5,548,800
L I F U L L	28,900	235.00	6,791,500
M I X I	14,600	2,426.00	35,419,600
ジェイエイシーリクルートメント	5,800	2,552.00	14,801,600
日本M&Aセンターホールディングス	110,100	1,817.00	200,051,700
メンバーズ	2,300	2,078.00	4,779,400
U Tグループ	9,400	2,441.00	22,945,400
アイティメディア	2,900	1,734.00	5,028,600
E・Jホールディングス	4,100	1,282.00	5,256,200
夢真ビーネックスグループ	23,400	1,806.00	42,260,400
コシダカホールディングス	19,200	1,100.00	21,120,000
アルトナー	1,300	1,013.00	1,316,900
パソナグループ	7,800	1,940.00	15,132,000
C D S	2,700	1,798.00	4,854,600
リンクアンドモチベーション	18,500	711.00	13,153,500
エス・エム・エス	24,400	3,490.00	85,156,000
サニーサイドアップグループ	7,000	580.00	4,060,000
パーソルホールディングス	71,900	3,000.00	215,700,000
クックパッド	23,900	203.00	4,851,700
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,700	679.00	5,228,300
森永製菓	12,700	3,820.00	48,514,000
中村屋	1,600	3,090.00	4,944,000
江崎グリコ	17,600	3,625.00	63,800,000
名糖産業	3,000	1,633.00	4,899,000
井村屋グループ	3,400	2,204.00	7,493,600
不二家	4,200	2,580.00	10,836,000
山崎製パン	41,200	1,596.00	65,755,200
モロゾフ	2,000	3,530.00	7,060,000
亀田製菓	3,900	4,330.00	16,887,000
寿スピリッツ	6,500	7,540.00	49,010,000
カルビー	28,100	3,020.00	84,862,000
森永乳業	11,200	4,485.00	50,232,000
六甲バター	4,500	1,373.00	6,178,500
ヤクルト本社	43,900	8,760.00	384,564,000
明治ホールディングス	38,100	6,730.00	256,413,000
雪印メグミルク	14,900	1,741.00	25,940,900
プリマハム	8,300	2,080.00	17,264,000
日本ハム	24,000	3,630.00	87,120,000
林兼産業	7,000	464.00	3,248,000

丸大食品	6,200	1,397.00	8,661,400	
S Foods	6,800	2,891.00	19,658,800	
柿安本店	2,400	2,155.00	5,172,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	47,800	677.00	32,360,600	
学情	3,200	1,441.00	4,611,200	
スタジオアリス	3,200	2,060.00	6,592,000	
クロスキャット	3,600	1,515.00	5,454,000	
シミックホールディングス	3,500	1,669.00	5,841,500	
システナ	105,300	421.00	44,331,300	
N J S	2,300	2,043.00	4,698,900	
デジタルアーツ	4,000	6,290.00	25,160,000	
日鉄ソリューションズ	10,700	3,335.00	35,684,500	
総合警備保障	23,800	3,475.00	82,705,000	
キューブシステム	4,900	1,056.00	5,174,400	
いちご	70,800	302.00	21,381,600	
日本駐車場開発	73,200	295.00	21,594,000	
コア	3,300	1,454.00	4,798,200	
カカクコム	47,900	2,233.00	106,960,700	
アイロムグループ	2,300	2,257.00	5,191,100	
セントケア・ホールディング	5,800	858.00	4,976,400	
ルネサンス	5,100	877.00	4,472,700	
ディップ	11,200	3,805.00	42,616,000	
S B Sホールディングス	5,600	2,863.00	16,032,800	
デジタルホールディングス	5,000	1,186.00	5,930,000	
新日本科学	6,800	2,239.00	15,225,200	
ベネフィット・ワン	29,700	2,104.00	62,488,800	
エムスリー	126,800	4,123.00	522,796,400	
アウトソーシング	38,200	971.00	37,092,200	
ウェルネット	7,700	607.00	4,673,900	
ワールドホールディングス	2,900	2,779.00	8,059,100	
ディー・エヌ・エー	27,400	1,797.00	49,237,800	
博報堂D Yホールディングス	81,900	1,319.00	108,026,100	
ぐるなび	11,800	413.00	4,873,400	
ジャパンベストレスキューシステム	5,600	863.00	4,832,800	
ファンコミュニケーションズ	12,600	439.00	5,531,400	
ライク	2,400	1,990.00	4,776,000	
ビジネス・ブレークスルー	11,700	382.00	4,469,400	
エスプール	18,400	915.00	16,836,000	
W D Bホールディングス	3,300	2,209.00	7,289,700	
手間いらず	1,100	5,020.00	5,522,000	
アドウェイズ	8,800	515.00	4,532,000	
バリューコマース	4,800	1,955.00	9,384,000	
インフォマート	66,600	433.00	28,837,800	
サッポロホールディングス	20,200	3,590.00	72,518,000	
アサヒグループホールディングス	142,100	4,273.00	607,193,300	
麒麟ホールディングス	277,500	2,110.50	585,663,750	
宝ホールディングス	42,000	1,050.00	44,100,000	
オエノンホールディングス	18,400	279.00	5,133,600	
養命酒製造	2,700	1,796.00	4,849,200	

コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	48,200	1,460.00	70,372,000	
サントリー食品インターナショナル	43,300	4,570.00	197,881,000	
ダイドーグループホールディングス	3,500	4,855.00	16,992,500	
伊藤園	22,900	5,110.00	117,019,000	
キーコーヒー	6,900	2,058.00	14,200,200	
日清オイリオグループ	8,700	3,200.00	27,840,000	
不二製油グループ本社	14,300	2,052.00	29,343,600	
J・オイルミルズ	6,300	1,511.00	9,519,300	
ローソン	16,400	5,040.00	82,656,000	
サンエー	5,000	4,220.00	21,100,000	
カワチ薬品	5,200	2,155.00	11,206,000	
エービーシー・マート	9,600	7,040.00	67,584,000	
ハードオフコーポレーション	2,800	1,401.00	3,922,800	
高千穂交易	2,400	2,173.00	5,215,200	
アスクル	15,900	1,560.00	24,804,000	
ゲオホールディングス	6,900	2,004.00	13,827,600	
アダストリア	8,000	2,006.00	16,048,000	
伊藤忠食品	1,500	5,120.00	7,680,000	
くら寿司	7,700	3,340.00	25,718,000	
キャンドウ	2,300	2,188.00	5,032,400	
エレマテック	5,900	1,522.00	8,979,800	
パルグループホールディングス	6,500	2,421.00	15,736,500	
エディオン	26,200	1,263.00	33,090,600	
あらた	5,100	4,020.00	20,502,000	
サーラコーポレーション	13,900	698.00	9,702,200	
トーメンデバイス	1,000	5,480.00	5,480,000	
ハローズ	3,000	2,926.00	8,778,000	
J Pホールディングス	18,500	274.00	5,069,000	
フジオフードグループ本社	5,500	1,378.00	7,579,000	
あみやき亭	1,700	2,902.00	4,933,400	
東京エレクトロン デバイス	2,400	6,810.00	16,344,000	
円谷フィールズホールディングス	5,700	2,510.00	14,307,000	
双日	70,100	2,470.00	173,147,000	
アルフレッサ ホールディングス	66,300	1,617.00	107,207,100	
大黒天物産	2,400	5,200.00	12,480,000	
ハニーズホールディングス	5,900	1,270.00	7,493,000	
ファーマライズホールディングス	7,000	668.00	4,676,000	
キッコーマン	40,700	7,530.00	306,471,000	
味の素	150,500	4,486.00	675,143,000	
ブルドックソース	2,900	1,707.00	4,950,300	
キューピー	33,000	2,439.00	80,487,000	
ハウス食品グループ本社	18,800	2,757.00	51,831,600	
カゴメ	28,600	3,045.00	87,087,000	
アリアケジャパン	5,400	4,635.00	25,029,000	
エバラ食品工業	1,700	3,090.00	5,253,000	
ニチレイ	28,200	2,800.00	78,960,000	
横浜冷凍	18,000	1,017.00	18,306,000	
東洋水産	31,100	5,440.00	169,184,000	
イトアンドホールディングス	2,600	2,264.00	5,886,400	

ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,000	576.00	5,760,000	
日清食品ホールディングス	21,900	10,580.00	231,702,000	
永谷園ホールディングス	3,000	1,983.00	5,949,000	
一正蒲鉾	6,100	721.00	4,398,100	
フジッコ	6,300	1,869.00	11,774,700	
ロック・フィールド	7,500	1,476.00	11,070,000	
日本たばこ産業	404,800	2,824.00	1,143,155,200	
ケンコーマヨネーズ	4,200	1,561.00	6,556,200	
わらべや日洋ホールディングス	4,500	1,926.00	8,667,000	
なとり	3,900	2,038.00	7,948,200	
ファーマフーズ	9,500	1,492.00	14,174,000	
北の達人コーポレーション	26,400	295.00	7,788,000	
ユウグレナ	39,600	931.00	36,867,600	
紀文食品	5,400	947.00	5,113,800	
ピククルスホールディングス	4,600	1,069.00	4,917,400	
S R Eホールディングス	3,000	4,290.00	12,870,000	
A Dワークスグループ	20,200	154.00	3,110,800	
片倉工業	5,800	1,805.00	10,469,000	
グンゼ	4,700	4,005.00	18,823,500	
ヒューリック	143,500	1,139.00	163,446,500	
アルペン	5,400	2,057.00	11,107,800	
ラクーンホールディングス	6,200	1,196.00	7,415,200	
クオールホールディングス	9,100	1,162.00	10,574,200	
アルコニックス	8,700	1,323.00	11,510,100	
神戸物産	51,100	3,530.00	180,383,000	
ソリトンシステムズ	4,700	1,081.00	5,080,700	
ジーンズホールディングス	3,900	4,735.00	18,466,500	
ビックカメラ	43,900	1,292.00	56,718,800	
D C Mホールディングス	40,300	1,155.00	46,546,500	
ハイパー	4,500	507.00	2,281,500	
M o n o t a R O	93,700	2,213.00	207,358,100	
東京一番フーズ	8,200	490.00	4,018,000	
あい ホールディングス	10,600	2,168.00	22,980,800	
ディー・ブイエックス	4,700	968.00	4,549,600	
アークランドサービスホールディングス	5,400	2,218.00	11,977,200	
J . フロント リテイリング	82,100	1,164.00	95,564,400	
ドトール・日レスホールディングス	11,700	1,695.00	19,831,500	
マツキヨココカラ&カンパニー	40,100	6,240.00	250,224,000	
ブロンコビリー	3,500	2,493.00	8,725,500	
Z O Z O	43,700	3,365.00	147,050,500	
トレジャー・ファクトリー	700	2,494.00	1,745,800	
物語コーポレーション	3,700	6,410.00	23,717,000	
三越伊勢丹ホールディングス	111,200	1,300.00	144,560,000	
東洋紡	27,000	1,017.00	27,459,000	
ユニチカ	18,900	253.00	4,781,700	
富士紡ホールディングス	2,500	3,375.00	8,437,500	
日清紡ホールディングス	51,300	977.00	50,120,100	
倉敷紡績	4,700	2,204.00	10,358,800	
ダイワボウホールディングス	27,000	2,010.00	54,270,000	

日東紡績	7,500	2,036.00	15,270,000
トヨタ紡織	26,300	1,823.00	47,944,900
マクニカホールディングス	16,200	3,500.00	56,700,000
H a m e e	5,800	848.00	4,918,400
ラクト・ジャパン	2,500	2,073.00	5,182,500
ウエルシアホールディングス	34,300	3,100.00	106,330,000
クリエイトSDホールディングス	10,900	3,220.00	35,098,000
グリムス	2,700	1,881.00	5,078,700
パイタルケーエスケー・ホールディングス	9,700	821.00	7,963,700
八洲電機	5,300	1,019.00	5,400,700
メディアスホールディングス	6,900	758.00	5,230,200
レスターホールディングス	6,300	2,110.00	13,293,000
ジューテックホールディングス	4,500	1,162.00	5,229,000
丸善CHIホールディングス	12,700	329.00	4,178,300
OCHIホールディングス	3,900	1,226.00	4,781,400
TOKAIホールディングス	32,600	874.00	28,492,400
ミサワ	8,000	615.00	4,920,000
ティーライフ	3,400	1,294.00	4,399,600
C o m i n i x	6,600	725.00	4,785,000
三洋貿易	6,800	1,107.00	7,527,600
シュッピン	4,900	1,246.00	6,105,400
オイシックス・ラ・大地	8,900	1,925.00	17,132,500
ウイン・パートナーズ	5,000	990.00	4,950,000
ネクステージ	15,100	2,729.00	41,207,900
ジョイフル本田	21,300	1,876.00	39,958,800
鳥貴族ホールディングス	2,400	2,187.00	5,248,800
ホットランド	5,000	1,507.00	7,535,000
すかいらーくホールディングス	90,300	1,597.00	144,209,100
SFPホールディングス	3,600	1,733.00	6,238,800
綿半ホールディングス	5,100	1,327.00	6,767,700
日本毛織	18,200	986.00	17,945,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	21,500	1,100.00	23,650,000
三栄建築設計	3,300	1,521.00	5,019,300
野村不動産ホールディングス	38,400	3,110.00	119,424,000
三重交通グループホールディングス	13,200	482.00	6,362,400
サムティ	9,800	2,249.00	22,040,200
ディア・ライフ	9,300	608.00	5,654,400
コーセーアールイー	7,200	741.00	5,335,200
地主	4,700	1,970.00	9,259,000
プレサンスコーポレーション	8,100	1,535.00	12,433,500
ハウスコム	4,000	1,090.00	4,360,000
JPMC	4,800	1,022.00	4,905,600
サンセイランディック	5,700	852.00	4,856,400
エストラスト	8,700	597.00	5,193,900
フージャースホールディングス	9,500	745.00	7,077,500
オープンハウスグループ	22,500	5,610.00	126,225,000
東急不動産ホールディングス	184,900	695.00	128,505,500
飯田グループホールディングス	53,900	2,101.00	113,243,900

ムゲンエステート	10,100	487.00	4,918,700
帝国繊維	7,000	1,639.00	11,473,000
日本コークス工業	56,500	90.00	5,085,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,400	1,680.00	5,712,000
B E E N O S	3,700	2,559.00	9,468,300
あさひ	5,500	1,377.00	7,573,500
日本調剤	4,500	1,192.00	5,364,000
コスモス薬品	7,500	14,070.00	105,525,000
シップヘルスケアホールディングス	23,700	2,658.00	62,994,600
ソフトクリエイトホールディングス	2,600	3,320.00	8,632,000
セブン&アイ・ホールディングス	227,700	5,588.00	1,272,387,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	49,700	937.00	46,568,900
明治電機工業	4,700	1,043.00	4,902,100
ツルハホールディングス	16,200	9,490.00	153,738,000
サンマルクホールディングス	5,300	1,682.00	8,914,600
フェリシモ	4,400	1,006.00	4,426,400
トリドールホールディングス	16,400	2,731.00	44,788,400
帝人	60,100	1,300.00	78,130,000
東レ	419,100	723.40	303,176,940
クラレ	99,400	1,105.00	109,837,000
旭化成	390,600	999.00	390,209,400
T O K Y O B A S E	14,000	297.00	4,158,000
稲葉製作所	3,800	1,402.00	5,327,600
宮地エンジニアリンググループ	1,800	3,430.00	6,174,000
トーカロ	17,700	1,200.00	21,240,000
アルファ	4,700	937.00	4,403,900
S U M C O	122,700	2,001.00	245,522,700
川田テクノロジーズ	1,500	3,370.00	5,055,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,100	8,570.00	17,997,000
A n d D o ホールディングス	5,600	841.00	4,709,600
シーアールイー	3,400	1,366.00	4,644,400
ケイアイスター不動産	3,000	4,875.00	14,625,000
グッドコムアセット	7,000	725.00	5,075,000
ジェイ・エス・ビー	1,500	4,230.00	6,345,000
ロードスターキャピタル	3,100	1,752.00	5,431,200
日本フェルト	11,500	406.00	4,669,000
イチカワ	3,500	1,295.00	4,532,500
芦森工業	4,100	1,253.00	5,137,300
アツギ	10,200	387.00	3,947,400
J Mホールディングス	5,600	1,728.00	9,676,800
コメダホールディングス	16,200	2,437.00	39,479,400
アレンザホールディングス	5,100	984.00	5,018,400
パロックジャパンリミテッド	6,100	815.00	4,971,500
クスリのアオキホールディングス	6,600	8,160.00	53,856,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	37,900	2,845.00	107,825,500
アセンテック	9,400	493.00	4,634,200
セーレン	12,100	2,538.00	30,709,800
ソトー	5,800	835.00	4,843,000

東海染工	1,600	1,120.00	1,792,000
小松マテーレ	9,100	785.00	7,143,500
ワコールホールディングス	12,000	2,282.00	27,384,000
ホギメディカル	8,400	3,485.00	29,274,000
T S Iホールディングス	22,400	456.00	10,214,400
マツオカコーポレーション	5,300	1,059.00	5,612,700
ワールド	8,000	1,271.00	10,168,000
T I S	70,400	3,750.00	264,000,000
グリー	33,600	744.00	24,998,400
コーエーテクモホールディングス	39,200	2,424.00	95,020,800
三菱総合研究所	3,100	4,915.00	15,236,500
A G S	6,400	669.00	4,281,600
ファインデックス	8,000	525.00	4,200,000
ブレインパッド	6,200	842.00	5,220,400
K L a b	12,300	447.00	5,498,100
ポールトゥウィンホールディングス	10,700	858.00	9,180,600
ネクソン	161,800	3,030.00	490,254,000
アイスタイル	20,000	623.00	12,460,000
エムアップホールディングス	7,700	1,297.00	9,986,900
エイチーム	6,400	920.00	5,888,000
エニグモ	8,900	660.00	5,874,000
コロプラ	24,300	668.00	16,232,400
ブロードリーフ	36,600	439.00	16,067,400
クロス・マーケティンググループ	5,600	758.00	4,244,800
デジタルハーツホールディングス	3,900	1,928.00	7,519,200
システム情報	5,500	888.00	4,884,000
メディアドゥ	2,500	1,933.00	4,832,500
じげん	18,300	376.00	6,880,800
ブイキューブ	7,500	782.00	5,865,000
サイバーリンクス	3,700	1,019.00	3,770,300
フィックスターズ	7,100	1,313.00	9,322,300
C A R T A H O L D I N G S	3,000	1,667.00	5,001,000
オブティム	5,400	1,146.00	6,188,400
セレス	4,800	928.00	4,454,400
S H I F T	4,600	28,770.00	132,342,000
特種東海製紙	3,100	2,794.00	8,661,400
ティーガイア	6,500	1,638.00	10,647,000
テクマトリックス	11,400	1,724.00	19,653,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,200	2,130.00	40,896,000
G M Oペイメントゲートウェイ	14,300	12,390.00	177,177,000
インターネットイニシアティブ	34,900	2,474.00	86,342,600
さくらインターネット	9,200	515.00	4,738,000
G M Oグローバルサイン・ホールディングス	1,900	3,890.00	7,391,000
S R Aホールディングス	3,200	3,105.00	9,936,000
朝日ネット	8,300	573.00	4,755,900
e B A S E	8,800	592.00	5,209,600
アバントグループ	7,900	1,577.00	12,458,300
アドソル日進	3,400	1,464.00	4,977,600

フリービット	4,500	1,004.00	4,518,000
コムチュア	8,300	2,643.00	21,936,900
サイバーコム	600	1,495.00	897,000
アステリア	6,100	816.00	4,977,600
アイル	3,500	2,050.00	7,175,000
王子ホールディングス	260,600	536.00	139,681,600
日本製紙	32,600	970.00	31,622,000
三菱製紙	8,100	278.00	2,251,800
北越コーポレーション	39,500	788.00	31,126,000
大王製紙	27,600	1,032.00	28,483,200
阿波製紙	14,800	300.00	4,440,000
マークライNZ	3,400	2,788.00	9,479,200
メディカル・データ・ビジョン	9,300	998.00	9,281,400
g u m i	10,200	775.00	7,905,000
テラスカイ	2,700	2,721.00	7,346,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,300	1,953.00	6,444,900
P R T I M E S	2,100	2,486.00	5,220,600
ラクス	29,600	1,730.00	51,208,000
ランドコンピュータ	5,500	900.00	4,950,000
ダブルスタンダード	2,500	2,127.00	5,317,500
オープンドア	4,400	1,848.00	8,131,200
アカツキ	3,000	2,200.00	6,600,000
U b i c o mホールディングス	2,300	2,120.00	4,876,000
カナミックネットワーク	9,000	641.00	5,769,000
ノムラシステムコーポレーション	39,000	122.00	4,758,000
レンゴー	57,000	868.00	49,476,000
トーモク	3,600	1,576.00	5,673,600
ザ・バック	4,600	2,429.00	11,173,400
チェンジ	15,300	2,485.00	38,020,500
シンクロ・フード	200	440.00	88,000
オークネット	3,300	1,825.00	6,022,500
キャピタル・アセット・プランニング	7,600	572.00	4,347,200
マクロミル	14,200	1,041.00	14,782,200
ビーグリー	3,500	1,283.00	4,490,500
オロ	3,100	1,931.00	5,986,100
ユーザーローカル	3,100	1,590.00	4,929,000
マネーフォワード	15,100	4,620.00	69,762,000
昭和電工	60,400	2,221.00	134,148,400
住友化学	464,000	483.00	224,112,000
住友精化	2,600	4,180.00	10,868,000
日産化学	29,700	6,610.00	196,317,000
ラサ工業	2,400	1,976.00	4,742,400
クレハ	5,300	8,770.00	46,481,000
多木化学	2,400	4,880.00	11,712,000
テイカ	4,200	1,233.00	5,178,600
石原産業	11,300	1,122.00	12,678,600
片倉コープアグリ	3,900	1,601.00	6,243,900
日本曹達	6,700	4,115.00	27,570,500
東ソー	83,500	1,630.00	136,105,000

トクヤマ	20,200	1,860.00	37,572,000
セントラル硝子	10,000	3,250.00	32,500,000
東亜合成	32,200	1,130.00	36,386,000
大阪ソーダ	3,700	4,220.00	15,614,000
関東電化工業	12,100	985.00	11,918,500
デンカ	22,700	3,190.00	72,413,000
イビデン	36,200	5,530.00	200,186,000
信越化学工業	107,000	17,100.00	1,829,700,000
日本カーバイド工業	3,500	1,262.00	4,417,000
電算システムホールディングス	3,000	2,244.00	6,732,000
堺化学工業	4,800	1,810.00	8,688,000
第一稀元素化学工業	5,700	1,132.00	6,452,400
エア・ウォーター	59,000	1,563.00	92,217,000
日本酸素ホールディングス	60,700	2,181.00	132,386,700
日本化学工業	2,600	1,790.00	4,654,000
日本パーカライジング	31,000	949.00	29,419,000
高圧ガス工業	9,100	671.00	6,106,100
四国化成工業	7,400	1,302.00	9,634,800
ステラ ケミファ	3,700	2,558.00	9,464,600
保土谷化学工業	1,800	3,010.00	5,418,000
日本触媒	9,500	5,360.00	50,920,000
大日精化工業	4,300	1,716.00	7,378,800
カネカ	14,300	3,365.00	48,119,500
協和キリン	75,700	3,080.00	233,156,000
三菱瓦斯化学	46,700	1,911.00	89,243,700
三井化学	52,600	3,090.00	162,534,000
J S R	58,400	2,884.00	168,425,600
東京応化工業	10,900	6,730.00	73,357,000
大阪有機化学工業	4,700	2,091.00	9,827,700
三菱ケミカルグループ	422,100	718.30	303,194,430
K Hネオケム	10,400	2,800.00	29,120,000
ダイセル	92,000	1,008.00	92,736,000
住友ベークライト	9,300	4,240.00	39,432,000
積水化学工業	129,900	1,873.00	243,302,700
日本ゼオン	37,500	1,326.00	49,725,000
アイカ工業	15,800	3,250.00	51,350,000
U B E	32,200	1,950.00	62,790,000
積水樹脂	9,100	1,751.00	15,934,100
タキロンシーアイ	13,700	508.00	6,959,600
旭有機材	4,200	2,615.00	10,983,000
ニチバン	3,900	1,745.00	6,805,500
リケンテクノス	13,500	477.00	6,439,500
大倉工業	2,900	1,963.00	5,692,700
積水化成品工業	12,500	391.00	4,887,500
群栄化学工業	2,000	2,385.00	4,770,000
ダイキョーニシカワ	13,800	559.00	7,714,200
森六ホールディングス	3,200	1,733.00	5,545,600
恵和	2,000	3,395.00	6,790,000
日本化薬	47,800	1,177.00	56,260,600
カーリットホールディングス	7,200	707.00	5,090,400

CLホールディングス	5,700	810.00	4,617,000
プレステージ・インターナショナル	27,000	701.00	18,927,000
プロトコーポレーション	7,800	1,217.00	9,492,600
アミューズ	3,500	1,771.00	6,198,500
野村総合研究所	128,500	3,245.00	416,982,500
ドリームインキュベータ	2,100	2,776.00	5,829,600
サイバネットシステム	5,200	911.00	4,737,200
クイック	4,900	2,000.00	9,800,000
TAC	22,800	210.00	4,788,000
CEホールディングス	9,700	576.00	5,587,200
電通グループ	67,300	4,225.00	284,342,500
インテージホールディングス	8,500	1,399.00	11,891,500
ぴあ	2,200	3,220.00	7,084,000
イオンファンタジー	2,800	2,966.00	8,304,800
ソースネクスト	31,800	292.00	9,285,600
シーティーエス	7,100	842.00	5,978,200
インフォコム	8,100	1,999.00	16,191,900
メディカルシステムネットワーク	11,800	413.00	4,873,400
日本精化	3,600	2,343.00	8,434,800
扶桑化学工業	5,800	3,490.00	20,242,000
トリケミカル研究所	8,300	2,299.00	19,081,700
シンプレクス・ホールディングス	10,500	2,268.00	23,814,000
HEROZ	4,400	1,122.00	4,936,800
ラクスル	8,800	3,055.00	26,884,000
メルカリ	28,200	2,887.00	81,413,400
IPS	2,000	2,925.00	5,850,000
FIG	12,000	449.00	5,388,000
ADEKA	21,800	2,203.00	48,025,400
日油	19,300	5,610.00	108,273,000
ミヨシ油脂	3,300	995.00	3,283,500
新日本理化	5,800	238.00	1,380,400
ハリマ化成グループ	5,800	832.00	4,825,600
イーソル	7,600	883.00	6,710,800
アルテリア・ネットワークス	5,800	1,234.00	7,157,200
ウイングアーク1st	6,400	2,250.00	14,400,000
サーバーワークス	1,900	2,567.00	4,877,300
トピラシステムズ	4,900	918.00	4,498,200
Sansan	23,400	1,623.00	37,978,200
ギフトィ	6,700	2,303.00	15,430,100
花王	152,300	5,471.00	833,233,300
第一工業製薬	2,600	1,930.00	5,018,000
石原ケミカル	3,900	1,245.00	4,855,500
日華化学	5,500	868.00	4,774,000
三洋化成工業	3,800	4,125.00	15,675,000
ベース	2,100	3,690.00	7,749,000
JMDC	10,300	5,040.00	51,912,000
武田薬品工業	554,200	4,051.00	2,245,064,200
アステラス製薬	600,200	2,129.00	1,277,825,800
住友ファーマ	46,500	1,049.00	48,778,500
塩野義製薬	80,000	6,863.00	549,040,000

わかもと製薬	5,400	235.00	1,269,000	
日本新薬	14,800	7,870.00	116,476,000	
中外製薬	196,000	3,614.00	708,344,000	
科研製薬	10,700	3,855.00	41,248,500	
エーザイ	76,200	9,580.00	729,996,000	
理研ビタミン	5,300	1,752.00	9,285,600	
ロート製薬	30,300	4,465.00	135,289,500	
小野薬品工業	120,800	3,423.00	413,498,400	
久光製薬	13,900	3,860.00	53,654,000	
有機合成薬品工業	15,800	298.00	4,708,400	
持田製薬	7,500	3,360.00	25,200,000	
参天製薬	121,600	1,135.00	138,016,000	
扶桑薬品工業	2,400	1,993.00	4,783,200	
ツムラ	19,700	2,964.00	58,390,800	
テルモ	195,100	3,997.00	779,814,700	
H・U・グループホールディングス	18,800	2,751.00	51,718,800	
キッセイ薬品工業	9,700	2,502.00	24,269,400	
生化学工業	11,900	949.00	11,293,100	
栄研化学	10,200	1,854.00	18,910,800	
鳥居薬品	3,400	2,850.00	9,690,000	
JCRファーマ	21,200	1,885.00	39,962,000	
東和薬品	9,600	2,119.00	20,342,400	
富士製薬工業	4,500	997.00	4,486,500	
ゼリア新薬工業	8,700	2,246.00	19,540,200	
第一三共	545,600	4,373.00	2,385,908,800	
キョーリン製薬ホールディングス	13,600	1,729.00	23,514,400	
大幸薬品	11,400	465.00	5,301,000	
ダイト	4,700	2,474.00	11,627,800	
大塚ホールディングス	143,300	4,561.00	653,591,300	
大正製薬ホールディングス	13,900	5,410.00	75,199,000	
ペプチドリーム	30,400	1,692.00	51,436,800	
大日本塗料	7,600	754.00	5,730,400	
日本ペイントホールディングス	276,800	1,189.00	329,115,200	
関西ペイント	57,300	1,764.00	101,077,200	
中国塗料	11,600	980.00	11,368,000	
藤倉化成	12,300	410.00	5,043,000	
太陽ホールディングス	9,500	2,445.00	23,227,500	
D I C	24,400	2,438.00	59,487,200	
サカタイクス	13,900	1,085.00	15,081,500	
東洋インキS Cホールディングス	12,200	1,843.00	22,484,600	
T & K T O K A	5,600	1,124.00	6,294,400	
アルプス技研	5,600	2,105.00	11,788,000	
日本空調サービス	6,900	693.00	4,781,700	
オリエンタルランド	67,900	19,595.00	1,330,500,500	
フォーカスシステムズ	4,800	994.00	4,771,200	
ダスキン	14,300	2,960.00	42,328,000	
パーク24	47,900	1,983.00	94,985,700	
明光ネットワークジャパン	8,400	618.00	5,191,200	
ファルコホールディングス	2,900	1,737.00	5,037,300	
クレスコ	4,800	1,746.00	8,380,800	

フジ・メディア・ホールディングス	60,200	1,071.00	64,474,200	
秀英予備校	11,100	440.00	4,884,000	
ラウンドワン	53,700	513.00	27,548,100	
リゾートトラスト	25,300	2,407.00	60,897,100	
オービック	20,900	20,760.00	433,884,000	
ジャストシステム	9,000	3,115.00	28,035,000	
TDCソフト	5,300	1,474.00	7,812,200	
Zホールディングス	891,300	361.50	322,204,950	
ビー・エム・エル	8,000	3,370.00	26,960,000	
トレンドマイクロ	36,200	6,550.00	237,110,000	
りらいあコミュニケーションズ	10,600	1,011.00	10,716,600	
IDホールディングス	5,300	904.00	4,791,200	
リソー教育	29,200	345.00	10,074,000	
日本オラクル	12,000	8,070.00	96,840,000	
早稲田アカデミー	4,300	1,105.00	4,751,500	
アルファシステムズ	2,000	4,180.00	8,360,000	
フューチャー	15,600	1,624.00	25,334,400	
CAC Holdings	3,800	1,526.00	5,798,800	
SBテクノロジー	2,700	1,973.00	5,327,100	
トーセ	6,200	754.00	4,674,800	
ユー・エス・エス	66,000	2,179.00	143,814,000	
オービックビジネスコンサルタント	12,300	4,350.00	53,505,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	33,600	3,200.00	107,520,000	
アイティフォー	8,200	827.00	6,781,400	
東京個別指導学院	9,300	530.00	4,929,000	
東計電算	900	5,660.00	5,094,000	
サイバーエージェント	153,600	1,219.00	187,238,400	
楽天グループ	296,900	635.00	188,531,500	
エクスネット	4,800	999.00	4,795,200	
クリーク・アンド・リバー社	3,800	1,995.00	7,581,000	
モーニングスター	10,700	457.00	4,889,900	
テー・オー・ダブリュー	15,700	294.00	4,615,800	
大塚商会	35,500	4,325.00	153,537,500	
サイボウズ	8,600	2,441.00	20,992,600	
山田コンサルティンググループ	4,200	1,146.00	4,813,200	
セントラルスポーツ	2,400	2,367.00	5,680,800	
電通国際情報サービス	7,600	4,270.00	32,452,000	
ACCESS	7,400	900.00	6,660,000	
デジタルガレージ	11,100	4,375.00	48,562,500	
イーエムシステムズ	10,400	882.00	9,172,800	
ウェザーニューズ	2,200	7,360.00	16,192,000	
CIJ	6,000	918.00	5,508,000	
日本エンタープライズ	30,300	141.00	4,272,300	
WOWOW	4,000	1,225.00	4,900,000	
スカラ	6,600	745.00	4,917,000	
フルキャストホールディングス	6,100	2,997.00	18,281,700	
エン・ジャパン	11,600	2,289.00	26,552,400	
あすか製薬ホールディングス	6,500	1,225.00	7,962,500	
サワイグループホールディングス	14,300	4,090.00	58,487,000	
富士フイルムホールディングス	120,200	7,018.00	843,563,600	

コニカミノルタ	140,900	557.00	78,481,300
資生堂	130,800	6,562.00	858,309,600
ライオン	75,100	1,466.00	110,096,600
高砂香料工業	4,200	2,703.00	11,352,600
マンダム	13,500	1,436.00	19,386,000
ミルボン	9,300	5,570.00	51,801,000
ファンケル	27,400	2,579.00	70,664,600
コーセー	12,700	15,250.00	193,675,000
コタ	5,200	1,700.00	8,840,000
シーボン	2,900	1,591.00	4,613,900
ポーラ・オルビスホールディングス	32,100	1,881.00	60,380,100
ノエビアホールディングス	5,600	5,790.00	32,424,000
アジュバンホールディングス	5,000	948.00	4,740,000
新日本製薬	3,600	1,390.00	5,004,000
エステー	4,800	1,506.00	7,228,800
アグロ カネショウ	3,600	1,740.00	6,264,000
コニシ	10,500	1,694.00	17,787,000
長谷川香料	13,000	3,115.00	40,495,000
星光PMC	8,900	533.00	4,743,700
小林製薬	19,200	8,240.00	158,208,000
荒川化学工業	5,300	999.00	5,294,700
メック	5,200	2,411.00	12,537,200
日本高純度化学	2,100	2,584.00	5,426,400
タカラバイオ	16,900	1,805.00	30,504,500
JCU	7,100	3,295.00	23,394,500
新田ゼラチン	500	975.00	487,500
OATアグリオ	2,800	1,626.00	4,552,800
デクセリアルズ	18,100	3,065.00	55,476,500
アース製薬	5,700	5,250.00	29,925,000
北興化学工業	6,300	860.00	5,418,000
大成ラミック	2,000	3,130.00	6,260,000
クミアイ化学工業	24,900	887.00	22,086,300
日本農薬	11,500	715.00	8,222,500
ニチレキ	7,400	1,251.00	9,257,400
ユシロ化学工業	6,000	814.00	4,884,000
富士石油	15,800	252.00	3,981,600
MORESCO	900	1,137.00	1,023,300
出光興産	69,600	3,075.00	214,020,000
ENEOSホールディングス	1,131,500	446.10	504,762,150
コスモエネルギーホールディングス	23,800	3,855.00	91,749,000
テスホールディングス	6,600	1,085.00	7,161,000
インフロニア・ホールディングス	64,200	1,026.00	65,869,200
横浜ゴム	35,600	2,220.00	79,032,000
TOYO TIRE	36,000	1,556.00	56,016,000
ブリヂストン	200,000	5,061.00	1,012,200,000
住友ゴム工業	61,400	1,174.00	72,083,600
藤倉コンポジット	2,600	823.00	2,139,800
オカモト	3,500	3,730.00	13,055,000
アキレス	4,100	1,280.00	5,248,000
フコク	4,800	1,068.00	5,126,400

ニッタ	6,400	2,910.00	18,624,000
住友理工	12,100	588.00	7,114,800
三ツ星ベルト	9,100	3,395.00	30,894,500
バンドー化学	9,900	991.00	9,810,900
A G C	63,700	4,575.00	291,427,500
日本板硝子	31,900	612.00	19,522,800
有沢製作所	10,200	1,317.00	13,433,400
日本電気硝子	25,600	2,504.00	64,102,400
オハラ	3,900	1,207.00	4,707,300
住友大阪セメント	8,800	3,150.00	27,720,000
太平洋セメント	39,900	2,082.00	83,071,800
日本ヒューム	7,800	643.00	5,015,400
日本コンクリート工業	20,300	226.00	4,587,800
三谷セキサン	2,600	3,975.00	10,335,000
アジアパイルホールディングス	9,800	523.00	5,125,400
東海カーボン	52,500	1,135.00	59,587,500
日本カーボン	3,600	4,360.00	15,696,000
東洋炭素	3,900	3,945.00	15,385,500
ノリタケカンパニーリミテド	3,100	4,005.00	12,415,500
T O T O	41,300	4,830.00	199,479,000
日本碍子	74,100	1,794.00	132,935,400
日本特殊陶業	47,700	2,561.00	122,159,700
M A R U W A	2,300	17,520.00	40,296,000
品川リフラクトリーズ	1,800	3,885.00	6,993,000
黒崎播磨	1,300	4,870.00	6,331,000
ヨータイ	4,200	1,398.00	5,871,600
ニッカトー	5,200	482.00	2,506,400
フジインコーポレーテッド	5,000	7,330.00	36,650,000
クニミネ工業	3,100	862.00	2,672,200
ニチアス	15,800	2,431.00	38,409,800
日本製鉄	288,500	2,241.00	646,528,500
神戸製鋼所	129,600	616.00	79,833,600
中山製鋼所	13,300	736.00	9,788,800
合同製鐵	3,200	1,950.00	6,240,000
J F E ホールディングス	172,200	1,551.00	267,082,200
東京製鐵	18,100	1,273.00	23,041,300
共英製鋼	7,300	1,226.00	8,949,800
大和工業	10,600	4,570.00	48,442,000
東京鐵鋼	3,400	1,398.00	4,753,200
大阪製鐵	4,400	1,078.00	4,743,200
淀川製鋼所	7,300	2,497.00	18,228,100
丸一鋼管	19,600	2,777.00	54,429,200
大同特殊鋼	8,100	4,420.00	35,802,000
日本高周波鋼業	15,200	313.00	4,757,600
日本冶金工業	4,700	4,265.00	20,045,500
山陽特殊製鋼	6,400	2,150.00	13,760,000
愛知製鋼	3,700	2,208.00	8,169,600
日立金属	60,100	2,178.00	130,897,800
大平洋金属	4,600	2,041.00	9,388,600
新日本電工	41,200	385.00	15,862,000

栗本鐵工所	3,100	1,752.00	5,431,200
日本製鋼所	17,400	2,850.00	49,590,000
三菱製鋼	5,000	1,007.00	5,035,000
日亜鋼業	18,500	233.00	4,310,500
日本精線	1,200	4,250.00	5,100,000
エンビプロ・ホールディングス	300	714.00	214,200
大紀アルミニウム工業所	9,200	1,294.00	11,904,800
日本軽金属ホールディングス	17,400	1,543.00	26,848,200
三井金属鉱業	18,700	3,180.00	59,466,000
東邦亜鉛	3,800	2,192.00	8,329,600
三菱マテリアル	43,000	2,231.00	95,933,000
住友金属鉱山	74,700	4,799.00	358,485,300
DOWAホールディングス	14,500	4,380.00	63,510,000
古河機械金属	9,400	1,287.00	12,097,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	9,500	4,195.00	39,852,500
東邦チタニウム	11,700	2,814.00	32,923,800
UACJ	9,000	2,307.00	20,763,000
CKサンエツ	1,600	4,075.00	6,520,000
古河電気工業	21,500	2,634.00	56,631,000
住友電気工業	222,500	1,580.00	351,550,000
フジクラ	69,100	1,122.00	77,530,200
昭和電線ホールディングス	7,200	1,775.00	12,780,000
東京特殊電線	1,200	5,650.00	6,780,000
タツタ電線	13,200	426.00	5,623,200
平河ヒューテック	4,300	1,137.00	4,889,100
いよぎんホールディングス	73,200	656.00	48,019,200
しずおかフィナンシャルグループ	139,000	959.00	133,301,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	51,800	933.00	48,329,400
リョービ	6,900	1,204.00	8,307,600
アーレスティ	7,800	417.00	3,252,600
アサヒホールディングス	26,100	2,004.00	52,304,400
東洋製罐グループホールディングス	42,600	1,607.00	68,458,200
ホッカンホールディングス	3,700	1,304.00	4,824,800
コロナ	5,700	869.00	4,953,300
横河ブリッジホールディングス	8,500	1,880.00	15,980,000
三和ホールディングス	59,300	1,259.00	74,658,700
文化シャッター	18,500	1,089.00	20,146,500
三協立山	8,800	551.00	4,848,800
アルインコ	5,000	1,010.00	5,050,000
LIXIL	93,900	2,065.00	193,903,500
日本ファイルコン	9,800	451.00	4,419,800
ノーリツ	9,500	1,491.00	14,164,500
長府製作所	6,500	1,956.00	12,714,000
リンナイ	11,700	10,100.00	118,170,000
ユニプレス	11,200	807.00	9,038,400
ダイニチ工業	7,200	670.00	4,824,000
日東精工	9,300	518.00	4,817,400
三洋工業	2,900	1,732.00	5,022,800
岡部	10,400	715.00	7,436,000
ジーテクト	7,200	1,455.00	10,476,000

東ブレ	11,400	1,198.00	13,657,200
高周波熱錬	10,500	678.00	7,119,000
東京製綱	5,400	846.00	4,568,400
サンコール	2,500	629.00	1,572,500
モリテックスチール	7,200	235.00	1,692,000
パイオラックス	8,900	1,680.00	14,952,000
エイチワン	7,900	622.00	4,913,800
日本発条	57,000	892.00	50,844,000
三浦工業	26,300	3,205.00	84,291,500
タクマ	19,400	1,275.00	24,735,000
テクノプロ・ホールディングス	43,000	3,775.00	162,325,000
インターワークス	12,900	369.00	4,760,100
アイ・アールジャパンホールディングス	3,300	1,817.00	5,996,100
Keeper 技研	4,600	4,010.00	18,446,000
三機サービス	4,800	933.00	4,478,400
イー・ガーディアン	2,400	2,731.00	6,554,400
リブセンス	1,800	301.00	541,800
ジャパンマテリアル	19,600	2,399.00	47,020,400
ベクトル	10,100	1,290.00	13,029,000
ウチヤマホールディングス	15,900	277.00	4,404,300
チャーム・ケア・コーポレーション	5,300	1,186.00	6,285,800
キャリアリンク	2,400	3,115.00	7,476,000
IBJ	5,000	951.00	4,755,000
アサンテ	3,200	1,600.00	5,120,000
パリュール	5,600	1,672.00	9,363,200
M&Aキャピタルパートナーズ	5,900	4,695.00	27,700,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,700	1,118.00	5,254,600
シグマクシス・ホールディングス	9,700	1,316.00	12,765,200
ウィルグループ	5,300	1,288.00	6,826,400
メドピア	5,000	1,568.00	7,840,000
リクルートホールディングス	475,200	4,308.00	2,047,161,600
エラン	8,500	976.00	8,296,000
ツガミ	14,000	1,255.00	17,570,000
オークマ	6,300	5,040.00	31,752,000
芝浦機械	7,000	2,608.00	18,256,000
アマダ	100,600	1,073.00	107,943,800
アイダエンジニアリング	13,000	804.00	10,452,000
TAKISAWA	4,000	1,080.00	4,320,000
FUJI	27,400	2,088.00	57,211,200
牧野フライス製作所	7,000	4,505.00	31,535,000
オーエスジー	30,100	1,961.00	59,026,100
ダイジェット工業	5,300	820.00	4,346,000
旭ダイヤモンド工業	18,200	691.00	12,576,200
DMG森精機	38,200	1,775.00	67,805,000
ソディック	17,400	749.00	13,032,600
ディスコ	10,100	40,650.00	410,565,000
日東工器	3,100	1,519.00	4,708,900
日進工具	5,300	1,085.00	5,750,500

パンチ工業	10,500	410.00	4,305,000
日本郵政	841,300	1,043.00	877,475,900
ベルシステム24ホールディングス	8,600	1,340.00	11,524,000
鎌倉新書	7,300	995.00	7,263,500
S MN	8,300	489.00	4,058,700
エアトリ	4,100	2,602.00	10,668,200
アトラエ	5,000	1,422.00	7,110,000
ストライク	3,200	4,655.00	14,896,000
ソラスト	17,700	771.00	13,646,700
インソース	8,000	3,005.00	24,040,000
豊田自動織機	45,700	7,620.00	348,234,000
東洋機械金属	7,200	550.00	3,960,000
エンシュウ	5,600	691.00	3,869,600
島精機製作所	10,000	1,987.00	19,870,000
オプトラン	9,300	2,461.00	22,887,300
NCホールディングス	2,200	2,019.00	4,441,800
イワキ	4,200	1,244.00	5,224,800
フリー	6,600	1,207.00	7,966,200
ヤマシンフィルタ	15,000	495.00	7,425,000
日阪製作所	6,100	816.00	4,977,600
やまびこ	10,300	1,132.00	11,659,600
野村マイクロ・サイエンス	2,100	4,625.00	9,712,500
平田機工	3,000	5,480.00	16,440,000
ベガサスミシン製造	7,000	892.00	6,244,000
マルマエ	3,000	1,798.00	5,394,000
タツモ	3,500	1,658.00	5,803,000
ナブテスコ	39,600	3,495.00	138,402,000
三井海洋開発	7,900	1,390.00	10,981,000
レオン自動機	6,600	1,115.00	7,359,000
S M C	20,500	62,610.00	1,283,505,000
ホソカワミクロン	4,800	2,836.00	13,612,800
ユニオンツール	2,800	3,575.00	10,010,000
オイレス工業	8,800	1,463.00	12,874,400
日精エー・エス・ビー機械	2,900	4,750.00	13,775,000
サトーホールディングス	9,000	1,876.00	16,884,000
技研製作所	6,600	3,145.00	20,757,000
日本エアーテック	4,300	1,222.00	5,254,600
カワタ	4,900	838.00	4,106,200
日精樹脂工業	5,000	973.00	4,865,000
小松製作所	295,500	3,107.00	918,118,500
住友重機械工業	37,300	2,880.00	107,424,000
日立建機	25,100	3,120.00	78,312,000
日工	9,300	611.00	5,682,300
巴工業	2,700	2,385.00	6,439,500
井関農機	5,900	1,234.00	7,280,600
T O W A	6,400	1,945.00	12,448,000
北川鉄工所	3,800	1,200.00	4,560,000
シンニッタン	14,800	222.00	3,285,600
ローツェ	3,300	8,290.00	27,357,000
タカキタ	9,600	466.00	4,473,600

クボタ	333,700	2,004.00	668,734,800
荏原実業	3,100	2,313.00	7,170,300
三菱化工機	2,300	2,040.00	4,692,000
月島機械	8,500	958.00	8,143,000
帝国電機製作所	4,800	2,274.00	10,915,200
新東工業	12,700	654.00	8,305,800
澁谷工業	5,900	2,446.00	14,431,400
アイチコーポレーション	8,900	773.00	6,879,700
小森コーポレーション	14,600	812.00	11,855,200
鶴見製作所	4,800	1,967.00	9,441,600
荏原製作所	25,800	5,120.00	132,096,000
石井鐵工所	1,700	2,460.00	4,182,000
西島製作所	5,400	1,548.00	8,359,200
北越工業	6,300	1,159.00	7,301,700
ダイキン工業	75,300	21,980.00	1,655,094,000
オルガノ	8,700	2,962.00	25,769,400
トーヨーカネツ	2,400	2,491.00	5,978,400
栗田工業	35,300	5,840.00	206,152,000
椿本チエイン	8,900	3,040.00	27,056,000
大同工業	3,900	738.00	2,878,200
日機装	15,600	1,006.00	15,693,600
木村化工機	6,700	724.00	4,850,800
レイズネクスト	8,900	1,232.00	10,964,800
アネスト岩田	10,700	900.00	9,630,000
ダイフク	32,500	6,860.00	222,950,000
サムコ	2,100	3,735.00	7,843,500
加藤製作所	6,000	752.00	4,512,000
タダノ	33,300	967.00	32,201,100
フジテック	23,100	3,300.00	76,230,000
C K D	17,400	2,017.00	35,095,800
キトー	5,400	2,718.00	14,677,200
平和	21,000	2,427.00	50,967,000
理想科学工業	5,600	2,223.00	12,448,800
SANKYO	12,400	5,300.00	65,720,000
日本金銭機械	6,900	1,164.00	8,031,600
マースグループホールディングス	3,700	2,306.00	8,532,200
フクシマガリレイ	4,600	4,295.00	19,757,000
ダイコク電機	3,500	1,795.00	6,282,500
竹内製作所	11,400	2,978.00	33,949,200
アマノ	17,900	2,407.00	43,085,300
JUKI	9,800	673.00	6,595,400
ジャノメ	7,600	602.00	4,575,200
ブラザー工業	84,300	2,100.00	177,030,000
マックス	7,800	1,992.00	15,537,600
モリタホールディングス	11,000	1,137.00	12,507,000
グローリー	16,300	2,231.00	36,365,300
新晃工業	6,400	1,477.00	9,452,800
大和冷機工業	9,700	1,155.00	11,203,500
セガサミーホールディングス	50,700	1,831.00	92,831,700
リケン	2,500	2,228.00	5,570,000

T P R	7,400	1,203.00	8,902,200
ツバキ・ナカシマ	15,500	1,013.00	15,701,500
ホシザキ	40,600	4,585.00	186,151,000
大豊工業	6,700	667.00	4,468,900
日本精工	115,900	728.00	84,375,200
N T N	124,300	283.00	35,176,900
ジェイテクト	56,100	953.00	53,463,300
不二越	4,700	3,795.00	17,836,500
ミネベアミツミ	109,700	2,202.00	241,559,400
日本トムソン	15,400	579.00	8,916,600
T H K	36,400	2,658.00	96,751,200
ユーシン精機	7,100	670.00	4,757,000
前澤給装工業	5,300	991.00	5,252,300
イーグル工業	7,000	1,048.00	7,336,000
日本ピラー工業	5,800	2,854.00	16,553,200
キッツ	23,200	819.00	19,000,800
日立製作所	316,700	7,051.00	2,233,051,700
東芝	121,400	4,642.00	563,538,800
三菱電機	651,800	1,364.50	889,381,100
富士電機	38,300	5,580.00	213,714,000
東洋電機製造	5,300	863.00	4,573,900
安川電機	74,700	4,625.00	345,487,500
シンフォニア テクノロジー	7,000	1,470.00	10,290,000
明電舎	9,600	1,934.00	18,566,400
オリジン	1,600	1,245.00	1,992,000
山洋電気	2,700	6,040.00	16,308,000
デンヨー	4,800	1,544.00	7,411,200
P H C ホールディングス	8,800	1,580.00	13,904,000
ベイカレント・コンサルティング	50,800	4,800.00	243,840,000
Orchestra Holdings	1,900	2,006.00	3,811,400
アイモバイル	4,000	1,172.00	4,688,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	22,800	1,696.00	38,668,800
G A M E W I T H	10,800	367.00	3,963,600
ウェルビー	5,700	782.00	4,457,400
ミダックホールディングス	3,900	2,835.00	11,056,500
キュービーネットホールディングス	3,600	1,434.00	5,162,400
R P A ホールディングス	17,300	276.00	4,774,800
三櫻工業	9,500	635.00	6,032,500
マキタ	78,500	3,155.00	247,667,500
東芝テック	9,400	3,570.00	33,558,000
芝浦メカトロニクス	1,200	10,840.00	13,008,000
マブチモーター	15,700	3,885.00	60,994,500
日本電産	153,200	8,246.00	1,263,287,200
トレックス・セミコンダクター	3,000	2,860.00	8,580,000
東光高岳	3,800	1,789.00	6,798,200
ダブル・スコープ	20,600	1,635.00	33,681,000
ダイヘン	5,700	4,035.00	22,999,500
ヤーマン	12,300	1,347.00	16,568,100

JVCケンウッド	57,400	417.00	23,935,800
I-PEX	3,600	1,288.00	4,636,800
日新電機	15,100	1,292.00	19,509,200
大崎電気工業	15,000	531.00	7,965,000
オムロン	57,800	6,988.00	403,906,400
日東工業	8,500	2,303.00	19,575,500
IDEC	9,300	3,145.00	29,248,500
不二電機工業	4,100	1,127.00	4,620,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	20,700	2,094.00	43,345,800
サクサホールディングス	3,800	1,271.00	4,829,800
メルコホールディングス	1,700	3,035.00	5,159,500
日本電気	89,200	4,660.00	415,672,000
富士通	62,800	18,495.00	1,161,486,000
沖電気工業	28,500	708.00	20,178,000
岩崎通信機	6,000	767.00	4,602,000
電気興業	3,000	2,053.00	6,159,000
サンケン電気	5,900	6,930.00	40,887,000
アイホン	3,800	1,873.00	7,117,400
ルネサスエレクトロニクス	411,300	1,295.50	532,839,150
セイコーエプソン	84,000	2,091.00	175,644,000
ワコム	50,000	631.00	31,550,000
アルバック	15,000	6,090.00	91,350,000
EIZO	4,600	3,370.00	15,502,000
ジャパンディスプレイ	242,200	46.00	11,141,200
日本信号	14,400	1,022.00	14,716,800
京三製作所	13,200	416.00	5,491,200
能美防災	8,500	1,563.00	13,285,500
ホーチキ	4,700	1,416.00	6,655,200
星和電機	10,400	447.00	4,648,800
エレコム	15,100	1,424.00	21,502,400
パナソニック ホールディングス	745,000	1,222.00	910,390,000
シャープ	75,900	1,041.00	79,011,900
アンリツ	44,400	1,434.00	63,669,600
富士通ゼネラル	17,900	3,170.00	56,743,000
ソニーグループ	441,700	10,875.00	4,803,487,500
TDK	99,900	4,775.00	477,022,500
帝国通信工業	3,200	1,379.00	4,412,800
タムラ製作所	27,100	809.00	21,923,900
アルプスアルパイン	56,300	1,305.00	73,471,500
池上通信機	8,000	536.00	4,288,000
日本電波工業	7,600	1,818.00	13,816,800
メイコー	6,900	2,938.00	20,272,200
ローランド ディー・ジー	3,500	3,035.00	10,622,500
フォスター電機	6,000	910.00	5,460,000
SMK	1,800	2,360.00	4,248,000
ヨコオ	5,000	2,437.00	12,185,000
ホシデン	15,100	1,575.00	23,782,500
ヒロセ電機	10,400	17,770.00	184,808,000
日本航空電子工業	12,900	2,262.00	29,179,800
TOA	7,300	779.00	5,686,700

マクセル	13,700	1,415.00	19,385,500
古野電気	8,200	1,012.00	8,298,400
スミダコーポレーション	5,800	1,531.00	8,879,800
アイコム	2,400	2,800.00	6,720,000
リオン	2,600	1,925.00	5,005,000
横河電機	69,000	2,421.00	167,049,000
新電元工業	2,400	3,150.00	7,560,000
アズビル	43,600	3,840.00	167,424,000
東亜ディーケーケー	5,400	824.00	4,449,600
日本光電工業	28,800	3,160.00	91,008,000
共和電業	11,800	368.00	4,342,400
日本電子材料	4,100	1,497.00	6,137,700
堀場製作所	13,900	6,240.00	86,736,000
アドバンテスト	49,200	9,810.00	482,652,000
小野測器	11,300	399.00	4,508,700
エスベック	5,000	1,974.00	9,870,000
キーエンス	62,500	55,950.00	3,496,875,000
日置電機	3,300	6,640.00	21,912,000
シスメックス	53,900	8,879.00	478,578,100
日本マイクロニクス	10,300	1,426.00	14,687,800
メガチップス	5,100	2,580.00	13,158,000
OBARA GROUP	2,900	3,520.00	10,208,000
澤藤電機	3,300	1,141.00	3,765,300
デンソー	128,800	7,255.00	934,444,000
原田工業	5,500	842.00	4,631,000
コーセル	8,300	900.00	7,470,000
イリソ電子工業	5,700	4,485.00	25,564,500
オブテックスグループ	11,500	2,032.00	23,368,000
千代田インテグレ	2,500	2,379.00	5,947,500
レーザーテック	30,800	25,910.00	798,028,000
スタンレー電気	44,400	2,759.00	122,499,600
岩崎電気	2,000	2,420.00	4,840,000
ウシオ電機	32,600	1,791.00	58,386,600
岡谷電機産業	100	270.00	27,000
日本セラミック	6,400	2,596.00	16,614,400
遠藤照明	6,300	724.00	4,561,200
古河電池	4,600	1,108.00	5,096,800
山一電機	5,400	1,751.00	9,455,400
図研	5,400	3,210.00	17,334,000
日本電子	15,600	4,265.00	66,534,000
カシオ計算機	46,500	1,348.00	62,682,000
ファナック	61,300	21,080.00	1,292,204,000
日本シイエムケイ	13,300	526.00	6,995,800
エンプラス	1,800	4,405.00	7,929,000
大真空	7,600	791.00	6,011,600
ローム	28,900	10,640.00	307,496,000
浜松ホトニクス	50,100	7,070.00	354,207,000
三井ハイテック	6,500	7,220.00	46,930,000
新光電気工業	22,100	3,770.00	83,317,000
京セラ	97,000	6,892.00	668,524,000

太陽誘電	30,400	4,355.00	132,392,000
村田製作所	189,400	7,354.00	1,392,847,600
双葉電子工業	11,900	567.00	6,747,300
日東電工	45,500	8,430.00	383,565,000
北陸電気工業	4,300	1,259.00	5,413,700
東海理化電機製作所	17,600	1,466.00	25,801,600
ニチコン	12,800	1,331.00	17,036,800
日本ケミコン	6,200	1,730.00	10,726,000
K O A	9,500	2,046.00	19,437,000
三井E & Sホールディングス	28,500	394.00	11,229,000
日立造船	51,700	828.00	42,807,600
三菱重工業	110,300	5,436.00	599,590,800
川崎重工業	47,100	3,095.00	145,774,500
I H I	39,700	3,870.00	153,639,000
名村造船所	16,000	449.00	7,184,000
マネジメントソリューションズ	3,500	3,565.00	12,477,500
プロレド・パートナーズ	9,400	522.00	4,906,800
and factory	11,700	361.00	4,223,700
カーブスホールディングス	19,700	945.00	18,616,500
フォーラムエンジニアリング	5,700	863.00	4,919,100
日本車輛製造	2,500	1,932.00	4,830,000
三菱ロジスネクスト	10,000	840.00	8,400,000
フルサト・マルカホールディングス	6,600	3,605.00	23,793,000
ヤマエグループホールディングス	3,700	1,462.00	5,409,400
F P G	25,000	1,131.00	28,275,000
島根銀行	9,900	443.00	4,385,700
じもとホールディングス	8,400	393.00	3,301,200
全国保証	16,100	5,030.00	80,983,000
めぶきフィナンシャルグループ	305,200	296.00	90,339,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,000	1,216.00	6,080,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,900	2,310.00	18,249,000
九州フィナンシャルグループ	108,200	388.00	41,981,600
かんぽ生命保険	74,700	2,175.00	162,472,500
ゆうちょ銀行	175,100	1,024.00	179,302,400
富山第一銀行	15,300	525.00	8,032,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	339,000	475.00	161,025,000
ジェイリース	2,100	3,065.00	6,436,500
西日本フィナンシャルホールディングス	38,900	847.00	32,948,300
イントラスト	4,200	773.00	3,246,600
アルヒ	12,600	1,003.00	12,637,800
プレミアグループ	10,300	1,754.00	18,066,200
日産自動車	887,100	462.00	409,840,200
いすゞ自動車	181,500	1,696.00	307,824,000
トヨタ自動車	3,428,900	1,963.00	6,730,930,700
日野自動車	80,500	594.00	47,817,000
三菱自動車工業	243,600	591.00	143,967,600
エフテック	9,000	514.00	4,626,000

武蔵精密工業	15,300	1,686.00	25,795,800
日産車体	11,000	807.00	8,877,000
新明和工業	19,600	1,018.00	19,952,800
極東開発工業	11,000	1,351.00	14,861,000
トピー工業	5,100	1,622.00	8,272,200
ティラド	1,700	2,499.00	4,248,300
曙ブレーキ工業	38,200	161.00	6,150,200
タチエス	9,900	1,049.00	10,385,100
NOK	24,300	1,225.00	29,767,500
フタバ産業	16,700	359.00	5,995,300
K Y B	6,000	3,365.00	20,190,000
大同メタル工業	12,200	486.00	5,929,200
プレス工業	27,900	427.00	11,913,300
ミクニ	13,600	342.00	4,651,200
太平洋工業	14,300	1,066.00	15,243,800
アイシン	48,200	3,660.00	176,412,000
マツダ	206,600	1,065.00	220,029,000
今仙電機製作所	2,500	675.00	1,687,500
本田技研工業	507,600	3,261.00	1,655,283,600
スズキ	114,700	4,655.00	533,928,500
S U B A R U	197,600	2,230.00	440,648,000
ヤマハ発動機	98,100	3,325.00	326,182,500
小糸製作所	75,100	2,073.00	155,682,300
エクセディ	10,200	1,616.00	16,483,200
ミツバ	11,700	474.00	5,545,800
豊田合成	18,200	2,110.00	38,402,000
愛三工業	10,300	696.00	7,168,800
盟和産業	4,800	917.00	4,401,600
ヨロズ	5,900	742.00	4,377,800
エフ・シー・シー	11,100	1,383.00	15,351,300
シマノ	25,500	23,375.00	596,062,500
テイ・エス テック	28,600	1,578.00	45,130,800
三十三フィナンシャルグループ	5,500	1,444.00	7,942,000
第四北越フィナンシャルグループ	9,700	2,511.00	24,356,700
ひろぎんホールディングス	80,200	618.00	49,563,600
マーキュリアホールディングス	5,000	593.00	2,965,000
おきなわフィナンシャルグループ	5,900	2,053.00	12,112,700
ダイレクトマーケティングミックス	7,300	1,325.00	9,672,500
ポピンズ	3,200	1,610.00	5,152,000
L I T A L I C O	5,000	2,253.00	11,265,000
十六フィナンシャルグループ	8,000	2,569.00	20,552,000
北國フィナンシャルホールディングス	5,200	4,365.00	22,698,000
ネットプロテクションズホールディングス	20,300	497.00	10,089,100
プロクレアホールディングス	7,500	2,092.00	15,690,000
あいちフィナンシャルグループ	8,600	2,180.00	18,748,000
ジャムコ	3,400	1,533.00	5,212,200
小野建	6,100	1,436.00	8,759,600
はるやまホールディングス	11,000	438.00	4,818,000
南陽	2,700	1,848.00	4,989,600

ノジマ	21,600	1,321.00	28,533,600
佐島電機	4,100	1,261.00	5,170,100
カップ・クリエイト	10,400	1,381.00	14,362,400
伯東	3,800	3,860.00	14,668,000
コンドーテック	5,100	976.00	4,977,600
中山福	14,500	323.00	4,683,500
ライトオン	6,600	616.00	4,065,600
ナガイレーベン	8,300	2,067.00	17,156,100
三菱食品	6,100	3,140.00	19,154,000
良品計画	85,200	1,541.00	131,293,200
松田産業	5,000	2,272.00	11,360,000
第一興商	12,800	3,950.00	50,560,000
メディバルホールディングス	68,500	1,751.00	119,943,500
アドヴァングループ	6,300	888.00	5,594,400
S P K	3,400	1,392.00	4,732,800
萩原電気ホールディングス	2,500	2,446.00	6,115,000
アルビス	2,200	2,375.00	5,225,000
アズワン	9,700	6,100.00	59,170,000
スズデン	2,300	2,275.00	5,232,500
シモジマ	4,700	933.00	4,385,100
ドウシシャ	7,000	1,507.00	10,549,000
小津産業	2,600	1,447.00	3,762,200
コナカ	14,200	334.00	4,742,800
高速	3,400	1,792.00	6,092,800
ハウス オブ ローゼ	2,900	1,618.00	4,692,200
G - 7ホールディングス	8,200	1,511.00	12,390,200
イオン北海道	9,800	1,136.00	11,132,800
コジマ	12,700	612.00	7,772,400
ヒマラヤ	4,900	927.00	4,542,300
コーナン商事	8,900	3,280.00	29,192,000
ネットワンシステムズ	23,300	3,345.00	77,938,500
エコス	2,700	1,828.00	4,935,600
ワタミ	8,000	1,031.00	8,248,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	148,200	2,346.00	347,677,200
丸文	5,900	891.00	5,256,900
西松屋チェーン	14,600	1,369.00	19,987,400
ゼンショーホールディングス	36,200	3,425.00	123,985,000
ハビネット	5,600	1,912.00	10,707,200
橋本総業ホールディングス	4,900	995.00	4,875,500
日本ライフライン	19,400	931.00	18,061,400
サイゼリヤ	11,000	3,030.00	33,330,000
V Tホールディングス	25,100	503.00	12,625,300
アルゴグラフィックス	5,700	3,610.00	20,577,000
魚力	2,300	2,140.00	4,922,000
I D O M	20,000	684.00	13,680,000
日本エム・ディ・エム	4,800	981.00	4,708,800
フジ・コーポレーション	3,900	1,271.00	4,956,900
ユナイテッドアローズ	7,100	1,889.00	13,411,900
進和	4,400	2,062.00	9,072,800

ダイトロン	2,600	2,368.00	6,156,800
ハイデイ日高	9,800	1,981.00	19,413,800
シークス	9,400	1,425.00	13,395,000
コロワイド	30,400	1,800.00	54,720,000
ピーシーデポコーポレーション	18,300	267.00	4,886,100
田中商事	8,300	565.00	4,689,500
オーハシテクニカ	3,400	1,376.00	4,678,400
壱番屋	5,200	4,580.00	23,816,000
白銅	2,400	2,443.00	5,863,200
スギホールディングス	13,300	6,290.00	83,657,000
薬王堂ホールディングス	3,700	2,655.00	9,823,500
島津製作所	76,100	4,050.00	308,205,000
JMS	9,600	505.00	4,848,000
長野計器	4,500	1,126.00	5,067,000
ブイ・テクノロジー	3,100	2,666.00	8,264,600
スター精密	11,900	1,726.00	20,539,400
東京計器	4,800	1,328.00	6,374,400
愛知時計電機	3,600	1,323.00	4,762,800
インターアクション	3,800	1,527.00	5,802,600
オーバル	6,800	500.00	3,400,000
東京精密	13,700	4,405.00	60,348,500
マニー	27,500	2,206.00	60,665,000
ニコン	97,100	1,236.00	120,015,600
トプコン	32,900	1,601.00	52,672,900
オリンパス	390,400	2,669.50	1,042,172,800
理研計器	3,900	4,970.00	19,383,000
SCREENホールディングス	10,700	9,230.00	98,761,000
キヤノン電子	6,900	1,566.00	10,805,400
タムロン	4,700	3,280.00	15,416,000
HOYA	134,900	13,795.00	1,860,945,500
シード	2,600	495.00	1,287,000
ノーリツ鋼機	5,900	2,730.00	16,107,000
A&Dホロンホールディングス	9,100	1,079.00	9,818,900
朝日インテック	82,500	2,544.00	209,880,000
キヤノン	342,600	3,105.00	1,063,773,000
リコー	163,700	1,050.00	171,885,000
シチズン時計	68,700	583.00	40,052,100
リズム	1,200	1,725.00	2,070,000
メニコン	21,400	2,948.00	63,087,200
KYORITSU	25,700	121.00	3,109,700
スノーピーク	10,700	2,406.00	25,744,200
パラマウントベッドホールディングス	14,400	2,570.00	37,008,000
トランザクション	4,800	1,228.00	5,894,400
粧美堂	2,200	356.00	783,200
ニホンフラッシュ	5,900	900.00	5,310,000
前田工織	6,800	3,180.00	21,624,000
永大産業	18,700	225.00	4,207,500
アートネイチャー	6,400	780.00	4,992,000
バンダイナムコホールディングス	57,000	8,952.00	510,264,000
アイフィスジャパン	7,000	612.00	4,284,000

SHOEI	6,600	5,540.00	36,564,000	
フランスベッドホールディングス	7,700	934.00	7,191,800	
マーベラス	10,200	669.00	6,823,800	
パイロットコーポレーション	9,800	4,845.00	47,481,000	
エイベックス	10,600	1,546.00	16,387,600	
フジシールインターナショナル	12,600	1,782.00	22,453,200	
タカラトミー	28,800	1,242.00	35,769,600	
広済堂ホールディングス	4,200	1,958.00	8,223,600	
レック	8,900	800.00	7,120,000	
プロネクサス	5,200	952.00	4,950,400	
大建工業	3,800	2,130.00	8,094,000	
きもと	5,500	232.00	1,276,000	
凸版印刷	81,700	2,040.00	166,668,000	
大日本印刷	74,100	2,710.00	200,811,000	
共同印刷	1,900	2,811.00	5,340,900	
NISSHA	11,900	1,870.00	22,253,000	
藤森工業	4,900	3,165.00	15,508,500	
TAKARA & COMPANY	4,300	2,107.00	9,060,100	
前澤化成工業	4,000	1,372.00	5,488,000	
未来工業	3,300	1,456.00	4,804,800	
アシックス	57,600	3,075.00	177,120,000	
ツツミ	2,500	1,921.00	4,802,500	
JSP	4,400	1,484.00	6,529,600	
ニチハ	7,800	2,719.00	21,208,200	
ローランド	4,600	3,855.00	17,733,000	
エフピコ	11,800	3,675.00	43,365,000	
小松ウオール工業	2,700	1,831.00	4,943,700	
ヤマハ	39,400	5,480.00	215,912,000	
河合楽器製作所	1,800	2,566.00	4,618,800	
ビジョン	39,800	2,239.00	89,112,200	
天馬	5,300	2,032.00	10,769,600	
兼松サステック	3,000	1,585.00	4,755,000	
キングジム	5,500	906.00	4,983,000	
象印マホービン	18,600	1,671.00	31,080,600	
リンテック	12,500	2,169.00	27,112,500	
信越ポリマー	11,600	1,213.00	14,070,800	
東リ	23,200	223.00	5,173,600	
イトーキ	12,800	544.00	6,963,200	
任天堂	394,200	5,684.00	2,240,632,800	
三菱鉛筆	8,900	1,394.00	12,406,600	
松風	2,800	2,342.00	6,557,600	
タカラスタンダード	12,100	1,315.00	15,911,500	
コクヨ	30,100	1,812.00	54,541,200	
ナカバヤシ	9,300	485.00	4,510,500	
ニフコ	22,600	3,435.00	77,631,000	
グローブライド	5,000	2,698.00	13,490,000	
オカムラ	18,800	1,368.00	25,718,400	
パルカー	5,200	2,650.00	13,780,000	
MUTOHホールディングス	2,400	1,697.00	4,072,800	
伊藤忠商事	407,100	4,266.00	1,736,688,600	

丸紅	521,600	1,527.50	796,744,000	
スクロール	9,800	717.00	7,026,600	
ヨンドシーホールディングス	5,700	1,734.00	9,883,800	
長瀬産業	31,100	2,012.00	62,573,200	
蝶理	3,500	1,977.00	6,919,500	
豊田通商	57,900	5,310.00	307,449,000	
オンワードホールディングス	40,600	321.00	13,032,600	
三共生興	10,200	477.00	4,865,400	
兼松	25,700	1,510.00	38,807,000	
美津濃	6,200	2,890.00	17,918,000	
三井物産	483,400	3,999.00	1,933,116,600	
日本紙パルプ商事	3,500	4,905.00	17,167,500	
東京エレクトロン	44,100	45,250.00	1,995,525,000	
カメイ	7,000	1,174.00	8,218,000	
OUGホールディングス	1,700	2,405.00	4,088,500	
スターゼン	5,000	2,064.00	10,320,000	
セイコーグループ	9,700	3,030.00	29,391,000	
山善	17,800	1,000.00	17,800,000	
椿本興業	1,300	3,990.00	5,187,000	
住友商事	409,200	2,223.00	909,651,600	
BIPROGY	23,000	3,270.00	75,210,000	
内田洋行	2,900	4,520.00	13,108,000	
三菱商事	413,100	4,422.00	1,826,728,200	
第一実業	2,300	4,275.00	9,832,500	
キャノンマーケティングジャパン	15,300	3,015.00	46,129,500	
西華産業	2,900	1,554.00	4,506,600	
佐藤商事	4,600	1,199.00	5,515,400	
菱洋エレクトロ	5,600	2,361.00	13,221,600	
東京産業	6,200	772.00	4,786,400	
ユアサ商事	5,900	3,490.00	20,591,000	
神鋼商事	1,700	4,475.00	7,607,500	
阪和興業	11,900	3,605.00	42,899,500	
正栄食品工業	4,400	4,150.00	18,260,000	
カナデン	5,300	1,110.00	5,883,000	
菱電商事	5,300	1,662.00	8,808,600	
ニプロ	52,100	1,019.00	53,089,900	
岩谷産業	15,000	5,550.00	83,250,000	
ナイス	2,900	1,349.00	3,912,100	
極東貿易	3,900	1,330.00	5,187,000	
アステナホールディングス	11,700	430.00	5,031,000	
兼松エレクトロニクス	4,000	4,380.00	17,520,000	
三愛オブリ	18,200	1,231.00	22,404,200	
稲畑産業	13,500	2,352.00	31,752,000	
G S I クレオス	3,800	1,447.00	5,498,600	
明和産業	8,800	691.00	6,080,800	
クワザワホールディングス	10,600	413.00	4,377,800	
ゴールドウイン	11,100	9,530.00	105,783,000	
ユニ・チャーム	130,500	5,194.00	677,817,000	
デサント	10,800	3,255.00	35,154,000	
ワキタ	12,100	1,180.00	14,278,000	

ヤマトインターナショナル	17,500	249.00	4,357,500
東邦ホールディングス	16,400	2,042.00	33,488,800
サンゲツ	16,600	2,105.00	34,943,000
ミツウロコグループホールディングス	8,500	1,007.00	8,559,500
シナネンホールディングス	2,100	3,715.00	7,801,500
伊藤忠エネクス	16,400	1,007.00	16,514,800
サンリオ	18,700	4,560.00	85,272,000
サンワテクノス	3,400	1,473.00	5,008,200
リョーサン	7,000	2,856.00	19,992,000
新光商事	8,900	1,153.00	10,261,700
トーホー	2,900	1,785.00	5,176,500
三信電気	2,700	2,181.00	5,888,700
東陽テクニカ	7,300	1,343.00	9,803,900
モスフードサービス	9,700	3,135.00	30,409,500
加賀電子	5,400	4,230.00	22,842,000
三益半導体工業	5,800	2,564.00	14,871,200
都築電気	3,600	1,289.00	4,640,400
立花エレテック	4,800	1,746.00	8,380,800
木曽路	10,000	2,094.00	20,940,000
S R Sホールディングス	10,900	858.00	9,352,200
千趣会	12,200	400.00	4,880,000
リテールパートナーズ	9,800	1,237.00	12,122,600
ケーヨー	10,600	903.00	9,571,800
上新電機	5,900	1,900.00	11,210,000
日本瓦斯	35,400	2,091.00	74,021,400
ロイヤルホールディングス	12,700	2,480.00	31,496,000
東天紅	5,400	793.00	4,282,200
いなげや	6,400	1,177.00	7,532,800
チヨダ	6,600	760.00	5,016,000
ライフコーポレーション	5,800	2,544.00	14,755,200
リンガーハット	8,500	2,219.00	18,861,500
MrMaxHD	9,300	650.00	6,045,000
AOKIホールディングス	12,300	669.00	8,228,700
オークワ	10,600	914.00	9,688,400
コメリ	10,200	2,579.00	26,305,800
青山商事	14,100	889.00	12,534,900
しまむら	7,800	12,580.00	98,124,000
高島屋	49,800	1,697.00	84,510,600
松屋	11,200	985.00	11,032,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	32,200	1,178.00	37,931,600
近鉄百貨店	2,100	2,420.00	5,082,000
丸井グループ	48,700	2,253.00	109,721,100
クレディセゾン	39,000	1,706.00	66,534,000
アクシアルリテイリング	4,500	3,345.00	15,052,500
イオン	224,000	2,828.00	633,472,000
イズミ	10,000	2,985.00	29,850,000
平和堂	11,000	2,041.00	22,451,000
フジ	10,100	1,817.00	18,351,700
ヤオコー	7,500	6,800.00	51,000,000
ゼビオホールディングス	9,000	934.00	8,406,000

ケーズホールディングス	52,500	1,111.00	58,327,500
PALTA C	10,400	4,450.00	46,280,000
三谷産業	16,100	316.00	5,087,600
日産東京販売ホールディングス	4,800	289.00	1,387,200
新生銀行	18,100	2,244.00	40,616,400
あおぞら銀行	38,700	2,580.00	99,846,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,032,100	755.50	3,046,251,550
りそなホールディングス	784,900	641.30	503,356,370
三井住友トラスト・ホールディングス	113,900	4,205.00	478,949,500
三井住友フィナンシャルグループ	449,400	4,655.00	2,091,957,000
千葉銀行	171,400	830.00	142,262,000
群馬銀行	119,300	428.00	51,060,400
武蔵野銀行	7,900	1,843.00	14,559,700
千葉興業銀行	11,400	398.00	4,537,200
筑波銀行	27,000	198.00	5,346,000
七十七銀行	19,700	1,894.00	37,311,800
秋田銀行	4,100	1,698.00	6,961,800
山形銀行	6,800	1,139.00	7,745,200
岩手銀行	4,200	1,847.00	7,757,400
東邦銀行	48,600	206.00	10,011,600
ふくおかフィナンシャルグループ	49,100	2,644.00	129,820,400
スルガ銀行	54,200	406.00	22,005,200
八十二銀行	126,200	498.00	62,847,600
山梨中央銀行	6,300	1,037.00	6,533,100
大垣共立銀行	11,700	1,719.00	20,112,300
福井銀行	5,500	1,429.00	7,859,500
清水銀行	3,400	1,463.00	4,974,200
富山銀行	1,100	1,650.00	1,815,000
滋賀銀行	10,200	2,486.00	25,357,200
南都銀行	9,300	2,261.00	21,027,300
百五銀行	57,900	338.00	19,570,200
京都銀行	19,500	5,420.00	105,690,000
紀陽銀行	22,000	1,405.00	30,910,000
ほくほくフィナンシャルグループ	39,100	868.00	33,938,800
山陰合同銀行	38,500	714.00	27,489,000
百十四銀行	5,600	1,703.00	9,536,800
四国銀行	9,800	881.00	8,633,800
阿波銀行	9,100	1,982.00	18,036,200
大分銀行	3,700	1,851.00	6,848,700
宮崎銀行	4,000	2,257.00	9,028,000
佐賀銀行	3,600	1,549.00	5,576,400
琉球銀行	14,100	800.00	11,280,000
セブン銀行	220,300	256.00	56,396,800
みずほフィナンシャルグループ	889,400	1,686.00	1,499,528,400
山口フィナンシャルグループ	67,900	773.00	52,486,700
芙蓉総合リース	5,700	8,490.00	48,393,000
みずほリース	9,200	3,255.00	29,946,000
東京センチュリー	11,500	4,575.00	52,612,500
SBIホールディングス	89,000	2,575.00	229,175,000
日本証券金融	24,700	1,067.00	26,354,900

アイフル	101,900	408.00	41,575,200
長野銀行	3,700	1,201.00	4,443,700
名古屋銀行	4,100	3,060.00	12,546,000
北洋銀行	93,200	228.00	21,249,600
大光銀行	3,600	1,143.00	4,114,800
愛媛銀行	8,300	841.00	6,980,300
京葉銀行	28,600	520.00	14,872,000
栃木銀行	28,200	298.00	8,403,600
北日本銀行	2,600	1,885.00	4,901,000
東和銀行	11,300	524.00	5,921,200
リコーリース	5,800	3,620.00	20,996,000
イオンフィナンシャルサービス	35,300	1,398.00	49,349,400
アコム	109,800	314.00	34,477,200
ジャックス	6,600	4,140.00	27,324,000
オリエントコーポレーション	16,100	1,151.00	18,531,100
オリックス	411,400	2,202.50	906,108,500
三菱HCキャピタル	239,800	638.00	152,992,400
ジャフコ グループ	20,500	2,373.00	48,646,500
九州リースサービス	3,400	675.00	2,295,000
トモニホールディングス	49,700	328.00	16,301,600
大和証券グループ本社	439,800	585.00	257,283,000
野村ホールディングス	1,132,600	485.50	549,877,300
岡三証券グループ	54,000	392.00	21,168,000
丸三証券	20,500	404.00	8,282,000
東洋証券	20,400	268.00	5,467,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	66,900	349.00	23,348,100
光世証券	5,100	378.00	1,927,800
水戸証券	22,100	216.00	4,773,600
いちよし証券	11,300	621.00	7,017,300
松井証券	36,300	776.00	28,168,800
SOMPOホールディングス	105,600	5,639.00	595,478,400
日本取引所グループ	172,800	1,927.00	332,985,600
マネックスグループ	68,700	424.00	29,128,800
極東証券	7,900	592.00	4,676,800
岩井コスモホールディングス	7,000	1,254.00	8,778,000
アイザワ証券グループ	8,900	682.00	6,069,800
フィデアホールディングス	6,400	1,319.00	8,441,600
池田泉州ホールディングス	78,700	225.00	17,707,500
アニコム ホールディングス	20,900	657.00	13,731,300
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	138,700	3,917.00	543,287,900
スパークス・グループ	6,900	1,693.00	11,681,700
第一生命ホールディングス	313,100	2,607.50	816,408,250
東京海上ホールディングス	619,300	2,797.00	1,732,182,100
イー・ギャランティ	9,900	2,278.00	22,552,200
アサックス	8,000	595.00	4,760,000
NECキャピタルソリューション	3,000	2,055.00	6,165,000
T & Dホールディングス	165,100	1,637.00	270,268,700
アドバンスクリエイト	2,900	1,060.00	3,074,000

三井不動産	267,300	2,613.00	698,454,900
三菱地所	389,900	1,836.50	716,051,350
平和不動産	10,000	3,930.00	39,300,000
東京建物	58,600	1,844.00	108,058,400
京阪神ビルディング	7,900	1,271.00	10,040,900
住友不動産	111,200	3,412.00	379,414,400
テーオーシー	11,100	667.00	7,403,700
東京楽天地	1,100	4,360.00	4,796,000
レオパレス21	69,200	289.00	19,998,800
スターツコーポレーション	8,800	2,658.00	23,390,400
フジ住宅	8,600	653.00	5,615,800
空港施設	9,100	528.00	4,804,800
ゴールドクレスト	5,800	1,708.00	9,906,400
リログループ	35,700	2,191.00	78,218,700
エスリード	2,900	1,826.00	5,295,400
日神グループホールディングス	11,300	435.00	4,915,500
日本エスコン	13,800	845.00	11,661,000
MIRARTHホールディングス	31,100	378.00	11,755,800
AVANTIA	5,800	787.00	4,564,600
イオンモール	31,900	1,710.00	54,549,000
ファースト住建	4,300	997.00	4,287,100
カチタス	16,500	3,155.00	52,057,500
東祥	4,500	1,143.00	5,143,500
トーセイ	10,200	1,410.00	14,382,000
穴吹興産	2,300	1,967.00	4,524,100
サンフロンティア不動産	10,200	1,127.00	11,495,400
FJネクストホールディングス	6,500	962.00	6,253,000
グランディハウス	8,700	555.00	4,828,500
東武鉄道	68,600	3,180.00	218,148,000
相鉄ホールディングス	20,600	2,163.00	44,557,800
東急	175,100	1,713.00	299,946,300
京浜急行電鉄	70,800	1,354.00	95,863,200
小田急電鉄	94,700	1,744.00	165,156,800
京王電鉄	33,000	4,940.00	163,020,000
京成電鉄	40,300	3,850.00	155,155,000
富士急行	7,700	4,970.00	38,269,000
東日本旅客鉄道	105,900	7,783.00	824,219,700
西日本旅客鉄道	79,800	5,742.00	458,211,600
東海旅客鉄道	48,100	16,380.00	787,878,000
西武ホールディングス	75,500	1,416.00	106,908,000
鴻池運輸	10,600	1,581.00	16,758,600
西日本鉄道	16,700	2,642.00	44,121,400
ハマキョウレックス	4,900	3,340.00	16,366,000
サカイ引越センター	3,000	4,495.00	13,485,000
近鉄グループホールディングス	62,300	4,505.00	280,661,500
阪急阪神ホールディングス	83,100	4,120.00	342,372,000
南海電気鉄道	29,800	2,927.00	87,224,600
京阪ホールディングス	25,800	3,460.00	89,268,000
神戸電鉄	1,700	3,225.00	5,482,500
名古屋鉄道	68,900	2,182.00	150,339,800

山陽電気鉄道	4,700	2,120.00	9,964,000	
アルプス物流	5,000	1,149.00	5,745,000	
トランコム	1,800	7,650.00	13,770,000	
ヤマトホールディングス	79,800	2,319.00	185,056,200	
山九	15,900	4,915.00	78,148,500	
日新	4,700	1,997.00	9,385,900	
丸全昭和運輸	3,900	3,060.00	11,934,000	
センコーグループホールディングス	33,000	982.00	32,406,000	
トナミホールディングス	1,400	3,775.00	5,285,000	
ニッコンホールディングス	20,000	2,374.00	47,480,000	
日本石油輸送	1,300	2,209.00	2,871,700	
福山通運	5,200	3,345.00	17,394,000	
セイノーホールディングス	38,800	1,202.00	46,637,600	
神奈川中央交通	1,800	3,330.00	5,994,000	
日立物流	13,700	8,880.00	121,656,000	
A Z - C O M丸和ホールディングス	15,000	1,509.00	22,635,000	
C & F ロジホールディングス	6,000	1,198.00	7,188,000	
日本郵船	166,800	3,076.00	513,076,800	
商船三井	109,900	3,315.00	364,318,500	
川崎汽船	53,100	2,554.00	135,617,400	
N S ユナイテッド海運	3,400	3,875.00	13,175,000	
明治海運	6,200	729.00	4,519,800	
飯野海運	22,900	946.00	21,663,400	
共栄タンカー	600	932.00	559,200	
九州旅客鉄道	44,100	2,966.00	130,800,600	
S Gホールディングス	119,600	2,025.00	242,190,000	
N I P P O N E X P R E S S ホール ディングス	23,300	8,040.00	187,332,000	
日本航空	153,100	2,741.00	419,647,100	
A N A ホールディングス	169,600	2,903.50	492,433,600	
パスコ	1,200	1,331.00	1,597,200	
T R E ホールディングス	13,500	1,453.00	19,615,500	
人・夢・技術グループ	2,900	1,971.00	5,715,900	
西本W i s m e t t a c ホールディ ングス	1,700	3,690.00	6,273,000	
G e n k y D r u g S t o r e s	3,300	3,535.00	11,665,500	
K P P グループホールディングス	15,400	865.00	13,321,000	
ナルミヤ・インターナショナル	5,600	866.00	4,849,600	
ブックオフグループホールディングス	3,900	1,342.00	5,233,800	
ギフトホールディングス	1,400	3,770.00	5,278,000	
三菱倉庫	13,400	3,180.00	42,612,000	
三井倉庫ホールディングス	5,800	3,520.00	20,416,000	
住友倉庫	17,100	1,957.00	33,464,700	
澁澤倉庫	2,500	2,051.00	5,127,500	
ヤマタネ	2,900	1,663.00	4,822,700	
東陽倉庫	16,500	253.00	4,174,500	
乾汽船	8,000	1,935.00	15,480,000	
日本トランスシティ	12,500	510.00	6,375,000	
中央倉庫	5,200	928.00	4,825,600	
安田倉庫	5,200	924.00	4,804,800	

東洋埠頭	3,800	1,277.00	4,852,600
上組	31,000	2,697.00	83,607,000
キューソー流通システム	4,200	994.00	4,174,800
東海運	13,300	279.00	3,710,700
エーアイテイー	3,900	1,420.00	5,538,000
日本コンセプト	2,700	1,627.00	4,392,900
TBSホールディングス	32,100	1,556.00	49,947,600
日本テレビホールディングス	55,400	1,039.00	57,560,600
朝日放送グループホールディングス	7,800	624.00	4,867,200
テレビ朝日ホールディングス	15,200	1,351.00	20,535,200
スカパーJ S A Tホールディングス	55,600	483.00	26,854,800
テレビ東京ホールディングス	4,500	1,837.00	8,266,500
日本BS放送	4,800	911.00	4,372,800
ビジョン	8,200	1,296.00	10,627,200
USEN-NEXT HOLDINGS	5,600	2,178.00	12,196,800
コネクシオ	4,400	1,225.00	5,390,000
日本通信	57,800	221.00	12,773,800
日本電信電話	802,500	3,730.00	2,993,325,000
KDDI	484,000	3,984.00	1,928,256,000
ソフトバンク	1,006,100	1,476.50	1,485,506,650
光通信	7,400	18,380.00	136,012,000
エムティーアイ	9,400	522.00	4,906,800
GMOインターネットグループ	23,300	2,487.00	57,947,100
アйдママーケティングコミュニケーション	16,400	281.00	4,608,400
KADOKAWA	33,100	2,672.00	88,443,200
学研ホールディングス	10,400	963.00	10,015,200
ゼンリン	10,700	838.00	8,966,600
インプレスホールディングス	22,700	213.00	4,835,100
東京電力ホールディングス	562,900	510.00	287,079,000
中部電力	230,100	1,284.00	295,448,400
関西電力	241,100	1,166.00	281,122,600
中国電力	99,400	656.00	65,206,400
北陸電力	58,900	541.00	31,864,900
東北電力	152,700	643.00	98,186,100
四国電力	53,300	713.00	38,002,900
九州電力	143,900	705.00	101,449,500
北海道電力	60,300	441.00	26,592,300
沖縄電力	14,600	1,020.00	14,892,000
電源開発	47,000	2,086.00	98,042,000
エフオン	7,600	523.00	3,974,800
イーレックス	11,100	2,480.00	27,528,000
レノバ	16,600	2,637.00	43,774,200
東京瓦斯	132,000	2,598.00	342,936,000
大阪瓦斯	126,500	2,152.00	272,228,000
東邦瓦斯	24,600	2,669.00	65,657,400
北海道瓦斯	3,700	1,640.00	6,068,000
広島ガス	7,900	339.00	2,678,100
西部ガスホールディングス	5,900	1,680.00	9,912,000

静岡ガス	14,200	1,118.00	15,875,600
メタウォーター	7,800	1,737.00	13,548,600
アイネット	3,800	1,295.00	4,921,000
松竹	3,600	12,140.00	43,704,000
東宝	39,200	5,320.00	208,544,000
エイチ・アイ・エス	16,800	2,035.00	34,188,000
東映	1,700	18,950.00	32,215,000
ラックランド	2,000	2,981.00	5,962,000
エヌ・ティ・ティ・データ	196,500	2,057.00	404,200,500
共立メンテナンス	11,000	5,800.00	63,800,000
イチネンホールディングス	6,800	1,257.00	8,547,600
建設技術研究所	3,300	3,350.00	11,055,000
スペース	5,600	900.00	5,040,000
アインホールディングス	9,100	6,340.00	57,694,000
燦ホールディングス	2,800	1,796.00	5,028,800
ピー・シー・エー	4,300	1,300.00	5,590,000
東京テアトル	4,000	1,118.00	4,472,000
タナベコンサルティンググループ	7,000	639.00	4,473,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,700	1,913.00	5,165,100
ナガワ	1,700	7,330.00	12,461,000
東京都競馬	5,400	3,775.00	20,385,000
カナモト	11,800	2,335.00	27,553,000
D T S	13,800	3,110.00	42,918,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	31,500	6,290.00	198,135,000
シーイーシー	8,800	1,531.00	13,472,800
カブコン	62,200	4,370.00	271,814,000
西尾レントオール	6,000	3,110.00	18,660,000
アイ・エス・ビー	3,600	1,290.00	4,644,000
日本空港ビルディング	21,800	6,310.00	137,558,000
トランス・コスモス	8,000	3,140.00	25,120,000
乃村工藝社	28,000	945.00	26,460,000
ジャステック	3,800	1,181.00	4,487,800
S C S K	51,100	2,089.00	106,747,900
藤田観光	2,900	2,926.00	8,485,400
K N T - C Tホールディングス	3,800	1,654.00	6,285,200
日本管財	6,700	2,515.00	16,850,500
トーカイ	5,700	1,938.00	11,046,600
セコム	65,400	8,192.00	535,756,800
N S W	2,400	2,125.00	5,100,000
セントラル警備保障	3,500	2,351.00	8,228,500
アイネス	4,400	1,366.00	6,010,400
丹青社	12,400	714.00	8,853,600
メイテック	25,600	2,506.00	64,153,600
T K C	11,200	3,620.00	40,544,000
富士ソフト	7,100	7,570.00	53,747,000
応用地質	6,200	2,075.00	12,865,000
船井総研ホールディングス	13,500	2,767.00	37,354,500
N S D	22,300	2,392.00	53,341,600
進学会ホールディングス	14,600	304.00	4,438,400

丸紅建材リース	2,500	1,717.00	4,292,500
コナミグループ	26,800	6,220.00	166,696,000
学究社	2,900	1,764.00	5,115,600
ベネッセホールディングス	24,000	1,963.00	47,112,000
イオンディライト	7,100	2,969.00	21,079,900
ナック	5,200	928.00	4,825,600
福井コンピュータホールディングス	4,400	2,798.00	12,311,200
ダイセキ	13,100	4,545.00	59,539,500
ステップ	2,600	1,790.00	4,654,000
日鉄物産	4,500	5,020.00	22,590,000
泉州電業	3,300	3,025.00	9,982,500
元気寿司	2,100	3,155.00	6,625,500
トラスコ中山	13,900	2,137.00	29,704,300
ヤマダホールディングス	270,900	469.00	127,052,100
オートバックスセブン	23,000	1,424.00	32,752,000
モリト	6,400	744.00	4,761,600
アークランズ	9,700	1,513.00	14,676,100
ニトリホールディングス	26,700	16,035.00	428,134,500
グルメ杵屋	5,400	997.00	5,383,800
愛眼	27,500	173.00	4,757,500
吉野家ホールディングス	25,900	2,355.00	60,994,500
加藤産業	8,000	3,415.00	27,320,000
イノテック	4,200	1,270.00	5,334,000
イエローハット	11,700	1,727.00	20,205,900
松屋フーズホールディングス	3,100	3,915.00	12,136,500
J B C Cホールディングス	4,600	1,917.00	8,818,200
J Kホールディングス	5,200	1,024.00	5,324,800
サガミホールディングス	10,600	1,216.00	12,889,600
日伝	3,900	1,675.00	6,532,500
関西フードマーケット	6,000	1,304.00	7,824,000
ミロク情報サービス	5,700	1,445.00	8,236,500
北沢産業	23,800	192.00	4,569,600
杉本商事	2,900	1,976.00	5,730,400
因幡電機産業	17,100	2,769.00	47,349,900
王将フードサービス	4,400	6,040.00	26,576,000
プレナス	7,300	2,635.00	19,235,500
ミニストップ	4,800	1,431.00	6,868,800
アークス	12,100	2,092.00	25,313,200
パローホールディングス	12,600	1,761.00	22,188,600
東テク	2,200	3,105.00	6,831,000
ミスミグループ本社	99,700	3,385.00	337,484,500
ベルク	3,300	5,700.00	18,810,000
大 庄	4,100	1,060.00	4,346,000
ファーストリテイリング	9,900	83,900.00	830,610,000
ソフトバンクグループ	362,100	6,205.00	2,246,830,500
蔵王産業	2,600	1,756.00	4,565,600
スズケン	24,100	3,605.00	86,880,500
サンドラッグ	25,100	3,785.00	95,003,500
サックスパー ホールディングス	6,500	778.00	5,057,000
ジェコス	5,900	797.00	4,702,300

ヤマザワ	3,400	1,302.00	4,426,800	
やまや	1,900	2,461.00	4,675,900	
ベルーナ	15,900	677.00	10,764,300	
合計	73,238,900		176,655,224,340	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,256,878,287
金銭信託	150,825,199
コール・ローン	4,772,294,886
株式	554,552,685,082
投資証券	12,811,063,524
派生商品評価勘定	264,037,652
未収入金	4,152,335
未収配当金	704,918,265
差入委託証拠金	8,381,563,406
流動資産合計	583,898,418,636
資産合計	
583,898,418,636	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	276,348,129
未払金	411,602
未払解約金	624,953,163
その他未払費用	20,988
流動負債合計	901,733,882
負債合計	
901,733,882	
純資産の部	
元本等	
元本	194,980,621,021
剰余金	
剰余金又は欠損金()	388,016,063,733
元本等合計	582,996,684,754
純資産合計	582,996,684,754
負債純資産合計	583,898,418,636

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<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礎となる事項	<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	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	174,421,748,763円
同期中追加設定元本額	54,079,992,728円
同期中一部解約元本額	33,521,120,470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）	823,091,122円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,719,946,543円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,200,902,697円
ニッセイ外国株式インデックスSA（適格機関投資家限定）	2,051,975,721円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	1,401,134円
ニッセイインデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	6,809,396円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	7,404,872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）	644,310,675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	143,899,386,740円
DCニッセイ外国株式インデックス	33,646,738,077円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	2,112,427,869円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	299,412,408円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	178,763,020円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	341,436,804円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	624,053,475円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	16,858,522円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)	88,282,447円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,409,506円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	8,960,067円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	3,845,996円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	21,196,946円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	219,106,456円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	143,726,992円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	310,199,014円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	221,028,422円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適 格機関投資家限定)	195,612,702円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バス ケット)	199,864,938円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適 格機関投資家限定)	197,008,316円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01(適 格機関投資家限定)	193,072,729円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05(適 格機関投資家限定)	193,037,547円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08(適 格機関投資家限定)	173,805,587円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)	30,373,505円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	1,163,017,215円
FWニッセイ先進国株インデックス	21,011,488円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	16,142,073円
計	194,980,621,021円
2. 受益権の総数	194,980,621,021口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	2,075,744,490	
投資証券	82,102,345	
合計	1,993,642,145	

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年11月22日から2022年12月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年12月12日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	10,426,979,809	-	10,287,309,138	139,670,671	
アメリカ・ドル	7,731,155,760	-	7,594,188,723	136,967,037	
イギリス・ポンド	785,629,767	-	788,613,664	2,983,897	
ユーロ	1,910,194,282	-	1,904,506,751	5,687,531	
買建	13,196,538,348	-	13,081,379,303	115,159,045	
アメリカ・ドル	9,456,670,115	-	9,338,668,629	118,001,486	
イギリス・ポンド	1,132,248,087	-	1,143,840,530	11,592,443	
ユーロ	2,607,620,146	-	2,598,870,144	8,750,002	
合計	23,623,518,157	-	23,368,688,441	24,511,626	

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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

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

株式関連

種類	2022年12月12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	14,976,967,348	-	14,940,145,244	36,822,104
合計	14,976,967,348	-	14,940,145,244	36,822,104

（注）株価指数先物取引

1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年12月12日現在
1口当たり純資産額	2.9900円
（1万口当たり純資産額）	（29,900円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年12月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	47,950	125.760	6,030,192.00	
	ABBOTT LABORATORIES	151,725	107.510	16,311,954.75	
	ABBVIE INC	153,215	163.060	24,983,237.90	
	ABIOMED INC	3,919	380.750	1,492,159.25	
	ACCENTURE PLC	54,780	288.410	15,799,099.80	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	67,807	75.160	5,096,374.12	
	ADOBE INC	40,521	330.640	13,397,863.44	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,201	145.900	758,825.90	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	139,863	68.590	9,593,203.17	
	AERCAP HOLDINGS NV	11,689	58.740	686,611.86	
	AES CORP	57,973	28.520	1,653,389.96	
	AFFIRM HOLDINGS INC	16,953	11.340	192,247.02	
	AFLAC INC	51,828	69.960	3,625,886.88	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,637	152.950	3,921,179.15	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,245	314.410	6,050,820.45	
	AIRBNB INC-CLASS A	32,834	94.700	3,109,379.80	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,783	89.020	1,226,962.66	
	ALBEMARLE CORP	10,145	253.250	2,569,221.25	
	ALCOA CORP	15,506	45.080	699,010.48	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	6,404	188.810	1,209,139.24	
	ALLEGION PLC	7,696	109.130	839,864.48	
	ALLIANT ENERGY CORP	21,750	55.310	1,202,992.50	
	ALLSTATE CORP	23,372	128.550	3,004,470.60	
	ALLY FINANCIAL INC	26,275	25.010	657,137.75	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,426	231.330	2,411,846.58	
	ALPHABET INC-CL A	519,306	92.830	48,207,175.98	
	ALPHABET INC-CL C	480,673	93.070	44,736,236.11	
	ALTRIA GROUP INC	156,093	46.710	7,291,104.03	
	AMAZON.COM INC	794,408	89.090	70,773,808.72	
	AMCOR PLC	130,583	12.370	1,615,311.71	
	AMERCO-NON VOTING	8,001	59.070	472,619.07	
	AMEREN CORPORATION	22,427	88.610	1,987,256.47	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	44,573	96.580	4,304,860.34	
	AMERICAN EXPRESS CO	55,231	153.900	8,500,050.90	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,190	135.970	841,654.30		
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	65,497	62.510	4,094,217.47		

AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,725	156.140	2,455,301.50	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,324	321.040	2,993,376.96	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,547	165.330	2,239,725.51	
AMETEK INC	19,974	139.110	2,778,583.14	
AMGEN INC	46,359	278.650	12,917,935.35	
AMPHENOL CORP-CL A	51,767	78.510	4,064,227.17	
ANALOG DEVICES INC	44,658	168.680	7,532,911.44	
ANSYS INC	7,525	242.210	1,822,630.25	
AON PLC	18,262	305.680	5,582,328.16	
APA CORP	28,083	41.860	1,175,554.38	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	34,759	62.880	2,185,645.92	
APPLE INC	1,392,345	142.160	197,935,765.20	
APPLIED MATERIALS INC	74,513	107.340	7,998,225.42	
APTIV PLC	23,479	93.280	2,190,121.12	
ARAMARK	20,450	41.160	841,722.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,857	60.040	1,912,694.28	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,540	91.880	4,459,855.20	
ARES MANAGEMENT CORP - A	13,435	69.160	929,164.60	
ARISTA NETWORKS INC	21,080	127.900	2,696,132.00	
ARROW ELECTRONICS INC	5,441	106.740	580,772.34	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,206	191.830	3,492,456.98	
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,522	217.050	547,400.10	
ASSURANT INC	4,620	130.360	602,263.20	
AT&T INC	617,490	19.090	11,787,884.10	
ATMOS ENERGY CORP	12,200	117.670	1,435,574.00	
AUTODESK INC	18,832	194.310	3,659,245.92	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	36,046	257.200	9,271,031.20	
AUTOZONE INC	1,687	2,454.990	4,141,568.13	
AVANTOR INC	58,540	21.510	1,259,195.40	
AVERY DENNISON CORP	7,039	177.730	1,251,041.47	
BAKER HUGHES COMPANY	87,862	27.110	2,381,938.82	
BALL CORP	27,275	53.560	1,460,849.00	
BANK OF AMERICA CORP	626,260	32.380	20,278,298.80	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,493	44.710	2,972,902.03	
BATH & BODY WORKS INC	19,588	42.310	828,768.28	
BAXTER INTERNATIONAL INC	43,813	52.380	2,294,924.94	
BECTON DICKINSON & CO	24,735	247.600	6,124,386.00	
BENTLEY SYSTEMS INC- CLASS B	16,763	39.630	664,317.69	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	112,814	306.390	34,565,081.46	
BEST BUY CO INC	17,499	81.810	1,431,593.19	
BILL.COM HOLDINGS INC	8,176	111.850	914,485.60	

BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,929	416.090	802,637.61	
BIO-TECHNE CORP	13,528	80.730	1,092,115.44	
BIOGEN INC	12,559	285.370	3,583,961.83	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,097	102.330	1,647,206.01	
BLACK KNIGHT INC	13,576	59.890	813,066.64	
BLACKROCK INC	13,045	706.950	9,222,162.75	
BLACKSTONE INC	60,708	78.480	4,764,363.84	
BLOCK INC	45,897	64.600	2,964,946.20	
BOEING CO	48,904	179.540	8,780,224.16	
BOOKING HOLDINGS INC	3,440	2,019.980	6,948,731.20	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,456	104.830	1,200,932.48	
BORGWARNER INC	20,661	40.470	836,150.67	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	124,111	46.230	5,737,651.53	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	185,152	78.830	14,595,532.16	
BROADCOM INC	35,004	544.720	19,067,378.88	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	10,219	142.110	1,452,222.09	
BROWN & BROWN INC	20,664	57.500	1,188,180.00	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	26,904	67.920	1,827,319.68	
BUNGE LIMITED	13,075	95.510	1,248,793.25	
BURLINGTON STORES INC	5,673	194.920	1,105,781.16	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,041	95.300	1,052,207.30	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	23,672	163.670	3,874,396.24	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	18,562	49.340	915,849.08	
CAMPBELL SOUP CO	18,259	55.660	1,016,295.94	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,131	94.410	3,127,897.71	
CARDINAL HEALTH INC	23,767	77.550	1,843,130.85	
CARLISLE COS INC	4,473	248.330	1,110,780.09	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,733	29.550	494,460.15	
CARMAX INC	13,777	65.700	905,148.90	
CARNIVAL CORP	86,118	8.870	763,866.66	
CARRIER GLOBAL CORP	72,912	43.020	3,136,674.24	
CATALENT INC	14,762	44.680	659,566.16	
CATERPILLAR INC	45,753	227.290	10,399,199.37	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,222	124.390	1,147,124.58	
CBRE GROUP INC	27,754	75.840	2,104,863.36	
CDW CORP/DE	11,769	185.480	2,182,914.12	
CELANESE CORP-SERIES A	9,288	102.360	950,719.68	
CENTENE CORP	49,528	86.250	4,271,790.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	54,691	30.450	1,665,340.95	
CENTURYLINK INC	80,597	5.490	442,477.53	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,984	64.900	777,761.60	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17,227	98.700	1,700,304.90	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,393	210.170	923,276.81	
CHARLES SCHWAB CORP	126,018	79.820	10,058,756.76	
CHARTER COMMUNICATIONS- CL A	9,737	380.570	3,705,610.09	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	8,698	131.530	1,144,047.94	
CHENIERE ENERGY INC	19,494	158.530	3,090,383.82	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,793	94.720	832,872.96	
CHEVRON CORP	161,135	168.000	27,070,680.00	
CHEWY INC - CLASS A	8,092	43.650	353,215.80	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,406	1,526.260	3,672,181.56	
CHUBB LTD	36,168	217.330	7,860,391.44	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,065	80.030	1,685,831.95	
CIGNA CORP	26,462	332.120	8,788,559.44	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,041	105.910	1,381,172.31	
CINTAS CORP	7,866	453.460	3,566,916.36	
CISCO SYSTEMS INC	358,677	48.460	17,381,487.42	
CITIGROUP INC	167,719	44.860	7,523,874.34	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	42,704	39.820	1,700,473.28	
CLARIVATE PLC	26,630	9.000	239,670.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	44,732	15.500	693,346.00	
CLOROX CO	10,708	148.780	1,593,136.24	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	22,058	48.420	1,068,048.36	
CME GROUP INC	31,188	178.830	5,577,350.04	
CMS ENERGY CORP	25,322	62.220	1,575,534.84	
COCA-COLA CO	356,149	63.140	22,487,247.86	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	17,858	53.900	962,546.20	
COGNEX CORP	14,983	48.330	724,128.39	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	44,709	58.340	2,608,323.06	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	10,682	40.240	429,843.68	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,735	77.780	5,346,208.30	
COMCAST CORP	381,403	35.320	13,471,153.96	
CONAGRA BRANDS INC	41,731	38.020	1,586,612.62	
CONOCOPHILLIPS	110,259	110.020	12,130,695.18	
CONSOLIDATED EDISON INC	30,770	96.530	2,970,228.10	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,840	242.040	3,349,833.60	
CONSTELLATION ENERGY	28,303	89.720	2,539,345.16	
COOPER COS INC/THE	4,275	309.470	1,322,984.25	
COPART INC	36,971	63.790	2,358,380.09	
CORNING INC	69,858	33.020	2,306,711.16	

CORTEVA INC	62,439	62.990	3,933,032.61	
COSTAR GROUP INC	34,315	80.700	2,769,220.50	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,350	483.020	18,523,817.00	
COTERRA ENERGY INC	68,845	24.480	1,685,325.60	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,589	115.080	2,024,142.12	
CROWN HOLDINGS INC	10,550	80.260	846,743.00	
CSX CORP	187,633	31.420	5,895,428.86	
CUMMINS INC	12,244	238.140	2,915,786.16	
CVS HEALTH CORP	113,758	101.650	11,563,500.70	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,562	135.870	483,968.94	
DANAHER CORP	59,861	269.340	16,122,961.74	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,613	142.570	1,513,095.41	
DARLING INTERNATIONAL INC	13,818	62.330	861,275.94	
DATADOG INC - CLASS A	21,419	74.560	1,597,000.64	
DAVITA INC	4,747	74.340	352,891.98	
DEERE & CO	25,161	434.810	10,940,254.41	
DELL TECHNOLOGIES -C	22,897	41.830	957,781.51	
DELTA AIR LINES INC	13,508	33.800	456,570.40	
DENTSPLY SIRONA INC	18,860	30.260	570,703.60	
DEVON ENERGY CORPORATION	53,714	59.620	3,202,428.68	
DEXCOM INC	34,000	116.460	3,959,640.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	14,599	129.600	1,892,030.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,656	103.000	2,436,568.00	
DISH NETWORK CORP	21,069	14.740	310,557.06	
DOCUSIGN INC	17,270	49.160	848,993.20	
DOLLAR GENERAL CORP	19,555	243.260	4,756,949.30	
DOLLAR TREE INC	19,410	142.310	2,762,237.10	
DOMINION ENERGY INC	72,232	58.280	4,209,680.96	
DOMINO'S PIZZA INC	3,099	362.650	1,123,852.35	
DOORDASH INC - A	20,238	55.270	1,118,554.26	
DOVER CORP	12,407	137.290	1,703,357.03	
DOW INC	62,201	50.200	3,122,490.20	
DR HORTON INC	28,468	85.340	2,429,459.12	
DROPBOX INC-CLASS A	23,795	22.390	532,770.05	
DTE ENERGY COMPANY	16,897	117.190	1,980,159.43	
DUKE ENERGY CORP	66,817	100.350	6,705,085.95	
DUPONT DE NEMOURS INC	43,419	68.890	2,991,134.91	
DYNATRACE INC	17,404	36.960	643,251.84	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,618	85.170	904,335.06	
EATON CORP PLC	34,524	158.280	5,464,458.72	
EBAY INC	47,480	43.640	2,072,027.20	
ECOLAB INC	22,282	150.350	3,350,098.70	
EDISON INTERNATIONAL	33,226	65.790	2,185,938.54	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,570	74.010	3,964,715.70	

ELANCO ANIMAL HEALTH INC	37,212	12.670	471,476.04	
ELECTRONIC ARTS INC	24,079	124.710	3,002,892.09	
ELEVANCE HEALTH, INC	20,786	524.920	10,910,987.12	
ELI LILLY & CO	69,983	360.990	25,263,163.17	
EMERSON ELECTRIC CO	51,344	94.190	4,836,091.36	
ENPHASE ENERGY INC	11,740	319.550	3,751,517.00	
ENTEGRIS INC	12,899	69.830	900,737.17	
ENTERGY CORP	17,719	116.870	2,070,819.53	
EOG RESOURCES INC	50,716	121.670	6,170,615.72	
EPAM SYSTEMS INC	4,958	343.880	1,704,957.04	
EQT CORP	28,840	35.670	1,028,722.80	
EQUIFAX INC	10,591	197.450	2,091,192.95	
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,262	29.700	958,181.40	
ERIE INDEMNITY COMPANY- CL A	2,205	266.900	588,514.50	
ESSENTIAL UTILITIES INC	21,888	48.230	1,055,658.24	
ESTEE LAUDER COS INC	20,010	240.410	4,810,604.10	
ETSY INC	10,948	126.780	1,387,987.44	
EVEREST RE GROUP LTD	3,398	332.560	1,130,038.88	
EVERGY INC	19,983	62.390	1,246,739.37	
EVERSOURCE ENERGY	30,105	84.050	2,530,325.25	
EXACT SCIENCES CORP	15,510	44.600	691,746.00	
EXELON CORP	85,794	41.420	3,553,587.48	
EXPEDIA GROUP INC	13,067	94.100	1,229,604.70	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	14,443	107.910	1,558,544.13	
EXXON MOBIL CORP	361,124	103.540	37,390,778.96	
F5 INC	5,122	149.490	765,687.78	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,290	449.740	1,479,644.60	
FAIR ISAAC CORP	2,186	615.450	1,345,373.70	
FASTENAL CO	49,701	50.960	2,532,762.96	
FEDEX CORP	21,570	172.330	3,717,158.10	
FERGUSON PLC	17,974	127.120	2,284,854.88	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	22,501	37.330	839,962.33	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	52,735	70.270	3,705,688.45	
FIFTH THIRD BANCORP	59,195	32.890	1,946,923.55	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,032	777.430	802,307.76	
FIRST HORIZON NATIONAL CORP	46,867	24.480	1,147,304.16	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15,816	116.980	1,850,155.68	
FIRST SOLAR INC	8,305	150.960	1,253,722.80	
FIRSTENERGY CORP	47,198	41.480	1,957,773.04	
FISERV INC	52,756	100.640	5,309,363.84	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,182	183.450	1,134,087.90	

FMC CORP	10,988	126.600	1,391,080.80	
FORD MOTOR CO	341,915	13.180	4,506,439.70	
FORTINET INC	57,967	52.130	3,021,819.71	
FORTIVE CORP	29,370	65.720	1,930,196.40	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,199	60.330	675,635.67	
FOX CORP - CLASS A	24,948	31.310	781,121.88	
FOX CORP- CLASS B	14,236	29.410	418,680.76	
FRANKLIN RESOURCES INC	25,769	26.590	685,197.71	
FREEPORT-MCMORAN INC	123,377	38.590	4,761,118.43	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,206	66.670	347,084.02	
GARMIN LTD	13,350	95.030	1,268,650.50	
GARTNER INC	6,849	343.300	2,351,261.70	
GEN DIGITAL INC	51,905	22.670	1,176,686.35	
GENERAC HOLDINGS INC	5,484	92.670	508,202.28	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,222	247.040	4,995,642.88	
GENERAL ELECTRIC CO	95,145	81.450	7,749,560.25	
GENERAL MILLS INC	51,512	85.840	4,421,790.08	
GENERAL MOTORS CO	119,890	38.280	4,589,389.20	
GENUINE PARTS CO	12,250	182.260	2,232,685.00	
GILEAD SCIENCES INC	108,578	87.970	9,551,606.66	
GLOBAL PAYMENTS INC	24,060	97.820	2,353,549.20	
GLOBE LIFE INC	8,067	116.520	939,966.84	
GODADDY INC - CLASS A	13,664	74.720	1,020,974.08	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,547	359.140	10,611,509.58	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	116,128	3.020	350,706.56	
HALLIBURTON CO	78,561	33.010	2,593,298.61	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	27,769	74.640	2,072,678.16	
HASBRO INC	11,434	59.490	680,208.66	
HCA HEALTHCARE INC	19,866	237.590	4,719,962.94	
HEICO CORP	3,780	157.030	593,573.40	
HEICO CORP-CLASS A	6,314	122.290	772,139.06	
HENRY SCHEIN INC	11,755	81.200	954,506.00	
HERSHEY CO/THE	12,724	236.770	3,012,661.48	
HESS CORP	24,230	129.320	3,133,423.60	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,179	16.150	1,811,690.85	
HF SINCLAIR CORP	14,020	48.720	683,054.40	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,817	137.430	3,273,170.31	
HOLOGIC INC	21,645	74.000	1,601,730.00	
HOME DEPOT INC	88,695	320.480	28,424,973.60	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,408	211.630	12,360,885.04	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,900	4.510	446,039.00	
HORIZON PHARMA PLC	18,919	97.290	1,840,629.51	
HORMEL FOODS CORP	26,129	47.020	1,228,585.58	

HOWMET AEROSPACE INC	32,526	38.000	1,235,988.00	
HP INC	89,353	28.210	2,520,648.13	
HUBBELL INC	4,661	250.100	1,165,716.10	
HUBSPOT INC	3,946	291.380	1,149,785.48	
HUMANA INC	10,964	533.420	5,848,416.88	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	124,783	14.550	1,815,592.65	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,451	233.360	805,325.36	
IDEX CORP	6,584	235.210	1,548,622.64	
IDEXX LABORATORIES INC	7,187	420.630	3,023,067.81	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	26,868	219.760	5,904,511.68	
ILLUMINA INC	13,624	205.620	2,801,366.88	
INCYTE CORP	16,454	82.340	1,354,822.36	
INGERSOLL-RAND INC	35,073	53.250	1,867,637.25	
INSULET CORP	6,030	302.320	1,822,989.60	
INTEL CORP	355,616	28.240	10,042,595.84	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,408	103.330	5,001,998.64	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	78,327	147.050	11,517,985.35	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	22,219	107.260	2,383,209.94	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,900	36.080	1,078,792.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	33,786	32.070	1,083,517.02	
INTUIT INC	23,201	399.830	9,276,455.83	
INTUITIVE SURGICAL INC	30,905	270.600	8,362,893.00	
INVESCO LTD	28,975	18.350	531,691.25	
IQVIA HOLDINGS INC	16,175	208.530	3,372,972.75	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,330	181.540	1,149,148.20	
JACOBS SOLUTIONS INC	11,041	121.360	1,339,935.76	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	13,800	49.110	677,718.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,457	151.950	829,191.15	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,525	177.980	1,339,299.50	
JM SMUCKER CO	9,210	154.680	1,424,602.80	
JOHNSON & JOHNSON	227,838	175.740	40,040,250.12	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	59,776	65.770	3,931,467.52	
JPMORGAN CHASE & CO	254,026	132.160	33,572,076.16	
JUNIPER NETWORKS INC	27,993	32.380	906,413.34	
KELLOGG CO	22,064	72.340	1,596,109.76	
KEURIG DR PEPPER INC	67,675	37.930	2,566,912.75	
KEYCORP	80,202	17.420	1,397,118.84	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	15,508	180.720	2,802,605.76	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,343	136.200	3,996,516.60	

KINDER MORGAN INC	176,915	17.450	3,087,166.75	
KKR & CO INC -A	48,359	48.000	2,321,232.00	
KLA CORPORATION	12,300	393.410	4,838,943.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,997	54.780	766,755.66	
KRAFT HEINZ CO/THE	63,728	39.940	2,545,296.32	
KROGER CO	58,650	46.470	2,725,465.50	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	16,553	215.530	3,567,668.09	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	7,795	233.560	1,820,600.20	
LAM RESEARCH CORP	11,873	450.200	5,345,224.60	
LAMB WESTON HOLDING INC	12,532	85.580	1,072,488.56	
LAS VEGAS SANDS CORP	29,734	47.310	1,406,715.54	
LEAR CORP	5,240	130.390	683,243.60	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,265	106.850	1,203,665.25	
LENNAR CORP-CL A	22,069	88.500	1,953,106.50	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,785	257.590	717,388.15	
LIBERTY BROADBAND-C	10,907	88.150	961,452.05	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	11,828	19.030	225,086.84	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	27,120	19.670	533,450.40	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	6,171	41.480	255,973.08	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	14,710	41.360	608,405.60	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	17,030	61.670	1,050,240.10	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,990	31.660	442,923.40	
LINDE PLC	43,225	332.210	14,359,777.25	
LIVE NATION INC	14,885	71.770	1,068,296.45	
LKQ CORP	22,500	53.230	1,197,675.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,663	483.580	9,992,213.54	
LOEWS CORP	17,755	56.480	1,002,802.40	
LOWE'S COS INC	53,747	201.770	10,844,532.19	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,896	221.040	1,524,291.84	
LUCID GROUP INC	36,879	8.680	320,109.72	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,064	326.390	3,284,788.96	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,538	81.460	1,835,945.48	
M&T BANK CORP	15,245	151.380	2,307,788.10	
MARATHON OIL CORP	58,205	26.170	1,523,224.85	
MARATHON PETROLEUM CORP	43,062	106.830	4,600,313.46	
MARKEL CORP	1,180	1,298.060	1,531,710.80	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,261	280.930	916,112.73	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	23,916	161.160	3,854,302.56	
MARSH & MCLENNAN COS INC	43,227	171.060	7,394,410.62	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,431	356.940	1,938,541.14	

MARVELL TECHNOLOGY INC	73,917	41.500	3,067,555.50	
MASCO CORP	19,574	49.320	965,389.68	
MASIMO CORPORATION	4,282	138.490	593,014.18	
MASTERCARD INC-CLASS A	74,768	348.830	26,081,321.44	
MATCH GROUP INC	24,520	43.580	1,068,581.60	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,782	85.280	1,857,568.96	
MCDONALD'S CORP	63,770	272.040	17,347,990.80	
MCKESSON CORP	12,475	371.410	4,633,339.75	
MEDTRONIC PLC	115,182	78.590	9,052,153.38	
MERCADOLIBRE INC	3,932	896.480	3,524,959.36	
MERCK & CO INC	219,517	108.780	23,879,059.26	
META PLATFORMS INC-A	197,515	115.900	22,891,988.50	
METLIFE INC	58,456	72.190	4,219,938.64	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,947	1,455.560	2,833,975.32	
MGM MIRAGE	26,980	36.350	980,723.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	47,979	75.880	3,640,646.52	
MICRON TECHNOLOGY INC	95,456	54.870	5,237,670.72	
MICROSOFT CORP	613,809	245.420	150,641,004.78	
MODERNA INC	28,760	177.350	5,100,586.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,370	99.450	434,596.50	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,033	341.150	1,717,007.95	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	16,482	52.460	864,645.72	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	118,767	67.060	7,964,515.02	
MONGODB INC	5,904	191.750	1,132,092.00	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,849	386.100	1,486,098.90	
MONSTER BEVERAGE CORP	34,211	100.040	3,422,468.44	
MOODY'S CORP	14,289	287.970	4,114,803.33	
MORGAN STANLEY	111,513	89.470	9,977,068.11	
MOSAIC CO/THE	29,712	46.810	1,390,818.72	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,472	265.570	3,843,329.04	
MSCI INC	6,958	492.550	3,427,162.90	
NASDAQ INC	29,867	63.200	1,887,594.40	
NETAPP INC	19,006	64.290	1,221,895.74	
NETFLIX INC	38,507	320.010	12,322,625.07	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,349	117.240	978,836.76	
NEWELL BRANDS INC	34,081	13.440	458,048.64	
NEWMONT CORP	68,598	46.400	3,182,947.20	
NEWS CORP - CLASS A	33,206	18.050	599,368.30	
NEXTERA ENERGY INC	170,225	84.510	14,385,714.75	
NIKE INC	109,503	109.420	11,981,818.26	
NISOURCE INC	35,501	27.390	972,372.39	
NORDSON CORP	4,476	232.900	1,042,460.40	
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,636	244.050	5,036,215.80	

NORTHERN TRUST CORP	17,159	87.860	1,507,589.74	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,711	528.940	6,723,356.34	
NOVOCURE LTD	8,210	75.300	618,213.00	
NRG ENERGY INC	20,367	32.280	657,446.76	
NUCOR CORP	22,628	147.070	3,327,899.96	
NVIDIA CORP	215,722	170.010	36,674,897.22	
NVR INC	270	4,648.530	1,255,103.10	
NXP SEMICONDUCTORS NV	22,776	169.720	3,865,542.72	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,481	827.800	4,537,171.80	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	80,694	62.600	5,051,444.40	
OKTA INC	13,151	64.420	847,187.42	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,360	292.230	2,443,042.80	
OMNICOM GROUP	17,773	75.650	1,344,527.45	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	37,507	70.530	2,645,368.71	
ONEOK INC	38,684	63.550	2,458,368.20	
ORACLE CORP	138,527	79.860	11,062,766.22	
OTIS WORLDWIDE CORP	36,512	78.460	2,864,731.52	
OVINTIV INC	21,854	46.710	1,020,800.34	
OWENS CORNING	8,288	92.800	769,126.40	
PACCAR INC	30,246	101.260	3,062,709.96	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,124	135.110	1,097,633.64	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	144,893	7.110	1,030,189.23	
PALO ALTO NETWORKS INC	25,900	158.900	4,115,510.00	
PARAMOUNT GLOBAL	52,492	19.020	998,397.84	
PARKER HANNIFIN CORP	11,131	289.440	3,221,756.64	
PAYCHEX INC	28,065	119.510	3,354,048.15	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,418	314.130	1,387,826.34	
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,583	202.700	726,274.10	
PAYPAL HOLDINGS INC	95,143	73.570	6,999,670.51	
PENTAIR PLC	14,033	45.070	632,467.31	
PEPSICO INC	119,578	183.100	21,894,731.80	
PERKINELMER INC	10,907	139.150	1,517,709.05	
PFIZER INC	486,199	51.720	25,146,212.28	
PG&E CORP	129,371	15.540	2,010,425.34	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	134,276	102.090	13,708,236.84	
PHILLIPS 66	41,596	98.000	4,076,408.00	
PINTEREST INC- CLASS A	50,517	23.160	1,169,973.72	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,641	214.000	4,203,174.00	
PLUG POWER INC	45,174	13.360	603,524.64	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,526	154.080	5,473,846.08	
POOL CORP	3,419	331.010	1,131,723.19	

PPG INDUSTRIES INC	20,386	130.410	2,658,538.26	
PPL CORPORATION	64,234	28.950	1,859,574.30	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,413	88.070	1,885,842.91	
PROCTER & GAMBLE CO	206,721	150.920	31,198,333.32	
PROGRESSIVE CORP	50,704	129.380	6,560,083.52	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,161	101.370	3,260,160.57	
PTC INC	9,680	121.190	1,173,119.20	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,420	59.770	2,595,213.40	
PULTE GROUP INC	19,953	43.920	876,335.76	
QORVO INC	8,924	97.600	870,982.40	
QUALCOMM INC	97,280	119.050	11,581,184.00	
QUANTA SERVICES INC	12,404	148.140	1,837,528.56	
QUEST DIAGNOSTICS	10,064	148.850	1,498,026.40	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	16,773	113.460	1,903,064.58	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	127,937	98.270	12,572,368.99	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,275	750.060	6,956,806.50	
REGIONS FINANCIAL CORP	80,215	22.020	1,766,334.30	
REPLIGEN CORP	4,571	163.320	746,535.72	
REPUBLIC SERVICES INC	19,149	135.810	2,600,625.69	
RESMED INC	12,675	219.680	2,784,444.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	27,827	27.290	759,398.83	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	9,346	73.010	682,351.46	
ROBLOX CORP -CLASS A	30,803	31.650	974,914.95	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,005	259.810	2,599,399.05	
ROKU INC	10,521	51.740	544,356.54	
ROLLINS INC	19,158	38.510	737,774.58	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,203	431.330	3,969,529.99	
ROSS STORES INC	30,323	114.890	3,483,809.47	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,868	56.210	1,116,780.28	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,468	41.750	1,272,039.00	
RPM INTERNATIONAL INC	11,293	103.450	1,168,260.85	
S&P GLOBAL INC	29,509	346.750	10,232,245.75	
SALESFORCE INC	86,648	131.110	11,360,419.28	
SCHLUMBERGER LTD	122,583	46.970	5,757,723.51	
SEA LTD-ADR	31,347	60.650	1,901,195.55	
SEAGATE TECHNOLOGY	17,111	54.140	926,389.54	
SEAGEN INC	12,035	124.000	1,492,340.00	
SEALED AIR CORP	12,600	50.780	639,828.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,791	60.670	594,019.97	
SEMPRA ENERGY	27,284	161.150	4,396,816.60	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,548	43.460	588,796.08	

SERVICENOW INC	17,500	393.580	6,887,650.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,340	252.880	5,396,459.20	
SIGNATURE BANK	5,396	118.560	639,749.76	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,736	6.110	419,976.96	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,881	94.520	1,312,032.12	
SMITH (A.O.) CORP	11,153	58.300	650,219.90	
SNAP INC - A	96,598	9.450	912,851.10	
SNAP-ON INC	4,596	233.840	1,074,728.64	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,316	144.530	2,791,741.48	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,824	314.800	1,518,595.20	
SOUTHERN CO	94,524	68.360	6,461,660.64	
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,500	38.010	475,125.00	
SPLUNK INC	14,119	87.540	1,235,977.26	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	20,117	51.740	1,040,853.58	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,833	79.230	1,016,758.59	
STARBUCKS CORP	99,434	101.790	10,121,386.86	
STATE STREET CORP	31,723	79.030	2,507,068.69	
STEEL DYNAMICS INC	15,726	108.410	1,704,855.66	
STERIS PLC	8,662	191.960	1,662,757.52	
STRYKER CORP	29,495	244.630	7,215,361.85	
SVB FINANCIAL GROUP	5,085	220.270	1,120,072.95	
SYNCHRONY FINANCIAL	41,473	35.110	1,456,117.03	
SYNOPSIS INC	13,231	325.750	4,309,998.25	
SYSCO CORP	43,867	82.230	3,607,183.41	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,362	119.830	2,320,148.46	
T-MOBILE US INC	54,511	141.570	7,717,122.27	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14,453	102.060	1,475,073.18	
TARGA RESOURCES CORP	18,506	68.620	1,269,881.72	
TARGET CORP	39,825	152.280	6,064,551.00	
TE CONNECTIVITY LTD	27,738	121.730	3,376,546.74	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,079	405.690	1,654,809.51	
TELEFLEX INC	4,057	247.340	1,003,458.38	
TERADYNE INC	13,535	92.410	1,250,769.35	
TESLA, INC.	230,761	179.050	41,317,757.05	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	96,352	8.440	813,210.88	
TEXAS INSTRUMENTS INC	79,186	174.260	13,798,952.36	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	535	2,380.080	1,273,342.80	
TEXTRON INC	18,177	71.710	1,303,472.67	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,943	560.230	19,015,886.89	
TJX COS INC	100,655	78.060	7,857,129.30	
TOAST INC-CLASS A	21,340	19.300	411,862.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,602	218.320	2,096,308.64	

TRADE DESK INC/THE - CLASS A	38,404	47.810	1,836,095.24	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,319	64.550	601,541.45	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,133	175.260	3,528,509.58	
TRANSDIGM GROUP INC	4,473	609.700	2,727,188.10	
TRANSUNION	16,664	58.930	982,009.52	
TRAVELERS COS INC/THE	20,489	185.650	3,803,782.85	
TRIMBLE INC	21,443	57.500	1,232,972.50	
TRUIST FINANCIAL CORP	115,093	42.080	4,843,113.44	
TWILIO INC - A	15,187	45.550	691,767.85	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,599	323.080	1,162,764.92	
TYSON FOODS INC-CL A	24,939	63.750	1,589,861.25	
UBER TECHNOLOGIES INC	129,370	26.550	3,434,773.50	
UGI CORP	18,108	38.360	694,622.88	
ULTA BEAUTY INC	4,422	471.630	2,085,547.86	
UNION PACIFIC CORP	54,473	211.350	11,512,868.55	
UNITED PARCEL SERVICE INC	63,614	177.640	11,300,390.96	
UNITED RENTALS INC	6,037	352.630	2,128,827.31	
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,043	539.200	43,698,385.60	
UNITY SOFTWARE INC	21,436	33.930	727,323.48	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	5,660	127.330	720,687.80	
US BANCORP	122,271	43.110	5,271,102.81	
VAIL RESORTS INC	3,527	258.640	912,223.28	
VALERO ENERGY CORP	34,050	114.650	3,903,832.50	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,133	172.170	2,088,938.61	
VERISIGN INC	8,350	197.670	1,650,544.50	
VERISK ANALYTICS INC	13,583	182.510	2,479,033.33	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	364,222	37.400	13,621,902.80	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,222	312.220	6,938,152.84	
VF CORP	28,817	28.200	812,639.40	
VIATRIS INC	104,937	10.780	1,131,220.86	
VISA INC-CLASS A SHARES	141,683	208.700	29,569,242.10	
VISTRA CORP	32,814	23.860	782,942.04	
VMWARE INC-CLASS A	18,346	120.940	2,218,765.24	
VULCAN MATERIALS CO	11,594	182.450	2,115,325.30	
WABTEC CORP	15,043	100.390	1,510,166.77	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,438	40.430	2,564,798.34	
WALMART INC	130,526	145.310	18,966,733.06	
WALT DISNEY CO	157,993	93.380	14,753,386.34	
WARNER BROS DISCOVERY INC	199,903	11.090	2,216,924.27	
WASTE CONNECTIONS INC	22,307	139.940	3,121,641.58	

WASTE MANAGEMENT INC	35,815	166.830	5,975,016.45	
WATERS CORP	5,178	336.530	1,742,552.34	
WEBSTER FINANCIAL CORP	15,146	47.210	715,042.66	
WEC ENERGY GROUP INC	27,401	95.730	2,623,097.73	
WELLS FARGO & CO	328,462	42.500	13,959,635.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,389	239.010	1,527,034.89	
WESTERN DIGITAL CORP	27,205	35.710	971,490.55	
WESTERN UNION CO	33,570	13.980	469,308.60	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,245	106.660	346,111.70	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	22,068	35.880	791,799.84	
WEYERHAEUSER CO	64,090	31.480	2,017,553.20	
WHIRLPOOL CORP	4,725	143.810	679,502.25	
WILLIAMS COS INC	105,773	32.590	3,447,142.07	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,511	244.530	2,325,724.83	
WIX.COM LTD	5,002	82.740	413,865.48	
WOLFSPEED INC	10,756	82.670	889,198.52	
WORKDAY INC-CLASS A	17,407	169.600	2,952,227.20	
WR BERKLEY CORP	18,218	73.560	1,340,116.08	
WW GRAINGER INC	3,969	588.060	2,334,010.14	
WYNN RESORTS LTD	9,363	84.990	795,761.37	
XCEL ENERGY INC	47,492	69.840	3,316,841.28	
XYLEM INC	15,602	111.230	1,735,410.46	
YUM! BRANDS INC	24,635	127.710	3,146,135.85	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,470	251.450	1,123,981.50	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	13,877	35.100	487,082.70	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,594	18.570	141,020.58	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,210	124.400	2,265,324.00	
ZOETIS INC	40,565	153.390	6,222,265.35	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19,522	72.160	1,408,707.52	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	22,805	29.040	662,257.20	
ZSCALER INC	7,382	117.210	865,244.22	
アメリカ・ドル 小計	29,554,384		2,944,424,996.14 (402,679,562,470)	
イギリス・ポンド				
3I GROUP PLC	82,542	13.380	1,104,411.96	
ABRDN PLC	183,576	1.852	339,982.75	
ADMIRAL GROUP PLC	15,515	20.150	312,627.25	
ANGLO AMERICAN PLC	109,713	31.900	3,499,844.70	
ANTOFAGASTA PLC	33,802	14.570	492,495.14	
ASHTED GROUP PLC	38,100	49.020	1,867,662.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,056	16.390	509,007.84	
ASTRAZENECA PLC	134,304	113.540	15,248,876.16	

AUTO TRADER GROUP PLC-WI	80,922	5.622	454,943.48	
AVEVA GROUP PLC	10,550	32.000	337,600.00	
AVIVA PLC	244,297	4.480	1,094,450.56	
BAE SYSTEMS PLC	270,960	8.256	2,237,045.76	
BARCLAYS PLC	1,383,830	1.594	2,205,825.02	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	88,577	4.079	361,305.58	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	9,414	38.100	358,673.40	
BP PLC	1,632,335	4.619	7,539,755.36	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	185,314	33.160	6,145,012.24	
BT GROUP PLC	602,147	1.135	683,436.84	
BUNZL PLC	29,376	30.230	888,036.48	
BURBERRY GROUP PLC	34,109	21.370	728,909.33	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,262	19.900	343,513.80	
COMPASS GROUP PLC	153,287	19.195	2,942,343.96	
CRODA INTERNATIONAL PLC	12,043	67.960	818,442.28	
DCC PLC	8,615	42.960	370,100.40	
DIAGEO PLC	197,419	37.430	7,389,393.17	
ENTAIN PLC	50,978	13.995	713,437.11	
EXPERIAN PLC	79,603	28.950	2,304,506.85	
GLENCORE PLC	845,252	5.425	4,585,492.10	
GSK PLC	352,189	14.578	5,134,211.24	
HALEON PLC	438,200	3.146	1,378,577.20	
HALMA PLC	32,845	21.330	700,583.85	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	30,489	8.648	263,668.87	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,215	14.810	210,524.15	
HSBC HOLDINGS PLC	1,730,928	4.962	8,588,864.73	
IMPERIAL BRANDS PLC	78,193	20.770	1,624,068.61	
INFORMA PLC	127,322	6.266	797,799.65	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	16,206	49.860	808,031.16	
INTERTEK GROUP PLC	14,127	40.800	576,381.60	
JD SPORTS FASHION PLC	218,145	1.229	268,100.20	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,955	20.720	330,587.60	
KINGFISHER PLC	166,908	2.416	403,249.72	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	518,094	2.547	1,319,585.41	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,905,568	0.464	2,740,183.55	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	28,615	74.060	2,119,226.90	
M&G PLC	224,948	1.839	413,679.37	
MELROSE INDUSTRIES PLC	356,390	1.273	453,684.47	
MONDI PLC/WI	41,966	14.875	624,244.25	
NATIONAL GRID PLC	317,946	10.170	3,233,510.82	
NATWEST GROUP PLC	459,510	2.637	1,211,727.87	
NEXT PLC	11,073	58.460	647,327.58	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	

OCADO GROUP PLC	49,999	6.862	343,093.13		
PEARSON PLC	57,553	9.366	539,041.39		
PERSIMMON PLC	27,565	12.820	353,383.30		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	69,831	6.038	421,639.57		
PRUDENTIAL PLC	237,619	10.905	2,591,235.19		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	62,116	58.400	3,627,574.40		
RELX PLC	166,408	23.290	3,875,642.32		
RENTOKIL INITIAL PLC	217,379	5.350	1,162,977.65		
RIO TINTO PLC	97,199	58.350	5,671,561.65		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	732,590	0.940	688,634.60		
SAGE GROUP PLC	88,652	7.788	690,421.77		
SAINSBURY (J) PLC	147,359	2.264	333,620.77		
SCHRODERS PLC	62,921	4.520	284,402.92		
SEVERN TRENT PLC	22,097	27.400	605,457.80		
SHELL PLC-NEW	629,031	22.860	14,379,648.66		
SMITH & NEPHEW PLC	75,547	10.980	829,506.06		
SMITHS GROUP PLC	31,514	16.140	508,635.96		
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,373	109.950	700,711.35		
SSE PLC	92,492	16.960	1,568,664.32		
ST JAMES'S PLACE PLC	48,186	11.385	548,597.61		
STANDARD CHARTERED PLC	216,639	5.990	1,297,667.61		
TAYLOR WIMPEY PLC	306,756	1.043	319,946.50		
TESCO PLC	644,589	2.279	1,469,018.33		
UNILEVER PLC	220,703	41.255	9,105,102.26		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	59,742	10.340	617,732.28		
VODAFONE GROUP PLC	2,310,016	0.867	2,002,783.87		
WHITBREAD PLC	17,286	26.370	455,831.82		
WPP PLC	94,644	8.400	795,009.60		
イギリス・ボンド 小計	24,462,294		155,512,497.76 (26,001,689,625)		
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	3,677	242.500	891,672.50	
	BANK HAPOLIM BM	109,931	32.210	3,540,877.51	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	133,756	31.150	4,166,499.40	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	182,644	5.920	1,081,252.48	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,315	589.000	1,363,535.00	
	ICL GROUP LTD	61,345	28.150	1,726,861.75	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	106,584	20.050	2,137,009.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	13,561	123.300	1,672,071.30	
	NICE LTD	5,507	675.800	3,721,630.60	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	9,593	157.000	1,506,101.00	
イスラエル・シュケル 小計	628,913		21,807,510.74 (869,934,315)		

オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	22,702	27.090	614,997.18	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	53,546	34.010	1,821,099.46	
	ASX LTD	18,240	68.010	1,240,502.40	
	AURIZON HOLDINGS LTD	199,691	3.800	758,825.80	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	264,885	23.640	6,261,881.40	
	BHP GROUP LIMITED	440,595	47.480	20,919,450.60	
	BLUESCOPE STEEL LTD	43,320	18.220	789,290.40	
	BRAMBLES LTD	129,201	11.940	1,542,659.94	
	COCHLEAR LTD	6,100	208.680	1,272,948.00	
	COLES GROUP LTD	121,996	16.830	2,053,192.68	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	148,481	104.980	15,587,535.38	
	COMPUTERSHARE LIMITED	49,525	26.520	1,313,403.00	
	CSL LIMITED	42,104	298.460	12,566,359.84	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	124,139	6.980	866,490.22	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	148,328	21.390	3,172,735.92	
	IDP EDUCATION LTD	19,296	27.680	534,113.28	
	IGO LTD	60,822	15.040	914,762.88	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	230,642	4.790	1,104,775.18	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	39,829	29.260	1,165,396.54	
	LOTTERY CORP LTD/THE	211,437	4.800	1,014,897.60	
	MACQUARIE GROUP LTD	32,565	168.040	5,472,222.60	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	259,889	3.020	784,864.78	
	MINERAL RESOURCES LTD	15,141	90.500	1,370,260.50	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	279,354	30.190	8,433,697.26	
	NEWCREST MINING LIMITED	81,175	21.380	1,735,521.50	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	105,140	11.140	1,171,259.60	
	ORICA LTD	43,294	15.440	668,459.36	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	157,823	7.800	1,231,019.40	
	PILBARA MINERALS LTD	222,508	4.470	994,610.76	
	QANTAS AIRWAYS LTD	86,875	6.210	539,493.75	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	134,717	12.950	1,744,585.15	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	17,167	65.880	1,130,961.96	
	REA GROUP LTD	5,177	121.220	627,555.94	
	REECE LTD	22,550	14.600	329,230.00	
RIO TINTO LTD	32,799	117.160	3,842,730.84		
SANTOS LTD	287,585	7.060	2,030,350.10		
SEEK LTD	32,128	21.800	700,390.40		
SONIC HEALTHCARE LTD	41,805	30.200	1,262,511.00		
SOUTH32 LTD	412,048	4.190	1,726,481.12		

	SUNCORP GROUP LTD	118,360	11.790	1,395,464.40	
	TELSTRA GROUP LTD	406,709	4.000	1,626,836.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	68,685	13.720	942,358.20	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	21,479	27.760	596,257.04	
	WESFARMERS LIMITED	100,852	47.920	4,832,827.84	
	WESTPAC BANKING CORP	308,010	23.440	7,219,754.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,321	53.500	712,673.50	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	166,040	34.180	5,675,247.20	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	108,114	34.450	3,724,527.30	
	XERO LTD	12,494	70.010	874,704.94	
	オーストラリア・ドル 小計	5,968,683		138,912,174.54 (12,832,706,684)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	39,411	69.510	2,739,458.61	
	AIR CANADA	16,023	18.900	302,834.70	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	60,911	9.780	595,709.58	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	70,803	61.780	4,374,209.34	
	ALTAGAS LTD	25,227	24.500	618,061.50	
	ARC RESOURCES LTD	56,706	17.800	1,009,366.80	
	BANK OF MONTREAL	58,221	126.160	7,345,161.36	
	BANK OF NOVA SCOTIA	103,936	68.660	7,136,245.76	
	BARRICK GOLD CORP	152,743	22.660	3,461,156.38	
	BCE INC	7,610	63.340	482,017.40	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	122,100	58.880	7,189,248.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,480	42.150	483,882.00	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,159	104.710	330,778.89	
	CAE INC	27,579	27.770	765,868.83	
	CAMECO CORP	37,352	29.550	1,103,751.60	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	78,496	58.520	4,593,585.92	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	51,450	170.040	8,748,558.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	97,117	74.650	7,249,784.05	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	81,537	107.770	8,787,242.49	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,863	149.750	728,234.25	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	12,119	37.320	452,281.08	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,082	60.590	792,638.38	
	CENOVUS ENERGY INC	120,292	24.190	2,909,863.48	
	CGI INC	18,444	116.160	2,142,455.04	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,750	2,088.990	3,655,732.50	

DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	7,444	93.380	695,120.72	
DOLLARAMA INC	24,071	82.430	1,984,172.53	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	34,784	19.300	671,331.20	
EMERA INC	23,870	53.360	1,273,703.20	
EMPIRE CO LTD 'A'	13,980	36.970	516,840.60	
ENBRIDGE INC	176,421	53.390	9,419,117.19	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,006	791.490	1,587,728.94	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	50,767	32.680	1,659,065.56	
FIRSTSERVICE CORP	3,531	168.710	595,715.01	
FORTIS INC	42,819	54.980	2,354,188.62	
FRANCO-NEVADA CORP	16,576	192.230	3,186,404.48	
GEORGE WESTON LTD	6,211	178.570	1,109,098.27	
GFL ENVIRONMENTAL INC- SUB VT	16,515	38.460	635,166.90	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,827	39.460	624,533.42	
GREAT-WEST LIFECO INC	25,321	30.450	771,024.45	
HYDRO ONE LTD	30,015	37.280	1,118,959.20	
IA FINANCIAL CORP INC	9,215	76.720	706,974.80	
IGM FINANCIAL INC	7,496	38.650	289,720.40	
IMPERIAL OIL LTD	19,347	68.220	1,319,852.34	
INTACT FINANCIAL CORP	15,308	203.970	3,122,372.76	
IVANHOE MINES LTD-CL A	52,346	12.170	637,050.82	
KEYERA CORP	19,692	29.700	584,852.40	
KINROSS GOLD CORP	110,406	5.740	633,730.44	
LOBLAW COS LTD	14,106	125.550	1,771,008.30	
LUNDIN MINING CORP	56,400	8.300	468,120.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,924	79.450	1,900,761.80	
MANULIFE FINANCIAL CORP	166,111	24.190	4,018,225.09	
METRO INC	20,826	78.380	1,632,341.88	
NATIONAL BANK OF CANADA	29,264	94.960	2,778,909.44	
NORTHLAND POWER INC	20,930	37.860	792,409.80	
NUTRIEN LTD	46,657	104.800	4,889,653.60	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,669	36.820	208,732.58	
ONEX CORPORATION	6,234	64.250	400,534.50	
OPEN TEXT CORP	23,585	38.400	905,664.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,452	22.420	413,693.84	
PARKLAND CORP	14,201	29.920	424,893.92	
PEMBINA PIPELINE CORP	48,566	45.830	2,225,779.78	
POWER CORP OF CANADA	48,260	33.000	1,592,580.00	
QUEBECOR INC -CL B	13,982	28.110	393,034.02	
RESTAURANT BRANDS INTERN	25,390	90.820	2,305,919.80	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	9,700	77.190	748,743.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	31,334	60.830	1,906,047.22	

	ROYAL BANK OF CANADA	120,849	130.910	15,820,342.59	
	SAPUTO INC	22,011	34.110	750,795.21	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	42,019	36.660	1,540,416.54	
	SHOPIFY INC - CLASS A	102,785	52.400	5,385,934.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	51,246	63.250	3,241,309.50	
	SUNCOR ENERGY INC	118,343	40.380	4,778,690.34	
	TC ENERGY CORP	88,028	57.740	5,082,736.72	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	41,121	50.060	2,058,517.26	
	TFI INTERNATIONAL INC	7,172	141.740	1,016,559.28	
	THOMSON REUTERS CORP	14,937	156.920	2,343,914.04	
	TMX GROUP LTD	5,015	138.040	692,270.60	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,268	99.890	726,000.52	
	TORONTO-DOMINION BANK	157,794	90.550	14,288,246.70	
	TOURMALINE OIL CORP	27,512	74.160	2,040,289.92	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,073	103.870	526,932.51	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	38,946	53.220	2,072,706.12	
	WSP GLOBAL INC	10,791	161.730	1,745,228.43	
カナダ・ドル 小計		3,480,880		207,382,793.04 (20,759,017,583)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,700	3.630	812,031.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	35,600	8.200	291,920.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	156,900	33.390	5,238,891.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	537,900	0.890	478,731.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,600	28.170	242,262.00	
	KEPPEL CORP LTD	131,000	7.480	979,880.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	294,200	12.300	3,618,660.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	116,600	5.490	640,134.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	75,200	9.210	692,592.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	140,900	3.330	469,197.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	725,000	2.640	1,914,000.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,300	31.050	3,176,415.00	
	UOL Group Limited	43,700	6.700	292,790.00	
	VENTURE CORP LTD	24,400	17.360	423,584.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	166,600	4.050	674,730.00		
シンガポール・ドル 小計		2,782,600		19,945,817.00 (2,013,330,768)	
スイス・フラン	ABB LTD	136,187	29.180	3,973,936.66	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,880	31.110	431,806.80	
	ALCON INC	43,303	64.580	2,796,507.74	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	2,850	85.650	244,102.50	
	BALOISE HOLDING AG	4,028	143.500	578,018.00	

BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,806	89.750	251,838.50	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	314	1,837.000	576,818.00	
BKW AG	1,866	127.500	237,915.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	88	9,740.000	857,120.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	10	96,700.000	967,000.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON- REG	45,260	123.300	5,580,558.00	
CLARIANT AG	18,938	14.960	283,312.48	
CREDIT SUISSE GROUP AG	233,333	3.141	732,898.95	
EMS-CHEMIE HOLDING AG- REG	599	655.500	392,644.50	
GEBERIT AG-REG	3,093	454.200	1,404,840.60	
GIVAUDAN-REG	800	3,051.000	2,440,800.00	
HOLCIM LTD	48,238	48.630	2,345,813.94	
JULIUS BAER GROUP LTD	18,564	54.320	1,008,396.48	
KUEHNE & NAGEL INTL AG- REG	4,736	218.300	1,033,868.80	
LOGITECH INTERNATIONAL- REG	14,910	56.660	844,800.60	
LONZA GROUP AG	6,444	457.300	2,946,841.20	
NESTLE SA	238,287	109.240	26,030,471.88	
NOVARTIS AG	187,443	85.480	16,022,627.64	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,947	874.200	1,702,067.40	
ROCHE HOLDING AG	60,827	304.600	18,527,904.20	
ROCHE HOLDING AG-BR	2,333	375.200	875,341.60	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,349	170.800	401,209.20	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,258	179.950	586,277.10	
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	551	2,175.000	1,198,425.00	
SIG GROUP AG	26,690	21.260	567,429.40	
SIKA AG-BEARER	12,643	238.800	3,019,148.40	
SONOVA HOLDING AG-REG	4,612	244.400	1,127,172.80	
STRAUMANN HOLDING AG	9,584	109.000	1,044,656.00	
SWATCH GROUP AG	2,209	261.600	577,874.40	
SWISS LIFE HOLDING AG- REG	2,674	495.000	1,323,630.00	
SWISS PRIME SITE-REG	6,784	79.700	540,684.80	
SWISS RE AG	26,289	87.040	2,288,194.56	
SWISSCOM AG	2,266	512.600	1,161,551.60	
TEMENOS GROUP AG-REG	5,497	53.340	293,209.98	
THE SWATCH GROUP AG-REG	6,247	47.780	298,481.66	
UBS GROUP AG	289,804	17.125	4,962,893.50	
VAT GROUP AG	2,279	275.000	626,725.00	

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,045	452.600	5,904,167.00	
スイス・フラン	小計	1,507,865		119,009,981.87 (17,381,407,852)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	25,007	308.100	7,704,656.70	
	ASSA ABLOY AB	87,389	236.700	20,684,976.30	
	ATLAS COPCO AB	136,387	118.660	16,183,681.42	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	231,129	131.000	30,277,899.00	
	BIOVITRUM	14,788	212.500	3,142,450.00	
	BOLIDEN AB	23,572	399.200	9,409,942.40	
	ELECTROLUX AB	19,243	148.380	2,855,276.34	
	EMBRACER GROUP AB	56,592	50.050	2,832,429.60	
	EPIROC AB-A	56,197	193.950	10,899,408.15	
	EPIROC AB-B	34,671	170.200	5,901,004.20	
	EQT AB	25,492	243.400	6,204,752.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	53,123	267.500	14,210,402.50	
	EVOLUTION AB	15,802	1,073.000	16,955,546.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	52,398	50.180	2,629,331.64	
	GETINGE AB-B SHS	19,459	241.500	4,699,348.50	
	HENNES & MAURITZ AB	63,441	117.600	7,460,661.60	
	HEXAGON AB-B SHS	168,612	119.550	20,157,564.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	8,192	442.000	3,620,864.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	35,535	81.100	2,881,888.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,203	259.400	1,609,058.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	19,406	258.700	5,020,332.20	
	INDUTRADE AB	22,907	220.500	5,050,993.50	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	12,510	208.200	2,604,582.00	
	INVESTOR AB	156,284	193.900	30,303,467.60	
	INVESTOR AB-A SHS	45,421	200.700	9,115,994.70	
	KINNEVIK AB - B	20,469	151.700	3,105,147.30	
	LIFCO AB-B SHS	19,843	186.200	3,694,766.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,644	453.500	3,013,054.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	130,987	104.700	13,714,338.90	
	NORDEA BANK ABP	291,969	108.520	31,684,475.88	
	SAGAX AB-B	16,055	243.400	3,907,787.00	
	SANDVIK AB	92,194	189.350	17,456,933.90	
	SECURITAS AB	42,368	84.860	3,595,348.48	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	140,249	118.750	16,654,568.75		
SKANSKA AB-B SHS	29,799	168.600	5,024,111.40		
SKF AB	33,157	172.950	5,734,503.15		
SVENSKA CELLULOSA AB	52,716	144.850	7,635,912.60		
SVENSKA HANDELSBANKEN	127,467	102.650	13,084,487.55		
SWEDBANK AB - A SHARES	78,448	169.600	13,304,780.80		
TELE2 AB	51,329	94.080	4,829,032.32		

	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	252,909	67.690	17,119,410.21	
	TELIA CO AB	239,772	28.290	6,783,149.88	
	VOLVO AB	127,289	194.500	24,757,710.50	
	VOLVO AB-A SHS	20,628	204.400	4,216,363.20	
	VOLVO CAR AB-B	51,142	50.410	2,578,068.22	
スウェーデン・クローナ 小計		3,215,194		444,310,463.09 (5,869,341,217)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	427	14,920.000	6,370,840.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	289	14,660.000	4,236,740.00	
	CARLSBERG AS-B	8,366	913.400	7,641,504.40	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	9,180	444.200	4,077,756.00	
	COLOPLAST-B	10,262	853.800	8,761,695.60	
	DANSKE BANK A/S	59,915	129.000	7,729,035.00	
	DEMANT A/S	7,621	192.750	1,468,947.75	
	DSV A/S	16,519	1,087.000	17,956,153.00	
	GENMAB A/S	5,694	3,212.000	18,289,128.00	
	NOVO-NORDISK A/S	143,343	921.700	132,119,243.10	
	NOVOZYMES A/S	17,610	431.000	7,589,910.00	
	ORSTED A/S	16,298	639.200	10,417,681.60	
	PANDORA A/S	7,628	533.400	4,068,775.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	745	1,557.500	1,160,337.50	
	TRYGVESTA AS	31,778	163.350	5,190,936.30	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	87,499	203.300	17,788,546.70		
デンマーク・クローネ 小計		423,174		254,867,230.15 (4,926,583,559)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	119,484	8.070	964,235.88	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	50,109	22.580	1,131,461.22	
	MERCURY NZ LTD	63,181	5.520	348,759.12	
	MERIDIAN ENERGY LTD	115,394	5.050	582,739.70	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	171,855	5.270	905,675.85	
ニュージーランド・ドル 小計		520,023		3,932,871.77 (343,418,363)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	25,762	69.400	1,787,882.80	
	AKER BP ASA	27,436	296.900	8,145,748.40	
	DNB BANK ASA	81,592	184.950	15,090,440.40	
	EQUINOR ASA	82,310	358.200	29,483,442.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	17,901	192.600	3,447,732.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	7,758	411.800	3,194,744.40	
	MOWI ASA	35,722	155.700	5,561,915.40	
	NORSK HYDRO ASA	116,182	74.660	8,674,148.12	
	ORKLA ASA	66,435	70.160	4,661,079.60	
	SALMAR ASA	5,605	360.600	2,021,163.00	
	TELENOR ASA	64,219	93.160	5,982,642.04	

	YARA INTERNATIONAL ASA	14,430	432.500	6,240,975.00	
ノルウェー・クローネ 小計		545,352		94,291,913.76 (1,288,970,461)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	34,811	12.590	438,270.49	
	ACCIONA SA	2,098	178.300	374,073.40	
	ACCOR	14,774	26.040	384,714.96	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,392	27.260	528,625.92	
	ADIDAS AG	14,992	118.900	1,782,548.80	
	ADP	2,931	133.800	392,167.80	
	ADYEN NV	1,877	1,411.000	2,648,447.00	
	AEGON NV	152,383	4.690	714,676.27	
	AENA SME SA	6,983	127.100	887,539.30	
	AGEAS	13,949	42.230	589,066.27	
	AIB GROUP PLC	90,821	3.170	287,902.57	
	AIR LIQUIDE	45,410	136.840	6,213,904.40	
	AIRBUS SE	51,181	111.640	5,713,846.84	
	AKZO NOBEL NV	15,734	65.140	1,024,912.76	
	ALLIANZ SE	35,405	204.700	7,247,403.50	
	ALSTOM RGPT	27,802	24.040	668,360.08	
	AMADEUS IT GROUP SA	38,948	51.900	2,021,401.20	
	AMPLIFON SPA	10,778	27.970	301,460.66	
	AMUNDI SA	5,243	54.850	287,578.55	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	75,355	56.880	4,286,192.40	
	ARCELORMITTAL	44,398	25.955	1,152,350.09	
	ARGENX SE	4,794	369.400	1,770,903.60	
	ARKEMA	4,977	85.840	427,225.68	
	AROUNDTOWN SA	89,248	2.388	213,124.22	
	ASM INTERNATIONAL NV	4,044	273.250	1,105,023.00	
	ASML HOLDING NV	35,220	577.300	20,332,506.00	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	95,722	17.315	1,657,426.43	
	AXA SA	161,386	27.350	4,413,907.10	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	521,830	5.533	2,887,285.39	
	BANCO SANTANDER SA	1,445,600	2.786	4,027,441.60	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	92,221	8.018	739,427.97	
	BASF SE	79,496	47.720	3,793,549.12	
	BAYER AG	85,159	52.880	4,503,207.92	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,567	84.540	2,415,054.18		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	5,058	80.700	408,180.60		
BECHTLE AG	7,010	36.190	253,691.90		
BEIERSDORF AG	8,805	105.950	932,889.75		
BIOMERIEUX	3,620	96.960	350,995.20		
BNP PARIBAS	96,040	52.890	5,079,555.60		

BOLLORE SE	77,796	5.280	410,762.88	
BOUYGUES	20,197	29.440	594,599.68	
BRENTAG SE	13,373	59.940	801,577.62	
BUREAU VERITAS SA	25,663	24.990	641,318.37	
CAIXABANK	382,469	3.304	1,263,677.57	
CAPGEMINI SA	14,144	171.950	2,432,060.80	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,449	121.650	419,570.85	
CARREFOUR SA	51,124	16.525	844,824.10	
CELLNEX TELECOM SAU	47,215	32.790	1,548,179.85	
CIE DE SAINT-GOBAIN	42,647	46.800	1,995,879.60	
CNH INDUSTRIAL NV	88,555	15.350	1,359,319.25	
COMMERZBANK AG	91,224	7.914	721,946.73	
CONTINENTAL AG	9,490	57.140	542,258.60	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,614	36.460	204,686.44	
COVESTRO AG	16,429	36.670	602,451.43	
CREDIT AGRICOLE SA	105,284	9.553	1,005,778.05	
CRH PLC	65,298	37.630	2,457,163.74	
D' IETEREN GROUP	2,134	181.400	387,107.60	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,044	30.910	1,206,850.04	
DANONE	55,667	50.210	2,795,040.07	
DASSAULT AVIATION SA	2,152	156.100	335,927.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	57,677	34.785	2,006,294.44	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	45,202	9.956	450,031.11	
DELIVERY HERO SE	14,856	40.000	594,240.00	
DEUTSCHE BANK AG	178,686	10.140	1,811,876.04	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,529	172.150	2,845,467.35	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	51,350	7.717	396,267.95	
DEUTSCHE POST AG	86,645	38.255	3,314,604.47	
DEUTSCHE TELEKOM AG	282,096	19.324	5,451,223.10	
DIASORIN ITALIA SPA	2,185	130.700	285,579.50	
DR ING HC F PORSCHE AG	9,882	101.400	1,002,034.80	
E.ON SE	194,610	9.182	1,786,909.02	
EDENRED	21,784	52.500	1,143,660.00	
EDF	50,931	12.000	611,172.00	
EDP RENOVAVEIS SA	24,431	21.530	525,999.43	
EIFFAGE	7,321	96.100	703,548.10	
ELIA GROUP SA/NV	2,925	138.900	406,282.50	
ELISA OYJ	12,591	50.920	641,133.72	
ENAGAS SA	21,440	17.045	365,444.80	
ENDESA SA	27,553	17.835	491,407.75	
ENEL SPA	705,639	5.222	3,684,846.85	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	241,615	4.578	1,106,113.47	
ENGIE	158,369	14.384	2,277,979.69	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	215,808	13.526	2,919,019.00	
ERSTE GROUP BANK AG	29,954	28.820	863,274.28	
ESSILORLUXOTTICA	25,195	179.750	4,528,801.25	

EURAZEO	3,790	60.250	228,347.50	
EUROFINS SCIENTIFIC	11,611	66.180	768,415.98	
EURONEXT NV	7,553	70.760	534,450.28	
EVONIK INDUSTRIES AG	18,165	18.125	329,240.62	
EXOR NV	9,607	73.820	709,188.74	
FERRARI NV	10,947	209.400	2,292,301.80	
FERROVIAL S.A.	43,166	25.690	1,108,934.54	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	189,117	13.724	2,595,441.70	
FINECOBANK SPA	52,629	15.480	814,696.92	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	14,470	139.450	2,017,841.50	
FORTUM OYJ	38,628	15.510	599,120.28	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	17,912	30.340	543,450.08	
FRESENIUS SE & CO KGAA	36,578	26.670	975,535.26	
GALP ENERGIA SGPS SA	44,181	11.670	515,592.27	
GEA GROUP AG	13,100	39.910	522,821.00	
GETLINK SE - REGR	41,031	15.755	646,443.40	
GRIFOLS SA	25,819	10.190	263,095.61	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,088	76.840	698,321.92	
HANNOVER RUECK SE	5,246	187.450	983,362.70	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,368	52.100	644,372.80	
HEINEKEN HOLDING NV	8,734	73.400	641,075.60	
HEINEKEN NV	22,461	89.740	2,015,650.14	
HELLOFRESH SE	14,078	24.120	339,561.36	
HENKEL AG & CO KGAA	9,898	63.200	625,553.60	
HENKEL KGAA-VORZUG	14,813	67.620	1,001,655.06	
HERMES INTERNATIONAL	2,744	1,528.500	4,194,204.00	
IBERDROLA SA	523,141	10.995	5,751,935.29	
IMCD NV	4,883	147.050	718,045.15	
INDITEX SA	94,278	24.480	2,307,925.44	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	113,082	31.285	3,537,770.37	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	31,685	9.480	300,373.80	
ING GROEP NV-CVA	325,629	11.354	3,697,191.66	
INTESA SANPAOLO	1,446,399	2.067	2,989,706.73	
IPSEN	3,227	102.600	331,090.20	
JDE PEET'S BV	8,818	27.680	244,082.24	
JERONIMO MARTINS	24,242	20.460	495,991.32	
JUST EAT TAKEAWAY	16,138	21.375	344,949.75	
KBC GROEP NV	21,483	56.120	1,205,625.96	
KERING	6,487	523.500	3,395,944.50	
KERRY GROUP PLC-A	13,786	85.940	1,184,768.84	
KESKO OYJ-B SHS	23,193	20.950	485,893.35	
KINGSPAN GROUP PLC	13,302	53.160	707,134.32	
KNORR-BREMSE AG	6,275	51.700	324,417.50	
KONE OYJ	29,479	48.600	1,432,679.40	

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	89,850	28.550	2,565,217.50	
KONINKLIJKE DSM NV	15,109	121.850	1,841,031.65	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77,073	13.546	1,044,030.85	
L'OREAL SA	20,905	355.000	7,421,275.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,994	38.710	348,157.74	
LEG IMMOBILIEN SE	6,379	63.120	402,642.48	
LEGRAND SA	23,118	79.120	1,829,096.16	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,980	720.300	17,272,794.00	
MEDIOBANCA SPA	53,448	9.182	490,759.53	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	69,330	64.790	4,491,890.70	
MERCK KGAA	11,163	180.000	2,009,340.00	
MICHELIN (C.G.D.E.)	58,637	26.650	1,562,676.05	
MONCLER SPA	17,756	49.370	876,613.72	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,633	205.000	949,765.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	12,132	308.400	3,741,508.80	
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,630	26.560	335,452.80	
NEMETSCHEK SE	4,922	47.570	234,139.54	
NESTE OYJ	36,498	45.740	1,669,418.52	
NEXI SPA	51,110	7.742	395,693.62	
NN GROUP NV	23,933	41.130	984,364.29	
NOKIA OYJ	467,723	4.688	2,192,685.42	
OCI NV	9,276	37.540	348,221.04	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS- A	5,930	83.800	496,934.00	
OMV AG	12,645	47.230	597,223.35	
ORANGE S.A.	175,603	9.299	1,632,932.29	
ORION OYJ-CLASS B	9,203	50.340	463,279.02	
PERNOD-RICARD	17,883	186.350	3,332,497.05	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	13,136	56.640	744,023.04	
POSTE ITALIANE SPA	47,608	9.376	446,372.60	
PROSUS	71,877	64.980	4,670,567.46	
PRYSMIAN SPA	22,163	35.500	786,786.50	
PUBLICIS GROUPE	19,656	61.040	1,199,802.24	
PUMA AG	9,180	52.080	478,094.40	
QIAGEN NV	19,772	46.990	929,086.28	
RANDSTAD NV	10,159	56.200	570,935.80	
RATIONAL AG	443	600.500	266,021.50	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	9,073	40.840	370,541.32	
RED ELECTRICA DE ESPANA	34,554	17.100	590,873.40	
REMY COINTREAU	2,004	160.200	321,040.80	
RENAULT SA	16,705	34.405	574,735.52	
REPSOL SA	118,514	14.150	1,676,973.10	

RHEINMETALL AG	3,761	196.550	739,224.55	
ROYAL KPN NV	293,053	2.992	876,814.57	
RWE AG	55,671	42.320	2,355,996.72	
SAFRAN SA	29,732	117.180	3,483,995.76	
SAMPO OYJ	41,351	49.440	2,044,393.44	
SANOFI	98,865	88.730	8,772,291.45	
SAP SE	90,435	102.340	9,255,117.90	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,101	350.800	737,030.80	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,396	313.700	751,625.20	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,964	138.380	6,498,878.32	
SCOUT24 SE	7,104	51.280	364,293.12	
SEB SA	2,189	79.650	174,353.85	
SIEMENS AG	66,262	133.440	8,842,001.28	
SIEMENS ENERGY AG	37,861	16.935	641,176.03	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	20,802	18.025	374,956.05	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,392	49.980	1,219,112.16	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	21,253	35.640	757,456.92	
SNAM SPA	175,890	4.874	857,287.86	
SOCIETE GENERALE	69,368	22.630	1,569,797.84	
SODEXO	7,670	95.780	734,632.60	
SOFINA	1,346	219.400	295,312.40	
SOLVAY SA	6,398	94.700	605,890.60	
STMICROELECTRONICS NV	59,158	36.895	2,182,634.41	
STORA ENSO OYJ	47,336	14.715	696,549.24	
SYMRISE AG	11,556	105.100	1,214,535.60	
TELECOM ITALIA SPA	894,546	0.203	181,592.83	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	97,121	2.270	220,464.67	
TELEFONICA SA	454,676	3.474	1,579,544.42	
TELEPERFORMANCE	5,096	224.700	1,145,071.20	
TENARIS SA	40,485	15.385	622,861.72	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	122,299	7.362	900,365.23	
THALES SA	9,222	120.000	1,106,640.00	
TOTALENERGIES SE	215,376	56.290	12,123,515.04	
UBISOFT ENTERTAINMENT	8,188	26.960	220,748.48	
UCB SA	10,897	71.660	780,879.02	
UMICORE	18,090	34.950	632,245.50	
UNICREDIT SPA	165,966	12.530	2,079,553.98	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	8,592	19.765	169,820.88	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	62,839	22.745	1,429,273.05	
UPM-KYMMENE OYJ	46,167	36.950	1,705,870.65	
VALEO SA	18,169	16.720	303,785.68	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,659	25.230	1,454,736.57	
VINCI SA	46,836	98.620	4,618,966.32	
VIVENDI SA	61,751	9.000	555,759.00	
VOESTALPINE AG	9,763	25.820	252,080.66	

	VOLKSWAGEN AG	2,612	177.700	464,152.40	
	VOLKSWAGEN AG	16,069	137.240	2,205,309.56	
	VONOVIA SE	62,167	23.370	1,452,842.79	
	WARTSILA OYJ	40,996	8.364	342,890.54	
	WENDEL	2,406	89.700	215,818.20	
	WOLTERS KLUWER NV	22,684	104.850	2,378,417.40	
	WORLDLINE SA	20,803	41.130	855,627.39	
	ZALANDO SE	19,313	31.250	603,531.25	
ユーロ 小計		15,979,974		381,908,447.27 (54,903,158,380)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,034,675	85.500	88,464,712.50	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	323,039	24.900	8,043,671.10	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	150,300	24.500	3,682,350.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	173,909	47.350	8,234,591.15	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	234,909	45.450	10,676,614.05	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	57,000	40.550	2,311,350.00	
	CLP HOLDINGS LTD	144,643	56.350	8,150,633.05	
	ESR GROUP LIMITED	176,600	17.360	3,065,776.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	189,810	52.900	10,040,949.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	180,157	15.000	2,702,355.00	
	HANG SENG BANK LTD	67,212	125.500	8,435,106.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	132,641	26.500	3,514,986.50	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,005,437	7.190	7,229,092.03	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	104,411	345.800	36,105,323.80	
	MTR CORP	146,255	38.700	5,660,068.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	141,917	22.250	3,157,653.25	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	122,587	41.600	5,099,619.20	
	SANDS CHINA LTD	212,180	26.300	5,580,334.00	
	SINO LAND CO	314,000	10.280	3,227,920.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	122,000	17.460	2,130,120.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	127,023	102.500	13,019,857.50	
	SWIRE PACIFIC LTD	43,366	64.200	2,784,097.20	
	SWIRE PROPERTIES LTD	109,400	19.440	2,126,736.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	119,000	94.550	11,251,450.00	
	WH GROUP LTD	721,500	4.630	3,340,545.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	146,733	42.900	6,294,845.70	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	155,000	15.400	2,387,000.00	
香港・ドル 小計		6,455,704		266,717,756.53	

			(4,683,563,805)	
合計	95,525,040		554,552,685,082	
			(554,552,685,082)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,390.00	1,998,591.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	27,257.00	895,665.02	
		AMERICAN TOWER REIT INC	40,331.00	8,624,381.04	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	40,542.00	878,545.14	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,012.00	2,036,994.96	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,945.00	862,266.45	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,676.00	1,006,416.00	
		CROWN CASTLE INC	37,544.00	5,249,402.08	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	24,829.00	2,655,709.84	
		EQUINIX INC	7,897.00	5,336,792.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,264.00	989,259.84	
		EQUITY RESIDENTIAL	30,680.00	1,924,556.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,624.00	1,207,978.96	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,551.00	1,808,655.58	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22,199.00	1,156,567.90	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	32,979.00	649,356.51	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	46,297.00	1,173,628.95	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	61,710.00	1,091,649.90	
		INVITATION HOMES INC	52,919.00	1,671,711.21	
		IRON MOUNTAIN INC	25,168.00	1,369,390.88	
		KIMCO REALTY CORP	52,844.00	1,147,243.24	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	51,724.00	610,343.20	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,889.00	1,598,457.96	
		PROLOGIS INC	79,896.00	9,293,502.72	
		PUBLIC STORAGE	13,643.00	4,060,156.80	
		REALTY INCOME CORP	53,482.00	3,446,914.90	
		REGENCY CENTERS CORP	13,193.00	867,175.89	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,364.00	2,698,611.16	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	28,303.00	3,304,375.25	
		SUN COMMUNITIES INC	10,703.00	1,523,143.93	
		UDR INC	28,141.00	1,122,544.49	
		VENTAS INC	34,549.00	1,569,561.07	
	VICI PROPERTIES INC	83,705.00	2,840,110.65		
WELLTOWER INC	40,211.00	2,680,867.37			
WP CAREY INC	16,667.00	1,314,192.95			
アメリカ・ドル	小計		1,056,128.00	80,664,722.24 (11,031,707,415)	
イギリス・ポンド		BRITISH LAND CO PLC	74,543.00	295,637.53	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	60,949.00	381,906.43	
	SEGR0 PLC	102,295.00	821,224.26	
イギリス・ポンド 小計		237,787.00	1,498,768.22 (250,594,046)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	106,401.00	852,272.01	
	GOODMAN GROUP	150,506.00	2,736,199.08	
	GPT GROUP	186,828.00	810,833.52	
	MIRVAC GROUP	378,070.00	831,754.00	
	SCENTRE GROUP	483,270.00	1,391,817.60	
	STOCKLAND	227,957.00	882,193.59	
	VICINITY CENTRES	367,764.00	726,333.90	
オーストラリア・ドル 小計		1,900,796.00	8,231,403.70 (760,417,074)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	7,538.00	324,360.14	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	13,208.00	276,047.20	
カナダ・ドル 小計		20,746.00	600,407.34 (60,100,775)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	295,300.00	812,075.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	459,290.00	927,765.80	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	288,400.00	461,440.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	204,700.00	345,943.00	
シンガポール・ドル 小計		1,247,690.00	2,547,223.80 (257,116,770)	
ユーロ	COVIVIO	3,886.00	220,724.80	
	GECINA SA	3,853.00	371,814.50	
	KLEPIERRE	18,422.00	412,468.58	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,139.00	532,196.11	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	13,308.00	356,388.24	
ユーロ 小計		49,608.00	1,893,592.23 (272,222,819)	
香港・ドル	LINK REIT	183,571.00	10,188,190.50	
香港・ドル 小計		183,571.00	10,188,190.50 (178,904,625)	
投資証券 合計		4,696,326	12,811,063,524 (12,811,063,524)	
合計			12,811,063,524 (12,811,063,524)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 602銘柄	69.07	-	72.92
	投資証券 35銘柄	-	1.89	
イギリス・ポンド	株式 79銘柄	4.46	-	4.63
	投資証券 3銘柄	-	0.04	
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	0.15	-	0.15
オーストラリア・ドル	株式 49銘柄	2.20	-	2.40
	投資証券 7銘柄	-	0.13	
カナダ・ドル	株式 84銘柄	3.56	-	3.67
	投資証券 2銘柄	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 15銘柄	0.35	-	0.40
	投資証券 4銘柄	-	0.04	
スイス・フラン	株式 43銘柄	2.98	-	3.06
スウェーデン・クローナ	株式 45銘柄	1.01	-	1.03
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.85	-	0.87
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.06	-	0.06
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.22	-	0.23
ユーロ	株式 223銘柄	9.42	-	9.72
	投資証券 5銘柄	-	0.05	
香港・ドル	株式 27銘柄	0.80	-	0.86
	投資証券 1銘柄	-	0.03	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	33,596,826
金銭信託	5,831,314
コール・ローン	184,509,951
株式	4,863,578,498
投資信託受益証券	399,114,055
投資証券	5,249,600
派生商品評価勘定	23,002,638
未収入金	4,556,846
未収配当金	8,137,212
差入委託証拠金	145,731,571
流動資産合計	5,673,308,511
資産合計	5,673,308,511
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,999,012
未払解約金	19,610,527
その他未払費用	660
流動負債合計	27,610,199
負債合計	27,610,199
純資産の部	
元本等	
元本	4,858,147,649
剰余金	
剰余金又は欠損金()	787,550,663
元本等合計	5,645,698,312
純資産合計	5,645,698,312
負債純資産合計	5,673,308,511

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,662,815,573円
同期中追加設定元本額	2,050,000,146円
同期中一部解約元本額	854,668,070円
元本の内訳	
ファンド名	
<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド	2,753,679,204円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	17,166,801円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	23,769,435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）	10,202,720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）	56,230,969円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド（GDP型バスケット）	447,545,218円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	257,935,470円
FWニッセイ新興国株インデックス	6,078,830円
DCニッセイ新興国株式インデックス	1,285,539,002円
計	4,858,147,649円
2. 受益権の総数	4,858,147,649口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	157,179,415
投資信託受益証券	24,174,864
投資証券	60,295
合計	133,064,846

(注)「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年11月22日から2022年12月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年12月12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	325,046,063	-	322,950,683	2,095,380
アメリカ・ドル	325,046,063	-	322,950,683	2,095,380
買建	482,263,223	-	475,208,612	7,054,611
アメリカ・ドル	482,263,223	-	475,208,612	7,054,611
合計	807,309,286	-	798,159,295	4,959,231

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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

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

株式関連

種類	2022年12月12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	351,439,010	-	371,401,867	19,962,857
合計	351,439,010	-	371,401,867	19,962,857

(注) 株価指数先物取引

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年12月12日現在
1口当たり純資産額	1.1621円
(1万口当たり純資産額)	(11,621円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年12月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	360 DIGITECH INC	500	17.950	8,975.00	
	AUTOHOME INC-ADR	534	32.950	17,595.30	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	533	8.100	4,317.30	
	CREDICORP LTD	437	147.780	64,579.86	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	400	49.610	19,844.00	
	H WORLD GROUP LIMITED (ADR)	1,017	42.980	43,710.66	
	IQIYI INC-ADR	900	3.670	3,303.00	
	JOYY INC	334	34.880	11,649.92	
	KANZHUN LTD	1,100	20.070	22,077.00	
	KE HOLDINGS INC	3,874	15.390	59,620.86	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	200	53.550	10,710.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,892	0.000	0.18	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1,444	0.000	0.14	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	2,982	0.000	0.29	
	NIO INC - ADR	8,857	12.630	111,863.91	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	468	0.000	0.04	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	729	0.000	0.07	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	300	0.000	0.03	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	552	0.000	0.05	
	PINDUODUO INC-ADR	3,152	89.710	282,765.92	
	PJSC GAZPROM ADR	27,971	0.000	2.79	
	PJSC MMC NORILSK NICKEL- ADR	2,732	0.000	0.27	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	460	0.000	0.04	
	ROSNEFT OJSC-GDR	5,479	0.000	0.54	
	SBERBANK OF RUSSIA	49,840	0.000	4.98	
	SEVERSTAL PAO - GDR REG S	1,314	0.000	0.13	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	2,280	0.802	1,828.56	
	SOUTHERN COPPER CORP	434	60.670	26,330.78	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	5,163	0.000	0.51	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	2,824	6.610	18,666.64	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	1,225	0.000	0.12	
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	568	0.000	0.05		
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	3,468	8.210	28,472.28		

	TRIP.COM GROUP LTD	3,104	32.410	100,600.64	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	2,315	13.030	30,164.45	
	VK COMPANY LTD-GDR	380	0.000	0.03	
	VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	6,620	0.000	0.66	
	WEIBO CORP-SPON ADR	334	18.040	6,025.36	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	422	0.000	0.04	
	YANDEX NV-A	1,315	0.000	0.13	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	2,622	56.530	148,221.66	
	ZAI LAB LTD-ADR	559	35.400	19,788.60	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC- ADR	2,452	25.720	63,065.44	
アメリカ・ドル	小計	154,086		1,104,188.23 (151,008,782)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	1,915	0.000	0.19	
イギリス・ポンド	小計	1,915		0.19 (32)	
インド・ルピー	ABB INDIA LTD	456	2,976.650	1,357,352.40	
	ACC LTD	679	2,619.500	1,778,640.50	
	ADANI ENTERPRISES LTD	1,855	3,996.800	7,414,064.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	1,846	2,053.450	3,790,668.70	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	3,356	890.750	2,989,357.00	
	ADANI POWER LTD	5,133	316.050	1,622,284.65	
	ADANI TOTAL GAS LTD	1,602	3,621.300	5,801,322.60	
	ADANI TRANSMISSION LTD	1,617	2,646.400	4,279,228.80	
	AMBUJA CEMENTS LTD	4,484	581.000	2,605,204.00	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	495	4,685.100	2,319,124.50	
	ASIAN PAINTS LTD	2,244	3,226.950	7,241,275.80	
	AU SMALL FINANCE BANK LTD	1,152	682.150	785,836.80	
	AUROBINDO PHARMA LTD	802	454.000	364,108.00	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	839	4,002.400	3,358,013.60	
	AXIS BANK LTD	14,348	933.700	13,396,727.60	
	BAJAJ AUTO LTD	269	3,616.950	972,959.55	
	BAJAJ FINANCE LTD	1,736	6,517.450	11,314,293.20	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,100	1,598.600	3,357,060.00	
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	215	6,209.800	1,335,107.00	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	331	2,058.100	681,231.10	
	BANDHAN BANK LTD	3,556	246.950	878,154.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	1,972	615.150	1,213,075.80	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	21,234	105.800	2,246,557.20	
	BHARAT FORGE LTD	1,798	857.400	1,541,605.20	

BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,051	338.450	1,709,510.95	
BHARTI AIRTEL LTD	13,721	834.900	11,455,662.90	
BIOCON LTD	1,590	272.250	432,877.50	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	585	4,410.300	2,580,025.50	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	2,189	744.100	1,628,834.90	
CIPLA LIMITED	2,591	1,107.900	2,870,568.90	
COAL INDIA LTD	12,030	228.850	2,753,065.50	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	740	1,656.950	1,226,143.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,694	774.050	1,311,240.70	
DABUR INDIA LTD	3,788	598.750	2,268,065.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	710	3,274.050	2,324,575.50	
DLF LTD	4,020	402.250	1,617,045.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	621	4,407.100	2,736,809.10	
EICHER MOTORS LTD	975	3,358.200	3,274,245.00	
GAIL INDIA LTD	14,833	90.850	1,347,578.05	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,634	923.600	2,432,762.40	
GODREJ PROPERTIES LTD	606	1,277.650	774,255.90	
GRASIM INDUSTRIES LTD	1,475	1,799.900	2,654,852.50	
HAVELLS INDIA LTD	1,487	1,182.000	1,757,634.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	6,199	1,027.500	6,369,472.50	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	5,150	579.600	2,984,940.00	
HERO MOTOCORP LTD	729	2,751.500	2,005,843.50	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	8,856	462.850	4,098,999.60	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1,930	240.000	463,200.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	5,066	2,722.250	13,790,918.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	10,453	2,672.100	27,931,461.30	
ICICI BANK LTD	31,551	929.900	29,339,274.90	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,456	1,247.950	1,817,015.20	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,346	456.850	1,071,770.10	
INDIAN HOTELS CO LTD	6,819	330.100	2,250,951.90	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	8,985	77.000	691,845.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	1,331	722.150	961,181.65	
INDRAPRASTHA GAS LTD	1,088	435.750	474,096.00	
INDUS TOWERS LTD	4,167	194.600	810,898.20	
INFO EDGE INDIA LTD	364	4,015.000	1,461,460.00	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	20,371	1,569.300	31,968,210.30	
INTERGLOBE AVIATION LTD	562	1,992.050	1,119,532.10	
ITC LTD	19,025	341.400	6,495,135.00	

JINDAL STEEL & POWER LTD	2,793	545.800	1,524,419.40	
JSW STEEL LTD	4,649	740.400	3,442,119.60	
JUBILANT FOODWORKS LTD	2,065	535.650	1,106,117.25	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	3,220	1,888.050	6,079,521.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	4,015	2,154.050	8,648,510.75	
LTIMINDTREE LIMITED	551	4,401.750	2,425,364.25	
LUPIN LTD	907	751.500	681,610.50	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	5,052	1,265.400	6,392,800.80	
MARICO LTD	2,894	523.750	1,515,732.50	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	763	8,613.350	6,571,986.05	
MPHASIS LTD	416	1,997.300	830,876.80	
MRF LTD	7	91,510.700	640,574.90	
MUTHOOT FINANCE LTD	448	1,103.300	494,278.40	
NESTLE INDIA LTD	178	20,241.750	3,603,031.50	
NTPC LTD	24,490	169.500	4,151,055.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	14,568	140.700	2,049,717.60	
PAGE INDUSTRIES LTD	33	46,395.950	1,531,066.35	
PETRONET LNG LTD	1,873	213.750	400,353.75	
PI INDUSTRIES LTD	332	3,452.850	1,146,346.20	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	836	2,739.650	2,290,347.40	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	20,646	217.200	4,484,311.20	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	18,313	2,609.100	47,780,448.30	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	9,052	73.100	661,701.20	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	1,031	801.400	826,243.40	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	2,308	1,269.650	2,930,352.20	
SHREE CEMENT LTD	75	24,441.550	1,833,116.25	
SHRIRAM FINANCE LIMITED	1,214	1,344.050	1,631,676.70	
SRF LTD	761	2,365.500	1,800,145.50	
STATE BANK OF INDIA	10,593	616.500	6,530,584.50	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	6,350	992.850	6,304,597.50	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	5,543	3,292.750	18,251,713.25	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	3,367	803.300	2,704,711.10	
TATA ELXSI LTD	210	6,745.750	1,416,607.50	
TATA MOTORS LTD	9,540	413.300	3,942,882.00	
TATA STEEL LTD	44,652	110.450	4,931,813.40	
TECH MAHINDRA LTD	3,212	1,035.300	3,325,383.60	
TITAN CO LTD	2,336	2,615.450	6,109,691.20	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	514	1,617.600	831,446.40	
TRENT LTD	1,146	1,458.000	1,670,868.00	

	TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	792	3,010.200	2,384,078.40	
	TVS MOTOR CO LTD	1,779	1,036.150	1,843,310.85	
	ULTRATECH CEMENT LTD	538	7,077.400	3,807,641.20	
	UNITED SPIRITS LTD	1,802	938.000	1,690,276.00	
	UPL LTD	2,564	763.700	1,958,126.80	
	VARUN BEVERAGES LTD	1,795	1,410.250	2,531,398.75	
	VEDANTA LTD	4,714	308.850	1,455,918.90	
	WIPRO LTD	9,369	394.050	3,691,854.45	
	ZOMATO LTD	22,979	64.150	1,474,102.85	
インド・ルピー	小計	539,192		460,236,041.65 (768,594,190)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	84,200	3,680.000	309,856,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	53,200	1,935.000	102,942,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	122,000	5,675.000	692,350,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	329,700	8,575.000	2,827,177,500.00	
	BANK JAGO TBK PT	22,400	3,530.000	79,072,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	108,100	9,925.000	1,072,892,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	48,700	9,550.000	465,085,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	446,100	4,800.000	2,141,280,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	88,500	775.000	68,587,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	45,500	5,725.000	260,487,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	9,275.000	55,650,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	9,600	10,150.000	97,440,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	10,400	6,925.000	72,020,000.00	
	INTERNATIONAL NICKEL INDONES	18,100	7,250.000	131,225,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	176,100	2,130.000	375,093,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	62,800	4,380.000	275,064,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	162,600	1,110.000	180,486,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	9,400	6,950.000	65,330,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	99,800	2,500.000	249,500,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	269,000	3,650.000	981,850,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	49,100	4,620.000	226,842,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	10,600	26,125.000	276,925,000.00	
インドネシア・ルピア	小計	2,231,900		11,007,155,000.00 (96,862,964)	

オフショア・人民元	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,500	6.950	31,275.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	528	107.000	56,496.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	1,000	44.000	44,000.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	33,800	2.890	97,682.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	3,567	28.930	103,193.31	
	AIR CHINA LTD-A	10,100	10.920	110,292.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	30.250	30,250.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	266.180	79,854.00	
	ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	140	136.120	19,056.80	
	AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS	9,200	3.680	33,856.00	
	BANK OF BEIJING CO LTD - A	8,600	4.370	37,582.00	
	BANK OF CHINA LTD-A	32,100	3.160	101,436.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	22,200	4.760	105,672.00	
	BANK OF JIANGSU CO LTD-A	7,800	7.470	58,266.00	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	1,700	33.000	56,100.00	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	4,500	6.050	27,225.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	5,700	5.880	33,516.00	
	BBMG CORPORATION-A	14,100	2.700	38,070.00	
	BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	218	250.170	54,537.06	
	BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,000	48.910	97,820.00	
	BEIJING UNITED INFORMATION-A	900	99.700	89,730.00	
	BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	400	144.480	57,792.00	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	11,000	3.610	39,710.00	
	BYD CO LTD -A	700	274.700	192,290.00	
	CAITONG SECURITIES CO LTD-A	7,500	7.560	56,700.00	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	178.270	17,827.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	12,300	5.600	68,880.00		
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,600	5.600	53,760.00		
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	3,200	23.420	74,944.00		

CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6,800	5.570	37,876.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	9,700	3.120	30,264.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	6,900	10.060	69,414.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO- A	1,000	36.200	36,200.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	6,900	36.750	253,575.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2,700	13.890	37,503.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	14.620	27,778.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	21,200	3.570	75,684.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	6.260	66,356.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	1,600	26.820	42,912.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	6,500	25.280	164,320.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	8,400	4.510	37,884.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD- A	8,800	6.090	53,592.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	35,904	4.790	171,980.16	
CHINA SHENHUA ENERGY CO- A	2,000	29.110	58,220.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4,700	7.470	35,109.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	10,800	5.940	64,152.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	12,800	5.680	72,704.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	800	213.230	170,584.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	2,200	20.460	45,012.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	9,000	20.920	188,280.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	500	110.000	55,000.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	24,600	3.080	75,768.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	5,850	13.900	81,315.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	400	86.770	34,708.00	
CITIC SECURITIES CO-A	10,800	20.640	222,912.00	
CMOC GROUP LTD-A	11,300	5.010	56,613.00	

CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	900	424.600	382,140.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	5,070	13.300	67,431.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,600	25.650	66,690.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,200	21.060	88,452.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	5,011	20.580	103,126.38	
EVE ENERGY CO LTD-A	900	90.600	81,540.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	6.860	40,474.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,029	80.200	82,525.80	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	2,600	9.460	24,596.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	700	80.710	56,497.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	13,200	4.090	53,988.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	16.360	60,532.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	196	99.360	19,474.56	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	200	193.450	38,690.00	
GOERTEK INC -A	1,000	17.610	17,610.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD- A	1,800	32.730	58,914.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD- A	700	31.550	22,085.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,200	33.880	108,416.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO- A	1,000	59.700	59,700.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	5,400	10.090	54,486.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,300	32.150	41,795.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,000	50.520	50,520.00	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	9,800	6.520	63,896.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,200	9.270	103,824.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,300	14.300	47,190.00	
HAIER SMART HOME CO LTD- A	2,000	25.450	50,900.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	2,900	9.100	26,390.00	

HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	840	63.520	53,356.80	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	25.660	20,528.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	2,800	17.500	49,000.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2,800	15.200	42,560.00	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	5,700	7.400	42,180.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	400	101.000	40,400.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD- A	1,300	44.300	57,590.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	7,700	7.010	53,977.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	2,100	13.300	27,930.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD- A	4,100	8.270	33,907.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	5.300	32,860.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	18.410	25,774.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	114.880	57,440.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	1,183	39.500	46,728.50	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	34.000	40,800.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	100	528.930	52,893.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	28,000	4.300	120,400.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD - A	8,900	18.000	160,200.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	2.020	65,448.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	4.280	8,988.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	2,800	31.990	89,572.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	980	57.370	56,222.60	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	2,900	14.740	42,746.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,000	65.490	65,490.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	3,384	38.820	131,366.88	
JIANGSU YANGHE BREWERY - A	400	161.030	64,412.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,200	15.800	34,760.00	

JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	18.080	36,160.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	500	1,730.000	865,000.00	
LB GROUP CO LTD-A	2,900	19.780	57,362.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	2,400	10.910	26,184.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	13,900	4.820	66,998.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	3,080	46.300	142,604.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	3,089	31.950	98,693.55	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	400	212.880	85,152.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,300	26.510	34,463.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	480	112.590	54,043.20	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	3.460	70,930.00	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	974	68.500	66,719.00	
MUYUAN FOODS CO LTD-A	2,190	48.790	106,850.10	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	2,592	26.400	68,428.80	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	244.810	48,962.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	30.510	27,459.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	13.460	24,228.00	
NINESTAR CORP-A	1,700	51.440	87,448.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	62.840	43,988.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	4,400	14.260	62,744.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	4,500	9.210	41,445.00	
PETROCHINA CO LTD-A	6,900	5.140	35,466.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	450	64.410	28,984.50	
PICC HOLDING CO-A	14,900	5.410	80,609.00	
PING AN BANK CO LTD-A	9,700	13.700	132,890.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	3,700	47.600	176,120.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	16.450	44,415.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	12,200	4.650	56,730.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	7.630	76,300.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	2,700	25.460	68,742.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,000	13.420	40,260.00	

S F HOLDING CO LTD-A	2,200	58.030	127,666.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	2,100	15.240	32,004.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	16.910	50,730.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	2,300	23.820	54,786.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	4,700	19.680	92,496.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	460	20.590	9,471.40	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,900	32.300	61,370.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,300	40.770	53,001.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	4.240	26,712.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	700	37.000	25,900.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,600	5.560	47,816.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	5,100	12.750	65,025.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	5,500	19.530	107,415.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	6,700	7.320	49,044.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	800	58.770	47,016.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	5,600	5.600	31,360.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	480	284.190	136,411.20	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	140	76.150	10,661.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11,000	4.180	45,980.00	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	100	265.560	26,556.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,500	69.370	104,055.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	480	34.790	16,699.20	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	500	311.440	155,720.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	336	82.330	27,662.88	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,800	50.880	91,584.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	500	106.800	53,400.00	

SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	100	451.630	45,163.00	
TBEA CO LTD-A	2,200	21.060	46,332.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4,000	3.980	15,920.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	1,500	40.300	60,450.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	7,200	9.140	65,808.00	
TONGWEI CO LTD-A	1,500	41.990	62,985.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	1,092	58.250	63,609.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	600	110.960	66,576.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	419	135.800	56,900.20	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	980	19.700	19,306.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	1,500	93.400	140,100.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	3,400	10.910	37,094.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1,800	18.200	32,760.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.480	62,856.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	405	84.700	34,303.50	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	56.200	11,240.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	5,100	5.150	26,265.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	4,000	11.600	46,400.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	1,500	183.270	274,905.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-A	672	80.000	53,760.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2,600	5.380	13,988.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,900	11.380	44,382.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	1,300	44.480	57,824.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,690	22.620	38,227.80	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	2,500	21.550	53,875.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	700	58.990	41,293.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	300	139.950	41,985.00	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	300	273.000	81,900.00	

	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	1,100	29.850	32,835.00	
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	3,000	12.540	37,620.00	
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	650	65.350	42,477.50	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	800	70.780	56,624.00	
	ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,008	19.750	19,908.00	
	ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2,000	10.680	21,360.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	7,100	10.610	75,331.00	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9,400	5.970	56,118.00	
	ZTE CORP-A	700	26.510	18,557.00	
オフショア・人民元 小計		946,167		13,886,897.68 (272,258,184)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	2,517	39,980.000	100,629,660.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	1,664	31,950.000	53,164,800.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,462	18,900.000	27,631,800.00	
コロンビア・ペソ 小計		5,643		181,426,260.00 (5,157,586)	
タイ・パーツ	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	6,600	187.000	1,234,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	25,500	73.500	1,874,250.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-FOREIGN	88,100	6.200	546,220.00	
	B GRIMM POWER PCL-FOREIGN	3,100	37.750	117,025.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	59,700	28.250	1,686,525.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	71,300	9.600	684,480.00	
	BERLI JUCKER PUB CO-FORGN	6,000	34.750	208,500.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	57,400	8.300	476,420.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	3,900	210.000	819,000.00	
	CARABAO GROUP PCL-F	2,600	95.500	248,300.00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	12,600	71.000	894,600.00	
	CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN	15,700	43.500	682,950.00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	26,800	23.600	632,480.00	
CP ALL PCL-FOREIGN	34,300	64.500	2,212,350.00		

	ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R	1,000	170.000	170,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN	8,900	97.000	863,300.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F	8,800	70.000	616,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	17,300	54.000	934,200.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	44,400	14.400	639,360.00	
	INDORAMA VENTURES-FOREIGN	12,200	40.750	497,150.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6,300	74.250	467,775.00	
	JMT NETWORK SERVICES-FOREIGN	5,700	70.000	399,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	4,900	143.000	700,700.00	
	KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	32,300	17.600	568,480.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN	5,400	59.500	321,300.00	
	LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	28,500	9.550	272,175.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	18,500	30.750	568,875.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG	2,100	39.000	81,900.00	
	OSOTSPA PCL-FOREIGN	3,200	28.750	92,000.00	
	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	7,900	171.500	1,354,850.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	14,300	46.000	657,800.00	
	PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN	14,200	24.300	345,060.00	
	PTT PCL/FOREIGN	66,400	32.000	2,124,800.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	2,300	42.000	96,600.00	
	SCB X PCL-FOREIGN	6,800	103.000	700,400.00	
	SCG PACKAGING PCL-FOREIGN	7,300	57.750	421,575.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	4,200	334.000	1,402,800.00	
	SRISAWADCORP PCL -FOREIGN	2,400	49.750	119,400.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	9,300	54.250	504,525.00	
	THAI UNION GROUP PCL-F	9,800	16.800	164,640.00	
	TRUE CORP PCL-FOREIGN	101,300	4.600	465,980.00	
	タイ・パーツ 小計	859,300		27,867,945.00 (109,521,024)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	1,019	748.500	762,721.50	
	KOMERCNI BANKA AS	654	652.500	426,735.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	71.600	80,478.40	

チェコ・コルナ 小計		2,797		1,269,934.90 (7,517,507)	
チリ・ペソ	BANCO DE CHILE	306,426	83.350	25,540,607.10	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	183	24,000.000	4,392,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	553,318	33.300	18,425,489.40	
	CENCOSUD SA	4,383	1,320.100	5,785,998.30	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	273	5,156.000	1,407,588.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	92,857	69.300	6,434,990.10	
	EMPRESAS CMPC SA	3,736	1,449.900	5,416,826.40	
	EMPRESAS COPEC SA	3,034	6,148.000	18,653,032.00	
	ENEL CHILE SA	90,486	37.100	3,357,030.60	
	ENERSIS SA	99,456	114.390	11,376,771.84	
	FALABELLA SA	2,406	1,580.000	3,801,480.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	937	81,500.000	76,365,500.00	
チリ・ペソ 小計		1,157,495		180,957,313.74 (28,707,792)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	25,852	16.670	430,952.84	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	8,295	53.500	443,782.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,552	123.000	313,896.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,135	40.500	329,467.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	157	428.800	67,321.60	
	HEKTAS TICARET T.A.S	9,137	38.700	353,601.90	
	KOC HOLDING AS	8,792	68.650	603,570.80	
	SASA POLYESTER SANAYI	3,606	113.900	410,723.40	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,082	437.400	473,266.80	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,833	32.380	383,152.54	
	TURKIYE IS BANKASI-C	32,580	10.570	344,370.60	
トルコ・リラ 小計		112,021		4,154,106.48 (30,469,956)	
ハンガリー・ フォロント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	2,658	2,600.000	6,910,800.00	
	OTP BANK RT	1,120	10,000.000	11,200,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	875	8,800.000	7,700,000.00	
ハンガリー・フォロント 小計		4,653		25,810,800.00 (8,874,605)	
フィリピン・ペ ソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	6,310	54.000	340,740.00	
	ACEN CORPORATION	46,985	7.250	340,641.25	
	AYALA CORPORATION	1,795	700.000	1,256,500.00	
	AYALA LAND INC	48,800	29.200	1,424,960.00	

	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	12,570	98.500	1,238,145.00	
	BDO UNIBANK INC	11,140	129.000	1,437,060.00	
	GLOBE TELECOM INC	65	2,160.000	140,400.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	5,650	203.000	1,146,950.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	18,558	46.500	862,947.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	1,380	236.800	326,784.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,370	280.000	383,600.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	15,127	55.000	831,985.00	
	MONDE NISSIN CORP	29,200	11.240	328,208.00	
	PLDT INC	585	1,730.000	1,012,050.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,585	930.000	1,474,050.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	60,300	34.700	2,092,410.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	7,280	136.600	994,448.00	
	フィリピン・ペン 小計	268,700		15,631,878.25 (38,596,671)	
ブラジル・リアル	AMBEV SA	26,800	15.510	415,668.00	
	AMERICANAS SA	3,814	8.370	31,923.18	
	ATACADAO SA	1,900	14.860	28,234.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	11,303	12.810	144,791.43	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	32,979	14.300	471,599.70	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	6,900	22.850	157,665.00	
	BANCO DO BRASIL SA	5,700	34.980	199,386.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	3,000	27.050	81,150.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	3,900	31.720	123,708.00	
	BM&FBOVESPA SA	34,900	11.740	409,726.00	
	BRF SA	4,300	7.520	32,336.00	
	CCR SA	6,800	10.780	73,304.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,600	45.220	117,572.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIEN	6,900	42.670	294,423.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	8,475	11.080	93,903.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,200	55.770	122,694.00	
	COSAN SA	9,200	16.640	153,088.00	
	ENERGISA SA-UNITS	600	41.810	25,086.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	675	38.310	25,859.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	5,300	26.380	139,814.00	
GERDAU SA-PREF	8,400	31.470	264,348.00		
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	27,606	4.730	130,576.38		

	HYPERA S.A	2,600	42.460	110,396.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	31,550	24.330	767,611.50	
	ITAUSA SA	36,416	8.170	297,518.72	
	JBS SA	4,200	21.110	88,662.00	
	KLABIN SA - UNIT	4,000	21.110	84,440.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	4,195	52.810	221,537.95	
	LOJAS RENNER S.A.	5,962	20.740	123,651.88	
	MAGAZINE LUIZA SA	15,200	2.800	42,560.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	4,200	11.530	48,426.00	
	PETRO RIO SA	3,800	33.650	127,870.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	24,400	28.060	684,664.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	27,100	24.710	669,641.00	
	RAIA DROGASIL SA	5,900	23.540	138,886.00	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	2,500	26.410	66,025.00	
	RUMO SA	7,200	17.640	127,008.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	6,500	19.280	125,320.00	
	SUZANO S.A.	4,922	54.990	270,660.78	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	2,700	37.600	101,520.00	
	TIM SA	3,500	12.570	43,995.00	
	TOTVS SA	2,500	26.760	66,900.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	2,200	12.650	27,830.00	
	VALE SA	22,854	88.740	2,028,063.96	
	VIBRA ENERGIA SA	6,900	14.930	103,017.00	
	WEG SA	10,920	37.100	405,132.00	
ブラジル・リアル 小計		456,471		10,308,191.73 (268,618,076)	
ポーランド・ズロチ	ALLEGRO.EU SA	1,606	24.250	38,945.50	
	BANK PEKAO SA	1,177	82.640	97,267.28	
	CD PROJEKT SA	427	131.380	56,099.26	
	CYFROWY POLSAT SA	1,022	18.160	18,559.52	
	DINO POLSKA SA	292	369.100	107,777.20	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	838	121.550	101,858.90	
	LPP SA	4	9,600.000	38,400.00	
	PGE SA	1,780	6.898	12,278.44	
	PKO BANK POLSKI SA	5,021	28.590	143,550.39	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,087	62.200	254,211.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	3,437	32.470	111,599.39	
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	506	258.800	130,952.80	
ポーランド・ズロチ 小計		20,197		1,111,500.08 (34,083,483)	
マレーシア・リンギット	AMBANK HOLDINGS BHD	9,700	4.220	40,934.00	

AXIATA GROUP BERHAD	20,500	3.090	63,345.00		
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	40,300	5.650	227,695.00		
DIALOG GROUP BHD	14,900	2.310	34,419.00		
DIGI.COM BHD	22,500	3.910	87,975.00		
GENTING BHD	6,700	4.360	29,212.00		
GENTING MALAYSIA BHD	11,300	2.640	29,832.00		
HAP SENG CONSOLIDATED	1,100	6.220	6,842.00		
HARTELEGA HOLDINGS BHD	4,700	1.630	7,661.00		
HONG LEONG BANK BERHAD	4,500	20.620	92,790.00		
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	18.420	34,998.00		
IHH HEALTHCARE BHD	6,300	6.000	37,800.00		
INARI AMERTRON BHD	16,600	2.690	44,654.00		
IOI CORPORATION BHD	19,700	3.820	75,254.00		
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	3,400	20.800	70,720.00		
MALAYAN BANKING BHD	28,700	8.690	249,403.00		
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	4,900	6.350	31,115.00		
MAXIS BHD	19,600	3.880	76,048.00		
MISC BHD	5,000	7.190	35,950.00		
MR DIY GROUP M BHD	16,300	2.070	33,741.00		
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	200	136.800	27,360.00		
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	13,300	8.530	113,449.00		
PETRONAS DAGANGAN BHD	3,300	22.200	73,260.00		
PETRONAS GAS BHD	5,400	16.840	90,936.00		
PPB GROUP BERHAD	5,680	17.500	99,400.00		
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	23,000	4.840	111,320.00		
PUBLIC BANK BHD	87,400	4.410	385,434.00		
QL RESOURCES BHD	3,000	5.540	16,620.00		
RHB BANK BHD	4,900	5.610	27,489.00		
SIME DARBY BERHAD	4,800	2.190	10,512.00		
SIME DARBY PLANTATION BHD	7,700	4.350	33,495.00		
TELEKOM MALAYSIA BHD	12,500	5.420	67,750.00		
TENAGA NASIONAL BHD	12,900	9.330	120,357.00		
TOP GLOVE CORP BHD	34,100	0.840	28,644.00		
マレーシア・リンギット 小計	476,780		2,516,414.00 (77,991,219)		
メキシコ・ペソ	ALFA S.A.B.-A	17,900	13.210	236,459.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	173,300	17.990	3,117,667.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,800	162.650	292,770.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	5,900	61.150	360,785.00	
	CEMEX SAB-CPO	78,200	8.330	651,406.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	2,890	129.920	375,468.80	

	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	11,100	154.170	1,711,287.00	
	GRUMA S.A.B.-B	1,200	249.670	299,604.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	1,070	486.120	520,148.40	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	1,900	308.080	585,352.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	8,900	85.990	765,311.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	900	84.320	75,888.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	15,200	143.320	2,178,464.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	14,600	35.100	512,460.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	21,400	78.280	1,675,192.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	14,000	19.570	273,980.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,160	281.740	326,818.40	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	10,000	32.970	329,700.00	
	OPERADORA DE SITES MEX-A-1	12,000	20.360	244,320.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	3,300	36.720	121,176.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,765	173.330	305,927.45	
	WALMART DE MEXICO-SER V	30,000	70.870	2,126,100.00	
メキシコ・ペソ	小計	428,485		17,086,284.05 (118,170,449)	
ユーロ	FF GROUP	129	4.800	619.20	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,568	14.800	23,206.40	
	JUMBO SA	994	15.160	15,069.04	
	MYTILINEOS S.A.	1,320	18.860	24,895.20	
	OPAP SA	1,819	13.290	24,174.51	
	PUBLIC POWER CORP	2,762	6.750	18,643.50	
	TERNA ENERGY SA	1,017	20.400	20,746.80	
ユーロ	小計	9,609		127,354.65 (18,308,504)	
韓国・ウォン	AMOREPACIFIC CORP	173	139,500.000	24,133,500.00	
	BGF RETAIL CO LTD/NEW	15	205,000.000	3,075,000.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	430	65,200.000	28,036,000.00	
	CELLTRION INC	565	180,500.000	101,982,500.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	132	23,750.000	3,135,000.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	61	378,500.000	23,088,500.00	

CJ CORP	53	80,800.000	4,282,400.00	
COWAY CO LTD	312	58,900.000	18,376,800.00	
DAUM COMMUNICATIONS CORP	1,791	58,100.000	104,057,100.00	
DB INSURANCE CO LTD	161	63,100.000	10,159,100.00	
DOOSAN BOBCAT INC	272	35,300.000	9,601,600.00	
E-MART CO LTD	63	100,000.000	6,300,000.00	
ECOPRO BM CO LTD	276	101,000.000	27,876,000.00	
F&F CO LTD / NEW	90	150,500.000	13,545,000.00	
GS HOLDINGS CORP	407	45,900.000	18,681,300.00	
HANA FINANCIAL GROUP	2,123	46,450.000	98,613,350.00	
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	531	33,300.000	17,682,300.00	
HANMI PHARM CO LTD	58	269,500.000	15,631,000.00	
HANON SYSTEMS	960	8,620.000	8,275,200.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	624	46,950.000	29,296,800.00	
HD HYUNDAI	361	63,800.000	23,031,800.00	
HLB INC	591	32,700.000	19,325,700.00	
HMM CO LTD	1,944	22,050.000	42,865,200.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	99	79,600.000	7,880,400.00	
HYBE CO LTD	99	156,500.000	15,493,500.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	474	38,600.000	18,296,400.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	131	173,000.000	22,663,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	128	116,000.000	14,848,000.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	212	83,700.000	17,744,400.00	
HYUNDAI MOBIS	346	208,500.000	72,141,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	781	162,500.000	126,912,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	239	79,500.000	19,000,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	79,500.000	13,515,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	528	33,100.000	17,476,800.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	126	58,300.000	7,345,800.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,205	11,050.000	24,365,250.00	
KAKAO GAMES CORP	157	42,750.000	6,711,750.00	
KAKAOBANK CORP	748	28,100.000	21,018,800.00	
KANGWON LAND INC	358	24,650.000	8,824,700.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	2,630	52,600.000	138,338,000.00	
KIA CORPORATION	1,508	65,200.000	98,321,600.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	515	45,900.000	23,638,500.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	1,311	21,000.000	27,531,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	481	58,500.000	28,138,500.00	
KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	222	73,600.000	16,339,200.00	
KOREA ZINC CO LTD	53	602,000.000	31,906,000.00	

KOREAN AIR LINES CO LTD	1,198	26,050.000	31,207,900.00	
KRAFTON INC	212	180,500.000	38,266,000.00	
KT&G CORP	696	98,000.000	68,208,000.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	101	142,000.000	14,342,000.00	
L&F CO LTD	112	193,300.000	21,649,600.00	
LG CHEM LTD	304	627,000.000	190,608,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	56	289,000.000	16,184,000.00	
LG CORP	564	80,400.000	45,345,600.00	
LG DISPLAY CO LTD	1,329	13,950.000	18,539,550.00	
LG ELECTRONICS INC	632	91,000.000	57,512,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	224	515,000.000	115,360,000.00	
LG H AND H CO LTD	64	722,000.000	46,208,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	83	286,500.000	23,779,500.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	1,340	9,690.000	12,984,600.00	
LG UPLUS CORP	815	12,050.000	9,820,750.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	113	186,000.000	21,018,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	22	90,100.000	1,982,200.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	281	44,400.000	12,476,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	1,040	5,700.000	5,928,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	1,312	6,460.000	8,475,520.00	
NAVER CORP	834	195,000.000	162,630,000.00	
NCISOFT CORPORATION	86	468,000.000	40,248,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	50,000.000	2,900,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	92	118,000.000	10,856,000.00	
PEARL ABYSS CORP	159	44,650.000	7,099,350.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	155	193,000.000	29,915,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	519	284,000.000	147,396,000.00	
S-1 CORPORATION	32	64,200.000	2,054,400.00	
S-OIL CORPORATION	300	84,400.000	25,320,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	103	827,000.000	85,181,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	457	118,500.000	54,154,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	336	138,000.000	46,368,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	28,660	60,400.000	1,731,064,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	5,041	54,700.000	275,742,700.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	821	22,850.000	18,759,850.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	177	207,000.000	36,639,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,275	5,140.000	16,833,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	437	73,700.000	32,206,900.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	342	645,000.000	220,590,000.00	

	SAMSUNG SDS CO LTD	186	127,500.000	23,715,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	452	35,000.000	15,820,000.00	
	SD BIOSENSOR INC	218	32,850.000	7,161,300.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	3,163	38,000.000	120,194,000.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	152	72,900.000	11,080,800.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	115	82,900.000	9,533,500.00	
	SK HYNIX INC	3,339	81,500.000	272,128,500.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	181	62,600.000	11,330,600.00	
	SK INC	203	203,500.000	41,310,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	336	168,500.000	56,616,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	542	35,900.000	19,457,800.00	
	SKC CO LTD	129	98,100.000	12,654,900.00	
	STX PAN OCEAN CO LTD	1,852	5,950.000	11,019,400.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	3,811	12,950.000	49,352,450.00	
	YUHAN CORP	159	58,500.000	9,301,500.00	
韓国・ウォン 小計		92,734		5,806,031,820.00 (607,310,928)	
香港・ドル	3SBIO INC	4,000	8.450	33,800.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	3,500	17.940	62,790.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	158,000	2.600	410,800.00	
	AIR CHINA LIMITED-H	10,000	7.180	71,800.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	89,300	91.850	8,202,205.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	30,000	9.400	282,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	3.570	85,680.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	10,000	30.000	300,000.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	700	119.060	83,342.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	7,000	100.400	702,800.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	4,000	3.730	14,920.00	
	BAIDU INC-CLASS A	13,850	123.000	1,703,550.00	
	BANK OF CHINA LTD - H	458,000	2.750	1,259,500.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	38,000	4.420	167,960.00	
	BEIGENE LTD	4,200	124.200	521,640.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	4,000	5.660	22,640.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	1,500	24.750	37,125.00	

BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	2.020	32,320.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	1,180	196.500	231,870.00	
BOC AVIATION LTD	500	62.100	31,050.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	16,000	3.900	62,400.00	
BYD CO LTD	5,000	215.000	1,075,000.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	3,000	27.250	81,750.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	6,000	20.800	124,800.00	
CGN POWER CO LTD-H	65,000	1.850	120,250.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	28,000	1.110	31,080.00	
CHINA CITIC BANK	49,000	3.460	169,540.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	2.690	21,520.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	8,500	17.520	148,920.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK- H	574,000	4.730	2,715,020.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	14,650	8.310	121,741.50	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	12,000	2.370	28,440.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	15,000	3.490	52,350.00	
CHINA FEIHE LTD	17,000	7.470	126,990.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	11,500	4.000	46,000.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	15,000	11.320	169,800.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	14,000	7.510	105,140.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	11,600	15.100	175,160.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	56,000	2.010	112,560.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	5,000	9.180	45,900.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO- H	44,000	12.400	545,600.00	
CHINA LITERATURE LTD	3,600	31.900	114,840.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	17,000	9.100	154,700.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	8,000	13.200	105,600.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	2,000	16.820	33,640.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	21,000	34.800	730,800.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	26,000	42.300	1,099,800.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	10,000	11.440	114,400.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	22,900	2.700	61,830.00	

CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	20,000	7.080	141,600.00	
CHINA OILFIELD SERVICES- H	12,000	9.250	111,000.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	23,000	21.950	504,850.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	5,000	8.870	44,350.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	14,800	18.520	274,096.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	162,000	3.700	599,400.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	52,880	8.320	439,961.60	
CHINA POWER INTERNATIONAL	33,000	2.870	94,710.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	28,000	4.520	126,560.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	10,000	55.000	550,000.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	18,000	4.450	80,100.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	7,200	31.500	226,800.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	22,000	35.500	781,000.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	4,400	39.700	174,680.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	10,000	14.100	141,000.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	23,000	22.700	522,100.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	5.140	123,360.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	12,000	8.600	103,200.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	6,600	9.910	65,406.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	600	213.400	128,040.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	216,000	0.830	179,280.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	6,000	3.910	23,460.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	13,800	17.640	243,432.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	12,000	6.910	82,920.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	13,200	14.920	196,944.00	
CITIC LTD	32,000	7.880	252,160.00	
CITIC SECURITIES CO LTD- H	14,500	16.360	237,220.00	
CMOC GROUP LIMITED-H	24,000	3.880	93,120.00	

COSCO PACIFIC LTD	6,000	6.070	36,420.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	48,000	3.060	146,880.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	11,000	23.950	263,450.00	
CRRC CORP LTD H	34,000	3.170	107,780.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	21,500	3.650	78,475.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	18,000	4.660	83,880.00	
DONGYUE GROUP	8,000	9.360	74,880.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	5,100	112.800	575,280.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	6.090	42,630.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD- H	3,000	19.320	57,960.00	
FOSUN INTERNATIONAL	17,000	6.410	108,970.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3,200	34.300	109,760.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	2,200	70.250	154,550.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	5,700	20.500	116,850.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	35,000	12.540	438,900.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	23.950	143,700.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	4,800	11.320	54,336.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	15,000	10.760	161,400.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	6,000	5.880	35,280.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	16,000	7.840	125,440.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	19,600	5.570	109,172.00	
HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS	25,000	1.660	41,500.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	5,000	21.900	109,500.00	
HAIER SMART HOME CO LTD- H	15,800	26.850	424,230.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	5,000	20.400	102,000.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	10,000	5.020	50,200.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,200	75.900	91,080.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	8,000	15.440	123,520.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	4,500	37.400	168,300.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	484	9.950	4,815.80	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	26.800	80,400.00	

HUANENG POWER INTL INC-H	14,000	3.340	46,760.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	5,400	9.200	49,680.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	2,000	49.500	99,000.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	340,000	3.890	1,322,600.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	5,500	32.250	177,375.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6,950	84.650	588,317.50	
JD.COM INC - CL A	13,257	236.800	3,139,257.60	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	6.860	13,720.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	9,000	11.980	107,820.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	3,000	19.940	59,820.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	4,000	26.350	105,400.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	2,500	8.710	21,775.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	14,000	15.880	222,320.00	
KINGSOFT CORP LTD	5,200	25.100	130,520.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	11,500	70.100	806,150.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	20,000	5.980	119,600.00	
LEGEND GROUP LTD	40,000	6.210	248,400.00	
LI AUTO INC-CLASS A	7,400	94.000	695,600.00	
LI NING CO LTD	15,500	63.050	977,275.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	13,500	29.500	398,250.00	
MEITUAN-B	26,800	188.500	5,051,800.00	
MICROPORIT SCIENTIFIC CORP	5,300	21.400	113,420.00	
MINTH GROUP LTD	4,000	21.050	84,200.00	
NETEASE INC	11,800	112.500	1,327,500.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	6,000	19.620	117,720.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	9,800	25.500	249,900.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,000	6.650	19,950.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	10,200	43.450	443,190.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	1,000	137.900	137,900.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	23,000	2.640	60,720.00	
PETROCHINA CO LTD-H	122,000	3.470	423,340.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	900	48.700	43,830.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	41,000	7.690	315,290.00	

PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1,600	30.800	49,280.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	40,000	52.750	2,110,000.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	3,800	22.050	83,790.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	59,000	4.890	288,510.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	11,000	7.790	85,690.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	5,750	15.320	88,090.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,400	11.640	190,896.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	3,000	25.850	77,550.00	
SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	3,000	32.450	97,350.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	13.560	36,612.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	1,500	7.390	11,085.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	4,400	86.650	381,260.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	57,000	4.540	258,780.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	8,800	20.150	177,320.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	10,000	14.340	143,400.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	23,000	4.580	105,340.00	
SUNNY OPTICAL TECH	4,200	107.100	449,820.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	37,600	325.600	12,242,560.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	12,000	13.600	163,200.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	8,000	17.880	143,040.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	4,000	6.020	24,080.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	10,000	16.000	160,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD- H	4,000	74.850	299,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	3,000	6.960	20,880.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	28,000	5.070	141,960.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	12,000	10.840	130,080.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-H	2,540	78.750	200,025.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	23,500	53.900	1,266,650.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	98,800	11.480	1,134,224.00	

	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2,400	7.880	18,912.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	26,000	8.510	221,260.00	
	XPENG INC - CLASS A SHARES	6,500	46.850	304,525.00	
	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	10.060	90,540.00	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	4,000	13.760	55,040.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	10,000	24.900	249,000.00	
	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	2,000	26.600	53,200.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	3,200	9.700	31,040.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	5.950	11,900.00	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	3,100	22.450	69,595.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	3,500	41.000	143,500.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	3,900	38.250	149,175.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	42,000	11.260	472,920.00	
	ZTE CORP-H	6,200	17.900	110,980.00	
香港・ドル	小計	4,578,441		73,776,511.00 (1,295,515,531)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	3,000	250.500	751,500.00	
	ACER INC	13,000	23.600	306,800.00	
	ADVANTECH CO LTD	2,099	334.500	702,115.50	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	947.000	947,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	21,000	99.500	2,089,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	7,000	41.350	289,450.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	4,000	268.500	1,074,000.00	
	AUO CORPORATION	32,800	15.700	514,960.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	4,000	173.500	694,000.00	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	46,000	41.100	1,890,600.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	9,870	212.500	2,097,375.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	19,952	17.450	348,162.40	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	13,000	35.000	455,000.00	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	83,083	12.950	1,075,924.85	
	CHINA STEEL CORP	70,000	29.050	2,033,500.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	21,000	112.000	2,352,000.00	
	COMPAL ELECTRONICS	13,000	21.950	285,350.00	

CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	108,000	22.700	2,451,600.00	
DELTA ELECTRONICS INC	12,000	294.500	3,534,000.00	
E INK HOLDINGS INC	5,000	170.000	850,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	77,300	24.650	1,905,445.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,000	480.000	480,000.00	
EVERGREEN MARINE	5,660	154.500	874,470.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	21,000	33.200	697,200.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	8,000	67.500	540,000.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,320	194.500	645,740.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	56,002	26.200	1,467,252.40	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	18,000	70.900	1,276,200.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	7,000	81.500	570,500.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	23,000	87.900	2,021,700.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	42,735	57.500	2,457,262.50	
GIANT MANUFACTURING	2,000	231.500	463,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	463.000	926,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	76,200	102.000	7,772,400.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	624.000	1,248,000.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	45,314	22.650	1,026,362.10	
INNOLUX CORPORATION	42,535	12.000	510,420.00	
INVENTEC CO LTD	8,000	24.500	196,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	2,190.000	2,190,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	11,000	63.700	700,700.00	
MEDIATEK INC	9,000	729.000	6,561,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	71,450	31.150	2,225,667.50	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	4,000	119.000	476,000.00	
MOMO.COM INC	1,000	636.000	636,000.00	
NAN YA PLASTICS CORP	30,000	73.500	2,205,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	1,000	281.500	281,500.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	8,000	53.700	429,600.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	275.500	275,500.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	4,000	299.000	1,196,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,000	821.000	821,000.00	

PEGATRON CORP	10,000	63.100	631,000.00	
PHARMAESSENTIA CORP	1,000	537.000	537,000.00	
POU CHEN	7,000	33.050	231,350.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	15,000	33.450	501,750.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2,000	273.000	546,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	15,000	72.500	1,087,500.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	3,000	299.500	898,500.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,780	44.850	438,633.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	56,244	8.710	489,885.24	
SILERGY CORP	2,000	477.000	954,000.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	60,074	17.750	1,066,313.50	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	8,000	59.800	478,400.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	76,895	15.050	1,157,269.75	
TAIWAN CEMENT	34,090	33.700	1,148,833.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	60,254	26.250	1,581,667.50	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	28.500	171,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	8,000	95.400	763,200.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	148,000	481.500	71,262,000.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	22,000	47.800	1,051,600.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	25,000	66.000	1,650,000.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	8,000	149.500	1,196,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	75,000	43.500	3,262,500.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	4,000	83.200	332,800.00	
WALSIN LIHWA CORP	15,000	46.950	704,250.00	
WAN HAI LINES LIMITED	3,795	70.100	266,029.50	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	2,000	149.500	299,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	17,000	20.700	351,900.00	
WIWYNN CORP	1,000	906.000	906,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	5,760	48.500	279,360.00	
YAGEO CORPORATION	2,387	479.000	1,143,373.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	9,000	62.800	565,200.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	59,556	22.400	1,334,054.40	

	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	4,000	116.000	464,000.00	
台湾・ドル 小計		1,848,155		165,569,126.14 (739,315,819)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	6,050	195.140	1,180,597.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	654	294.260	192,446.04	
	ANGLO PLATINUM LTD	287	1,589.560	456,203.72	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	2,818	326.300	919,513.40	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	2,248	140.950	316,855.60	
	BID CORP LTD	1,933	342.260	661,588.58	
	BIDVEST GROUP LTD	1,706	220.750	376,599.50	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	534	1,900.000	1,014,600.00	
	CLICKS GROUP LTD	1,256	289.220	363,260.32	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	2,428	122.830	298,231.24	
	EXXARO RESOURCES LTD	1,516	225.350	341,630.60	
	FIRSTRAND LTD	29,955	60.870	1,823,360.85	
	GOLD FIELDS LTD	4,684	192.560	901,951.04	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	3,846	61.410	236,182.86	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	5,899	214.060	1,262,739.94	
	KUMBA IRON ORE LTD	436	507.450	221,248.20	
	MR PRICE GROUP LTD	1,395	163.850	228,570.75	
	MTN GROUP LTD	9,955	130.700	1,301,118.50	
	MULTICHOICE GROUP LTD	1,332	117.590	156,629.88	
	NASPERS LTD-N SHS	1,331	2,797.050	3,722,873.55	
	NEDBANK GROUP LTD	3,390	211.700	717,663.00	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	1,207	104.280	125,865.96	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	1,947	190.660	371,215.02	
	OLD MUTUAL LTD	28,719	10.160	291,785.04	
	REINET INVESTMENTS SCA	764	330.000	252,120.00	
	REMGRO LTD	2,748	137.340	377,410.32	
	SANLAM LIMITED	9,720	48.370	470,156.40	
	SASOL LTD	3,778	271.010	1,023,875.78	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	3,466	238.000	824,908.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	15,663	49.260	771,559.38	
SPAR GROUP LIMITED/THE	596	137.000	81,652.00		
STANDARD BANK GROUP LTD	8,915	169.550	1,511,538.25		
VODACOM GROUP LTD	4,205	129.200	543,286.00		
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	6,082	67.960	413,332.72		
南アフリカ・ランド 小計		171,463		23,752,569.44 (186,695,196)	
合計		14,366,204		4,863,578,498 (4,863,578,498)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	11,135.00	390,170.40	
		ISHARES MSCI QATAR CP ETF	21,703.00	427,983.16	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	41,312.00	1,550,439.36	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	36,408.00	549,760.80	
	アメリカ・ドル	小計	110,558.00	2,918,353.72 (399,114,055)	
投資信託受益証券 合計			110,558	399,114,055 (399,114,055)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	18,800.00	449,884.00	
		メキシコ・ペソ 小計	18,800.00	449,884.00 (3,111,442)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	19,627.00	272,030.22	
		南アフリカ・ランド 小計	19,627.00	272,030.22 (2,138,158)	
投資証券 合計			38,427	5,249,600 (5,249,600)	
合計				404,363,655 (404,363,655)	

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

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 43銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	2.67 -	- 7.07	- -	10.44
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.00	-	-	0.00
インド・ルピー	株式 110銘柄	13.61	-	-	14.59
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.72	-	-	1.84
オフショア・人民元	株式 204銘柄	4.82	-	-	5.17
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.09	-	-	0.10
タイ・バーツ	株式 41銘柄	1.94	-	-	2.08
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.13	-	-	0.14
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.51	-	-	0.54
トルコ・リラ	株式 11銘柄	0.54	-	-	0.58
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.16	-	-	0.17
フィリピン・ペソ	株式 17銘柄	0.68	-	-	0.73
ブラジル・リアル	株式 46銘柄	4.76	-	-	5.10
ポーランド・ズロチ	株式 12銘柄	0.60	-	-	0.65
マレーシア・リングgit	株式 34銘柄	1.38	-	-	1.48
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄 投資証券 1銘柄	2.09 -	- -	- 0.06	2.30
ユーロ	株式 7銘柄	0.32	-	-	0.35
韓国・ウォン	株式 100銘柄	10.76	-	-	11.53
香港・ドル	株式 184銘柄	22.95	-	-	24.59
台湾・ドル	株式 83銘柄	13.10	-	-	14.03
南アフリカ・ランド	株式 34銘柄 投資証券 1銘柄	3.31 -	- -	- 0.04	3.58

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	13,811,163
コール・ローン	437,002,194
国債証券	52,334,796,700
地方債証券	4,322,377,382
特殊債券	5,739,885,672
社債券	5,525,358,000
未収利息	185,981,978
前払費用	4,953,559
流動資産合計	68,564,166,648
資産合計	68,564,166,648
負債の部	
流動負債	
未払解約金	56,325,702
その他未払費用	1,249
流動負債合計	56,326,951
負債合計	56,326,951
純資産の部	
元本等	
元本	72,429,082,391
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,921,242,694
元本等合計	68,507,839,697
純資産合計	68,507,839,697
負債純資産合計	68,564,166,648

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	78,605,413,115円
同期中追加設定元本額	10,190,310,456円
同期中一部解約元本額	16,366,641,180円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブDB(適格機関投資家限定)	53,751,759,211円
DCニッセイ日本債券インデックス	4,179,607,663円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	162,720,525円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	6,882,637,921円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	313,848,171円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	1,578,337,264円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	2,407,337,398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)	281,916,117円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	31,068,483円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	95,043,314円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	68,270,390円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	84,557,339円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	103,163,352円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	379,919,250円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	2,074,777,894円
FWニッセイ国内債インデックス	28,929,493円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	5,188,606円
計	72,429,082,391円
2. 受益権の総数	72,429,082,391口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,921,242,694円です。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		1,939,883,360
地方債証券		85,128,828
特殊債券		98,797,904
社債券		43,314,800
合計		2,167,124,892

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年3月11日から2022年12月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額		0.9459円
（1万口当たり純資産額）		（9,459円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	第432回 利付国債(2年)	111,000,000	111,093,240	
	第433回 利付国債(2年)	114,000,000	114,090,060	
	第434回 利付国債(2年)	114,000,000	114,088,920	
	第435回 利付国債(2年)	102,000,000	102,078,540	
	第436回 利付国債(2年)	95,000,000	95,071,250	
	第437回 利付国債(2年)	106,000,000	106,068,900	
	第438回 利付国債(2年)	92,000,000	92,056,120	
	第439回 利付国債(2年)	200,000,000	200,114,000	
	第440回 利付国債(2年)	175,000,000	175,089,250	
	第441回 利付国債(2年)	400,000,000	400,216,000	
	第442回 利付国債(2年)	200,000,000	200,112,000	
	第139回 利付国債(5年)	53,000,000	53,100,170	
	第140回 利付国債(5年)	296,000,000	296,606,800	
	第141回 利付国債(5年)	377,000,000	377,833,170	
	第142回 利付国債(5年)	405,000,000	405,899,100	
	第143回 利付国債(5年)	377,000,000	377,893,490	
	第144回 利付国債(5年)	497,000,000	498,312,080	
	第145回 利付国債(5年)	290,000,000	290,800,400	
	第146回 利付国債(5年)	80,000,000	80,228,800	
	第149回 利付国債(5年)	456,000,000	455,311,440	
	第150回 利付国債(5年)	200,000,000	199,518,000	
	第153回 利付国債(5年)	408,000,000	406,253,760	
	第1回 利付国債(40年)	95,000,000	117,328,800	
	第2回 利付国債(40年)	115,000,000	136,737,300	
	第3回 利付国債(40年)	118,000,000	140,652,460	
	第4回 利付国債(40年)	157,000,000	185,822,060	
	第5回 利付国債(40年)	159,000,000	181,441,260	
	第6回 利付国債(40年)	167,000,000	185,936,130	
	第7回 利付国債(40年)	183,000,000	194,726,640	
	第8回 利付国債(40年)	184,000,000	181,576,720	
	第9回 利付国債(40年)	232,000,000	167,733,680	
	第10回 利付国債(40年)	211,000,000	179,501,920	
	第11回 利付国債(40年)	174,000,000	142,455,540	
	第12回 利付国債(40年)	106,000,000	77,375,760	
	第13回 利付国債(40年)	170,000,000	123,178,600	
	第14回 利付国債(40年)	236,000,000	182,980,240	
	第15回 利付国債(40年)	106,000,000	89,688,720	
	第333回 利付国債(10年)	89,000,000	89,732,470	
	第334回 利付国債(10年)	387,000,000	390,730,680	

第335回 利付国債(10年)	152,000,000	153,412,080	
第336回 利付国債(10年)	205,000,000	207,109,450	
第337回 利付国債(10年)	348,000,000	350,178,480	
第338回 利付国債(10年)	519,000,000	523,759,230	
第339回 利付国債(10年)	387,000,000	390,943,530	
第340回 利付国債(10年)	470,000,000	475,202,900	
第341回 利付国債(10年)	493,000,000	497,387,700	
第342回 利付国債(10年)	423,000,000	424,239,390	
第343回 利付国債(10年)	341,000,000	341,896,830	
第344回 利付国債(10年)	334,000,000	334,688,040	
第345回 利付国債(10年)	472,000,000	472,660,800	
第346回 利付国債(10年)	328,000,000	328,278,800	
第347回 利付国債(10年)	272,000,000	272,000,000	
第348回 利付国債(10年)	338,000,000	337,678,900	
第349回 利付国債(10年)	494,000,000	493,135,500	
第350回 利付国債(10年)	637,000,000	635,496,680	
第351回 利付国債(10年)	564,000,000	562,454,640	
第352回 利付国債(10年)	370,000,000	368,834,500	
第353回 利付国債(10年)	353,000,000	351,630,360	
第354回 利付国債(10年)	333,000,000	331,451,550	
第355回 利付国債(10年)	339,000,000	337,142,280	
第356回 利付国債(10年)	380,000,000	377,461,600	
第357回 利付国債(10年)	384,000,000	380,943,360	
第358回 利付国債(10年)	384,000,000	380,701,440	
第359回 利付国債(10年)	337,000,000	333,515,420	

第360回 利付国債(10年)	297,000,000	293,379,570	
第361回 利付国債(10年)	467,000,000	460,947,680	
第362回 利付国債(10年)	466,000,000	459,406,100	
第363回 利付国債(10年)	480,000,000	472,809,600	
第364回 利付国債(10年)	598,000,000	588,784,820	
第365回 利付国債(10年)	566,000,000	557,277,940	
第366回 利付国債(10年)	244,000,000	244,331,840	
第367回 利付国債(10年)	189,000,000	188,383,860	
第368回 利付国債(10年)	381,000,000	379,182,630	
第1回 利付国債(30年)	6,000,000	7,049,040	
第2回 利付国債(30年)	66,000,000	76,263,000	
第3回 利付国債(30年)	81,000,000	93,320,910	
第4回 利付国債(30年)	40,000,000	48,286,800	
第5回 利付国債(30年)	52,000,000	60,324,160	
第6回 利付国債(30年)	39,000,000	46,269,210	
第7回 利付国債(30年)	31,000,000	36,754,840	
第8回 利付国債(30年)	63,000,000	71,880,480	
第9回 利付国債(30年)	80,000,000	88,130,400	
第10回 利付国債(30年)	21,000,000	22,504,860	
第11回 利付国債(30年)	25,000,000	28,308,750	
第12回 利付国債(30年)	73,000,000	85,724,630	
第13回 利付国債(30年)	14,000,000	16,303,840	
第14回 利付国債(30年)	35,000,000	42,317,800	
第15回 利付国債(30年)	74,000,000	90,462,780	
第16回 利付国債(30年)	53,000,000	64,890,550	
第17回 利付国債(30年)	54,000,000	65,594,880	
第18回 利付国債(30年)	63,000,000	75,886,020	
第19回 利付国債(30年)	52,000,000	62,693,800	
第20回 利付国債(30年)	59,000,000	72,640,800	
第21回 利付国債(30年)	60,000,000	72,448,200	
第22回 利付国債(30年)	72,000,000	88,809,120	
第23回 利付国債(30年)	73,000,000	90,117,040	
第24回 利付国債(30年)	43,000,000	53,154,450	
第25回 利付国債(30年)	51,000,000	61,772,220	
第26回 利付国債(30年)	108,000,000	132,328,080	
第27回 利付国債(30年)	132,000,000	163,694,520	
第28回 利付国債(30年)	177,000,000	219,577,350	
第29回 利付国債(30年)	209,000,000	256,183,840	
第30回 利付国債(30年)	226,000,000	273,609,160	
第31回 利付国債(30年)	193,000,000	230,565,520	
第32回 利付国債(30年)	242,000,000	292,846,620	

第33回	利付国債(30年)	273,000,000	317,062,200	
第34回	利付国債(30年)	252,000,000	301,029,120	
第35回	利付国債(30年)	281,000,000	326,179,180	
第36回	利付国債(30年)	271,000,000	314,774,630	
第37回	利付国債(30年)	289,000,000	330,295,210	
第38回	利付国債(30年)	191,000,000	214,756,580	
第39回	利付国債(30年)	175,000,000	199,941,000	
第40回	利付国債(30年)	145,000,000	162,987,250	
第41回	利付国債(30年)	150,000,000	165,789,000	
第42回	利付国債(30年)	163,000,000	180,009,050	
第43回	利付国債(30年)	156,000,000	172,135,080	
第44回	利付国債(30年)	165,000,000	181,907,550	
第45回	利付国債(30年)	180,000,000	191,235,600	
第46回	利付国債(30年)	216,000,000	229,197,600	
第47回	利付国債(30年)	201,000,000	216,983,520	
第48回	利付国債(30年)	223,000,000	231,596,650	
第49回	利付国債(30年)	220,000,000	228,140,000	
第50回	利付国債(30年)	222,000,000	202,896,900	
第51回	利付国債(30年)	155,000,000	125,498,850	
第52回	利付国債(30年)	202,000,000	171,100,060	
第53回	利付国債(30年)	187,000,000	161,708,250	
第54回	利付国債(30年)	223,000,000	201,500,570	
第55回	利付国債(30年)	184,000,000	165,815,280	
第56回	利付国債(30年)	188,000,000	168,805,200	
第57回	利付国債(30年)	191,000,000	171,032,860	
第58回	利付国債(30年)	234,000,000	208,767,780	
第59回	利付国債(30年)	181,000,000	157,030,170	
第60回	利付国債(30年)	184,000,000	167,051,760	
第61回	利付国債(30年)	164,000,000	141,295,840	
第62回	利付国債(30年)	160,000,000	130,219,200	
第63回	利付国債(30年)	132,000,000	103,959,240	
第64回	利付国債(30年)	134,000,000	105,143,100	
第65回	利付国債(30年)	122,000,000	95,920,060	
第66回	利付国債(30年)	125,000,000	98,106,250	
第67回	利付国債(30年)	192,000,000	157,420,800	
第68回	利付国債(30年)	159,000,000	129,926,850	
第69回	利付国債(30年)	198,000,000	165,931,920	
第70回	利付国債(30年)	190,000,000	158,724,100	
第71回	利付国債(30年)	155,000,000	129,200,250	
第72回	利付国債(30年)	153,000,000	127,377,090	
第73回	利付国債(30年)	81,000,000	67,353,120	
第74回	利付国債(30年)	191,000,000	172,278,180	
第75回	利付国債(30年)	191,000,000	186,232,640	
第76回	利付国債(30年)	129,000,000	128,191,170	
第69回	利付国債(20年)	32,000,000	32,871,360	
第70回	利付国債(20年)	234,000,000	242,650,980	
第72回	利付国債(20年)	136,000,000	141,116,320	
第73回	利付国債(20年)	105,000,000	109,261,950	
第74回	利付国債(20年)	64,000,000	66,727,040	
第75回	利付国債(20年)	50,000,000	52,384,500	

第76回 利付国債(20年)	71,000,000	74,064,360	
第77回 利付国債(20年)	52,000,000	54,362,360	
第78回 利付国債(20年)	77,000,000	80,693,690	
第79回 利付国債(20年)	64,000,000	67,230,720	
第80回 利付国債(20年)	77,000,000	81,081,000	
第81回 利付国債(20年)	121,000,000	127,702,190	
第82回 利付国債(20年)	135,000,000	142,851,600	
第83回 利付国債(20年)	106,000,000	112,703,440	
第84回 利付国債(20年)	152,000,000	161,153,440	
第85回 利付国債(20年)	115,000,000	122,846,450	
第86回 利付国債(20年)	122,000,000	131,120,720	
第87回 利付国債(20年)	101,000,000	108,220,490	
第88回 利付国債(20年)	158,000,000	170,632,100	
第89回 利付国債(20年)	103,000,000	110,873,320	
第90回 利付国債(20年)	260,000,000	281,086,000	
第91回 利付国債(20年)	185,000,000	200,699,100	
第92回 利付国債(20年)	336,000,000	363,407,520	
第93回 利付国債(20年)	219,000,000	236,925,150	
第94回 利付国債(20年)	267,000,000	289,988,700	
第95回 利付国債(20年)	229,000,000	251,714,510	
第96回 利付国債(20年)	134,000,000	146,085,460	
第97回 利付国債(20年)	196,000,000	215,333,440	
第98回 利付国債(20年)	139,000,000	152,052,100	
第99回 利付国債(20年)	257,000,000	282,245,110	
第100回 利付国債(20年)	189,000,000	209,351,520	
第101回 利付国債(20年)	118,000,000	131,939,340	
第102回 利付国債(20年)	119,000,000	133,688,170	
第103回 利付国債(20年)	112,000,000	125,211,520	
第104回 利付国債(20年)	98,000,000	108,486,980	
第105回 利付国債(20年)	88,000,000	97,815,520	
第106回 利付国債(20年)	53,000,000	59,214,780	
第107回 利付国債(20年)	74,000,000	82,583,260	
第108回 利付国債(20年)	99,000,000	109,301,940	
第109回 利付国債(20年)	79,000,000	87,499,610	
第110回 利付国債(20年)	103,000,000	115,360,000	
第111回 利付国債(20年)	79,000,000	89,308,710	
第112回 利付国債(20年)	126,000,000	141,630,300	

第113回 利付国債(20年)	300,000,000	338,298,000	
第114回 利付国債(20年)	201,000,000	227,355,120	
第115回 利付国債(20年)	120,000,000	136,564,800	
第116回 利付国債(20年)	138,000,000	157,709,160	
第117回 利付国債(20年)	210,000,000	238,488,600	
第118回 利付国債(20年)	134,000,000	151,583,480	
第119回 利付国債(20年)	121,000,000	135,088,030	
第120回 利付国債(20年)	150,000,000	165,247,500	
第121回 利付国債(20年)	206,000,000	231,993,080	
第122回 利付国債(20年)	149,000,000	166,665,440	
第123回 利付国債(20年)	201,000,000	230,231,430	
第124回 利付国債(20年)	128,000,000	145,608,960	
第125回 利付国債(20年)	133,000,000	153,940,850	
第126回 利付国債(20年)	123,000,000	140,373,750	
第127回 利付国債(20年)	119,000,000	134,846,040	
第128回 利付国債(20年)	232,000,000	263,596,080	
第129回 利付国債(20年)	122,000,000	137,598,920	
第130回 利付国債(20年)	189,000,000	213,862,950	
第131回 利付国債(20年)	124,000,000	139,249,520	
第132回 利付国債(20年)	131,000,000	147,492,900	
第133回 利付国債(20年)	156,000,000	177,014,760	
第134回 利付国債(20年)	157,000,000	178,713,100	
第135回 利付国債(20年)	114,000,000	128,735,640	
第136回 利付国債(20年)	118,000,000	132,185,960	
第137回 利付国債(20年)	101,000,000	114,137,070	

第138回 利付国債(20年)	110,000,000	122,270,500	
第139回 利付国債(20年)	114,000,000	127,772,340	
第140回 利付国債(20年)	104,000,000	117,595,920	
第141回 利付国債(20年)	173,000,000	195,701,060	
第142回 利付国債(20年)	119,000,000	135,767,100	
第143回 利付国債(20年)	173,000,000	194,043,720	
第144回 利付国債(20年)	123,000,000	136,745,250	
第145回 利付国債(20年)	246,000,000	278,558,100	
第146回 利付国債(20年)	194,000,000	219,699,180	
第147回 利付国債(20年)	214,000,000	240,088,740	
第148回 利付国債(20年)	184,000,000	204,385,360	
第149回 利付国債(20年)	199,000,000	221,033,280	
第150回 利付国債(20年)	216,000,000	237,342,960	
第151回 利付国債(20年)	216,000,000	232,219,440	
第152回 利付国債(20年)	198,000,000	212,665,860	
第153回 利付国債(20年)	234,000,000	253,957,860	
第154回 利付国債(20年)	220,000,000	235,796,000	
第155回 利付国債(20年)	211,000,000	220,524,540	
第156回 利付国債(20年)	180,000,000	174,078,000	
第157回 利付国債(20年)	182,000,000	170,761,500	
第158回 利付国債(20年)	192,000,000	187,057,920	
第159回 利付国債(20年)	197,000,000	193,987,870	
第160回 利付国債(20年)	180,000,000	179,186,400	
第161回 利付国債(20年)	184,000,000	180,148,880	
第162回 利付国債(20年)	244,000,000	238,024,440	

	第163回 利付国債(20年)	260,000,000	252,688,800	
	第164回 利付国債(20年)	324,000,000	309,092,760	
	第165回 利付国債(20年)	246,000,000	233,714,760	
	第166回 利付国債(20年)	234,000,000	228,323,160	
	第167回 利付国債(20年)	255,000,000	240,380,850	
	第168回 利付国債(20年)	222,000,000	205,085,820	
	第169回 利付国債(20年)	248,000,000	224,343,280	
	第170回 利付国債(20年)	219,000,000	197,266,440	
	第171回 利付国債(20年)	234,000,000	209,869,920	
	第172回 利付国債(20年)	217,000,000	197,248,660	
	第173回 利付国債(20年)	277,000,000	250,914,910	
	第174回 利付国債(20年)	277,000,000	249,848,460	
	第175回 利付国債(20年)	264,000,000	241,631,280	
	第176回 利付国債(20年)	261,000,000	238,086,810	
	第177回 利付国債(20年)	254,000,000	226,646,740	
	第178回 利付国債(20年)	264,000,000	239,168,160	
	第179回 利付国債(20年)	274,000,000	247,556,260	
	第180回 利付国債(20年)	258,000,000	245,889,480	
	第181回 利付国債(20年)	253,000,000	245,065,920	
	第182回 利付国債(20年)	175,000,000	175,141,750	
	国債証券 合計	51,261,000,000	52,334,796,700	
地方債証券	第730回 東京都公募公債	300,000,000	302,226,300	
	第34回 東京都公募公債(20年)	100,000,000	96,822,100	
	平成27年度第1回 北海道公募公債	300,000,000	302,064,300	
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	104,753,900	
	第448回 大阪府公募公債	38,000,000	37,034,192	
	第455回 大阪府公募公債	180,000,000	176,252,040	

第7回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	111,985,800	
第11回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	110,894,800	
第12回 大阪府公募公債(20年)	100,000,000	108,287,600	
平成29年度第5回 京都府公募公債	100,000,000	96,041,500	
第15回 兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	111,250,900	
第21回 兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	109,322,500	
平成26年度第11回 愛知県公募公債	100,000,000	104,174,200	
令和4年度第3回 愛知県公募公債	200,000,000	198,274,000	
平成20年度第1回 福岡県公募公債	100,000,000	111,085,700	
平成24年度第2回 福岡県公募公債	100,000,000	111,376,700	
令和4年度第1回 千葉県公募公債	300,000,000	297,507,600	
第133回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,490,600	
第22回 大阪市公募公債(20年)	100,000,000	93,810,100	
第1回 名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	121,099,800	
第1回 京都市公募公債	300,000,000	312,214,800	
第25回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,199,500	
第26回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,259,100	
第31回 横浜市公募公債(20年)	100,000,000	105,247,000	
第9回 川崎市公募公債(20年)	100,000,000	112,997,700	
第4回 川崎市公募公債(30年)	100,000,000	115,505,600	
平成26年度第2回 北九州市公募公債	150,000,000	151,012,350	
平成30年度第5回 広島市公募公債	200,000,000	198,613,600	
平成29年度第1回 仙台市公募公債	100,000,000	95,573,100	
地方債証券 合計	4,168,000,000	4,322,377,382	
特殊債券			
第9回 新関西国際空港	300,000,000	312,618,900	
第16回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,820,100	
第174回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,133,400	

第205回 政保道路機構債券	100,000,000	110,238,000	
第212回 政保道路機構債券	100,000,000	109,928,400	
第218回 政保道路機構債券	500,000,000	504,533,500	
第233回 政府道路機構債券	100,000,000	107,826,700	
第249回 政保道路機構債券	179,000,000	180,873,235	
第278回 政保道路機構債券	100,000,000	93,338,800	
第293回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,913,900	
第316回 政保道路機構債券	100,000,000	96,468,000	
第319回 政保日本高速道路 保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,172,200	
第17回 地方公共団体金融機 構債券(20年)	200,000,000	221,922,800	
第36回 地方公共団体金融機 構債券(20年)	100,000,000	108,507,100	
第1回 地方公共団体金融機 構債券(30年)	100,000,000	109,914,900	
第72回 政保地方公共団体金 融機構債券	200,000,000	202,137,000	
第83回 政保地方公共団体金 融機構債券	103,000,000	102,710,158	
第116回 政保地方公共団体 金融機構債券	138,000,000	136,671,060	
第120回 政保地方公共団体 金融機構債券	100,000,000	98,228,100	
第136回 地方公共団体金融 機構債券	200,000,000	194,034,800	
第16回 公営企業債券	200,000,000	211,227,000	
第97回 都市再生債券	100,000,000	103,945,100	
第46回 福祉医療機構債券	200,000,000	198,793,400	
第59回 一般担保住宅金融支 援機構債券	200,000,000	221,647,800	
第143回 住宅金融支援機構 債券	100,000,000	104,596,700	
第37回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	20,404,000	21,334,422	
第42回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	50,546,000	52,744,751	
第46回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	58,698,000	61,574,202	
第54回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	48,854,000	50,881,441	
第55回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	54,712,000	56,993,490	
第60回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	57,128,000	59,378,842	
第61回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	28,744,000	29,778,784	
第62回 貸付債権担保住宅金 融支援機構債券	256,968,000	265,936,183	

	第63回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,350,000	164,194,240	
	第73回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,055,000	117,520,672	
	第78回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,181,000	101,008,612	
	第109回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	206,451,000	202,321,980	
	い第845号 利付商工債券	200,000,000	200,080,200	
	い第854号 利付商工債券	200,000,000	199,251,600	
	い第862号 利付商工債券	100,000,000	99,651,200	
	第353回 利付しんきん中金債券	100,000,000	100,034,000	
特殊債券 合計		5,573,091,000	5,739,885,672	
社債券	第29回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2019)	100,000,000	99,005,400	
	第13回 クレディ・アグリコル	100,000,000	99,584,600	
	第5回 スヴェンスカ・ハンデルスバンケン	200,000,000	200,637,600	
	第25回 首都高速道路債券	400,000,000	398,805,600	
	第38回 成田国際空港	200,000,000	194,009,800	
	第60回 中日本高速道路債券	100,000,000	100,645,500	
	第25回 西日本高速道路債券	200,000,000	201,210,400	
	第26回 西日本高速道路債券	200,000,000	201,755,000	
	第13回 日本たばこ産業	100,000,000	99,194,800	
	第14回 森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,948,700	
	第5回 電通グループ	400,000,000	398,045,600	
	第1回 オリックス銀行	200,000,000	199,392,400	
	第19回 豊田通商	100,000,000	101,992,300	
	第1回 三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	100,000,000	100,557,600	
	第29回 三菱東京UFJ銀行劣後特約付	100,000,000	105,060,100	
	第1回 三井住友フィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	100,569,000	
	第8回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	100,000,000	104,328,700	
	第16回 NTTファイナンス	200,000,000	199,026,400	
	第18回 NTTファイナンス	100,000,000	97,864,700	
	第96回 トヨタファイナンス	100,000,000	99,217,800	
	第2回 三菱HCキャピタル	100,000,000	98,237,500	
	第40回 三菱UFJリース	300,000,000	297,681,900	
	第6回 三井住友海上火災保険	100,000,000	99,861,600	
	第66回 三井不動産	100,000,000	99,965,800	
	第132回 三菱地所	100,000,000	98,707,200	
	第7回 野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	222,359,200	
	第106回 東日本旅客鉄道	100,000,000	100,534,000	

第3回 東日本旅客鉄道サステナビリティボンド	100,000,000	96,708,500	
第27回 K D D I	200,000,000	199,341,000	
第510回 関西電力	100,000,000	99,609,200	
第381回 中国電力	200,000,000	202,376,000	
第306回 北陸電力	100,000,000	101,136,100	
第429回 九州電力	200,000,000	202,430,200	
第451回 九州電力	100,000,000	99,510,300	
第331回 北海道電力	100,000,000	100,156,400	
第352回 北海道電力	100,000,000	100,274,000	
第13回 電源開発	100,000,000	104,617,100	
社債券 合計	5,500,000,000	5,525,358,000	
合計		67,922,417,754	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	498,316,995
金銭信託	3,355,525
コール・ローン	106,172,942
国債証券	109,819,382,888
派生商品評価勘定	101,534,881
未収利息	600,851,097
前払費用	76,496,082
流動資産合計	111,206,110,410
資産合計	
111,206,110,410	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	464,546,481
未払金	304,004,355
未払解約金	807,993
その他未払費用	1,466
流動負債合計	769,360,295
負債合計	
769,360,295	
純資産の部	
元本等	
元本	107,106,575,454
剰余金	
剰余金又は欠損金()	3,330,174,661
元本等合計	110,436,750,115
純資産合計	110,436,750,115
負債純資産合計	111,206,110,410

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	93,523,743,774円
同期中追加設定元本額	18,601,843,507円
同期中一部解約元本額	5,019,011,827円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブD B（適格機関投資家限定）	94,742,697,219円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02（適格機関投資家限定）	2,551,425,627円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09（適格機関投資家限定）	2,569,781,332円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01（適格機関投資家限定）	2,518,023,970円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05（適格機関投資家限定）	2,505,903,338円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08（適格機関投資家限定）	2,209,779,242円
FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）	8,964,726円
計	107,106,575,454円
2. 受益権の総数	107,106,575,454口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券		10,924,095,966
合計		10,924,095,966

(注)「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年3月11日から2022年12月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年12月12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	109,479,548,765	-	109,842,560,365	363,011,600
アメリカ・ドル	55,009,408,703	-	55,043,636,473	34,227,770
イギリス・ポンド	5,293,035,798	-	5,352,363,344	59,327,546
イスラエル・シケル	401,856,797	-	405,684,309	3,827,512
オーストラリア・ドル	1,776,472,629	-	1,764,890,097	11,582,532
オフショア・人民元	3,910,180,834	-	3,946,056,283	35,875,449
カナダ・ドル	2,271,976,689	-	2,231,291,806	40,684,883
シンガポール・ドル	1,111,048,909	-	1,115,114,681	4,065,772
スウェーデン・クローナ	226,938,901	-	229,481,236	2,542,335
デンマーク・クローネ	370,166,766	-	373,036,514	2,869,748
ニュージーランド・ドル	246,576,591	-	249,325,201	2,748,610
ノルウェー・クローネ	230,113,177	-	226,028,163	4,085,014
ポーランド・ズロチ	466,922,160	-	471,240,000	4,317,840
メキシコ・ペソ	942,925,889	-	919,888,710	23,037,179
ユーロ	37,221,924,922	-	37,514,523,548	292,598,626
合計	109,479,548,765	-	109,842,560,365	363,011,600

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年12月12日現在
1口当たり純資産額	1.0311円
(1万口当たり純資産額)	(10,311円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	360,000.00	403,394.40	
		US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,121,243.20	
		US TREASURY N/B	340,000.00	375,910.80	
		US TREASURY N/B	3,430,000.00	3,317,050.10	
		US TREASURY N/B	28,020,000.00	27,388,429.20	
		US TREASURY N/B	19,520,000.00	18,948,844.80	
		US TREASURY N/B	28,680,000.00	27,691,687.20	
		US TREASURY N/B	3,950,000.00	3,522,728.50	
		US TREASURY N/B	10,290,000.00	9,893,217.60	
		US TREASURY N/B	15,320,000.00	14,595,823.60	
		US TREASURY N/B	14,310,000.00	13,627,985.40	
		US TREASURY N/B	3,530,000.00	3,012,078.40	
		US TREASURY N/B	14,870,000.00	14,068,358.30	
		US TREASURY N/B	12,640,000.00	12,008,000.00	
		US TREASURY N/B	11,400,000.00	10,589,916.00	
		US TREASURY N/B	11,340,000.00	10,487,232.00	
		US TREASURY N/B	11,830,000.00	10,844,679.30	
		US TREASURY N/B	4,180,000.00	3,159,954.60	
		US TREASURY N/B	10,810,000.00	10,062,920.90	
		US TREASURY N/B	10,520,000.00	9,864,498.80	
		US TREASURY N/B	12,300,000.00	11,563,353.00	
		US TREASURY N/B	10,890,000.00	10,163,419.20	
		US TREASURY N/B	4,710,000.00	3,934,875.30	
		US TREASURY N/B	12,090,000.00	11,251,195.80	
		US TREASURY N/B	8,710,000.00	8,283,645.50	
		US TREASURY N/B	530,000.00	586,662.30	
		US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,357,350.00	
		US TREASURY N/B	1,210,000.00	1,300,036.10	
		US TREASURY N/B	9,440,000.00	9,004,060.80	
		US TREASURY N/B	6,680,000.00	5,873,657.20	
		US TREASURY N/B	9,590,000.00	9,265,186.70	
		US TREASURY N/B	890,000.00	968,845.10	
		US TREASURY N/B	8,220,000.00	7,713,894.60	
		US TREASURY N/B	8,550,000.00	7,893,018.00	
US TREASURY N/B	5,840,000.00	5,146,500.00			
US TREASURY N/B	7,720,000.00	5,867,431.60			
US TREASURY N/B	6,300,000.00	5,595,660.00			
US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,498,486.40			
US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,422,407.80			
US TREASURY N/B	250,000.00	290,000.00			
US TREASURY N/B	1,420,000.00	933,366.00			

US TREASURY N/B	10,480,000.00	8,415,440.00	
US TREASURY N/B	9,890,000.00	6,028,251.70	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	1,800,789.60	
US TREASURY N/B	8,060,000.00	6,715,269.60	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	3,614,420.80	
US TREASURY N/B	2,970,000.00	2,603,026.80	
US TREASURY N/B	8,110,000.00	6,724,325.40	
US TREASURY N/B	11,760,000.00	8,409,693.60	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,991,858.00	
US TREASURY N/B	9,830,000.00	8,535,585.60	
US TREASURY N/B	3,960,000.00	3,155,922.00	
US TREASURY N/B	2,080,000.00	1,837,451.20	
US TREASURY N/B	5,820,000.00	5,432,562.60	
US TREASURY N/B	7,860,000.00	7,042,009.80	
US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,422,385.60	
WI TREASURY SEC.	940,000.00	1,021,253.60	
WI TREASURY SEC.	2,500,000.00	2,018,750.00	
WI TREASURY SEC.	4,410,000.00	4,779,469.80	
アメリカ・ドル 小計	444,890,000.00 (60,843,156,400)	404,445,470.20 (55,311,962,506)	
イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	980,000.00	1,027,775.00
	UNITED KINGDOM GILT	1,110,000.00	1,269,451.50
	UNITED KINGDOM GILT	2,020,000.00	1,995,032.80
	UNITED KINGDOM GILT	170,000.00	175,236.00
	UNITED KINGDOM GILT	180,000.00	148,177.80
	UNITED KINGDOM GILT	1,190,000.00	1,120,837.20
	UNITED KINGDOM GILT	750,000.00	597,360.00
	UNITED KINGDOM GILT	1,090,000.00	1,194,552.80
	UNITED KINGDOM GILT	1,040,000.00	1,087,819.20
	UNITED KINGDOM GILT	1,150,000.00	1,053,227.50
	UNITED KINGDOM GILT	1,040,000.00	1,187,108.00
	UNITED KINGDOM GILT	1,490,000.00	1,369,161.00
	UNITED KINGDOM GILT	760,000.00	473,654.80
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	309,948.80
	UNITED KINGDOM GILT	620,000.00	427,527.20
	UNITED KINGDOM GILT	590,000.00	378,591.20
	UNITED KINGDOM GILT	1,210,000.00	1,362,980.30
	UNITED KINGDOM GILT	980,000.00	844,368.00
	UNITED KINGDOM GILT	2,560,000.00	2,402,432.00
	UNITED KINGDOM GILT	900,000.00	972,126.00
	UNITED KINGDOM GILT	1,720,000.00	1,868,315.60
	UNITED KINGDOM GILT	1,050,000.00	1,179,643.50
	UNITED KINGDOM GILT	1,450,000.00	988,334.50
	UNITED KINGDOM GILT	1,340,000.00	1,079,839.00
	UNITED KINGDOM GILT	890,000.00	810,647.60
	UNITED KINGDOM GILT	670,000.00	479,284.50
	UNITED KINGDOM GILT	1,670,000.00	1,298,341.50
	UNITED KINGDOM GILT	2,320,000.00	1,327,921.60

	UNITED KINGDOM GILT	750,000.00	441,000.00	
	UNITED KINGDOM GILT	970,000.00	1,073,508.70	
	UNITED KINGDOM GILT	1,450,000.00	1,577,948.00	
イギリス・ポンド	小計	34,430,000.00 (5,756,696,000)	31,522,151.60 (5,270,503,748)	
イスラエル・シケル	ISRAEL FIXED BOND	3,240,000.00	3,188,322.00	
	ISRAEL FIXED BOND	2,490,000.00	2,388,283.50	
	ISRAEL FIXED BOND	1,770,000.00	1,520,518.50	
	ISRAEL FIXED BOND	2,280,000.00	2,424,096.00	
	ISRAEL FIXED BOND	150,000.00	140,482.50	
	ISRAEL FIXED BOND	650,000.00	599,235.00	
イスラエル・シケル	小計	10,580,000.00 (422,052,070)	10,260,937.50 (409,324,188)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	780,000.00	783,634.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	995,750.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,930,000.00	2,132,302.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	332,182.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,210,000.00	1,242,004.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,950,000.00	1,864,024.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,130,000.00	1,015,350.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,080,000.00	2,934,285.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	180,000.00	158,884.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,720,000.00	1,495,350.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,550,000.00	1,296,063.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,340,000.00	2,159,188.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	630,000.00	424,141.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,340,000.00	2,497,177.80	
オーストラリア・ドル	小計	20,160,000.00 (1,862,380,800)	19,330,339.90 (1,785,736,800)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	2,900,000.00	3,081,337.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,900,000.00	3,944,343.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,100,000.00	13,128,820.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,100,000.00	12,116,214.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,900,000.00	14,996,254.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,401,792.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,739,400.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	7,506,444.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,057,934.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,296,217.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,000,000.00	11,996,400.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,494,995.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,108,012.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,900,000.00	8,951,798.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,900,000.00	6,870,813.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	6,954,640.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,530,560.00	

	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,988,080.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	6,044,612.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,900,000.00	2,845,741.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	7,397,688.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	13,879,740.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,000,000.00	10,838,520.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,000,000.00	10,921,350.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,447,845.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,300,000.00	3,198,921.00	
オフショア・人民元 小計		196,300,000.00 (3,848,540,020)	195,738,470.00 (3,837,531,000)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT	260,000.00	257,189.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	660,000.00	728,178.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	830,000.00	1,030,752.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,880,000.00	5,762,106.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,648,201.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	760,000.00	697,011.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	115,197.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,330,000.00	1,956,454.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,295,083.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,120,000.00	1,000,529.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,532,824.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,550,000.00	2,290,665.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	950,000.00	745,237.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,322,825.00	
カナダ・ドル 小計		23,780,000.00 (2,380,378,000)	22,382,252.90 (2,240,463,515)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,380,000.00	2,468,536.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	460,000.00	454,544.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	830,000.00	817,135.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	450,000.00	451,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,370,000.00	3,276,651.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	530,000.00	521,944.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,003,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	600,000.00	597,618.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,490,000.00	1,475,845.00	
シンガポール・ドル 小計		11,310,000.00 (1,141,631,400)	11,067,273.40 (1,117,130,577)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	2,900,000.00	2,912,673.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,450,000.00	2,355,111.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	6,110,000.00	5,768,023.30	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,340,000.00	2,975,590.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	3,950,000.00	3,455,697.00	
スウェーデン・クローナ 小計		17,750,000.00 (234,477,500)	17,467,095.60 (230,740,333)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	5,220,000.00	5,157,203.40	

	KINGDOM OF DENMARK	380,000.00	351,633.00	
	KINGDOM OF DENMARK	5,360,000.00	4,436,311.20	
	KINGDOM OF DENMARK	6,990,000.00	9,417,347.40	
デンマーク・クローネ 小計		17,950,000.00 (346,973,500)	19,362,495.00 (374,277,028)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	700,000.00	671,692.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	420,000.00	354,555.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	850,000.00	696,167.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	300,000.00	228,774.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	860,000.00	755,174.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	152,290.50	
ニュージーランド・ドル 小計		3,280,000.00 (286,409,600)	2,858,653.70 (249,617,641)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,120,000.00	5,118,771.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,150,000.00	2,059,291.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,320,000.00	6,847,567.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,628,900.00	
ノルウェー・クローネ 小計		17,590,000.00 (240,455,300)	16,654,529.90 (227,667,424)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,350,000.00	1,239,637.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	810,000.00	702,156.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,310,000.00	5,329,110.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,650,000.00	1,376,001.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,300,000.00	3,971,652.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,300,000.00	2,958,400.00	
ポーランド・ズロチ 小計		18,720,000.00 (574,037,568)	15,576,957.60 (477,658,059)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	23,150,000.00	21,539,454.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,200,000.00	2,903,488.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,500,000.00	3,161,165.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	32,300,000.00	31,496,376.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	30,870,000.00	29,322,795.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,300,000.00	10,112,334.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	34,450,000.00	32,826,027.00	
メキシコ・ペソ 小計		137,770,000.00 (952,831,097)	131,361,640.10 (908,510,239)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,080,000.00	1,085,454.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,520,000.00	1,890,956.00	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	552,080.80	
	BELGIUM KINGDOM	1,480,000.00	1,323,948.80	
	BELGIUM KINGDOM	950,000.00	919,201.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,240,000.00	1,193,785.20	
	BELGIUM KINGDOM	420,000.00	340,153.80	
	BELGIUM KINGDOM	480,000.00	434,380.80	
	BELGIUM KINGDOM	960,000.00	903,830.40	
	BELGIUM KINGDOM	610,000.00	563,762.00	

BELGIUM KINGDOM	180,000.00	153,471.60	
BELGIUM KINGDOM	1,230,000.00	1,143,654.00	
BELGIUM KINGDOM	1,070,000.00	982,527.50	
BELGIUM KINGDOM	410,000.00	333,510.40	
BELGIUM KINGDOM	1,360,000.00	1,647,449.60	
BELGIUM KINGDOM	570,000.00	460,503.00	
BELGIUM KINGDOM	720,000.00	589,608.00	
BONOS Y OBLIG DE	1,100,000.00	902,165.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	990,000.00	1,299,998.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,700,000.00	2,755,107.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,720,000.00	1,633,157.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	566,423.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	780,000.00	807,853.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,920,000.00	2,805,506.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	930,000.00	894,353.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,800,000.00	2,667,420.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,310,000.00	1,200,916.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,070,000.00	2,553,717.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,125,378.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,690,000.00	3,469,743.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	532,511.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,650,000.00	2,317,213.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,170,000.00	1,131,694.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,650,000.00	2,318,909.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	561,344.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,570,000.00	4,350,914.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	130,000.00	94,018.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	880,000.00	816,508.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,070,000.00	1,663,058.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	398,689.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	205,263.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	379,271.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	1,450,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,750,000.00	3,739,762.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000.00	2,744,088.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,230,000.00	2,192,692.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,140,000.00	2,071,498.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,300,000.00	4,190,092.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,350,000.00	4,158,687.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,030,000.00	1,329,719.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,080,000.00	4,748,377.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,950,000.00	1,830,367.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,070,000.00	1,414,882.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	810,000.00	1,145,979.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,730,000.00	3,479,642.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	990,000.00	904,464.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	2,541,028.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,860,000.00	1,813,583.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	860,000.00	1,052,175.60	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,940,000.00	2,574,205.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,270,000.00	995,934.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,480,000.00	1,852,042.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	257,643.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,570,000.00	2,186,350.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,380,000.00	848,161.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,900,000.00	1,598,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	830,000.00	926,495.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,340,000.00	2,370,396.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,150,000.00	3,061,579.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,770,000.00	2,342,367.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,850,000.00	5,712,700.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,420,000.00	1,675,159.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,150,000.00	955,144.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,680,000.00	2,510,409.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	409,162.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,880,000.00	1,645,488.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,180,000.00	4,136,026.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,370,000.00	3,220,944.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	630,000.00	558,501.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,180,000.00	3,949,138.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,340,000.00	1,499,379.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,740,000.00	1,696,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,380,000.00	1,349,819.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,124,826.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,110,000.00	3,519,276.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,780,000.00	1,374,338.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,570,000.00	1,186,056.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,510,000.00	1,653,812.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,030,000.00	2,508,264.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,310,000.00	4,220,998.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	654,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	583,410.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,320,000.00	1,808,509.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	810,000.00	530,452.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	760,000.00	683,126.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	221,163.30	
DEUTSCHLAND REP	1,640,000.00	2,070,631.20	
FINNISH GOVERNMENT	620,000.00	634,749.80	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	135,398.20	
FINNISH GOVERNMENT	780,000.00	739,229.40	
FINNISH GOVERNMENT	460,000.00	396,961.60	
FINNISH GOVERNMENT	620,000.00	515,895.80	
FINNISH GOVERNMENT	230,000.00	155,815.80	
FINNISH GOVERNMENT	410,000.00	340,546.00	
FINNISH GOVERNMENT	660,000.00	541,543.20	
FINNISH GOVERNMENT	530,000.00	511,004.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,130,000.00	1,387,798.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,910,000.00	2,117,445.10	

FRANCE (GOVT OF)	5,100,000.00	5,099,286.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,770,000.00	3,850,150.20	
FRANCE (GOVT OF)	4,040,000.00	3,876,501.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,640,000.00	1,586,618.00	
FRANCE (GOVT OF)	4,470,000.00	4,227,368.40	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	496,446.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,050,000.00	1,739,712.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	929,030.00	
FRANCE (GOVT OF)	5,840,000.00	5,557,110.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,140,000.00	1,018,259.40	
FRANCE (GOVT OF)	5,500,000.00	5,096,190.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,430,000.00	1,248,418.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,730,000.00	2,038,926.10	
FRANCE (GOVT OF)	2,180,000.00	2,762,823.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,196,115.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,420,000.00	5,772,671.40	
FRANCE (GOVT OF)	2,200,000.00	2,090,924.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,240,000.00	795,274.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,866,840.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,740,000.00	3,897,304.40	
FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	1,127,994.00	
FRANCE (GOVT OF)	710,000.00	500,862.40	
FRANCE (GOVT OF)	420,000.00	202,893.60	
FRANCE (GOVT OF)	770,000.00	483,937.30	
FRANCE (GOVT OF)	2,690,000.00	2,161,038.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,560,000.00	2,021,557.20	
FRANCE (GOVT OF)	850,000.00	1,107,422.50	
IRELAND GOVERNMENT BOND	840,000.00	756,226.80	
IRELAND GOVERNMENT BOND	270,000.00	260,863.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	410,000.00	383,345.90	
IRELAND GOVERNMENT BOND	860,000.00	770,577.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	1,210,000.00	1,129,692.30	
IRELAND GOVERNMENT BOND	50,000.00	40,481.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	856,392.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	340,000.00	289,890.80	
IRELAND GOVERNMENT BOND	580,000.00	473,262.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	950,000.00	1,084,444.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	409,364.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	730,000.00	696,558.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,340,000.00	1,268,792.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	870,000.00	821,193.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	970,000.00	948,349.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,090,000.00	1,946,897.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,360,000.00	1,646,579.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	248,211.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,360,000.00	1,040,862.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,630,000.00	1,391,465.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	348,776.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	110,000.00	101,160.40	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	670,000.00	394,388.80	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	85,498.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	533,212.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	460,000.00	511,556.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	690,000.00	657,052.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	87,910.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	360,000.00	315,270.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,110,000.00	1,031,767.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,050,000.00	1,245,111.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,280,000.00	1,390,758.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	334,630.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	990,000.00	812,057.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,600,000.00	1,519,744.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	695,064.00	
	ユーロ 小計	271,540,000.00 (39,036,590,400)	260,004,589.80 (37,378,259,830)	
国債証券 合計		117,926,609,655 (117,926,609,655)	109,819,382,888 (109,819,382,888)	
合計			109,819,382,888 (109,819,382,888)	

（注）

- 1．各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
- 2．合計欄における（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
- 3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 59銘柄	50.08	50.37
イギリス・ポンド	国債証券 31銘柄	4.77	4.80
イスラエル・シケル	国債証券 6銘柄	0.37	0.37
オーストラリア・ドル	国債証券 14銘柄	1.62	1.63
オフショア・人民元	国債証券 26銘柄	3.47	3.49
カナダ・ドル	国債証券 14銘柄	2.03	2.04
シンガポール・ドル	国債証券 9銘柄	1.01	1.02
スウェーデン・クローナ	国債証券 5銘柄	0.21	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券 4銘柄	0.34	0.34
ニュージーランド・ドル	国債証券 6銘柄	0.23	0.23
ノルウェー・クローネ	国債証券 4銘柄	0.21	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券 6銘柄	0.43	0.43
メキシコ・ペソ	国債証券 7銘柄	0.82	0.83
ユーロ	国債証券 171銘柄	33.85	34.04

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	107,920,847
金銭信託	4,276,640
コール・ローン	135,318,151
国債証券	56,963,674,167
派生商品評価勘定	40,503
未収利息	310,365,995
前払費用	25,376,125
流動資産合計	57,546,972,428
資産合計	
57,546,972,428	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	673,362
未払金	781,681,893
未払解約金	53,973,424
その他未払費用	439
流動負債合計	836,329,118
負債合計	
836,329,118	
純資産の部	
元本等	
元本	37,157,490,721
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,553,152,589
元本等合計	56,710,643,310
純資産合計	56,710,643,310
負債純資産合計	57,546,972,428

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	30,597,024,407円
同期中追加設定元本額	13,167,239,630円
同期中一部解約元本額	6,606,773,316円
元本の内訳	
ファンド名	
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	3,229,869,400円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,453,282,942円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,077,897,451円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	873,641,585円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	2,741,209円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	6,642,931円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	5,152,267円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	14,413,951,164円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	4,142,970,521円
DCニッセイ外国債券インデックス	3,339,214,161円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	198,635,153円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,761,117,296円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	230,522,346円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	444,808,323円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	71,055,004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)	173,404,066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)	18,961,745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)	41,659,051円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	144,757,302円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	96,014,132円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	211,175,493円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	194,942,219円
FWニッセイ外国債インデックス	14,372,027円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	10,702,933円
計	37,157,490,721円
2. 受益権の総数	37,157,490,721口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2．金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券	739,250,311	
合計	739,250,311	

(注) 「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年11月22日から2022年12月12日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年12月12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	811,655,982	-	811,023,123	632,859
アメリカ・ドル	427,413,564	-	426,841,862	571,702
イギリス・ポンド	38,140,968	-	38,137,906	3,062
イスラエル・シケル	2,264,563	-	2,269,667	5,104
オーストラリア・ドル	11,076,262	-	11,075,494	768
オフショア・人民元	25,489,100	-	25,483,640	5,460
カナダ・ドル	15,200,994	-	15,203,546	2,552
シンガポール・ドル	4,094,806	-	4,095,029	223
スウェーデン・クローナ	1,183,970	-	1,184,338	368
デンマーク・クローネ	2,011,640	-	2,011,755	115
ニュージーランド・ドル	2,269,188	-	2,266,040	3,148
ノルウェー・クローネ	1,573,594	-	1,573,640	46
ポーランド・ズロチ	3,332,121	-	3,328,570	3,551
マレーシア・リングギット	5,504,489	-	5,505,946	1,457
メキシコ・ペソ	7,041,407	-	7,045,484	4,077
ユーロ	265,059,316	-	265,000,206	59,110
合計	811,655,982	-	811,023,123	632,859

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年12月12日現在
1口当たり純資産額	1.5262円
(1万口当たり純資産額)	(15,262円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	132,266.40	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	128,896.80	
		US TREASURY BONDS	170,000.00	190,491.80	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	105,800.00	
		US TREASURY N/B	460,000.00	387,798.40	
		US TREASURY N/B	170,000.00	187,955.40	
		US TREASURY N/B	650,000.00	558,441.00	
		US TREASURY N/B	450,000.00	435,181.50	
		US TREASURY N/B	450,000.00	443,299.50	
		US TREASURY N/B	4,550,000.00	4,447,443.00	
		US TREASURY N/B	6,530,000.00	6,338,932.20	
		US TREASURY N/B	5,590,000.00	5,397,368.60	
		US TREASURY N/B	610,000.00	544,016.30	
		US TREASURY N/B	6,140,000.00	5,903,241.60	
		US TREASURY N/B	5,760,000.00	5,487,724.80	
		US TREASURY N/B	4,680,000.00	4,456,951.20	
		US TREASURY N/B	390,000.00	349,443.90	
		US TREASURY N/B	490,000.00	473,996.60	
		US TREASURY N/B	450,000.00	418,288.50	
		US TREASURY N/B	510,000.00	445,510.50	
		US TREASURY N/B	670,000.00	535,470.70	
		US TREASURY N/B	330,000.00	288,053.70	
		US TREASURY N/B	450,000.00	383,976.00	
		US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,465,544.80	
		US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,572,000.00	
		US TREASURY N/B	280,000.00	244,496.00	
		US TREASURY N/B	3,570,000.00	3,316,315.80	
		US TREASURY N/B	540,000.00	430,077.60	
		US TREASURY N/B	3,230,000.00	2,987,104.00	
		US TREASURY N/B	580,000.00	461,210.20	
		US TREASURY N/B	3,640,000.00	3,336,824.40	
		US TREASURY N/B	680,000.00	514,059.60	
		US TREASURY N/B	3,720,000.00	3,462,910.80	
		US TREASURY N/B	310,000.00	264,671.80	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,633,013.00			
US TREASURY N/B	3,310,000.00	3,103,753.90			
US TREASURY N/B	600,000.00	523,614.00			
US TREASURY N/B	2,030,000.00	1,965,202.40			
US TREASURY N/B	3,910,000.00	3,675,830.10			
US TREASURY N/B	470,000.00	410,587.30			
US TREASURY N/B	2,090,000.00	2,010,308.30			

US TREASURY N/B	4,270,000.00	3,985,105.60	
US TREASURY N/B	690,000.00	576,446.70	
US TREASURY N/B	1,990,000.00	1,911,713.40	
US TREASURY N/B	4,160,000.00	3,871,379.20	
US TREASURY N/B	160,000.00	174,673.60	
US TREASURY N/B	670,000.00	560,019.50	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,419,200.00	
US TREASURY N/B	3,920,000.00	3,728,116.00	
US TREASURY N/B	150,000.00	166,036.50	
US TREASURY N/B	770,000.00	675,459.40	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,385,945.90	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,433,250.00	
US TREASURY N/B	820,000.00	736,942.20	
US TREASURY N/B	160,000.00	157,086.40	
US TREASURY N/B	240,000.00	257,858.40	
US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,785,708.80	
US TREASURY N/B	3,320,000.00	3,166,682.40	
US TREASURY N/B	930,000.00	817,739.70	
US TREASURY N/B	260,000.00	287,716.00	
US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,698,987.50	
US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,198,001.20	
US TREASURY N/B	920,000.00	868,424.80	
US TREASURY N/B	280,000.00	304,805.20	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,823,772.00	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,035,249.00	
US TREASURY N/B	980,000.00	866,947.20	
US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,442,615.00	
US TREASURY N/B	3,750,000.00	3,461,850.00	
US TREASURY N/B	290,000.00	325,330.70	
US TREASURY N/B	950,000.00	821,341.50	
US TREASURY N/B	2,030,000.00	1,892,325.40	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	2,996,250.00	
US TREASURY N/B	900,000.00	684,027.00	
US TREASURY N/B	1,930,000.00	1,776,352.70	
US TREASURY N/B	2,210,000.00	1,962,922.00	
US TREASURY N/B	270,000.00	274,819.50	
US TREASURY N/B	840,000.00	656,737.20	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,961,495.70	
US TREASURY N/B	1,950,000.00	1,691,683.50	
US TREASURY N/B	260,000.00	277,456.40	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	782,412.90	
US TREASURY N/B	130,000.00	150,800.00	
US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,806,551.10	
US TREASURY N/B	840,000.00	552,132.00	
US TREASURY N/B	280,000.00	317,984.80	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	1,913,262.60	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	1,734,480.00	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	859,437.30	
US TREASURY N/B	1,010,000.00	658,984.60	

US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,454,765.40	
US TREASURY N/B	2,280,000.00	1,861,483.20	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	893,281.10	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	783,656.00	
US TREASURY N/B	3,760,000.00	3,592,830.40	
US TREASURY N/B	1,120,000.00	958,552.00	
US TREASURY N/B	2,180,000.00	1,816,288.80	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,062,386.10	
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,029,517.40	
US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,085,434.00	
US TREASURY N/B	4,350,000.00	4,117,536.00	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,011,229.50	
US TREASURY N/B	2,190,000.00	1,883,137.20	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,209,604.50	
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,220,698.00	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,489,948.00	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	927,727.80	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	1,948,479.00	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,108,420.50	
US TREASURY N/B	1,570,000.00	1,124,559.60	
US TREASURY N/B	4,270,000.00	3,978,914.10	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,211,188.80	
US TREASURY N/B	1,970,000.00	1,704,739.50	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	1,933,650.40	
US TREASURY N/B	1,430,000.00	990,661.10	
US TREASURY N/B	280,000.00	253,509.20	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	978,452.10	
US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,697,946.20	
US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,338,481.60	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	1,875,571.20	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	978,787.50	
US TREASURY N/B	290,000.00	262,255.70	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	852,736.50	
US TREASURY N/B	270,000.00	238,515.30	
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,070,862.60	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,020,951.80	
US TREASURY N/B	920,000.00	844,817.60	
US TREASURY N/B	2,040,000.00	1,904,197.20	
US TREASURY N/B	1,270,000.00	1,137,831.10	
US TREASURY N/B	800,000.00	748,624.00	
US TREASURY N/B	320,000.00	270,400.00	
US TREASURY N/B	2,070,000.00	2,037,480.30	
US TREASURY N/B	760,000.00	795,264.00	
US TREASURY N/B	460,000.00	497,950.00	
US TREASURY N/B	330,000.00	338,867.10	
US TREASURY NOTES	150,000.00	174,474.00	
WI TREASURY SEC.	270,000.00	293,338.80	
WI TREASURY SEC.	1,230,000.00	725,503.20	
WI TREASURY SEC.	1,660,000.00	1,340,450.00	

	WI TREASURY SEC.	260,000.00	281,782.80	
	WI TREASURY SEC.	260,000.00	258,494.60	
アメリカ・ドル	小計	232,290,000.00 (31,767,980,400)	209,928,823.70 (28,709,865,926)	
イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	347,770.40	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	335,600.00	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	365,968.00	
	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	227,157.20	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	390,764.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	268,008.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	290,040.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	246,963.00	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	301,401.60	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	229,362.00	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	350,451.20	
	UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	253,802.00	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	361,653.60	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	334,713.60	
	UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	265,596.50	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	410,922.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	238,914.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	162,039.80	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	300,262.90	
	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	158,598.80	
	UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	322,984.60	
	UNITED KINGDOM GILT	270,000.00	291,486.60	
	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	263,596.10	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	400,633.20	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	166,836.80	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	292,871.80	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	267,096.00	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	328,457.50	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	345,644.80	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	369,318.20	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	415,683.90	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	333,988.90	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	265,930.50	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	141,417.50	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	273,252.00	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	265,155.40	
	UNITED KINGDOM GILT	200,000.00	97,748.00	
	UNITED KINGDOM GILT	430,000.00	307,600.50	
	UNITED KINGDOM GILT	670,000.00	645,712.50	
	UNITED KINGDOM GILT	570,000.00	443,146.50	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	194,609.20	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	439,285.00	
UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	241,080.00		
UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	210,285.00		

	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	339,040.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	234,795.00	
	UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	447,657.60	
	UNITED KINGDOM GILT	200,000.00	124,356.00	
	UNITED KINGDOM GILT	680,000.00	559,504.00	
	UNITED KINGDOM GILT	200,000.00	99,472.00	
	UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	287,744.60	
	UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	352,263.80	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	435,296.00	
	UNITED KINGDOM GILT	180,000.00	184,748.40	
	UNITED KINGDOM GILT	120,000.00	122,570.40	
イギリス・ポンド 小計		18,460,000.00 (3,086,512,000)	16,351,256.90 (2,733,930,154)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND	420,000.00	399,798.00	
	ISRAEL FIXED BOND	310,000.00	305,055.50	
	ISRAEL FIXED BOND	440,000.00	453,178.00	
	ISRAEL FIXED BOND	680,000.00	654,602.00	
	ISRAEL FIXED BOND	290,000.00	321,842.00	
	ISRAEL FIXED BOND	380,000.00	364,477.00	
	ISRAEL FIXED BOND	500,000.00	429,525.00	
	ISRAEL FIXED BOND	390,000.00	518,193.00	
	ISRAEL FIXED BOND	500,000.00	531,600.00	
	ISRAEL FIXED BOND	370,000.00	292,707.00	
	ISRAEL FIXED BOND	390,000.00	365,254.50	
	ISRAEL FIXED BOND	290,000.00	267,351.00	
	ISRAEL FIXED BOND	250,000.00	236,262.50	
ISRAEL FIXED BOND	160,000.00	135,872.00		
イスラエル・シュケル 小計		5,370,000.00 (214,217,355)	5,275,717.50 (210,456,285)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	401,864.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	308,682.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	486,120.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	394,466.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	210,000.00	195,394.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	442,657.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	256,612.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	210,000.00	201,371.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	290,000.00	277,213.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	373,756.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	251,591.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	273,918.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	370,000.00	359,788.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	490,000.00	466,818.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	280,000.00	247,153.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	452,082.80	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	620,000.00	518,425.40		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	353,623.20		

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	570,000.00	540,194.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	390,000.00	359,864.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	255,831.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	640,000.00	527,712.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	510,000.00	463,569.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	461,078.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	368,630.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	480,226.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	310,812.00	
オーストラリア・ドル 小計		10,720,000.00 (990,313,600)	10,029,460.30 (926,521,543)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,299,768.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	720,000.00	730,281.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,218,456.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,338,787.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,011,370.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,409,680.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,607,504.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,434,884.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,340,000.00	3,340,935.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	3,766,508.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,160,608.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,573,324.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	6,997,900.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,596,724.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,649,482.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,431,428.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,480,965.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,464,360.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,049,160.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,193,444.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,756,416.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	981,290.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,406,830.00	
CHINA GOVERNMENT BOND	8,300,000.00	8,228,703.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,222,196.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,971,400.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	1,600,000.00	1,581,456.00		
オフショア・人民元 小計		101,070,000.00 (1,981,517,778)	100,903,860.60 (1,978,260,549)	
カナダ・ドル	CANADA GOVERNMENT	140,000.00	138,486.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	231,693.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	216,572.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	136,605.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	225,388.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	222,991.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	150,812.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	187,172.80	

	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	155,910.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	133,890.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	213,333.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	207,354.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	830,000.00	696,934.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	125,642.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	127,270.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	173,091.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	670,000.00	598,531.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	142,255.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	570,000.00	525,112.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	500,184.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	334,694.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	410,000.00	390,865.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	750,000.00	673,725.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	340,603.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	290,000.00	274,656.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	620,000.00	486,365.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	640,000.00	571,603.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	340,000.00	314,561.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	310,000.00	298,607.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	238,025.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	309,315.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	464,565.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	96,520.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	325,558.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	323,908.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	226,644.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	339,073.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	280,000.00	275,774.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	163,766.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	80,000.00	79,929.60	
	カナダ・ドル 小計	12,410,000.00 (1,242,241,000)	11,637,994.90 (1,164,963,289)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	134,836.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	118,576.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	139,020.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	167,365.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	140,560.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	155,568.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	156,352.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	108,328.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	176,952.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	70,000.00	64,890.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	117,040.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	209,166.30	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	214,935.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	178,290.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	102,465.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	107,851.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	84,409.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	93,850.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	54,310.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	48,706.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	50,039.50	
シンガポール・ドル 小計		2,710,000.00 (273,547,400)	2,623,511.30 (264,817,231)	
スウェーデン・ クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,610,000.00	1,617,035.70	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,770,000.00	1,701,447.90	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,070,000.00	1,122,965.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,320,000.00	1,246,119.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,390,000.00	1,295,410.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	890,000.00	1,131,741.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,070,000.00	936,100.20	
スウェーデン・クローナ 小計		9,120,000.00 (120,475,200)	9,050,820.70 (119,561,341)	
デンマーク・ク ローネ	KINGDOM OF DENMARK	980,000.00	968,210.60	
	KINGDOM OF DENMARK	1,450,000.00	1,341,757.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	1,255,940.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,180,000.00	770,705.20	
	KINGDOM OF DENMARK	1,600,000.00	1,324,272.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,340,000.00	3,152,588.40	
	KINGDOM OF DENMARK	1,270,000.00	1,216,748.90	
デンマーク・クローネ 小計		10,220,000.00 (197,552,600)	10,030,222.60 (193,884,203)	
ニュージーラン ド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	340,000.00	326,250.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	234,615.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	101,301.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	140,000.00	114,662.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	30,000.00	24,377.70	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	95,322.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	67,947.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	76,258.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	300,000.00	263,433.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	110,000.00	92,587.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	70,000.00	71,068.90	
ニュージーランド・ドル 小計		1,660,000.00 (144,951,200)	1,467,823.40 (128,170,339)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,430,000.00	1,429,656.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,250,000.00	1,217,612.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	980,000.00	938,653.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	940,000.00	900,040.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	840,000.00	806,156.40	

	NORWEGIAN GOVERNMENT	890,000.00	832,559.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,079,628.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	800,000.00	701,040.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	770,000.00	722,483.30	
ノルウェー・クローネ 小計		9,100,000.00 (124,397,000)	8,627,830.80 (117,942,447)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	810,000.00	743,782.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	950,000.00	823,517.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	565,848.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	760,000.00	633,794.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	880,000.00	832,568.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	990,000.00	794,148.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND	850,000.00	785,094.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	174,528.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	670,000.00	585,278.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	770,000.00	529,760.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	690,000.00	541,988.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND	680,000.00	462,230.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	640,000.00	570,848.00	
ポーランド・ズロチ 小計		9,540,000.00 (292,538,376)	8,043,385.30 (246,645,584)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA GOVERNMENT	450,000.00	445,590.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	420,000.00	433,351.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	399,733.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	171,433.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	770,000.00	778,824.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	610,335.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	685,174.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	367,192.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	384,662.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	321,657.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	371,209.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	210,000.00	219,086.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	540,000.00	571,541.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	120,000.00	121,152.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	400,772.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	160,857.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	180,000.00	192,609.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	198,460.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	440,000.00	437,804.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	256,608.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	349,750.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	490,000.00	456,082.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	580,000.00	543,019.20	
MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	216,429.60		
MALAYSIA GOVERNMENT	140,000.00	134,559.60		
MALAYSIA GOVERNMENT	300,000.00	312,870.00		

	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	164,532.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	334,685.80	
マレーシア・リングgit 小計		10,020,000.00 (310,549,860)	10,039,988.20 (311,169,354)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,720,000.00	1,560,848.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,810,000.00	8,197,088.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,370,000.00	4,713,786.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,870,000.00	8,048,105.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,240,000.00	4,732,715.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,240,000.00	5,256,296.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,650,000.00	1,784,029.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,580,000.00	6,395,496.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,760,000.00	4,641,571.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,020,000.00	6,668,157.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,140,000.00	6,028,129.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,710,000.00	4,487,970.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,220,000.00	2,840,877.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,500,000.00	2,269,500.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,200,000.00	1,083,528.00	
メキシコ・ペソ 小計		73,030,000.00 (505,082,783)	68,708,100.60 (475,192,095)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	310,000.00	311,565.50	
	BELGIUM KINGDOM	410,000.00	510,060.50	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	234,928.00	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	213,387.10	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	197,136.40	
	BELGIUM KINGDOM	370,000.00	330,987.20	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	269,105.00	
	BELGIUM KINGDOM	480,000.00	464,438.40	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	161,852.40	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	336,955.50	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	186,274.70	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	144,793.60	
	BELGIUM KINGDOM	320,000.00	301,276.80	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	252,064.80	
	BELGIUM KINGDOM	150,000.00	138,630.00	
	BELGIUM KINGDOM	150,000.00	127,893.00	
	BELGIUM KINGDOM	420,000.00	490,358.40	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	325,430.00	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	195,520.60	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	358,117.50	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	187,091.20	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	220,760.80	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	122,023.80	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	179,658.00	
	BELGIUM KINGDOM	370,000.00	448,203.20	
BELGIUM KINGDOM	290,000.00	234,291.00		
BELGIUM KINGDOM	110,000.00	55,584.10		
BELGIUM KINGDOM	340,000.00	278,426.00		

BELGIUM KINGDOM	220,000.00	163,196.00	
BELGIUM KINGDOM	90,000.00	90,157.50	
BONOS Y OBLIG DE	450,000.00	369,067.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	340,000.00	446,464.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	520,409.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	503,765.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	621,712.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	518,001.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	432,462.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	539,385.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	491,905.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	474,755.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	577,836.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	532,585.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	364,815.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	310,000.00	321,070.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	518,826.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	471,218.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	369,513.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	466,798.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	471,465.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	330,022.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	493,472.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	650,218.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	451,348.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	467,115.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	410,977.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	357,886.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	420,028.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	298,259.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	420,018.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	402,473.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	418,906.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	417,177.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	266,464.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	484,747.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	558,927.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	267,591.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	417,532.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	385,636.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	396,170.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	130,000.00	73,048.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	342,708.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	270,000.00	195,720.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	160,000.00	109,473.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	388,526.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	387,341.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	414,836.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	210,000.00	156,170.70	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	221,827.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	415,896.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	102,111.00	
BUNDES OblIGATION	470,000.00	452,722.80	
BUNDES OblIGATION	500,000.00	477,280.00	
BUNDES OblIGATION	520,000.00	492,154.00	
BUNDES OblIGATION	100,000.00	94,889.00	
BUNDES OblIGATION	590,000.00	553,844.80	
BUNDES OblIGATION	520,000.00	506,584.00	
BUNDES OblIGATION	510,000.00	473,744.10	
BUNDES OblIGATION	460,000.00	423,255.20	
BUNDES OblIGATION	570,000.00	553,544.10	
BUNDES OblIGATION	100,000.00	97,226.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	558,471.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	506,348.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	743,190.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	511,300.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	600,153.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	604,152.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	659,653.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	658,404.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	625,089.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	630,000.00	588,873.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000.00	638,282.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	380,000.00	502,481.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	622,507.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	644,211.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	578,385.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	557,296.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	553,581.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	548,253.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	730,000.00	462,907.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	489,384.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	507,836.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	470,000.00	428,574.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	376,416.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	599,161.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	713,286.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	182,355.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	498,109.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	392,649.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	133,423.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	561,475.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	493,075.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	170,312.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	239,697.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	630,000.00	530,145.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	250,000.00	321,447.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	695,199.80	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	240,000.00	209,448.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	530,000.00	519,797.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	150,000.00	151,903.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	80,000.00	81,344.80	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	380,000.00	372,400.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	470,000.00	458,188.90	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	350,000.00	340,308.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	380,000.00	368,911.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	130,000.00	130,137.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	413,016.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	522,220.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	590,000.00	597,664.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	398,724.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	429,183.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	336,529.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	554,000.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	573,391.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	439,722.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	516,811.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	418,154.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	410,142.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	719,610.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	307,307.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	449,338.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	291,935.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	421,524.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	157,370.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	341,351.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	367,171.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	494,740.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	356,747.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	372,750.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	274,818.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	519,623.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	640,000.00	716,121.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	487,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	291,564.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	289,875.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	459,721.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	268,002.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	584,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	423,296.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	504,595.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	531,852.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	254,793.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	226,635.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	569,524.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	409,850.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	322,845.90	

BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	450,833.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	416,649.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	254,628.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	352,566.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	408,245.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	469,829.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	229,110.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	320,875.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	234,821.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	358,583.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	183,366.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	416,617.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	66,193.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	291,845.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	318,324.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	560,755.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	268,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	359,540.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	454,231.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	376,585.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	417,192.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	350,701.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	349,581.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	351,925.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	611,975.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	284,852.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	322,198.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	386,887.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	294,859.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	135,551.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	291,987.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	145,714.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	285,686.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	220,353.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	304,504.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	288,930.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	137,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	331,092.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	171,105.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	202,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	80,000.00	83,172.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	70,000.00	71,318.80	
DEUTSCHLAND REP	320,000.00	376,739.20	
DEUTSCHLAND REP	270,000.00	323,111.70	
DEUTSCHLAND REP	300,000.00	344,250.00	
DEUTSCHLAND REP	440,000.00	555,535.20	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	112,616.90	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	99,885.00	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	112,313.30	

FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	87,355.00	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	125,726.90	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	132,682.20	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	128,821.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	86,296.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	83,209.00	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	114,948.60	
FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	58,341.60	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	94,304.70	
FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	54,196.80	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	99,672.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	55,891.00	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	106,667.60	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	90,248.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	96,416.00	
FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	73,653.60	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	69,065.00	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	100,611.50	
FINNISH GOVERNMENT	80,000.00	76,908.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,110,000.00	1,140,336.30	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	736,884.00	
FRANCE (GOVT OF)	620,000.00	687,338.20	
FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	696,483.90	
FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	779,890.80	
FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	821,899.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,210,000.00	1,235,724.60	
FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	930,744.10	
FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	764,285.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,210,000.00	1,144,321.20	
FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	979,678.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,050,000.00	992,649.00	
FRANCE (GOVT OF)	320,000.00	264,771.20	
FRANCE (GOVT OF)	980,000.00	831,667.20	
FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	771,094.90	
FRANCE (GOVT OF)	660,000.00	590,838.60	
FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	789,794.80	
FRANCE (GOVT OF)	650,000.00	580,586.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,180,000.00	1,093,364.40	
FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	733,336.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,104,840.00	
FRANCE (GOVT OF)	870,000.00	845,579.10	
FRANCE (GOVT OF)	540,000.00	636,427.80	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	1,013,880.00	
FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	542,238.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,150,000.00	1,034,045.50	
FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	940,915.80	
FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	799,083.90	
FRANCE (GOVT OF)	670,000.00	429,704.50	
FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	877,414.80	

FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	969,115.80	
FRANCE (GOVT OF)	340,000.00	456,569.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,060,000.00	888,947.80	
FRANCE (GOVT OF)	510,000.00	359,774.40	
FRANCE (GOVT OF)	210,000.00	101,446.80	
FRANCE (GOVT OF)	340,000.00	226,565.80	
FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	808,562.70	
FRANCE (GOVT OF)	860,000.00	786,298.00	
FRANCE (GOVT OF)	650,000.00	633,399.00	
FRANCE (GOVT OF)	590,000.00	370,809.10	
FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	594,486.40	
FRANCE (GOVT OF)	580,000.00	552,078.80	
FRANCE (GOVT OF)	120,000.00	99,368.40	
FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	945,985.10	
FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	631,699.60	
FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	541,088.80	
FRANCE (GOVT OF)	420,000.00	547,197.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	97,824.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	172,762.50	
IRELAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	198,059.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	212,459.10	
IRELAND GOVERNMENT BOND	240,000.00	231,878.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	125,533.80	
IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	168,298.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	98,562.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	140,000.00	130,690.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	196,062.30	
IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	137,635.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	85,299.50	
IRELAND GOVERNMENT BOND	230,000.00	246,212.70	
IRELAND GOVERNMENT BOND	150,000.00	137,853.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	136,419.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	155,034.30	
IRELAND GOVERNMENT BOND	80,000.00	56,203.20	
IRISH GOVERNMENT BOND	100,000.00	82,523.00	
ITALIAN GOVT	200,000.00	232,234.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	430,000.00	490,853.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	328,332.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	359,442.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	391,217.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	369,275.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	302,048.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	312,857.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	344,666.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	447,966.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	250,000.00	221,617.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	340,000.00	260,215.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	247,561.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	485,795.70	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	330,000.00	303,481.20	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	164,819.20	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	233,746.80	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	122,456.10	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	314,007.30	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	260,000.00	228,836.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	159,262.80	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	239,394.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	101,091.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	177,881.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	106,642.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	177,932.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	227,999.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	290,000.00	283,127.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	314,242.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	149,956.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	279,636.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	43,955.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	105,090.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	236,078.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	213,789.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	310,000.00	367,604.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	224,132.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	162,979.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	210,752.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	107,081.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	70,427.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	45,743.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	229,672.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	38,028.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	170,000.00	161,472.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	95,262.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	240,000.00	231,914.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	113,713.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	199,830.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	71,363.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	109,437.90	
	ユーロ 小計	141,390,000.00 (20,326,226,400)	134,823,969.30 (19,382,293,827)	
	国債証券 合計	61,578,102,952 (61,578,102,952)	56,963,674,167 (56,963,674,167)	
	合計		56,963,674,167 (56,963,674,167)	

（注）

- 1．各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
- 2．合計欄における（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
- 3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 141銘柄	50.63	50.40
イギリス・ポンド	国債証券 55銘柄	4.82	4.80
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	0.37	0.37
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.63	1.63
オフショア・人民元	国債証券 27銘柄	3.49	3.47
カナダ・ドル	国債証券 40銘柄	2.05	2.05
シンガポール・ドル	国債証券 21銘柄	0.47	0.46
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.21	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.34	0.34
ニュージーランド・ドル	国債証券 11銘柄	0.23	0.23
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.21	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.43	0.43
マレーシア・リングgit	国債証券 28銘柄	0.55	0.55
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.84	0.83
ユーロ	国債証券 359銘柄	34.18	34.03

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	17,440,820
金銭信託	238,890
コール・ローン	7,558,767
国債証券	1,492,162,471
派生商品評価勘定	4,004
未収利息	13,255,322
前払費用	1,517,753
流動資産合計	1,532,178,027
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,804
未払解約金	286,915
その他未払費用	16
流動負債合計	343,735
負債合計	343,735
純資産の部	
元本等	
元本	1,305,469,671
剰余金	
剰余金又は欠損金()	226,364,621
元本等合計	1,531,834,292
純資産合計	1,531,834,292
負債純資産合計	1,532,178,027

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価して おります。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の 仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に 換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令 第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,031,132,641円
同期中追加設定元本額	287,372,723円
同期中一部解約元本額	13,035,693円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	982,100,960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）	55,612,694円
ニッセイ新興国債券インデックス（ラップ専用）	257,040,505円
FWニッセイ新興国債インデックス	10,715,512円
計	1,305,469,671円
2. 受益権の総数	1,305,469,671口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	58,552,919
合計	58,552,919

(注)「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年11月22日から2022年12月12日まで)に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年12月12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 アメリカ・ドル	10,625,744	-	10,572,944	52,800
	10,625,744	-	10,572,944	52,800
合計	10,625,744	-	10,572,944	52,800

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年12月12日現在
1口当たり純資産額	1.1734円
（1万口当たり純資産額）	（11,734円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	182,728.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	153,988.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	192,376.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	174,666.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	178,164.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	189,194.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	182,128.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	179,398.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	181,436.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	122,422.50	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	128,721.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	112,783.50	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	125,832.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	136,032.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	188,262.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	148,996.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	177,478.00	
		HUNGARY	200,000.00	153,504.00	
		HUNGARY	200,000.00	125,510.00	
		OMAN GOV INTERNTL BOND	200,000.00	198,746.00	
		OMAN GOV INTERNTL BOND	200,000.00	190,838.00	
		OMAN GOV INTERNTL BOND	200,000.00	201,914.00	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	154,506.00	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	171,106.00	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	151,698.00	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	177,474.00	
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	162,704.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	139,500.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	150,316.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	146,526.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	176,022.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	191,436.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	147,504.00	
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	159,388.00	
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	154,944.00	
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	153,446.00	
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	211,508.00	
		REPUBLIC OF PERU	180,000.00	154,875.60	
		REPUBLIC OF PERU	110,000.00	69,996.30	
		REPUBLIC OF PERU	60,000.00	46,132.80	
REPUBLIC OF PERU	100,000.00	83,515.00			

	REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	187,728.00	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	152,022.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	179,134.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	149,268.00	
	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	120,000.00	119,325.60	
	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	100,000.00	100,345.00	
	ROMANIA	70,000.00	48,721.40	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	192,308.00	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	197,840.00	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	200,882.00	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	194,162.00	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	199,860.00	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	183,188.00	
	SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	165,882.00	
	STATE OF QATAR	200,000.00	207,906.00	
	STATE OF QATAR	200,000.00	199,302.00	
	STATE OF QATAR	200,000.00	201,260.00	
	STATE OF QATAR	200,000.00	196,276.00	
	STATE OF QATAR	200,000.00	189,972.00	
	STATE OF QATAR	200,000.00	195,626.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	196,696.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	194,964.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	168,176.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	138,520.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	164,820.00	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	158,912.00	
	アメリカ・ドル 小計	12,490,000.00 (1,708,132,400)	10,910,810.70 (1,492,162,471)	
国債証券 合計		1,708,132,400 (1,708,132,400)	1,492,162,471 (1,492,162,471)	
合計			1,492,162,471 (1,492,162,471)	

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における（ ）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 67銘柄	97.41	100.00

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	6,919,364
コール・ローン	218,937,186
投資証券	31,809,224,300
未収配当金	194,833,327
流動資産合計	32,229,914,177
資産合計	32,229,914,177
負債の部	
流動負債	
未払解約金	54,669,766
その他未払費用	721
流動負債合計	54,670,487
負債合計	54,670,487
純資産の部	
元本等	
元本	16,963,532,535
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,211,711,155
元本等合計	32,175,243,690
純資産合計	32,175,243,690
負債純資産合計	32,229,914,177

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,531,349,649円
同期中追加設定元本額	5,346,682,360円
同期中一部解約元本額	4,914,499,474円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイJ-REITインデックスファンド(適格機関投資家限定)	737,827,247円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,181,082,086円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	8,618,683,449円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02(適格機関投資家限定)	1,691,363,284円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,867,012,097円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	1,661,800,501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)	139,832,838円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	14,170,606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)	6,153,132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)	10,083,010円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	33,801,866円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)	87,225円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)	186,861円
FWニッセイ国内リートインデックス	1,448,333円
計	16,963,532,535円
2. 受益権の総数	16,963,532,535口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年12月12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）は短時間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
投資証券	230,004,924	
合計	230,004,924	

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年11月15日から2022年12月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年12月12日現在
1口当たり純資産額	1.8967円
（1万口当たり純資産額）	（18,967円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	1,139	230,533,600	
	GLP投資法人	9,493	1,460,972,700	
	NTT都市開発リート投資法人	2,827	400,020,500	
	Oneリート投資法人	513	129,481,200	
	SOSILA物流リート投資法人	1,463	203,649,600	
	いちごオフィスリート投資法人	2,410	206,296,000	
	いちごホテルリート投資法人	487	51,183,700	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	1,553	643,718,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,941	1,010,233,500	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,282	188,710,400	
	イオンリート投資法人	3,256	505,982,400	
	インヴィンシブル投資法人	12,946	651,183,800	
	エスコンジャパンリート投資法人	598	71,461,000	
	オリックス不動産投資法人	5,860	1,102,266,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,015	216,612,500	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,711	556,075,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,109	446,475,300	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,279	333,563,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,368	425,448,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	765	91,188,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	942	86,664,000	
	ザイマックス・リート投資法人	477	57,144,600	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,485	740,778,500	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,698	366,388,400	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,941	1,755,777,000		
スターアジア不動産投資法人	3,672	199,756,800		
スターツプロシード投資法人	510	117,555,000		

タカラレーベン不動産投資法人	1,288	128,413,600	
トーセイ・リート投資法人	652	86,520,400	
ヒューリックリート投資法人	2,752	470,316,800	
フロンティア不動産投資法人	1,091	566,229,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	725	131,152,500	
マリモ地方創生リート投資法人	367	49,875,300	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,579	978,955,200	
ラサルロジポート投資法人	3,601	584,442,300	
阪急阪神リート投資法人	1,329	202,008,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,162	579,257,000	
三菱地所物流リート投資法人	1,010	441,370,000	
産業ファンド投資法人	4,395	690,015,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	690	91,425,000	
森トラスト総合リート投資法人	2,102	301,426,800	
森ヒルズリート投資法人	3,459	551,364,600	
星野リゾート・リート投資法人	514	357,230,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,838	690,247,800	
大江戸温泉リート投資法人	475	30,400,000	
大和ハウスリート投資法人	4,434	1,327,983,000	
大和証券オフィス投資法人	615	400,980,000	
大和証券リビング投資法人	4,076	483,006,000	
投資法人みらい	3,573	166,859,100	
東海道リート投資法人	357	43,197,000	
東急リアル・エステート投資法人	1,972	419,838,800	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,016	630,936,000	
日本ビルファンド投資法人	3,431	2,110,065,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,011	772,224,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,820	1,585,780,000	
日本リート投資法人	955	348,097,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,983	634,560,000	
日本都市ファンド投資法人	14,840	1,547,812,000	
福岡リート投資法人	1,521	263,133,000	
平和不動産リート投資法人	2,010	312,354,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	9,511	1,582,630,400	
投資証券 合計	174,894	31,809,224,300	
合計		31,809,224,300	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	24,839,098
金銭信託	2,014,815
コール・ローン	63,751,225
投資証券	5,804,583,581
未収入金	293,557
未収配当金	12,427,590
流動資産合計	5,907,909,866
資産合計	
5,907,909,866	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	10,230,078
その他未払費用	154
流動負債合計	10,230,232
負債合計	
10,230,232	
純資産の部	
元本等	
元本	4,224,235,841
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,673,443,793
元本等合計	5,897,679,634
純資産合計	
5,897,679,634	
負債純資産合計	
5,907,909,866	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 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。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,154,259,414円
同期中追加設定元本額	2,010,373,348円
同期中一部解約元本額	940,396,921円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ先進国リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,724,802,655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）	190,601,542円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	19,190,749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）	8,334,628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）	45,789,723円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	58,112,666円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	288,941,173円
FWニッセイ先進国リートインデックス	3,492,100円
DCニッセイ先進国リートインデックス	1,884,970,605円
計	4,224,235,841円
2. 受益権の総数	4,224,235,841口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月30日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	9,735,435
合計	9,735,435

(注)「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年11月22日から2022年12月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年12月12日現在
1口当たり純資産額	1.3962円
(1万口当たり純資産額)	(13,962円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	3,516.00	51,685.20	
		AGREE REALTY CORP	2,623.00	188,016.64	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	2,024.00	39,731.12	
		ALEXANDER'S INC	45.00	10,520.55	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,024.00	749,882.24	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	337.00	6,409.74	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,831.00	49,729.96	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9,916.00	325,839.76	
		AMERICOLD REALTY TRUST	8,719.00	254,158.85	
		APARTMENT INCOME REIT CO	5,309.00	195,955.19	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	4,788.00	38,399.76	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	7,128.00	119,821.68	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1,833.00	21,886.02	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	629.00	3,723.68	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,693.00	795,838.94	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	147.00	3,433.92	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,835.00	322,059.35	
		BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	1,295.00	4,998.70	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	5,036.00	31,777.16	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	10,560.00	238,022.40	
		BROADSTONE NET LEASE INC- A	5,190.00	89,631.30	
		BRT APARTMENTS CORP	345.00	6,941.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,550.00	411,800.00	
		CARETRUST REIT INC	3,028.00	60,620.56	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	610.00	16,293.10	
		CENTERSPACE	486.00	31,842.72	
		CHATHAM LODGING TRUST	1,594.00	21,216.14	
CITY OFFICE REIT INC	1,032.00	9,680.16			
CLIPPER REALTY INC	93.00	687.27			
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	490.00	17,179.40			
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3,241.00	83,552.98			

COUSINS PROPERTIES INC	4,701.00	117,289.95	
CTO REALTY GROWTH INC	453.00	8,548.11	
CUBESMART	7,536.00	323,746.56	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	6,673.00	60,657.57	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	14,100.00	8,671.50	
DIGITAL REALTY TRUST INC	9,757.00	1,043,608.72	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	5,848.00	4,491.26	
DOUGLAS EMMETT INC	5,580.00	88,889.40	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,300.00	20.30	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2,206.00	33,707.68	
EASTGROUP PROPERTIES	1,451.00	224,208.52	
ELME COMMUNITIES	2,576.00	49,381.92	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	4,951.00	33,617.29	
EPR PROPERTIES	2,532.00	103,254.96	
EQUINIX INC	3,077.00	2,079,436.60	
EQUITY COMMONWEALTH	2,361.00	61,315.17	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,848.00	379,008.88	
EQUITY RESIDENTIAL	11,318.00	709,978.14	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	5,150.00	119,840.50	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,196.00	471,678.84	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,529.00	709,150.82	
FARMLAND PARTNERS INC	1,393.00	17,969.70	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,573.00	276,983.45	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	4,417.00	215,902.96	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2,581.00	69,480.52	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1,666.00	4,914.70	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	8,733.00	454,989.30	
GETTY REALTY CORP	1,344.00	44,701.44	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,555.00	29,638.30	
GLADSTONE LAND CORP	938.00	17,906.42	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,212.00	22,164.24	
GLOBAL NET LEASE INC	4,183.00	56,512.33	
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	12,842.00	252,858.98	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	18,309.00	464,133.15	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	962.00	9,158.24	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,597.00	103,054.05	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	24,150.00	427,213.50	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	4,295.00	44,238.50	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	7,630.00	136,119.20	
INDUS REALTY TRUST INC	103.00	6,595.09	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2,205.00	8,026.20	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	857.00	96,155.40	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	2,068.00	50,335.12	
INVITATION HOMES INC	19,545.00	617,426.55	
IRON MOUNTAIN INC	9,745.00	530,225.45	
ISTAR FINANCIAL INC	3,256.00	24,094.40	
JBG SMITH PROPERTIES	3,107.00	61,611.81	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	15,200.00	8,284.00	
KILROY REALTY CORP	3,468.00	139,205.52	
KIMCO REALTY CORP	21,000.00	455,910.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	7,169.00	156,570.96	
LIFE STORAGE INC	2,839.00	304,482.75	
LTC PROPERTIES INC	1,210.00	46,706.00	
LXP INDUSTRIAL TRUST	8,016.00	84,809.28	
MACERICH CO/THE	7,299.00	90,945.54	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	59,100.00	21,276.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,426.00	241,026.80	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,874.00	626,193.36	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	6,282.00	289,600.20	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,016.00	116,025.52	
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,380.00	78,246.00	
NETSTREIT CORP	1,594.00	30,843.90	
NEXPOINT RESIDENTIAL	720.00	33,458.40	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,864.00	26,767.04	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7,962.00	237,347.22	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	420.00	9,870.00	
ORION OFFICE REIT INC	1,316.00	11,988.76	
PARAMOUNT GROUP INC	5,579.00	32,469.78	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	7,556.00	93,089.92	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	4,423.00	68,423.81	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	3,412.00	111,162.96	

PHYSICIANS REALTY TRUST	6,474.00	96,397.86	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	3,447.00	31,815.81	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1,193.00	23,931.58	
POSTAL REALTY TRUST INC-A	399.00	6,004.95	
PRIME US REIT	11,300.00	5,254.50	
PROLOGIS INC	31,084.00	3,615,690.88	
PUBLIC STORAGE	5,320.00	1,583,232.00	
REALTY INCOME CORP	20,660.00	1,331,537.00	
REGENCY CENTERS CORP	5,256.00	345,476.88	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4,045.00	63,223.35	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	5,783.00	315,115.67	
RLJ LODGING TRUST	5,534.00	63,696.34	
RPT REALTY	3,789.00	41,186.43	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,951.00	173,424.39	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	7,411.00	93,378.60	
SAFEHOLD INC	835.00	23,137.85	
SAUL CENTERS INC	390.00	16,134.30	
SERVICE PROPERTIES TRUST	6,142.00	48,276.12	
SIMON PROPERTY GROUP INC	11,161.00	1,303,046.75	
SITE CENTERS CORP	6,186.00	82,088.22	
SL GREEN REALTY CORP	2,166.00	77,131.26	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	4,996.00	206,284.84	
STAG INDUSTRIAL INC	5,854.00	194,001.56	
STORE CAPITAL CORP	9,346.00	298,885.08	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,004.00	31,631.60	
SUN COMMUNITIES INC	4,186.00	595,709.66	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6,035.00	62,401.90	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	3,331.00	61,889.98	
TERRENO REALTY CORP	2,039.00	116,365.73	
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	3,794.00	25,078.34	
UDR INC	10,408.00	415,175.12	
UMH PROPERTIES INC	1,956.00	33,212.88	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	291.00	14,945.76	
URBAN EDGE PROPERTIES	4,275.00	64,595.25	
URSTADT BIDDLE - CL A	1,030.00	18,993.20	
VENTAS INC	13,507.00	613,623.01	
VERIS RESIDENTIAL INC	2,115.00	33,945.75	

	VICI PROPERTIES INC	32,576.00	1,105,303.68	
	VORNADO REALTY TRUST	5,676.00	125,382.84	
	WELLTOWER INC	15,599.00	1,039,985.33	
	WHITESTONE REIT	1,800.00	17,460.00	
	WP CAREY INC	6,950.00	548,007.50	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	3,511.00	53,332.09	
アメリカ・ドル	小計	846,286.00	33,204,343.14 (4,541,025,966)	
イギリス・ポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	9,970.00	5,633.05	
	AEW UK REIT PLC	3,378.00	3,269.90	
	ASSURA PLC	88,440.00	47,934.48	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	25,690.00	24,225.67	
	BIG YELLOW GROUP PLC	5,794.00	65,182.50	
	BRITISH LAND CO PLC	30,280.00	120,090.48	
	CAPITAL & COUNTIES PRO- W/I	27,207.00	27,642.31	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	14,406.00	8,874.09	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	5,885.00	5,325.92	
	DERWENT LONDON PLC	3,766.00	88,576.32	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	16,612.00	13,588.61	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	7,677.00	38,369.64	
	HAMMERSON PLC	134,681.00	32,054.07	
	HOME REIT PLC	24,530.00	11,381.92	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	10,174.00	10,377.48	
	INTU PROPERTIES PLC	19,587.00	19.58	
	INVISTA FOUNDATION PROPERTY	6,989.00	3,110.10	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	25,913.00	162,370.85	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	32,983.00	58,247.97	
	LXI REIT PLC	60,381.00	70,162.72	
	NEWRIVER REIT PLC	6,981.00	5,480.08	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	13,020.00	10,793.58	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	39,176.00	43,446.18	
	PRS REIT PLC/THE	21,946.00	18,785.77	
	REGIONAL REIT LTD	15,531.00	8,992.44	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	7,372.00	69,186.22	
	SEGRO PLC	42,047.00	337,553.31	
	SHAFTESBURY PLC	8,402.00	29,222.15	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	32,679.00	33,495.97		

	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	11,942.00	8,239.98	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	60,390.00	88,109.01	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	28,186.00	16,404.25	
	UNITE GROUP PLC	13,961.00	129,558.08	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	15,973.00	22,601.79	
	WAREHOUSE REIT PLC	17,045.00	18,579.05	
	WORKSPACE GROUP PLC	4,836.00	20,108.08	
イギリス・ポンド 小計		893,830.00	1,656,993.60 (277,049,330)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	23,959.00	40,155.28	
	REIT 1 LTD	5,482.00	96,209.10	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	5,434.00	45,634.73	
イスラエル・シュケル 小計		34,875.00	181,999.11 (7,260,217)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	14,277.00	38,547.90	
	ARENA REIT	9,254.00	34,887.58	
	BWP TRUST	13,743.00	55,384.29	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	28,258.00	49,734.08	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	21,663.00	68,238.45	
	CENTURIA OFFICE REIT	17,874.00	28,866.51	
	CHARTER HALL GROUP	16,454.00	208,472.18	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	23,392.00	104,328.32	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	17,184.00	68,564.16	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	11,269.00	36,736.94	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	40,078.00	27,453.43	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	10,419.00	31,361.19	
	DEXUS/AU	36,415.00	291,684.15	
	GDI PROPERTY GROUP	14,036.00	10,877.90	
	GOODMAN GROUP	57,937.00	1,053,294.66	
	GPT GROUP	68,145.00	295,749.30	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	10,991.00	34,401.83	
	HEALTHCO REIT	12,478.00	21,274.99	
	HMC CAPITAL LTD	7,990.00	35,955.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	56,053.00	73,989.96	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	5,048.00	17,970.88	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	11,306.00	49,746.40	
	MIRVAC GROUP	133,761.00	294,274.20	
NATIONAL STORAGE REIT	36,613.00	86,040.55		
REGION RE LTD	39,483.00	106,209.27		
RURAL FUNDS GROUP	14,484.00	35,485.80		
SCENTRE GROUP	177,645.00	511,617.60		

	STOCKLAND	84,323.00	326,330.01	
	VICINITY CENTRES	133,360.00	263,386.00	
	WAYPOINT REIT LTD	24,160.00	67,164.80	
オーストラリア・ドル 小計		1,148,093.00	4,328,028.33 (399,823,257)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,100.00	55,839.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,100.00	19,509.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	800.00	9,048.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	900.00	45,351.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,600.00	111,878.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	3,548.00	52,013.68	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1,700.00	27,268.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1,100.00	16,918.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4,100.00	49,323.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	1,000.00	15,030.00	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	2,100.00	6,657.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,100.00	68,880.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,100.00	84,238.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT- UTS	4,800.00	58,560.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2,800.00	11,732.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,600.00	20,016.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,000.00	33,140.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,300.00	18,720.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	200.00	3,180.00	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	800.00	7,936.00	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2,200.00	21,736.00		
PRIMARIS REIT	1,900.00	28,215.00		
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	2,600.00	15,418.00		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700.00	98,230.00		

	SLATE GROCERY REIT	1,700.00	27,183.00	
	SLATE OFFICE REIT	2,200.00	9,724.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,200.00	59,642.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	2,800.00	63,448.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	900.00	5,265.00	
カナダ・ドル 小計		61,948.00	1,044,097.68 (104,514,178)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	22,800.00	27,360.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	108,000.00	297,000.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	63,042.00	62,096.37	
	CAPITALAND CHINA TRUST	50,300.00	57,342.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	171,828.00	347,092.56	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	37,800.00	46,116.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	32,200.00	20,286.00	
	ESR-LOGOS REIT	213,133.00	76,727.88	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	26,300.00	16,043.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	29,400.00	7,350.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	37,300.00	75,719.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	95,611.00	108,996.54	
	KEPPEL DC REIT	36,500.00	68,985.00	
	KEPPEL REIT	63,200.00	56,880.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	59,800.00	43,056.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	61,900.00	136,799.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	106,100.00	169,760.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	64,700.00	109,343.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	52,000.00	18,460.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	7,400.00	28,120.00	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	5,200.00	3,900.00		
SPH REIT	16,900.00	15,041.00		
STARHILL GLOBAL REIT	42,000.00	22,470.00		
SUNTEC REIT	70,900.00	99,969.00		
シンガポール・ドル 小計		1,474,314.00	1,914,912.35 (193,291,253)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	34,700.00	41,640.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	23,913.00	49,499.91	

	KIWI PROPERTY GROUP LTD	33,732.00	31,539.42	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	27,156.00	36,117.48	
	STRIDE PROPERTY GROUP	15,725.00	22,329.50	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	14,429.00	34,052.44	
ニュージーランド・ドル 小計		149,655.00	215,178.75 (18,789,408)	
ユーロ	AEDIFICA	1,210.00	94,017.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	508.00	3,766.82	
	ALTAREA	195.00	26,169.00	
	CARMILA	1,868.00	25,965.20	
	COFINIMMO	914.00	78,466.90	
	COVIVIO	1,469.00	83,439.20	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	1,633.00	37,591.66	
	GECINA SA	1,827.00	176,305.50	
	ICADE	966.00	39,161.64	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,126.00	3,653.87	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	8,602.00	51,568.99	
	INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	773.00	15,351.78	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	6,593.00	7,094.06	
	KLEPIERRE	6,453.00	144,482.67	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	1,218.00	5,359.20	
	MERCIALYS	2,968.00	28,567.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	10,699.00	96,825.95	
	MONTEA NV	231.00	15,015.00	
	NSI NV	299.00	7,116.20	
	RETAIL ESTATES	211.00	12,892.10	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,706.00	194,527.94		
VASTNED RETAIL NV	513.00	10,747.35		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,259.00	114,056.02		
WERELDHAVE NV	1,496.00	19,253.52		
XIOR STUDENT HOUSING NV	383.00	10,609.10		
ユーロ 小計		60,120.00	1,302,003.67 (187,176,048)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	50,000.00	146,500.00	
	FORTUNE REIT	30,000.00	178,800.00	
	LINK REIT	69,500.00	3,857,250.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	15,000.00	47,100.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	38,000.00	78,660.00	
香港・ドル 小計		202,500.00	4,308,310.00	

			(75,653,924)	
投資証券 合計		4,871,621	5,804,583,581 (5,804,583,581)	
合計			5,804,583,581 (5,804,583,581)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 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	投資証券 145銘柄	77.00	78.23
イギリス・ポンド	投資証券 36銘柄	4.70	4.77
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	0.12	0.13
オーストラリア・ドル	投資証券 30銘柄	6.78	6.89
カナダ・ドル	投資証券 29銘柄	1.77	1.80
シンガポール・ドル	投資証券 24銘柄	3.28	3.33
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	0.32	0.32
ユーロ	投資証券 25銘柄	3.17	3.22
香港・ドル	投資証券 5銘柄	1.28	1.30

(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

該当事項はありません。

中間財務諸表

F Wニッセイ国内株インデックス

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

F Wニッセイ先進国株インデックス

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

F Wニッセイ新興国株インデックス

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

F Wニッセイ国内債インデックス

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

F Wニッセイ外国債インデックス

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

F Wニッセイ新興国債インデックス

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

F Wニッセイ国内リートインデックス

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

F Wニッセイ先進国リートインデックス

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【FWニッセイ国内株インデックス】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	676	2,240
コール・ローン	21,398	123,944
親投資信託受益証券	52,584,304	111,810,834
未収入金	1,253	4,075,815
流動資産合計	52,607,631	116,012,833
資産合計	52,607,631	116,012,833
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	4,073,073
未払受託者報酬	1,791	9,709
未払委託者報酬	21,999	117,165
その他未払費用	818	4,782
流動負債合計	24,608	4,204,729
負債合計	24,608	4,204,729
純資産の部		
元本等		
元本	51,164,188	93,913,519
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,418,835	17,894,585
（分配準備積立金）	907,935	759,671
元本等合計	52,583,023	111,808,104
純資産合計	52,583,023	111,808,104
負債純資産合計	52,607,631	116,012,833

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2021年11月30日 至 2022年5月29日	第2期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	7,251	15,442,644
営業収益合計	7,251	15,442,644
営業費用		
受託者報酬	206	9,709
委託者報酬	2,826	117,165
その他費用	59	4,782
営業費用合計	3,091	131,656
営業利益又は営業損失（ ）	4,160	15,310,988
経常利益又は経常損失（ ）	4,160	15,310,988
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,160	15,310,988
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	7,890	1,160,238
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	1,418,835
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,245	2,759,475
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,245	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	2,759,475
剰余金減少額又は欠損金増加額	112,836	434,475
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	434,475
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	112,836	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	99,541	17,894,585

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2022年12月13日	至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年6月12日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	51,164,188円
期中追加設定元本額	50,780,776円	57,902,810円
期中一部解約元本額	616,588円	15,153,479円
2. 受益権の総数	51,164,188口	93,913,519口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0277円 (10,277円)	1.1905円 (11,905円)

【FWニッセイ先進国株インデックス】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	881	3,188
コール・ローン	27,875	176,386
親投資信託受益証券	62,824,349	142,810,029
未収入金	1,677	3,242,498
流動資産合計	62,854,782	146,232,101
資産合計	62,854,782	146,232,101
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	3,238,632
未払受託者報酬	2,109	12,452
未払委託者報酬	29,065	168,696
その他未払費用	969	6,153
流動負債合計	32,143	3,425,933
負債合計	32,143	3,425,933
純資産の部		
元本等		
元本	60,381,201	123,255,045
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,441,438	19,551,123
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	62,822,639	142,806,168
純資産合計	62,822,639	142,806,168
負債純資産合計	62,854,782	146,232,101

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2021年11月30日 至 2022年5月29日	第2期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	87,362	15,440,551
営業収益合計	87,362	15,440,551
営業費用		
受託者報酬	199	12,452
委託者報酬	3,371	168,696
その他費用	59	6,153
営業費用合計	3,629	187,301
営業利益又は営業損失（ ）	90,991	15,253,250
経常利益又は経常損失（ ）	90,991	15,253,250
中間純利益又は中間純損失（ ）	90,991	15,253,250
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	18,839	1,093,641
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	2,441,438
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,179	3,475,000
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,179	3,475,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,633	524,924
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,633	524,924
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	57,606	19,551,123

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2022年12月13日	至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年6月12日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	60,381,201円
期中追加設定元本額	60,354,529円	78,456,829円
期中一部解約元本額	973,328円	15,582,985円
2. 受益権の総数	60,381,201口	123,255,045口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,040円 (10,404円)	1,158円 (11,586円)

【FWニッセイ新興国株インデックス】
（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	139	247
コール・ローン	4,411	13,671
親投資信託受益証券	7,064,208	9,855,392
未収入金	639	808,916
流動資産合計	7,069,397	10,678,226
資産合計	7,069,397	10,678,226
負債の部		
流動負債		
未払解約金	211	808,260
未払受託者報酬	304	921
未払委託者報酬	4,816	13,561
その他未払費用	53	365
流動負債合計	5,384	823,107
負債合計	5,384	823,107
純資産の部		
元本等		
元本	7,170,800	9,473,145
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	106,787	381,974
（分配準備積立金）	174,200	117,539
元本等合計	7,064,013	9,855,119
純資産合計	7,064,013	9,855,119
負債純資産合計	7,069,397	10,678,226

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期中間計算期間 自 2021年11月30日 至 2022年5月29日	第2期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	59,095	657,844
営業収益合計	59,095	657,844
営業費用		
受託者報酬	98	921
委託者報酬	1,831	13,561
その他費用	-	365
営業費用合計	1,929	14,847
営業利益又は営業損失()	61,024	642,997
経常利益又は経常損失()	61,024	642,997
中間純利益又は中間純損失()	61,024	642,997
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	320	50,881
期首剰余金又は期首欠損金()	-	106,787
剰余金増加額又は欠損金減少額	88	67,267
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	88	67,267
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	28,914	170,622
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	28,914	170,622
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	89,530	381,974

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2022年12月13日	至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年6月12日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	7,170,800円
期中追加設定元本額	6,343,377円	5,572,599円
期中一部解約元本額	172,577円	3,270,254円
2. 受益権の総数	7,170,800口	9,473,145口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は106,787円であります。	-

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9851円 (9,851円)	1.0403円 (10,403円)

【FWニッセイ国内債インデックス】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	200	488
コール・ローン	6,334	26,979
親投資信託受益証券	27,364,407	33,012,109
未収入金	15,650	131,985
流動資産合計	27,386,591	33,171,561
資産合計	27,386,591	33,171,561
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,188	131,422
未払受託者報酬	753	2,987
未払委託者報酬	6,426	24,175
その他未払費用	285	1,432
流動負債合計	22,652	160,016
負債合計	22,652	160,016
純資産の部		
元本等		
元本	28,502,469	34,134,256
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,138,530	1,122,711
（分配準備積立金）	-	-
元本等合計	27,363,939	33,011,545
純資産合計	27,363,939	33,011,545
負債純資産合計	27,386,591	33,171,561

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2021年11月30日 至 2022年5月29日	第2期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	17,570	436,969
営業収益合計	17,570	436,969
営業費用		
受託者報酬	90	2,987
委託者報酬	1,025	24,175
その他費用	-	1,432
営業費用合計	1,115	28,594
営業利益又は営業損失（ ）	18,685	408,375
経常利益又は経常損失（ ）	18,685	408,375
中間純利益又は中間純損失（ ）	18,685	408,375
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,321	14,522
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	1,138,530
剰余金増加額又は欠損金減少額	250	777,211
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	250	777,211
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,960	1,155,245
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,960	1,155,245
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	38,074	1,122,711

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年6月12日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	28,502,469円
期中追加設定元本額	28,556,858円	24,519,341円
期中一部解約元本額	1,054,389円	18,887,554円
2. 受益権の総数	28,502,469口	34,134,256口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,138,530円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,122,711円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	0.9601円	0.9671円
（1万口当たり純資産額）	(9,601円)	(9,671円)

【FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	87	370
コール・ローン	2,763	20,450
親投資信託受益証券	9,243,528	20,910,573
未収入金	5,024	12,453
流動資産合計	9,251,402	20,943,846
資産合計	9,251,402	20,943,846
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,898	12,168
未払受託者報酬	240	1,830
未払委託者報酬	2,873	18,870
その他未払費用	52	837
流動負債合計	8,063	33,705
負債合計	8,063	33,705
純資産の部		
元本等		
元本	10,902,605	25,495,217
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	1,659,266	4,585,076
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	9,243,339	20,910,141
純資産合計	9,243,339	20,910,141
負債純資産合計	9,251,402	20,943,846

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2021年11月30日 至 2022年5月29日	第2期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	102,878	417,948
営業収益合計	102,878	417,948
営業費用		
受託者報酬	6	1,830
委託者報酬	1,097	18,870
その他費用	-	837
営業費用合計	1,103	21,537
営業利益又は営業損失（ ）	103,981	439,485
経常利益又は経常損失（ ）	103,981	439,485
中間純利益又は中間純損失（ ）	103,981	439,485
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	8,492	44,078
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	1,659,266
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,580	1,340,143
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,580	1,340,143
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,589	3,870,546
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,589	3,870,546
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	115,498	4,585,076

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2022年12月13日	至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年6月12日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	10,902,605円
期中追加設定元本額	10,592,565円	23,241,355円
期中一部解約元本額	689,960円	8,648,743円
2. 受益権の総数	10,902,605口	25,495,217口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,659,266円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,585,076円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	0.8478円	0.8202円
（1万口当たり純資産額）	（8,478円）	（8,202円）

【FWニッセイ外国債インデックス】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	239	819
コール・ローン	7,552	45,336
親投資信託受益証券	21,934,587	40,661,318
未収入金	505	9,411
流動資産合計	21,942,883	40,716,884
資産合計	21,942,883	40,716,884
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	8,440
未払受託者報酬	614	3,524
未払委託者報酬	8,005	42,896
その他未払費用	214	1,693
流動負債合計	8,833	56,553
負債合計	8,833	56,553
純資産の部		
元本等		
元本	21,869,189	39,881,423
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	64,861	778,908
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	21,934,050	40,660,331
純資産合計	21,934,050	40,660,331
負債純資産合計	21,942,883	40,716,884

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2021年11月30日 至 2022年5月29日	第2期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	19,550	1,216,529
営業収益合計	19,550	1,216,529
営業費用		
受託者報酬	67	3,524
委託者報酬	1,515	42,896
その他費用	-	1,693
営業費用合計	1,582	48,113
営業利益又は営業損失（ ）	21,132	1,168,416
経常利益又は経常損失（ ）	21,132	1,168,416
中間純利益又は中間純損失（ ）	21,132	1,168,416
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	4,241	47,725
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	64,861
剰余金増加額又は欠損金減少額	85	36,168
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	85	36,168
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,818	442,812
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,818	442,812
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	25,624	778,908

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2022年12月13日	至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年6月12日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	21,869,189円
期中追加設定元本額	21,471,963円	23,706,067円
期中一部解約元本額	602,774円	5,693,833円
2. 受益権の総数	21,869,189口	39,881,423口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0030円 (10,030円)	1.0195円 (10,195円)

【FWニッセイ新興国債インデックス】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	153	659
コール・ローン	4,838	36,467
親投資信託受益証券	12,573,581	32,258,997
未収入金	297	800
流動資産合計	12,578,869	32,296,923
資産合計	12,578,869	32,296,923
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	390	2,740
未払委託者報酬	5,109	34,692
その他未払費用	104	1,304
流動負債合計	5,603	38,736
負債合計	5,603	38,736
純資産の部		
元本等		
元本	13,264,818	33,193,578
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	691,552	935,391
（分配準備積立金）	120,861	108,268
元本等合計	12,573,266	32,258,187
純資産合計	12,573,266	32,258,187
負債純資産合計	12,578,869	32,296,923

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 2021年11月30日 至 2022年5月29日	第2期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	98,328	1,303,688
営業収益合計	98,328	1,303,688
営業費用		
受託者報酬	49	2,740
委託者報酬	1,423	34,692
その他費用	-	1,304
営業費用合計	1,472	38,736
営業利益又は営業損失()	99,800	1,264,952
経常利益又は経常損失()	99,800	1,264,952
中間純利益又は中間純損失()	99,800	1,264,952
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	4,421	45,470
期首剰余金又は期首欠損金()	-	691,552
剰余金増加額又は欠損金減少額	520	223,862
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	520	223,862
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	71,407	1,687,183
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	71,407	1,687,183
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	166,266	935,391

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2022年12月13日	至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年6月12日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	13,264,818円
期中追加設定元本額	12,564,095円	23,181,145円
期中一部解約元本額	299,277円	3,252,385円
2. 受益権の総数	13,264,818口	33,193,578口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は691,552円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は935,391円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	0.9479円	0.9718円
（1万口当たり純資産額）	(9,479円)	(9,718円)

【FWニッセイ国内リートインデックス】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	59	147
コール・ローン	1,867	8,123
親投資信託受益証券	2,747,053	7,324,196
未収入金	428	35,390
流動資産合計	2,749,407	7,367,856
資産合計	2,749,407	7,367,856
負債の部		
流動負債		
未払解約金	365	35,213
未払受託者報酬	101	608
未払委託者報酬	1,951	7,786
その他未払費用	-	230
流動負債合計	2,417	43,837
負債合計	2,417	43,837
純資産の部		
元本等		
元本	2,771,681	7,516,995
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	24,691	192,976
（分配準備積立金）	-	-
元本等合計	2,746,990	7,324,019
純資産合計	2,746,990	7,324,019
負債純資産合計	2,749,407	7,367,856

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期中間計算期間 自 2021年11月30日 至 2022年5月29日	第2期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,246	57,314
営業収益合計	1,246	57,314
営業費用		
受託者報酬	48	608
委託者報酬	1,277	7,786
その他費用	-	230
営業費用合計	1,325	8,624
営業利益又は営業損失()	2,571	48,690
経常利益又は経常損失()	2,571	48,690
中間純利益又は中間純損失()	2,571	48,690
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,758	2,965
期首剰余金又は期首欠損金()	-	24,691
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	21,375
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	21,375
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,254	241,315
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,252	241,315
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	2,067	192,976

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2022年12月13日	至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年6月12日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	2,771,681円
期中追加設定元本額	1,840,503円	5,424,867円
期中一部解約元本額	68,822円	679,553円
2. 受益権の総数	2,771,681口	7,516,995口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は24,691円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は192,976円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	0.9911円	0.9743円
（1万口当たり純資産額）	(9,911円)	(9,743円)

【FWニッセイ先進国リートインデックス】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	91	227
コール・ローン	2,885	12,542
親投資信託受益証券	4,875,670	10,214,989
未収入金	123	267
流動資産合計	4,878,769	10,228,025
資産合計	4,878,769	10,228,025
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	192	862
未払委託者報酬	3,004	12,106
その他未払費用	32	344
流動負債合計	3,228	13,312
負債合計	3,228	13,312
純資産の部		
元本等		
元本	4,947,462	10,139,770
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	71,921	74,943
（分配準備積立金）	-	-
元本等合計	4,875,541	10,214,713
純資産合計	4,875,541	10,214,713
負債純資産合計	4,878,769	10,228,025

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 2021年11月30日 至 2022年5月29日	第2期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	10,212	356,814
営業収益合計	10,212	356,814
営業費用		
受託者報酬	40	862
委託者報酬	1,566	12,106
その他費用	-	344
営業費用合計	1,606	13,312
営業利益又は営業損失()	8,606	343,502
経常利益又は経常損失()	8,606	343,502
中間純利益又は中間純損失()	8,606	343,502
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	210	12,522
期首剰余金又は期首欠損金()	-	71,921
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,951	31,050
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	31,050
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,951	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	91	215,166
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	91	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	215,166
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	19,256	74,943

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2022年12月13日	至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	ファンドの中間計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年6月12日までとなっております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2022年12月12日現在	2023年6月12日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	4,947,462円
期中追加設定元本額	4,033,936円	6,438,884円
期中一部解約元本額	86,474円	1,246,576円
2. 受益権の総数	4,947,462口	10,139,770口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は71,921円であります。	-

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年12月12日現在	第2期中間計算期間 2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9855円 (9,855円)	1.0074円 (10,074円)

（参考）

「FWニッセイ国内株インデックス」、「FWニッセイ先進国株インデックス」、「FWニッセイ新興国株インデックス」、「FWニッセイ国内債インデックス」、「FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）」、「FWニッセイ外国債インデックス」、「FWニッセイ新興国債インデックス」、「FWニッセイ国内リートインデックス」、「FWニッセイ先進国リートインデックス」は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における同親投資信託の状況は以下の通りであります。それらは監査意見の対象外であります。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2023年6月12日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	83,952,438
コール・ローン	4,644,883,237
株式	178,370,819,082
派生商品評価勘定	16,906,550
未収配当金	1,554,024,948
前払金	13,425,000
差入委託証拠金	153,045,000
流動資産合計	184,837,056,255
資産合計	184,837,056,255
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,392,852,396
その他未払費用	6,786
流動負債合計	2,392,859,182
負債合計	2,392,859,182
純資産の部	
元本等	
元本	69,752,267,942
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	112,691,929,131
元本等合計	182,444,197,073
純資産合計	182,444,197,073
負債純資産合計	184,837,056,255

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年6月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	80,607,445,865円
同期中追加設定元本額	8,842,561,370円
同期中一部解約元本額	19,697,739,293円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,396,467,766円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	3,163,941,763円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,346,413円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,076,700,981円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,376,884,619円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,834,710,428円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	2,727,684円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	11,375,707円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	11,317,458円
DCニッセイ国内株式インデックス	2,186,805,222円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	23,689,761,252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)	3,059,506,199円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	308,865,840円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	229,593,701円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	360,721,576円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	579,927,363円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	44,066,178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)	119,955,511円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	9,440,790円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	12,626,291円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	4,741,855円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	8,591,980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)	27,542,294円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	227,399,657円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	154,557,553円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	309,267,249円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	195,793,880円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	14,249,718,241円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット)	23,407,264円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)	40,917円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)	88,015円
FWニッセイ国内株インデックス	42,747,681円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	29,628,614円
計	69,752,267,942円
2. 受益権の総数	69,752,267,942口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2023年6月12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	3,986,330,000	-		4,003,335,000	17,005,000
合計	3,986,330,000	-		4,003,335,000	17,005,000

（注）株価指数先物取引

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	2.6156円
（1万口当たり純資産額）	（26,156円）

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,237,818,375
金銭信託	154,240,851
コール・ローン	8,533,769,346
株式	657,999,309,025
投資証券	13,765,097,275
派生商品評価勘定	722,965,991
未収入金	11,051,813
未収配当金	825,121,377
差入委託証拠金	9,449,966,402
流動資産合計	692,699,340,455
資産合計	
692,699,340,455	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,870,053
未払解約金	1,138,304,065
その他未払費用	12,742
流動負債合計	1,195,186,860
負債合計	
1,195,186,860	
純資産の部	
元本等	
元本	207,342,403,734
剰余金	
剰余金又は欠損金()	484,161,749,861
元本等合計	691,504,153,595
純資産合計	
691,504,153,595	
負債純資産合計	
692,699,340,455	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<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礎となる事項	<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	2023年6月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	194,980,621,021円
同期中追加設定元本額	23,621,895,488円
同期中一部解約元本額	11,260,112,775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）	806,617,592円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,764,663,447円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,329,050,651円
ニッセイ外国株式インデックスSA（適格機関投資家限定）	2,141,482,594円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	1,059,566円
ニッセイインデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	5,891,566円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	6,519,663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）	608,870,638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	151,410,045,877円
DCニッセイ外国株式インデックス	36,021,030,676円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	2,376,509,750円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	343,107,012円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	178,374,825円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	397,768,776円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	617,448,008円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	14,672,228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)	93,182,392円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,292,606円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	9,849,529円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	3,698,978円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	21,486,795円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	252,665,997円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	170,696,010円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	338,606,660円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	179,343,478円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定)	162,128,941円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット)	237,366,463円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適格機関投資家限定)	163,299,247円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01(適格機関投資家限定)	159,983,550円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05(適格機関投資家限定)	159,323,253円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08(適格機関投資家限定)	142,339,184円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)	30,347,880円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	3,010,207,516円
FWニッセイ先進国株インデックス	42,820,314円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	33,038,744円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド 2023-05 (適格機関投資家限定)	101,613,328円
計	207,342,403,734円
2. 受益権の総数	207,342,403,734口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年6月12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				
アメリカ・ドル	3,957,957,296	-	3,956,034,766	1,922,530
イギリス・ポンド	3,137,332,947	-	3,133,166,562	4,166,385
ユーロ	228,684,848	-	231,328,848	2,644,000
買建				
アメリカ・ドル	591,939,501	-	591,539,356	400,145
イギリス・ポンド	10,269,353,356	-	10,394,296,333	124,942,977
ユーロ	8,120,799,906	-	8,208,893,610	88,093,704
合計	760,979,370	-	782,703,432	21,724,062
	1,387,574,080	-	1,402,699,291	15,125,211
	14,227,310,652	-	14,350,331,099	126,865,507

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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

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

株式関連

種類	2023年6月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	17,366,444,729	-	17,905,675,160	539,230,431
合計	17,366,444,729	-	17,905,675,160	539,230,431

（注）株価指数先物取引

1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3,3351円 (33,351円)

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	44,002,462
金銭信託	4,652,951
コール・ローン	257,436,398
株式	6,121,752,204
投資信託受益証券	495,206,979
投資証券	5,739,096
派生商品評価勘定	29,404,993
未収入金	216,468
未収配当金	23,901,519
差入委託証拠金	184,120,134
流動資産合計	7,166,433,204
資産合計	7,166,433,204
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	607,784
未払解約金	39,592,456
その他未払費用	943
流動負債合計	40,201,183
負債合計	40,201,183
純資産の部	
元本等	
元本	5,796,810,469
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,329,421,552
元本等合計	7,126,232,021
純資産合計	7,126,232,021
負債純資産合計	7,166,433,204

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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	2023年6月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,858,147,649円
同期中追加設定元本額	1,456,794,448円
同期中一部解約元本額	518,131,628円
元本の内訳	
ファンド名	
<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド	2,845,301,718円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	20,078,111円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式ノリート）	27,096,241円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式ノリートノ債券）	10,206,694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）	59,274,841円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド（GDP型バスケット）	552,871,196円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	773,754,861円
FWニッセイ新興国株インデックス	8,017,077円
DCニッセイ新興国株式インデックス	1,500,209,730円
計	5,796,810,469円
2. 受益権の総数	5,796,810,469口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年6月12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	521,870,815	-	521,151,012	719,803
アメリカ・ドル	521,870,815	-	521,151,012	719,803
買建	737,179,258	-	752,928,264	15,749,006
アメリカ・ドル	737,179,258	-	752,928,264	15,749,006
合計	1,259,050,073	-	1,274,079,276	16,468,809

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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

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

株式関連

種類	2023年6月12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	478,165,424	-	490,493,825	12,328,401
合計	478,165,424	-	490,493,825	12,328,401

(注) 株価指数先物取引

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	1.2293円
(1万口当たり純資産額)	(12,293円)

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	8,254,466
コール・ローン	456,699,404
国債証券	51,541,883,400
地方債証券	3,693,002,606
特殊債券	5,077,614,663
社債券	5,127,383,900
未収利息	165,445,206
前払費用	6,586,299
流動資産合計	66,076,869,944
資産合計	66,076,869,944
負債の部	
流動負債	
未払解約金	39,621,376
その他未払費用	1,101
流動負債合計	39,622,477
負債合計	39,622,477
純資産の部	
元本等	
元本	69,237,858,034
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,200,610,567
元本等合計	66,037,247,467
純資産合計	66,037,247,467
負債純資産合計	66,076,869,944

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年6月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	72,429,082,391円
同期中追加設定元本額	4,621,886,393円
同期中一部解約元本額	7,813,110,750円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブD B（適格機関投資家限定）	48,732,137,921円
DCニッセイ日本債券インデックス	4,591,007,771円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	209,361,150円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	7,467,028,392円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	398,756,834円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	2,195,593,822円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	1,854,631,711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）	318,427,809円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート/債券）	31,597,580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）	107,999,198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）	73,341,655円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	109,333,869円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	139,026,272円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	492,101,154円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	2,471,677,335円
FWニッセイ国内債インデックス	34,611,144円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	11,224,417円
計	69,237,858,034円
2. 受益権の総数	69,237,858,034口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,200,610,567円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	0.9538円
（1万口当たり純資産額）	（9,538円）

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	145,917,876
金銭信託	22,806,628
コール・ローン	1,261,834,997
国債証券	105,265,760,618
派生商品評価勘定	26,003,743
未収入金	450,442,660
未収利息	585,996,012
前払費用	70,228,972
流動資産合計	107,828,991,506
資産合計	107,828,991,506
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	499,932,215
未払金	1,521,369,331
未払解約金	881,556
その他未払費用	1,167
流動負債合計	2,022,184,269
負債合計	2,022,184,269
純資産の部	
元本等	
元本	105,959,863,099
剰余金	
剰余金又は欠損金()	153,055,862
元本等合計	105,806,807,237
純資産合計	105,806,807,237
負債純資産合計	107,828,991,506

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価して おります。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の 仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に 換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令 第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年6月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	107,106,575,454円
同期中追加設定元本額	9,595,202,788円
同期中一部解約元本額	10,741,915,143円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブDB（適格機関投資家限定）	90,575,222,676円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02（適格機関投資家限定）	2,788,066,290円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09（適格機関投資家限定）	2,808,207,859円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01（適格機関投資家限定）	2,751,175,161円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05（適格機関投資家限定）	2,739,725,016円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08（適格機関投資家限定）	2,447,244,994円
FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）	20,939,889円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド 2023-05（適格機関投資家限定）	1,829,281,214円
計	105,959,863,099円
2. 受益権の総数	105,959,863,099口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は153,055,862円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年6月12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	106,475,638,062	-	106,950,614,594	474,976,532
アメリカ・ドル	52,749,001,993	-	52,817,060,981	68,058,988
イギリス・ポンド	5,060,102,532	-	5,120,499,909	60,397,377
イスラエル・シェケル	313,410,177	-	327,145,341	13,735,164
オーストラリア・ドル	1,618,778,281	-	1,680,158,529	61,380,248
オフショア・人民元	5,866,967,377	-	5,842,751,759	24,215,618
カナダ・ドル	2,155,246,998	-	2,192,875,861	37,628,863
シンガポール・ドル	1,079,813,524	-	1,086,412,060	6,598,536
スウェーデン・クローナ	214,438,644	-	214,587,585	148,941
デンマーク・クローネ	336,508,608	-	338,317,477	1,808,869
ニュージーランド・ドル	223,441,814	-	227,758,946	4,317,132
ノルウェー・クローネ	170,180,970	-	174,681,100	4,500,130
ポーランド・ズロチ	502,841,482	-	515,612,728	12,771,246
メキシコ・ペソ	1,013,179,876	-	1,039,348,863	26,168,987
ユーロ	35,171,725,786	-	35,373,403,455	201,677,669
買建	801,434,606	-	802,482,666	1,048,060
アメリカ・ドル	511,054,081	-	510,320,411	733,670
イギリス・ポンド	38,608,169	-	39,027,521	419,352
カナダ・ドル	17,450,049	-	17,724,908	274,859
シンガポール・ドル	13,965,342	-	14,042,578	77,236
ポーランド・ズロチ	3,820,645	-	3,918,801	98,156
ユーロ	216,536,320	-	217,448,447	912,127
合計	107,277,072,668	-	107,753,097,260	473,928,472

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	0.9986円
(1万口当たり純資産額)	(9,986円)

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	107,516,116
金銭信託	3,380,923
コール・ローン	187,058,187
国債証券	63,247,892,933
派生商品評価勘定	1,005,785
未収利息	369,446,755
前払費用	39,528,383
流動資産合計	63,955,829,082
資産合計	
63,955,829,082	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	27,953
未払金	722,432,241
未払解約金	110,678,309
その他未払費用	421
流動負債合計	833,138,924
負債合計	
833,138,924	
純資産の部	
元本等	
元本	40,627,143,285
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	22,495,546,873
元本等合計	63,122,690,158
純資産合計	63,122,690,158
負債純資産合計	63,955,829,082

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年6月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	37,157,490,721円
同期中追加設定元本額	6,470,667,457円
同期中一部解約元本額	3,001,014,893円
元本の内訳	
ファンド名	
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	3,401,787,630円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	5,895,156,287円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,307,573,530円
ニッセイ外国債券インデックスSA（適格機関投資家限定）	883,509,766円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	2,234,518円
ニッセイインデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	6,137,185円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	4,840,947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	15,362,608,020円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）	4,971,587,972円
DCニッセイ外国債券インデックス	3,767,112,189円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	243,682,565円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,902,592,962円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	284,801,499円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	483,147,194円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	67,966,850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）	196,071,238円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート/債券）	19,316,213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）	44,878,384円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	177,001,298円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	121,592,146円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	246,956,769円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	187,241,916円
FWニッセイ外国債インデックス	26,170,637円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	23,175,570円
計	40,627,143,285円
2. 受益権の総数	40,627,143,285口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年6月12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	763,231,087	-	764,208,919	977,832
アメリカ・ドル	394,922,104	-	395,873,893	951,789
イギリス・ポンド	35,953,494	-	35,964,448	10,954
オーストラリア・ドル	9,471,209	-	9,472,417	1,208
オフショア・人民元	39,020,000	-	39,011,200	8,800
カナダ・ドル	15,933,132	-	15,941,558	8,426
シンガポール・ドル	4,167,231	-	4,168,127	896
スウェーデン・クローナ	1,082,163	-	1,082,525	362
デンマーク・クローネ	2,253,297	-	2,253,858	561
ニュージーランド・ドル	1,223,461	-	1,223,414	47
ノルウェー・クローネ	709,198	-	708,995	203
ポーランド・ズロチ	4,004,683	-	4,002,130	2,553
マレーシア・リングギット	4,275,994	-	4,272,229	3,765
メキシコ・ペソ	7,470,232	-	7,484,494	14,262
ユーロ	242,744,889	-	242,749,631	4,742
合計	763,231,087	-	764,208,919	977,832

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	1.5537円
(1万口当たり純資産額)	(15,537円)

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	16,244,024
金銭信託	250,713
コール・ローン	13,871,365
国債証券	1,980,907,497
特殊債券	77,669,203
派生商品評価勘定	175,839
未収利息	18,991,565
前払費用	4,428,068
流動資産合計	2,112,538,274
資産合計	2,112,538,274
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,156
未払解約金	622,488
その他未払費用	21
流動負債合計	624,665
負債合計	624,665
純資産の部	
元本等	
元本	1,752,824,226
剰余金	
剰余金又は欠損金()	359,089,383
元本等合計	2,111,913,609
純資産合計	2,111,913,609
負債純資産合計	2,112,538,274

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年6月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,305,469,671円
同期中追加設定元本額	467,849,685円
同期中一部解約元本額	20,495,130円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	980,270,677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）	58,088,077円
ニッセイ新興国債券インデックス（ラップ専用）	687,692,298円
FWニッセイ新興国債インデックス	26,773,174円
計	1,752,824,226円
2. 受益権の総数	1,752,824,226口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年6月12日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	629,723	-	631,879	2,156
アメリカ・ドル	629,723	-	631,879	2,156
買建	23,200,577	-	23,376,416	175,839
アメリカ・ドル	23,200,577	-	23,376,416	175,839
合計	23,830,300	-	24,008,295	173,683

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	1.2049円
（1万口当たり純資産額）	（12,049円）

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	5,072,924
コール・ローン	280,672,463
投資証券	31,929,452,000
未収配当金	207,065,689
流動資産合計	32,422,263,076
資産合計	32,422,263,076
負債の部	
流動負債	
未払解約金	79,739,777
その他未払費用	741
流動負債合計	79,740,518
負債合計	79,740,518
純資産の部	
元本等	
元本	17,320,156,133
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,022,366,425
元本等合計	32,342,522,558
純資産合計	32,342,522,558
負債純資産合計	32,422,263,076

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 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	2023年6月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,963,532,535円
同期中追加設定元本額	2,569,994,974円
同期中一部解約元本額	2,213,371,376円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイJ-REITインデックスファンド(適格機関投資家限定)	725,865,300円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	1,148,199,292円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	8,852,184,174円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02(適格機関投資家限定)	1,663,182,538円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	2,928,180,854円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	1,762,381,738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)	162,922,385円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	17,145,380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)	6,469,779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)	11,840,615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)	37,515,270円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(安定型)	109,943円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド(積極型)	236,519円
FWニッセイ国内リートインデックス	3,922,346円
計	17,320,156,133円
2. 受益権の総数	17,320,156,133口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	1.8673円
(1万口当たり純資産額)	(18,673円)

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年6月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	114,183,396
金銭信託	1,238,991
コール・ローン	68,550,341
株式	1,057,512
投資証券	7,030,169,333
派生商品評価勘定	54,885
未収入金	243,131
未収配当金	11,759,888
流動資産合計	7,227,257,477
資産合計	7,227,257,477
負債の部	
流動負債	
未払金	101,641,544
未払解約金	29,343,113
その他未払費用	190
流動負債合計	130,984,847
負債合計	130,984,847
純資産の部	
元本等	
元本	4,963,924,159
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,132,348,471
元本等合計	7,096,272,630
純資産合計	7,096,272,630
負債純資産合計	7,227,257,477

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年12月13日 至 2023年6月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年6月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,224,235,841円
同期中追加設定元本額	1,128,464,917円
同期中一部解約元本額	388,776,599円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ先進国リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,721,699,905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）	215,783,431円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	22,580,950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）	8,506,900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）	49,399,002円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	56,792,492円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	884,600,897円
FWニッセイ先進国リートインデックス	7,145,348円
DCニッセイ先進国リートインデックス	1,997,415,234円
計	4,963,924,159円
2. 受益権の総数	4,963,924,159口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年6月12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 オーストラリア・ドル	5,908,848	-	5,963,733	54,885
	5,908,848	-	5,963,733	54,885
合計	5,908,848	-	5,963,733	54,885

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年6月12日現在
1口当たり純資産額	1.4296円
（1万口当たり純資産額）	（14,296円）

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

F Wニッセイ国内株インデックス

2023年6月30日現在

資産総額	114,010,071円
負債総額	15,941円
純資産総額（ - ）	113,994,130円
発行済数量	93,567,210口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2183円

F Wニッセイ先進国株インデックス

2023年6月30日現在

資産総額	148,859,406円
負債総額	79,946円
純資産総額（ - ）	148,779,460円
発行済数量	121,223,783口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2273円

F Wニッセイ新興国株インデックス

2023年6月30日現在

資産総額	10,449,947円
負債総額	36,665円
純資産総額（ - ）	10,413,282円
発行済数量	9,742,671口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0688円

F Wニッセイ国内債インデックス

2023年6月30日現在

資産総額	36,974,898円
負債総額	3,624円
純資産総額（ - ）	36,971,274円
発行済数量	38,136,652口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9694円

F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

2023年6月30日現在

資産総額	23,633,419円
負債総額	2,691円
純資産総額（ - ）	23,630,728円
発行済数量	28,970,214口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8157円

F Wニッセイ外国債インデックス

2023年6月30日現在

資産総額	45,165,870円
負債総額	6,600円
純資産総額（ - ）	45,159,270円
発行済数量	42,592,768口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0603円

F Wニッセイ新興国債インデックス

2023年6月30日現在

資産総額	35,599,665円
負債総額	5,268円
純資産総額（ - ）	35,594,397円
発行済数量	35,147,266口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0127円

F Wニッセイ国内リートインデックス

2023年6月30日現在

資産総額	8,009,779円
負債総額	1,087円
純資産総額（ - ）	8,008,692円
発行済数量	8,211,240口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9753円

F Wニッセイ先進国リートインデックス

2023年6月30日現在

資産総額	10,989,255円
負債総額	1,604円
純資産総額（ - ）	10,987,651円
発行済数量	10,503,944口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0461円

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	188,021,794,880円
負債総額	446,045,823円
純資産総額（ - ）	187,575,749,057円
発行済数量	70,069,795,768口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6770円

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	740,052,318,628円
負債総額	820,726,740円
純資産総額（ - ）	739,231,591,888円
発行済数量	209,214,918,297口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5334円

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	7,590,247,098円
負債総額	54,084,486円
純資産総額（ - ）	7,536,162,612円
発行済数量	5,965,812,810口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2632円

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	68,829,144,308円
負債総額	2,079,540,190円
純資産総額（ - ）	66,749,604,118円
発行済数量	69,808,348,153口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9562円

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	107,992,643,073円
負債総額	5,330,366,971円
純資産総額（ - ）	102,662,276,102円
発行済数量	103,353,579,056口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9933円

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	67,316,809,633円
負債総額	378,037,137円
純資産総額（ - ）	66,938,772,496円
発行済数量	41,422,196,859口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6160円

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	2,367,539,981円
負債総額	21,049,173円
純資産総額（ - ）	2,346,490,808円
発行済数量	1,868,561,182口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2558円

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	31,342,130,557円
負債総額	140,431,099円
純資産総額（ - ）	31,201,699,458円
発行済数量	16,689,617,191口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8695円

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2023年6月30日現在

資産総額	7,653,155,960円
負債総額	14,624,205円
純資産総額（ - ）	7,638,531,755円
発行済数量	5,144,712,790口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4847円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

（2）受益者に対する特典

ありません。

（3）譲渡制限

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

（4）受益権の譲渡

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

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

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

（5）受益権の再分割

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

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2023年6月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間に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1年以内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとします。ただし、任期満了前に退任した取締役の補欠として選任された取締役の任期は、退任者の残存期間とします。

取締役会は、取締役のなか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名を選任することができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年6月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	416	72,202
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	108	19,490
単位型公社債投資信託	0	0
合計	524	91,692

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して記載しておりますので、表中の個々の金額の合計と合計欄の金額とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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せん。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		38,492,350		31,522,565
有価証券		6,249,635		5,099,877
前払費用		763,755		595,955
未収委託者報酬		6,157,565		5,813,921
未収運用受託報酬		3,219,400		3,456,007
未収投資助言報酬		265,131		259,830
その他		8,403		18,700
流動資産合計		55,156,243		46,766,858
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	1	150,311	1	150,182
車両	1	968	1	482
器具備品	1	103,050	1	92,889
有形固定資産合計		254,330		243,554
無形固定資産				
ソフトウェア		1,840,943		1,803,047
ソフトウェア仮勘定		577,731		1,198,151
その他		8,013		8,013
無形固定資産合計		2,426,688		3,009,212
投資その他の資産				
投資有価証券		30,679,401		37,635,584
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		10,629		11,881
差入保証金		374,819		367,613
繰延税金資産		1,413,142		1,600,306
その他		10,305		10,037
投資その他の資産合計		32,554,521		39,691,645
固定資産合計		35,235,540		42,944,413
資産合計		90,391,783		89,711,272

負債の部

流動負債

預り金		51,241		53,649
未払収益分配金		8,706		7,080
未払手数料	2	2,315,345	2	2,148,508
未払運用委託報酬	2	1,728,950	2	1,868,264
未払投資助言報酬	2	828,040	2	801,755
その他未払金	2	4,619,477	2	2,880,396
未払費用	2	134,086	2	122,649
未払法人税等		611,046		1,689,458
未払消費税等		349,108		321,144
賞与引当金		1,227,440		1,047,233
その他		93,579		46,054
流動負債合計		11,967,023		10,986,194

固定負債

退職給付引当金		2,423,289		2,402,314
役員退職慰労引当金		16,750		16,150
固定負債合計		2,440,039		2,418,464

負債合計

		14,407,063		13,404,658
--	--	------------	--	------------

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		56,866,270		57,905,876

利益剰余金合計		57,546,077		58,585,683
---------	--	------------	--	------------

株主資本合計		75,827,917		76,867,523
--------	--	------------	--	------------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		348,871		254,732
繰延ヘッジ損益		192,067		306,177
評価・換算差額等合計		156,803		560,910

純資産合計		75,984,720		76,306,613
-------	--	------------	--	------------

負債・純資産合計		90,391,783		89,711,272
----------	--	------------	--	------------

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,144,394	27,807,455
運用受託報酬	17,750,312	18,365,703
投資助言報酬	1,032,738	1,146,302
その他営業収益	-	4,497
営業収益計	47,927,445	47,323,959
営業費用		
支払手数料	11,524,989	10,826,133
広告宣伝費	62,919	34,423
公告費	125	125
調査費	8,730,925	9,426,129
支払運用委託報酬	3,825,413	3,994,350
支払投資助言報酬	3,083,142	3,279,321
委託調査費	125,430	143,143
調査費	1,696,938	2,009,314
委託計算費	277,534	278,897
営業雑経費	846,156	876,260
通信費	59,759	60,541
印刷費	173,841	166,600
協会費	38,262	37,646
その他営業雑経費	574,292	611,472
営業費用計	21,442,649	21,441,969
一般管理費		
役員報酬	150,830	114,167
給料・手当	4,699,931	5,179,604
賞与引当金繰入額	1,184,037	1,033,669
賞与	369,403	357,187
福利厚生費	925,165	988,302
退職給付費用	431,379	411,161
役員退職慰労引当金繰入額	8,950	5,850
役員退職慰労金	-	2,550
その他人件費	162,879	214,336
不動産賃借料	766,098	803,805
その他不動産経費	36,278	35,247
交際費	12,883	27,169
旅費交通費	17,654	133,750
固定資産減価償却費	552,239	663,401
租税公課	385,352	367,046
業務委託費	349,177	438,018
器具備品費	484,762	769,903
保険料	46,907	49,248
寄付金	5,126	10,762
諸経費	247,185	279,825
一般管理費計	10,836,244	11,885,008
営業利益	15,648,550	13,996,981
営業外収益		
受取利息	2,029	950
有価証券利息	3,452	15,666

受取配当金	1	83,809	1	191,353
為替差益		27,680		22,628
その他営業外収益		19,955		20,449
営業外収益計		136,927		251,049
営業外費用				
控除対象外消費税		20,188		5,712
その他営業外費用		404		314
営業外費用計		20,592		6,026
経常利益		15,764,885		14,242,004
特別利益				
投資有価証券売却益		18,927		97,919
投資有価証券償還益		510,138		45,181
特別利益計		529,065		143,100
特別損失				
投資有価証券売却損		7,280		73,703
投資有価証券償還損		50,697		71,887
固定資産除却損	2	132	2	1,757
事故損失賠償金	3	9,883	3	2,015
特別損失計		67,993		149,364
税引前当期純利益		16,225,956		14,235,739
法人税、住民税及び事業税		4,940,051		4,112,329
法人税等調整額		24,895		74,919
法人税等合計		4,964,946		4,187,249
当期純利益		11,261,009		10,048,489

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2021年4月1日 至2022年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余 金合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	55,045,550	55,725,357	74,007,197
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	9,440,289	9,440,289	9,440,289
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	11,261,009	11,261,009	11,261,009
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,820,719	1,820,719	1,820,719
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	56,866,270	57,546,077	75,827,917

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,242,655	97,204	1,145,450	75,152,647
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	9,440,289
当期純利益	-	-	-	11,261,009
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	893,783	94,862	988,646	988,646
当期変動額合計	893,783	94,862	988,646	832,073
当期末残高	348,871	192,067	156,803	75,984,720

当事業年度(自2022年4月1日 至2023年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									株主資本 合計	
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	利益剰余金				利益剰余 金合計		
		資本準備金	資本剰余金 合計		利益準備金	その他利益剰余金					
						配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立金			繰越利益 剰余金
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	56,866,270	57,546,077	75,827,917	
当期変動額											
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	9,008,883	9,008,883	9,008,883	
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	10,048,489	10,048,489	10,048,489	
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,039,606	1,039,606	1,039,606	
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	57,905,876	58,585,683	76,867,523	

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	348,871	192,067	156,803	75,984,720
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	9,008,883
当期純利益	-	-	-	10,048,489
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	603,603	114,109	717,713	717,713
当期変動額合計	603,603	114,109	717,713	321,892
当期末残高	254,732	306,177	560,910	76,306,613

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023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 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>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p> <p>役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>

5．収益及び費用の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p> <p>投資信託委託業務 投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。 委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</p> <p>投資運用業務 投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。 運用受託報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。また、成功報酬は、契約上定められる超過収益の達成等により報酬額及び支払われることが確定した時点で収益として認識しております。</p> <p>投資助言業務 投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。 投資助言報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、契約期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</p>
6．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、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
7．ヘッジ会計の方法	<p>ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によるおります。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定は、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間について、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によるおります。</p>
8．グループ通算制度の適用	<p>当社は、日本生命保険相互会社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。</p>

（会計方針の変更）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計基準を将来にわたって適用することとしております。なお、財務諸表に与える影響はありません。

（未適用の会計基準等）

- ・ 「法人税、住民税及び事業税等に関する会計基準」（企業会計基準第27号 2022年10月28日）
- ・ 「包括利益の表示に関する会計基準」（企業会計基準第25号 2022年10月28日）
- ・ 「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2022年10月28日）

（1）概要

その他の包括利益に対して課税される場合の法人税等の計上区分及びグループ法人税制が適用される場合の子会社株式等の売却に係る税効果の取扱いを定めるものです。

（2）適用予定日

2025年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「法人税、住民税及び事業税等に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

（貸借対照表関係）

- 1．有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物附属設備	329,011千円	340,233千円
車両	5,760	6,246
器具備品	494,576	516,937
計	829,348	863,417

- 2．前事業年度において、関係会社に対する負債として、未払手数料、未払運用委託報酬、未払投資助言報酬、その他未払金、未払費用に含まれるものの合計額は、負債及び純資産の合計額の100分の5を超えており、その金額は前事業年度および当事業年度においてそれぞれ5,317,615千円、2,706,850千円であります。

（損益計算書関係）

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

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
受取配当金	42,069千円	174,180千円

- 2．固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
器具備品	132	1,749
ソフトウェア	-	8
計	132	1,757

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2021年6月30日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度（自2022年4月1日 至2023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

2022年6月30日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	9,008,883千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	83,071円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月30日

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

2023年6月26日開催の定時株主総会において、以下のとおり決議することを予定しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	8,038,816千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	74,126円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023年6月26日

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、以下のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品または市場価格のない株式等（注1）は次表に含まれておりません。また、短期間で決済されるため時価が簿価に近似する金融商品は、注記を省略しております。

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	17,319,017	17,308,937	10,080
その他有価証券	19,610,019	19,610,019	-
資産計	36,929,036	36,918,956	10,080
デリバティブ取引（ ）			
ヘッジ会計が適用され ているもの	73,870	73,870	-
デリバティブ取引計	73,870	73,870	-

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

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,445,768	23,460,731	14,962
その他有価証券	19,289,693	19,289,693	-
資産計	42,735,461	42,750,424	14,962
デリバティブ取引()			
ヘッジ会計が適用され ているもの	24,321	24,321	-
デリバティブ取引計	24,321	24,321	-

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

(注1) 市場価格のない株式等

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)
関係会社株式	66,222

(単位:千円)

区分	当事業年度 (2023年3月31日)
関係会社株式	66,222

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融商品

前事業年度（2022年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 其他有価証券	-	19,610,019	-	19,610,019
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	73,870	-	73,870
合計	-	19,536,149	-	19,536,149

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

当事業年度（2023年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 其他有価証券	-	19,289,693	-	19,289,693
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	24,321	-	24,321
合計	-	19,265,372	-	19,265,372

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融商品

前事業年度(2022年3月31日)

区分	時価(千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券 国債・地方債等	-	17,308,937	-	17,308,937
合計	-	17,308,937	-	17,308,937

当事業年度(2023年3月31日)

区分	時価(千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券 国債・地方債等	-	23,460,731	-	23,460,731
合計	-	23,460,731	-	23,460,731

(注) 時価の算定に用いた評価技法および時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

地方債は相場価格を用いて評価しております。当社が保有している地方債は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格と認められないため、その時価をレベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

4. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(2022年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	38,492,350	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	6,250,000	11,070,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	6,108,860	12,060,309	1,121,260	101,009
合計	50,851,210	23,130,309	1,121,260	101,009

(注) 投資信託受益証券であります。

当事業年度(2023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	31,522,565	-	-	-
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	5,100,000	18,340,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	3,029,947	15,086,454	997,574	175,716
合計	39,652,513	33,426,454	997,574	175,716

(注) 投資信託受益証券であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度（2022年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が貸借対照 表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	4,899,207	4,900,290	1,082
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	4,899,207	4,900,290	1,082
時価が貸借対照 表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	12,419,810	12,408,647	11,163
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	12,419,810	12,408,647	11,163
合計		17,319,017	17,308,937	10,080

当事業年度（2023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	13,455,768	13,484,645	28,876
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	13,455,768	13,484,645	28,876
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	9,990,000	9,976,086	13,914
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	9,990,000	9,976,086	13,914
合計		23,445,768	23,460,731	14,962

2. その他有価証券

前事業年度（2022年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上 額が取得原価ま たは償却原価を 超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	10,012,022	9,238,000	774,022
	小計	10,012,022	9,238,000	774,022
貸借対照表計上 額が取得原価ま たは償却原価を 超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	9,597,996	10,017,000	419,003
	小計	9,597,996	10,017,000	419,003
	合計	19,610,019	19,255,000	355,019

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）関係会社株式66,222千円は、市場価格がないことから、上表には記載しておりません。

当事業年度（2023年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価または 償却原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,778,610	6,336,999	441,610
	小計	6,778,610	6,336,999	441,610
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）	12,511,082	13,413,000	901,917
	小計	12,511,082	13,413,000	901,917
	合計	19,289,693	19,749,999	460,306

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）関係会社株式66,222千円は、市場価格がないことから、上表には記載しておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	-	-	-
(2)債券	-	-	-
(3)その他	72,646	18,927	7,280
合計	72,646	18,927	7,280

当事業年度（自2022年4月1日 至2023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	325,215	97,919	73,703
合計	325,215	97,919	73,703

（デリバティブ取引関係）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度（2022年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2023年3月31日）

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資 有価証券	1,264,288	-	73,870
合計			1,264,288	-	73,870

（注1）時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

（注2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 〇 で示しております。

当事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資 有価証券	1,129,663	-	24,321
合計			1,129,663	-	24,321

（注1）時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

（注2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 〇 で示しております。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．確定給付制度

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

	前事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,049,929 千円	2,324,488 千円
勤務費用	296,556	261,043
利息費用	5,724	7,886
数理計算上の差異の発生額	26,217	51,020
退職給付の支払額	58,809	318,533
その他	4,869	2,382
退職給付債務の期末残高	2,324,488	2,226,246

（2）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	134,197 千円	147,543 千円
退職給付費用	19,557	18,835
退職給付の支払額	1,342	1,081
その他	4,869	2,382
退職給付引当金の期末残高	147,543	162,914

（3）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,472,031 千円	2,389,160 千円
未認識数理計算上の差異	48,741	13,153
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,423,289	2,402,314
退職給付引当金	2,423,289	2,402,314
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,423,289	2,402,314

(4) 退職給付費用

	前事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
簡便法で計算した退職給付費用	19,557 千円	18,835 千円
勤務費用	296,556	261,043
利息費用	5,724	7,886
数理計算上の差異の当期費用処理額	5,631	10,874
確定給付制度に係る退職給付費用	327,469	298,639

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表しております。)

	前事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.35 %	0.66 %

3 . 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度において68,995千円、当事業年度において75,867千円であり、退職給付費用に計上しております。

(税効果会計関係)

1 . 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	375,842 千円	320,663 千円
未払事業税	134,561	113,779
退職給付引当金	742,011	735,588
税務上の繰延資産償却超過額	1,565	2,055
役員退職慰労引当金	5,128	4,945
投資有価証券評価差額	140,574	314,276
減価償却超過額	38,704	48,992
その他	128,909	180,561
小計	1,567,297	1,720,862
評価性引当額	1,808	12,818
繰延税金資産合計	1,565,488	1,708,043
繰延税金負債		
特別分配金否認	6,396	10,817
投資有価証券評価差額	145,949	96,919
繰延税金負債合計	152,345	107,737
繰延税金資産(は負債)の純額	1,413,142	1,600,306

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

3 . 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度からグループ通算制度を適用しております。「グループ通算制度を適用する場合の会計処理および開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	6,500,632

当事業年度（自2022年4月1日 至2023年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	5,921,322

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

（単位：千円）

区分	前事業年度 （自 2021年4月 1日 至2022年3月31日）	当事業年度 （自 2022年4月 1日 至2023年3月31日）
営業収益		
投資信託委託業務	29,144,394	27,807,455
投資運用業務（注）	17,750,312	18,365,703
投資助言業務	1,032,738	1,146,302
その他営業収益	-	4,497
計	47,927,445	47,323,959

（注）成功報酬は、損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。

2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の「5．収益及び費用の計上基準」に記載の通りでございます。

（関連当事者との取引）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等
前事業年度（自2021年4月1日 至2022年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	100,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	6,521,634	未収運用受託報酬	1,657,146
								投資助言報酬の受取	120,504	未収投資助言報酬	11,837
								連結納税に伴う支払	3,919,311	その他未払金	3,919,311

当事業年度（自2022年4月1日 至2023年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	100,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	5,922,395	未収運用受託報酬	1,446,614
								投資助言報酬の受取	118,702	未収投資助言報酬	10,996
								グループ通算に伴う支払	2,065,951	その他未払金	2,065,951

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2．親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
1 株当たり純資産額	700,655円80銭	703,623円97銭
1 株当たり当期純利益金額	103,837円87銭	92,657円21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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
当期純利益	11,261,009千円	10,048,489千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	11,261,009千円	10,048,489千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます）。

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます）。

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

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

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

定款の変更等

2023年3月23日に開催された臨時株主総会において、定款に関し以下の変更が決議されました。

<変更前>

（略）

（株主総会の招集及び議長）

第10条 株主総会は、社長が招集し、議長となる。社長に事故があるときは、取締役会において予め定めた順序により、他の取締役が株主総会を招集し、議長となる。

（略）

（役付取締役）

第19条 取締役会は、その決議によって、取締役の中から社長1名を選定する。

2. 取締役会は、前項のほか必要に応じて会長1名、副社長、専務取締役及び常務取締役各若干名を選定することができる。

（取締役会）

第20条 取締役会は、社長が招集し、その議長となる。

2. 社長に事故があるときは、取締役会において予め定めた順序により、他の取締役が取締役会を招集し、議長となる。

（略）

<変更後>

（略）

（株主総会の招集及び議長）

第10条 株主総会は、取締役社長が招集し、議長となる。取締役社長に事故があるときは、取締役会において予め定めた順序により、他の取締役が株主総会を招集し、議長となる。

（略）

（役付取締役）

第19条 取締役会は、その決議によって、取締役の中から取締役社長 1名を選定する。

2．取締役会は、前項のほか必要に応じて取締役会長 1名を選定することができる。

（取締役会）

第20条 取締役会は、取締役社長が招集し、その議長となる。

2．取締役社長に事故があるときは、取締役会において予め定めた順序により、他の取締役が取締役会を招集し、議長となる。

（略）

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2023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

2023年3月末現在、10,000百万円

c. 事業の内容

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

(2) 販売会社

(資本金の額：2023年3月末現在)

a. 名称	b. 資本金の額 (単位：百万円)	c. 事業の内容
株式会社スマートプラス	100	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。

(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

2023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】

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

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

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (2) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (3) 投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・ ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更の際には、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
 - ・ 商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。
 - ・ 基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
- なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
- コールセンター 0120-762-506
(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)
ホームページ <https://www.nam.co.jp/>
- (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

2023年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大竹 新

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

2023年3月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ国内株インデックスの2021年11月30日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ国内株インデックスの2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2023年3月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ先進国株インデックスの2021年11月30日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ先進国株インデックスの2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2023年3月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ新興国株インデックスの2021年11月30日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、F Wニッセイ新興国株インデックスの2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2023年3月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ国内債インデックスの2021年11月30日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、F Wニッセイ国内債インデックスの2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2023年3月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）の2021年11月30日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）の2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2023年3月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ外国債インデックスの2021年11月30日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、F Wニッセイ外国債インデックスの2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2023年3月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ新興国債インデックスの2021年11月30日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ新興国債インデックスの2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2023年3月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ国内リートインデックスの2021年11月30日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ国内リートインデックスの2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2023年3月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ先進国リートインデックスの2021年11月30日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、F Wニッセイ先進国リートインデックスの2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ国内株インデックスの2022年12月13日から2023年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、F Wニッセイ国内株インデックスの2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ先進国株インデックスの2022年12月13日から2023年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、F Wニッセイ先進国株インデックスの2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ新興国株インデックスの2022年12月13日から2023年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、F Wニッセイ新興国株インデックスの2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ国内債インデックスの2022年12月13日から2023年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、F Wニッセイ国内債インデックスの2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）の2022年12月13日から2023年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）の2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ外国債インデックスの2022年12月13日から2023年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、F Wニッセイ外国債インデックスの2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ新興国債インデックスの2022年12月13日から2023年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、F Wニッセイ新興国債インデックスの2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ国内リートインデックスの2022年12月13日から2023年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、F Wニッセイ国内リートインデックスの2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月8日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ先進国リートインデックスの2022年12月13日から2023年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、FWニッセイ先進国リートインデックスの2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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