【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年3月8日提出
【計算期間】	第2期（自　2022年12月13日　至　2023年12月11日）
【ファンド名】	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
【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
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号
【電話番号】	０３－５５３３－４６０８
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① 基本方針

「国内株インデックス」

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、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。

「新興国株インデックス」

ファンドは、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、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ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、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、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、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。

「国内リートインデックス」

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

「先進国リートインデックス」

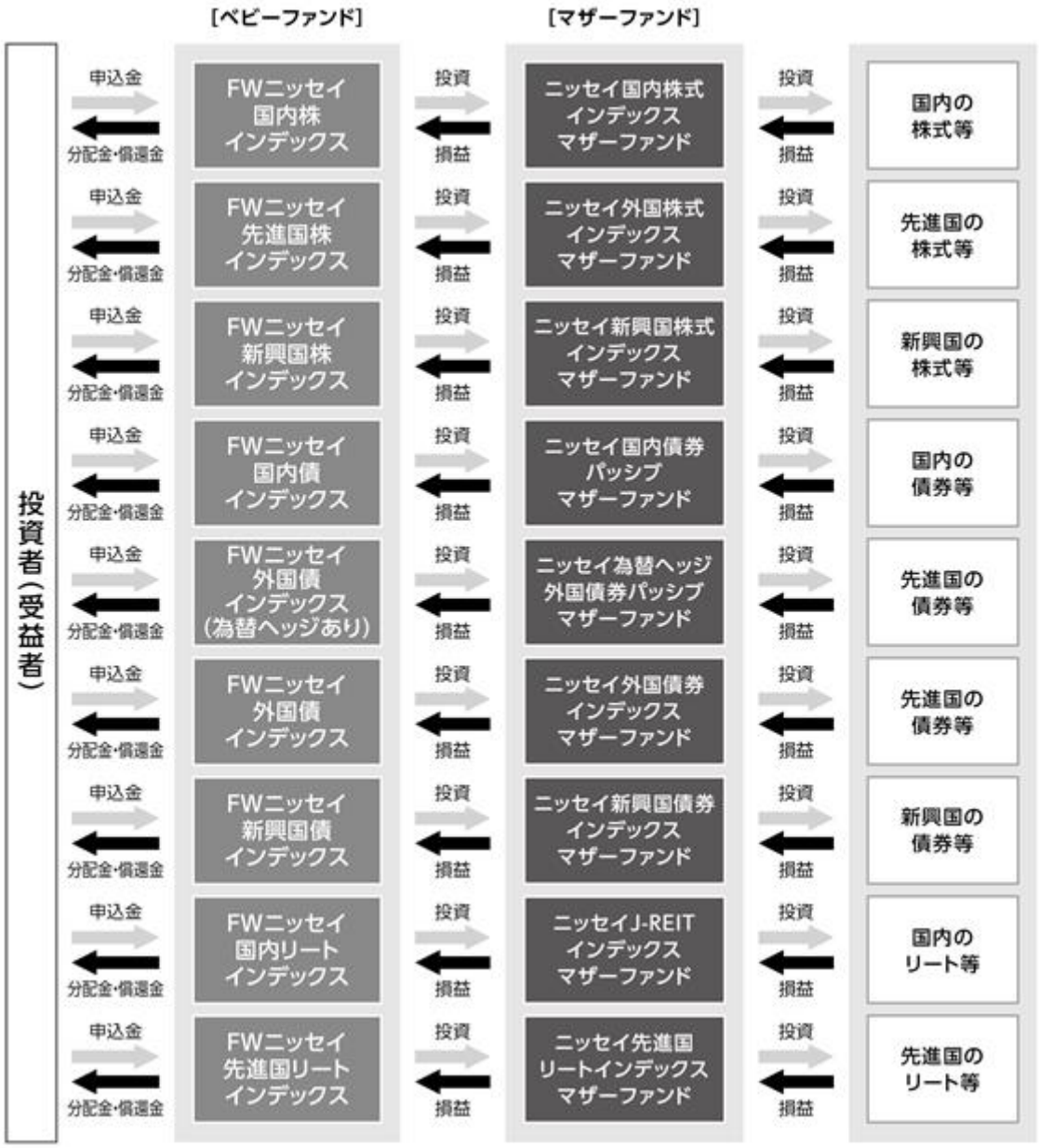
ファンドは、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

② 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

＜イメージ図＞



③ ファンドの特色

1「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写、使用、頒布することは禁じられています。Copyright ©2016 J.P. Morgan Chase & Co. 無断複写・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。

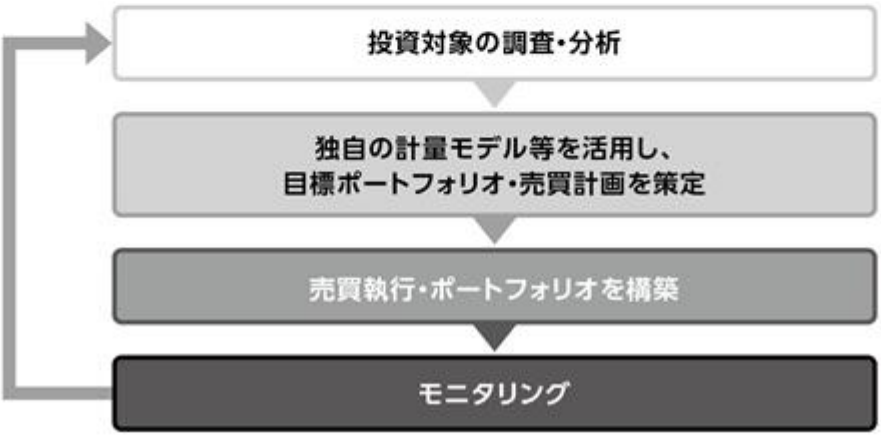
●S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

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（「SPDJI」）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SPDJI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、SPDJI、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。

〈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、参加もしておりません。ＭＳＣＩ Ｉｎｃ.、ＭＳＣＩ Ｉｎｃ.の関連会社およびＭＳＣＩ指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

④　信託金の上限

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	

⑤　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す）。

商品分類表

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

属性区分表

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

商品分類表

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

属性区分表

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

「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す）。

商品分類表

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

属性区分表

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

「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す）。

商品分類表

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

属性区分表

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

「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す）。

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式		グローバル（日本除く）			
一般					日経225
大型株					
中小型株	年１回	日　本			
債券					
一般	年２回	北　米	ファミリーファンド		
公債				あ　り（フルヘッジ）	
社債	年４回	欧　州			ＴＯＰＩＸ
その他債券					
クレジット属性	年６回（隔月）	アジア			
（　　）					
		オセアニア			
不動産投信	年12回（毎月）	中南米			
			ファンド・オブ・ファンズ		
その他資産					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））
（投資信託証券（債券（公債））	日　々	アフリカ		な　し	
	その他（　　）	中近東（中東）			
資産複合					
（　　）		エマージング			
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す）。

商品分類表

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

属性区分表

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

「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す）。

商品分類表

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年１回	グローバル	ファミリーファンド	あ　り	日経225
一般	年２回	日　本	ファンド・オブ・ファンズ	（　　）	ＴＯＰＩＸ
大型株	年４回	北　米		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））
中小型株	年６回（隔月）	欧　州			
債券	年12回（毎月）	アジア			
一般	日　々	オセアニア			
公債	その他（　　）	中南米			
社債		アフリカ			
その他債券		中近東（中東）			
クレジット属性（　　）		エマージング			
不動産投信					
その他資産（投資信託証券（債券（一般））					
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す）。

商品分類表

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

属性区分表

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

「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す）。

商品分類表

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

属性区分表

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

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	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。
日本	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。

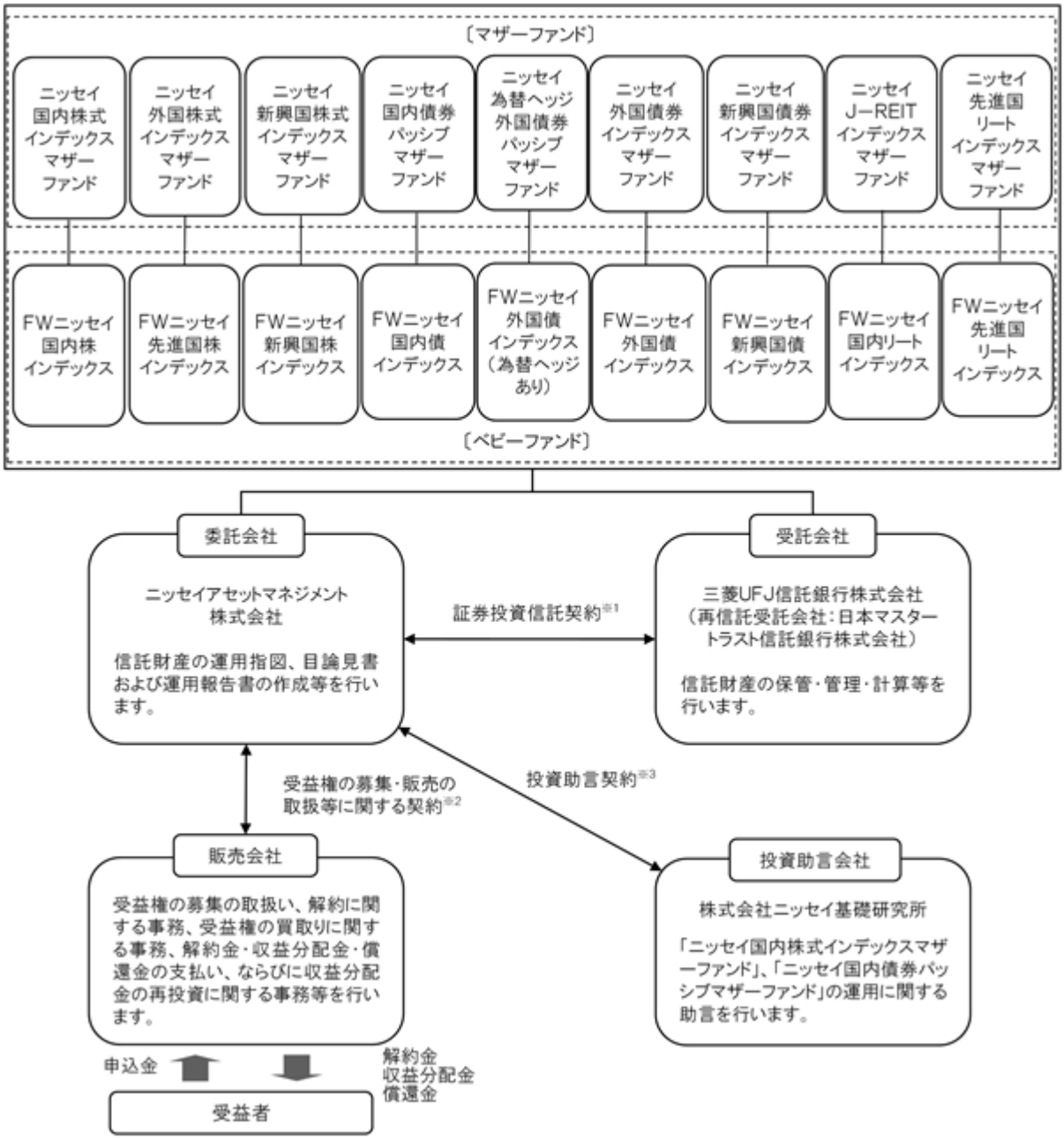
その他の指数（ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）（円ヘッジベース））	目論見書または約款において、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）（円ヘッジベース）の動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。
その他の指数（ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース））	目論見書または約款において、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。
その他の指数（ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（除くＢ格以下））	目論見書または約款において、ＪＰモルガン・エマージング・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ＲＥＩＴ指数）	目論見書または約款において、東証ＲＥＩＴ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ＲＥＩＴ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ＲＥＩＴ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12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」

①　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。
②　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。
③　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。
④　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。
⑤　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

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

ｂ　投資態度

①　国内の証券取引所上場株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

②　株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

③　株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

③　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。

④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑤　同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑦　外貨建資産への投資は行いません。

⑧　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑨　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

「先進国株インデックス」

①　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。

②　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。

③　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。
④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（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

①　主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、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。
②　株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。
③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

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

①　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（預託証書）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。
②　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。
③　株式の実質組入比率の維持のために株価指数先物取引等を活用することがあります。
④　実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
⑤　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（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、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（預託証書）を含みます）を主要投資対象とします。

ｂ　投資態度

①　主として新興国の株式等（ＤＲ（預託証書）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。

②　株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　株式の実質組入比率の維持のために株価指数先物取引等を活用することがあります。

④　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

⑤　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

③　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

⑥　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑦　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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

⑨　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、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」

①　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、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　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。

③　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

①　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。

②　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。

③　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。

④　公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　株式への投資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。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　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す。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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）」

①　主として、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。

②　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。

③　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。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（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

①　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、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。

②　公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

③　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。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　株式への投資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。

②　同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③　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。

④　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。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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」

①　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、ＦＴＳＥ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。

②　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。

③　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。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（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、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

①　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、ＦＴＳＥ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。

②　公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

③　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。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　株式への投資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。

②　同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以内とします。

③　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。

④　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。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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」

①　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、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。

②　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。

③　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。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（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

①　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。

②　公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　株式への投資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。

②　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。

③　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。

④　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。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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」

①　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。

②　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。

③　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－ＲＥＩＴ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ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

（２）運用方法

ａ　投資対象

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

ｂ　投資態度

①　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みます）している不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標とします。

②　不動産投資信託証券への投資にあたっては、東証ＲＥＩＴ指数採用銘柄（採用予定を含みます）に投資を行うものとします。なお、東証ＲＥＩＴ指数の採用銘柄の追加・変更があった場合は、適宜不動産投資信託証券の追加・見直しを行います。

③　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。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

②　同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える投資信託証券がある場合には、当該投資信託証券を東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

③　株式への直接投資は行いません。

④　外貨建資産への投資は行いません。

⑤　デリバティブの直接利用は行いません。

⑥　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」

①　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みます）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。

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

②　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。

③　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。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（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みます）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

①　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みます）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。

②　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。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　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。

②　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。

③　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。

④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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

①　投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産※の種類は、次に掲げるものとします。

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

※　「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　③　先物取引等、④　スワップ取引および⑤　金利先渡取引あるいは⑤　金利先渡取引および為替先渡取引」に定めるものに限ります）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

「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

②　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書
２．国債証券
３．地方債証券
４．特別の法律により法人の発行する債券
５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます）の新株引受権証券を除きます）
６．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます）
７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます）
８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます）
９．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます）
10．コマーシャル・ペーパー
11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ）および新株予約権証券
12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、１．から11．までの証券または証書の性質を有するもの
13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます）
14．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます）
15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます）
16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります）
17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます）
18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます）
21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22．外国の者に対する権利で21．の有価証券の性質を有するもの

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

「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。

③　金融商品

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

「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

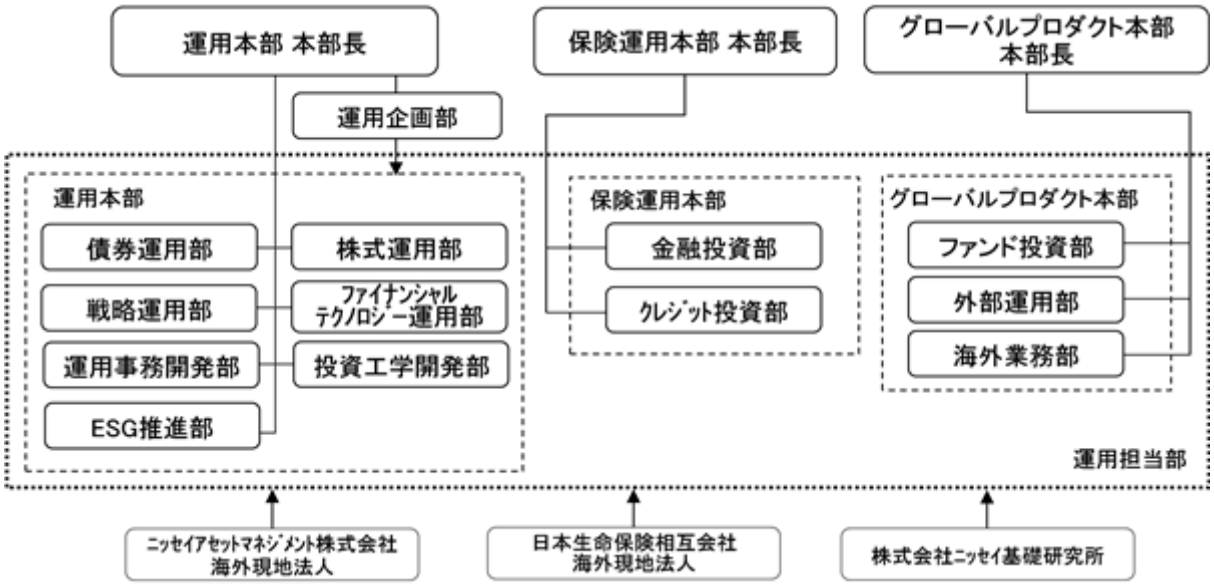
「国内リートインデックス」

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

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

（３）【運用体制】

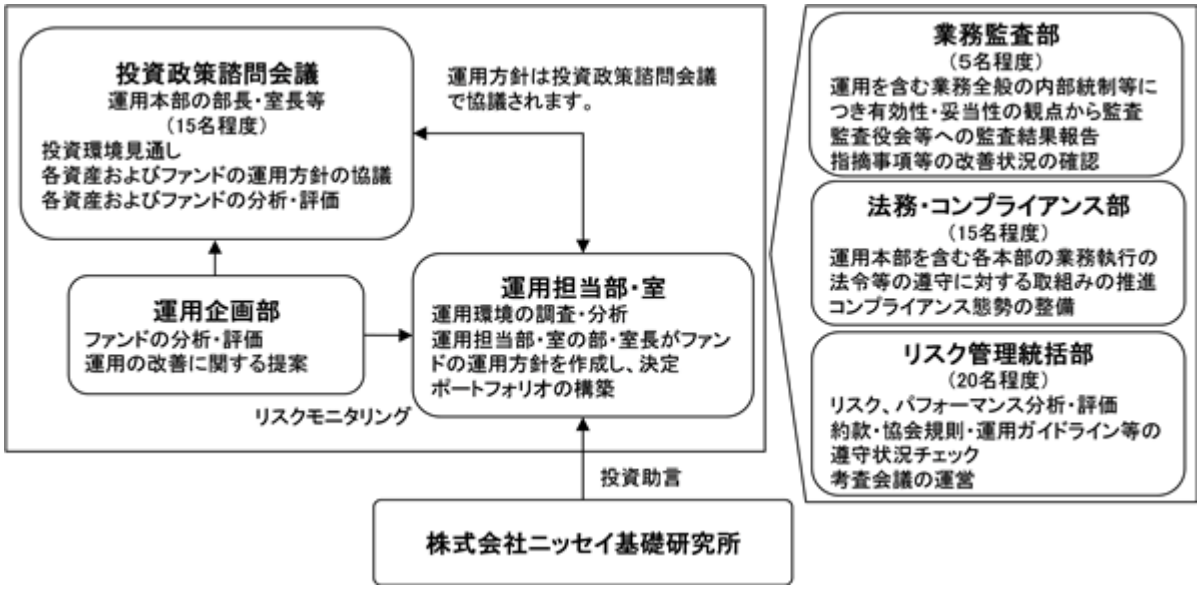
委託会社の組織体制



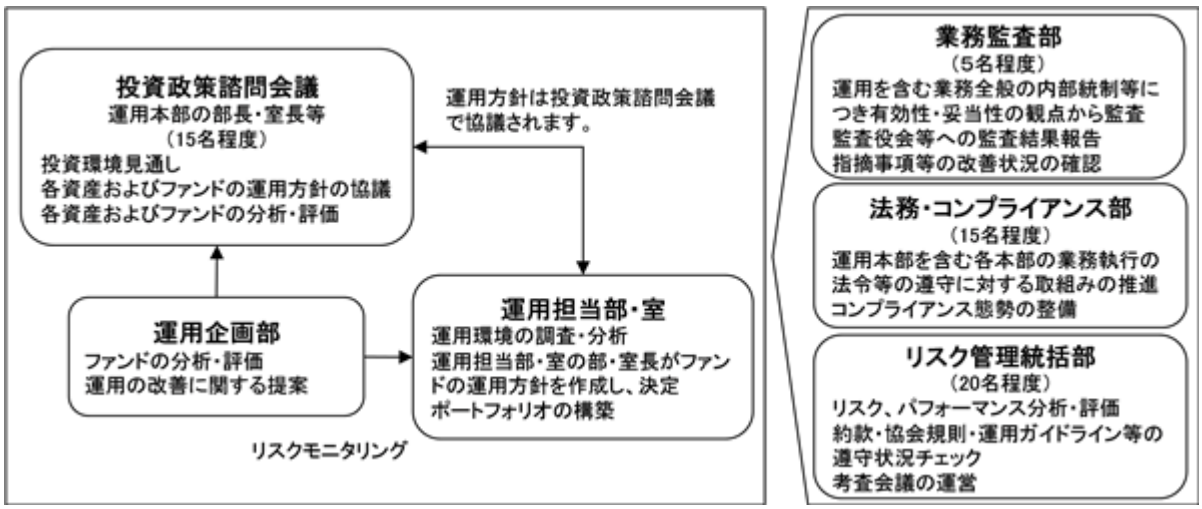
社内規程として、投資信託財産及び投資法人資産に係る運用業務規程およびポートフォリオ・マネジャー／アナリスト服務規程を定めています。また、各投資対象の適切な利用、リスク管理の推進を目的として、各投資対象の取扱いに関して規程を設けています。

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】

①　原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1．分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

2．分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

○　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。

②　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。

③　支払方法

＜分配金受取コースの場合＞

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

＜分配金再投資コースの場合＞

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

○　将来の分配金の支払いおよびその金額について、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」

①　株式への実質投資割合には、制限を設けません。
②　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。
③　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。
④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。
⑤　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑥　投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑦　外貨建資産への投資は行いません。
⑧　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
⑨　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
⑩　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「先進国株インデックス」

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

①　株式への実質投資割合には、制限を設けません。
②　新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
③　同一銘柄の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。

④　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
⑤　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。
⑥　外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
⑦　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
⑧　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
⑨　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、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」
①　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。
②　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。
③　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。
④　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。
⑤　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す。
⑥　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。
⑦　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。
⑧　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）」
①　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。
②　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。
③　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。
④　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。
⑤　外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
⑥　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。
⑦　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。
⑧　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」
① 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。
② 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。
③ 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。
④ 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。
⑤ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
⑥ 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。
⑦ 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。
⑧ 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」
① 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。
② 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。
③ 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。
④ 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。
⑤ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
⑥ 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。
⑦ 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。
⑧ 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」
① 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
② 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。
③ 株式への直接投資は行いません。
④ 外貨建資産への投資は行いません。
⑤ デリバティブの直接利用は行いません。
⑥ 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」

① 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。
② 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。
③ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑤ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
⑥ 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。
⑦ 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。
⑧ 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」

① 投資する株式等の範囲
１．投資する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、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、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。
② 信用取引の範囲
１．信託財産を効率的に運用するため、信用取引により株券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
２．前記１．の信用取引は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
３．信託財産の一部解約等の事由により、前記２．の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。
③ 先物取引等
１．国内の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます）ならびに外国の金融商品取引所における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。
④ 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ます。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該３．において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。
４．前記３．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合をかけた額をいいます。
５．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
６．スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑤　金利先渡取引

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．金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

１．信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。
ｉ．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
ii．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の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たときは、担保の受入れを行うものとします。

⑦　有価証券の空売り

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

⑧　有価証券の借入れ

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

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

⑨　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」

①　投資する株式等の範囲

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

②　信用取引の範囲

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

③　先物取引等

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

④　スワップ取引

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

３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該３．において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。

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

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

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

⑤　金利先渡取引および為替先渡取引

１．金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

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

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

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

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

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

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

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

⑦　有価証券の空売り

１．信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記⑧により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

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

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

⑧　有価証券の借入れ

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

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

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

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　外国為替予約等

１．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

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

⑩　資金の借入れ

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

①　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。

②　信用取引の範囲

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

③　先物取引等

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

④　スワップ取引

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

２．スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該３．において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。

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

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

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

⑤　金利先渡取引

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．金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

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

ⅰ．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ⅱ．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の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たときは、担保の受入れを行うものとします。

⑦　有価証券の空売り

１．信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記⑧により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

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

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

⑧　有価証券の借入れ

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

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

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

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　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」

①　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。

②　信用取引の範囲

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

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

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

③　先物取引等

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

２．国内の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことができます。

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

④　スワップ取引

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

２．スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該３．において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が

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

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

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

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

⑤　金利先渡取引および為替先渡取引

1．金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

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

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

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

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

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

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

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

⑦　有価証券の空売り

1．信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記⑧により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

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

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

⑧　有価証券の借入れ

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

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

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

4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　外国為替予約等

1．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

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

⑩　資金の借入れ

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

①　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。

②　信用取引の範囲

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

③　先物取引等

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

④　スワップ取引

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

３．スワップ取引にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下当該３．において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。

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

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

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

⑤　金利先渡取引および為替先渡取引

１．金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

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

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

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

ⅰ．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ⅱ．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の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たときは、担保の受入れを行うものとします。

⑦　有価証券の空売り

１．信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記⑧により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。

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

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

⑧　有価証券の借入れ

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

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

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

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　外国為替予約等

１．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

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

⑩　資金の借入れ

１．信託財産を効率的に運用するため、ならびに信託財産を安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て（一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます）を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

２．一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入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」

①　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たときは、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。

②　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」

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

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

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

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

③　同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

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

「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2023年12月11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0.8%）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。

「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2023年12月11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0.6%）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。

「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、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）の動きに連動することを目標に運用しますので、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けを中止すること、および既に受付けた購入・換金の申込みの受付けを取消すことがあります。

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドは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。

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）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2023年12月11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8.2%）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。

「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－ＢＰＩ総合の動きに連動することを目標に運用しますので、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ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－ＢＰＩ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2023年12月11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2.4%）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。

「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、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るとは限らないため、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2023年12月11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2.6%）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。

「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2023年12月11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1.8%）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。

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

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

・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2023年12月11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2.1%）保有しています。また、2023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32.6%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。

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

Ｊ－ＲＥＩＴの税制に関するリスク

一般に、Ｊ－ＲＥＩＴ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－ＲＥＩＴの価格が下落することおよび分配金が減少することがあります。

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・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2023年12月11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9.9%）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。

「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、リートの価格が下落することがあります。

信用リスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・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2023年12月11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6.5%）保有しています。また、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2023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26.4%保有しています。

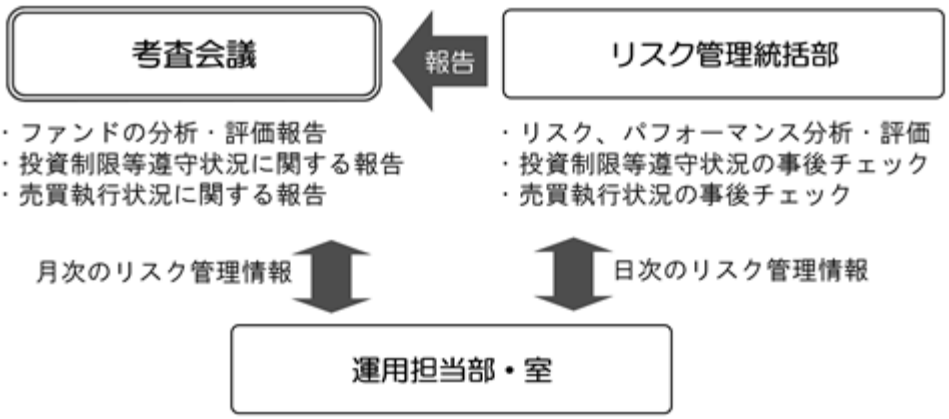
当該保有分は委託会社または日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

・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。

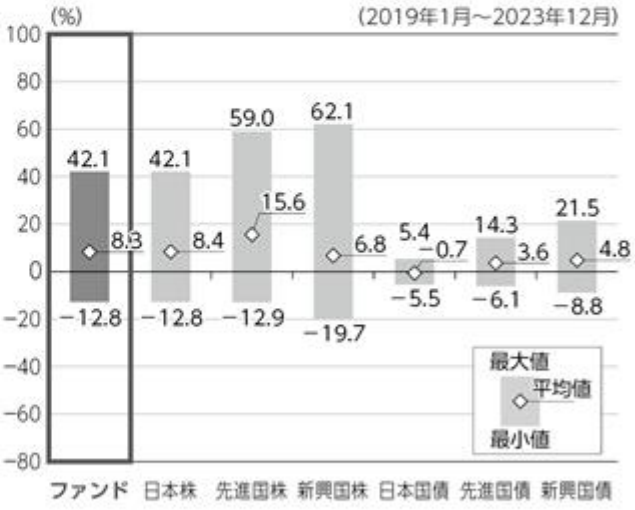
＜流動性リスクに関する管理体制＞
委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行っています。そして取締役会等においては、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢などを監督しています。

(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

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(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留意ください。

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

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

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

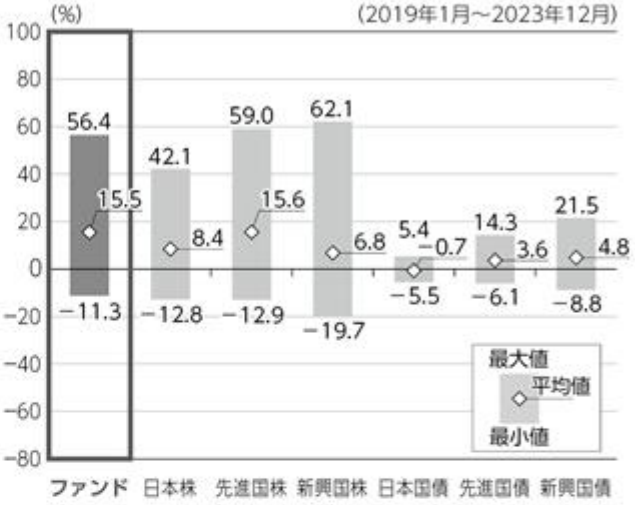
・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数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・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

(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留意ください。

・グラフにおけるファンドに関する記載は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額によるものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額の推移とは異なる場合があります。ファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率は、各月末における直近1年間の騰落率です。
・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間におけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。
<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>
日 本 株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債 … NOMURA-BPI 国債
先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)
・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

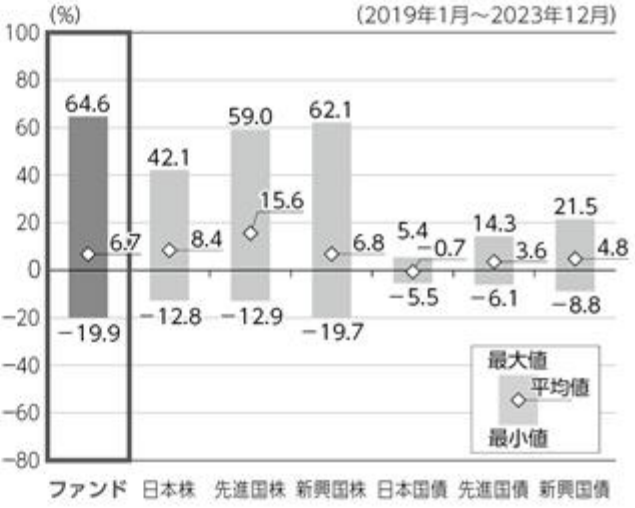
・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数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・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

(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

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留意ください。

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

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

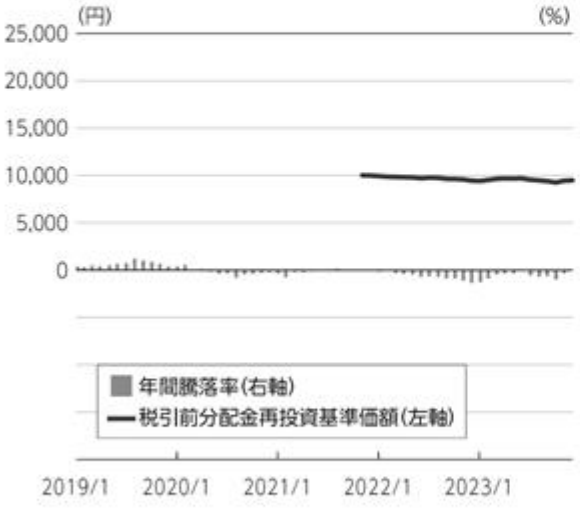
❗前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

・TOPIX(東証株価指数)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・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

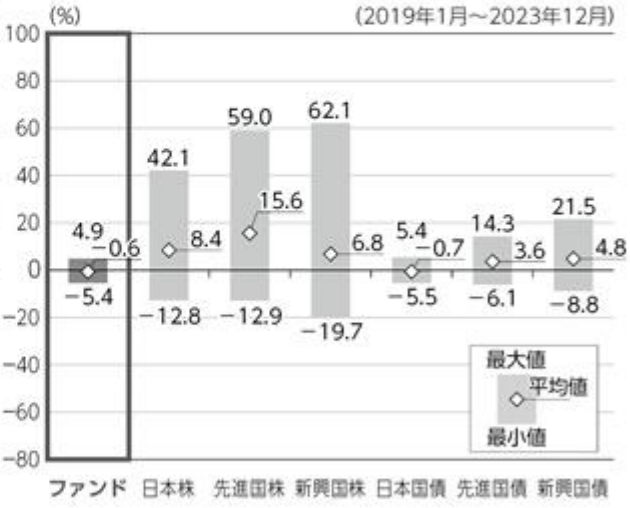
(参考情報) 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

◉FWニッセイ国内債インデックス

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(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留意ください。

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

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

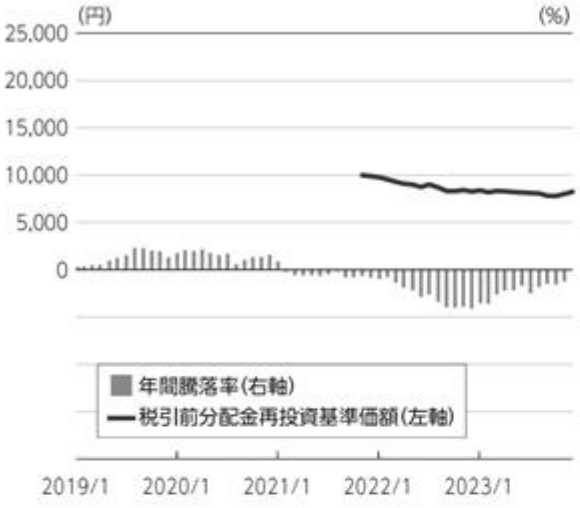
❗前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

・TOPIX(東証株価指数)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・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

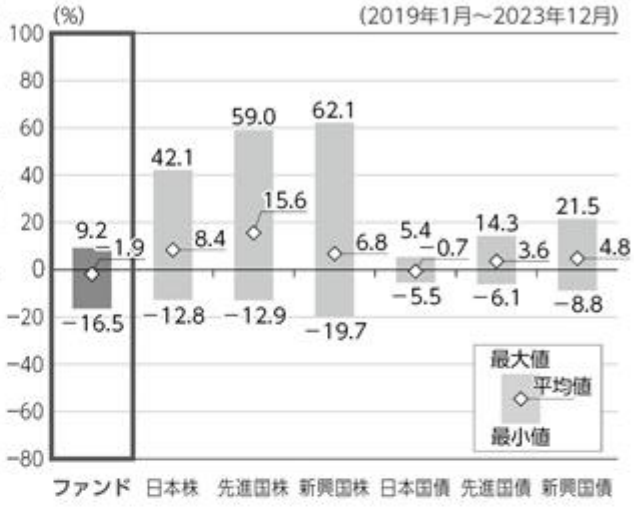
(参考情報) 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

◉FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)

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(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留意ください。

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

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

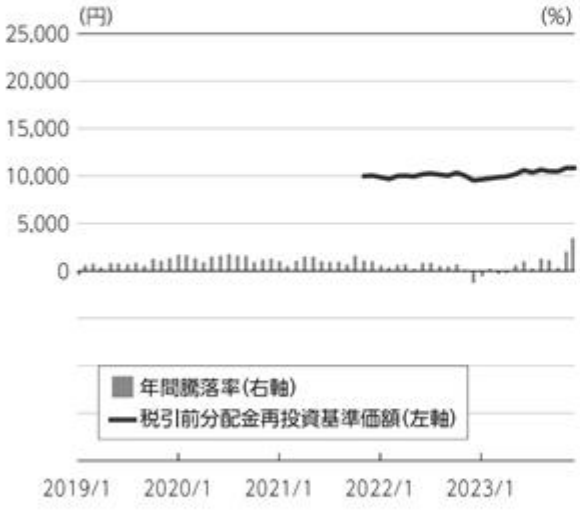
❗前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

・TOPIX(東証株価指数)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・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

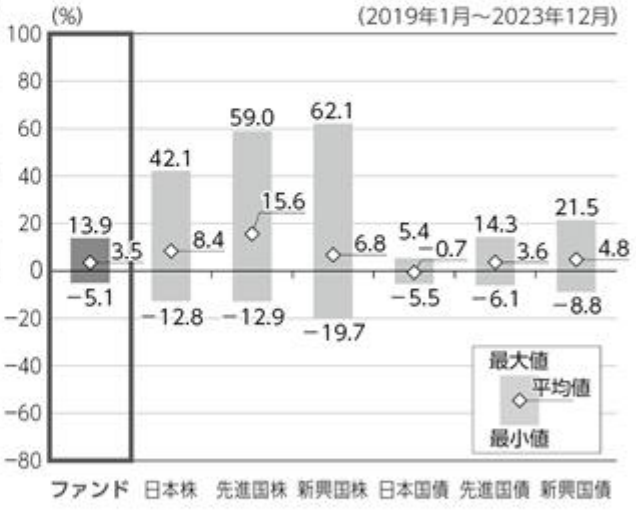
(参考情報) 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

◉FWニッセイ外国債インデックス

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(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留意ください。

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

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

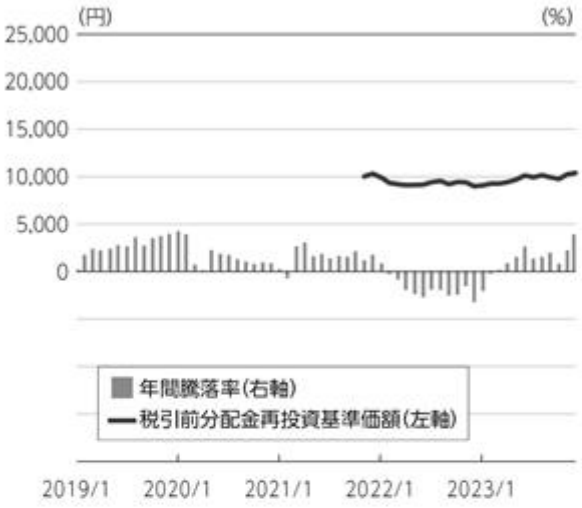
❗前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

・TOPIX(東証株価指数)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・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

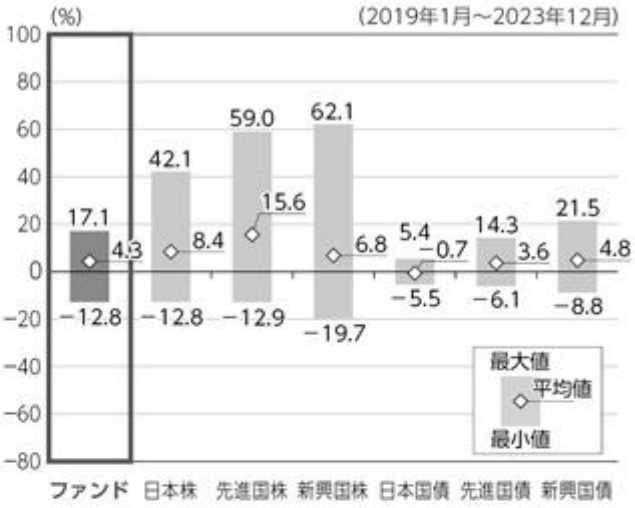
(参考情報) 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

◉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留意ください。

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

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

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

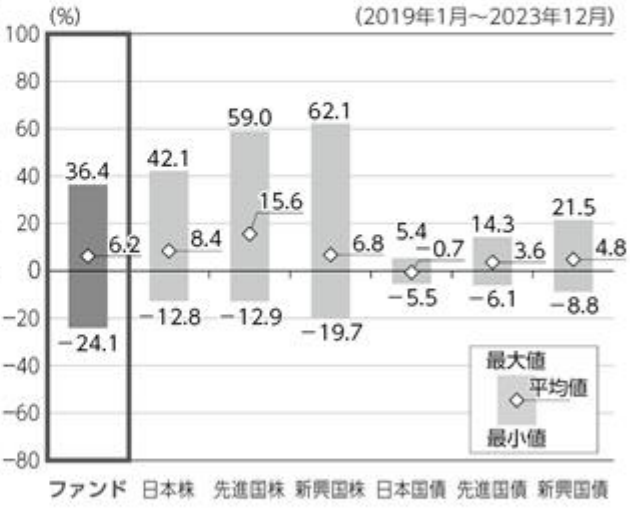
・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数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・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

(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留意ください。

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

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

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

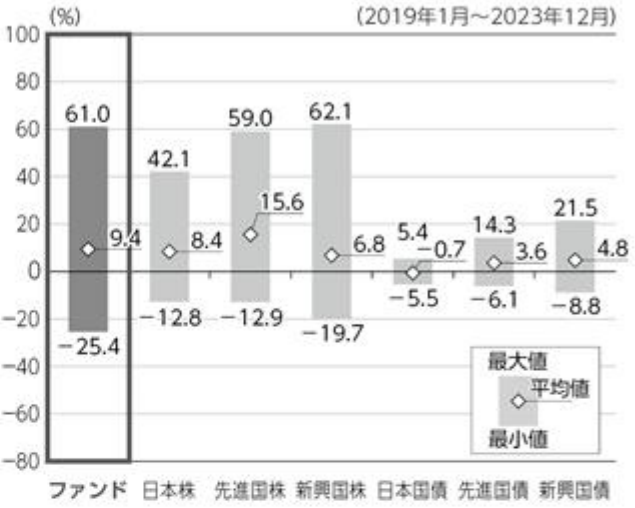
・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
・MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数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・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

(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留意ください。

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

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

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

・TOPIX(東証株価指数)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・ディバーシファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

① 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。

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

（４）【その他の手数料等】

① 証券取引の手数料等

「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。

② 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%）

③ 信託事務の諸費用

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

④ 借入金の利息

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

⑤ 信託財産留保額

「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①、③および④の費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「４ 手数料等及び税

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

＜ご参考＞

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税対象

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

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

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

※　申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

分　　配　　時　：　分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収※され申告不要制度が適用されます。
なお、確定申告を行い、総合課税(「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＞

少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」は少額上場株式等に関する非課税制度であり、ＮＩＳＡをご利用の場合、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。

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。

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、いずれのファンドもＮＩＳＡの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象となります。ただし、販売会社により取扱いが異なる場合があります。

詳しくは、販売会社にお問合せください。

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

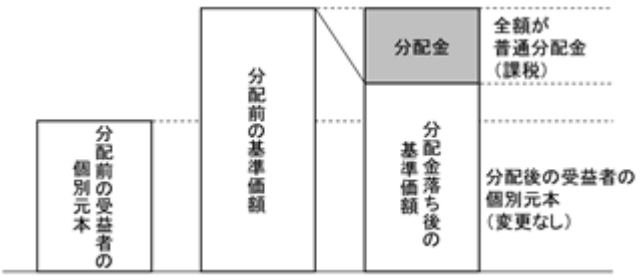
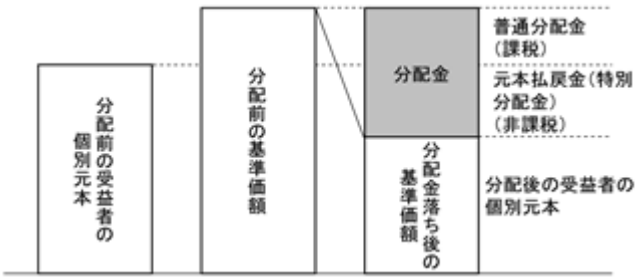
個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

○　投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

5【運用状況】

（1）【投資状況】

ＦＷニッセイ国内株インデックス

2023年12月29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		155,255,523	100.00
	内　日本	155,255,523	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△1,256	△0.00
純資産総額		155,254,267	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。

ＦＷニッセイ先進国株インデックス

2023年12月29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		209,231,994	100.00
	内　日本	209,231,994	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△1,907	△0.00
純資産総額		209,230,087	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。

ＦＷニッセイ新興国株インデックス

2023年12月29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		13,408,196	100.00
	内　日本	13,408,196	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△126	△0.00
純資産総額		13,408,070	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。

ＦＷニッセイ国内債インデックス

2023年12月29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		39,465,496	100.00
	内　日本	39,465,496	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△225	△0.00
純資産総額		39,465,271	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。

ＦＷニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

2023年12月29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		31,294,019	100.00
	内　日本	31,294,019	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△221	△0.00
純資産総額		31,293,798	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。

ＦＷニッセイ外国債インデックス

2023年12月29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		60,422,430	100.00
	内　日本	60,422,430	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△503	△0.00
純資産総額		60,421,927	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。

ＦＷニッセイ新興国債インデックス

2023年12月29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		48,400,588	100.00
	内　日本	48,400,588	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△415	△0.00
純資産総額		48,400,173	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。

ＦＷニッセイ国内リートインデックス

2023年12月29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		9,526,360	100.00
	内　日本	9,526,360	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△76	△0.00
純資産総額		9,526,284	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。

ＦＷニッセイ先進国リートインデックス

2023年12月29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		16,730,513	100.00
	内　日本	16,730,513	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△152	△0.00
純資産総額		16,730,361	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12月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		196,848,920,840	97.37
	内　日本	196,848,920,840	97.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,319,563,976	2.63
純資産総額		202,168,484,816	100.00

その他資産の投資状況

2023年12月29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）		5,583,760,000	2.76
	内　日本	5,583,760,000	2.76

（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12月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		799,632,114,850	95.79
	内　アメリカ	578,862,598,627	69.35
	内　イギリス	33,057,587,668	3.96
	内　カナダ	28,181,803,671	3.38
	内　スイス	26,008,345,031	3.12
	内　フランス	25,656,910,660	3.07
	内　ドイツ	19,729,493,555	2.36
	内　オーストラリア	16,577,147,054	1.99
	内　オランダ	14,504,185,278	1.74
	内　アイルランド	10,448,106,099	1.25
	内　デンマーク	7,810,655,704	0.94
	内　スウェーデン	7,539,578,568	0.90
	内　スペイン	6,220,212,833	0.75
	内　イタリア	5,319,553,128	0.64
	内　香港	4,378,432,054	0.52
	内　シンガポール	2,552,966,040	0.31
	内　フィンランド	2,531,826,861	0.30
	内　ベルギー	2,142,067,853	0.26
	内　ノルウェー	1,561,488,747	0.19
	内　ジャージィー	1,418,982,227	0.17
	内　イスラエル	1,176,139,757	0.14
	内　オランダ領キュラソー	1,069,014,078	0.13
	内　バミューダ	651,604,444	0.08
	内　ポルトガル	519,808,107	0.06
	内　ニュージーランド	477,219,786	0.06
	内　ケイマン諸島	469,246,731	0.06
	内　オーストリア	436,611,044	0.05
	内　ルクセンブルグ	330,529,245	0.04
投資証券		16,729,200,730	2.00
	内　アメリカ	14,394,588,075	1.72
	内　オーストラリア	1,011,517,869	0.12
	内　シンガポール	344,815,250	0.04
	内　フランス	333,496,157	0.04
	内　イギリス	285,242,373	0.03
	内　香港	206,905,069	0.02
	内　カナダ	76,672,741	0.01
	内　ベルギー	75,963,196	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		18,374,584,770	2.20
純資産総額		834,735,900,350	100.00

その他資産の投資状況

2023年12月29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）		17,460,254,838	2.09
	内　アメリカ	12,987,534,431	1.56
	内　ドイツ	3,199,214,592	0.38
	内　イギリス	1,273,505,815	0.15

（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12月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		8,183,081,875	85.48
	内　インド	1,491,392,864	15.58
	内　台湾	1,406,878,500	14.70
	内　韓国	1,151,726,820	12.03
	内　香港	888,665,515	9.28
	内　中国	807,339,253	8.43
	内　ブラジル	513,855,713	5.37
	内　ケイマン諸島	419,746,730	4.38
	内　南アフリカ	260,047,874	2.72
	内　メキシコ	233,244,773	2.44
	内　アメリカ	215,113,596	2.25
	内　インドネシア	166,853,000	1.74
	内　タイ	155,975,673	1.63
	内　マレーシア	116,381,436	1.22
	内　ポーランド	85,327,870	0.89
	内　トルコ	54,574,967	0.57
	内　フィリピン	52,954,926	0.55
	内　ギリシャ	43,168,382	0.45
	内　チリ	42,485,918	0.44
	内　バミューダ	28,101,926	0.29
	内　ハンガリー	23,909,531	0.25
	内　チェコ	12,078,069	0.13
	内　コロンビア	8,874,137	0.09
	内　オランダ	3,235,312	0.03
	内　ペルー	1,147,538	0.01
	内　ロシア	1,495	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		655,932,350	6.85
	内　アメリカ	655,932,350	6.85
投資証券		11,011,160	0.12
	内　メキシコ	11,011,160	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		722,635,323	7.55
純資産総額		9,572,660,708	100.00

その他資産の投資状況

2023年12月29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）		717,692,420	7.50
	内　アメリカ	717,692,420	7.50

（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12月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		42,827,553,930	79.69
	内　日本	42,827,553,930	79.69
地方債証券		3,204,700,616	5.96
	内　日本	3,204,700,616	5.96
特殊債券		4,580,582,771	8.52
	内　日本	4,580,582,771	8.52
社債券		2,696,209,800	5.02
	内　日本	2,600,037,100	4.84
	内　フランス	96,172,700	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		430,548,599	0.80
純資産総額		53,739,595,716	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12月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		106,720,818,400	95.72
	内　アメリカ	50,127,277,922	44.96
	内　フランス	9,102,502,913	8.16
	内　イタリア	8,168,757,336	7.33
	内　中国	7,524,565,577	6.75
	内　ドイツ	7,143,728,331	6.41
	内　イギリス	5,652,459,341	5.07
	内　スペイン	5,344,815,667	4.79
	内　カナダ	2,148,858,683	1.93
	内　ベルギー	1,945,244,795	1.74
	内　オランダ	1,652,508,130	1.48
	内　オーストラリア	1,543,672,747	1.38
	内　オーストリア	1,293,660,962	1.16
	内　シンガポール	999,886,242	0.90
	内　メキシコ	972,139,051	0.87
	内　アイルランド	631,157,902	0.57
	内　フィンランド	572,013,378	0.51
	内　ポーランド	553,126,286	0.50
	内　イスラエル	346,752,549	0.31
	内　デンマーク	307,616,628	0.28
	内　ニュージーランド	264,556,250	0.24
	内　スウェーデン	228,191,405	0.20
	内　ノルウェー	197,326,305	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,770,512,231	4.28
純資産総額		111,491,330,631	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12月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		71,631,747,736	98.87
	内　アメリカ	33,681,073,761	46.49
	内　フランス	6,103,612,602	8.42
	内　イタリア	5,473,561,051	7.55
	内　中国	5,072,172,454	7.00
	内　ドイツ	4,786,646,751	6.61
	内　イギリス	3,791,596,763	5.23
	内　スペイン	3,571,742,961	4.93
	内　カナダ	1,441,071,894	1.99
	内　ベルギー	1,301,601,423	1.80
	内　オランダ	1,105,007,853	1.53
	内　オーストラリア	1,035,277,007	1.43
	内　オーストリア	869,254,802	1.20
	内　メキシコ	654,546,428	0.90
	内　アイルランド	423,802,501	0.58
	内　フィンランド	382,780,162	0.53
	内　ポーランド	370,425,886	0.51
	内　マレーシア	362,433,606	0.50
	内　シンガポール	306,512,336	0.42
	内　イスラエル	231,398,704	0.32
	内　デンマーク	204,638,073	0.28
	内　ニュージーランド	178,704,047	0.25
	内　スウェーデン	154,235,050	0.21
	内　ノルウェー	129,651,621	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		819,622,130	1.13
純資産総額		72,451,369,866	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12月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		3,061,719,218	92.49
	内　メキシコ	320,313,120	9.68
	内　アラブ首長国連邦	297,849,520	9.00
	内　カタール	275,021,982	8.31
	内　サウジアラビア	259,245,096	7.83
	内　チリ	236,747,169	7.15
	内　ブラジル	234,453,497	7.08
	内　ドミニカ共和国	214,882,872	6.49
	内　コロンビア	194,281,284	5.87
	内　ハンガリー	160,418,520	4.85
	内　パナマ	146,120,637	4.41
	内　インドネシア	130,676,771	3.95
	内　中国	128,808,869	3.89
	内　ペルー	118,469,448	3.58
	内　南アフリカ	98,765,872	2.98
	内　オマーン	87,416,068	2.64
	内　ウルグアイ	65,728,134	1.99
	内　ルーマニア	50,395,715	1.52
	内　フィリピン	42,124,644	1.27
特殊債券		136,671,357	4.13
	内　ケイマン諸島	136,671,357	4.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		111,869,926	3.38
純資産総額		3,310,260,501	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12月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		30,400,529,700	98.71
	内　日本	30,400,529,700	98.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		397,307,523	1.29
純資産総額		30,797,837,223	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12月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		10,002,653,696	95.20
	内　アメリカ	7,778,802,576	74.03
	内　オーストラリア	689,829,154	6.57
	内　イギリス	501,329,091	4.77
	内　シンガポール	347,387,211	3.31
	内　フランス	185,647,124	1.77
	内　カナダ	144,456,305	1.37
	内　香港	121,505,083	1.16
	内　ベルギー	120,737,838	1.15
	内　スペイン	45,591,377	0.43
	内　ニュージーランド	29,589,982	0.28
	内　オランダ	17,231,022	0.16
	内　イスラエル	11,639,502	0.11
	内　ドイツ	4,685,283	0.04
	内　アイルランド	3,814,355	0.04
	内　イタリア	407,793	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		504,478,798	4.80
純資産総額		10,507,132,494	100.00

その他資産の投資状況

2023年12月29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）		469,118,568	4.46
	内　アメリカ	413,806,044	3.94
	内　ドイツ	55,312,524	0.53

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（２）【投資資産】
①【投資有価証券の主要銘柄】

ＦＷニッセイ国内株インデックス

2023年12月29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	55,470,193	2.7849 154,479,337	2.7989 155,255,523	－ －	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12月29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。

ＦＷニッセイ先進国株インデックス

2023年12月29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	55,381,682	3.7145 205,717,621	3.7780 209,231,994	－ －	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12月29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。

ＦＷニッセイ新興国株インデックス

2023年12月29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	10,357,019	1.2616 13,066,797	1.2946 13,408,196	－ －	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12月29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。

ＦＷニッセイ国内債インデックス

2023年12月29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	42,141,480	0.9256 39,007,574	0.9365 39,465,496	－ －	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。

種類別及び業種別投資比率

2023年12月29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。

ＦＷニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

2023年12月29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	31,181,765	0.9822 30,627,088	1.0036 31,294,019	－ －	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12月29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。

ＦＷニッセイ外国債インデックス

2023年12月29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	36,473,760	1.6348 59,629,111	1.6566 60,422,430	－ －	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12月29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。

ＦＷニッセイ新興国債インデックス

2023年12月29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	ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	37,496,582	1.2770 47,883,403	1.2908 48,400,588	－ －	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12月29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。

ＦＷニッセイ国内リートインデックス

2023年12月29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	5,133,567	1.8606 9,551,598	1.8557 9,526,360	－ －	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12月29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。

ＦＷニッセイ先進国リートインデックス

2023年12月29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	10,417,505	1.5191 15,825,818	1.6060 16,730,513	－ －	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12月29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12月29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	3,215,300	1,928.03 6,199,223,425	2,590.50 8,329,234,650	－ －	4.12
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	414,200	11,501.85 4,764,068,353	13,410.00 5,554,422,000	－ －	2.75
3	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	3,611,800	1,006.93 3,636,864,188	1,211.50 4,375,695,700	－ －	2.16
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	58,600	58,480.94 3,426,983,321	62,120.00 3,640,232,000	－ －	1.80
5	信越化学工業 日本	株式 化学	531,900	3,927.15 2,088,851,461	5,917.00 3,147,252,300	－ －	1.56
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	123,900	15,416.61 1,910,118,057	25,255.00 3,129,094,500	－ －	1.55
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	17,469,200	158.91 2,776,169,830	172.30 3,009,943,160	－ －	1.49
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	287,600	7,147.15 2,055,520,844	10,170.00 2,924,892,000	－ －	1.45
9	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	410,000	6,022.90 2,469,390,590	6,880.00 2,820,800,000	－ －	1.40
10	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,227,600	1,640.75 2,014,191,020	2,253.50 2,766,396,600	－ －	1.37
11	任天堂 日本	株式 その他製品	369,700	5,501.20 2,033,795,470	7,359.00 2,720,622,300	－ －	1.35

12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	445,600	3,846.93 1,714,196,119	5,963.00 2,657,112,800	－ －	1.31
13	三井物産 日本	株式 卸売業	466,800	4,060.92 1,895,639,464	5,298.00 2,473,106,400	－ －	1.22
14	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	416,500	4,274.66 1,780,399,558	5,767.00 2,401,955,500	－ －	1.19
15	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	519,800	4,258.89 2,213,772,755	4,054.00 2,107,269,200	－ －	1.04
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,428,000	1,170.02 1,670,790,125	1,466.00 2,093,448,000	－ －	1.04
17	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	116,300	13,460.80 1,565,491,814	17,625.00 2,049,787,500	－ －	1.01
18	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	453,800	4,053.95 1,839,682,969	4,486.00 2,035,746,800	－ －	1.01
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	570,100	2,883.82 1,644,067,661	3,529.00 2,011,882,900	－ －	1.00
20	第一三共 日本	株式 医薬品	511,700	4,265.49 2,182,655,199	3,872.00 1,981,302,400	－ －	0.98
21	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	778,400	2,150.30 1,673,795,505	2,412.50 1,877,890,000	－ －	0.93
22	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	289,700	5,771.96 1,672,139,525	6,293.00 1,823,082,100	－ －	0.90
23	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	318,600	4,336.68 1,381,667,936	5,251.00 1,672,968,600	－ －	0.83
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	944,800	1,536.67 1,451,849,710	1,759.50 1,662,375,600	－ －	0.82
25	ダイキン工業 日本	株式 機械	70,600	23,437.92 1,654,717,177	22,985.00 1,622,741,000	－ －	0.80
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	532,800	2,476.26 1,319,353,276	2,993.00 1,594,670,400	－ －	0.79
27	ＳＭＣ 日本	株式 機械	17,700	67,161.84 1,188,764,660	75,760.00 1,340,952,000	－ －	0.66
28	三菱電機 日本	株式 電気機器	658,300	1,575.37 1,037,067,528	1,999.00 1,315,941,700	－ －	0.65
29	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	350,400	2,803.88 982,479,762	3,645.00 1,277,208,000	－ －	0.63
30	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	213,500	6,107.79 1,304,013,999	5,595.00 1,194,532,500	－ －	0.59

（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12月29日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	電気機器	17.05
		輸送用機器	7.97
		情報・通信業	7.52
		卸売業	6.81
		銀行業	6.75
		化学	6.03
		機械	5.19
		サービス業	4.86
		医薬品	4.49
		小売業	4.18
		食料品	3.28
		陸運業	2.77
		保険業	2.35
		その他製品	2.31
		精密機器	2.31
		建設業	2.06
		不動産業	1.89
		電気・ガス業	1.37
		その他金融業	1.12
		鉄鋼	0.93
		海運業	0.82
		証券、商品先物取引業	0.79
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.66
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.51
		石油・石炭製品	0.45
		空運業	0.44
		繊維製品	0.39
		鉱業	0.33
		パルプ・紙	0.16
		倉庫・運輸関連業	0.14
		水産・農林業	0.08
	小計		97.37
合　計（対純資産総額比）			97.37

（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12月29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	1,587,177	26,903.06 42,699,921,412	27,455.45 43,576,660,986	－ －	5.22
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	716,549	52,481.64 37,605,670,821	53,225.96 38,139,010,131	－ －	4.57

3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	942,706	20,595.16 19,415,185,421	21,753.88 20,507,518,289	－ －	2.46
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	250,753	69,884.96 17,523,864,339	70,237.05 17,612,151,650	－ －	2.11
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	601,929	19,190.14 11,551,107,756	19,888.82 11,971,658,075	－ －	1.43
6	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	225,631	47,508.46 10,719,382,655	50,820.52 11,466,686,011	－ －	1.37
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	530,388	19,421.51 10,300,940,806	20,037.74 10,627,778,116	－ －	1.27
8	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・自動車部品	290,003	33,261.97 9,646,072,968	35,908.51 10,413,578,351	－ －	1.25
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	45,052	138,203.07 6,226,324,852	159,191.41 7,171,891,416	－ －	0.86
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	295,014	21,677.76 6,395,244,992	24,153.64 7,125,664,606	－ －	0.85
11	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	94,041	76,059.08 7,152,672,450	74,446.56 7,001,029,607	－ －	0.84
12	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	81,917	83,922.72 6,874,698,181	82,381.95 6,748,482,648	－ －	0.81
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	132,789	50,906.06 6,759,765,622	50,714.15 6,734,281,675	－ －	0.81
14	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サービス	163,121	35,404.36 5,775,195,874	36,932.53 6,024,471,552	－ －	0.72
15	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	406,712	14,881.98 6,052,681,535	14,209.94 5,779,356,248	－ －	0.69

16	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	244,468	21,251.65 5,195,348,437	22,207.74 5,429,082,124	－ －	0.65
17	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 金融サービス	85,417	56,795.17 4,851,273,262	60,464.96 5,164,735,966	－ －	0.62
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	101,531	43,588.51 4,425,585,713	49,266.06 5,002,033,231	－ －	0.60
19	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	239,282	21,426.44 5,126,963,718	20,668.88 4,945,692,355	－ －	0.59
20	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	331,293	14,633.68 4,848,038,434	14,718.05 4,875,988,926	－ －	0.58
21	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	271,054	16,654.58 4,514,290,784	16,283.94 4,413,829,674	－ －	0.53
22	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	40,925	98,783.05 4,042,696,371	107,768.60 4,410,430,282	－ －	0.53
23	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	44,947	81,887.68 3,680,605,743	94,047.47 4,227,151,768	－ －	0.51
24	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	257,618	14,429.36 3,717,264,126	15,426.84 3,974,234,011	－ －	0.48

25	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	179,201	19,615.70 3,515,154,665	21,948.19 3,933,138,044	－ －	0.47
26	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	184,199	20,487.13 3,773,710,538	21,241.87 3,912,732,888	－ －	0.47
27	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	46,219	85,516.85 3,952,503,750	84,462.60 3,903,776,983	－ －	0.47
28	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	98,777	31,401.47 3,101,743,760	37,667.21 3,720,654,140	－ －	0.45
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	726,022	4,252.91 3,087,709,632	4,805.20 3,488,681,204	－ －	0.42
30	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	417,105	8,124.06 3,388,587,778	8,332.51 3,475,532,626	－ －	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12月29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	9.91
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.78
		資本財	6.80
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.63
		金融サービス	6.63
		半導体・半導体製造装置	6.51
		メディア・娯楽	5.88
		銀行	5.39
		エネルギー	4.60
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.53
		ヘルスケア機器・サービス	4.28
		素材	3.98
		食品・飲料・タバコ	3.46
		保険	2.99
		公益事業	2.64
		消費者サービス	2.06
		自動車・自動車部品	2.04
		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	1.59
		商業・専門サービス	1.56
		耐久消費財・アパレル	1.52
		電気通信サービス	1.14
		不動産管理・開発	0.35
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.04
		その他	0.01

	小計		95.79
投資証券	外国		2.00
	小計		2.00
合　計（対純資産総額比）			97.80

（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12月29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	218,000	2,683.78 585,065,951	2,745.23 598,461,055	－ －	6.25
2	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	63,049	5,629.47 354,932,845	5,999.40 378,256,738	－ －	3.95
3	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	42,329	8,014.92 339,263,793	8,674.24 367,172,328	－ －	3.84
4	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	59,400	5,742.96 341,132,035	5,317.95 315,886,230	－ －	3.30
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	145,100	1,328.79 192,807,744	1,376.67 199,755,905	－ －	2.09
6	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネルギー	27,254	4,057.44 110,581,549	4,481.54 122,140,054	－ －	1.28
7	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	57,122	2,126.10 121,447,186	2,104.75 120,227,940	－ －	1.26
8	PDD HOLDINGS INC(ADR) アメリカ	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	5,341	16,846.88 89,979,192	20,614.99 110,104,664	－ －	1.15
9	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	32,967	2,496.58 82,304,988	2,571.37 84,770,615	－ －	0.89
10	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	46,653	1,587.49 74,061,544	1,730.14 80,716,594	－ －	0.84

11	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	29,902	2,476.80 74,061,425	2,687.75 80,369,339	－ －	0.84
12	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	4,946	14,403.75 71,240,989	15,635.74 77,334,419	－ －	0.81
13	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	25,367	2,596.66 65,869,500	2,933.02 74,402,172	－ －	0.78
14	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	875,000	82.21 71,934,796	84.03 73,530,187	－ －	0.77
15	ISHARES MSCI KUWAIT ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	16,579	4,258.57 70,602,942	4,383.68 72,677,057	－ －	0.76
16	VALE SA ブラジル	株式 素材	30,754	2,165.30 66,591,668	2,252.72 69,280,362	－ －	0.72
17	MEITUAN-B 香港	株式 消費者サービス	46,060	1,912.87 88,107,161	1,494.65 68,843,694	－ －	0.72
18	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	14,000	4,212.27 58,971,834	4,745.13 66,431,890	－ －	0.69
19	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	115,200	473.92 54,596,560	481.45 55,463,915	－ －	0.58
20	TATA CONSULTANCY SVCS LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	8,255	6,023.96 49,727,815	6,535.82 53,953,260	－ －	0.56
21	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7,536	6,358.57 47,918,243	6,884.14 51,878,954	－ －	0.54
22	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR ブラジル	株式 エネルギー	44,100	1,067.34 47,070,024	1,086.67 47,922,504	－ －	0.50
23	NETEASE INC 香港	株式 メディア・娯楽	17,900	3,249.44 58,165,088	2,560.96 45,841,273	－ －	0.48

24	JD.COM INC - CL A 香港	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	22,157	1,916.56 42,465,352	2,043.68 45,282,039	－ －	0.47
25	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	521,400	83.39 43,482,892	86.48 45,090,672	－ －	0.47
26	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	45,050	891.84 40,177,631	991.25 44,656,181	－ －	0.47
27	BAIDU INC-CLASS A 香港	株式 メディア・娯楽	20,900	1,904.01 39,793,841	2,085.43 43,585,591	－ －	0.46
28	XIAOMI CORP-CLASS B 香港	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	143,000	288.79 41,297,796	295.48 42,253,926	－ －	0.44
29	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	64,500	686.03 44,249,159	639.78 41,266,293	－ －	0.43
30	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	590,000	68.05 40,150,271	68.60 40,478,130	－ －	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12月29日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	銀行	12.50
		半導体・半導体製造装置	9.42
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.62
		素材	6.53
		メディア・娯楽	5.51
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.03
		エネルギー	4.37
		資本財	4.08
		自動車・自動車部品	3.53
		食品・飲料・タバコ	3.15
		金融サービス	2.78
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.47
		ソフトウェア・サービス	2.36
		公益事業	2.31
		保険	2.24
		消費者サービス	1.98
		電気通信サービス	1.96
		運輸	1.61
		生活必需品流通・小売り	1.31
		耐久消費財・アパレル	1.09
		不動産管理・開発	1.01
		家庭用品・パーソナル用品	0.75
		ヘルスケア機器・サービス	0.71
		その他	0.11
		商業・専門サービス	0.07
	小計		85.48
投資信託受益証券	外国		6.85
	小計		6.85
投資証券	外国		0.12
	小計		0.12
合　計（対純資産総額比）			92.45

（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。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。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2023年12月29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３４０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	500,000,000	101.01 505,091,460	100.66 503,330,000	0.4 2025/9/20	0.94
2	第１４５回　利付国債（５年） 日本	国債証券	466,000,000	100.28 467,325,800	100.15 466,712,980	0.1 2025/9/20	0.87
3	第３７０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	470,000,000	99.91 469,584,480	99.30 466,710,000	0.5 2033/3/20	0.87
4	第１４９回　利付国債（５年） 日本	国債証券	450,000,000	99.83 449,256,300	99.89 449,509,500	0.005 2026/9/20	0.84

5	第３３９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	444,000,000	100.91 448,057,980	100.58 446,588,520	0.4 2025/6/20	0.83
6	第３４１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	438,000,000	100.78 441,434,800	100.54 440,400,240	0.3 2025/12/20	0.82
7	第３６９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	437,000,000	98.03 428,392,380	99.48 434,762,560	0.5 2032/12/20	0.81
8	第３５０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	431,000,000	99.45 428,629,500	99.74 429,918,190	0.1 2028/3/20	0.80
9	第１５０回　利付国債（５年） 日本	国債証券	423,000,000	99.81 422,205,400	99.85 422,373,960	0.005 2026/12/20	0.79
10	第１４４回　利付国債（５年） 日本	国債証券	401,000,000	100.29 402,176,600	100.14 401,581,450	0.1 2025/6/20	0.75
11	第５回　電通グループ 日本	社債券	400,000,000	99.49 397,994,800	99.83 399,332,000	0.32 2027/7/8	0.74
12	第３４２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	395,000,000	100.29 396,145,500	100.15 395,608,300	0.1 2026/3/20	0.74
13	第４５３回　利付国債（２年） 日本	国債証券	395,000,000	99.84 394,388,000	99.97 394,893,350	0.005 2025/10/1	0.73
14	第３６４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	392,000,000	96.73 379,181,600	97.39 381,776,640	0.1 2031/9/20	0.71
15	第３６５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	393,000,000	96.63 379,755,900	97.12 381,697,320	0.1 2031/12/20	0.71
16	第３６２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	384,000,000	97.14 373,017,600	97.96 376,193,280	0.1 2031/3/20	0.70
17	第３６３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	384,000,000	96.89 372,057,600	97.68 375,114,240	0.1 2031/6/20	0.70
18	第３３８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	368,000,000	100.89 371,275,200	100.50 369,862,080	0.4 2025/3/20	0.69
19	第３６１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	373,000,000	97.37 363,190,100	98.23 366,412,820	0.1 2030/12/20	0.68
20	第１４６回　利付国債（５年） 日本	国債証券	362,000,000	100.24 362,895,510	100.15 362,564,720	0.1 2025/12/20	0.67
21	第３４５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	358,000,000	100.07 358,250,600	100.14 358,526,260	0.1 2026/12/20	0.67

22	第３６０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	363,000,000	97.59 354,251,700	98.49 357,518,700	0.1 2030/9/20	0.67
23	第３６８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	364,000,000	101.61 369,860,400	97.13 353,556,840	0.2 2032/9/20	0.66
24	第３５１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	341,000,000	99.32 338,681,200	99.64 339,792,860	0.1 2028/6/20	0.63
25	第３４９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	337,000,000	99.60 335,652,000	99.92 336,733,770	0.1 2027/12/20	0.63
26	第３７２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	330,000,000	100.30 331,009,230	101.69 335,593,500	0.8 2033/9/20	0.62
27	第３４８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	335,000,000	99.73 334,095,500	100.00 335,000,000	0.1 2027/9/20	0.62
28	第１５３回　利付国債（５年） 日本	国債証券	335,000,000	99.46 333,191,000	99.72 334,075,400	0.005 2027/6/20	0.62
29	第３４６回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	333,000,000	100.19 333,632,700	100.12 333,422,910	0.1 2027/3/20	0.62
30	第３４４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	322,000,000	100.15 322,483,000	100.16 322,521,640	0.1 2026/9/20	0.60

（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12月29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	79.69
		特殊債券	8.52
		地方債証券	5.96
		社債券	4.84
	小計		99.02
	外国	社債券	0.18
	小計		0.18
合　計（対純資産総額比）			99.20

（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。

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ　マザーファンド

2023年12月29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	3,681,906,800	95.45 3,514,439,907	97.01 3,571,854,605	2 2025/2/15	3.20
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,567,123,000	94.06 2,414,835,261	96.16 2,468,648,161	2 2025/8/15	2.21
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,354,378,000	95.13 2,239,905,022	96.75 2,278,025,521	2.125 2025/5/15	2.04

4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,262,188,500	94.12 2,129,204,973	96.24 2,177,175,456	2.25 2025/11/15	1.95
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,926,051,400	91.64 1,765,047,714	94.28 1,815,900,520	1.625 2026/5/15	1.63
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,733,162,600	93.99 1,629,142,403	95.54 1,656,036,864	2.75 2028/2/15	1.49
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,747,345,600	91.98 1,607,296,298	94.68 1,654,509,128	1.625 2026/2/15	1.48
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,714,724,700	93.46 1,602,672,643	95.67 1,640,494,267	2.875 2028/8/15	1.47
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,741,672,400	90.76 1,580,822,994	93.51 1,628,724,944	1.5 2026/8/15	1.46
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,587,077,700	93.97 1,491,454,134	95.84 1,521,166,363	2.875 2028/5/15	1.36
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,608,352,200	91.47 1,471,220,545	93.96 1,511,272,061	2.25 2027/11/15	1.36
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,439,574,500	91.72 1,320,464,105	94.24 1,356,741,383	2.25 2027/8/15	1.22
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,340,293,500	92.32 1,237,466,182	94.86 1,271,496,234	2.25 2027/2/15	1.14
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,341,711,800	91.73 1,230,805,902	94.46 1,267,488,303	2 2026/11/15	1.14
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,311,927,500	94.40 1,238,549,884	96.59 1,267,230,130	3.125 2028/11/15	1.14
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,331,783,700	91.07 1,212,870,706	91.80 1,222,630,707	2.75 2032/8/15	1.10
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,276,470,000	92.45 1,180,185,867	94.92 1,211,638,088	2.375 2027/5/15	1.09
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,256,613,800	81.18 1,020,220,661	83.56 1,050,051,623	1.125 2031/2/15	0.94
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,238,175,900	83.95 1,039,479,847	82.54 1,022,114,205	3 2052/8/15	0.92
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,016,921,100	91.87 934,318,379	94.15 957,451,554	2.625 2029/2/15	0.86
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,102,019,100	84.50 931,226,265	86.15 949,499,656	1.875 2032/2/15	0.85
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,113,365,500	80.95 901,281,002	82.90 923,091,336	1.25 2031/8/15	0.83
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,374,332,700	67.46 927,149,502	65.94 906,303,699	2 2051/8/15	0.81
24	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	912,867,200	92.28 842,459,961	96.96 885,152,551	2 2028/2/1	0.79
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,060,888,400	78.93 837,378,680	81.17 861,133,723	0.625 2030/8/15	0.77
26	FRANCE (GOVT OF) フランス	国債証券	927,008,000	85.89 796,273,193	91.62 849,380,350	0.5 2029/5/25	0.76
27	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	857,875,200	96.23 825,559,873	97.95 840,331,652	1.5 2025/6/1	0.75
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,021,176,000	79.56 812,519,808	82.25 839,917,260	0.875 2030/11/15	0.75

29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	872,254,500	90.35 788,140,091	92.72 808,771,817	2.375 2029/5/15	0.73
30	WI TREASURY SEC. アメリカ	国債証券	985,718,500	80.49 793,409,501	81.78 806,130,446	0.625 2030/5/15	0.72

（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12月29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	95.72
	小計		95.72
合　計（対純資産総額比）			95.72

（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12月29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	1,639,554,800	96.28 1,578,573,573	97.01 1,590,548,507	2 2025/2/15	2.20
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,114,783,800	95.04 1,059,512,819	96.24 1,072,890,224	2.25 2025/11/15	1.48
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,093,509,300	95.80 1,047,625,649	96.75 1,058,046,793	2.125 2025/5/15	1.46
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,058,051,800	93.34 987,617,291	94.68 1,001,837,507	1.625 2026/2/15	1.38
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	978,627,000	93.13 911,493,187	95.67 936,262,237	2.875 2028/8/15	1.29
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	975,790,400	92.77 905,270,027	94.28 919,984,947	1.625 2026/5/15	1.27
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	977,208,700	91.88 897,957,074	93.51 913,836,715	1.5 2026/8/15	1.26
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	850,980,000	95.08 809,149,907	96.16 818,336,407	2 2025/8/15	1.13
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	863,744,700	91.74 792,485,762	93.96 811,609,069	2.25 2027/11/15	1.12
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	843,888,500	93.44 788,551,043	95.84 808,841,810	2.875 2028/5/15	1.12
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	799,921,200	93.25 745,950,516	95.54 764,324,706	2.75 2028/2/15	1.05
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	784,319,900	93.01 729,533,061	94.46 740,931,323	2 2026/11/15	1.02
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	720,496,400	92.18 664,175,196	94.24 679,039,037	2.25 2027/8/15	0.94
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	683,620,600	96.52 659,878,456	97.46 666,311,326	2.75 2025/6/30	0.92
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	650,999,700	91.33 594,571,046	94.15 612,929,237	2.625 2029/2/15	0.85
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	632,561,800	92.96 588,054,751	94.92 600,433,986	2.375 2027/5/15	0.83

17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	706,313,400	77.81 549,624,835	81.17 573,321,649	0.625 2030/8/15	0.79
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	574,411,500	89.78 515,712,388	92.72 532,605,831	2.375 2029/5/15	0.74
19	WI TREASURY SEC. アメリカ	国債証券	605,614,100	78.47 475,237,496	81.78 495,277,267	0.625 2030/5/15	0.68
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	513,424,600	93.01 477,570,784	94.86 487,070,515	2.25 2027/2/15	0.67
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	575,829,800	79.27 456,503,620	82.24 473,620,010	0.875 2030/11/15	0.65
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	537,535,700	83.96 451,336,475	87.17 468,596,746	1.5 2030/2/15	0.65
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	514,842,900	85.90 442,260,347	89.02 458,328,594	1.625 2029/8/15	0.63
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	448,182,800	96.78 433,791,650	97.48 436,924,448	2.25 2024/12/31	0.60
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	438,254,700	94.29 413,259,053	96.59 423,323,362	3.125 2028/11/15	0.58
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	453,856,000	86.07 390,652,013	89.29 405,275,253	1.75 2029/11/15	0.56
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	407,052,100	96.72 393,725,214	97.57 397,193,298	2.625 2025/3/31	0.55
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	377,267,800	97.48 367,767,601	98.48 371,548,420	3.5 2025/9/15	0.51
29	CHINA GOVERNMENT BOND 中国	国債証券	350,676,480	99.92 350,423,992	100.09 351,002,609	2.3 2026/5/15	0.48
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	365,921,400	94.45 345,623,739	95.85 350,768,594	2.25 2026/3/31	0.48

（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。

種類別及び業種別投資比率

2023年12月29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	98.87
	小計		98.87
合　計（対純資産総額比）			98.87

（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。

ニッセイ新興国債券インデックス　マザーファンド

2023年12月29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	85,098,000	87.06 74,092,275	97.51 82,979,910	4.817 2049/3/14	2.51
2	HUNGARY ハンガリー	国債証券	56,732,000	101.28 57,461,573	104.21 59,123,253	6.125 2028/5/22	1.79
3	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	56,732,000	95.53 54,198,348	99.98 56,721,788	6 2033/10/20	1.71
4	STATE OF QATAR カタール	国債証券	56,732,000	97.58 55,362,489	99.33 56,355,299	4 2029/3/14	1.70

5	DOMINICAN REPUBLIC ドミニカ共和国	国債証券	63,823,500	76.17 48,614,998	86.99 55,525,806	5.875 2060/1/30	1.68
6	STATE OF QATAR カタール	国債証券	56,732,000	93.92 53,283,261	97.74 55,453,260	3.75 2030/4/16	1.68
7	ABU DHABI GOVT INT'L アラブ首長国連邦	国債証券	56,732,000	92.52 52,493,835	94.34 53,521,536	3.125 2030/4/16	1.62
8	CHINA GOVT INTL BOND 中国	国債証券	56,732,000	91.95 52,165,074	93.25 52,907,695	0.55 2025/10/21	1.60
9	STATE OF QATAR カタール	国債証券	56,732,000	82.32 46,702,917	92.35 52,397,107	4.4 2050/4/16	1.58
10	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	56,732,000	87.72 49,767,012	91.47 51,896,164	3.875 2030/6/12	1.57
11	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	56,732,000	80.21 45,507,573	84.64 48,022,503	2.659 2031/5/24	1.45
12	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券	56,732,000	75.63 42,911,233	81.37 46,167,366	3.125 2031/4/15	1.39
13	REPUBLICA ORIENT URUGUAY ウルグアイ	国債証券	42,549,000	106.00 45,101,940	108.29 46,078,439	5.75 2034/10/28	1.39
14	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証券	56,732,000	70.33 39,903,019	79.87 45,317,521	5.75 2049/9/30	1.37
15	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	56,732,000	70.34 39,908,125	77.03 43,704,063	4.75 2050/1/14	1.32
16	DOMINICAN REPUBLIC ドミニカ共和国	国債証券	42,549,000	92.72 39,452,709	97.72 41,581,861	5.5 2029/2/22	1.26
17	REPUBLIC OF PERU ペルー	国債証券	46,803,900	82.62 38,671,722	87.02 40,733,434	2.783 2031/1/23	1.23
18	DOMINICAN REPUBLIC ドミニカ共和国	国債証券	42,549,000	83.62 35,583,303	91.06 38,746,821	4.875 2032/9/23	1.17
19	REPUBLIC OF PANAMA パナマ	国債証券	56,732,000	62.11 35,238,514	67.14 38,091,566	4.5 2056/4/1	1.15
20	REPUBLIC OF PERU ペルー	国債証券	36,875,800	78.18 28,832,081	84.45 31,144,931	3 2034/1/15	0.94
21	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券	28,366,000	101.23 28,715,469	108.96 30,909,579	8 2033/4/20	0.93
22	ROMANIA ルーマニア	国債証券	28,366,000	102.57 29,096,708	108.12 30,672,155	7.125 2033/1/17	0.93
23	HUNGARY ハンガリー	国債証券	28,366,000	99.85 28,325,152	107.12 30,385,942	6.25 2032/9/22	0.92
24	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証券	28,366,000	102.10 28,964,522	106.65 30,255,175	5.5 2032/10/25	0.91
25	UAE INT'L GOVT BOND アラブ首長国連邦	国債証券	28,366,000	100.16 28,413,938	105.44 29,910,245	4.917 2033/9/25	0.90
26	OMAN GOV INTERNTL BOND オマーン	国債証券	28,366,000	100.35 28,467,550	105.35 29,883,864	6.25 2031/1/25	0.90
27	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証券	28,366,000	97.07 27,536,010	105.32 29,877,340	7.5 2034/2/2	0.90
28	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証券	28,366,000	99.10 28,110,989	105.06 29,803,021	6.35 2035/2/9	0.90
29	KSA SUKUK LTD ケイマン諸島	特殊債券	28,366,000	101.22 28,713,483	103.96 29,489,577	5.268 2028/10/25	0.89

30	OMAN GOV INTERNTL BOND オマーン	国債証券	28,366,000	99.64 28,265,017	103.82 29,449,864	6 2029/8/1	0.89

（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12月29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	92.49
		特殊債券	4.13
	小計		96.62
合　計（対純資産総額比）			96.62

（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12月29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	3,447	606,041.84 2,089,026,225	611,000.00 2,106,117,000	－ －	6.84
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,035	556,049.54 1,687,610,371	584,000.00 1,772,440,000	－ －	5.76
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	9,555	168,007.82 1,605,314,788	165,000.00 1,576,575,000	－ －	5.12
4	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	14,162	97,812.08 1,385,214,741	101,900.00 1,443,107,800	－ －	4.69
5	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	9,980	136,610.84 1,363,376,203	140,500.00 1,402,190,000	－ －	4.55
6	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	5,147	271,813.99 1,399,026,646	271,400.00 1,396,895,800	－ －	4.54
7	ＫＤＸ不動産投資法人 日本	投資証券	8,503	160,022.71 1,360,673,147	160,800.00 1,367,282,400	－ －	4.44
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,454	272,411.41 1,213,320,421	251,700.00 1,121,071,800	－ －	3.64
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	5,887	169,712.19 999,095,710	166,500.00 980,185,500	－ －	3.18
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	6,609	149,810.83 990,099,812	144,100.00 952,356,900	－ －	3.09
11	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,899	324,528.27 940,807,472	316,000.00 916,084,000	－ －	2.97
12	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	14,306	57,511.99 822,766,622	61,000.00 872,666,000	－ －	2.83
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,021	346,037.20 699,341,186	350,000.00 707,350,000	－ －	2.30
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	8,878	77,605.74 688,983,820	77,100.00 684,493,800	－ －	2.22
15	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	9,891	67,413.03 666,782,358	69,200.00 684,457,200	－ －	2.22

16	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,508	134,613.22 606,836,414	139,600.00 629,316,800	－ －	2.04
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,020	609,033.79 621,214,468	604,000.00 616,080,000	－ －	2.00
18	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,550	399,046.10 618,521,463	388,500.00 602,175,000	－ －	1.96
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,777	150,301.90 567,690,309	152,000.00 574,104,000	－ －	1.86
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	1,229	467,514.11 574,574,852	457,500.00 562,267,500	－ －	1.83
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,893	284,513.89 538,584,800	286,000.00 541,398,000	－ －	1.76
22	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,624	141,906.80 514,270,251	141,400.00 512,433,600	－ －	1.66
23	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,474	138,707.41 481,869,565	140,200.00 487,054,800	－ －	1.58
24	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,096	451,018.08 494,315,822	433,000.00 474,568,000	－ －	1.54
25	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,453	316,011.63 459,164,911	317,000.00 460,601,000	－ －	1.50
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	4,351	107,805.82 469,063,164	104,300.00 453,809,300	－ －	1.47
27	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	5,695	73,200.73 416,878,159	72,500.00 412,887,500	－ －	1.34
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,764	150,909.76 417,114,585	149,200.00 412,388,800	－ －	1.34
29	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	612	652,061.01 399,061,340	665,000.00 406,980,000	－ －	1.32
30	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	1,020	377,019.14 384,559,526	374,500.00 381,990,000	－ －	1.24

（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12月29日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
投資証券	国内		98.71
	小計		98.71
合　計（対純資産総額比）			98.71

（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12月29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	46,785	15,683.94 733,773,233	19,173.99 897,055,482	－ －	8.54
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	4,752	110,038.66 522,903,745	115,462.38 548,677,252	－ －	5.22
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	27,992	12,444.68 348,351,655	12,929.22 361,914,804	－ －	3.44
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	8,013	36,652.66 293,697,818	43,655.27 349,809,710	－ －	3.33
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	16,486	17,328.78 285,682,400	20,463.23 337,356,849	－ －	3.21
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	36,661	7,528.02 275,985,009	8,308.40 304,594,303	－ －	2.90
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	15,331	19,086.81 292,619,911	19,305.89 295,978,746	－ －	2.82
8	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	10,751	18,259.74 196,310,484	22,999.15 247,263,891	－ －	2.35
9	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	52,322	4,068.13 212,853,190	4,564.08 238,802,285	－ －	2.27
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	87,174	2,245.71 195,767,649	2,443.85 213,040,824	－ －	2.03
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	7,161	24,043.31 172,174,182	26,890.96 192,566,221	－ －	1.83
12	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	17,435	7,885.66 137,486,528	8,864.37 154,550,378	－ －	1.47
13	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	14,874	8,851.30 131,654,315	10,013.19 148,936,307	－ －	1.42
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	20,307	6,334.06 128,625,817	7,226.23 146,743,225	－ －	1.40
15	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	7,995	14,800.45 118,329,645	18,281.88 146,163,686	－ －	1.39
16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	29,076	4,755.82 138,280,264	4,921.50 143,097,563	－ －	1.36
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	6,315	17,446.62 110,175,468	19,165.48 121,030,056	－ －	1.15
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	3,253	30,026.24 97,675,382	35,847.53 116,612,023	－ －	1.11
19	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	5,906	17,266.80 101,977,759	19,366.88 114,380,831	－ －	1.09
20	LINK REIT 香港	投資証券	129,900	723.76 94,017,262	795.87 103,384,487	－ －	0.98
21	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	10,942	8,067.93 88,279,357	9,315.39 101,929,045	－ －	0.97
22	SEGRO PLC イギリス	投資証券	62,485	1,488.86 93,032,007	1,621.06 101,291,994	－ －	0.96

23	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証券	36,243	2,455.38 88,990,650	2,789.79 101,110,580	－ －	0.96
24	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証券	31,386	2,676.35 84,000,042	3,091.89 97,042,185	－ －	0.92
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	9,392	9,867.96 92,679,908	10,157.86 95,402,664	－ －	0.91
26	GAMING AND LEISURE PROPERTIE アメリカ	投資証券	13,441	6,448.87 86,679,376	7,044.69 94,687,760	－ －	0.90
27	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN アメリカ	投資証券	10,602	6,695.01 70,980,497	8,081.47 85,679,780	－ －	0.82
28	UDR INC アメリカ	投資証券	15,513	4,671.01 72,461,481	5,498.74 85,302,094	－ －	0.81
29	AMERICAN HOMES 4 RENT- A アメリカ	投資証券	16,061	5,121.04 82,249,091	5,148.42 82,688,918	－ －	0.79
30	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	27,783	2,347.92 65,232,477	2,862.12 79,518,541	－ －	0.76

（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12月29日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
投資証券	外国		95.20
	小計		95.20
合　計（対純資産総額比）			95.20

（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。

②【投資不動産物件】

ＦＷニッセイ国内株インデックス
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
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
該当事項はありません。

ＦＷニッセイ国内債インデックス
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）
該当事項はありません。

ＦＷニッセイ外国債インデックス
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
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
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
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－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【その他投資資産の主要なもの】

ＦＷニッセイ国内株インデックス
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
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
該当事項はありません。

ＦＷニッセイ国内債インデックス
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）
該当事項はありません。

ＦＷニッセイ外国債インデックス
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
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
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
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12月29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　０６０３月	買建	236	5,541,624,800	5,583,760,000	2.76

（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12月29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 202403	買建	379	12,609,753,207	12,987,534,431	1.56
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 202403	買建	448	3,229,750,235	3,199,214,592	0.38
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE 202403	買建	91	1,248,250,003	1,273,505,815	0.15

（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12月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	ＮＹＳＥ ＬＩＦＦＥ　ＵＳ	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202403	買建	98	692,285,845	717,692,420	7.50

（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

2023年12月29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	シカゴオプション取引所	DOW JONES U.S. REAL ESTATE INDEX FUTURES 202403	買建	81	394,610,588	413,806,044	3.94
	ＥＵＲＥＸ取引所	THE STOXX 600 REAL ESTATE INDEX FUTURE 202403	買建	52	53,433,998	55,312,524	0.53

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（３）【運用実績】
①【純資産の推移】

ＦＷニッセイ国内株インデックス

直近日（2023年12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
第2計算期間末(2023年12月11日)	156,316,990	156,316,990	1.2661	1.2661
2022年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	－
7月末日	124,212,649	－	1.2363	－
8月末日	134,502,692	－	1.2412	－
9月末日	138,750,661	－	1.2474	－
10月末日	145,285,542	－	1.2099	－
11月末日	155,961,257	－	1.2749	－
12月末日	155,254,267	－	1.2719	－

ＦＷニッセイ先進国株インデックス

直近日（2023年12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
第2計算期間末(2023年12月11日)	208,179,029	208,179,029	1.2882	1.2882
2022年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	－
7月末日	160,449,254	－	1.2456	－
8月末日	178,394,566	－	1.2669	－
9月末日	180,406,276	－	1.2360	－
10月末日	187,728,911	－	1.1942	－
11月末日	203,623,461	－	1.2876	－
12月末日	209,230,087	－	1.3101	－

ＦＷニッセイ新興国株インデックス

直近日（2023年12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
第2計算期間末(2023年12月11日)	13,075,008	13,075,008	1.0657	1.0657
2022年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	－
7月末日	11,213,110	－	1.1032	－
8月末日	12,089,076	－	1.0864	－
9月末日	12,704,496	－	1.0631	－
10月末日	12,511,843	－	1.0365	－
11月末日	13,449,366	－	1.0886	－
12月末日	13,408,070	－	1.0936	－

ＦＷニッセイ国内債インデックス

直近日（2023年12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
第2計算期間末(2023年12月11日)	39,749,321	39,749,321	0.9374	0.9374
2022年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	－
7月末日	36,624,166	－	0.9544	－
8月末日	38,022,718	－	0.9475	－
9月末日	41,158,800	－	0.9404	－
10月末日	41,235,809	－	0.9252	－
11月末日	40,749,985	－	0.9448	－
12月末日	39,465,271	－	0.9485	－

ＦＷ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12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
第2計算期間末(2023年12月11日)	31,485,565	31,485,565	0.8055	0.8055
2022年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	－
7月末日	24,590,271	－	0.8113	－
8月末日	26,486,264	－	0.8052	－
9月末日	28,210,897	－	0.7826	－
10月末日	30,054,693	－	0.7787	－
11月末日	30,855,653	－	0.8009	－
12月末日	31,293,798	－	0.8231	－

ＦＷニッセイ外国債インデックス

直近日（2023年12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
第2計算期間末(2023年12月11日)	61,064,272	61,064,272	1.0712	1.0712
2022年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	－
7月末日	46,836,108	－	1.0371	－
8月末日	52,129,317	－	1.0656	－
9月末日	54,097,582	－	1.0489	－
10月末日	58,503,789	－	1.0481	－
11月末日	60,247,935	－	1.0842	－
12月末日	60,421,927	－	1.0853	－

ＦＷニッセイ新興国債インデックス

直近日（2023年12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
第2計算期間末(2023年12月11日)	49,107,539	49,107,539	1.0284	1.0284
2022年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	－
7月末日	37,285,723	－	0.9939	－
8月末日	41,269,445	－	1.0155	－
9月末日	42,427,357	－	0.9942	－
10月末日	45,549,382	－	0.9760	－
11月末日	47,505,726	－	1.0254	－
12月末日	48,400,173	－	1.0394	－

ＦＷニッセイ国内リートインデックス

直近日（2023年12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
第2計算期間末(2023年12月11日)	9,755,640	9,755,640	0.9696	0.9696
2022年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	－
7月末日	8,354,939	－	0.9864	－
8月末日	8,939,699	－	1.0006	－
9月末日	9,321,344	－	0.9849	－
10月末日	9,623,414	－	0.9646	－
11月末日	9,907,540	－	0.9828	－
12月末日	9,526,284	－	0.9667	－

ＦＷニッセイ先進国リートインデックス

直近日（2023年12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
第2計算期間末(2023年12月11日)	16,318,793	16,318,793	1.0683	1.0683
2022年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	－
7月末日	11,973,103	－	1.0508	－
8月末日	13,168,586	－	1.0661	－
9月末日	13,060,241	－	1.0054	－
10月末日	13,807,390	－	0.9468	－
11月末日	15,265,819	－	1.0459	－
12月末日	16,730,361	－	1.1297	－

②【分配の推移】

ＦＷ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
第2計算期間	0.0000

ＦＷ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
第2計算期間	0.0000

ＦＷ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
第2計算期間	0.0000

ＦＷ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
第2計算期間	0.0000

ＦＷ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
第2計算期間	0.0000

ＦＷ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
第2計算期間	0.0000

ＦＷ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
第2計算期間	0.0000

ＦＷ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
第2計算期間	0.0000

ＦＷ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
第2計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

ＦＷニッセイ国内株インデックス

	収益率（%）
第1計算期間	2.8
第2計算期間	23.2

（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。）。

ＦＷ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
第2計算期間	23.8

（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。）。

ＦＷ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
第2計算期間	8.2

（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。）。

ＦＷニッセイ国内債インデックス

	収益率（%）
第1計算期間	△4.0
第2計算期間	△2.4

（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。）。

ＦＷ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
第2計算期間	△5.0

（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。）。

FWニッセイ外国債インデックス

	収益率（%）
第1計算期間	0.3
第2計算期間	6.8

（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。）。

FW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
第2計算期間	8.5

（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。）。

FW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
第2計算期間	△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。）。

FW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
第2計算期間	8.4

（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。）。

（4）【設定及び解約の実績】

FW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
第2計算期間	106,543,174	34,239,629	123,467,733

（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。

FW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
第2計算期間	142,889,264	41,662,099	161,608,366

（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。

ＦＷ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
第2計算期間	9,203,729	4,105,474	12,269,055

（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。

ＦＷ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
第2計算期間	40,682,519	26,783,101	42,401,887

（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。

ＦＷ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
第2計算期間	42,017,468	13,830,598	39,089,475

（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。

ＦＷ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
第2計算期間	49,101,514	13,963,459	57,007,244

（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。

ＦＷ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
第2計算期間	45,163,345	10,676,853	47,751,310

（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。

ＦＷ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
第2計算期間	9,220,199	1,930,015	10,061,865

（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。

ＦＷ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
第2計算期間	13,970,820	3,642,742	15,275,540

（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12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	12,719円
純資産総額	155百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023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。

●組入上位業種(マザーファンド)

	業種	比率
1	電気機器	17.5%
2	輸送用機器	8.2%
3	情報・通信業	7.7%
4	卸売業	7.0%
5	銀行業	6.9%
6	化学	6.2%
7	機械	5.3%
8	サービス業	5.0%
9	医薬品	4.6%
10	小売業	4.3%

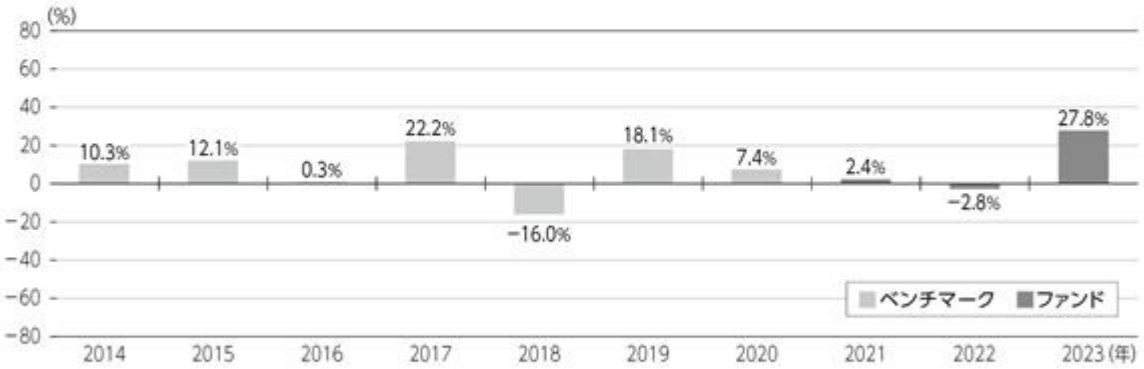
・比率は対組入株式評価額比です。

●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	4.2%
2	ソニーグループ	2.8%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.2%
4	キーエンス	1.8%
5	信越化学工業	1.6%
6	東京エレクトロン	1.6%
7	日本電信電話	1.5%
8	日立製作所	1.5%
9	三井住友フィナンシャルグループ	1.4%
10	三菱商事	1.4%

・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12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	13,101円
純資産総額	209百万円

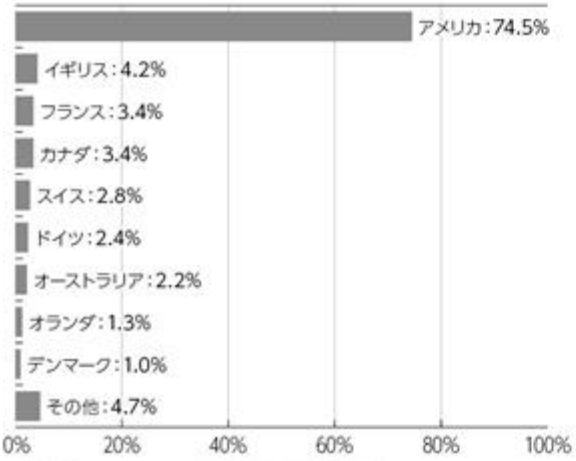
●分配の推移　1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

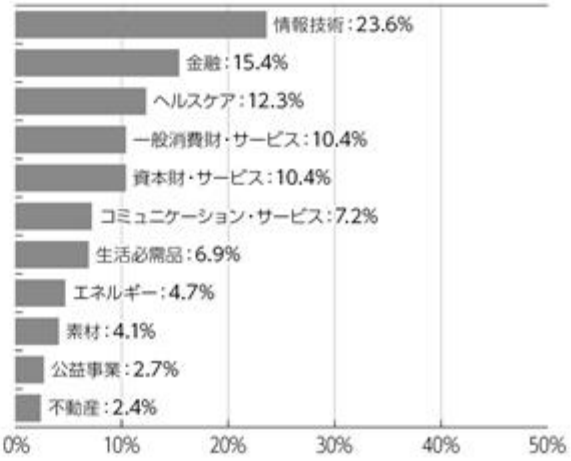
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●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12月末現在

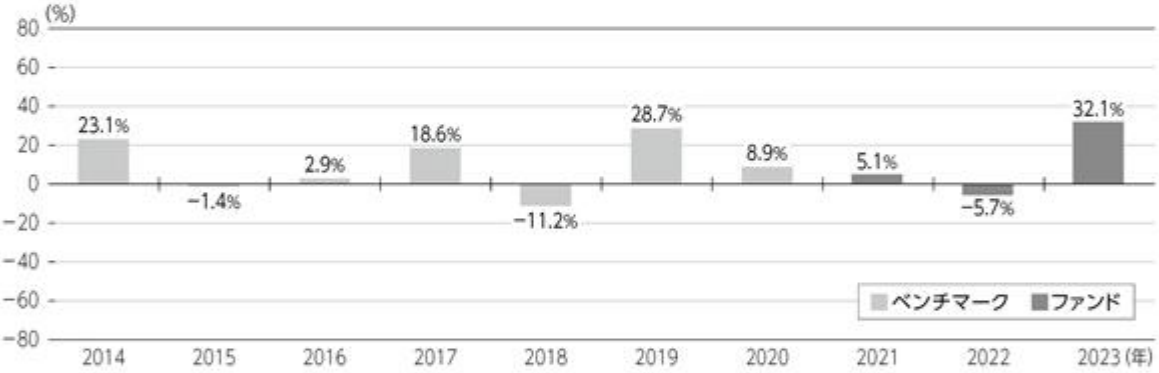
3.運用実績

●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	5.3%
2	マイクロソフト	情報技術	4.7%
3	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.5%
4	エヌビディア	情報技術	2.2%
5	アルファベット(A)	コミュニケーション・サービス	1.5%
6	メタ・プラットフォームズ	コミュニケーション・サービス	1.4%
7	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.3%
8	テスラ	一般消費財・サービス	1.3%
9	ブロードコム	情報技術	0.9%
10	JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	金融	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。
・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12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	10,936円
純資産総額	13百万円

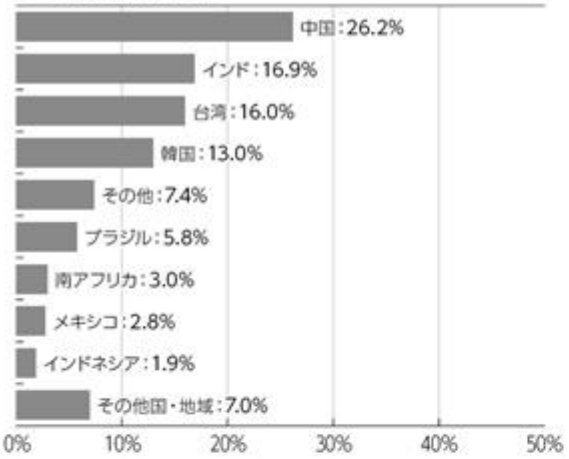
●分配の推移　1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

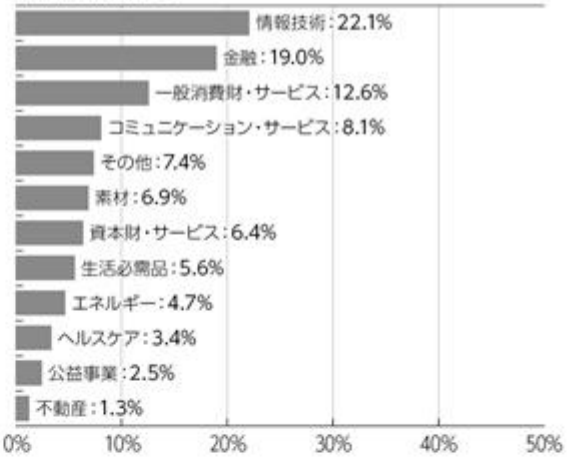
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●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。

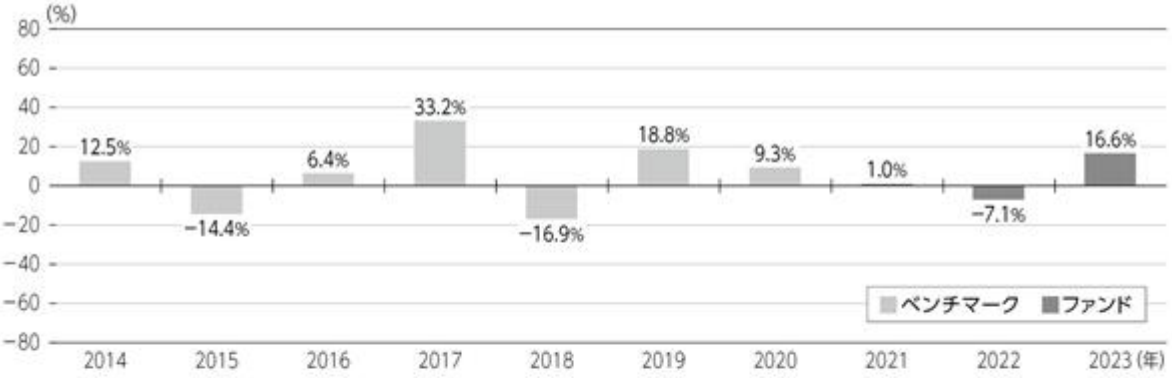
2023年12月末現在

●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	4.3%
3	サムスン電子	情報技術	4.1%
4	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	3.6%
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	2.3%
6	リライアンス・インダストリーズ	エネルギー	1.4%
7	iシェアーズMSCI　UAEキャップトETF	その他	1.4%
8	PDDホールディングス	一般消費財・サービス	1.2%
9	iシェアーズMSCIカタールETF	その他	1.0%
10	ICICI銀行	金融	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12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	9,485円
純資産総額	39百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023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	99.2%
債券先物	−
現金、その他	0.8%

・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340回 利付国債(10年)	国債	2025/09/20	0.400%	0.9%
2	第145回 利付国債(5年)	国債	2025/09/20	0.100%	0.9%
3	第370回 利付国債(10年)	国債	2033/03/20	0.500%	0.9%
4	第149回 利付国債(5年)	国債	2026/09/20	0.005%	0.8%
5	第339回 利付国債(10年)	国債	2025/06/20	0.400%	0.8%
6	第341回 利付国債(10年)	国債	2025/12/20	0.300%	0.8%
7	第369回 利付国債(10年)	国債	2032/12/20	0.500%	0.8%
8	第350回 利付国債(10年)	国債	2028/03/20	0.100%	0.8%
9	第150回 利付国債(5年)	国債	2026/12/20	0.005%	0.8%
10	第144回 利付国債(5年)	国債	2025/06/20	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。

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。

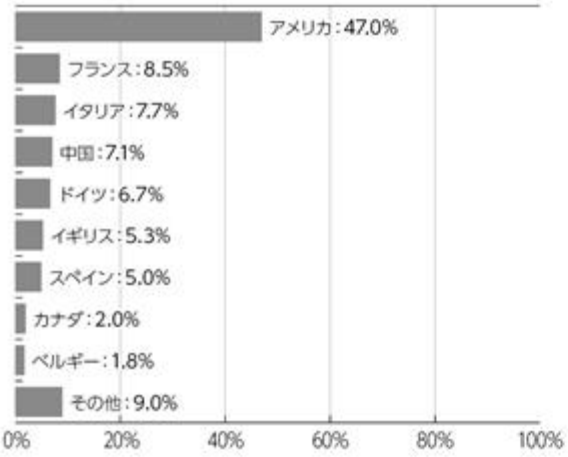
基準価額	8,231円
純資産総額	31百万円

●分配の推移　1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

●主要な資産の状況(マザーファンド)

国・地域別組入比率



・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

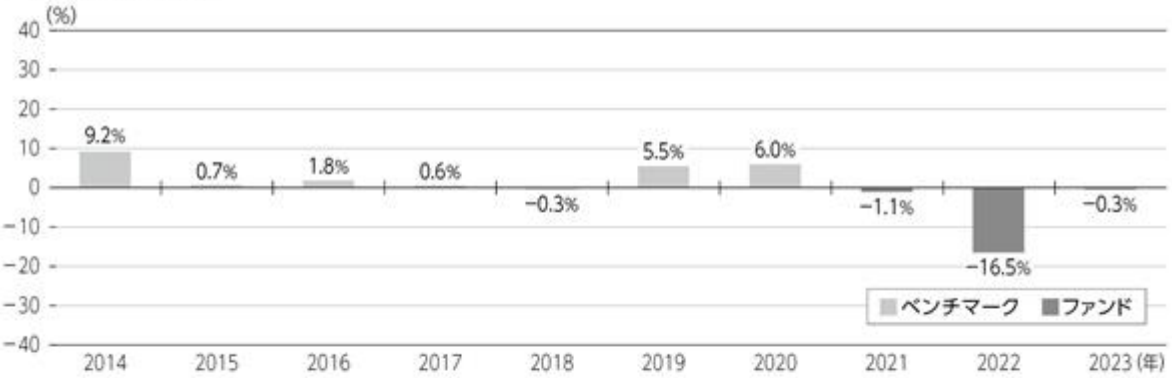
2023年12月末現在

●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	アメリカドル	2025/02/15	2.000%	3.3%
2	アメリカ国債	アメリカドル	2025/08/15	2.000%	2.3%
3	アメリカ国債	アメリカドル	2025/05/15	2.125%	2.1%
4	アメリカ国債	アメリカドル	2025/11/15	2.250%	2.0%
5	アメリカ国債	アメリカドル	2026/05/15	1.625%	1.7%
6	アメリカ国債	アメリカドル	2028/02/15	2.750%	1.6%
7	アメリカ国債	アメリカドル	2026/02/15	1.625%	1.6%
8	アメリカ国債	アメリカドル	2028/08/15	2.875%	1.5%
9	アメリカ国債	アメリカドル	2026/08/15	1.500%	1.5%
10	アメリカ国債	アメリカドル	2028/05/15	2.875%	1.4%

・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12月末現在

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	10,853円
純資産総額	60百万円

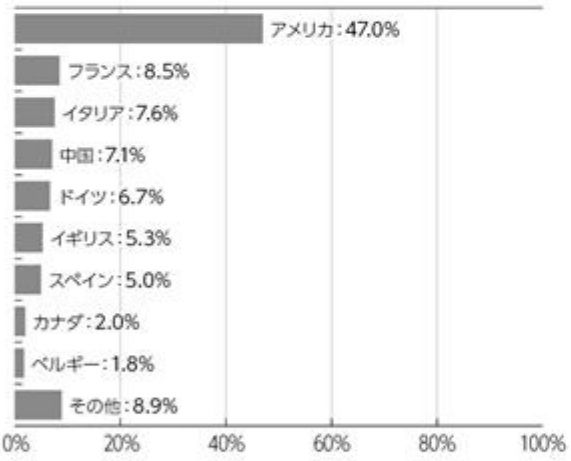
●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

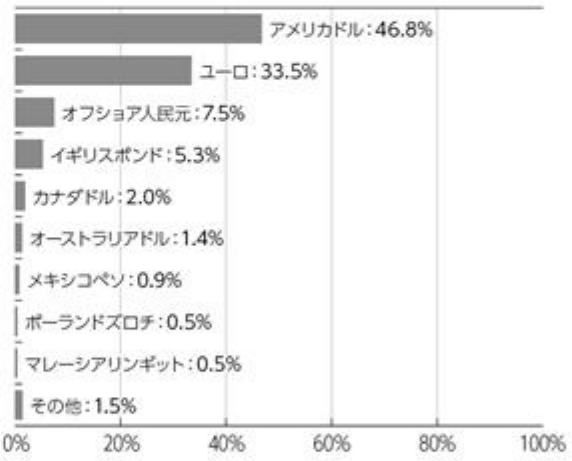
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●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

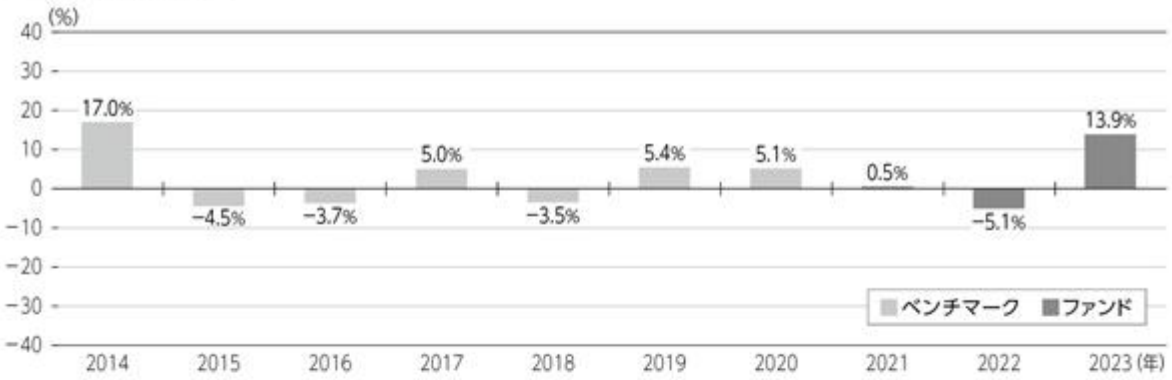
2023年12月末現在

●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	アメリカドル	2025/02/15	2.000%	2.2%
2	アメリカ国債	アメリカドル	2025/11/15	2.250%	1.5%
3	アメリカ国債	アメリカドル	2025/05/15	2.125%	1.5%
4	アメリカ国債	アメリカドル	2026/02/15	1.625%	1.4%
5	アメリカ国債	アメリカドル	2028/08/15	2.875%	1.3%
6	アメリカ国債	アメリカドル	2026/05/15	1.625%	1.3%
7	アメリカ国債	アメリカドル	2026/08/15	1.500%	1.3%
8	アメリカ国債	アメリカドル	2025/08/15	2.000%	1.1%
9	アメリカ国債	アメリカドル	2027/11/15	2.250%	1.1%
10	アメリカ国債	アメリカドル	2028/05/15	2.875%	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。

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	10,394円
純資産総額	48百万円

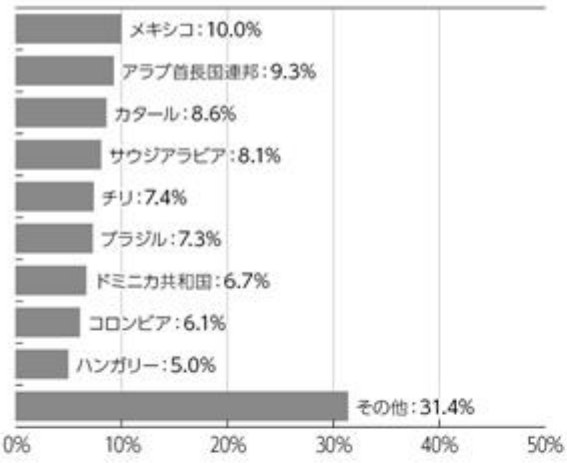
●分配の推移　1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

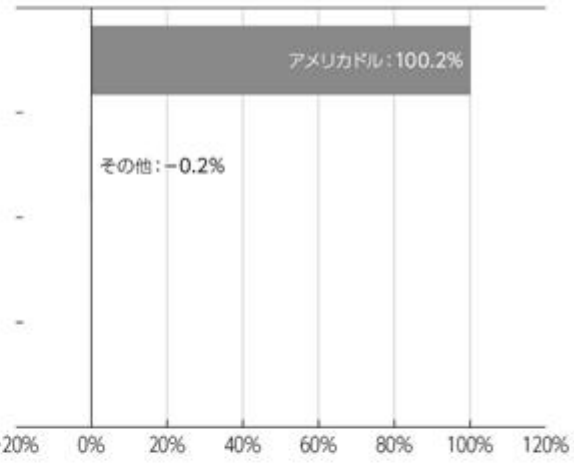
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●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

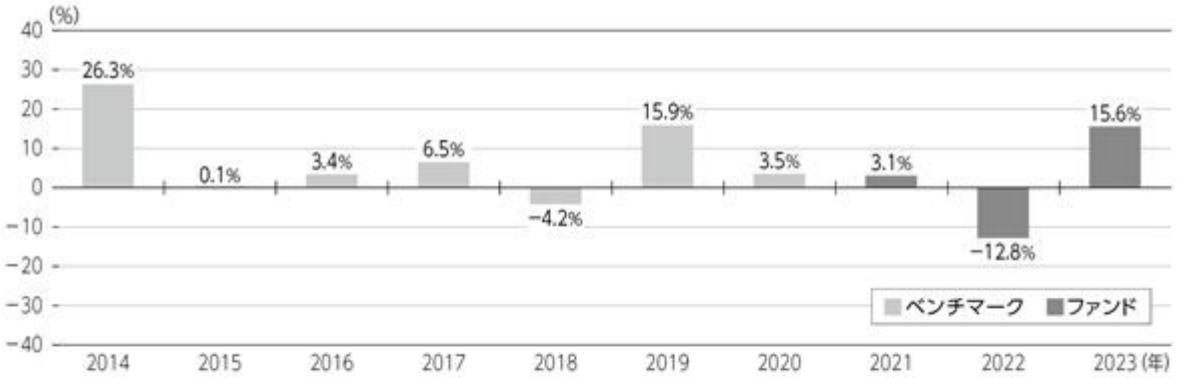
2023年12月末現在

●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	アメリカドル	2049/03/14	4.817%	2.6%
2	ハンガリー国債	アメリカドル	2028/05/22	6.125%	1.8%
3	ブラジル国債	アメリカドル	2033/10/20	6.000%	1.8%
4	カタール国債	アメリカドル	2029/03/14	4.000%	1.8%
5	ドミニカ共和国国債	アメリカドル	2060/01/30	5.875%	1.7%
6	カタール国債	アメリカドル	2030/04/16	3.750%	1.7%
7	アラブ首長国連邦国債	アメリカドル	2030/04/16	3.125%	1.7%
8	中国国債	アメリカドル	2025/10/21	0.550%	1.7%
9	カタール国債	アメリカドル	2050/04/16	4.400%	1.6%
10	ブラジル国債	アメリカドル	2030/06/12	3.875%	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。

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	9,667円
純資産総額	952万円

●分配の推移　1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023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)

不動産投資信託証券	98.7%
短期金融資産等	1.3%

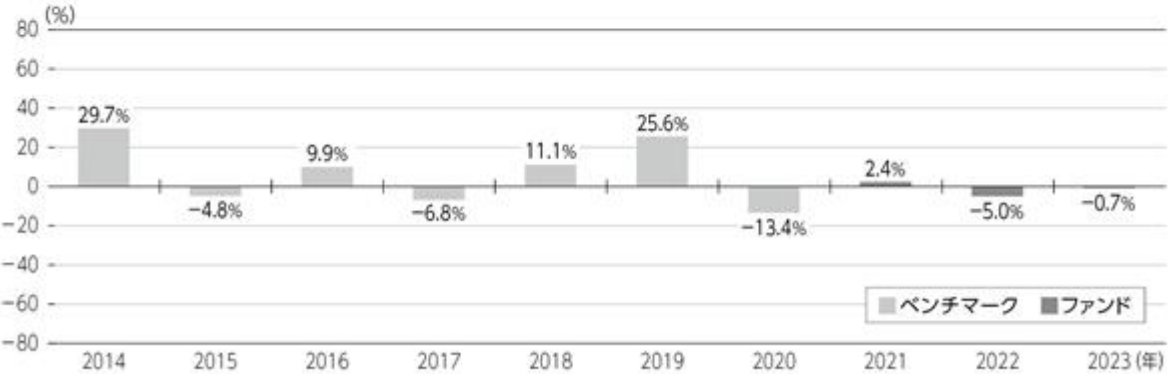
・比率は対純資産総額比です。

●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	6.9%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.8%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.2%
4	日本都市ファンド投資法人	4.7%
5	GLP投資法人	4.6%
6	日本プロロジスリート投資法人	4.6%
7	KDX不動産投資法人	4.5%
8	大和ハウスリート投資法人	3.7%
9	オリックス不動産投資法人	3.2%
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12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	11,297円
純資産総額	16百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

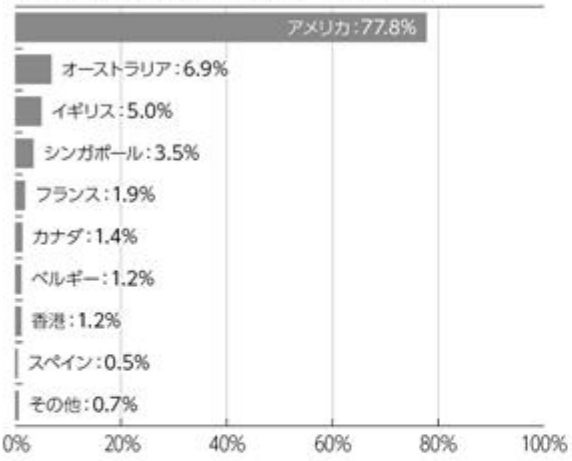
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産別投資比率(マザーファンド)

不動産投資信託証券	95.2%
現金、その他	4.8%

・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。

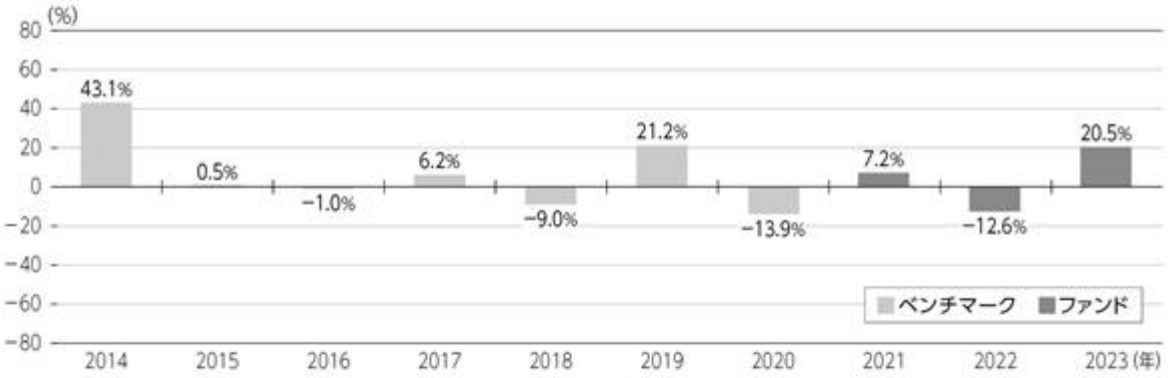
2023年12月末現在

●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	9.0%
2	EQUINIX INC	アメリカ	5.5%
3	WELLTOWER INC	アメリカ	3.6%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.5%
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.4%
6	REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.0%
7	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.0%
8	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	2.5%
9	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	2.4%
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	2.1%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入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】

①　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。

○　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。

②　取扱コース

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

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

③　申込単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　申込価額（発行価額）

「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）。

⑤　販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、「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。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　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。

⑧　その他

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

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

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

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

２【換金（解約）手続等】

①　換金受付

「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。

② 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の２つの方法があります。

③ 換金単位

各販売会社が定める単位とします。

○ 販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④ 換金価額

「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。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　その他

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

２．換金請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該中止以前に行った当日の換金請求を撤回することができます。ただし、受益者が換金請求を撤回しない場合には、当該受益権の換金価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金請求を受付けたものとして前記④の規定に準じて算出した価額とします。

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

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

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

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

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

⑤ 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

⑥ 基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、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】

①　繰上償還

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

ⅰ．受益権の口数が30億口または純資産総額が30億円を下回っている場合

ⅱ．この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

ⅲ．やむを得ない事情が発生したとき

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

３．前記２．の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該３．において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

４．前記２．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

５．前記２．から４．までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記２．から４．までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

６．委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。

７．委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「②　約款の変更等　２．」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

８．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記「②　約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。

９．償還金については、原則として償還日から起算して５営業日目（償還日が休業日の場合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。

②　約款の変更等

１．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「②　約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

２．委託会社は、前記１．の事項（前記１．の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

３．前記２．の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該３．において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。

４．前記２．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

５．書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

６．前記２．から５．までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

７．前記１．から６．までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

８．委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記１．から７．までの規定にしたがいます。

③　反対者の買取請求の不適用

ファンドは、受益者からの換金請求に対して、この信託契約の一部を解約することにより公正な価格をもって支払いに応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、前記「①　繰上償還」に規定する信託契約の解約または前記「②　約款の変更等」に規定する重大な約款の変更等を行う場合の書面決議において反対した受益者からの買取請求を受付けません。

④　公告

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

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

⑤　運用報告書の作成

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

・交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知れている受益者に交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（https://www.nam.co.jp/）に掲載します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、交付します。

⑥　信託事務処理の再信託

受託会社は、ファンドにかかる信託事務の処理の一部について、日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。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。

⑦　関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する請求権

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

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

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

（２）償還金に対する請求権

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

（３）解約請求権

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

（４）帳簿閲覧権

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

（５）書面決議における議決権

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

（６）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

第３【ファンドの経理状況】

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2期計算期間（2022年12月13日から2023年12月11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2期計算期間（2022年12月13日から2023年12月11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2期計算期間（2022年12月13日から2023年12月11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2期計算期間（2022年12月13日から2023年12月11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2期計算期間（2022年12月13日から2023年12月11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2期計算期間（2022年12月13日から2023年12月11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2期計算期間（2022年12月13日から2023年12月11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2期計算期間（2022年12月13日から2023年12月11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2期計算期間（2022年12月13日から2023年12月11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	第2期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	676	1,729
コール・ローン	21,398	188,510
親投資信託受益証券	52,584,304	156,320,749
未収入金	1,253	28,682
流動資産合計	52,607,631	156,539,670
資産合計	52,607,631	156,539,670
負債の部		
流動負債		
未払解約金	－	24,889
未払受託者報酬	1,791	14,624
未払委託者報酬	21,999	175,916
その他未払費用	818	7,251
流動負債合計	24,608	222,680
負債合計	24,608	222,680
純資産の部		
元本等		
元本	51,164,188	123,467,733
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,418,835	32,849,257
（分配準備積立金）	907,935	19,845,413
元本等合計	52,583,023	156,316,990
純資産合計	52,583,023	156,316,990
負債純資産合計	52,607,631	156,539,670

（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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	930,967	24,003,082
営業収益合計	930,967	24,003,082
営業費用		
受託者報酬	2,000	24,333
委託者報酬	24,861	293,081
その他費用	878	12,033
営業費用合計	27,739	329,447
営業利益又は営業損失（△）	903,228	23,673,635
経常利益又は経常損失（△）	903,228	23,673,635
当期純利益又は当期純損失（△）	903,228	23,673,635
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	4,455,364
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	510,900	13,892,481
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	13,892,481
剰余金減少額又は欠損金増加額	－	1,680,330
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	1,680,330
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	32,849,257

（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2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年12月11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	第2期 2023年12月11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	106,543,174円
期中一部解約元本額	616,588円	34,239,629円
２．　受益権の総数	51,164,188口	123,467,733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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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。	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（19,218,271円）、収益調整金（13,003,844円）及び分配準備積立金（627,142円）より分配対象収益は32,849,257円（1万口当たり2,660.55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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び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。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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	第2期 2023年12月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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

（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	第2期 2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	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	19,493,429
合計	934,804	19,493,429

（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	第2期 2023年12月11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)	1.2661円 (12,661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

2023年12月11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	56,117,443	156,320,749	
親投資信託受益証券　合計		56,117,443	156,320,749	
合計			156,320,749	

（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	第2期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	881	2,518
コール・ローン	27,875	274,627
親投資信託受益証券	62,824,349	208,184,564
未収入金	1,677	5,613
流動資産合計	62,854,782	208,467,322
資産合計	62,854,782	208,467,322
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	2,109	19,190
未払委託者報酬	29,065	259,574
その他未払費用	969	9,529
流動負債合計	32,143	288,293
負債合計	32,143	288,293
純資産の部		
元本等		
元本	60,381,201	161,608,366
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,441,438	46,570,663
（分配準備積立金）	－	27,199,603
元本等合計	62,822,639	208,179,029
純資産合計	62,822,639	208,179,029
負債純資産合計	62,854,782	208,467,322

（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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	△665,600	33,437,562
営業収益合計	△665,600	33,437,562
営業費用		
受託者報酬	2,311	31,642
委託者報酬	32,481	428,270
その他費用	1,029	15,682
営業費用合計	35,821	475,594
営業利益又は営業損失（△）	△701,421	32,961,968
経常利益又は経常損失（△）	△701,421	32,961,968
当期純利益又は当期純損失（△）	△701,421	32,961,968
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（△）	△11,757	5,268,834
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	3,141,697	18,781,869
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	18,781,869
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,595	2,345,778
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	2,345,778
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	46,570,663

（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2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年12月11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	第2期 2023年12月11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	142,889,264円
期中一部解約元本額	973,328円	41,662,099円
２．　受益権の総数	60,381,201口	161,608,366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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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（1万口当たり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。	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（27,199,603円）、収益調整金（19,371,060円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は46,570,663円（1万口当たり2,881.70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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び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。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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	第2期 2023年12月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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

（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	第2期 2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	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	28,093,153
合計	△654,759	28,093,153

（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	第2期 2023年12月11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)	1.2882円 (12,882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

2023年12月11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	56,052,493	208,184,564	
親投資信託受益証券　合計		56,052,493	208,184,564	
合計			208,184,564	

（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	第2期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	139	171
コール・ローン	4,411	18,659
親投資信託受益証券	7,064,208	13,075,365
未収入金	639	90,057
流動資産合計	7,069,397	13,184,252
資産合計	7,069,397	13,184,252
負債の部		
流動負債		
未払解約金	211	89,185
未払受託者報酬	304	1,257
未払委託者報酬	4,816	18,238
その他未払費用	53	564
流動負債合計	5,384	109,244
負債合計	5,384	109,244
純資産の部		
元本等		
元本	7,170,800	12,269,055
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△106,787	805,953
（分配準備積立金）	174,200	847,209
元本等合計	7,064,013	13,075,008
純資産合計	7,064,013	13,075,008
負債純資産合計	7,069,397	13,184,252

（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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	181,428	884,668
営業収益合計	181,428	884,668
営業費用		
受託者報酬	403	2,178
委託者報酬	6,660	31,799
その他費用	53	929
営業費用合計	7,116	34,906
営業利益又は営業損失（△）	174,312	849,762
経常利益又は経常損失（△）	174,312	849,762
当期純利益又は当期純損失（△）	174,312	849,762
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	111,716
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	1,048	174,694
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	70,562
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	104,132
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	805,953

（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2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年12月11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	第2期 2023年12月11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	9,203,729円
期中一部解約元本額	172,577円	4,105,474円
２．　受益権の総数	7,170,800口	12,269,055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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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。	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（738,046円）、収益調整金（188,881円）及び分配準備積立金（109,163円）より分配対象収益は1,036,090円（1万口当たり844.47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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び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。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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	第2期 2023年12月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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

（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	第2期 2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	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	767,414
合計	181,101	767,414

（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	第2期 2023年12月11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)	1.0657円 (10,657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

2023年12月11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	10,365,757	13,075,365	
親投資信託受益証券　合計		10,365,757	13,075,365	
合計			13,075,365	

（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	第2期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	200	355
コール・ローン	6,334	38,671
親投資信託受益証券	27,364,407	39,749,999
未収入金	15,650	687
流動資産合計	27,386,591	39,789,712
資産合計	27,386,591	39,789,712
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,188	－
未払受託者報酬	753	4,229
未払委託者報酬	6,426	34,103
その他未払費用	285	2,059
流動負債合計	22,652	40,391
負債合計	22,652	40,391
純資産の部		
元本等		
元本	28,502,469	42,401,887
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,138,530	△2,652,566
（分配準備積立金）	－	－
元本等合計	27,363,939	39,749,321
純資産合計	27,363,939	39,749,321
負債純資産合計	27,386,591	39,789,712

（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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	△79,264	△664,843
営業収益合計	△79,264	△664,843
営業費用		
受託者報酬	844	7,216
委託者報酬	7,460	58,278
その他費用	285	3,491
営業費用合計	8,589	68,985
営業利益又は営業損失（△）	△87,853	△733,828
経常利益又は経常損失（△）	△87,853	△733,828
当期純利益又は当期純損失（△）	△87,853	△733,828
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	△5,675
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	16,930	1,125,743
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	1,125,743
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	1,911,626
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	1,911,626
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,138,530	△2,652,566

（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2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年12月11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	第2期 2023年12月11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	40,682,519円
期中一部解約元本額	1,054,389円	26,783,101円
２．　受益権の総数	28,502,469口	42,401,887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2,652,566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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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。	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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び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。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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	第2期 2023年12月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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

（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	第2期 2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	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	△670,205
合計	△70,728	△670,205

（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	第2期 2023年12月11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)	0.9374円 (9,374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

2023年12月11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	42,949,756	39,749,999	
親投資信託受益証券　合計		42,949,756	39,749,999	
合計			39,749,999	

（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	第2期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	87	297
コール・ローン	2,763	32,438
親投資信託受益証券	9,243,528	31,486,219
未収入金	5,024	433
流動資産合計	9,251,402	31,519,387
資産合計	9,251,402	31,519,387
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,898	－
未払受託者報酬	240	2,922
未払委託者報酬	2,873	29,509
その他未払費用	52	1,391
流動負債合計	8,063	33,822
負債合計	8,063	33,822
純資産の部		
元本等		
元本	10,902,605	39,089,475
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,659,266	△7,603,910
（分配準備積立金）	－	－
元本等合計	9,243,339	31,485,565
純資産合計	9,243,339	31,485,565
負債純資産合計	9,251,402	31,519,387

（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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	△124,918	△717,322
営業収益合計	△124,918	△717,322
営業費用		
受託者報酬	246	4,752
委託者報酬	3,976	48,379
その他費用	52	2,228
営業費用合計	4,274	55,359
営業利益又は営業損失（△）	△129,192	△772,681
経常利益又は経常損失（△）	△129,192	△772,681
当期純利益又は当期純損失（△）	△129,192	△772,681
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	△171,377
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	22,866	2,226,673
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	2,226,673
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	7,570,013
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	7,570,013
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,659,266	△7,603,910

（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2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年12月11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	第2期 2023年12月11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	42,017,468円
期中一部解約元本額	689,960円	13,830,598円
２．　受益権の総数	10,902,605口	39,089,475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7,603,910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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（3,604円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は3,604円（1万口当たり0.92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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日

１． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２． 金融商品の内容及び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。	同左
３． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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	第2期 2023年12月11日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左

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

（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	第2期 2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	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	△552,910
合計	△104,226	△552,910

（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	第2期 2023年12月11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)	0.8055円 (8,055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

2023年12月11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	32,063,360	31,486,219	
親投資信託受益証券　合計		32,063,360	31,486,219	
合計			31,486,219	

（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	第2期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	239	674
コール・ローン	7,552	73,517
親投資信託受益証券	21,934,587	61,065,748
未収入金	505	1,494
流動資産合計	21,942,883	61,141,433
資産合計	21,942,883	61,141,433
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	614	5,680
未払委託者報酬	8,005	68,702
その他未払費用	214	2,779
流動負債合計	8,833	77,161
負債合計	8,833	77,161
純資産の部		
元本等		
元本	21,869,189	57,007,244
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	64,861	4,057,028
（分配準備積立金）	－	2,951,311
元本等合計	21,934,050	61,064,272
純資産合計	21,934,050	61,064,272
負債純資産合計	21,942,883	61,141,433

（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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	△191,588	3,663,036
営業収益合計	△191,588	3,663,036
営業費用		
受託者報酬	682	9,204
委託者報酬	9,534	111,598
その他費用	214	4,472
営業費用合計	10,430	125,274
営業利益又は営業損失（△）	△202,018	3,537,762
経常利益又は経常損失（△）	△202,018	3,537,762
当期純利益又は当期純損失（△）	△202,018	3,537,762
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	449,192
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	267,983	903,597
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	15,147
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	888,450
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	4,057,028

（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2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年12月11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	第2期 2023年12月11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	49,101,514円
期中一部解約元本額	602,774円	13,963,459円
２．　受益権の総数	21,869,189口	57,007,244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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（2,951,311円）、収益調整金（1,105,717円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は4,057,028円（1万口当たり711.67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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び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。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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	第2期 2023年12月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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

（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	第2期 2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	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	3,199,996
合計	△190,726	3,199,996

（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	第2期 2023年12月11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)	1.0712円 (10,712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

2023年12月11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	37,353,651	61,065,748	
親投資信託受益証券　合計		37,353,651	61,065,748	
合計			61,065,748	

（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	第2期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	153	550
コール・ローン	4,838	60,009
親投資信託受益証券	12,573,581	49,108,766
未収入金	297	1,236
流動資産合計	12,578,869	49,170,561
資産合計	12,578,869	49,170,561
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	390	4,464
未払委託者報酬	5,109	56,394
その他未払費用	104	2,164
流動負債合計	5,603	63,022
負債合計	5,603	63,022
純資産の部		
元本等		
元本	13,264,818	47,751,310
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△691,552	1,356,229
（分配準備積立金）	120,861	3,190,655
元本等合計	12,573,266	49,107,539
純資産合計	12,573,266	49,107,539
負債純資産合計	12,578,869	49,170,561

（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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	119,547	3,630,312
営業収益合計	119,547	3,630,312
営業費用		
受託者報酬	440	7,204
委託者報酬	6,543	91,086
その他費用	104	3,468
営業費用合計	7,087	101,758
営業利益又は営業損失（△）	112,460	3,528,554
経常利益又は経常損失（△）	112,460	3,528,554
当期純利益又は当期純損失（△）	112,460	3,528,554
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	426,737
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	11,077	613,112
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	613,112
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	1,667,148
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	1,667,148
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△691,552	1,356,229

（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2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年12月11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	第2期 2023年12月11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	45,163,345円
期中一部解約元本額	299,277円	10,676,853円
２．　受益権の総数	13,264,818口	47,751,310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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（3,101,817円）、収益調整金（346,255円）及び分配準備積立金（88,838円）より分配対象収益は3,536,910円（1万口当たり740.69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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び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。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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	第2期 2023年12月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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

（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	第2期 2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	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	3,191,125
合計	127,819	3,191,125

（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	第2期 2023年12月11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)	1.0284円 (10,284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

2023年12月11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	38,456,356	49,108,766	
親投資信託受益証券　合計		38,456,356	49,108,766	
合計			49,108,766	

（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	第2期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	59	114
コール・ローン	1,867	12,397
親投資信託受益証券	2,747,053	9,755,874
未収入金	428	234
流動資産合計	2,749,407	9,768,619
資産合計	2,749,407	9,768,619
負債の部		
流動負債		
未払解約金	365	－
未払受託者報酬	101	937
未払委託者報酬	1,951	11,674
その他未払費用	－	368
流動負債合計	2,417	12,979
負債合計	2,417	12,979
純資産の部		
元本等		
元本	2,771,681	10,061,865
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△24,691	△306,225
（分配準備積立金）	－	－
元本等合計	2,746,990	9,755,640
純資産合計	2,746,990	9,755,640
負債純資産合計	2,749,407	9,768,619

（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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	△20,583	8,963
営業収益合計	△20,583	8,963
営業費用		
受託者報酬	149	1,545
委託者報酬	3,236	19,460
その他費用	－	598
営業費用合計	3,385	21,603
営業利益又は営業損失（△）	△23,968	△12,640
経常利益又は経常損失（△）	△23,968	△12,640
当期純利益又は当期純損失（△）	△23,968	△12,640
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	7,778
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	41	59,251
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	41	59,251
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	320,367
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	320,367
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△24,691	△306,225

（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2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年12月11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	第2期 2023年12月11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	9,220,199円
期中一部解約元本額	68,822円	1,930,015円
２．　受益権の総数	2,771,681口	10,061,865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306,225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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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。	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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び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。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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	第2期 2023年12月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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

（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	第2期 2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	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	△1,003
合計	△18,575	△1,003

（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	第2期 2023年12月11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)	0.9696円 (9,696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

2023年12月11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	5,242,557	9,755,874	
親投資信託受益証券　合計		5,242,557	9,755,874	
合計			9,755,874	

（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	第2期 2023年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	91	184
コール・ローン	2,885	20,110
親投資信託受益証券	4,875,670	16,319,225
未収入金	123	435
流動資産合計	4,878,769	16,339,954
資産合計	4,878,769	16,339,954
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	192	1,376
未払委託者報酬	3,004	19,178
その他未払費用	32	607
流動負債合計	3,228	21,161
負債合計	3,228	21,161
純資産の部		
元本等		
元本	4,947,462	15,275,540
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△71,921	1,043,253
（分配準備積立金）	－	984,964
元本等合計	4,875,541	16,318,793
純資産合計	4,875,541	16,318,793
負債純資産合計	4,878,769	16,339,954

（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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	△77,459	1,204,893
営業収益合計	△77,459	1,204,893
営業費用		
受託者報酬	232	2,238
委託者報酬	4,580	31,284
その他費用	32	951
営業費用合計	4,844	34,473
営業利益又は営業損失（△）	△82,303	1,170,420
経常利益又は経常損失（△）	△82,303	1,170,420
当期純利益又は当期純損失（△）	△82,303	1,170,420
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	128,879
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	10,943	73,633
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	66,278
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	7,355
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	1,043,253

（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2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、2022年12月13日から2023年12月11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	第2期 2023年12月11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	13,970,820円
期中一部解約元本額	86,474円	3,642,742円
２．　受益権の総数	4,947,462口	15,275,540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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11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。	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（984,964円）、収益調整金（58,289円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,043,253円（1万口当たり682.96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	第2期 自　2022年12月13日 至　2023年12月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び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。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

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	第2期 2023年12月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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

（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	第2期 2023年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	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	1,071,510
合計	△77,774	1,071,510

（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	第2期 2023年12月11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)	1.0683円 (10,683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

2023年12月11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	10,746,938	16,319,225	
親投資信託受益証券　合計		10,746,938	16,319,225	
合計			16,319,225	

（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、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における同親投資信託の状況は以下の通りでありますが、それらは監査意見の対象外であります。

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月11日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	40,249,676
コール・ローン	4,389,070,583
株式	196,201,019,970
派生商品評価勘定	14,778,750
未収入金	11,154,458
未収配当金	116,712,608
前払金	46,375,000
差入委託証拠金	204,517,972
流動資産合計	201,023,879,017
資産合計	201,023,879,017
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,350
未払解約金	339,859,290
その他未払費用	6,918
流動負債合計	339,875,558
負債合計	339,875,558
純資産の部	
元本等	
元本	72,044,115,492
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	128,639,887,967
元本等合計	200,684,003,459
純資産合計	200,684,003,459
負債純資産合計	201,023,879,017

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12月11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12月11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	18,408,766,505円
	同期中一部解約元本額	26,972,096,878円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイＴＯＰＩＸオープン	5,368,177,024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）	3,089,119,048円
	ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	3,158,427円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,047,909,985円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,500,558,728円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	6,178,165,410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）	2,434,774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）	10,865,784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）	10,039,155円
	ＤＣニッセイ国内株式インデックス	2,802,699,869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	24,648,508,922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）	3,423,814,903円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	363,811,404円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	230,993,028円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	418,504,952円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	642,022,899円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	40,788,857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）	121,299,192円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	10,126,351円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	13,255,583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）	4,817,149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）	10,130,486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）	27,455,809円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	284,847,801円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	185,073,303円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	360,494,102円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	205,262,269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）	13,903,186,508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）	26,185,539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）	48,655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）	106,375円
	ＦＷニッセイ国内株インデックス	56,117,443円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	54,037,991円
	ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	97,767円
	計	72,044,115,492円
２．	受益権の総数	72,044,115,492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　2022年12月13日 至　2023年12月11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	2023年12月11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	2023年12月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	28,697,630,988
合計	28,697,630,988

（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（2023年2月21日から2023年12月11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	2023年12月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引 先物取引 買建	4,502,885,000	－	4,517,760,000	14,875,000
合計	4,502,885,000	－	4,517,760,000	14,875,000

（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）

	2023年12月11日現在
1口当たり純資産額	2.7856円
（1万口当たり純資産額）	(27,856円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年12月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,100	3,785.00	11,733,500	
ニッスイ	82,100	811.00	66,583,100	
マルハニチロ	12,200	2,939.50	35,861,900	
雪国まいたけ	7,000	941.00	6,587,000	
カネコ種苗	3,200	1,423.00	4,553,600	
サカタのタネ	9,300	3,915.00	36,409,500	
ホクト	6,600	1,723.00	11,371,800	
ショーボンドホールディングス	11,200	5,972.00	66,886,400	
ミライト・ワン	27,200	1,850.00	50,320,000	

タマホーム	5,200	3,570.00	18,564,000	
ファーストコーポレーション	1,300	739.00	960,700	
住石ホールディングス	8,300	1,041.00	8,640,300	
日鉄鉱業	3,300	5,220.00	17,226,000	
三井松島ホールディングス	4,900	2,836.00	13,896,400	
ＩＮＰＥＸ	303,600	1,937.00	588,073,200	
石油資源開発	9,500	5,240.00	49,780,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	3,700	2,091.00	7,736,700	
安藤・間	47,600	1,104.00	52,550,400	
東急建設	25,700	798.00	20,508,600	
コムシスホールディングス	26,200	3,218.00	84,311,600	
ビーアールホールディングス	14,900	351.00	5,229,900	
高松コンストラクショングループ	6,100	2,700.00	16,470,000	
東建コーポレーション	2,400	8,550.00	20,520,000	
ソネック	1,500	955.00	1,432,500	
ヤマウラ	4,400	1,424.00	6,265,600	
オリエンタル白石	30,400	325.00	9,880,000	
大成建設	53,700	5,069.00	272,205,300	
大林組	205,400	1,245.50	255,825,700	
清水建設	162,800	980.40	159,609,120	
飛島建設	5,900	1,307.00	7,711,300	
長谷工コーポレーション	52,700	1,800.00	94,860,000	
松井建設	7,000	823.00	5,761,000	
鹿島建設	127,300	2,355.00	299,791,500	
不動テトラ	4,000	2,299.00	9,196,000	
鉄建建設	4,100	1,942.00	7,962,200	
西松建設	11,000	3,908.00	42,988,000	
三井住友建設	42,700	395.00	16,866,500	
大豊建設	2,000	3,670.00	7,340,000	
佐田建設	2,100	652.00	1,369,200	
ナカノフドー建設	12,000	467.00	5,604,000	
奥村組	9,300	4,560.00	42,408,000	
東鉄工業	7,100	3,050.00	21,655,000	
淺沼組	4,200	3,700.00	15,540,000	
戸田建設	77,700	930.70	72,315,390	
熊谷組	9,600	3,565.00	34,224,000	
植木組	900	1,461.00	1,314,900	
矢作建設工業	7,800	1,341.00	10,459,800	
ピーエス三菱	7,300	866.00	6,321,800	
日本ハウスホールディングス	14,600	308.00	4,496,800	
大東建託	21,100	16,550.00	349,205,000	
新日本建設	8,100	1,066.00	8,634,600	
東亜道路工業	2,300	6,720.00	15,456,000	
日本道路	6,700	1,977.00	13,245,900	
東亜建設工業	4,400	3,490.00	15,356,000	
日本国土開発	16,300	581.00	9,470,300	
若築建設	2,000	3,005.00	6,010,000	
東洋建設	14,500	1,319.00	19,125,500	
五洋建設	81,400	784.10	63,825,740	
世紀東急工業	7,400	1,671.00	12,365,400	

福田組	2,200	5,160.00	11,352,000	
住友林業	49,600	3,903.00	193,588,800	
日本基礎技術	8,100	440.00	3,564,000	
巴コーポレーション	6,000	552.00	3,312,000	
大和ハウス工業	158,800	4,314.00	685,063,200	
ライト工業	11,800	1,939.00	22,880,200	
積水ハウス	174,200	3,050.00	531,310,000	
日特建設	5,500	1,030.00	5,665,000	
北陸電気工事	5,400	972.00	5,248,800	
ユアテック	12,700	1,045.00	13,271,500	
日本リーテック	4,500	1,228.00	5,526,000	
四電工	2,400	3,075.00	7,380,000	
中電工	8,900	2,560.00	22,784,000	
関電工	36,000	1,400.00	50,400,000	
きんでん	40,400	2,309.00	93,283,600	
東京エネシス	5,700	1,039.00	5,922,300	
トーエネック	1,900	4,370.00	8,303,000	
住友電設	5,500	2,525.00	13,887,500	
日本電設工業	10,800	1,963.00	21,200,400	
エクシオグループ	28,900	3,137.00	90,659,300	
新日本空調	3,700	2,230.00	8,251,000	
九電工	12,400	4,941.00	61,268,400	
三機工業	12,400	1,784.00	22,121,600	
日揮ホールディングス	56,800	1,622.00	92,129,600	
中外炉工業	2,600	2,274.00	5,912,400	
ヤマト	5,100	913.00	4,656,300	
太平電業	3,600	4,125.00	14,850,000	
高砂熱学工業	15,400	3,165.00	48,741,000	
三晃金属工業	1,000	4,650.00	4,650,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	22,900	2,288.00	52,395,200	
朝日工業社	2,700	2,960.00	7,992,000	
明星工業	11,100	1,115.00	12,376,500	
大氣社	6,600	4,175.00	27,555,000	
ダイダン	7,500	1,479.00	11,092,500	
日比谷総合設備	4,200	2,395.00	10,059,000	
ニップン	17,300	2,352.00	40,689,600	
日清製粉グループ本社	53,300	2,059.50	109,771,350	
日東富士製粉	1,100	4,775.00	5,252,500	
昭和産業	5,600	3,135.00	17,556,000	
中部飼料	8,000	1,078.00	8,624,000	
フィード・ワン	8,400	776.00	6,518,400	
日本甜菜製糖	3,400	1,975.00	6,715,000	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	5,700	2,925.00	16,672,500	
塩水港精糖	12,100	231.00	2,795,100	
ウェルネオシュガー	2,900	2,124.00	6,159,600	
ＬＩＦＵＬＬ	24,900	186.00	4,631,400	
ＭＩＸＩ	12,900	2,357.00	30,405,300	
ジェイエイシーリクルートメント	5,400	2,762.00	14,914,800	
日本M&Aセンターホールディングス	95,900	714.70	68,539,730	
メンバーズ	4,800	976.00	4,684,800	

ＵＴグループ	8,000	2,205.00	17,640,000	
アイティメディア	5,300	905.00	4,796,500	
Ｅ・Ｊホールディングス	3,500	1,584.00	5,544,000	
オープンアップグループ	18,000	2,216.00	39,888,000	
コシダカホールディングス	18,000	1,036.00	18,648,000	
パソナグループ	7,300	2,859.00	20,870,700	
リンクアンドモチベーション	17,300	560.00	9,688,000	
エス・エム・エス	21,100	2,673.00	56,400,300	
パーソルホールディングス	612,800	227.00	139,105,600	
クックパッド	49,100	112.00	5,499,200	
森永製菓	12,300	5,325.00	65,497,500	
中村屋	1,800	3,060.00	5,508,000	
江崎グリコ	16,500	4,224.00	69,696,000	
名糖産業	3,400	1,651.00	5,613,400	
井村屋グループ	3,400	2,350.00	7,990,000	
不二家	4,000	2,501.00	10,004,000	
山崎製パン	38,600	3,387.00	130,738,200	
モロゾフ	1,900	3,795.00	7,210,500	
亀田製菓	3,300	3,965.00	13,084,500	
寿スピリッツ	27,300	2,289.00	62,489,700	
カルビー	26,400	2,875.50	75,913,200	
森永乳業	21,000	2,801.00	58,821,000	
六甲バター	4,200	1,335.00	5,607,000	
ヤクルト本社	82,400	3,180.00	262,032,000	
明治ホールディングス	70,700	3,410.00	241,087,000	
雪印メグミルク	13,900	2,186.00	30,385,400	
プリマハム	7,700	2,264.00	17,432,800	
日本ハム	24,800	4,541.00	112,616,800	
林兼産業	2,300	594.00	1,366,200	
丸大食品	5,800	1,627.00	9,436,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,400	3,270.00	20,928,000	
柿安本店	2,200	2,408.00	5,297,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	8,800	3,900.00	34,320,000	
学情	3,200	2,015.00	6,448,000	
スタジオアリス	3,000	2,064.00	6,192,000	
クロスキャット	5,400	1,073.00	5,794,200	
シミックホールディングス	3,200	2,645.00	8,464,000	
システナ	88,900	297.00	26,403,300	
ＮＪＳ	2,000	2,857.00	5,714,000	
デジタルアーツ	3,700	4,875.00	18,037,500	
日鉄ソリューションズ	10,000	4,610.00	46,100,000	
綜合警備保障	100,500	834.30	83,847,150	
キューブシステム	5,100	1,111.00	5,666,100	
いちご	66,400	341.00	22,642,400	
日本駐車場開発	61,000	181.00	11,041,000	
コア	3,300	1,747.00	5,765,100	
カカクコム	39,800	1,732.00	68,933,600	
アイロムグループ	3,200	1,918.00	6,137,600	
セントケア・ホールディング	6,500	926.00	6,019,000	
ルネサンス	6,200	873.00	5,412,600	

ディップ	9,200	3,060.00	28,152,000	
ＳＢＳホールディングス	5,200	2,452.00	12,750,400	
デジタルホールディングス	5,300	1,265.00	6,704,500	
新日本科学	5,500	1,629.00	8,959,500	
ベネフィット・ワン	20,900	1,970.00	41,173,000	
エムスリー	118,900	2,156.50	256,407,850	
アウトソーシング	38,600	1,453.50	56,105,100	
ワールドホールディングス	2,700	2,751.00	7,427,700	
ディー・エヌ・エー	21,400	1,432.50	30,655,500	
博報堂ＤＹホールディングス	76,800	1,070.00	82,176,000	
ぐるなび	20,500	284.00	5,822,000	
ジャパンベストレスキューシステム	9,000	997.00	8,973,000	
ファンコミュニケーションズ	13,600	415.00	5,644,000	
ライク	4,000	1,314.00	5,256,000	
エスプール	17,300	406.00	7,023,800	
ＷＤＢホールディングス	3,100	2,208.00	6,844,800	
手間いらず	2,700	2,696.00	7,279,200	
アドウェイズ	10,200	519.00	5,293,800	
バリューコマース	5,300	1,391.00	7,372,300	
インフォマート	62,500	428.00	26,750,000	
サッポロホールディングス	19,000	6,108.00	116,052,000	
アサヒグループホールディングス	133,200	5,493.00	731,667,600	
キリンホールディングス	240,200	2,120.50	509,344,100	
宝ホールディングス	39,400	1,226.00	48,304,400	
オエノンホールディングス	17,200	366.00	6,295,200	
養命酒製造	2,900	1,853.00	5,373,700	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	45,200	2,169.50	98,061,400	
サントリー食品インターナショナル	40,600	4,625.00	187,775,000	
ダイドーグループホールディングス	3,300	5,870.00	19,371,000	
伊藤園	19,500	4,279.00	83,440,500	
キーコーヒー	6,500	2,065.00	13,422,500	
日清オイリオグループ	8,100	4,395.00	35,599,500	
不二製油グループ本社	13,400	2,365.50	31,697,700	
Ｊ－オイルミルズ	6,600	2,031.00	13,404,600	
ローソン	13,200	7,297.00	96,320,400	
サンエー	4,700	4,625.00	21,737,500	
カワチ薬品	4,800	2,543.00	12,206,400	
エービーシー・マート	27,100	2,594.00	70,297,400	
ハードオフコーポレーション	3,700	1,516.00	5,609,200	
高千穂交易	1,700	3,375.00	5,737,500	
アスクル	12,800	2,159.00	27,635,200	
ゲオホールディングス	6,900	2,318.00	15,994,200	
アダストリア	7,500	3,760.00	28,200,000	
伊藤忠食品	1,400	7,990.00	11,186,000	
くら寿司	7,300	3,685.00	26,900,500	
キャンドゥ	2,200	2,669.00	5,871,800	
エレマテック	5,600	1,698.00	9,508,800	
パルグループホールディングス	12,200	2,498.00	30,475,600	
エディオン	24,500	1,489.00	36,480,500	

あらた	4,700	6,300.00	29,610,000	
サーラコーポレーション	13,000	710.00	9,230,000	
トーメンデバイス	1,100	5,070.00	5,577,000	
ハローズ	2,800	4,175.00	11,690,000	
ＪＰホールディングス	15,700	411.00	6,452,700	
フジオフードグループ本社	6,900	1,443.00	9,956,700	
あみやき亭	1,500	3,660.00	5,490,000	
東京エレクトロン　デバイス	6,200	4,775.00	29,605,000	
円谷フィールズホールディングス	10,600	1,255.00	13,303,000	
双日	69,000	3,325.00	229,425,000	
アルフレッサ　ホールディングス	62,200	2,467.50	153,478,500	
大黒天物産	1,900	6,700.00	12,730,000	
ハニーズホールディングス	4,900	1,761.00	8,628,900	
ファーマライズホールディングス	7,000	636.00	4,452,000	
キッコーマン	38,200	9,194.00	351,210,800	
味の素	137,000	5,309.00	727,333,000	
ブルドックソース	3,100	2,078.00	6,441,800	
キユーピー	31,000	2,550.00	79,050,000	
ハウス食品グループ本社	19,900	3,295.00	65,570,500	
カゴメ	24,800	3,144.00	77,971,200	
アリアケジャパン	5,700	4,580.00	26,106,000	
エバラ食品工業	1,900	2,862.00	5,437,800	
ニチレイ	26,400	3,580.00	94,512,000	
横浜冷凍	16,900	1,112.00	18,792,800	
東洋水産	29,100	7,967.00	231,839,700	
イートアンドホールディングス	2,800	2,083.00	5,832,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,300	1,053.00	5,580,900	
日清食品ホールディングス	20,300	15,310.00	310,793,000	
永谷園ホールディングス	2,800	2,161.00	6,050,800	
一正蒲鉾	3,300	743.00	2,451,900	
フジッコ	5,900	1,948.00	11,493,200	
ロック・フィールド	6,500	1,533.00	9,964,500	
日本たばこ産業	350,400	3,790.00	1,328,016,000	
ケンコーマヨネーズ	4,000	1,696.00	6,784,000	
わらべや日洋ホールディングス	3,900	3,650.00	14,235,000	
なとり	3,600	2,062.00	7,423,200	
ファーマフーズ	8,300	1,227.00	10,184,100	
北の達人コーポレーション	27,400	200.00	5,480,000	
ユーグレナ	35,900	703.00	25,237,700	
紀文食品	5,000	1,139.00	5,695,000	
ピックルスホールディングス	4,600	1,208.00	5,556,800	
ＳＲＥホールディングス	2,600	2,605.00	6,773,000	
ＡＤワークスグループ	20,100	239.00	4,803,900	
片倉工業	5,400	1,660.00	8,964,000	
グンゼ	4,200	5,210.00	21,882,000	
ヒューリック	134,500	1,498.00	201,481,000	
アルペン	5,100	1,968.00	10,036,800	
ラクーンホールディングス	7,800	707.00	5,514,600	
クオールホールディングス	8,500	1,700.00	14,450,000	
アルコニックス	8,200	1,319.00	10,815,800	

神戸物産	47,900	4,179.00	200,174,100	
ソリトンシステムズ	5,000	1,525.00	7,625,000	
ジンズホールディングス	3,700	4,255.00	15,743,500	
ビックカメラ	33,000	1,264.00	41,712,000	
ＤＣＭホールディングス	32,700	1,296.00	42,379,200	
ハイパー	4,500	315.00	1,417,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	87,800	1,465.00	128,627,000	
東京一番フーズ	8,200	500.00	4,100,000	
あい　ホールディングス	9,900	2,387.00	23,631,300	
ディーブイエックス	4,000	1,032.00	4,128,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	71,100	1,327.00	94,349,700	
ドトール・日レスホールディングス	11,000	2,179.00	23,969,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	112,700	2,595.00	292,456,500	
ブロンコビリー	3,600	3,170.00	11,412,000	
ＺＯＺＯ	40,900	3,127.00	127,894,300	
トレジャー・ファクトリー	4,700	1,337.00	6,283,900	
物語コーポレーション	10,300	3,985.00	41,045,500	
三越伊勢丹ホールディングス	104,300	1,619.00	168,861,700	
東洋紡	25,300	1,043.00	26,387,900	
富士紡ホールディングス	2,600	3,460.00	8,996,000	
日清紡ホールディングス	44,500	1,102.50	49,061,250	
倉敷紡績	4,400	2,427.00	10,678,800	
ダイワボウホールディングス	27,400	2,826.50	77,446,100	
日東紡績	7,400	4,005.00	29,637,000	
トヨタ紡織	24,700	2,367.00	58,464,900	
マクニカホールディングス	14,700	7,598.00	111,690,600	
Ｈａｍｅｅ	5,800	1,000.00	5,800,000	
ラクト・ジャパン	2,800	1,893.00	5,300,400	
ウエルシアホールディングス	32,100	2,576.00	82,689,600	
クリエイトＳＤホールディングス	10,200	3,115.00	31,773,000	
グリムス	2,700	1,939.00	5,235,300	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9,400	1,061.00	9,973,400	
八洲電機	5,000	1,272.00	6,360,000	
メディアスホールディングス	7,200	774.00	5,572,800	
レスターホールディングス	5,300	2,730.00	14,469,000	
ジオリーブグループ	3,900	1,243.00	4,847,700	
丸善ＣＨＩホールディングス	12,600	331.00	4,170,600	
ＴＯＫＡＩホールディングス	33,600	970.00	32,592,000	
ミサワ	2,300	643.00	1,478,900	
三洋貿易	7,000	1,274.00	8,918,000	
シュッピン	5,600	1,155.00	6,468,000	
ビューティガレージ	2,400	1,951.00	4,682,400	
オイシックス・ラ・大地	8,300	1,374.00	11,404,200	
ウイン・パートナーズ	5,000	1,151.00	5,755,000	
ネクステージ	14,100	2,372.00	33,445,200	
ジョイフル本田	18,000	1,813.00	32,634,000	
鳥貴族ホールディングス	2,300	3,335.00	7,670,500	
ホットランド	4,700	1,961.00	9,216,700	
すかいらーくホールディングス	84,700	2,181.00	184,730,700	

ＳＦＰホールディングス	3,400	2,122.00	7,214,800	
綿半ホールディングス	4,800	1,363.00	6,542,400	
日本毛織	15,500	1,362.00	21,111,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17,300	1,017.00	17,594,100	
野村不動産ホールディングス	32,100	3,664.00	117,614,400	
三重交通グループホールディングス	12,300	583.00	7,170,900	
サムティ	9,200	2,340.00	21,528,000	
ディア・ライフ	9,800	865.00	8,477,000	
コーセーアールイー	3,700	1,055.00	3,903,500	
地主	4,400	2,257.00	9,930,800	
プレサンスコーポレーション	9,100	1,548.00	14,086,800	
ハウスコム	4,000	875.00	3,500,000	
ＪＰＭＣ	4,900	1,138.00	5,576,200	
サンセイランディック	2,300	1,035.00	2,380,500	
エストラスト	7,500	631.00	4,732,500	
フージャースホールディングス	8,900	1,047.00	9,318,300	
オープンハウスグループ	21,100	4,071.00	85,898,100	
東急不動産ホールディングス	173,400	916.50	158,921,100	
飯田グループホールディングス	55,300	2,190.00	121,107,000	
ムゲンエステート	4,800	1,158.00	5,558,400	
帝国繊維	6,600	1,971.00	13,008,600	
日本コークス工業	59,600	125.00	7,450,000	
ＢＥＥＮＯＳ	3,800	1,365.00	5,187,000	
あさひ	5,700	1,308.00	7,455,600	
日本調剤	4,200	1,311.00	5,506,200	
コスモス薬品	6,100	17,120.00	104,432,000	
シップヘルスケアホールディングス	22,300	2,106.00	46,963,800	
ソフトクリエイトホールディングス	4,800	1,784.00	8,563,200	
セブン&アイ・ホールディングス	213,500	5,790.00	1,236,165,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	41,900	1,045.00	43,785,500	
明治電機工業	3,900	1,394.00	5,436,600	
ツルハホールディングス	13,000	12,465.00	162,045,000	
サンマルクホールディングス	5,000	2,029.00	10,145,000	
フェリシモ	4,400	909.00	3,999,600	
トリドールホールディングス	17,400	4,194.00	72,975,600	
帝人	56,400	1,325.00	74,730,000	
東レ	393,000	731.60	287,518,800	
クラレ	85,500	1,461.00	124,915,500	
旭化成	396,800	1,020.00	404,736,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	18,900	248.00	4,687,200	
稲葉製作所	3,600	1,483.00	5,338,800	
宮地エンジニアリンググループ	3,000	3,180.00	9,540,000	
トーカロ	17,400	1,401.00	24,377,400	
ＳＵＭＣＯ	107,400	2,050.50	220,223,700	
川田テクノロジーズ	1,400	6,740.00	9,436,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	4,000	2,663.00	10,652,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	5,600	1,030.00	5,768,000	
シーアールイー	3,500	1,413.00	4,945,500	

ケイアイスター不動産	2,800	3,125.00	8,750,000	
グッドコムアセット	5,900	629.00	3,711,100	
ジェイ・エス・ビー	2,900	2,394.00	6,942,600	
ロードスターキャピタル	3,800	1,951.00	7,413,800	
日本フエルト	5,500	421.00	2,315,500	
イチカワ	3,400	1,598.00	5,433,200	
芦森工業	1,800	2,073.00	3,731,400	
アツギ	10,200	496.00	5,059,200	
ＪＭホールディングス	4,700	2,105.00	9,893,500	
コメダホールディングス	15,200	2,737.00	41,602,400	
アレンザホールディングス	5,500	1,018.00	5,599,000	
バロックジャパンリミテッド	6,900	816.00	5,630,400	
クスリのアオキホールディングス	16,500	3,542.00	58,443,000	
力の源ホールディングス	2,100	1,509.00	3,168,900	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	33,000	2,807.00	92,631,000	
アセンテック	10,700	524.00	5,606,800	
セーレン	11,300	2,411.00	27,244,300	
ソトー	5,700	709.00	4,041,300	
東海染工	1,600	917.00	1,467,200	
小松マテーレ	8,500	746.00	6,341,000	
ワコールホールディングス	12,000	3,363.00	40,356,000	
ホギメディカル	7,800	3,515.00	27,417,000	
ＴＳＩホールディングス	19,700	780.00	15,366,000	
マツオカコーポレーション	3,200	1,482.00	4,742,400	
ワールド	8,300	1,671.00	13,869,300	
ＴＩＳ	64,200	3,086.00	198,121,200	
グリー	15,700	563.00	8,839,100	
コーエーテクモホールディングス	36,800	1,711.50	62,983,200	
三菱総合研究所	2,900	4,705.00	13,644,500	
ブレインパッド	6,700	983.00	6,586,100	
ＫＬａｂ	20,500	266.00	5,453,000	
ポールトゥウィンホールディングス	11,700	488.00	5,709,600	
ネクソン	131,200	3,057.00	401,078,400	
アイスタイル	17,400	431.00	7,499,400	
エムアップホールディングス	7,200	1,029.00	7,408,800	
エイチーム	9,100	583.00	5,305,300	
エニグモ	17,000	356.00	6,052,000	
コロプラ	22,800	603.00	13,748,400	
ブロードリーフ	27,900	560.00	15,624,000	
デジタルハーツホールディングス	6,100	1,001.00	6,106,100	
メディアドゥ	4,200	1,432.00	6,014,400	
じげん	17,100	528.00	9,028,800	
ブイキューブ	15,700	298.00	4,678,600	
フィックスターズ	6,600	1,246.00	8,223,600	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,600	1,317.00	6,058,200	
オプティム	6,700	827.00	5,540,900	
セレス	5,900	1,059.00	6,248,100	
ＳＨＩＦＴ	3,900	33,240.00	129,636,000	
特種東海製紙	3,200	3,720.00	11,904,000	

ティーガイア	6,100	1,852.00	11,297,200	
テクマトリックス	10,700	1,747.00	18,692,900	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15,300	2,240.00	34,272,000	
GMOペイメントゲートウェイ	11,700	8,811.00	103,088,700	
システムリサーチ	2,000	3,580.00	7,160,000	
インターネットイニシアティブ	28,100	2,703.00	75,954,300	
さくらインターネット	6,600	2,040.00	13,464,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,200	2,416.00	5,315,200	
ＳＲＡホールディングス	3,000	3,500.00	10,500,000	
朝日ネット	9,000	621.00	5,589,000	
ｅＢＡＳＥ	8,500	789.00	6,706,500	
アバントグループ	7,400	1,390.00	10,286,000	
アドソル日進	3,500	1,584.00	5,544,000	
フリービット	5,400	1,333.00	7,198,200	
コムチュア	8,500	1,877.00	15,954,500	
アステリア	8,100	683.00	5,532,300	
アイル	2,700	3,310.00	8,937,000	
王子ホールディングス	244,300	531.00	129,723,300	
日本製紙	33,100	1,333.00	44,122,300	
三菱製紙	4,900	520.00	2,548,000	
北越コーポレーション	28,800	1,523.00	43,862,400	
大王製紙	25,900	1,063.50	27,544,650	
阿波製紙	3,900	374.00	1,458,600	
マークラインズ	3,200	2,649.00	8,476,800	
メディカル・データ・ビジョン	8,200	617.00	5,059,400	
ｇｕｍｉ	12,700	395.00	5,016,500	
テラスカイ	3,700	1,581.00	5,849,700	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,500	1,583.00	5,540,500	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,500	1,715.00	6,002,500	
ラクス	27,800	2,508.50	69,736,300	
ダブルスタンダード	3,800	1,505.00	5,719,000	
オープンドア	7,300	725.00	5,292,500	
アカツキ	2,800	2,146.00	6,008,800	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,800	1,553.00	7,454,400	
カナミックネットワーク	11,700	392.00	4,586,400	
レンゴー	53,400	940.70	50,233,380	
トーモク	3,400	2,157.00	7,333,800	
ザ・パック	4,400	3,175.00	13,970,000	
チェンジホールディングス	12,800	1,353.00	17,318,400	
オークネット	3,100	1,937.00	6,004,700	
マクロミル	11,500	779.00	8,958,500	
ユーザーローカル	3,500	1,669.00	5,841,500	
マネーフォワード	13,100	4,020.00	52,662,000	
レゾナック・ホールディングス	56,700	2,791.50	158,278,050	
住友化学	435,300	360.90	157,099,770	
住友精化	2,800	4,805.00	13,454,000	
日産化学	27,600	5,034.00	138,938,400	

ラサ工業	2,700	2,013.00	5,435,100	
クレハ	4,300	8,510.00	36,593,000	
多木化学	2,300	3,500.00	8,050,000	
テイカ	5,100	1,347.00	6,869,700	
石原産業	9,700	1,325.00	12,852,500	
片倉コープアグリ	1,900	1,103.00	2,095,700	
日本曹達	6,900	5,330.00	36,777,000	
東ソー	78,300	1,849.00	144,776,700	
トクヤマ	18,900	2,248.50	42,496,650	
セントラル硝子	6,300	2,650.00	16,695,000	
東亞合成	29,400	1,313.00	38,602,200	
大阪ソーダ	4,100	9,580.00	39,278,000	
関東電化工業	11,300	807.00	9,119,100	
デンカ	21,300	2,516.50	53,601,450	
イビデン	30,800	6,671.00	205,466,800	
信越化学工業	531,900	4,925.00	2,619,607,500	
日本カーバイド工業	3,100	1,444.00	4,476,400	
プラスアルファ・コンサルティング	3,500	2,451.00	8,578,500	
電算システムホールディングス	2,600	2,710.00	7,046,000	
堺化学工業	4,500	1,839.00	8,275,500	
第一稀元素化学工業	6,400	956.00	6,118,400	
エア・ウォーター	55,300	1,874.00	103,632,200	
日本酸素ホールディングス	56,900	3,750.00	213,375,000	
日本化学工業	2,900	1,898.00	5,504,200	
日本パーカライジング	26,100	1,103.00	28,788,300	
高圧ガス工業	8,500	868.00	7,378,000	
四国化成ホールディングス	7,500	1,728.00	12,960,000	
ステラ　ケミファ	3,200	3,175.00	10,160,000	
保土谷化学工業	1,800	3,385.00	6,093,000	
日本触媒	8,900	5,258.00	46,796,200	
大日精化工業	4,100	2,270.00	9,307,000	
カネカ	14,900	3,641.00	54,250,900	
協和キリン	70,900	2,453.00	173,917,700	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	20,100	1,513.00	30,411,300	
三菱瓦斯化学	43,800	2,234.50	97,871,100	
三井化学	48,400	4,190.00	202,796,000	
ＪＳＲ	63,900	4,004.00	255,855,600	
東京応化工業	9,300	8,793.00	81,774,900	
大阪有機化学工業	4,900	2,515.00	12,323,500	
三菱ケミカルグループ	428,800	946.40	405,816,320	
ＫＨネオケム	8,900	2,259.00	20,105,100	
ダイセル	75,400	1,377.00	103,825,800	
住友ベークライト	8,700	7,234.00	62,935,800	
積水化学工業	118,900	2,081.00	247,430,900	
日本ゼオン	40,200	1,330.50	53,486,100	
アイカ工業	14,800	3,358.00	49,698,400	
ＵＢＥ	27,900	2,255.50	62,928,450	
積水樹脂	8,800	2,554.00	22,475,200	
タキロンシーアイ	15,000	614.00	9,210,000	
旭有機材	3,900	3,915.00	15,268,500	

ニチバン	3,200	1,720.00	5,504,000	
リケンテクノス	12,600	816.00	10,281,600	
大倉工業	2,700	2,710.00	7,317,000	
積水化成品工業	12,300	505.00	6,211,500	
群栄化学工業	1,700	2,986.00	5,076,200	
ダイキョーニシカワ	12,900	714.00	9,210,600	
森六ホールディングス	3,300	2,852.00	9,411,600	
恵和	4,200	1,240.00	5,208,000	
日本化薬	44,800	1,337.00	59,897,600	
カーリットホールディングス	6,300	889.00	5,600,700	
ＣＬホールディングス	6,800	864.00	5,875,200	
プレステージ・インターナショナル	28,200	586.00	16,525,200	
プロトコーポレーション	6,400	1,296.00	8,294,400	
ハイマックス	4,000	1,398.00	5,592,000	
アミューズ	3,700	1,512.00	5,594,400	
野村総合研究所	130,100	3,986.00	518,578,600	
ドリームインキュベータ	2,100	2,701.00	5,672,100	
サイバネットシステム	7,000	1,092.00	7,644,000	
クイック	4,200	2,121.00	8,908,200	
電通グループ	59,200	3,801.00	225,019,200	
インテージホールディングス	6,600	1,532.00	10,111,200	
ぴあ	2,100	3,290.00	6,909,000	
イオンファンタジー	2,200	2,494.00	5,486,800	
ソースネクスト	31,000	179.00	5,549,000	
シーティーエス	8,200	630.00	5,166,000	
インフォコム	7,600	2,420.00	18,392,000	
メディカルシステムネットワーク	12,200	639.00	7,795,800	
日本精化	3,900	2,828.00	11,029,200	
扶桑化学工業	6,200	3,895.00	24,149,000	
トリケミカル研究所	7,100	3,505.00	24,885,500	
シンプレクス・ホールディングス	8,800	2,425.00	21,340,000	
ＨＥＲＯＺ	3,900	1,575.00	6,142,500	
ラクスル	14,100	1,312.00	18,499,200	
メルカリ	35,600	2,678.50	95,354,600	
ＡＤＥＫＡ	20,500	2,761.00	56,600,500	
日油	18,100	6,803.00	123,134,300	
新日本理化	5,700	180.00	1,026,000	
ハリマ化成グループ	6,800	794.00	5,399,200	
イーソル	7,900	568.00	4,487,200	
ウイングアーク１ｓｔ	6,100	3,095.00	18,879,500	
サーバーワークス	1,800	3,360.00	6,048,000	
Ｓａｎｓａｎ	19,200	1,522.00	29,222,400	
ギフティ	5,100	1,747.00	8,909,700	
花王	132,600	5,827.00	772,660,200	
第一工業製薬	3,300	1,812.00	5,979,600	
石原ケミカル	3,300	1,940.00	6,402,000	
三洋化成工業	3,600	4,250.00	15,300,000	
メドレー	7,900	4,175.00	32,982,500	
ベース	2,000	3,315.00	6,630,000	
ＪＭＤＣ	10,000	4,193.00	41,930,000	

武田薬品工業	519,800	4,110.00	2,136,378,000	
アステラス製薬	515,200	1,729.50	891,038,400	
住友ファーマ	43,600	475.00	20,710,000	
塩野義製薬	74,100	7,137.00	528,851,700	
わかもと製薬	3,100	197.00	610,700	
日本新薬	15,400	5,058.00	77,893,200	
中外製薬	183,900	5,356.00	984,968,400	
科研製薬	10,100	3,273.00	33,057,300	
エーザイ	71,500	7,569.00	541,183,500	
理研ビタミン	5,000	2,297.00	11,485,000	
ロート製薬	56,900	3,031.00	172,463,900	
小野薬品工業	124,600	2,606.00	324,707,600	
久光製薬	13,100	4,598.00	60,233,800	
有機合成薬品工業	12,400	281.00	3,484,400	
持田製薬	6,700	3,300.00	22,110,000	
参天製薬	107,000	1,391.00	148,837,000	
扶桑薬品工業	2,800	1,885.00	5,278,000	
ツムラ	18,500	2,685.50	49,681,750	
テルモ	163,700	4,756.00	778,557,200	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	17,600	2,600.50	45,768,800	
キッセイ薬品工業	9,700	3,135.00	30,409,500	
生化学工業	10,000	751.00	7,510,000	
栄研化学	11,400	1,725.00	19,665,000	
鳥居薬品	3,200	3,630.00	11,616,000	
ＪＣＲファーマ	19,900	1,178.00	23,442,200	
東和薬品	9,000	2,373.00	21,357,000	
富士製薬工業	4,700	1,660.00	7,802,000	
ゼリア新薬工業	8,200	2,020.00	16,564,000	
そーせいグループ	18,900	1,426.00	26,951,400	
第一三共	511,700	4,140.00	2,118,438,000	
杏林製薬	12,700	1,826.00	23,190,200	
ダイト	4,500	1,936.00	8,712,000	
大塚ホールディングス	122,200	5,695.00	695,929,000	
大正製薬ホールディングス	13,100	8,626.00	113,000,600	
ペプチドリーム	28,500	1,184.50	33,758,250	
大日本塗料	6,500	983.00	6,389,500	
日本ペイントホールディングス	311,500	1,104.50	344,051,750	
関西ペイント	57,500	2,364.00	135,930,000	
中国塗料	12,000	1,633.00	19,596,000	
藤倉化成	12,300	426.00	5,239,800	
太陽ホールディングス	10,200	3,095.00	31,569,000	
ＤＩＣ	22,900	2,463.50	56,414,150	
サカタインクス	13,000	1,318.00	17,134,000	
東洋インキＳＣホールディングス	12,800	2,677.00	34,265,600	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5,600	1,434.00	8,030,400	
アルプス技研	5,700	2,711.00	15,452,700	
日本空調サービス	7,100	791.00	5,616,100	
オリエンタルランド	318,600	5,300.00	1,688,580,000	
フォーカスシステムズ	5,600	963.00	5,392,800	
ダスキン	13,400	3,399.00	45,546,600	

パーク２４	37,500	1,791.00	67,162,500	
明光ネットワークジャパン	7,800	733.00	5,717,400	
ファルコホールディングス	2,700	2,111.00	5,699,700	
クレスコ	4,800	1,847.00	8,865,600	
フジ・メディア・ホールディングス	56,400	1,636.50	92,298,600	
ラウンドワン	56,600	543.00	30,733,800	
リゾートトラスト	26,100	2,453.00	64,023,300	
オービック	19,600	23,615.00	462,854,000	
ジャストシステム	8,400	3,230.00	27,132,000	
ＴＤＣソフト	5,500	2,108.00	11,594,000	
ＬＩＮＥヤフー	836,000	466.40	389,910,400	
ビー・エム・エル	7,400	2,908.00	21,519,200	
トレンドマイクロ	27,800	8,157.00	226,764,600	
ＩＤホールディングス	4,000	1,612.00	6,448,000	
リソー教育	30,800	223.00	6,868,400	
日本オラクル	11,200	11,595.00	129,864,000	
早稲田アカデミー	3,900	1,815.00	7,078,500	
アルファシステムズ	2,000	2,943.00	5,886,000	
フューチャー	12,500	1,729.00	21,612,500	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,100	1,768.00	5,480,800	
ＳＢテクノロジー	2,600	2,429.00	6,315,400	
ユー・エス・エス	67,500	2,903.50	195,986,250	
オービックビジネスコンサルタント	8,300	6,888.00	57,170,400	
アイティフォー	7,500	1,161.00	8,707,500	
東京個別指導学院	10,900	468.00	5,101,200	
サイバーエージェント	133,000	820.00	109,060,000	
楽天グループ	515,500	589.60	303,938,800	
クリーク・アンド・リバー社	3,000	2,033.00	6,099,000	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	11,800	612.00	7,221,600	
テー・オー・ダブリュー	17,500	314.00	5,495,000	
大塚商会	29,100	6,141.00	178,703,100	
サイボウズ	8,100	2,059.00	16,677,900	
山田コンサルティンググループ	3,500	1,764.00	6,174,000	
セントラルスポーツ	2,300	2,450.00	5,635,000	
電通国際情報サービス	7,100	5,040.00	35,784,000	
ＡＣＣＥＳＳ	7,400	670.00	4,958,000	
デジタルガレージ	9,400	3,565.00	33,511,000	
イーエムシステムズ	9,800	699.00	6,850,200	
ウェザーニューズ	1,800	5,440.00	9,792,000	
ＣＩＪ	10,300	602.00	6,200,600	
WOWOW	5,000	1,070.00	5,350,000	
スカラ	7,200	760.00	5,472,000	
フルキャストホールディングス	5,700	1,790.00	10,203,000	
エン・ジャパン	9,800	2,567.00	25,156,600	
あすか製薬ホールディングス	6,000	1,777.00	10,662,000	
サワイグループホールディングス	13,500	5,001.00	67,513,500	
富士フイルムホールディングス	109,000	8,744.00	953,096,000	
コニカミノルタ	132,100	444.30	58,692,030	
資生堂	122,600	3,835.00	470,171,000	

ライオン	76,900	1,321.00	101,584,900	
高砂香料工業	4,400	3,300.00	14,520,000	
マンダム	12,700	1,278.00	16,230,600	
ミルボン	8,000	3,323.00	26,584,000	
ファンケル	25,700	2,237.50	57,503,750	
コーセー	11,900	10,630.00	126,497,000	
コタ	5,400	1,538.00	8,305,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	30,100	1,578.50	47,512,850	
ノエビアホールディングス	5,200	5,150.00	26,780,000	
アジュバンホールディングス	3,300	925.00	3,052,500	
新日本製薬	3,700	1,650.00	6,105,000	
エステー	4,500	1,514.00	6,813,000	
アグロ　カネショウ	4,100	1,429.00	5,858,900	
コニシ	9,800	2,463.00	24,137,400	
長谷川香料	11,200	3,235.00	36,232,000	
小林製薬	17,100	6,651.00	113,732,100	
荒川化学工業	5,400	1,023.00	5,524,200	
メック	4,800	4,025.00	19,320,000	
日本高純度化学	2,100	2,390.00	5,019,000	
タカラバイオ	15,800	1,126.00	17,790,800	
ＪＣＵ	6,600	3,600.00	23,760,000	
新田ゼラチン	500	775.00	387,500	
ＯＡＴアグリオ	2,900	1,767.00	5,124,300	
デクセリアルズ	14,700	4,170.00	61,299,000	
アース製薬	5,300	4,765.00	25,254,500	
北興化学工業	5,900	952.00	5,616,800	
大成ラミック	1,800	2,833.00	5,099,400	
クミアイ化学工業	23,300	1,036.00	24,138,800	
日本農薬	10,800	611.00	6,598,800	
ニチレキ	7,700	2,309.00	17,779,300	
ユシロ化学工業	3,700	1,662.00	6,149,400	
富士石油	17,400	346.00	6,020,400	
出光興産	65,300	4,041.00	263,877,300	
ＥＮＥＯＳホールディングス	929,800	596.00	554,160,800	
コスモエネルギーホールディングス	17,500	5,735.00	100,362,500	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	2,100	3,855.00	8,095,500	
テスホールディングス	12,400	412.00	5,108,800	
インフロニア・ホールディングス	66,200	1,581.00	104,662,200	
横浜ゴム	29,700	3,260.00	96,822,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	33,700	2,417.00	81,452,900	
ブリヂストン	171,900	6,080.00	1,045,152,000	
住友ゴム工業	57,600	1,670.50	96,220,800	
藤倉コンポジット	4,700	1,357.00	6,377,900	
オカモト	2,800	5,170.00	14,476,000	
アキレス	3,700	1,548.00	5,727,600	
フコク	2,600	1,366.00	3,551,600	
ニッタ	6,000	3,675.00	22,050,000	
住友理工	9,100	1,007.00	9,163,700	
三ツ星ベルト	7,100	4,405.00	31,275,500	
バンドー化学	8,700	1,562.00	13,589,400	

ＡＧＣ	54,800	5,282.00	289,453,600	
日本板硝子	28,000	572.00	16,016,000	
有沢製作所	10,300	1,068.00	11,000,400	
日本電気硝子	24,000	3,050.00	73,200,000	
オハラ	4,200	1,242.00	5,216,400	
住友大阪セメント	9,800	3,548.00	34,770,400	
太平洋セメント	34,700	2,717.00	94,279,900	
日本ヒューム	6,200	895.00	5,549,000	
日本コンクリート工業	17,700	319.00	5,646,300	
三谷セキサン	2,500	4,455.00	11,137,500	
アジアパイルホールディングス	8,300	682.00	5,660,600	
東海カーボン	54,200	1,061.50	57,533,300	
日本カーボン	3,100	4,555.00	14,120,500	
東洋炭素	4,100	4,625.00	18,962,500	
ノリタケカンパニーリミテド	3,300	6,750.00	22,275,000	
ＴＯＴＯ	38,800	3,659.00	141,969,200	
日本碍子	68,300	1,683.00	114,948,900	
日本特殊陶業	49,200	3,347.00	164,672,400	
ＭＡＲＵＷＡ	2,200	27,320.00	60,104,000	
品川リフラクトリーズ	7,200	1,700.00	12,240,000	
黒崎播磨	1,200	11,100.00	13,320,000	
ヨータイ	3,800	1,508.00	5,730,400	
ニッカトー	3,400	564.00	1,917,600	
フジミインコーポレーテッド	15,800	2,775.00	43,845,000	
クニミネ工業	900	986.00	887,400	
ニチアス	14,800	3,250.00	48,100,000	
日本製鉄	270,500	3,332.00	901,306,000	
神戸製鋼所	121,500	1,670.50	202,965,750	
中山製鋼所	13,800	817.00	11,274,600	
合同製鐵	3,400	4,360.00	14,824,000	
ＪＦＥホールディングス	168,000	2,098.50	352,548,000	
東京製鐵	17,000	1,848.00	31,416,000	
共英製鋼	6,900	2,034.00	14,034,600	
大和工業	11,400	7,392.00	84,268,800	
東京鐵鋼	2,700	3,785.00	10,219,500	
大阪製鐵	3,100	1,940.00	6,014,000	
淀川製鋼所	6,900	3,820.00	26,358,000	
中部鋼鈑	4,000	1,965.00	7,860,000	
丸一鋼管	18,400	3,752.00	69,036,800	
大同特殊鋼	7,600	7,048.00	53,564,800	
日本冶金工業	4,400	4,050.00	17,820,000	
山陽特殊製鋼	6,000	2,487.00	14,922,000	
愛知製鋼	3,500	3,160.00	11,060,000	
大平洋金属	5,100	1,192.00	6,079,200	
新日本電工	30,000	279.00	8,370,000	
栗本鐵工所	2,800	3,130.00	8,764,000	
日本製鋼所	16,300	2,515.50	41,002,650	
三菱製鋼	4,500	1,482.00	6,669,000	
日亜鋼業	10,400	307.00	3,192,800	
日本精線	1,100	4,695.00	5,164,500	

エンビプロ・ホールディングス	8,400	578.00	4,855,200	
大紀アルミニウム工業所	7,600	1,171.00	8,899,600	
日本軽金属ホールディングス	17,600	1,641.00	28,881,600	
三井金属鉱業	17,600	4,330.00	76,208,000	
東邦亜鉛	3,900	1,130.00	4,407,000	
三菱マテリアル	43,200	2,478.00	107,049,600	
住友金属鉱山	70,000	4,094.00	286,580,000	
ＤＯＷＡホールディングス	14,900	5,029.00	74,932,100	
古河機械金属	8,000	1,832.00	14,656,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,500	2,660.00	27,930,000	
東邦チタニウム	12,500	1,808.00	22,600,000	
ＵＡＣＪ	8,500	3,735.00	31,747,500	
ＣＫサンエツ	1,500	3,705.00	5,557,500	
古河電気工業	20,100	2,263.50	45,496,350	
住友電気工業	226,000	1,806.50	408,269,000	
フジクラ	71,300	1,063.50	75,827,550	
ＳＷＣＣ	6,800	2,560.00	17,408,000	
タツタ電線	10,800	680.00	7,344,000	
平河ヒューテック	3,900	1,326.00	5,171,400	
いよぎんホールディングス	68,600	989.30	67,865,980	
しずおかフィナンシャルグループ	128,100	1,247.50	159,804,750	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	48,600	1,085.50	52,755,300	
楽天銀行	20,100	2,478.00	49,807,800	
京都フィナンシャルグループ	18,300	9,051.00	165,633,300	
リョービ	6,400	2,687.00	17,196,800	
アーレスティ	5,200	740.00	3,848,000	
ＡＲＥホールディングス	22,700	1,871.00	42,471,700	
東洋製罐グループホールディングス	36,000	2,271.50	81,774,000	
ホッカンホールディングス	3,400	1,636.00	5,562,400	
コロナ	5,900	952.00	5,616,800	
横河ブリッジホールディングス	9,500	2,688.00	25,536,000	
三和ホールディングス	60,700	2,089.00	126,802,300	
文化シヤッター	15,800	1,401.00	22,135,800	
三協立山	6,900	798.00	5,506,200	
アルインコ	5,700	1,000.00	5,700,000	
ＬＩＸＩＬ	94,300	1,741.00	164,176,300	
日本フイルコン	3,000	465.00	1,395,000	
ノーリツ	10,000	1,514.00	15,140,000	
長府製作所	6,000	2,035.00	12,210,000	
リンナイ	29,600	3,127.00	92,559,200	
ユニプレス	10,500	964.00	10,122,000	
日東精工	9,300	537.00	4,994,100	
三洋工業	400	2,427.00	970,800	
岡部	10,800	711.00	7,678,800	
ジーテクト	7,700	1,683.00	12,959,100	
東プレ	10,600	1,962.00	20,797,200	
高周波熱錬	9,300	978.00	9,095,400	
東京製綱	4,000	1,319.00	5,276,000	
サンコール	11,000	460.00	5,060,000	
モリテックスチール	7,100	281.00	1,995,100	

パイオラックス	7,500	2,206.00	16,545,000	
エイチワン	6,900	780.00	5,382,000	
日本発条	53,400	1,126.00	60,128,400	
中央発條	7,300	705.00	5,146,500	
三浦工業	24,700	2,687.50	66,381,250	
タクマ	20,000	1,817.00	36,340,000	
テクノプロ・ホールディングス	35,600	3,465.00	123,354,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,000	1,525.00	6,100,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	3,700	6,330.00	23,421,000	
イー・ガーディアン	3,400	1,446.00	4,916,400	
ジャパンマテリアル	18,400	2,432.00	44,748,800	
ベクトル	7,400	1,069.00	7,910,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,000	1,113.00	5,565,000	
キャリアリンク	2,200	2,319.00	5,101,800	
ＩＢＪ	8,600	706.00	6,071,600	
アサンテ	3,400	1,639.00	5,572,600	
バリューＨＲ	5,300	1,532.00	8,119,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	4,900	2,292.00	11,230,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,300	1,022.00	5,416,600	
シグマクシス・ホールディングス	8,100	1,267.00	10,262,700	
ウィルグループ	5,000	1,112.00	5,560,000	
メドピア	6,000	681.00	4,086,000	
リクルートホールディングス	445,600	5,353.00	2,385,296,800	
エラン	8,000	1,081.00	8,648,000	
ツガミ	13,100	1,155.00	15,130,500	
オークマ	5,200	5,911.00	30,737,200	
芝浦機械	5,900	3,660.00	21,594,000	
アマダ	94,400	1,462.50	138,060,000	
アイダエンジニアリング	13,700	834.00	11,425,800	
ＦＵＪＩ	27,800	2,450.00	68,110,000	
牧野フライス製作所	6,500	5,640.00	36,660,000	
オーエスジー	26,100	1,954.00	50,999,400	
ダイジェット工業	2,000	879.00	1,758,000	
旭ダイヤモンド工業	14,200	856.00	12,155,200	
DMG森精機	35,900	2,599.50	93,322,050	
ソディック	14,400	726.00	10,454,400	
ディスコ	28,500	30,250.00	862,125,000	
日東工器	2,900	1,842.00	5,341,800	
日進工具	5,500	990.00	5,445,000	
パンチ工業	3,300	407.00	1,343,100	
日本郵政	707,400	1,329.50	940,488,300	
ベルシステム２４ホールディングス	6,500	1,783.00	11,589,500	
鎌倉新書	9,400	518.00	4,869,200	
エアトリ	4,400	1,630.00	7,172,000	
アトラエ	4,200	667.00	2,801,400	
ストライク	2,500	4,110.00	10,275,000	
ソラスト	16,600	577.00	9,578,200	
インソース	13,100	821.00	10,755,100	

豊田自動織機	49,900	11,860.00	591,814,000	
リケンＮＰＲ	6,400	1,973.00	12,627,200	
東洋機械金属	4,900	664.00	3,253,600	
エンシュウ	4,500	685.00	3,082,500	
島精機製作所	9,400	1,435.00	13,489,000	
オプトラン	9,700	1,616.00	15,675,200	
ＮＣホールディングス	2,200	1,804.00	3,968,800	
イワキ	3,900	2,074.00	8,088,600	
フリュー	5,600	1,299.00	7,274,400	
ヤマシンフィルタ	17,900	313.00	5,602,700	
日阪製作所	6,500	952.00	6,188,000	
やまびこ	9,700	1,490.00	14,453,000	
野村マイクロ・サイエンス	2,000	11,290.00	22,580,000	
平田機工	2,800	5,960.00	16,688,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	10,600	445.00	4,717,000	
マルマエ	4,000	1,740.00	6,960,000	
タツモ	3,600	2,947.00	10,609,200	
ナブテスコ	37,100	2,661.50	98,741,650	
三井海洋開発	7,500	1,896.00	14,220,000	
レオン自動機	6,800	1,507.00	10,247,600	
ＳＭＣ	17,700	71,400.00	1,263,780,000	
ホソカワミクロン	3,800	4,100.00	15,580,000	
ユニオンツール	2,600	3,255.00	8,463,000	
オイレス工業	8,000	1,907.00	15,256,000	
日精エー・エス・ビー機械	2,400	4,725.00	11,340,000	
サトーホールディングス	8,400	1,983.00	16,657,200	
技研製作所	5,600	1,717.00	9,615,200	
日本エアーテック	4,000	1,357.00	5,428,000	
カワタ	3,900	1,037.00	4,044,300	
日精樹脂工業	5,200	1,077.00	5,600,400	
ワイエイシイホールディングス	2,300	2,278.00	5,239,400	
小松製作所	277,200	3,623.00	1,004,295,600	
住友重機械工業	35,000	3,553.00	124,355,000	
日立建機	23,600	3,605.00	85,078,000	
日工	8,800	660.00	5,808,000	
巴工業	2,300	2,830.00	6,509,000	
井関農機	5,500	1,103.00	6,066,500	
ＴＯＷＡ	6,600	6,620.00	43,692,000	
北川鉄工所	3,800	1,261.00	4,791,800	
シンニッタン	14,300	255.00	3,646,500	
ローツェ	3,100	13,450.00	41,695,000	
クボタ	310,400	2,040.50	633,371,200	
荏原実業	3,100	2,872.00	8,903,200	
三菱化工機	2,100	3,050.00	6,405,000	
月島ホールディングス	8,000	1,273.00	10,184,000	
帝国電機製作所	4,200	2,927.00	12,293,400	
新東工業	12,000	1,088.00	13,056,000	
澁谷工業	5,500	2,425.00	13,337,500	
アイチコーポレーション	8,200	997.00	8,175,400	
小森コーポレーション	14,900	1,115.00	16,613,500	

鶴見製作所	4,500	3,495.00	15,727,500	
荏原製作所	24,300	8,020.00	194,886,000	
酉島製作所	5,100	2,147.00	10,949,700	
北越工業	5,900	2,301.00	13,575,900	
ダイキン工業	70,600	21,455.00	1,514,723,000	
オルガノ	7,100	5,450.00	38,695,000	
トーヨーカネツ	2,200	3,820.00	8,404,000	
栗田工業	33,100	4,970.00	164,507,000	
椿本チエイン	8,400	3,935.00	33,054,000	
大同工業	3,900	729.00	2,843,100	
日機装	13,600	977.00	13,287,200	
木村化工機	7,700	730.00	5,621,000	
レイズネクスト	8,300	1,425.00	11,827,500	
アネスト岩田	9,100	1,075.00	9,782,500	
ダイフク	99,800	2,637.00	263,172,600	
サムコ	1,600	4,490.00	7,184,000	
タダノ	34,000	1,109.00	37,706,000	
フジテック	13,800	3,539.00	48,838,200	
ＣＫＤ	16,400	2,385.00	39,114,000	
平和	17,500	2,077.00	36,347,500	
理想科学工業	4,700	2,718.00	12,774,600	
ＳＡＮＫＹＯ	14,500	7,099.00	102,935,500	
日本金銭機械	7,100	1,181.00	8,385,100	
マースグループホールディングス	3,000	2,345.00	7,035,000	
フクシマガリレイ	3,900	4,930.00	19,227,000	
ダイコク電機	2,900	3,200.00	9,280,000	
竹内製作所	10,700	4,245.00	45,421,500	
アマノ	16,800	3,267.00	54,885,600	
ＪＵＫＩ	9,200	484.00	4,452,800	
ジャノメ	7,500	696.00	5,220,000	
ブラザー工業	79,000	2,568.00	202,872,000	
マックス	8,300	2,981.00	24,742,300	
モリタホールディングス	10,300	1,496.00	15,408,800	
グローリー	14,200	2,739.50	38,900,900	
新晃工業	6,000	2,488.00	14,928,000	
大和冷機工業	9,100	1,463.00	13,313,300	
セガサミーホールディングス	52,800	2,100.50	110,906,400	
ＴＰＲ	7,500	1,638.00	12,285,000	
ツバキ・ナカシマ	11,800	703.00	8,295,400	
ホシザキ	34,900	4,809.00	167,834,100	
大豊工業	6,600	818.00	5,398,800	
日本精工	109,500	760.60	83,285,700	
ＮＴＮ	128,300	261.10	33,499,130	
ジェイテクト	52,600	1,284.00	67,538,400	
不二越	4,400	3,600.00	15,840,000	
ミネベアミツミ	102,900	2,706.50	278,498,850	
日本トムソン	16,100	588.00	9,466,800	
ＴＨＫ	34,100	2,810.50	95,838,050	
ユーシン精機	8,200	664.00	5,444,800	
前澤給装工業	4,500	1,300.00	5,850,000	

イーグル工業	6,500	1,623.00	10,549,500	
日本ピラー工業	5,500	4,310.00	23,705,000	
キッツ	19,800	1,161.00	22,987,800	
日立製作所	287,600	9,919.00	2,852,704,400	
三菱電機	658,300	1,986.00	1,307,383,800	
富士電機	36,000	5,938.00	213,768,000	
安川電機	64,200	5,266.00	338,077,200	
シンフォニア　テクノロジー	6,500	2,107.00	13,695,500	
明電舎	11,000	2,423.00	26,653,000	
オリジン	1,600	1,162.00	1,859,200	
山洋電気	2,600	5,860.00	15,236,000	
デンヨー	4,500	2,112.00	9,504,000	
ＰＨＣホールディングス	11,000	1,440.00	15,840,000	
ソシオネクスト	8,600	12,265.00	105,479,000	
ベイカレント・コンサルティング	44,200	4,767.00	210,701,400	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	5,800	1,002.00	5,811,600	
アイモバイル	11,700	457.00	5,346,900	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	19,500	2,214.00	43,173,000	
ミダックホールディングス	3,600	1,731.00	6,231,600	
キュービーネットホールディングス	3,300	1,495.00	4,933,500	
ＲＰＡホールディングス	18,800	280.00	5,264,000	
三櫻工業	8,900	807.00	7,182,300	
マキタ	67,400	3,770.00	254,098,000	
東芝テック	7,600	2,708.00	20,580,800	
芝浦メカトロニクス	3,400	5,790.00	19,686,000	
マブチモーター	14,700	4,640.00	68,208,000	
ニデック	130,600	5,502.00	718,561,200	
トレックス・セミコンダクター	3,000	1,874.00	5,622,000	
東光高岳	3,600	2,123.00	7,642,800	
ダブル・スコープ	16,900	976.00	16,494,400	
ダイヘン	5,900	6,100.00	35,990,000	
ヤーマン	10,200	1,046.00	10,669,200	
ＪＶＣケンウッド	46,700	779.00	36,379,300	
Ｉ－ＰＥＸ	4,100	1,529.00	6,268,900	
大崎電気工業	12,900	637.00	8,217,300	
オムロン	45,200	6,034.00	272,736,800	
日東工業	8,000	3,540.00	28,320,000	
ＩＤＥＣ	8,700	2,746.00	23,890,200	
不二電機工業	300	1,164.00	349,200	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	19,400	2,025.00	39,285,000	
メルコホールディングス	1,900	3,425.00	6,507,500	
テクノメディカ	2,400	2,364.00	5,673,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	6,600	671.00	4,428,600	
日本電気	77,700	8,327.00	647,007,900	
富士通	54,400	21,720.00	1,181,568,000	
沖電気工業	26,700	921.00	24,590,700	
電気興業	2,600	2,376.00	6,177,600	

サンケン電気	5,500	7,608.00	41,844,000	
アイホン	3,200	2,703.00	8,649,600	
ルネサスエレクトロニクス	386,000	2,336.50	901,889,000	
セイコーエプソン	75,900	2,113.50	160,414,650	
ワコム	44,900	679.00	30,487,100	
アルバック	14,100	6,126.00	86,376,600	
ＥＩＺＯ	4,300	5,060.00	21,758,000	
ジャパンディスプレイ	254,900	25.00	6,372,500	
日本信号	13,500	960.00	12,960,000	
京三製作所	12,400	472.00	5,852,800	
能美防災	8,000	1,998.00	15,984,000	
ホーチキ	4,400	1,593.00	7,009,200	
エレコム	14,100	1,748.00	24,646,800	
パナソニック　ホールディングス	698,700	1,432.00	1,000,538,400	
シャープ	99,700	960.50	95,761,850	
アンリツ	41,700	1,310.50	54,647,850	
富士通ゼネラル	16,800	2,421.00	40,672,800	
ソニーグループ	414,200	13,015.00	5,390,813,000	
ＴＤＫ	93,600	6,610.00	618,696,000	
帝国通信工業	3,000	1,888.00	5,664,000	
タムラ製作所	23,600	556.00	13,121,600	
アルプスアルパイン	52,800	1,241.50	65,551,200	
日本電波工業	7,100	1,107.00	7,859,700	
鈴木	4,800	1,139.00	5,467,200	
メイコー	5,900	3,910.00	23,069,000	
ローランド　ディー．ジー．	3,200	3,665.00	11,728,000	
フォスター電機	6,100	1,030.00	6,283,000	
ＳＭＫ	2,200	2,500.00	5,500,000	
ヨコオ	5,200	1,466.00	7,623,200	
ホシデン	13,400	1,676.00	22,458,400	
ヒロセ電機	8,700	16,385.00	142,549,500	
日本航空電子工業	14,100	3,105.00	43,780,500	
ＴＯＡ	6,700	1,015.00	6,800,500	
マクセル	13,100	1,600.00	20,960,000	
古野電気	7,700	1,748.00	13,459,600	
スミダコーポレーション	7,900	1,126.00	8,895,400	
アイコム	2,300	3,210.00	7,383,000	
リオン	2,400	2,063.00	4,951,200	
横河電機	64,700	2,709.50	175,304,650	
新電元工業	2,300	2,966.00	6,821,800	
アズビル	40,900	4,553.00	186,217,700	
日本光電工業	25,100	3,620.00	90,862,000	
チノー	2,700	2,015.00	5,440,500	
共和電業	11,800	408.00	4,814,400	
日本電子材料	3,900	1,408.00	5,491,200	
堀場製作所	11,200	9,897.00	110,846,400	
アドバンテスト	167,800	4,343.00	728,755,400	
エスペック	4,700	2,247.00	10,560,900	
キーエンス	58,600	60,850.00	3,565,810,000	
日置電機	2,800	6,140.00	17,192,000	

シスメックス	50,500	7,970.00	402,485,000	
日本マイクロニクス	10,500	3,645.00	38,272,500	
メガチップス	4,600	4,310.00	19,826,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,200	3,635.00	11,632,000	
澤藤電機	3,300	1,211.00	3,996,300	
デンソー	483,100	2,165.00	1,045,911,500	
原田工業	4,500	771.00	3,469,500	
コーセル	7,000	1,216.00	8,512,000	
イリソ電子工業	5,400	3,675.00	19,845,000	
オプテックスグループ	10,700	1,694.00	18,125,800	
千代田インテグレ	2,300	2,988.00	6,872,400	
レーザーテック	26,800	34,480.00	924,064,000	
スタンレー電気	37,500	2,645.50	99,206,250	
ウシオ電機	29,700	1,904.50	56,563,650	
岡谷電機産業	100	289.00	28,900	
日本セラミック	4,800	2,853.00	13,694,400	
古河電池	6,000	851.00	5,106,000	
山一電機	5,300	1,742.00	9,232,600	
図研	5,100	4,175.00	21,292,500	
日本電子	14,700	5,863.00	86,186,100	
カシオ計算機	42,300	1,233.50	52,177,050	
ファナック	285,500	4,017.00	1,146,853,500	
日本シイエムケイ	12,400	715.00	8,866,000	
エンプラス	1,700	12,480.00	21,216,000	
大真空	8,700	767.00	6,672,900	
ローム	108,300	2,814.00	304,756,200	
浜松ホトニクス	47,000	5,477.00	257,419,000	
三井ハイテック	5,200	6,966.00	36,223,200	
新光電気工業	20,700	5,240.00	108,468,000	
京セラ	91,000	8,281.00	753,571,000	
太陽誘電	28,500	3,468.00	98,838,000	
村田製作所	532,800	2,834.50	1,510,221,600	
双葉電子工業	11,100	511.00	5,672,100	
日東電工	37,700	10,125.00	381,712,500	
北陸電気工業	2,800	1,368.00	3,830,400	
東海理化電機製作所	16,500	2,326.00	38,379,000	
ニチコン	15,400	1,383.00	21,298,200	
日本ケミコン	6,200	1,359.00	8,425,800	
ＫＯＡ	8,900	1,546.00	13,759,400	
三井Ｅ＆Ｓ	28,000	594.00	16,632,000	
日立造船	52,200	884.00	46,144,800	
三菱重工業	103,400	7,904.00	817,273,600	
川崎重工業	47,800	3,115.00	148,897,000	
ＩＨＩ	44,000	2,689.00	118,316,000	
名村造船所	12,800	1,123.00	14,374,400	
マネジメントソリューションズ	2,600	2,635.00	6,851,000	
プロレド・パートナーズ	13,500	377.00	5,089,500	
アンビスホールディングス	6,400	3,150.00	20,160,000	
カーブスホールディングス	16,400	632.00	10,364,800	
フォーラムエンジニアリング	8,200	779.00	6,387,800	

日本車輌製造	2,700	2,072.00	5,594,400	
三菱ロジスネクスト	9,300	1,324.00	12,313,200	
フルサト・マルカホールディングス	5,500	2,549.00	14,019,500	
ヤマエグループホールディングス	3,500	3,965.00	13,877,500	
ＦＰＧ	19,500	1,690.00	32,955,000	
島根銀行	6,000	521.00	3,126,000	
じもとホールディングス	3,600	610.00	2,196,000	
全国保証	15,100	5,133.00	77,508,300	
めぶきフィナンシャルグループ	286,200	465.90	133,340,580	
ジャパンインベストメントアドバイザー	4,700	1,587.00	7,458,900	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,400	4,270.00	31,598,000	
九州フィナンシャルグループ	111,600	867.10	96,768,360	
かんぽ生命保険	58,800	2,676.50	157,378,200	
ゆうちょ銀行	633,700	1,521.00	963,857,700	
富山第一銀行	18,300	800.00	14,640,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	309,400	716.70	221,746,980	
ジェイリース	2,900	1,779.00	5,159,100	
西日本フィナンシャルホールディングス	32,500	1,641.00	53,332,500	
イントラスト	1,800	810.00	1,458,000	
アルヒ	6,600	800.00	5,280,000	
プレミアグループ	9,700	1,684.00	16,334,800	
日産自動車	831,800	574.80	478,118,640	
いすゞ自動車	170,200	1,896.00	322,699,200	
トヨタ自動車	3,215,300	2,705.50	8,698,994,150	
日野自動車	88,100	478.50	42,155,850	
三菱自動車工業	228,400	463.40	105,840,560	
エフテック	1,400	648.00	907,200	
武蔵精密工業	14,300	1,504.00	21,507,200	
日産車体	6,900	910.00	6,279,000	
新明和工業	16,900	1,166.00	19,705,400	
極東開発工業	9,700	1,913.00	18,556,100	
トピー工業	4,700	2,616.00	12,295,200	
ティラド	2,500	3,030.00	7,575,000	
タチエス	10,800	1,712.00	18,489,600	
ＮＯＫ	22,700	1,869.50	42,437,650	
フタバ産業	15,700	794.00	12,465,800	
カヤバ	5,600	4,740.00	26,544,000	
市光工業	10,500	550.00	5,775,000	
大同メタル工業	11,400	563.00	6,418,200	
プレス工業	23,400	594.00	13,899,600	
ミクニ	3,600	466.00	1,677,600	
太平洋工業	13,400	1,341.00	17,969,400	
アイシン	45,200	5,141.00	232,373,200	
マツダ	193,700	1,544.00	299,072,800	
今仙電機製作所	2,500	594.00	1,485,000	
本田技研工業	1,428,000	1,494.50	2,134,146,000	
スズキ	107,500	5,742.00	617,265,000	

ＳＵＢＡＲＵ	185,300	2,598.00	481,409,400	
ヤマハ発動機	84,400	3,793.00	320,129,200	
小糸製作所	63,400	2,252.00	142,776,800	
エクセディ	9,600	2,478.00	23,788,800	
ミツバ	11,000	950.00	10,450,000	
豊田合成	17,100	2,721.00	46,529,100	
愛三工業	9,700	1,263.00	12,251,100	
盟和産業	4,600	988.00	4,544,800	
ヨロズ	6,100	882.00	5,380,200	
エフ・シー・シー	10,400	1,772.00	18,428,800	
シマノ	23,800	22,505.00	535,619,000	
テイ・エス　テック	20,800	1,742.00	36,233,600	
三十三フィナンシャルグループ	5,200	1,884.00	9,796,800	
第四北越フィナンシャルグループ	9,100	4,075.00	37,082,500	
ひろぎんホールディングス	82,100	958.50	78,692,850	
マーキュリアホールディングス	1,400	733.00	1,026,200	
おきなわフィナンシャルグループ	4,900	2,429.00	11,902,100	
ダイレクトマーケティングミックス	14,100	451.00	6,359,100	
ポピンズ	4,500	1,081.00	4,864,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	4,700	2,087.00	9,808,900	
十六フィナンシャルグループ	7,500	3,920.00	29,400,000	
北國フィナンシャルホールディングス	6,100	4,880.00	29,768,000	
ネットプロテクションズホールディングス	20,700	187.00	3,870,900	
プロクレアホールディングス	6,600	1,904.00	12,566,400	
あいちフィナンシャルグループ	8,900	2,369.00	21,084,100	
ジャムコ	3,700	1,495.00	5,531,500	
小野建	6,100	1,683.00	10,266,300	
はるやまホールディングス	5,300	540.00	2,862,000	
南陽	1,400	2,051.00	2,871,400	
ノジマ	18,000	1,479.00	26,622,000	
佐鳥電機	3,000	2,015.00	6,045,000	
カッパ・クリエイト	9,700	1,639.00	15,898,300	
伯東	3,500	5,320.00	18,620,000	
コンドーテック	4,900	1,166.00	5,713,400	
中山福	13,500	358.00	4,833,000	
ライトオン	6,600	455.00	3,003,000	
ナガイレーベン	7,800	2,350.00	18,330,000	
三菱食品	5,700	5,100.00	29,070,000	
良品計画	67,600	2,231.50	150,849,400	
松田産業	4,700	2,379.00	11,181,300	
第一興商	24,000	2,140.50	51,372,000	
メディパルホールディングス	64,200	2,359.00	151,447,800	
アドヴァングループ	5,900	1,060.00	6,254,000	
ＳＰＫ	2,900	1,812.00	5,254,800	
萩原電気ホールディングス	2,600	4,700.00	12,220,000	
アルビス	2,200	2,596.00	5,711,200	
アズワン	9,700	5,352.00	51,914,400	
スズデン	2,500	2,289.00	5,722,500	
シモジマ	4,800	1,222.00	5,865,600	

ドウシシャ	5,700	2,075.00	11,827,500	
小津産業	2,300	1,598.00	3,675,400	
高速	3,700	2,018.00	7,466,600	
ハウス　オブ　ローゼ	2,800	1,602.00	4,485,600	
Ｇ－７ホールディングス	6,800	1,163.00	7,908,400	
イオン北海道	18,300	903.00	16,524,900	
コジマ	10,200	754.00	7,690,800	
ヒマラヤ	400	922.00	368,800	
コーナン商事	7,600	3,740.00	28,424,000	
ネットワンシステムズ	23,700	2,305.00	54,628,500	
エコス	2,500	2,233.00	5,582,500	
ワタミ	6,500	1,028.00	6,682,000	
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	125,100	3,371.00	421,712,100	
丸文	5,500	1,459.00	8,024,500	
西松屋チェーン	12,200	2,164.00	26,400,800	
ゼンショーホールディングス	30,500	7,372.00	224,846,000	
ハピネット	5,300	2,577.00	13,658,100	
橋本総業ホールディングス	4,500	1,298.00	5,841,000	
日本ライフライン	18,200	1,196.00	21,767,200	
サイゼリヤ	9,200	5,210.00	47,932,000	
ＶＴホールディングス	23,500	515.00	12,102,500	
アルゴグラフィックス	5,400	3,625.00	19,575,000	
魚力	2,500	2,247.00	5,617,500	
ＩＤＯＭ	16,400	932.00	15,284,800	
日本エム・ディ・エム	7,600	722.00	5,487,200	
フジ・コーポレーション	3,100	1,600.00	4,960,000	
ユナイテッドアローズ	7,300	1,968.00	14,366,400	
進和	3,800	2,379.00	9,040,200	
ダイトロン	2,400	2,789.00	6,693,600	
ハイデイ日高	9,200	2,671.00	24,573,200	
シークス	8,800	1,471.00	12,944,800	
コロワイド	26,600	2,168.50	57,682,100	
田中商事	7,100	704.00	4,998,400	
オーハシテクニカ	3,300	1,801.00	5,943,300	
壱番屋	4,900	5,320.00	26,068,000	
白銅	2,500	2,162.00	5,405,000	
スギホールディングス	12,500	6,445.00	80,562,500	
薬王堂ホールディングス	3,000	2,675.00	8,025,000	
島津製作所	77,800	3,925.00	305,365,000	
ＪＭＳ	10,300	509.00	5,242,700	
長野計器	4,300	2,003.00	8,612,900	
ブイ・テクノロジー	3,100	2,448.00	7,588,800	
スター精密	11,000	1,775.00	19,525,000	
東京計器	4,500	1,612.00	7,254,000	
愛知時計電機	2,600	2,250.00	5,850,000	
インターアクション	5,400	952.00	5,140,800	
東京精密	12,000	8,053.00	96,636,000	
マニー	23,400	2,163.00	50,614,200	
ニコン	84,700	1,385.00	117,309,500	

トプコン	28,500	1,481.50	42,222,750	
オリンパス	360,400	2,112.50	761,345,000	
理研計器	4,100	6,390.00	26,199,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	20,000	11,115.00	222,300,000	
キヤノン電子	6,500	1,952.00	12,688,000	
タムロン	3,600	4,960.00	17,856,000	
ＨＯＹＡ	116,300	16,920.00	1,967,796,000	
ノーリツ鋼機	5,500	2,893.00	15,911,500	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	8,500	1,841.00	15,648,500	
朝日インテック	65,400	2,796.00	182,858,400	
キヤノン	292,100	3,802.00	1,110,564,200	
リコー	146,800	1,135.00	166,618,000	
シチズン時計	53,900	834.00	44,952,600	
メニコン	20,100	2,328.00	46,792,800	
スノーピーク	8,400	876.00	7,358,400	
パラマウントベッドホールディングス	12,200	2,798.00	34,135,600	
トランザクション	3,900	2,137.00	8,334,300	
ニホンフラッシュ	6,200	900.00	5,580,000	
前田工繊	4,900	3,045.00	14,920,500	
アートネイチャー	6,700	785.00	5,259,500	
バンダイナムコホールディングス	160,400	2,808.00	450,403,200	
ＳＨＯＥＩ	13,200	1,862.00	24,578,400	
フランスベッドホールディングス	7,600	1,293.00	9,826,800	
マーベラス	9,500	689.00	6,545,500	
パイロットコーポレーション	8,200	4,321.00	35,432,200	
萩原工業	3,900	1,595.00	6,220,500	
エイベックス	10,000	1,381.00	13,810,000	
フジシールインターナショナル	11,900	1,692.00	20,134,800	
タカラトミー	26,600	2,020.00	53,732,000	
広済堂ホールディングス	13,000	753.00	9,789,000	
レック	7,500	999.00	7,492,500	
プロネクサス	6,100	1,256.00	7,661,600	
きもと	5,500	187.00	1,028,500	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	72,000	3,923.00	282,456,000	
大日本印刷	64,000	4,271.00	273,344,000	
共同印刷	1,700	3,430.00	5,831,000	
ＮＩＳＳＨＡ	10,000	1,490.00	14,900,000	
藤森工業	4,600	3,725.00	17,135,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,700	2,509.00	9,283,300	
前澤化成工業	3,800	1,558.00	5,920,400	
未来工業	2,100	3,090.00	6,489,000	
アシックス	49,900	4,852.00	242,114,800	
ツツミ	2,300	2,140.00	4,922,000	
ＪＳＰ	4,100	1,780.00	7,298,000	
ニチハ	7,400	2,777.00	20,549,800	
ローランド	4,300	4,295.00	18,468,500	
エフピコ	11,100	2,763.00	30,669,300	
小松ウオール工業	2,400	2,856.00	6,854,400	
ヤマハ	36,900	3,216.00	118,670,400	
河合楽器製作所	1,800	3,270.00	5,886,000	

クリナップ	7,800	679.00	5,296,200	
ピジョン	37,300	1,625.00	60,612,500	
天馬	4,300	2,328.00	10,010,400	
キングジム	6,100	864.00	5,270,400	
象印マホービン	15,900	1,488.00	23,659,200	
リンテック	11,800	2,612.00	30,821,600	
信越ポリマー	12,700	1,409.00	17,894,300	
東リ	11,300	331.00	3,740,300	
イトーキ	12,000	1,241.00	14,892,000	
任天堂	369,700	6,890.00	2,547,233,000	
三菱鉛筆	8,300	1,947.00	16,160,100	
松風	2,600	2,777.00	7,220,200	
タカラスタンダード	12,300	1,795.00	22,078,500	
コクヨ	24,000	2,312.00	55,488,000	
ナカバヤシ	10,600	542.00	5,745,200	
ニフコ	17,600	3,607.00	63,483,200	
グローブライド	5,300	1,909.00	10,117,700	
オカムラ	17,600	2,083.00	36,660,800	
バルカー	4,900	3,845.00	18,840,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,800	1,909.00	3,436,200	
伊藤忠商事	416,500	5,865.00	2,442,772,500	
丸紅	516,500	2,282.00	1,178,653,000	
スクロール	9,200	954.00	8,776,800	
ヨンドシーホールディングス	5,900	1,986.00	11,717,400	
長瀬産業	28,400	2,294.50	65,163,800	
蝶理	3,900	2,720.00	10,608,000	
豊田通商	54,300	8,340.00	452,862,000	
オンワードホールディングス	34,600	503.00	17,403,800	
三共生興	8,600	720.00	6,192,000	
兼松	25,900	2,040.00	52,836,000	
美津濃	5,800	3,895.00	22,591,000	
三井物産	466,800	5,238.00	2,445,098,400	
日本紙パルプ商事	3,000	4,970.00	14,910,000	
東京エレクトロン	123,900	23,005.00	2,850,319,500	
カメイ	6,600	1,624.00	10,718,400	
ＯＵＧホールディングス	1,700	2,390.00	4,063,000	
スターゼン	4,300	2,459.00	10,573,700	
セイコーグループ	8,200	2,485.00	20,377,000	
山善	18,800	1,224.00	23,011,200	
椿本興業	1,300	6,490.00	8,437,000	
住友商事	375,000	3,117.00	1,168,875,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	19,200	4,260.00	81,792,000	
内田洋行	2,500	6,720.00	16,800,000	
三菱商事	409,200	6,838.00	2,798,109,600	
第一実業	5,800	1,892.00	10,973,600	
キヤノンマーケティングジャパン	14,400	3,889.00	56,001,600	
西華産業	2,500	2,833.00	7,082,500	
佐藤商事	4,300	1,430.00	6,149,000	
菱洋エレクトロ	5,900	3,635.00	21,446,500	
東京産業	6,600	839.00	5,537,400	

ユアサ商事	4,800	4,640.00	22,272,000	
神鋼商事	1,600	5,720.00	9,152,000	
阪和興業	11,100	4,580.00	50,838,000	
正栄食品工業	4,100	4,460.00	18,286,000	
カナデン	4,700	1,523.00	7,158,100	
ＲＹＯＤＥＮ	5,000	2,640.00	13,200,000	
ニプロ	48,800	1,116.50	54,485,200	
岩谷産業	14,100	6,455.00	91,015,500	
ナイス	2,900	1,612.00	4,674,800	
極東貿易	3,700	1,912.00	7,074,400	
アステナホールディングス	11,600	477.00	5,533,200	
三愛オブリ	14,900	1,656.00	24,674,400	
稲畑産業	12,200	3,175.00	38,735,000	
ＧＳＩクレオス	3,300	2,056.00	6,784,800	
明和産業	8,400	647.00	5,434,800	
ゴールドウイン	10,400	11,250.00	117,000,000	
ユニ・チャーム	122,400	4,924.00	602,697,600	
デサント	10,100	3,940.00	39,794,000	
ワキタ	10,300	1,585.00	16,325,500	
ヤマトインターナショナル	14,100	299.00	4,215,900	
東邦ホールディングス	17,100	3,317.00	56,720,700	
サンゲツ	14,300	2,892.00	41,355,600	
ミツウロコグループホールディングス	7,900	1,425.00	11,257,500	
シナネンホールディングス	1,700	4,100.00	6,970,000	
伊藤忠エネクス	15,400	1,646.00	25,348,400	
サンリオ	17,600	5,721.00	100,689,600	
サンワ　テクノス	3,200	2,176.00	6,963,200	
リョーサン	4,400	4,885.00	21,494,000	
新光商事	8,300	1,158.00	9,611,400	
トーホー	2,400	3,170.00	7,608,000	
三信電気	2,500	2,195.00	5,487,500	
東陽テクニカ	6,300	1,389.00	8,750,700	
モスフードサービス	9,100	3,255.00	29,620,500	
加賀電子	5,700	6,390.00	36,423,000	
三益半導体工業	4,700	2,650.00	12,455,000	
都築電気	3,100	2,193.00	6,798,300	
立花エレテック	4,100	2,811.00	11,525,100	
木曽路	9,400	2,495.00	23,453,000	
ＳＲＳホールディングス	10,200	1,046.00	10,669,200	
リテールパートナーズ	9,200	1,711.00	15,741,200	
上新電機	6,100	2,399.00	14,633,900	
日本瓦斯	32,800	2,354.00	77,211,200	
ロイヤルホールディングス	10,900	2,555.00	27,849,500	
東天紅	5,400	827.00	4,465,800	
いなげや	6,000	1,369.00	8,214,000	
チヨダ	6,500	882.00	5,733,000	
ライフコーポレーション	6,500	3,430.00	22,295,000	
リンガーハット	8,000	2,327.00	18,616,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	8,900	622.00	5,535,800	
ＡＯＫＩホールディングス	13,300	1,166.00	15,507,800	

オークワ	8,900	828.00	7,369,200	
コメリ	9,500	3,165.00	30,067,500	
青山商事	13,200	1,566.00	20,671,200	
しまむら	7,300	16,265.00	118,734,500	
高島屋	42,800	2,020.00	86,456,000	
松屋	10,500	923.00	9,691,500	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	27,400	1,614.00	44,223,600	
近鉄百貨店	2,700	2,650.00	7,155,000	
丸井グループ	41,100	2,329.00	95,721,900	
クレディセゾン	36,500	2,580.50	94,188,250	
アクシアル　リテイリング	4,200	3,885.00	16,317,000	
イオン	210,000	3,090.00	648,900,000	
イズミ	11,000	3,580.00	39,380,000	
平和堂	10,400	2,229.00	23,181,600	
フジ	9,500	1,875.00	17,812,500	
ヤオコー	7,000	8,370.00	58,590,000	
ゼビオホールディングス	8,400	956.00	8,030,400	
ケーズホールディングス	43,800	1,331.50	58,319,700	
ＰＡＬＴＡＣ	8,400	4,767.00	40,042,800	
三谷産業	16,800	332.00	5,577,600	
日産東京販売ホールディングス	4,800	433.00	2,078,400	
あおぞら銀行	41,400	3,087.00	127,801,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	3,611,800	1,280.50	4,624,909,900	
りそなホールディングス	672,500	813.10	546,809,750	
三井住友トラスト・ホールディングス	103,600	5,603.00	580,470,800	
三井住友フィナンシャルグループ	410,000	7,363.00	3,018,830,000	
千葉銀行	160,700	1,147.00	184,322,900	
群馬銀行	111,900	781.10	87,405,090	
武蔵野銀行	8,000	2,897.00	23,176,000	
千葉興業銀行	9,500	843.00	8,008,500	
筑波銀行	25,300	261.00	6,603,300	
七十七銀行	16,800	3,875.00	65,100,000	
秋田銀行	3,900	2,018.00	7,870,200	
山形銀行	6,400	1,113.00	7,123,200	
岩手銀行	3,600	2,509.00	9,032,400	
東邦銀行	45,600	310.00	14,136,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	50,200	3,505.00	175,951,000	
スルガ銀行	50,900	817.00	41,585,300	
八十二銀行	123,800	838.60	103,818,680	
山梨中央銀行	6,500	1,825.00	11,862,500	
大垣共立銀行	11,000	1,904.00	20,944,000	
福井銀行	5,200	1,606.00	8,351,200	
清水銀行	3,400	1,567.00	5,327,800	
富山銀行	1,100	1,698.00	1,867,800	
滋賀銀行	9,600	3,685.00	35,376,000	
南都銀行	8,700	2,489.00	21,654,300	
百五銀行	54,300	576.00	31,276,800	
紀陽銀行	20,600	1,562.00	32,177,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	35,700	1,581.50	56,459,550	
山陰合同銀行	36,100	994.00	35,883,400	

百十四銀行	5,700	2,553.00	14,552,100	
四国銀行	8,500	987.00	8,389,500	
阿波銀行	8,100	2,485.00	20,128,500	
大分銀行	3,500	2,569.00	8,991,500	
宮崎銀行	3,500	2,582.00	9,037,000	
佐賀銀行	3,400	1,877.00	6,381,800	
琉球銀行	12,300	1,147.00	14,108,100	
セブン銀行	180,800	305.80	55,288,640	
みずほフィナンシャルグループ	778,400	2,506.00	1,950,670,400	
山口フィナンシャルグループ	56,500	1,350.00	76,275,000	
芙蓉総合リース	5,300	12,010.00	63,653,000	
みずほリース	9,700	4,955.00	48,063,500	
東京センチュリー	10,800	5,916.00	63,892,800	
ＳＢＩホールディングス	84,400	3,233.00	272,865,200	
日本証券金融	21,200	1,559.00	33,050,800	
アイフル	84,900	385.00	32,686,500	
名古屋銀行	3,700	5,690.00	21,053,000	
北洋銀行	87,400	374.00	32,687,600	
大光銀行	1,200	1,326.00	1,591,200	
愛媛銀行	7,800	988.00	7,706,400	
京葉銀行	24,200	718.00	17,375,600	
栃木銀行	28,800	314.00	9,043,200	
北日本銀行	2,400	2,114.00	5,073,600	
東和銀行	10,600	617.00	6,540,200	
リコーリース	5,500	4,725.00	25,987,500	
イオンフィナンシャルサービス	33,100	1,260.50	41,722,550	
アコム	102,900	337.90	34,769,910	
ジャックス	6,100	5,130.00	31,293,000	
オリエントコーポレーション	18,800	1,068.00	20,078,400	
オリックス	351,500	2,660.50	935,165,750	
三菱ＨＣキャピタル	257,000	973.10	250,086,700	
ジャフコ　グループ	17,200	1,684.50	28,973,400	
トモニホールディングス	46,600	379.00	17,661,400	
大和証券グループ本社	446,800	976.80	436,434,240	
野村ホールディングス	969,800	607.10	588,765,580	
岡三証券グループ	50,600	710.00	35,926,000	
丸三証券	19,200	856.00	16,435,200	
東洋証券	17,400	302.00	5,254,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	68,500	546.00	37,401,000	
光世証券	3,400	528.00	1,795,200	
水戸証券	17,000	431.00	7,327,000	
いちよし証券	10,800	717.00	7,743,600	
松井証券	28,400	739.00	20,987,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	91,400	7,246.00	662,284,400	
日本取引所グループ	150,500	2,918.00	439,159,000	
マネックスグループ	56,500	675.00	38,137,500	
極東証券	7,900	1,035.00	8,176,500	
岩井コスモホールディングス	6,600	1,751.00	11,556,600	
アイザワ証券グループ	8,300	1,159.00	9,619,700	

フィデアホールディングス	6,000	1,522.00	9,132,000	
池田泉州ホールディングス	80,000	344.00	27,520,000	
アニコム　ホールディングス	19,600	549.00	10,760,400	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	129,200	5,644.00	729,204,800	
スパークス・グループ	6,400	1,534.00	9,817,600	
第一生命ホールディングス	281,800	3,084.00	869,071,200	
東京海上ホールディングス	570,100	3,766.00	2,146,996,600	
イー・ギャランティ	9,400	1,880.00	17,672,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,800	3,325.00	9,310,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	167,700	2,323.00	389,567,100	
アドバンスクリエイト	5,700	1,001.00	5,705,700	
三井不動産	266,700	3,515.00	937,450,500	
三菱地所	377,000	1,937.00	730,249,000	
平和不動産	9,400	3,855.00	36,237,000	
東京建物	50,400	2,109.50	106,318,800	
京阪神ビルディング	10,800	1,403.00	15,152,400	
住友不動産	83,400	4,299.00	358,536,600	
テーオーシー	10,300	681.00	7,014,300	
東京楽天地	1,300	6,800.00	8,840,000	
レオパレス２１	57,800	447.00	25,836,600	
スターツコーポレーション	8,300	2,779.00	23,065,700	
フジ住宅	7,600	696.00	5,289,600	
空港施設	9,700	569.00	5,519,300	
ゴールドクレスト	4,700	2,130.00	10,011,000	
リログループ	30,200	1,581.00	47,746,200	
エスリード	2,700	3,195.00	8,626,500	
日神グループホールディングス	10,700	486.00	5,200,200	
日本エスコン	10,800	918.00	9,914,400	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	26,500	444.00	11,766,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	5,600	854.00	4,782,400	
イオンモール	29,900	1,731.00	51,756,900	
ファースト住建	1,500	1,077.00	1,615,500	
カチタス	15,500	2,126.00	32,953,000	
東祥	5,500	779.00	4,284,500	
トーセイ	9,600	1,797.00	17,251,200	
サンフロンティア不動産	8,500	1,558.00	13,243,000	
ＦＪネクストホールディングス	6,100	1,103.00	6,728,300	
グランディハウス	8,700	591.00	5,141,700	
東武鉄道	64,300	3,860.00	248,198,000	
相鉄ホールディングス	21,000	2,735.00	57,435,000	
東急	164,200	1,745.00	286,529,000	
京浜急行電鉄	72,500	1,286.00	93,235,000	
小田急電鉄	96,800	2,223.00	215,186,400	
京王電鉄	28,100	4,422.00	124,258,200	
京成電鉄	37,800	6,626.00	250,462,800	
富士急行	7,200	4,335.00	31,212,000	
東日本旅客鉄道	107,600	8,189.00	881,136,400	
西日本旅客鉄道	69,500	5,928.00	411,996,000	
東海旅客鉄道	225,500	3,626.00	817,663,000	

西武ホールディングス	70,800	1,989.50	140,856,600	
鴻池運輸	10,000	1,892.00	18,920,000	
西日本鉄道	15,600	2,434.00	37,970,400	
ハマキョウレックス	5,000	3,935.00	19,675,000	
サカイ引越センター	6,500	2,668.00	17,342,000	
近鉄グループホールディングス	58,500	4,296.00	251,316,000	
阪急阪神ホールディングス	78,000	4,540.00	354,120,000	
南海電気鉄道	26,100	2,878.00	75,115,800	
京阪ホールディングス	32,200	3,730.00	120,106,000	
神戸電鉄	2,000	2,925.00	5,850,000	
名古屋鉄道	60,300	2,229.50	134,438,850	
山陽電気鉄道	4,400	2,119.00	9,323,600	
アルプス物流	4,700	1,632.00	7,670,400	
トランコム	1,700	7,400.00	12,580,000	
ヤマトホールディングス	74,900	2,694.50	201,818,050	
山九	14,900	4,987.00	74,306,300	
日新	4,400	2,450.00	10,780,000	
丸全昭和運輸	3,600	3,790.00	13,644,000	
センコーグループホールディングス	31,000	1,053.00	32,643,000	
トナミホールディングス	1,300	4,750.00	6,175,000	
ニッコンホールディングス	18,700	3,089.00	57,764,300	
福山通運	6,700	3,890.00	26,063,000	
セイノーホールディングス	32,900	2,116.00	69,616,400	
神奈川中央交通	1,800	3,010.00	5,418,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	14,100	1,479.00	20,853,900	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	5,600	1,517.00	8,495,200	
日本郵船	167,600	3,918.00	656,656,800	
商船三井	126,900	4,051.00	514,071,900	
川崎汽船	49,400	5,087.00	251,297,800	
ＮＳユナイテッド海運	3,100	4,765.00	14,771,500	
明海グループ	3,400	700.00	2,380,000	
飯野海運	21,500	1,179.00	25,348,500	
共栄タンカー	600	823.00	493,800	
九州旅客鉄道	41,300	3,184.00	131,499,200	
ＳＧホールディングス	98,200	2,095.50	205,778,100	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	19,800	7,990.00	158,202,000	
ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス	3,600	3,210.00	11,556,000	
日本航空	143,600	2,870.00	412,132,000	
ＡＮＡホールディングス	159,100	3,106.00	494,164,600	
パスコ	600	1,710.00	1,026,000	
ＴＲＥホールディングス	11,500	1,026.00	11,799,000	
人・夢・技術グループ	3,300	1,740.00	5,742,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,600	5,480.00	8,768,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	2,700	5,710.00	15,417,000	
ＫＰＰグループホールディングス	16,000	708.00	11,328,000	
ナルミヤ・インターナショナル	3,300	1,150.00	3,795,000	
ギフトホールディングス	2,600	2,013.00	5,233,800	
三菱倉庫	14,400	4,497.00	64,756,800	

三井倉庫ホールディングス	5,500	4,780.00	26,290,000	
住友倉庫	15,800	2,532.00	40,005,600	
澁澤倉庫	2,700	2,802.00	7,565,400	
ヤマタネ	2,700	2,303.00	6,218,100	
乾汽船	6,900	1,136.00	7,838,400	
日本トランスシティ	11,800	631.00	7,445,800	
中央倉庫	5,100	1,115.00	5,686,500	
安田倉庫	4,300	1,148.00	4,936,400	
大栄環境	10,900	2,166.00	23,609,400	
日本管財ホールディングス	6,300	2,501.00	15,756,300	
上組	28,000	3,335.00	93,380,000	
キユーソー流通システム	5,700	892.00	5,084,400	
エーアイテイー	3,700	1,699.00	6,286,300	
内外トランスライン	2,300	2,476.00	5,694,800	
日本コンセプト	3,200	1,647.00	5,270,400	
ＴＢＳホールディングス	30,100	2,949.50	88,779,950	
日本テレビホールディングス	52,000	1,494.50	77,714,000	
朝日放送グループホールディングス	8,200	643.00	5,272,600	
テレビ朝日ホールディングス	14,300	1,644.00	23,509,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	45,600	657.00	29,959,200	
テレビ東京ホールディングス	4,200	2,970.00	12,474,000	
ビジョン	8,800	1,170.00	10,296,000	
ＵＳＥＮ−ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,600	3,690.00	24,354,000	
日本通信	57,800	226.00	13,062,800	
日本電信電話	17,469,200	172.00	3,004,702,400	
ＫＤＤＩ	453,800	4,525.00	2,053,445,000	
ソフトバンク	944,800	1,809.00	1,709,143,200	
光通信	5,900	22,920.00	135,228,000	
エムティーアイ	5,200	579.00	3,010,800	
GMOインターネットグループ	21,700	2,467.00	53,533,900	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	31,000	2,547.50	78,972,500	
学研ホールディングス	9,800	996.00	9,760,800	
ゼンリン	10,000	874.00	8,740,000	
東京電力ホールディングス	527,800	891.60	470,586,480	
中部電力	215,800	2,065.00	445,627,000	
関西電力	226,100	2,077.50	469,722,750	
中国電力	101,700	1,060.00	107,802,000	
北陸電力	59,900	764.50	45,793,550	
東北電力	154,200	1,008.50	155,510,700	
四国電力	54,500	1,095.50	59,704,750	
九州電力	135,000	1,045.00	141,075,000	
北海道電力	56,600	670.40	37,944,640	
沖縄電力	15,000	1,136.00	17,040,000	
電源開発	48,100	2,396.00	115,247,600	
エフオン	2,400	469.00	1,125,600	
イーレックス	10,400	545.00	5,668,000	
レノバ	15,600	1,059.00	16,520,400	
東京瓦斯	123,800	3,569.00	441,842,200	
大阪瓦斯	118,600	2,949.00	349,751,400	

東邦瓦斯	25,400	2,803.00	71,196,200	
北海道瓦斯	3,500	2,260.00	7,910,000	
広島ガス	13,900	383.00	5,323,700	
西部ガスホールディングス	6,100	1,942.00	11,846,200	
静岡ガス	11,700	1,080.00	12,636,000	
メタウォーター	7,000	2,007.00	14,049,000	
M&A総研ホールディングス	2,900	4,120.00	11,948,000	
アイネット	3,600	1,784.00	6,422,400	
松竹	3,100	9,523.00	29,521,300	
東宝	32,700	5,426.00	177,430,200	
エイチ・アイ・エス	17,500	1,794.00	31,395,000	
東映	1,900	19,480.00	37,012,000	
ラックランド	2,700	2,690.00	7,263,000	
ＮＴＴデータグループ	153,600	1,761.50	270,566,400	
共立メンテナンス	9,400	5,798.00	54,501,200	
イチネンホールディングス	6,400	1,501.00	9,606,400	
建設技術研究所	3,100	5,080.00	15,748,000	
スペース	6,000	937.00	5,622,000	
アインホールディングス	8,500	4,793.00	40,740,500	
燦ホールディングス	5,600	1,129.00	6,322,400	
ピー・シー・エー	5,000	1,154.00	5,770,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,600	2,079.00	5,405,400	
ナガワ	1,900	6,820.00	12,958,000	
東京都競馬	5,000	4,405.00	22,025,000	
カナモト	9,300	2,846.00	26,467,800	
ＤＴＳ	12,500	3,535.00	44,187,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	26,800	5,006.00	134,160,800	
シーイーシー	7,400	1,731.00	12,809,400	
カプコン	52,500	4,813.00	252,682,500	
ニシオホールディングス	5,600	3,850.00	21,560,000	
アイ・エス・ビー	4,200	1,518.00	6,375,600	
日本空港ビルデング	20,400	6,348.00	129,499,200	
トランス・コスモス	7,500	2,992.00	22,440,000	
乃村工藝社	26,300	849.00	22,328,700	
ジャステック	3,600	1,487.00	5,353,200	
ＳＣＳＫ	41,100	2,797.50	114,977,250	
藤田観光	2,400	4,385.00	10,524,000	
トーカイ	5,300	1,958.00	10,377,400	
セコム	61,300	10,490.00	643,037,000	
ＮＳＷ	2,600	2,879.00	7,485,400	
セントラル警備保障	3,200	2,465.00	7,888,000	
アイネス	4,600	1,629.00	7,493,400	
丹青社	11,700	880.00	10,296,000	
メイテックグループホールディングス	21,700	2,820.00	61,194,000	
ＴＫＣ	9,300	3,520.00	32,736,000	
富士ソフト	11,800	6,090.00	71,862,000	
応用地質	5,600	2,057.00	11,519,200	
船井総研ホールディングス	12,500	2,493.00	31,162,500	
ＮＳＤ	21,000	2,772.00	58,212,000	

コナミグループ	22,000	7,558.00	166,276,000	
学究社	2,700	1,942.00	5,243,400	
ベネッセホールディングス	20,200	2,632.50	53,176,500	
イオンディライト	6,700	3,590.00	24,053,000	
ナック	5,700	984.00	5,608,800	
福井コンピュータホールディングス	3,600	2,593.00	9,334,800	
ダイセキ	12,300	3,815.00	46,924,500	
ステップ	3,200	1,892.00	6,054,400	
泉州電業	3,100	3,450.00	10,695,000	
元気寿司	3,500	3,350.00	11,725,000	
トラスコ中山	13,000	2,400.00	31,200,000	
ヤマダホールディングス	190,500	431.70	82,238,850	
オートバックスセブン	21,600	1,581.50	34,160,400	
モリト	4,400	1,300.00	5,720,000	
アークランズ	18,400	1,693.00	31,151,200	
ニトリホールディングス	22,600	18,045.00	407,817,000	
愛眼	1,400	181.00	253,400	
ケーユーホールディングス	5,000	1,094.00	5,470,000	
吉野家ホールディングス	22,800	3,146.00	71,728,800	
加藤産業	7,700	4,800.00	36,960,000	
イノテック	3,900	1,648.00	6,427,200	
イエローハット	9,800	1,779.00	17,434,200	
松屋フーズホールディングス	2,900	5,200.00	15,080,000	
ＪＢＣＣホールディングス	3,900	3,485.00	13,591,500	
ＪＫホールディングス	5,700	979.00	5,580,300	
サガミホールディングス	9,300	1,356.00	12,610,800	
日伝	4,200	2,732.00	11,474,400	
関西フードマーケット	4,200	1,437.00	6,035,400	
ミロク情報サービス	5,300	1,657.00	8,782,100	
北沢産業	10,100	271.00	2,737,100	
杉本商事	3,000	2,166.00	6,498,000	
因幡電機産業	16,100	3,280.00	52,808,000	
王将フードサービス	4,600	8,130.00	37,398,000	
ミニストップ	4,500	1,527.00	6,871,500	
アークス	11,400	2,817.00	32,113,800	
バローホールディングス	11,800	2,401.00	28,331,800	
東テク	2,100	4,730.00	9,933,000	
ミスミグループ本社	93,500	2,101.50	196,490,250	
ベルク	3,100	6,380.00	19,778,000	
大　庄	4,400	1,206.00	5,306,400	
ファーストリテイリング	27,900	35,450.00	989,055,000	
ソフトバンクグループ	289,700	5,764.00	1,669,830,800	
スズケン	23,600	4,990.00	117,764,000	
サンドラッグ	20,900	4,564.00	95,387,600	
サックスバー　ホールディングス	6,300	859.00	5,411,700	
ジェコス	5,700	1,055.00	6,013,500	
ヤマザワ	3,400	1,254.00	4,263,600	
ベルーナ	14,900	613.00	9,133,700	
合計	88,511,500		196,201,019,970	

（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）

	2023年12月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,752,189,141
金銭信託	44,199,259
コール・ローン	4,819,757,184
株式	787,563,559,838
投資証券	15,968,440,201
派生商品評価勘定	1,082,667,941
未収入金	49,088,887
未収配当金	1,054,948,042
差入委託証拠金	10,971,955,110
流動資産合計	824,306,805,603
資産合計	824,306,805,603
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	556,839,780
未払解約金	2,861,218,403
その他未払費用	36,630
流動負債合計	3,418,094,813
負債合計	3,418,094,813
純資産の部	
元本等	
元本	221,016,811,238
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	599,871,899,552
元本等合計	820,888,710,790
純資産合計	820,888,710,790
負債純資産合計	824,306,805,603

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12月11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。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、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。 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．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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12月11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	49,349,368,318円
同期中一部解約元本額	23,313,178,101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）	767,226,172円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,694,768,337円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,430,680,863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）	2,168,412,515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）	912,044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）	5,443,553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）	5,595,053円
ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ（適格機関投資家限定）	328,530,413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	158,049,236,382円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	39,278,952,663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）	2,581,712,370円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	396,744,271円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	173,033,143円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	451,985,471円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	665,458,344円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	13,022,962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）	92,289,910円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	7,727,022円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	10,145,460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）	3,645,793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）	20,884,327円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	311,153,819円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	200,369,579円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	385,530,745円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	182,064,226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）	161,280,130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）	264,287,622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）	162,449,208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）	159,136,989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）	158,477,385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）	141,578,971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）	30,652,089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）	6,496,960,147円
ＦＷニッセイ先進国株インデックス	56,052,493円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	59,013,958円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンドⅡ２０２３－０５（適格機関投資家限定）	100,283,727円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	1,113,082円
計	221,016,811,238円
２．　受益権の総数	221,016,811,238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　2022年12月13日 至　2023年12月11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	2023年12月11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	2023年12月11日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	16,314,581,399
投資証券	773,275,543
合計	17,087,856,942

（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（2023年11月21日から2023年12月11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	2023年12月11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	15,746,259,834	－	15,575,268,633	170,991,201
アメリカ・ドル	11,908,030,617	－	11,824,053,702	83,976,915
イギリス・ポンド	1,046,450,054	－	1,027,300,050	19,150,004
ユーロ	2,791,779,163	－	2,723,914,881	67,864,282
買建	16,916,576,489	－	16,390,317,528	△526,258,961
アメリカ・ドル	12,424,478,847	－	12,004,169,216	△420,309,631
イギリス・ポンド	1,458,818,465	－	1,440,661,250	△18,157,215
ユーロ	3,033,279,177	－	2,945,487,062	△87,792,115
合計	32,662,836,323	－	31,965,586,161	△355,267,760

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

株式関連

種類	2023年12月11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	15,539,284,279	－	16,420,380,201	881,095,922
合計	15,539,284,279	－	16,420,380,201	881,095,922

（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）

	2023年12月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.7141円 (37,141円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年12月11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	56,060	103.370	5,794,922.20	
	ABBOTT LABORATORIES	176,180	104.510	18,412,571.80	
	ABBVIE INC	179,201	149.280	26,751,125.28	
	ACCENTURE PLC	63,716	337.230	21,486,946.68	
	ADOBE INC	46,219	610.010	28,194,052.19	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	164,024	128.920	21,145,974.08	
	AECOM	13,377	91.230	1,220,383.71	
	AERCAP HOLDINGS NV	20,290	72.150	1,463,923.50	
	AES CORP	68,024	18.220	1,239,397.28	
	AFLAC INC	57,276	82.550	4,728,133.80	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,717	127.200	3,780,002.40	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	22,558	263.270	5,938,844.66	
	AIRBNB INC-CLASS A	43,282	140.680	6,088,911.76	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	15,388	114.410	1,760,541.08	
	ALBEMARLE CORP	11,916	127.990	1,525,128.84	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	35,030	22.190	777,315.70	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	7,382	221.230	1,633,119.86	
	ALLEGION PLC	8,911	110.340	983,239.74	
	ALLIANT ENERGY CORP	25,623	51.380	1,316,509.74	
	ALLSTATE CORP	26,554	139.320	3,699,503.28	
	ALLY FINANCIAL INC	27,543	30.080	828,493.44	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,699	170.040	2,159,337.96	
	ALPHABET INC-CL A	601,929	134.990	81,254,395.71	
	ALPHABET INC-CL C	530,388	136.640	72,472,216.32	
	ALTRIA GROUP INC	180,212	41.300	7,442,755.60	

AMAZON.COM INC	942,706	147.420	138,973,718.52	
AMCOR PLC	147,058	9.650	1,419,109.70	
AMEREN CORPORATION	26,655	78.020	2,079,623.10	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	52,292	79.640	4,164,534.88	
AMERICAN EXPRESS CO	63,555	168.430	10,704,568.65	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,329	115.820	848,844.78	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	72,214	65.530	4,732,183.42	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	19,762	131.350	2,595,738.70	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,412	357.580	3,723,122.96	
AMETEK INC	23,424	157.160	3,681,315.84	
AMGEN INC	54,304	269.120	14,614,292.48	
AMPHENOL CORP-CL A	60,563	93.230	5,646,288.49	
ANALOG DEVICES INC	50,601	184.880	9,355,112.88	
ANSYS INC	8,810	287.200	2,530,232.00	
AON PLC	20,593	324.100	6,674,191.30	
APA CORP	31,087	34.470	1,071,568.89	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	40,299	92.090	3,711,134.91	
APPLE INC	1,587,177	195.710	310,626,410.67	
APPLIED MATERIALS INC	84,915	147.720	12,543,643.80	
APTIV PLC	28,721	79.830	2,292,797.43	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	37,831	79.300	2,999,998.30	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,435	73.750	4,014,581.25	
ARES MANAGEMENT CORP - A	16,577	110.640	1,834,079.28	
ARISTA NETWORKS INC	26,718	224.030	5,985,633.54	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,884	240.960	5,273,168.64	
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,946	198.990	586,224.54	
ASSURANT INC	5,376	167.680	901,447.68	
AT&T INC	727,029	16.920	12,301,330.68	
ATLASSIAN CORP-CL A	15,752	192.360	3,030,054.72	
ATMOS ENERGY CORP	15,066	113.460	1,709,388.36	
AUTODESK INC	21,697	224.010	4,860,344.97	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	41,831	229.270	9,590,593.37	
AUTOZONE INC	1,813	2,620.490	4,750,948.37	
AVANTOR INC	68,626	20.980	1,439,773.48	
AVERY DENNISON CORP	8,183	191.710	1,568,762.93	
AXON ENTERPRISE INC	7,214	236.380	1,705,245.32	
BAKER HUGHES COMPANY	102,495	32.240	3,304,438.80	
BALL CORP	31,987	57.510	1,839,572.37	
BANK OF AMERICA CORP	726,022	30.960	22,477,641.12	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	79,017	49.060	3,876,574.02	
BATH & BODY WORKS INC	21,922	37.570	823,609.54	

BAXTER INTERNATIONAL INC	51,421	36.150	1,858,869.15	
BECTON DICKINSON & CO	29,450	232.300	6,841,235.00	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	21,580	50.590	1,091,732.20	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	132,789	353.080	46,885,140.12	
BEST BUY CO INC	19,883	73.990	1,471,143.17	
BILL HOLDINGS, INC.	9,745	70.980	691,700.10	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,196	304.130	667,869.48	
BIO-TECHNE CORP	16,083	68.310	1,098,629.73	
BIOGEN INC	14,698	239.290	3,517,084.42	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	19,111	92.940	1,776,176.34	
BLACKROCK INC	15,157	744.730	11,287,872.61	
BLACKSTONE INC	72,059	112.570	8,111,681.63	
BLOCK INC	55,791	69.170	3,859,063.47	
BOEING CO	58,174	244.700	14,235,177.80	
BOOKING HOLDINGS INC	3,624	3,275.000	11,868,600.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,299	125.290	1,666,231.71	
BORGWARNER INC	23,863	32.900	785,092.70	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	148,622	54.950	8,166,778.90	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	212,099	50.310	10,670,700.69	
BROADCOM INC	45,052	944.300	42,542,603.60	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	11,991	191.360	2,294,597.76	
BROWN & BROWN INC	24,467	74.150	1,814,228.05	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	31,513	55.080	1,735,736.04	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	12,689	147.700	1,874,165.30	
BUNGE GLOBAL SA	15,288	104.500	1,597,596.00	
BURLINGTON STORES INC	6,584	176.280	1,160,627.52	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,811	84.500	998,029.50	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	27,591	259.930	7,171,728.63	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,861	44.190	966,037.59	
CAMPBELL SOUP CO	19,675	42.910	844,254.25	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,716	118.090	4,571,972.44	
CARDINAL HEALTH INC	25,004	106.830	2,671,177.32	
CARLISLE COS INC	5,067	295.100	1,495,271.70	
CARLYLE GROUP INC/THE	21,920	36.930	809,505.60	
CARMAX INC	16,104	67.220	1,082,510.88	
CARNIVAL CORP	102,267	18.110	1,852,055.37	
CARRIER GLOBAL CORP	85,040	55.270	4,700,160.80	
CATALENT INC	18,309	37.180	680,728.62	
CATERPILLAR INC	51,789	259.500	13,439,245.50	

CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,701	178.720	1,912,482.72	
CBRE GROUP INC	31,458	82.690	2,601,262.02	
CDW CORP/DE	13,608	213.190	2,901,089.52	
CELANESE CORP-SERIES A	10,491	141.350	1,482,902.85	
CELSIUS HOLDINGS INC	15,231	50.900	775,257.90	
CENCORA, INC.	17,327	201.750	3,495,722.25	
CENTENE CORP	54,981	73.770	4,055,948.37	
CENTERPOINT ENERGY INC	64,006	28.770	1,841,452.62	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	15,011	67.170	1,008,288.87	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,576	76.560	1,498,738.56	
CHARLES RIVER LABORATORIES	5,209	204.460	1,065,032.14	
CHARLES SCHWAB CORP	152,759	64.070	9,787,269.13	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	9,874	367.550	3,629,188.70	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,485	145.720	1,382,154.20	
CHENIERE ENERGY INC	24,414	176.210	4,301,990.94	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,398	75.050	855,419.90	
CHEVRON CORP	184,199	144.310	26,581,757.69	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,801	2,242.950	6,282,502.95	
CHUBB LTD	41,691	222.910	9,293,340.81	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,984	92.940	2,322,012.96	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,923	102.800	1,636,884.40	
CINTAS CORP	9,305	553.330	5,148,735.65	
CISCO SYSTEMS INC	411,218	48.380	19,894,726.84	
CITIGROUP INC	195,473	48.890	9,556,674.97	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	47,925	29.610	1,419,059.25	
CLEVELAND-CLIFFS INC	51,641	17.380	897,520.58	
CLOROX CO	12,596	141.550	1,782,963.80	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	28,216	77.520	2,187,304.32	
CME GROUP INC	36,521	211.620	7,728,574.02	
CMS ENERGY CORP	29,580	58.150	1,720,077.00	
CNH INDUSTRIAL NV	101,405	11.110	1,126,609.55	
COCA-COLA CO	417,105	58.610	24,446,524.05	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	20,924	63.410	1,326,790.84	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	51,252	70.330	3,604,553.16	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	17,356	146.620	2,544,736.72	
COLGATE-PALMOLIVE CO	79,749	77.170	6,154,230.33	
COMCAST CORP	417,819	42.100	17,590,179.90	
CONAGRA BRANDS INC	48,579	29.520	1,434,052.08	
CONFLUENT INC-CLASS A	18,410	22.680	417,538.80	
CONOCOPHILLIPS	121,560	112.070	13,623,229.20	

CONSOLIDATED EDISON INC	35,003	91.550	3,204,524.65	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,779	234.440	3,933,668.76	
CONSTELLATION ENERGY	32,640	111.210	3,629,894.40	
COOPER COS INC/THE	5,024	335.000	1,683,040.00	
COPART INC	87,478	47.390	4,145,582.42	
CORNING INC	82,312	29.110	2,396,102.32	
CORTEVA INC	72,068	45.150	3,253,870.20	
COSTAR GROUP INC	41,464	82.390	3,416,218.96	
COSTCO WHOLESALE CORP	44,947	610.780	27,452,728.66	
COTERRA ENERGY INC	76,631	24.700	1,892,785.70	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	22,949	242.550	5,566,279.95	
CROWN HOLDINGS INC	12,237	88.530	1,083,341.61	
CSX CORP	203,625	32.960	6,711,480.00	
CUMMINS INC	14,384	230.580	3,316,662.72	
CVS HEALTH CORP	130,406	75.100	9,793,490.60	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,237	201.060	851,891.22	
DANAHER CORP	71,215	217.490	15,488,550.35	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,221	158.950	1,942,527.95	
DARLING INTERNATIONAL INC	16,199	47.590	770,910.41	
DATADOG INC - CLASS A	25,809	113.830	2,937,838.47	
DAVITA INC	5,556	107.580	597,714.48	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,653	695.380	1,844,843.14	
DEERE & CO	27,776	363.670	10,101,297.92	
DELL TECHNOLOGIES -C	25,985	68.700	1,785,169.50	
DELTA AIR LINES INC	16,279	40.350	656,857.65	
DEVON ENERGY CORPORATION	65,039	44.090	2,867,569.51	
DEXCOM INC	39,381	116.970	4,606,395.57	
DIAMONDBACK ENERGY INC	17,227	148.730	2,562,171.71	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,238	138.090	861,405.42	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	25,371	103.300	2,620,824.30	
DOCUSIGN INC	20,621	49.730	1,025,482.33	
DOLLAR GENERAL CORP	22,286	127.220	2,835,224.92	
DOLLAR TREE INC	21,218	124.410	2,639,731.38	
DOMINION ENERGY INC	84,976	47.490	4,035,510.24	
DOMINO'S PIZZA INC	3,541	394.900	1,398,340.90	
DOORDASH INC - A	26,001	100.000	2,600,100.00	
DOVER CORP	14,198	143.620	2,039,116.76	
DOW INC	71,397	50.920	3,635,535.24	
DR HORTON INC	30,902	138.460	4,278,690.92	
DRAFTKINGS INC	42,388	35.900	1,521,729.20	
DROPBOX INC-CLASS A	26,243	27.590	724,044.37	
DTE ENERGY COMPANY	20,927	108.610	2,272,881.47	
DUKE ENERGY CORP	78,243	94.390	7,385,356.77	

DUPONT DE NEMOURS INC	46,572	70.890	3,301,489.08	
DYNATRACE INC	25,297	54.130	1,369,326.61	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,038	84.850	1,021,424.30	
EATON CORP PLC	40,508	232.310	9,410,413.48	
EBAY INC	53,976	41.290	2,228,669.04	
ECOLAB INC	26,043	192.120	5,003,381.16	
EDISON INTERNATIONAL	38,899	67.450	2,623,737.55	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	61,708	69.180	4,268,959.44	
ELECTRONIC ARTS INC	26,122	137.140	3,582,371.08	
ELEVANCE HEALTH, INC	23,925	477.970	11,435,432.25	
ELI LILLY & CO	81,917	598.050	48,990,461.85	
EMERSON ELECTRIC CO	58,027	89.550	5,196,317.85	
ENPHASE ENERGY INC	13,849	103.010	1,426,585.49	
ENTEGRIS INC	15,243	106.990	1,630,848.57	
ENTERGY CORP	21,463	102.010	2,189,440.63	
EOG RESOURCES INC	59,105	118.960	7,031,130.80	
EPAM SYSTEMS INC	5,886	268.500	1,580,391.00	
EQT CORP	39,646	37.130	1,472,055.98	
EQUIFAX INC	12,459	228.380	2,845,386.42	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,179	32.120	1,129,949.48	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,581	305.750	789,140.75	
ESSENTIAL UTILITIES INC	25,557	36.000	920,052.00	
ESTEE LAUDER COS INC	23,583	133.730	3,153,754.59	
ETSY INC	12,493	80.080	1,000,439.44	
EVEREST GROUP LTD	4,402	384.780	1,693,801.56	
EVERGY INC	23,311	51.560	1,201,915.16	
EVERSOURCE ENERGY	35,458	59.650	2,115,069.70	
EXACT SCIENCES CORP	18,347	64.720	1,187,417.84	
EXELON CORP	100,985	39.210	3,959,621.85	
EXPEDIA GROUP INC	13,988	145.500	2,035,254.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	15,000	120.370	1,805,550.00	
EXXON MOBIL CORP	406,712	99.550	40,488,179.60	
F5 INC	6,015	170.820	1,027,482.30	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,871	443.890	1,718,298.19	
FAIR ISAAC CORP	2,522	1,134.390	2,860,931.58	
FASTENAL CO	58,000	62.290	3,612,820.00	
FEDEX CORP	24,241	272.210	6,598,642.61	
FERGUSON PLC	20,707	180.650	3,740,719.55	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	26,261	46.720	1,226,913.92	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	60,175	58.940	3,546,714.50	
FIFTH THIRD BANCORP	69,127	31.250	2,160,218.75	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,097	1,446.470	1,586,777.59	

FIRST SOLAR INC	10,305	145.380	1,498,140.90	
FIRSTENERGY CORP	55,297	37.080	2,050,412.76	
FISERV INC	61,890	132.360	8,191,760.40	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,128	256.090	1,825,409.52	
FMC CORP	12,696	55.880	709,452.48	
FORD MOTOR CO	399,137	11.010	4,394,498.37	
FORTINET INC	67,768	52.160	3,534,778.88	
FORTIVE CORP	35,730	68.890	2,461,439.70	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	12,869	73.430	944,970.67	
FOX CORP - CLASS A	25,034	29.940	749,517.96	
FOX CORP- CLASS B	14,715	28.010	412,167.15	
FRANKLIN RESOURCES INC	30,386	25.570	776,970.02	
FREEPORT-MCMORAN INC	145,521	38.150	5,551,626.15	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,600	52.060	291,536.00	
GARMIN LTD	15,556	124.590	1,938,122.04	
GARTNER INC	8,003	452.000	3,617,356.00	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	41,550	68.520	2,847,006.00	
GEN DIGITAL INC	58,402	22.150	1,293,604.30	
GENERAL DYNAMICS CORP	23,564	252.290	5,944,961.56	
GENERAL ELECTRIC CO	110,480	120.590	13,322,783.20	
GENERAL MILLS INC	59,039	65.470	3,865,283.33	
GENERAL MOTORS CO	139,626	33.750	4,712,377.50	
GENUINE PARTS CO	14,266	132.980	1,897,092.68	
GILEAD SCIENCES INC	126,499	79.020	9,995,950.98	
GLOBAL PAYMENTS INC	26,395	120.160	3,171,623.20	
GLOBAL-E ONLINE LTD	9,179	34.150	313,462.85	
GLOBE LIFE INC	9,595	122.360	1,174,044.20	
GODADDY INC - CLASS A	14,145	104.310	1,475,464.95	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,465	350.830	11,740,525.95	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	192,551	3.150	606,535.65	
GRACO INC	17,162	82.630	1,418,096.06	
HALLIBURTON CO	91,207	34.930	3,185,860.51	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	31,007	78.280	2,427,227.96	
HASBRO INC	13,400	48.700	652,580.00	
HCA HEALTHCARE INC	20,709	257.530	5,333,188.77	
HEICO CORP	4,418	178.910	790,424.38	
HEICO CORP-CLASS A	7,669	143.830	1,103,032.27	
HENRY SCHEIN INC	13,250	71.910	952,807.50	
HERSHEY CO/THE	15,222	185.740	2,827,334.28	
HESS CORP	28,054	134.500	3,773,263.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	130,183	16.220	2,111,568.26	
HF SINCLAIR CORP	14,926	52.670	786,152.42	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	26,544	171.330	4,547,783.52	
HOLOGIC INC	24,858	68.370	1,699,541.46	

HOME DEPOT INC	101,531	326.470	33,146,825.57	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	67,412	194.610	13,119,049.32	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	112,300	3.280	368,344.00	
HORMEL FOODS CORP	30,568	31.380	959,223.84	
HOWMET AEROSPACE INC	39,734	53.260	2,116,232.84	
HP INC	90,267	29.460	2,659,265.82	
HUBBELL INC	5,445	308.170	1,677,985.65	
HUBSPOT INC	4,824	502.040	2,421,840.96	
HUMANA INC	12,580	481.620	6,058,779.60	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	147,113	11.990	1,763,884.87	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,049	246.890	999,657.61	
HYATT HOTELS CORP - CL A	4,658	122.640	571,257.12	
IDEX CORP	7,680	204.840	1,573,171.20	
IDEXX LABORATORIES INC	8,428	531.350	4,478,217.80	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	30,704	249.610	7,664,025.44	
ILLUMINA INC	16,081	112.940	1,816,188.14	
INCYTE CORP	19,331	54.700	1,057,405.70	
INGERSOLL-RAND INC	41,073	73.310	3,011,061.63	
INSULET CORP	7,092	194.660	1,380,528.72	
INTEL CORP	425,153	42.700	18,154,033.10	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	58,087	113.340	6,583,580.58	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	92,487	161.960	14,979,194.52	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	25,933	76.820	1,992,173.06	
INTERNATIONAL PAPER CO	33,364	36.840	1,229,129.76	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	39,126	31.220	1,221,513.72	
INTUIT INC	28,452	573.900	16,328,602.80	
INTUITIVE SURGICAL INC	35,671	310.420	11,072,991.82	
IQVIA HOLDINGS INC	18,593	215.280	4,002,701.04	
JABIL CIRCUIT INC	13,279	119.000	1,580,201.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,395	164.690	1,217,882.55	
JACOBS SOLUTIONS INC	12,777	127.290	1,626,384.33	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,100	40.450	651,245.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,076	120.420	731,671.92	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,388	186.620	1,565,368.56	
JM SMUCKER CO	10,783	119.330	1,286,735.39	
JOHNSON & JOHNSON	244,468	154.420	37,750,748.56	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,082	56.080	3,874,118.56	

JPMORGAN CHASE & CO	295,014	158.520	46,765,619.28	
JUNIPER NETWORKS INC	32,653	28.990	946,610.47	
KELLANOVA	27,846	53.700	1,495,330.20	
KENVUE INC	175,033	20.610	3,607,430.13	
KEURIG DR PEPPER INC	106,425	32.110	3,417,306.75	
KEYCORP	95,100	13.260	1,261,026.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	18,036	144.330	2,603,135.88	
KIMBERLY-CLARK CORP	34,350	119.940	4,119,939.00	
KINDER MORGAN INC	203,601	17.700	3,603,737.70	
KKR & CO INC -A	58,378	76.950	4,492,187.10	
KLA CORPORATION	13,838	534.430	7,395,442.34	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16,354	55.690	910,754.26	
KRAFT HEINZ CO/THE	87,306	36.230	3,163,096.38	
KROGER CO	69,357	44.580	3,091,935.06	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,210	195.810	3,761,510.10	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	8,981	216.600	1,945,284.60	
LAM RESEARCH CORP	13,423	703.170	9,438,650.91	
LAMB WESTON HOLDING INC	14,716	100.960	1,485,727.36	
LAS VEGAS SANDS CORP	34,914	46.390	1,619,660.46	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	14,001	61.710	864,001.71	
LEAR CORP	5,967	133.080	794,088.36	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,244	108.490	1,436,841.56	
LENNAR CORP-CL A	25,384	139.580	3,543,098.72	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,242	420.620	1,363,650.04	
LIBERTY BROADBAND-C	12,140	75.600	917,784.00	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	23,924	17.080	408,621.92	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	16,618	26.640	442,703.52	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	20,016	62.920	1,259,406.72	
LINDE PLC	49,538	401.270	19,878,113.26	
LIVE NATION INC	16,356	85.190	1,393,367.64	
LKQ CORP	27,165	45.400	1,233,291.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,671	448.020	10,157,061.42	
LOEWS CORP	19,370	68.840	1,333,430.80	
LOWE'S COS INC	58,588	207.830	12,176,344.04	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	7,680	224.110	1,721,164.80	
LUCID GROUP INC	92,996	4.730	439,871.08	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,711	489.640	5,734,174.04	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,326	92.580	2,437,261.08	
M&T BANK CORP	16,842	132.650	2,234,091.30	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	6,255	221.740	1,386,983.70	
MARATHON OIL CORP	61,312	24.090	1,477,006.08	
MARATHON PETROLEUM CORP	40,554	143.020	5,800,033.08	
MARKEL GROUP INC	1,278	1,374.000	1,755,972.00	

MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,824	261.680	1,000,664.32	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	25,732	209.400	5,388,280.80	
MARSH & MCLENNAN COS INC	50,149	195.670	9,812,654.83	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,274	469.390	2,944,952.86	
MARVELL TECHNOLOGY INC	87,601	52.880	4,632,340.88	
MASCO CORP	22,816	64.000	1,460,224.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	85,417	412.160	35,205,470.72	
MATCH GROUP INC	28,223	32.100	905,958.30	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	25,525	67.090	1,712,472.25	
MCDONALD'S CORP	73,992	285.530	21,126,935.76	
MCKESSON CORP	13,693	457.890	6,269,887.77	
MEDTRONIC PLC	135,086	79.350	10,719,074.10	
MERCADOLIBRE INC	4,577	1,577.980	7,222,414.46	
MERCK & CO INC	257,618	103.750	26,727,867.50	
META PLATFORMS INC-A	225,631	332.750	75,078,715.25	
METLIFE INC	64,898	64.090	4,159,312.82	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,221	1,090.520	2,422,044.92	
MGM MIRAGE	28,473	41.420	1,179,351.66	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	55,262	86.080	4,756,952.96	
MICRON TECHNOLOGY INC	111,472	74.960	8,355,941.12	
MICROSOFT CORP	716,549	374.230	268,154,132.27	
MODERNA INC	32,862	80.320	2,639,475.84	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,920	367.720	2,176,902.40	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	19,266	62.310	1,200,464.46	
MONDAY.COM LTD	2,696	175.030	471,880.88	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	138,120	71.090	9,818,950.80	
MONGODB INC	7,242	381.790	2,764,923.18	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,610	575.730	2,654,115.30	
MONSTER BEVERAGE CORP	79,769	53.920	4,301,144.48	
MOODY'S CORP	16,763	374.610	6,279,587.43	
MORGAN STANLEY	126,174	82.280	10,381,596.72	
MOSAIC CO/THE	33,713	35.680	1,202,879.84	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,960	324.520	5,503,859.20	
MSCI INC	8,029	506.680	4,068,133.72	
NASDAQ INC	34,906	53.970	1,883,876.82	
NETAPP INC	21,191	89.390	1,894,263.49	
NETFLIX INC	44,989	453.760	20,414,208.64	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,914	117.280	1,162,713.92	
NEWMONT CORP	116,932	39.080	4,569,702.56	
NEWS CORP - CLASS A	38,684	21.940	848,726.96	
NEXTERA ENERGY INC	208,232	59.700	12,431,450.40	

NIKE INC	124,266	115.910	14,403,672.06	
NISOURCE INC	41,878	26.300	1,101,391.40	
NORDSON CORP	5,211	239.160	1,246,262.76	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,046	221.000	5,093,166.00	
NORTHERN TRUST CORP	21,016	80.390	1,689,476.24	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,593	476.250	6,949,916.25	
NRG ENERGY INC	23,246	47.810	1,111,391.26	
NUCOR CORP	25,250	162.090	4,092,772.50	
NVIDIA CORP	250,753	475.060	119,122,720.18	
NVR INC	331	6,535.890	2,163,379.59	
NXP SEMICONDUCTORS NV	26,169	215.550	5,640,727.95	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,116	945.880	5,785,002.08	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	67,356	56.470	3,803,593.32	
OKTA INC	15,912	72.010	1,145,823.12	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,982	369.450	3,687,849.90	
OMNICOM GROUP	20,069	81.940	1,644,453.86	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	43,810	76.140	3,335,693.40	
ONEOK INC	59,126	68.240	4,034,758.24	
ORACLE CORP	166,858	113.610	18,956,737.38	
OTIS WORLDWIDE CORP	41,805	87.500	3,657,937.50	
OVINTIV INC	26,261	41.630	1,093,245.43	
OWENS CORNING	9,108	143.360	1,305,722.88	
PACCAR INC	53,078	95.380	5,062,579.64	
PACKAGING CORP OF AMERICA	9,123	163.880	1,495,077.24	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	187,363	17.770	3,329,440.51	
PALO ALTO NETWORKS INC	31,327	298.420	9,348,603.34	
PARAMOUNT GLOBAL	49,644	16.850	836,501.40	
PARKER HANNIFIN CORP	13,039	438.630	5,719,296.57	
PAYCHEX INC	33,016	124.020	4,094,644.32	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,529	186.570	1,031,545.53	
PAYLOCITY HOLDING CORP	4,566	152.350	695,630.10	
PAYPAL HOLDINGS INC	105,901	58.940	6,241,804.94	
PENTAIR PLC	16,750	67.410	1,129,117.50	
PEPSICO INC	139,592	165.680	23,127,602.56	
PFIZER INC	573,221	28.780	16,497,300.38	
PG&E CORP	205,674	17.610	3,621,919.14	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	157,622	91.310	14,392,464.82	
PHILLIPS 66	45,183	125.320	5,662,333.56	
PINTEREST INC- CLASS A	59,058	34.910	2,061,714.78	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	23,686	223.050	5,283,162.30	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,443	140.670	5,689,116.81	

POOL CORP	3,965	354.120	1,404,085.80	
PPG INDUSTRIES INC	23,913	143.980	3,442,993.74	
PPL CORPORATION	74,752	26.060	1,948,037.12	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,529	75.150	1,843,354.35	
PROCTER & GAMBLE CO	239,282	145.150	34,731,782.30	
PROGRESSIVE CORP	59,420	161.170	9,576,721.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	36,856	100.870	3,717,664.72	
PTC INC	12,060	166.610	2,009,316.60	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	50,639	62.570	3,168,482.23	
PULTE GROUP INC	22,254	96.310	2,143,282.74	
QORVO INC	9,926	103.970	1,032,006.22	
QUALCOMM INC	113,295	132.970	15,064,836.15	
QUANTA SERVICES INC	14,745	199.250	2,937,941.25	
QUEST DIAGNOSTICS	11,393	135.910	1,548,422.63	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	20,131	107.050	2,155,023.55	
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,836	840.140	9,103,757.04	
REGIONS FINANCIAL CORP	95,227	17.440	1,660,758.88	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	5,942	264.640	1,572,490.88	
REPLIGEN CORP	5,382	159.270	857,191.14	
REPUBLIC SERVICES INC	22,476	161.790	3,636,392.04	
RESMED INC	14,939	162.870	2,433,114.93	
REVVITY INC	12,615	91.020	1,148,217.30	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	66,888	19.040	1,273,547.52	
ROBERT HALF INC	10,870	83.090	903,188.30	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	43,807	11.730	513,856.11	
ROBLOX CORP -CLASS A	43,158	40.830	1,762,141.14	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,662	278.530	3,248,216.86	
ROKU INC	12,602	103.360	1,302,542.72	
ROLLINS INC	29,551	41.430	1,224,297.93	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,832	536.600	5,812,451.20	
ROSS STORES INC	34,375	132.080	4,540,250.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	24,699	120.470	2,975,488.53	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	38,744	28.570	1,106,916.08	
RPM INTERNATIONAL INC	13,084	107.020	1,400,249.68	
RTX CORPORATION	147,788	81.320	12,018,120.16	
S&P GLOBAL INC	33,037	415.380	13,722,909.06	
SALESFORCE INC	98,777	250.810	24,774,259.37	
SCHLUMBERGER LTD	144,282	48.800	7,040,961.60	
SEA LTD-ADR	37,195	40.000	1,487,800.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,045	80.590	1,615,426.55	
SEAGEN INC	14,291	218.980	3,129,443.18	
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,370	60.240	684,928.80	

SEMPRA	63,883	72.380	4,623,851.54	
SERVICENOW INC	20,739	699.080	14,498,220.12	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,801	289.820	7,187,825.82	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	78,142	4.640	362,578.88	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,176	103.780	1,678,745.28	
SMITH (A.O.) CORP	12,641	77.990	985,871.59	
SNAP INC - A	104,193	15.090	1,572,272.37	
SNAP-ON INC	5,370	278.220	1,494,041.40	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	28,450	190.670	5,424,561.50	
SOUTHERN CO	110,705	71.500	7,915,407.50	
SOUTHWEST AIRLINES CO	15,198	29.070	441,805.86	
SPLUNK INC	16,247	150.950	2,452,484.65	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	22,650	57.110	1,293,541.50	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,558	92.850	1,444,560.30	
STARBUCKS CORP	116,285	96.610	11,234,293.85	
STATE STREET CORP	32,338	73.970	2,392,041.86	
STEEL DYNAMICS INC	15,973	113.160	1,807,504.68	
STERIS PLC	10,029	200.500	2,010,814.50	
STRYKER CORP	34,699	289.100	10,031,480.90	
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,834	272.650	1,317,990.10	
SYNCHRONY FINANCIAL	42,398	35.290	1,496,225.42	
SYNOPSYS INC	15,438	535.930	8,273,687.34	
SYSCO CORP	51,205	73.830	3,780,465.15	
T ROWE PRICE GROUP INC	22,770	98.440	2,241,478.80	
T-MOBILE US INC	54,009	156.400	8,447,007.60	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	17,241	155.320	2,677,872.12	
TARGA RESOURCES CORP	21,540	86.560	1,864,502.40	
TARGET CORP	46,870	135.190	6,336,355.30	
TE CONNECTIVITY LTD	31,876	133.320	4,249,708.32	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,782	411.490	1,967,745.18	
TELEFLEX INC	4,768	231.080	1,101,789.44	
TERADYNE INC	15,632	92.290	1,442,677.28	
TESLA, INC.	290,003	243.840	70,714,331.52	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	113,699	9.820	1,116,524.18	
TEXAS INSTRUMENTS INC	92,191	157.030	14,476,752.73	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	624	1,546.120	964,778.88	
TEXTRON INC	20,096	75.930	1,525,889.28	
THE CIGNA GROUP	30,047	258.800	7,776,163.60	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	39,184	489.770	19,191,147.68	
TJX COS INC	116,144	89.130	10,351,914.72	
TOAST INC-CLASS A	33,407	15.350	512,797.45	
TORO CO	10,553	84.230	888,879.19	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,048	212.070	2,342,949.36	

TRADE DESK INC/THE - CLASS A	45,307	70.630	3,200,033.41	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	11,049	90.350	998,277.15	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	23,187	234.000	5,425,758.00	
TRANSDIGM GROUP INC	5,603	983.920	5,512,903.76	
TRANSUNION	19,629	62.630	1,229,364.27	
TRAVELERS COS INC/THE	23,238	181.260	4,212,119.88	
TRIMBLE INC	25,216	46.900	1,182,630.40	
TRUIST FINANCIAL CORP	135,232	34.330	4,642,514.56	
TWILIO INC - A	17,467	70.610	1,233,344.87	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,272	403.070	1,721,915.04	
TYSON FOODS INC-CL A	29,017	51.380	1,490,893.46	
U-HAUL HOLDING CO	9,852	56.410	555,751.32	
UBER TECHNOLOGIES INC	186,708	61.700	11,519,883.60	
UIPATH INC - CLASS A	39,336	24.630	968,845.68	
ULTA BEAUTY INC	4,995	482.160	2,408,389.20	
UNION PACIFIC CORP	61,868	229.770	14,215,410.36	
UNITED PARCEL SERVICE INC	73,431	156.300	11,477,265.30	
UNITED RENTALS INC	6,930	495.060	3,430,765.80	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,763	241.650	1,150,978.95	
UNITEDHEALTH GROUP INC	94,041	549.770	51,700,920.57	
UNITY SOFTWARE INC	25,317	32.700	827,865.90	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,304	137.450	866,484.80	
US BANCORP	155,642	40.430	6,292,606.06	
VAIL RESORTS INC	3,876	225.870	875,472.12	
VALERO ENERGY CORP	35,827	122.740	4,397,405.98	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	15,497	172.710	2,676,486.87	
VERALTO CORP	23,741	75.430	1,790,783.63	
VERISIGN INC	9,413	212.970	2,004,686.61	
VERISK ANALYTICS INC	14,719	232.920	3,428,349.48	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	427,380	38.250	16,347,285.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,202	350.150	9,174,630.30	
VERTIV HOLDINGS CO	34,772	47.140	1,639,152.08	
VF CORP	33,588	18.140	609,286.32	
VIATRIS INC	121,679	9.830	1,196,104.57	
VISA INC-CLASS A SHARES	163,121	255.740	41,716,564.54	
VISTRA CORP	33,532	36.960	1,239,342.72	
VULCAN MATERIALS CO	13,489	216.030	2,914,028.67	
WABTEC CORP	18,190	118.400	2,153,696.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	74,638	23.160	1,728,616.08	
WALMART INC	150,286	150.860	22,672,145.96	
WALT DISNEY CO	185,764	92.820	17,242,614.48	

	WARNER BROS DISCOVERY INC	235,170	11.470	2,697,399.90	
	WASTE CONNECTIONS INC	26,156	138.330	3,618,159.48	
	WASTE MANAGEMENT INC	41,122	172.500	7,093,545.00	
	WATERS CORP	6,000	292.140	1,752,840.00	
	WATSCO INC	3,407	411.850	1,403,172.95	
	WEC ENERGY GROUP INC	32,012	84.070	2,691,248.84	
	WELLS FARGO & CO	371,419	46.100	17,122,415.90	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,499	342.240	2,566,457.76	
	WESTERN DIGITAL CORP	32,906	47.860	1,574,881.16	
	WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,887	129.250	502,394.75	
	WESTROCK CO-WHEN ISSUED	26,050	41.160	1,072,218.00	
	WEYERHAEUSER CO	74,137	30.870	2,288,609.19	
	WILLIAMS COS INC	123,472	35.520	4,385,725.44	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,638	242.660	2,581,417.08	
	WIX.COM LTD	5,507	103.180	568,212.26	
	WORKDAY INC-CLASS A	21,010	273.410	5,744,344.10	
	WR BERKLEY CORP	20,895	71.330	1,490,440.35	
	WW GRAINGER INC	4,568	804.050	3,672,900.40	
	WYNN RESORTS LTD	10,404	84.190	875,912.76	
	XCEL ENERGY INC	55,971	60.910	3,409,193.61	
	XYLEM INC	24,454	106.380	2,601,416.52	
	YUM! BRANDS INC	28,450	124.340	3,537,473.00	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,212	236.130	1,230,709.56	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	15,526	46.410	720,561.66	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	21,203	117.300	2,487,111.90	
	ZOETIS INC	46,736	184.600	8,627,465.60	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	24,186	73.060	1,767,029.16	
	ZSCALER INC	8,964	198.800	1,782,043.20	
アメリカ・ドル　小計		34,542,837		4,040,395,291.37 (587,473,475,364)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	98,613	23.440	2,311,488.72	
	ABRDN PLC	192,013	1.790	343,703.27	
	ADMIRAL GROUP PLC	26,429	28.010	740,276.29	
	ANGLO AMERICAN PLC	128,982	18.026	2,325,029.53	
	ANTOFAGASTA PLC	39,990	15.140	605,448.60	
	ASHTEAD GROUP PLC	44,451	50.320	2,236,774.32	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,965	24.220	846,852.30	
	ASTRAZENECA PLC	157,348	101.220	15,926,764.56	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	92,806	7.380	684,908.28	
	AVIVA PLC	278,344	4.291	1,194,374.10	
	BAE SYSTEMS PLC	308,611	10.425	3,217,269.67	
	BARCLAYS PLC	1,532,683	1.432	2,194,802.05	

BARRATT DEVELOPMENTS PLC	99,076	5.366	531,641.81	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	10,785	47.400	511,209.00	
BP PLC	1,731,921	4.682	8,108,854.12	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	215,730	23.165	4,997,385.45	
BT GROUP PLC	661,688	1.321	874,089.84	
BUNZL PLC	34,285	30.790	1,055,635.15	
BURBERRY GROUP PLC	36,912	15.185	560,508.72	
CENTRICA PLC	555,104	1.494	829,325.37	
COCA-COLA HBC AG-CDI	22,426	22.730	509,742.98	
COMPASS GROUP PLC	173,977	20.620	3,587,405.74	
CRH PLC	71,799	51.400	3,690,468.60	
CRODA INTERNATIONAL PLC	14,186	47.670	676,246.62	
DCC PLC	10,022	55.200	553,214.40	
DIAGEO PLC	228,207	28.290	6,455,976.03	
ENDEAVOUR MINING PLC	18,674	17.600	328,662.40	
ENTAIN PLC	64,884	8.030	521,018.52	
EXPERIAN PLC	93,371	30.810	2,876,760.51	
GLENCORE PLC	1,062,384	4.574	4,859,344.41	
GSK PLC	415,616	14.344	5,961,595.90	
HALEON PLC	562,409	3.248	1,826,704.43	
HALMA PLC	38,554	22.050	850,115.70	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,110	7.484	270,247.24	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,787	17.515	294,024.30	
HSBC HOLDINGS PLC	1,977,771	6.192	12,246,358.03	
IMPERIAL BRANDS PLC	86,468	18.200	1,573,717.60	
INFORMA PLC	140,516	7.744	1,088,155.90	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	16,762	68.300	1,144,844.60	
INTERTEK GROUP PLC	16,363	40.520	663,028.76	
JD SPORTS FASHION PLC	263,056	1.669	439,040.46	
KINGFISHER PLC	192,045	2.321	445,736.44	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	607,799	2.409	1,464,187.79	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,445,775	0.463	2,984,393.82	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	42,270	91.000	3,846,570.00	
M&G PLC	228,750	2.129	487,008.75	
MELROSE INDUSTRIES PLC	136,607	5.594	764,179.55	
MONDI PLC/WI	49,264	14.630	720,732.32	
NATIONAL GRID PLC	374,296	10.600	3,967,537.60	
NATWEST GROUP PLC	584,848	2.205	1,289,589.84	
NEXT PLC	12,219	80.020	977,764.38	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
OCADO GROUP PLC	58,882	6.274	369,425.66	
PEARSON PLC	64,847	9.604	622,790.58	
PERSIMMON PLC	32,469	13.095	425,181.55	

	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	77,163	4.976	383,963.08	
	PRUDENTIAL PLC	279,396	8.896	2,485,506.81	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	72,836	53.940	3,928,773.84	
	RELX PLC	191,759	31.070	5,957,952.13	
	RENTOKIL INITIAL PLC	256,209	4.191	1,073,771.91	
	RIO TINTO PLC	114,272	55.830	6,379,805.76	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	854,283	2.893	2,471,440.71	
	SAGE GROUP PLC	104,168	11.745	1,223,453.16	
	SAINSBURY (J) PLC	168,093	2.948	495,538.16	
	SCHRODERS PLC	81,699	4.214	344,279.58	
	SEVERN TRENT PLC	27,296	27.140	740,813.44	
	SHELL PLC-NEW	671,756	25.205	16,931,609.98	
	SMITH & NEPHEW PLC	88,602	10.485	928,991.97	
	SMITHS GROUP PLC	35,216	16.750	589,868.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,498	94.780	710,660.44	
	SSE PLC	110,795	18.825	2,085,715.87	
	ST JAMES'S PLACE PLC	55,883	6.996	390,957.46	
	STANDARD CHARTERED PLC	232,460	6.600	1,534,236.00	
	TAYLOR WIMPEY PLC	359,336	1.375	494,087.00	
	TESCO PLC	720,785	2.879	2,075,140.01	
	UNILEVER PLC	253,843	37.865	9,611,765.19	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	69,124	11.095	766,930.78	
	VODAFONE GROUP PLC	2,370,413	0.692	1,640,325.79	
	WHITBREAD PLC	19,581	33.430	654,592.83	
	WISE PLC - A	62,463	8.088	505,200.74	
	WPP PLC	109,133	7.226	788,595.05	
イギリス・ポンド　小計		27,839,969		184,072,093.00 (33,591,316,252)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	4,344	216.100	938,738.40	
	BANK HAPOALIM BM	128,890	31.380	4,044,568.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	154,726	28.200	4,363,273.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,707	770.600	2,086,014.20	
	ICL GROUP LTD	78,651	18.700	1,470,773.70	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	125,515	17.990	2,258,014.85	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	15,690	134.000	2,102,460.00	
	NICE LTD	6,427	756.900	4,864,596.30	
イスラエル・シュケル　小計		516,950		22,128,438.85 (868,813,405)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	24,132	34.490	832,312.68	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	305,029	24.610	7,506,763.69	
	APA GROUP	130,491	8.700	1,135,271.70	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	59,246	39.240	2,324,813.04	
	ASX LTD	19,657	59.210	1,163,890.97	

AURIZON HOLDINGS LTD	186,458	3.640	678,707.12	
BHP GROUP LIMITED	514,521	47.740	24,563,232.54	
BLUESCOPE STEEL LTD	45,748	21.160	968,027.68	
BRAMBLES LTD	140,900	12.980	1,828,882.00	
CARSALES.COM LTD	36,380	28.640	1,041,923.20	
COCHLEAR LTD	6,648	283.320	1,883,511.36	
COLES GROUP LTD	135,813	15.670	2,128,189.71	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	170,165	106.440	18,112,362.60	
COMPUTERSHARE LIMITED	55,160	23.610	1,302,327.60	
CSL LIMITED	49,048	266.920	13,091,892.16	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	145,555	5.050	735,052.75	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	171,935	25.750	4,427,326.25	
IDP EDUCATION LTD	26,879	23.210	623,861.59	
IGO LTD	69,265	8.180	566,587.70	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	247,009	5.940	1,467,233.46	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	44,670	49.500	2,211,165.00	
LOTTERY CORP LTD/THE	225,580	4.610	1,039,923.80	
MACQUARIE GROUP LTD	37,275	169.350	6,312,521.25	
MEDIBANK PRIVATE LTD	279,175	3.500	977,112.50	
MINERAL RESOURCES LTD	17,847	62.490	1,115,259.03	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	317,684	29.200	9,276,372.80	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	116,315	12.600	1,465,569.00	
ORICA LTD	46,176	15.580	719,422.08	
ORIGIN ENERGY LIMITED	174,689	7.840	1,369,561.76	
PILBARA MINERALS LTD	290,166	3.710	1,076,515.86	
QANTAS AIRWAYS LTD	85,178	5.560	473,589.68	
QBE INSURANCE GROUP LTD	151,542	14.520	2,200,389.84	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	18,638	48.530	904,502.14	
REA GROUP LTD	5,364	161.790	867,841.56	
REECE LTD	22,976	20.010	459,749.76	
RIO TINTO LTD	37,633	128.890	4,850,517.37	
SANTOS LTD	329,395	7.250	2,388,113.75	
SEEK LTD	36,149	24.830	897,579.67	
SONIC HEALTHCARE LTD	45,768	31.100	1,423,384.80	
SOUTH32 LTD	459,947	3.130	1,439,634.11	
SUNCORP GROUP LTD	128,853	13.900	1,791,056.70	
TELSTRA GROUP LTD	420,984	3.840	1,616,578.56	
TRANSURBAN GROUP	313,623	13.160	4,127,278.68	
TREASURY WINE ESTATES LTD	81,048	10.450	846,951.60	

	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	23,767	32.880	781,458.96	
	WESFARMERS LIMITED	115,180	53.700	6,185,166.00	
	WESTPAC BANKING CORP	356,262	21.920	7,809,263.04	
	WISETECH GLOBAL LTD	16,938	67.260	1,139,249.88	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	192,777	29.810	5,746,682.37	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	123,955	35.770	4,433,870.35	
	XERO LTD	14,603	105.000	1,533,315.00	
オーストラリア・ドル　小計		7,070,196		163,861,766.70 (15,663,546,279)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	50,343	69.640	3,505,886.52	
	AIR CANADA	18,039	18.490	333,541.11	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	67,324	8.230	554,076.52	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	78,595	76.560	6,017,233.20	
	ALTAGAS LTD	28,902	27.890	806,076.78	
	ARC RESOURCES LTD	61,797	20.450	1,263,748.65	
	BANK OF MONTREAL	73,415	118.500	8,699,677.50	
	BANK OF NOVA SCOTIA	122,757	60.900	7,475,901.30	
	BARRICK GOLD CORP	178,320	22.830	4,071,045.60	
	BCE INC	9,057	55.200	499,946.40	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	35,792	48.810	1,747,007.52	
	BROOKFIELD CORPORATION-A	141,636	48.770	6,907,587.72	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	13,940	36.760	512,434.40	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,525	83.060	292,786.50	
	CAE INC	32,476	27.950	907,704.20	
	CAMECO CORP	44,035	61.270	2,698,024.45	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	94,264	58.450	5,509,730.80	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	56,700	160.060	9,075,402.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	110,866	84.800	9,401,436.80	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	94,708	99.060	9,381,774.48	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,395	144.530	779,739.35	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	13,833	31.580	436,846.14	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	15,322	59.610	913,344.42	
	CENOVUS ENERGY INC	144,777	22.120	3,202,467.24	
	CGI INC	21,311	141.550	3,016,572.05	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,047	3,291.950	6,738,621.65	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	8,728	112.630	983,034.64	
	DOLLARAMA INC	28,814	99.650	2,871,315.10	

ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	39,850	22.160	883,076.00	
EMERA INC	28,119	49.100	1,380,642.90	
EMPIRE CO LTD 'A'	14,934	38.110	569,134.74	
ENBRIDGE INC	216,400	47.460	10,270,344.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,168	1,237.260	2,682,379.68	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	59,932	10.390	622,693.48	
FIRSTSERVICE CORP	4,127	222.040	916,359.08	
FORTIS INC	49,726	55.330	2,751,339.58	
FRANCO-NEVADA CORP	19,538	147.380	2,879,510.44	
GEORGE WESTON LTD	6,379	161.520	1,030,336.08	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	23,729	38.650	917,125.85	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,959	49.610	890,945.99	
GREAT-WEST LIFECO INC	28,730	43.910	1,261,534.30	
HYDRO ONE LTD	33,995	38.990	1,325,465.05	
IA FINANCIAL CORP INC	10,434	92.230	962,327.82	
IGM FINANCIAL INC	8,941	34.510	308,553.91	
IMPERIAL OIL LTD	20,261	75.320	1,526,058.52	
INTACT FINANCIAL CORP	18,160	210.250	3,818,140.00	
IVANHOE MINES LTD-CL A	62,210	12.640	786,334.40	
KEYERA CORP	23,584	33.570	791,714.88	
KINROSS GOLD CORP	124,626	7.800	972,082.80	
LOBLAW COS LTD	16,070	124.050	1,993,483.50	
LUNDIN MINING CORP	67,181	9.890	664,420.09	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,743	74.630	2,070,460.09	
MANULIFE FINANCIAL CORP	185,325	27.080	5,018,601.00	
MEG ENERGY CORP	29,083	23.830	693,047.89	
METRO INC	23,574	68.480	1,614,347.52	
NATIONAL BANK OF CANADA	34,496	94.550	3,261,596.80	
NORTHLAND POWER INC	26,125	22.660	591,992.50	
NUTRIEN LTD	50,276	73.960	3,718,412.96	
ONEX CORPORATION	6,889	91.320	629,103.48	
OPEN TEXT CORP	27,670	54.260	1,501,374.20	
PAN AMERICAN SILVER CORP	37,026	20.200	747,925.20	
PARKLAND CORP	14,360	44.770	642,897.20	
PEMBINA PIPELINE CORP	56,195	45.440	2,553,500.80	
POWER CORP OF CANADA	58,958	38.170	2,250,426.86	
QUEBECOR INC -CL B	16,334	30.900	504,720.60	
RB GLOBAL INC	18,521	85.320	1,580,211.72	
RESTAURANT BRANDS INTERN	29,289	97.700	2,861,535.30	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	36,542	61.750	2,256,468.50	
ROYAL BANK OF CANADA	141,884	125.240	17,769,552.16	
SAPUTO INC	25,995	26.400	686,268.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	122,178	98.590	12,045,529.02	
STANTEC INC	11,377	105.030	1,194,926.31	

	SUN LIFE FINANCIAL INC	59,884	69.900	4,185,891.60	
	SUNCOR ENERGY INC	132,245	41.770	5,523,873.65	
	TC ENERGY CORP	104,692	51.650	5,407,341.80	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	46,836	52.620	2,464,510.32	
	TFI INTERNATIONAL INC	8,297	156.740	1,300,471.78	
	THOMSON REUTERS CORP	16,255	192.200	3,124,211.00	
	TMX GROUP LTD	28,616	30.160	863,058.56	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	8,448	113.600	959,692.80	
	TORONTO-DOMINION BANK	184,951	81.010	14,982,880.51	
	TOURMALINE OIL CORP	32,867	62.220	2,044,984.74	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,813	102.250	594,379.25	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	46,053	64.290	2,960,747.37	
	WSP GLOBAL INC	12,741	189.440	2,413,655.04	
カナダ・ドル　小計		4,121,309		249,825,562.66 (26,736,331,716)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	264,000	3.100	818,400.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	50,400	6.290	317,016.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	183,800	31.600	5,808,080.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	613,000	0.980	600,740.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,000	29.600	296,000.00	
	KEPPEL CORP LTD	148,000	6.770	1,001,960.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	343,600	12.650	4,346,540.00	
	SEATRIUM LTD	4,496,352	0.109	490,102.36	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	90,300	4.950	446,985.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	150,900	6.380	962,742.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	86,800	9.600	833,280.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	158,400	3.770	597,168.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	848,300	2.340	1,985,022.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	128,300	27.580	3,538,514.00	
	UOL Group Limited	46,800	6.020	281,736.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,800	3.630	707,124.00	
シンガポール・ドル　小計		7,813,752		23,031,409.36 (2,496,374,461)	
スイス・フラン	ABB LTD	162,355	35.970	5,839,909.35	
	ADECCO GROUP AG-REG	16,239	41.510	674,080.89	
	ALCON INC	50,710	63.100	3,199,801.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	3,436	64.900	222,996.40	
	BALOISE HOLDING AG	4,641	133.000	617,253.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,050	102.500	312,625.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	362	1,429.000	517,298.00	
	BKW AG	2,134	152.100	324,581.40	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	97	10,880.000	1,055,360.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	11	107,200.000	1,179,200.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	52,999	115.750	6,134,634.25	
	CLARIANT AG	21,886	12.790	279,921.94	
	DUFRY AG-REG	9,888	31.270	309,197.76	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	715	654.500	467,967.50	
	GEBERIT AG-REG	3,393	507.200	1,720,929.60	
	GIVAUDAN-REG	937	3,392.000	3,178,304.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	3,761	117.000	440,037.00	
	HOLCIM LTD	52,879	65.420	3,459,344.18	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20,905	45.760	956,612.80	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,515	262.000	1,444,930.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	16,687	78.180	1,304,589.66	
	LONZA GROUP AG	7,562	329.200	2,489,410.40	
	NESTLE SA	271,054	99.380	26,937,346.52	
	NOVARTIS AG	208,063	84.720	17,627,097.36	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,303	1,172.500	2,700,267.50	
	ROCHE HOLDING AG	71,310	253.300	18,062,823.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	3,264	272.000	887,808.00	
	SANDOZ GROUP AG	41,555	27.040	1,123,647.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,419	193.200	467,350.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,099	202.700	830,867.30	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	15,216	73.160	1,113,202.56	
	SIG GROUP AG	31,061	19.920	618,735.12	
	SIKA AG-BEARER	15,481	245.700	3,803,681.70	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,144	257.000	1,322,008.00	
	STRAUMANN HOLDING AG	11,335	119.850	1,358,499.75	
	SWATCH GROUP AG	2,926	228.500	668,591.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,994	571.800	1,711,969.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,775	88.500	688,087.50	
	SWISS RE AG	30,605	98.880	3,026,222.40	
	SWISSCOM AG	2,679	508.600	1,362,539.40	
	TEMENOS GROUP AG-REG	6,482	76.820	497,947.24	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,388	43.950	236,802.60	
	UBS GROUP AG	333,762	25.010	8,347,387.62	
	VAT GROUP AG	2,743	395.900	1,085,953.70	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,857	450.600	6,694,564.20	
スイス・フラン　小計		1,532,677		137,302,383.80 (22,704,322,185)	

スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	29,333	385.200	11,299,071.60	
	ASSA ABLOY AB	101,654	274.800	27,934,519.20	
	ATLAS COPCO AB	158,545	141.050	22,362,772.25	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	272,562	165.150	45,013,614.30	
	BEIJER REF AB	39,146	128.700	5,038,090.20	
	BIOVITRUM	19,706	239.400	4,717,616.40	
	BOLIDEN AB	27,716	295.950	8,202,550.20	
	EPIROC AB-A	66,819	199.000	13,296,981.00	
	EPIROC AB-B	39,664	171.200	6,790,476.80	
	EQT AB	36,110	239.700	8,655,567.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	61,776	263.300	16,265,620.80	
	EVOLUTION AB	18,611	1,148.600	21,376,594.60	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	66,149	65.100	4,306,299.90	
	GETINGE AB-B SHS	23,193	232.000	5,380,776.00	
	HENNES & MAURITZ AB	65,536	172.540	11,307,581.44	
	HEXAGON AB-B SHS	210,768	115.700	24,385,857.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,708	443.800	3,420,810.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	35,432	86.040	3,048,569.28	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	13,351	322.900	4,311,037.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,543	323.400	4,703,206.20	
	INDUTRADE AB	27,781	253.100	7,031,371.10	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	15,060	249.800	3,761,988.00	
	INVESTOR AB	175,580	224.600	39,435,268.00	
	LIFCO AB-B SHS	23,662	240.100	5,681,246.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,639	532.000	4,063,948.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	153,937	69.100	10,637,046.70	
	SAAB AB-B	8,116	544.000	4,415,104.00	
	SAGAX AB-B	20,082	252.500	5,070,705.00	
	SANDVIK AB	108,145	211.100	22,829,409.50	
	SECURITAS AB	49,811	94.480	4,706,143.28	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	160,900	132.450	21,311,205.00	
	SKANSKA AB-B SHS	34,491	173.250	5,975,565.75	
	SKF AB	34,535	203.000	7,010,605.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB	61,401	156.800	9,627,676.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	147,855	102.350	15,132,959.25	
	SWEDBANK AB - A SHARES	86,104	198.550	17,095,949.20	
	TELE2 AB	56,411	85.900	4,845,704.90	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	297,160	59.300	17,621,588.00	
	TELIA CO AB	249,402	26.100	6,509,392.20	
	VOLVO AB	152,689	252.700	38,584,510.30	
	VOLVO AB-A SHS	20,739	257.800	5,346,514.20	
	VOLVO CAR AB-B	60,370	34.130	2,060,428.10	
スウェーデン・クローナ　小計		3,260,192		510,571,941.55 (7,091,844,268)	

デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	488	10,500.000	5,124,000.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	312	10,430.000	3,254,160.00	
	CARLSBERG AS-B	9,988	833.200	8,322,001.60	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,706	550.400	5,892,582.40	
	COLOPLAST-B	13,874	767.400	10,646,907.60	
	DANSKE BANK A/S	69,967	179.100	12,531,089.70	
	DEMANT A/S	10,214	293.200	2,994,744.80	
	DSV A/S	18,893	1,080.000	20,404,440.00	
	GENMAB A/S	6,710	2,252.000	15,110,920.00	
	NOVO-NORDISK A/S	331,293	668.600	221,502,499.80	
	NOVOZYMES A/S	20,766	360.300	7,481,989.80	
	ORSTED A/S	19,227	342.500	6,585,247.50	
	PANDORA A/S	8,575	937.600	8,039,920.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	933	1,918.000	1,789,494.00	
	TRYGVESTA AS	35,513	151.050	5,364,238.65	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	102,529	188.920	19,369,778.68	
デンマーク・クローネ　小計		659,988		354,414,014.53 (7,442,694,305)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	133,749	8.250	1,103,429.25	
	EBOS GROUP LTD	15,569	37.530	584,304.57	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	58,983	24.000	1,415,592.00	
	MERCURY NZ LTD	70,246	6.320	443,954.72	
	MERIDIAN ENERGY LTD	130,900	5.250	687,225.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	191,016	5.170	987,552.72	
ニュージーランド・ドル　小計		600,463		5,222,058.26 (464,919,847)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	35,506	112.000	3,976,672.00	
	AKER BP ASA	32,035	300.000	9,610,500.00	
	DNB BANK ASA	93,748	208.800	19,574,582.40	
	EQUINOR ASA	91,374	334.750	30,587,446.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20,217	184.700	3,734,079.90	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,909	445.600	3,969,850.40	
	MOWI ASA	47,177	183.650	8,664,056.05	
	NORSK HYDRO ASA	134,553	62.280	8,379,960.84	
	ORKLA ASA	70,763	80.900	5,724,726.70	
	SALMAR ASA	7,361	580.400	4,272,324.40	
	TELENOR ASA	65,886	123.200	8,117,155.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,744	361.800	6,057,979.20	
ノルウェー・クローネ　小計		624,273		112,669,333.59 (1,503,008,910)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	48,205	13.130	632,931.65	
	ACCIONA SA	2,506	135.850	340,440.10	
	ACCOR	20,104	34.810	699,820.24	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,149	37.450	792,030.05	
ADIDAS AG	16,443	193.360	3,179,418.48	
ADP	3,512	117.000	410,904.00	
ADYEN NV	2,205	1,186.800	2,616,894.00	
AEGON LTD	164,722	5.202	856,883.84	
AENA SME SA	7,604	163.500	1,243,254.00	
AGEAS	16,190	40.520	656,018.80	
AIB GROUP PLC	159,180	3.930	625,577.40	
AIR LIQUIDE	53,163	175.320	9,320,537.16	
AIRBUS SE	60,177	141.820	8,534,302.14	
AKZO NOBEL NV	17,295	72.280	1,250,082.60	
ALLIANZ SE	40,936	243.800	9,980,196.80	
ALSTOM RGPT	29,275	11.690	342,224.75	
AMADEUS IT GROUP SA	45,719	65.560	2,997,337.64	
AMPLIFON SPA	12,641	28.170	356,096.97	
AMUNDI SA	6,244	57.800	360,903.20	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	88,158	58.710	5,175,756.18	
ARCELORMITTAL	51,763	23.735	1,228,594.80	
ARGENX SE	5,999	424.000	2,543,576.00	
ARKEMA	6,081	91.640	557,262.84	
ASM INTERNATIONAL NV	4,765	458.700	2,185,705.50	
ASML HOLDING NV	40,925	649.600	26,584,880.00	
ASR NEDERLAND NV	16,085	44.120	709,670.20	
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	102,793	19.140	1,967,458.02	
AXA SA	183,134	29.995	5,493,104.33	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	605,295	8.506	5,148,639.27	
BANCO BPM SPA	122,757	4.989	612,434.67	
BANCO SANTANDER SA	1,641,828	3.940	6,468,802.32	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	107,147	8.108	868,747.87	
BASF SE	90,640	45.190	4,096,021.60	
BAYER AG	99,732	31.895	3,180,952.14	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,330	100.920	3,262,743.60	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,013	91.600	550,790.80	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	7,823	133.200	1,042,023.60	
BECHTLE AG	8,308	43.140	358,407.12	
BEIERSDORF AG	10,218	132.500	1,353,885.00	
BIOMERIEUX	4,200	97.880	411,096.00	
BNP PARIBAS	106,614	61.850	6,594,075.90	
BOLLORE SE	74,922	5.385	403,454.97	
BOUYGUES	19,359	36.010	697,117.59	
BRENNTAG SE	14,108	79.180	1,117,071.44	

BUREAU VERITAS SA	29,937	21.650	648,136.05	
CAIXABANK	418,779	3.913	1,638,682.22	
CAPGEMINI SA	15,857	192.150	3,046,922.55	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,092	86.920	355,676.64	
CARREFOUR SA	58,329	17.190	1,002,675.51	
CELLNEX TELECOM SAU	57,662	35.770	2,062,569.74	
CIE DE SAINT-GOBAIN	46,241	61.860	2,860,468.26	
COMMERZBANK AG	106,875	11.020	1,177,762.50	
CONTINENTAL AG	11,152	73.600	820,787.20	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	6,655	28.220	187,804.10	
COVESTRO AG	19,629	51.140	1,003,827.06	
CREDIT AGRICOLE SA	108,335	12.612	1,366,321.02	
D'IETEREN GROUP	2,187	161.500	353,200.50	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	54,281	32.250	1,750,562.25	
DANONE	65,332	59.220	3,868,961.04	
DASSAULT AVIATION SA	2,048	182.400	373,555.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	67,825	44.220	2,999,221.50	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	53,049	10.060	533,672.94	
DELIVERY HERO SE	17,884	31.510	563,524.84	
DEUTSCHE BANK AG	196,556	11.824	2,324,078.14	
DEUTSCHE BOERSE AG	19,280	180.500	3,480,040.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	60,583	8.364	506,716.21	
DEUTSCHE TELEKOM AG	330,482	22.615	7,473,850.43	
DHL GROUP	100,606	45.895	4,617,312.37	
DIASORIN ITALIA SPA	2,273	90.240	205,115.52	
DR ING HC F PORSCHE AG	11,566	83.560	966,454.96	
DSM-FIRMENICH AG	18,883	87.030	1,643,387.49	
E.ON SE	227,789	12.485	2,843,945.66	
EDENRED	25,340	53.200	1,348,088.00	
EDP RENOVAVEIS SA	31,263	17.425	544,757.77	
EIFFAGE	7,442	96.280	716,515.76	
ELIA GROUP SA/NV	2,985	107.200	319,992.00	
ELISA OYJ	14,895	41.970	625,143.15	
ENAGAS SA	25,256	16.860	425,816.16	
ENDESA SA	32,157	19.740	634,779.18	
ENEL SPA	825,296	6.566	5,418,893.53	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	318,469	4.514	1,437,569.06	
ENGIE	185,472	16.234	3,010,952.44	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	239,714	15.010	3,598,107.14	
ERSTE GROUP BANK AG	34,864	36.860	1,285,087.04	
ESSILORLUXOTTICA	29,932	182.700	5,468,576.40	
EURAZEO	4,396	70.350	309,258.60	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,702	55.000	753,610.00	
EURONEXT NV	8,694	77.700	675,523.80	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,688	17.485	414,184.68	
EXOR NV	9,414	92.420	870,041.88	

FERRARI NV	12,796	340.700	4,359,597.20	
FERROVIAL SE	51,989	32.480	1,688,602.72	
FINECOBANK SPA	62,040	12.930	802,177.20	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	17,939	153.700	2,757,224.30	
FORTUM OYJ	45,565	13.540	616,950.10	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	20,839	38.150	795,007.85	
FRESENIUS SE & CO KGAA	42,870	28.530	1,223,081.10	
GALP ENERGIA SGPS SA	45,924	13.435	616,988.94	
GEA GROUP AG	16,607	34.450	572,111.15	
GETLINK SE - REGR	36,231	17.190	622,810.89	
GRIFOLS SA	30,251	14.185	429,110.43	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,891	73.560	654,021.96	
HANNOVER RUECK SE	6,116	218.600	1,336,957.60	
HEIDELBERG MATERIALS AG	14,133	78.200	1,105,200.60	
HEINEKEN HOLDING NV	13,116	73.600	965,337.60	
HEINEKEN NV	29,210	87.480	2,555,290.80	
HELLOFRESH SE	15,782	16.015	252,748.73	
HENKEL AG & CO KGAA	10,620	64.000	679,680.00	
HENKEL KGAA-VORZUG	17,118	72.740	1,245,163.32	
HERMES INTERNATIONAL	3,216	1,982.400	6,375,398.40	
IBERDROLA SA	612,173	11.795	7,220,580.53	
IMCD NV	5,787	147.900	855,897.30	
INDITEX SA	110,725	37.880	4,194,263.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	132,574	37.160	4,926,449.84	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	35,679	11.545	411,914.05	
ING GROEP NV-CVA	367,290	13.510	4,962,087.90	
INTESA SANPAOLO	1,577,252	2.700	4,258,580.40	
IPSEN	3,819	103.100	393,738.90	
JDE PEET'S BV	9,843	24.700	243,122.10	
JERONIMO MARTINS	28,751	23.500	675,648.50	
KBC GROEP NV	25,414	56.960	1,447,581.44	
KERING	7,559	413.800	3,127,914.20	
KERRY GROUP PLC-A	16,163	74.280	1,200,587.64	
KESKO OYJ-B SHS	27,730	17.935	497,337.55	
KINGSPAN GROUP PLC	15,696	74.080	1,162,759.68	
KNORR-BREMSE AG	7,353	57.280	421,179.84	
KONE OYJ	34,499	40.920	1,411,699.08	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	97,430	27.275	2,657,403.25	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	80,068	18.808	1,505,918.94	
L'OREAL SA	24,486	441.950	10,821,587.70	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10,686	34.100	364,392.60	
LEG IMMOBILIEN SE	7,525	72.180	543,154.50	
LEGRAND SA	26,898	93.880	2,525,184.24	

LEONARDO SPA	40,963	13.850	567,337.55	
LOTUS BAKERIES	42	8,060.000	338,520.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	28,034	739.100	20,719,929.40	
MEDIOBANCA SPA	55,997	11.130	623,246.61	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	81,458	62.870	5,121,264.46	
MERCK KGAA	13,119	142.000	1,862,898.00	
METSO CORPORATION	67,372	9.016	607,425.95	
MICHELIN (C.G.D.E.)	68,853	31.920	2,197,787.76	
MONCLER SPA	20,920	53.660	1,122,567.20	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	5,463	190.000	1,037,970.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	13,847	391.300	5,418,331.10	
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,729	28.120	357,939.48	
NEMETSCHEK SE	5,858	78.660	460,790.28	
NESTE OYJ	42,931	35.220	1,512,029.82	
NEXI SPA	59,992	7.424	445,380.60	
NN GROUP NV	27,469	35.550	976,522.95	
NOKIA OYJ	548,357	2.985	1,636,845.64	
NORDEA BANK ABP	324,909	10.782	3,503,168.83	
OCI NV	10,743	18.375	197,402.62	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	6,912	87.250	603,072.00	
OMV AG	14,953	38.830	580,624.99	
ORANGE S.A.	192,253	11.094	2,132,854.78	
ORION OYJ-CLASS B	10,930	36.600	400,038.00	
PERNOD-RICARD	20,759	159.250	3,305,870.75	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	15,519	47.150	731,720.85	
POSTE ITALIANE SPA	53,034	10.035	532,196.19	
PROSUS	148,489	30.080	4,466,549.12	
PRYSMIAN SPA	26,631	38.520	1,025,826.12	
PUBLICIS GROUPE	23,243	79.260	1,842,240.18	
PUMA AG	10,713	56.000	599,928.00	
QIAGEN NV	23,114	38.570	891,506.98	
RANDSTAD NV	11,188	56.020	626,751.76	
RATIONAL AG	520	631.500	328,380.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	10,609	46.700	495,440.30	
REDEIA CORPORACION SA	41,383	15.565	644,126.39	
REMY COINTREAU	2,343	107.050	250,818.15	
RENAULT SA	19,466	37.980	739,318.68	
REPSOL SA	129,291	13.940	1,802,316.54	
RHEINMETALL AG	4,421	284.700	1,258,658.70	
ROYAL KPN NV	349,731	3.138	1,097,455.87	
RWE AG	64,134	40.450	2,594,220.30	
SAFRAN SA	34,694	164.600	5,710,632.40	
SAMPO OYJ	45,806	41.040	1,879,878.24	

	SANOFI	115,546	86.130	9,951,976.98	
	SAP SE	105,997	148.180	15,706,635.46	
	SARTORIUS AG-VORZUG	2,663	305.800	814,345.40	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,812	204.800	575,897.60	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	55,247	174.940	9,664,910.18	
	SCOUT24 SE	7,585	65.140	494,086.90	
	SEB SA	2,520	110.700	278,964.00	
	SIEMENS AG	77,153	162.420	12,531,190.26	
	SIEMENS ENERGY AG	52,751	11.365	599,515.11	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	28,639	52.740	1,510,420.86	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	26,394	35.270	930,916.38	
	SNAM SPA	204,658	4.696	961,073.96	
	SOCIETE GENERALE	74,930	24.040	1,801,317.20	
	SODEXO	8,977	100.050	898,148.85	
	SOFINA	1,571	208.000	326,768.00	
	SOLVAY SA	7,506	112.350	843,299.10	
	STELLANTIS NV	224,545	21.025	4,721,058.62	
	STMICROELECTRONICS NV	69,361	44.385	3,078,587.98	
	STORA ENSO OYJ	59,002	12.005	708,319.01	
	SYMRISE AG	13,477	105.350	1,419,801.95	
	TALANX AG	6,535	67.500	441,112.50	
	TELECOM ITALIA SPA	1,032,214	0.265	273,536.71	
	TELEFONICA SA	503,932	4.003	2,017,239.79	
	TELEPERFORMANCE	6,044	118.050	713,494.20	
	TENARIS SA	47,824	15.745	752,988.88	
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	142,598	7.672	1,094,011.85	
	THALES SA	10,666	138.950	1,482,040.70	
	TOTALENERGIES SE	232,587	61.900	14,397,135.30	
	UCB SA	12,825	76.600	982,395.00	
	UMICORE	21,255	24.100	512,245.50	
	UNICREDIT SPA	162,986	25.300	4,123,545.80	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	83,211	25.000	2,080,275.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	54,159	33.540	1,816,492.86	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	69,010	29.550	2,039,245.50	
	VINCI SA	51,541	115.840	5,970,509.44	
	VIVENDI SA	67,932	8.890	603,915.48	
	VOESTALPINE AG	11,774	26.580	312,952.92	
	VOLKSWAGEN AG	3,033	124.600	377,911.80	
	VOLKSWAGEN AG	20,884	114.860	2,398,736.24	
	VONOVIA SE	74,456	26.520	1,974,573.12	
	WACKER CHEMIE AG	1,856	110.500	205,088.00	
	WARTSILA OYJ	47,972	13.050	626,034.60	
	WOLTERS KLUWER NV	25,211	129.800	3,272,387.80	
	WORLDLINE SA	24,415	15.550	379,653.25	
	ZALANDO SE	22,769	22.280	507,293.32	
ユーロ　小計		18,460,281		492,242,531.04 (77,075,335,510)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,165,275	63.850	74,402,808.75	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	375,039	20.450	7,669,547.55	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	174,900	12.940	2,263,206.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	197,909	37.450	7,411,692.05	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	271,909	40.200	10,930,741.80	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	64,000	39.800	2,547,200.00	
	CLP HOLDINGS LTD	166,643	61.200	10,198,551.60	
	ESR GROUP LIMITED	221,000	9.950	2,198,950.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	221,810	41.900	9,293,839.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	182,157	10.420	1,898,075.94	
	HANG SENG BANK LTD	77,512	85.850	6,654,405.20	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	147,641	21.250	3,137,371.25	
	HKT TRUST AND HKT LTD	401,000	8.770	3,516,770.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,137,437	5.350	6,085,287.95	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	122,211	248.400	30,357,212.40	
	MTR CORP	157,755	27.900	4,401,364.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	152,917	11.020	1,685,145.34	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	140,587	41.600	5,848,419.20	
	SANDS CHINA LTD	246,180	21.050	5,182,089.00	
	SINO LAND CO	374,000	8.000	2,992,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	136,000	11.420	1,553,120.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	147,023	77.200	11,350,175.60	
	SWIRE PACIFIC LTD	43,366	57.750	2,504,386.50	
	SWIRE PROPERTIES LTD	119,200	15.360	1,830,912.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	139,500	77.550	10,818,225.00	
	WH GROUP LTD	843,000	4.820	4,063,260.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	109,000	23.250	2,534,250.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	169,733	25.250	4,285,758.25	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	172,000	8.490	1,460,280.00	
香港・ドル　小計		7,876,704		239,075,044.88 (4,451,577,336)	
合計		114,919,591		787,563,559,838 (787,563,559,838)	

（２）株式以外の有価証券

2023年12月11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	16,705.00	1,995,245.20	

		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	32,992.00	1,157,359.36	
		AMERICAN TOWER REIT INC	47,325.00	9,770,246.25	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	50,179.00	918,777.49	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,408.00	2,532,206.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	15,132.00	969,658.56	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,844.00	1,015,540.60	
		CROWN CASTLE INC	44,033.00	5,110,910.31	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	30,728.00	4,142,441.68	
		EQUINIX INC	9,497.00	7,614,409.69	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,943.00	1,270,543.83	
		EQUITY RESIDENTIAL	36,545.00	2,149,576.90	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,510.00	1,471,976.10	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	21,454.00	2,975,240.72	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	26,674.00	1,229,137.92	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	55,561.00	1,041,768.75	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	72,209.00	1,299,039.91	
		INVITATION HOMES INC	62,107.00	2,054,499.56	
		IRON MOUNTAIN INC	29,631.00	1,939,348.95	
		KIMCO REALTY CORP	62,977.00	1,274,654.48	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,845.00	1,505,854.85	
		PROLOGIS INC	93,801.00	11,242,049.85	
		PUBLIC STORAGE	16,065.00	4,398,757.65	
		REALTY INCOME CORP	72,024.00	3,879,212.64	
		REGENCY CENTERS CORP	16,844.00	1,077,342.24	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,999.00	2,685,735.82	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	33,217.00	4,413,874.96	
		SUN COMMUNITIES INC	12,633.00	1,612,476.12	
		UDR INC	31,782.00	1,124,129.34	
		VENTAS INC	40,824.00	1,907,297.28	
		VICI PROPERTIES INC	102,968.00	3,141,553.68	
		WELLTOWER INC	52,644.00	4,617,931.68	
		WP CAREY INC	21,731.00	1,359,491.36	
アメリカ・ドル　小計			1,180,831.00	94,898,289.73 (13,798,211,325)	
イギリス・ポンド		LAND SECURITIES GROUP PLC	71,973.00	463,362.17	
		SEGRO PLC	118,491.00	985,608.13	
イギリス・ポンド　小計			190,464.00	1,448,970.30 (264,422,590)	
オーストラリア・ドル		DEXUS/AU	109,312.00	796,884.48	
		GOODMAN GROUP	173,414.00	4,023,204.80	

		GPT GROUP	194,418.00	841,829.94	
		MIRVAC GROUP	400,368.00	844,776.48	
		SCENTRE GROUP	526,252.00	1,468,243.08	
		STOCKLAND	241,955.00	1,013,791.45	
		VICINITY CENTRES	392,507.00	753,613.44	
	オーストラリア・ドル　小計		2,038,226.00	9,742,343.67 (931,270,631)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,683.00	438,665.16	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,718.00	281,666.56	
	カナダ・ドル　小計		24,401.00	720,331.72 (77,089,901)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	378,100.00	1,077,585.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	540,290.00	1,026,551.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	352,000.00	573,760.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	241,000.00	342,220.00	
	シンガポール・ドル　小計		1,511,390.00	3,020,116.00 (327,350,373)	
	ユーロ	COVIVIO	5,172.00	241,118.64	
		GECINA SA	4,657.00	498,764.70	
		KLEPIERRE	21,823.00	514,586.34	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,967.00	756,553.74	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	16,834.00	458,221.48	
	ユーロ　小計		60,453.00	2,469,244.90 (386,634,366)	
	香港・ドル	LINK REIT	259,971.00	9,852,900.90	
	香港・ドル　小計		259,971.00	9,852,900.90 (183,461,015)	
投資証券　合計			5,265,736	15,968,440,201 (15,968,440,201)	
合計				15,968,440,201 (15,968,440,201)	

（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　590銘柄	71.57	－	74.83
	投資証券　33銘柄	－	1.68	

イギリス・ポンド	株式	81銘柄	4.09	－	4.21
	投資証券	2銘柄	－	0.03	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.11	－	0.11
オーストラリア・ドル	株式	51銘柄	1.91	－	2.07
	投資証券	7銘柄	－	0.11	
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.26	－	3.34
	投資証券	2銘柄	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.30	－	0.35
	投資証券	4銘柄	－	0.04	
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.77	－	2.83
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	0.86	－	0.88
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.91	－	0.93
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.06	－	0.06
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.18	－	0.19
ユーロ	株式	221銘柄	9.39	－	9.64
	投資証券	5銘柄	－	0.05	
香港・ドル	株式	29銘柄	0.54	－	0.58
	投資証券	1銘柄	－	0.02	

（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）

	2023年12月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	55,663,831
金銭信託	1,823,253
コール・ローン	198,818,612
株式	7,984,324,635
投資信託受益証券	640,022,617
投資証券	10,701,266
派生商品評価勘定	22,743,047
未収配当金	12,649,616
差入委託証拠金	294,716,189
流動資産合計	9,221,463,066
資産合計	9,221,463,066
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,324,760
未払解約金	50,231,279
その他未払費用	1,965
流動負債合計	86,558,004
負債合計	86,558,004
純資産の部	
元本等	
元本	7,242,099,133
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,892,805,929
元本等合計	9,134,905,062
純資産合計	9,134,905,062
負債純資産合計	9,221,463,066

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12月11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。 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。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、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。 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．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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12月11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	3,593,083,612円
同期中一部解約元本額	1,209,132,128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	2,905,308,348円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	22,538,135円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	29,453,931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）	10,601,860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）	60,731,698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）	588,781,696円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	1,938,797,042円
ＦＷニッセイ新興国株インデックス	10,365,757円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	400,245円
ＤＣニッセイ新興国株式インデックス	1,675,120,421円
計	7,242,099,133円
２．　受益権の総数	7,242,099,133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　2022年12月13日 至　2023年12月11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	2023年12月11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	2023年12月11日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△19,229,558
投資信託受益証券	△5,105,141
投資証券	357,018
合計	△23,977,681

（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（2023年11月21日から2023年12月11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	2023年12月11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	893,759,108	－	883,306,215	10,452,893
アメリカ・ドル	893,759,108	－	883,306,215	10,452,893
買建	1,058,580,337	－	1,023,799,217	△34,781,120
アメリカ・ドル	1,058,580,337	－	1,023,799,217	△34,781,120
合計	1,952,339,445	－	1,907,105,432	△24,328,227

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

株式関連

種類	2023年12月11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	484,922,086	－	495,668,600	10,746,514
合計	484,922,086	－	495,668,600	10,746,514

（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）

	2023年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.2614円
（1万口当たり純資産額）	(12,614円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年12月11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	AUTOHOME INC-ADR	534	26.450	14,124.30	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	533	9.440	5,031.52	
	CREDICORP LTD	695	124.670	86,645.65	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	400	23.110	9,244.00	
	H WORLD GROUP LIMITED (ADR)	1,493	34.570	51,613.01	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	9,900	1.523	15,077.70	
	IQIYI INC-ADR	3,200	4.560	14,592.00	
	JOYY INC	334	37.440	12,504.96	

	KANZHUN LTD	1,900	15.200	28,880.00	
	KE HOLDINGS INC	5,299	15.100	80,014.90	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	567	59.280	33,611.76	
	LUFAX HOLDING LTD	5,900	0.867	5,115.30	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,892	0.000	0.18	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	2,982	0.000	0.29	
	NIO INC - ADR	11,342	7.380	83,703.96	
	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	
	PDD HOLDINGS INC(ADR)	5,341	138.960	742,185.36	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	552	0.000	0.05	
	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	
	QIFU TECHNOLOGY INC(ADR	500	14.770	7,385.00	
	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 BAOSIGHT SOFTWARE-B	4,320	1.978	8,544.96	
	SOUTHERN COPPER CORP	719	75.450	54,248.55	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	5,163	0.000	0.51	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	2,824	11.140	31,459.36	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	1,225	0.000	0.12	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	568	0.000	0.05	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	5,973	8.220	49,098.06	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	2,625	15.270	40,083.75	
	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	9.570	3,196.38	
	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	3,426	39.910	136,731.66	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,347	21.310	71,324.57	
アメリカ・ドル　小計		181,918		1,584,427.66 (230,375,782)	
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 (35)	
インド・ルピー	ABB INDIA LTD	517	4,746.800	2,454,095.60	
	ADANI ENTERPRISES LTD	1,562	2,822.150	4,408,198.30	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	2,770	1,550.300	4,294,331.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	3,805	1,022.950	3,892,324.75	
	ADANI POWER LTD	5,133	533.800	2,739,995.40	
	AMBUJA CEMENTS LTD	5,084	494.350	2,513,275.40	
	APL APOLLO TUBES LTD	1,926	1,601.550	3,084,585.30	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	825	5,555.350	4,583,163.75	
	ASHOK LEYLAND LTD	11,457	174.900	2,003,829.30	
	ASIAN PAINTS LTD	3,704	3,232.000	11,971,328.00	
	ASTRAL LTD	1,023	1,928.750	1,973,111.25	
	AU SMALL FINANCE BANK LTD	1,152	740.500	853,056.00	
	AUROBINDO PHARMA LTD	2,097	1,017.400	2,133,487.80	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	1,325	4,070.650	5,393,611.25	
	AXIS BANK LTD	20,928	1,131.200	23,673,753.60	
	BAJAJ AUTO LTD	593	6,075.700	3,602,890.10	
	BAJAJ FINANCE LTD	2,517	7,307.600	18,393,229.20	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,227	1,710.150	5,518,654.05	
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	215	7,984.250	1,716,613.75	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	331	2,605.650	862,470.15	
	BANDHAN BANK LTD	3,556	237.050	842,949.80	
	BANK OF BARODA	9,496	212.000	2,013,152.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,366	578.950	1,369,795.70	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	40,951	158.750	6,500,971.25	
	BHARAT FORGE LTD	1,798	1,177.150	2,116,515.70	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,051	470.450	2,376,242.95	
	BHARTI AIRTEL LTD	20,558	1,000.250	20,563,139.50	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	878	4,942.200	4,339,251.60	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LIMITED	4,728	454.850	2,150,530.80	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	3,680	1,166.650	4,293,272.00	
	CIPLA LIMITED	4,391	1,219.100	5,353,068.10	
	COAL INDIA LTD	13,639	351.000	4,787,289.00	
	COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	740	2,293.800	1,697,412.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,694	843.200	1,428,380.80	
	CUMMINS INDIA LTD	1,068	1,949.350	2,081,905.80	
	DABUR INDIA LTD	7,985	547.500	4,371,787.50	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	1,272	3,681.750	4,683,186.00	

DLF LTD	4,558	649.900	2,962,244.20	
DR. REDDY'S LABORATORIES	819	5,763.900	4,720,634.10	
EICHER MOTORS LTD	1,105	4,055.000	4,480,775.00	
GAIL INDIA LTD	14,833	140.350	2,081,811.55	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,986	1,021.550	3,050,348.30	
GODREJ PROPERTIES LTD	606	1,930.150	1,169,670.90	
GRASIM INDUSTRIES LTD	2,865	2,070.050	5,930,693.25	
HAVELLS INDIA LTD	1,686	1,343.000	2,264,298.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	7,787	1,364.100	10,622,246.70	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	787	2,987.050	2,350,808.35	
HDFC BANK LTD	25,367	1,653.200	41,936,724.40	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	8,298	671.250	5,570,032.50	
HERO MOTOCORP LTD	827	3,715.750	3,072,925.25	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	10,041	520.350	5,224,834.35	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	1,478	2,733.650	4,040,334.70	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1,930	377.500	728,575.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	7,662	2,522.300	19,325,862.60	
ICICI BANK LTD	46,653	1,010.850	47,159,185.05	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,651	1,449.400	2,392,959.40	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,346	543.550	1,275,168.30	
IDFC BANK LTD	26,252	88.050	2,311,488.60	
INDIAN HOTELS CO LTD	7,731	435.500	3,366,850.50	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	25,665	118.800	3,049,002.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,327	749.550	3,243,302.85	
INDRAPRASTHA GAS LTD	1,088	401.100	436,396.80	
INDUSIND BANK LTD	3,140	1,508.950	4,738,103.00	
INFO EDGE INDIA LTD	593	4,745.650	2,814,170.45	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	29,902	1,491.150	44,588,367.30	
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,092	2,897.950	3,164,561.40	
ITC LTD	27,630	449.150	12,410,014.50	
JINDAL STEEL & POWER LTD	2,793	686.250	1,916,696.25	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	31,385	244.250	7,665,786.25	
JSW STEEL LTD	5,271	839.350	4,424,213.85	
JUBILANT FOODWORKS LTD	2,065	559.750	1,155,883.75	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	10,177	1,838.450	18,709,905.65	
LARSEN & TOUBRO LTD	6,191	3,378.450	20,915,983.95	
LTIMINDTREE LIMITED	943	5,708.700	5,383,304.10	
LUPIN LTD	2,422	1,239.350	3,001,705.70	
MACROTECH DEVELOPERS LTD	2,725	917.700	2,500,732.50	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	7,667	1,668.550	12,792,772.85	

MARICO LTD	4,615	530.500	2,448,257.50	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,109	10,618.550	11,775,971.95	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	6,533	678.200	4,430,680.60	
MPHASIS LTD	416	2,427.050	1,009,652.80	
MRF LTD	24	117,949.400	2,830,785.60	
MUTHOOT FINANCE LTD	448	1,440.650	645,411.20	
NESTLE INDIA LTD	272	24,789.600	6,742,771.20	
NTPC LTD	38,270	285.050	10,908,863.50	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	27,953	195.950	5,477,390.35	
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	2,496	651.250	1,625,520.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	55	37,335.500	2,053,452.50	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	558	6,464.500	3,607,191.00	
PETRONET LNG LTD	6,694	210.000	1,405,740.00	
PI INDUSTRIES LTD	717	3,843.500	2,755,789.50	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,522	2,561.650	3,898,831.30	
POLYCAB INDIA LTD	517	5,446.650	2,815,918.05	
POWER FINANCE CORPORATION	15,725	384.600	6,047,835.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	39,426	228.600	9,012,783.60	
REC LTD	14,200	405.450	5,757,390.00	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	27,254	2,455.750	66,929,010.50	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	24,494	95.000	2,326,930.00	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	2,791	759.950	2,121,020.45	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	3,698	1,465.200	5,418,309.60	
SHREE CEMENT LTD	75	27,670.250	2,075,268.75	
SHRIRAM FINANCE LIMITED	2,256	2,031.600	4,583,289.60	
SIEMENS LTD	622	3,827.200	2,380,518.40	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	3,909	571.800	2,235,166.20	
SRF LTD	1,334	2,423.100	3,232,415.40	
STATE BANK OF INDIA	14,800	614.150	9,089,420.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	9,129	1,235.800	11,281,618.20	
SUPREME INDUSTRIES LTD	503	4,522.250	2,274,691.75	
SUZLON ENERGY LTD	90,666	38.750	3,513,307.50	
TATA COMMUNICATIONS LTD	1,415	1,694.850	2,398,212.75	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	8,255	3,626.700	29,938,408.50	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	6,156	946.600	5,827,269.60	
TATA ELXSI LTD	210	8,365.850	1,756,828.50	
TATA MOTORS LTD	13,971	714.550	9,982,978.05	

	TATA MOTORS LTD-A-DVR	5,780	479.650	2,772,377.00	
	TATA POWER CO LTD	13,851	323.550	4,481,491.05	
	TATA STEEL LTD	59,823	129.200	7,729,131.60	
	TECH MAHINDRA LTD	4,711	1,225.300	5,772,388.30	
	TITAN CO LTD	3,423	3,634.650	12,441,406.95	
	TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	514	2,053.450	1,055,473.30	
	TRENT LTD	1,299	2,841.300	3,690,848.70	
	TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	898	3,574.200	3,209,631.60	
	TVS MOTOR CO LTD	2,017	1,902.700	3,837,745.90	
	ULTRATECH CEMENT LTD	930	9,413.550	8,754,601.50	
	UNITED SPIRITS LTD	1,802	1,045.250	1,883,540.50	
	UPL LTD	4,658	585.200	2,725,861.60	
	VARUN BEVERAGES LTD	4,070	1,066.950	4,342,486.50	
	VEDANTA LTD	4,714	244.800	1,153,987.20	
	WIPRO LTD	10,622	422.600	4,488,857.20	
	YES BANK LTD	92,528	19.900	1,841,307.20	
	ZOMATO LTD	50,036	119.950	6,001,818.20	
インド・ルピー　小計		1,172,150		834,782,082.30 (1,460,868,644)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	84,200	2,560.000	215,552,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	75,300	6,450.000	485,685,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	53,200	1,685.000	89,642,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	173,400	5,675.000	984,045,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	521,400	8,750.000	4,562,250,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	366,500	5,700.000	2,089,050,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	110,400	5,075.000	560,280,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	652,800	5,375.000	3,508,800,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	272,598	1,750.000	477,046,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	45,500	5,025.000	228,637,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	6,968,800	108.000	752,630,400.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	8,150.000	48,900,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	9,600	10,975.000	105,360,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	10,400	6,400.000	66,560,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	176,100	1,645.000	289,684,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	113,600	2,470.000	280,592,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	162,600	905.000	147,153,000.00	

	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	9,400	6,300.000	59,220,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	99,800	2,850.000	284,430,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	499,200	3,940.000	1,966,848,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	49,100	3,510.000	172,341,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	10,600	22,300.000	236,380,000.00	
インドネシア・ルピア　小計		10,470,498		17,611,086,900.00 (165,544,217)	
オフショア・人民元	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,500	9.470	42,615.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	528	156.030	82,383.84	
	AECC AVIATION POWER CO-A	3,100	34.800	107,880.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	71,800	3.570	256,326.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	4,637	16.320	75,675.84	
	AIR CHINA LTD-A	10,100	7.920	79,992.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	14,800	5.230	77,404.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	21.820	21,820.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	241.000	72,300.00	
	ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	140	121.030	16,944.20	
	AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS	9,200	3.300	30,360.00	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	8,600	4.540	39,044.00	
	BANK OF CHINA LTD-A	32,100	3.940	126,474.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	22,200	5.710	126,762.00	
	BANK OF JIANGSU CO LTD-A	7,800	6.540	51,012.00	
	BANK OF NANJING CO LTD -A	8,800	7.180	63,184.00	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	4,300	20.820	89,526.00	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	4,500	5.840	26,280.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	33,200	6.110	202,852.00	
	BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	218	324.300	70,697.40	
	BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,000	50.960	101,920.00	
	BEIJING UNITED INFORMATION-A	1,305	33.450	43,652.25	

BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	560	48.150	26,964.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	24,200	4.960	120,032.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	45,400	3.870	175,698.00	
BYD CO LTD -A	1,300	198.550	258,115.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	7,500	7.950	59,625.00	
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	38,200	5.570	212,774.00	
CGN POWER CO LTD-A	67,200	3.030	203,616.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	151.360	15,136.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	12,300	5.530	68,019.00	
CHINA BAOAN GROUP-A	17,200	11.850	203,820.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,600	6.350	60,960.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	3,200	27.590	88,288.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6,800	4.100	27,880.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	37,000	2.900	107,300.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	6,900	12.240	84,456.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	2,400	39.630	95,112.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1,000	28.490	28,490.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	10,800	27.500	297,000.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	10,500	14.060	147,630.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	9.580	18,202.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	21,200	3.820	80,984.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	7.040	74,624.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	11,500	19.620	225,630.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,000	23.090	92,360.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	25,900	5.470	141,673.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	8,800	5.530	48,664.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	10,871	4.420	48,049.82	

CHINA RESOURCES MICROELECT-A	1,473	45.700	67,316.10	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	4,800	30.580	146,784.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4,700	6.040	28,388.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	22,900	4.760	109,004.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	57,100	4.440	253,524.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	800	82.300	65,840.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	8,100	10.780	87,318.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	13,400	22.620	303,108.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	500	59.200	29,600.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	24,600	2.580	63,468.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	5,850	18.340	107,289.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	3,200	62.240	199,168.00	
CITIC SECURITIES CO-A	6,700	20.950	140,365.00	
CMOC GROUP LTD-A	11,300	4.900	55,370.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	1,300	48.490	63,037.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,280	163.590	372,985.20	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	5,070	9.930	50,345.10	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,600	25.450	66,170.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,200	14.090	59,178.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	6,013	14.370	86,406.81	
EVE ENERGY CO LTD-A	900	41.590	37,431.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	6.070	35,813.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	2,554	36.350	92,837.90	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	11,600	8.870	102,892.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	6,300	15.760	99,288.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	2,800	36.450	102,060.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	2,800	42.150	118,020.00	

GD POWER DEVELOPMENT CO -A	13,200	4.090	53,988.00	
GEM CO LTD-A	13,300	5.550	73,815.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	14.220	52,614.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	196	91.910	18,014.36	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	200	62.980	12,596.00	
GOERTEK INC -A	1,000	17.740	17,740.00	
GOLDWIND SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A	3,900	8.340	32,526.00	
GONGNIU GROUP CO LTD-A	700	92.780	64,946.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,800	22.500	40,500.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,500	25.980	90,930.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,200	32.880	105,216.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,000	42.600	42,600.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	5,400	7.070	38,178.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	8,700	9.310	80,997.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,300	29.090	37,817.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,000	23.330	23,330.00	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL HOLDINGS GROUP CO LTD-A	9,800	6.290	61,642.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,200	8.940	100,128.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,300	14.740	48,642.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,500	20.800	114,400.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	12,600	9.500	119,700.00	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,176	22.410	26,354.16	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	26.180	20,944.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	7,900	13.400	105,860.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2,800	12.090	33,852.00	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	5,700	6.680	38,076.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	700	159.300	111,510.00	

HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	400	49.350	19,740.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,300	39.510	51,363.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	7,700	7.780	59,906.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,500	14.140	120,190.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	4,100	7.960	32,636.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	5.680	35,216.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	16.580	23,212.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	123.720	61,860.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	1,183	29.460	34,851.18	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	48.450	58,140.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	100	281.070	28,107.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	54,400	4.730	257,312.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD - A	14,000	14.110	197,540.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	1.570	50,868.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	3.740	7,854.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	2,800	26.360	73,808.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,372	19.100	26,205.20	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	2,900	9.500	27,550.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,000	52.770	52,770.00	
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS CO LTD-A	3,384	45.590	154,276.56	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,300	51.020	66,326.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY - A	900	111.700	100,530.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,200	12.820	28,204.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	17.260	34,520.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	6,076	8.740	53,104.24	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	6,600	13.470	88,902.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	700	1,704.920	1,193,444.00	
LB GROUP CO LTD-A	2,900	16.470	47,763.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	2,400	12.700	30,480.00	

LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	13,900	6.490	90,211.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,480	20.730	134,330.40	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	3,089	30.890	95,419.21	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	900	190.000	171,000.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,300	30.260	39,338.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	480	136.000	65,280.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	3.070	62,935.00	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	974	57.500	56,005.00	
MUYUAN FOODS CO LTD-A	2,190	40.100	87,819.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,110	21.260	66,118.60	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	222.230	44,446.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	30.160	27,144.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	9.420	16,956.00	
NINESTAR CORP-A	1,700	25.700	43,690.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	5,400	13.600	73,440.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	70.400	49,280.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	4,400	13.940	61,336.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	4,500	8.680	39,060.00	
PETROCHINA CO LTD-A	29,700	6.870	204,039.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	675	29.150	19,676.25	
PICC HOLDING CO-A	14,900	4.920	73,308.00	
PING AN BANK CO LTD-A	9,700	9.300	90,210.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	4,900	39.190	192,031.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	9.770	26,379.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	12,200	4.370	53,314.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	4.970	49,700.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	2,700	16.050	43,335.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,000	10.280	30,840.00	
S F HOLDING CO LTD-A	2,200	41.190	90,618.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,000	14.120	112,960.00	

SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	5,100	13.730	70,023.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	12.990	38,970.00	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	4,600	15.480	71,208.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	13,700	6.870	94,119.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	12,900	12.750	164,475.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	2,300	11.930	27,439.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	4,700	19.240	90,428.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	460	22.780	10,478.80	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,900	28.570	54,283.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	30,200	2.830	85,466.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,560	46.930	73,210.80	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	4.240	26,712.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	27.200	97,920.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,600	5.000	43,000.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	5,100	10.680	54,468.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	5,500	17.400	95,700.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	18,900	6.670	126,063.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	1,160	21.470	24,905.20	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	14,800	5.630	83,324.00	
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,296	150.080	194,503.68	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	24,900	7.140	177,786.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	5,600	5.500	30,800.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	480	231.500	111,120.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	7,900	10.270	81,133.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	140	70.910	9,927.40	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11,000	4.520	49,720.00	

SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	160	64.550	10,328.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,500	59.110	88,665.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	480	32.600	15,648.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	500	296.000	148,000.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	336	127.770	42,930.72	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,800	24.910	44,838.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	500	79.020	39,510.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	102.410	16,385.60	
TBEA CO LTD-A	2,860	13.470	38,524.20	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4,400	4.170	18,348.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	1,875	15.600	29,250.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	7,200	10.500	75,600.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	1,300	55.600	72,280.00	
TONGWEI CO LTD-A	3,900	23.660	92,274.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	1,092	26.480	28,916.16	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	600	71.650	42,990.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	419	67.900	28,450.10	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	980	20.940	20,521.20	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	1,500	76.190	114,285.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	3,400	13.920	47,328.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1,800	19.660	35,388.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.540	63,438.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	405	107.300	43,456.50	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	44.550	8,910.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	5,100	4.610	23,511.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	5,200	7.500	39,000.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	2,300	142.930	328,739.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	1,872	76.000	142,272.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2,600	5.340	13,884.00	

	XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	4,700	17.000	79,900.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	5,200	19.520	101,504.00	
	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	1,300	33.470	43,511.00	
	YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,690	17.940	30,318.60	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	2,500	12.240	30,600.00	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	700	49.720	34,804.00	
	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	300	56.860	17,058.00	
	ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	300	242.200	72,660.00	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	1,100	21.450	23,595.00	
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	3,000	19.850	59,550.00	
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	650	32.150	20,897.50	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	800	40.260	32,208.00	
	ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,008	17.120	17,256.96	
	ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2,000	10.410	20,820.00	
	ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	12,400	7.130	88,412.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	21,100	11.670	246,237.00	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9,400	6.340	59,596.00	
	ZTE CORP-A	700	26.100	18,270.00	
オフショア・人民元　小計		1,659,267		19,251,076.04 (389,360,713)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	2,517	31,980.000	80,493,660.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,540	27,900.000	126,666,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,462	15,800.000	23,099,600.00	
コロンビア・ペソ　小計		8,519		230,259,260.00 (8,389,726)	
タイ・バーツ	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	11,200	220.000	2,464,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	38,000	60.000	2,280,000.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-FOREIGN	88,100	3.720	327,732.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	93,400	25.750	2,405,050.00	

BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	71,300	8.100	577,530.00	
BANPU PUBLIC CO LTD-FOR REG	85,600	6.750	577,800.00	
BERLI JUCKER PUB CO-FORGN	6,000	26.000	156,000.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	57,400	7.300	419,020.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	4,400	214.000	941,600.00	
CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	14,300	65.500	936,650.00	
CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN	15,700	38.750	608,375.00	
CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	26,800	18.800	503,840.00	
CP ALL PCL-FOREIGN	50,500	52.750	2,663,875.00	
CP AXTRA PUBLIC COMPANY LIMITED (F)	19,900	26.250	522,375.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN	25,500	81.000	2,065,500.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN	19,200	44.250	849,600.00	
GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F	8,800	46.750	411,400.00	
GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	42,400	45.500	1,929,200.00	
HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	44,400	12.000	532,800.00	
INDORAMA VENTURES-FOREIGN	12,200	25.500	311,100.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6,300	69.750	439,425.00	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	4,900	127.000	622,300.00	
KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	32,300	18.200	587,860.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN	15,500	46.250	716,875.00	
LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	154,500	7.650	1,181,925.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	18,500	27.250	504,125.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG	2,100	43.250	90,825.00	
OSOTSPA PCL-FOREIGN	3,200	21.500	68,800.00	
PTT EXPLORATION & PROD-FOR	15,800	142.000	2,243,600.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	14,300	38.750	554,125.00	
PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN	32,900	20.000	658,000.00	
PTT PCL/FOREIGN	102,600	35.750	3,667,950.00	

	SCB X PCL-FOREIGN	6,800	99.250	674,900.00	
	SCG PACKAGING PCL-FOREIGN	7,300	38.250	279,225.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	7,000	292.000	2,044,000.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	9,300	51.000	474,300.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-FOREIGN	60,798	5.150	313,109.70	
タイ・バーツ　小計		1,229,198		36,604,791.70 (150,445,694)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	1,396	987.500	1,378,550.00	
	KOMERCNI BANKA AS	654	710.500	464,667.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	92.000	103,408.00	
チェコ・コルナ　小計		3,174		1,946,625.00 (12,483,511)	
チリ・ペソ	BANCO DE CHILE	347,416	98.700	34,289,959.20	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	683	23,999.000	16,391,317.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	627,335	43.000	26,975,405.00	
	CENCOSUD SA	9,218	1,663.000	15,329,534.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	92,857	51.680	4,798,849.76	
	EMPRESAS CMPC SA	10,124	1,713.700	17,349,498.80	
	EMPRESAS COPEC SA	3,034	6,537.500	19,834,775.00	
	ENEL CHILE SA	90,486	57.840	5,233,710.24	
	ENERSIS SA	205,266	101.900	20,916,605.40	
	FALABELLA SA	7,564	2,197.900	16,624,915.60	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,584	46,190.000	73,164,960.00	
チリ・ペソ　小計		1,395,567		250,909,530.00 (41,776,688)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	29,310	34.960	1,024,677.60	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	11,662	46.180	538,551.16	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,758	321.750	1,530,886.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,135	39.340	320,030.90	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	593	809.500	480,033.50	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	6,843	61.850	423,239.55	
	HEKTAS TICARET T.A.S	9,137	21.100	192,790.70	
	KOC HOLDING AS	5,853	141.800	829,955.40	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	412	714.500	294,374.00	
	SASA POLYESTER SANAYI	8,293	49.700	412,162.10	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	1,087	225.000	244,575.00	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,587	152.600	1,310,376.20	

	TURK HAVA YOLLARI AO	6,115	254.000	1,553,210.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	10,503	47.440	498,262.32	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,833	58.500	692,230.50	
	TURKIYE IS BANKASI-C	32,580	22.260	725,230.80	
	YAPI VE KREDI BANKASI	39,247	19.670	771,988.49	
トルコ・リラ　小計		194,948		11,842,574.72 (59,471,042)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	4,259	2,766.000	11,780,394.00	
	OTP BANK RT	2,423	14,780.000	35,811,940.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	875	8,930.000	7,813,750.00	
ハンガリー・フォリント　小計		7,557		55,406,084.00 (22,824,148)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	6,310	48.100	303,511.00	
	AYALA CORPORATION	1,795	640.000	1,148,800.00	
	AYALA LAND INC	55,300	31.400	1,736,420.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	15,205	101.900	1,549,389.50	
	BDO UNIBANK INC	21,458	126.900	2,723,020.20	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	9,230	229.000	2,113,670.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	18,558	37.800	701,492.40	
	JOLLIBEE FOODS CORP	7,320	235.800	1,726,056.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,370	372.600	510,462.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	15,127	51.450	778,284.15	
	PLDT INC	585	1,252.000	732,420.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,795	826.000	1,482,670.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	105,700	32.650	3,451,105.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	7,280	112.800	821,184.00	
フィリピン・ペソ　小計		267,033		19,778,484.25 (51,900,721)	
ブラジル・レアル	AMBEV SA	47,600	14.310	681,156.00	
	ATACADAO SA	1,900	11.060	21,014.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	17,203	14.510	249,615.53	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	48,479	16.460	797,964.34	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	9,200	34.370	316,204.00	
	BANCO DO BRASIL SA	6,500	54.450	353,925.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	3,000	31.100	93,300.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	4,400	31.110	136,884.00	
	BM&FBOVESPA SA	56,500	13.540	765,010.00	
	CCR SA	6,800	14.050	95,540.00	

	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,600	45.150	117,390.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	10,100	40.900	413,090.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	8,475	10.920	92,547.00	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	13,900	9.570	133,023.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,500	67.660	169,150.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	5,100	17.200	87,720.00	
	COSAN SA	10,400	17.520	182,208.00	
	CPFL ENERGIA SA	3,000	37.050	111,150.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,300	52.150	119,945.00	
	ENEVA SA	8,300	12.730	105,659.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	675	43.750	29,531.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	8,600	34.250	294,550.00	
	GERDAU SA-PREF	10,020	22.510	225,550.20	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	43,506	4.350	189,251.10	
	HYPERA S.A	2,900	35.560	103,124.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	45,050	32.020	1,442,501.00	
	ITAUSA SA	43,381	9.860	427,736.66	
	JBS SA	7,100	23.880	169,548.00	
	KLABIN SA - UNIT	4,000	20.740	82,960.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	7,395	61.080	451,686.60	
	LOJAS RENNER S.A.	13,362	16.450	219,804.90	
	MAGAZINE LUIZA SA	15,200	2.130	32,376.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	7,300	16.930	123,589.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	32,000	36.660	1,173,120.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	44,100	34.490	1,521,009.00	
	PRIO S.A.	6,700	44.550	298,485.00	
	RAIA DROGASIL SA	10,936	28.190	308,285.84	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	5,300	26.500	140,450.00	
	RUMO SA	13,500	22.170	299,295.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	11,700	11.980	140,166.00	
	SUZANO S.A.	7,622	50.770	386,968.94	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	3,100	53.500	165,850.00	
	TIM SA	10,500	17.910	188,055.00	
	TOTVS SA	4,400	34.360	151,184.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	5,200	25.900	134,680.00	
	VALE SA	30,754	72.800	2,238,891.20	
	VIBRA ENERGIA SA	7,800	22.500	175,500.00	
	WEG SA	16,320	34.650	565,488.00	

ブラジル・レアル　小計		686,678		16,722,131.56 (492,871,450)	
ポーランド・ズロチ	ALLEGRO.EU SA	3,469	30.225	104,850.52	
	BANK PEKAO SA	2,397	147.600	353,797.20	
	BUDIMEX	97	576.000	55,872.00	
	CD PROJEKT SA	427	112.150	47,888.05	
	CYFROWY POLSAT SA	1,022	13.140	13,429.08	
	DINO POLSKA SA	331	454.300	150,373.30	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,585	117.950	186,950.75	
	LPP SA	9	16,260.000	146,340.00	
	MBANK SA	114	560.000	63,840.00	
	ORLEN SA	4,634	62.010	287,354.34	
	PEPCO GROUP NV	1,508	24.500	36,946.00	
	PGE SA	8,858	8.880	78,659.04	
	PKO BANK POLSKI SA	7,140	49.540	353,715.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	4,925	48.160	237,188.00	
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	361	510.500	184,290.50	
ポーランド・ズロチ　小計		36,877		2,301,494.38 (83,088,550)	
マレーシア・リンギット	AMBANK HOLDINGS BHD	9,700	4.020	38,994.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	20,500	2.330	47,765.00	
	CELCOMDIGI BERHAD	51,800	4.060	210,308.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	59,300	5.760	341,568.00	
	DIALOG GROUP BHD	14,900	1.970	29,353.00	
	GAMUDA BHD	18,800	4.460	83,848.00	
	GENTING BHD	33,300	4.600	153,180.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	11,300	2.640	29,832.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	4,500	19.160	86,220.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	17,200	5.860	100,792.00	
	INARI AMERTRON BHD	16,600	2.830	46,978.00	
	IOI CORPORATION BHD	19,700	3.960	78,012.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	3,400	21.520	73,168.00	
	MALAYAN BANKING BHD	46,500	9.040	420,360.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	4,900	7.080	34,692.00	
	MAXIS BHD	19,600	3.860	75,656.00	
	MISC BHD	5,000	7.100	35,500.00	
	MR DIY GROUP M BHD	16,300	1.540	25,102.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	117.500	70,500.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	28,500	7.060	201,210.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,300	21.620	71,346.00	
	PETRONAS GAS BHD	5,400	16.700	90,180.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,680	14.180	80,542.40	

	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	26,100	4.800	125,280.00	
	PUBLIC BANK BHD	159,700	4.240	677,128.00	
	QL RESOURCES BHD	3,000	5.470	16,410.00	
	RHB BANK BHD	17,000	5.500	93,500.00	
	SIME DARBY BERHAD	4,800	2.360	11,328.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	19,000	4.430	84,170.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	12,500	5.230	65,375.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	23,600	9.910	233,876.00	
マレーシア・リンギット　小計		682,480		3,732,173.40 (115,989,978)	
メキシコ・ペソ	ALFA S.A.B.-A	17,900	12.890	230,731.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	158,600	15.890	2,520,154.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,000	181.290	725,160.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	5,900	53.830	317,597.00	
	CEMEX SAB-CPO	125,400	12.330	1,546,182.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	3,275	153.900	504,022.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	17,700	223.160	3,949,932.00	
	GRUMA S.A.B.-B	1,200	321.180	385,416.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	1,580	402.900	636,582.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	3,800	155.350	590,330.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	4,425	256.040	1,132,977.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	10,100	87.270	881,427.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	5,300	161.020	853,406.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	24,000	166.060	3,985,440.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	16,600	42.630	707,658.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	30,200	80.250	2,423,550.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,160	256.470	297,505.20	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	10,000	34.830	348,300.00	
	OPERADORA DE SITES MEX-A-1	12,000	22.090	265,080.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	12,500	36.300	453,750.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,765	172.560	304,568.40	
	WALMART DE MEXICO-SER V	48,800	66.110	3,226,168.00	

メキシコ・ペソ　小計		516,205		26,285,936.10 (220,294,545)	
ユーロ	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	25,965	1.485	38,558.02	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	17,393	1.608	27,967.94	
	FF GROUP	129	4.800	619.20	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,778	13.300	23,647.40	
	JUMBO SA	1,127	25.500	28,738.50	
	MOTOR OIL (HELLAS) SA	567	24.860	14,095.62	
	MYTILINEOS S.A.	713	36.000	25,668.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	8,342	5.956	49,684.95	
	OPAP SA	2,062	14.860	30,641.32	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	5,508	3.126	17,218.00	
	PUBLIC POWER CORP	1,420	10.800	15,336.00	
ユーロ　小計		65,004		272,174.95 (42,617,154)	
韓国・ウォン	AMOREPACIFIC CORP	353	125,400.000	44,266,200.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	931	73,900.000	68,800,900.00	
	CELLTRION INC	918	167,700.000	153,948,600.00	
	CELLTRION PHARM INC	175	82,800.000	14,490,000.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	61	316,500.000	19,306,500.00	
	COSMOAM&T CO LTD	205	156,700.000	32,123,500.00	
	COWAY CO LTD	312	53,100.000	16,567,200.00	
	DAUM COMMUNICATIONS CORP	3,225	51,700.000	166,732,500.00	
	DB INSURANCE CO LTD	363	84,900.000	30,818,700.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	272	43,000.000	11,696,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,365	15,720.000	52,897,800.00	
	ECOPRO BM CO LTD	417	313,000.000	130,521,000.00	
	ECOPRO CO LTD	159	667,000.000	106,053,000.00	
	F&F CO LTD / NEW	90	79,800.000	7,182,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	407	41,950.000	17,073,650.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	2,407	41,450.000	99,770,150.00	
	HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	531	46,400.000	24,638,400.00	
	HANMI PHARM CO LTD	59	328,000.000	19,352,000.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	367	60,300.000	22,130,100.00	
	HANON SYSTEMS	960	6,970.000	6,691,200.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	330	131,300.000	43,329,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	968	31,400.000	30,395,200.00	
	HD HYUNDAI	361	61,300.000	22,129,300.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	128	123,100.000	15,756,800.00	

HD KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	337	109,400.000	36,867,800.00	
HLB INC	646	33,350.000	21,544,100.00	
HMM CO LTD	2,204	15,750.000	34,713,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	264	64,300.000	16,975,200.00	
HYBE CO LTD	157	237,500.000	37,287,500.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	474	36,100.000	17,111,400.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	131	176,400.000	23,108,400.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	212	80,100.000	16,981,200.00	
HYUNDAI MOBIS	630	226,500.000	142,695,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,370	185,100.000	253,587,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	239	109,400.000	26,146,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	108,100.000	18,377,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	528	34,750.000	18,348,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,205	11,860.000	26,151,300.00	
JYP ENTERTAINMENT CORP	217	94,400.000	20,484,800.00	
KAKAOBANK CORP	1,670	26,000.000	43,420,000.00	
KAKAOPAY CORP	248	48,400.000	12,003,200.00	
KANGWON LAND INC	358	16,130.000	5,774,540.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	3,666	51,800.000	189,898,800.00	
KIA CORPORATION	2,485	86,400.000	214,704,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	515	47,050.000	24,230,750.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,118	19,340.000	40,962,120.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	481	61,500.000	29,581,500.00	
KOREA ZINC CO LTD	53	498,500.000	26,420,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,198	22,700.000	27,194,600.00	
KRAFTON INC	240	207,000.000	49,680,000.00	
KT CORP	746	34,500.000	25,737,000.00	
KT&G CORP	789	90,800.000	71,641,200.00	
KUM YANG CO LTD	347	116,000.000	40,252,000.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	101	126,100.000	12,736,100.00	
L&F CO LTD	197	188,000.000	37,036,000.00	
LG CHEM LTD	481	478,500.000	230,158,500.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	56	302,000.000	16,912,000.00	
LG CORP	857	82,400.000	70,616,800.00	
LG DISPLAY CO LTD	1,329	12,430.000	16,519,470.00	
LG ELECTRONICS INC	917	94,600.000	86,748,200.00	
LG ENERGY SOLUTION	461	430,500.000	198,460,500.00	
LG H AND H CO LTD	100	320,500.000	32,050,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	83	236,500.000	19,629,500.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	1,340	10,490.000	14,056,600.00	

LG UPLUS CORP	815	10,320.000	8,410,800.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	113	159,800.000	18,057,400.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	848	58,500.000	49,608,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	1,312	7,160.000	9,393,920.00	
NAVER CORP	1,228	217,500.000	267,090,000.00	
NCSOFT CORPORATION	137	238,500.000	32,674,500.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	59,400.000	3,445,200.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	234	111,300.000	26,044,200.00	
PEARL ABYSS CORP	159	38,950.000	6,193,050.00	
POSCO DX CO LTD	586	49,400.000	28,948,400.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	270	343,000.000	92,610,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	665	471,500.000	313,547,500.00	
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	426	56,900.000	24,239,400.00	
S-OIL CORPORATION	300	66,700.000	20,010,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	191	709,000.000	135,419,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	701	124,800.000	87,484,800.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	502	150,900.000	75,751,800.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	42,329	72,600.000	3,073,085,400.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	7,536	58,400.000	440,102,400.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,205	25,300.000	30,486,500.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	334	252,500.000	84,335,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,102	7,890.000	40,254,780.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	495	69,200.000	34,254,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	535	450,000.000	240,750,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	365	165,600.000	60,444,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	452	39,550.000	17,876,600.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	3,586	36,650.000	131,426,900.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	152	90,200.000	13,710,400.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	115	70,000.000	8,050,000.00	
SK HYNIX INC	4,946	127,500.000	630,615,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	181	86,500.000	15,656,500.00	
SK INC	336	170,800.000	57,388,800.00	
SK INNOVATION CO LTD	492	135,600.000	66,715,200.00	
SK SQUARE CO LTD	1,151	49,600.000	57,089,600.00	
SK TELECOM CO LTD	720	49,900.000	35,928,000.00	
SKC CO LTD	129	92,300.000	11,906,700.00	

	WOORI FINANCIAL GROUP INC	6,866	12,810.000	87,953,460.00	
	YUHAN CORP	448	65,800.000	29,478,400.00	
韓国・ウォン　小計		134,004		9,769,907,490.00 (1,080,551,768)	
香港・ドル	3SBIO INC	15,500	7.160	110,980.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	3,500	20.850	72,975.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	217,000	2.830	614,110.00	
	AIR CHINA LIMITED-H	10,000	5.150	51,500.00	
	AKESO INC	4,000	43.200	172,800.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	145,100	70.500	10,229,550.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	52,000	4.250	221,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	3.560	85,440.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	11,500	17.220	198,030.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	700	120.290	84,203.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	13,000	73.400	954,200.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	4,000	3.310	13,240.00	
	BAIDU INC-CLASS A	20,900	111.800	2,336,620.00	
	BANK OF CHINA LTD - H	725,000	2.820	2,044,500.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	77,000	4.630	356,510.00	
	BEIGENE LTD	5,800	106.700	618,860.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	4,500	25.650	115,425.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	1.510	24,160.00	
	BILIBILI INC-CLASS Z	1,920	93.450	179,424.00	
	BOC AVIATION LTD	1,900	55.500	105,450.00	
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	16,000	3.390	54,240.00	
	BYD CO LTD	9,500	210.800	2,002,600.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	6,500	31.350	203,775.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	6,000	15.120	90,720.00	
	CGN POWER CO LTD-H	65,000	1.860	120,900.00	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	276,000	0.730	201,480.00	
	CHINA CITIC BANK	77,000	3.550	273,350.00	
	CHINA COAL ENERGY CO - H	20,000	6.700	134,000.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	3.280	26,240.00	

CHINA CONSTRUCTION BANK-H	875,000	4.440	3,885,000.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	30,150	6.980	210,447.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	12,000	2.200	26,400.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	15,000	2.380	35,700.00	
CHINA FEIHE LTD	32,000	4.230	135,360.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	11,500	4.040	46,460.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	26,800	7.090	190,012.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	14,000	5.660	79,240.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	13,200	11.240	148,368.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	62,000	9.970	618,140.00	
CHINA LITERATURE LTD	3,600	27.450	98,820.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	5.600	179,200.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	8,000	13.600	108,800.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	28,000	20.900	585,200.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	40,500	25.400	1,028,700.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	10,000	9.930	99,300.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	55,900	2.570	143,663.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	42,000	3.340	140,280.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	8.030	96,360.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	35,500	12.960	460,080.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	5,000	5.890	29,450.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	22,200	15.300	339,660.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	230,000	3.900	897,000.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	74,880	6.630	496,454.40	
CHINA POWER INTERNATIONAL	33,000	2.860	94,380.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	28,000	3.340	93,520.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	14,000	33.650	471,100.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	8,200	24.550	201,310.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	34,000	25.700	873,800.00	

CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	10,000	26.550	265,500.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	18,000	4.730	85,140.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	16,000	14.980	239,680.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	52,000	1.840	95,680.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	32,500	24.650	801,125.00	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	14,000	7.170	100,380.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	3.430	82,320.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	12,000	8.610	103,320.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	6,600	6.600	43,560.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	600	75.700	45,420.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	402,000	0.810	325,620.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	6,000	3.860	23,160.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	13,800	7.090	97,842.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	12,000	5.900	70,800.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	29,800	10.300	306,940.00	
CITIC LTD	50,000	7.160	358,000.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	16,500	15.460	255,090.00	
CMOC GROUP LIMITED-H	24,000	4.060	97,440.00	
COSCO PACIFIC LTD	6,000	5.280	31,680.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	21,000	6.540	137,340.00	
CRRC CORP LTD H	34,000	3.270	111,180.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	18,000	3.860	69,480.00	
EAST BUY HOLDING LIMITED	3,000	33.650	100,950.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	5,800	50.000	290,000.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	5.850	40,950.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	3,000	11.960	35,880.00	
FOSUN INTERNATIONAL	17,000	4.220	71,740.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3,200	35.350	113,120.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	2,200	26.800	58,960.00	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	170,000	1.090	185,300.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	5,700	8.640	49,248.00	

GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	57,000	7.830	446,310.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	20.200	202,000.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	4,800	9.670	46,416.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	15,000	10.180	152,700.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	11,500	7.590	87,285.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	30,000	5.180	155,400.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	19,600	3.460	67,816.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	16,000	14.500	232,000.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	25,400	21.300	541,020.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	5,000	18.880	94,400.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	10,000	4.140	41,400.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	8,000	14.400	115,200.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	4,500	27.250	122,625.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	16.860	50,580.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	14,000	4.100	57,400.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	5,400	9.800	52,920.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	2,000	41.400	82,800.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	590,000	3.630	2,141,700.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	12,500	39.750	496,875.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	10,550	37.050	390,877.50	
JD LOGISTICS INC	22,100	9.160	202,436.00	
JD.COM INC - CL A	22,157	104.800	2,322,053.60	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	6.920	13,840.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	9,000	10.520	94,680.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	4,000	17.780	71,120.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	2,500	6.740	16,850.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	23,000	10.380	238,740.00	
KINGSOFT CORP LTD	8,000	25.100	200,800.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	19,700	53.850	1,060,845.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	36,000	6.870	247,320.00	
LEGEND GROUP LTD	58,000	9.560	554,480.00	
LI AUTO INC-CLASS A	10,800	135.700	1,465,560.00	
LI NING CO LTD	20,500	21.350	437,675.00	

LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	15,500	12.300	190,650.00	
MEITUAN-B	46,060	86.650	3,991,099.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	5,300	8.020	42,506.00	
MINISO GROUP HOLDING LTD	4,200	39.850	167,370.00	
MINTH GROUP LTD	4,000	15.700	62,800.00	
NETEASE INC	17,900	165.000	2,953,500.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	6,000	14.680	88,080.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	14,000	62.850	879,900.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,000	3.650	10,950.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	19,600	44.950	881,020.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	1,000	93.200	93,200.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	105,000	2.440	256,200.00	
PETROCHINA CO LTD-H	180,000	4.860	874,800.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	69,000	8.850	610,650.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1,600	18.120	28,992.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	64,500	33.750	2,176,875.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	3,800	19.940	75,772.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	67,000	3.570	239,190.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	11,000	7.340	80,740.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	5,750	14.600	83,950.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,400	7.020	115,128.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	3,000	16.480	49,440.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	10.840	29,268.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	6,800	78.250	532,100.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	94,000	3.370	316,780.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	10,000	18.700	187,000.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	6,000	15.000	90,000.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	21,000	6.280	131,880.00	
SUNNY OPTICAL TECH	6,000	68.200	409,200.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	59,400	305.600	18,152,640.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	12,000	9.210	110,520.00	

	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	8,000	13.700	109,600.00	
	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	18,000	5.750	103,500.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	10,000	13.240	132,400.00	
	TRIP.COM GROUP LTD	5,150	260.800	1,343,120.00	
	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	51.200	409,600.00	
	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	3,000	5.280	15,840.00	
	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	28,000	4.530	126,840.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	12,000	13.400	160,800.00	
	WUXI APPTEC CO LTD-H	2,840	81.150	230,466.00	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	36,500	29.350	1,071,275.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	143,000	14.620	2,090,660.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	44,000	4.120	181,280.00	
	XPENG INC - CLASS A SHARES	9,700	60.400	585,880.00	
	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	4.550	40,950.00	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	10,000	13.320	133,200.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	15,000	13.760	206,400.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	17,200	6.640	114,208.00	
	ZAI LAB LTD	7,800	20.950	163,410.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	12,500	9.480	118,500.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	4.790	9,580.00	
	ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	5,900	38.650	228,035.00	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	7,700	19.120	147,224.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,500	17.060	110,890.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	3,900	23.800	92,820.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	48,000	11.640	558,720.00	
	ZTE CORP-H	6,200	16.720	103,664.00	
香港・ドル　小計		7,134,857		93,206,517.50 (1,735,505,352)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	4,000	532.000	2,128,000.00	
	ACER INC	21,000	35.200	739,200.00	
	ADVANTECH CO LTD	5,408	352.000	1,903,616.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	1,010.000	1,010,000.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	1,000	3,335.000	3,335,000.00	

ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	30,000	129.500	3,885,000.00	
ASIA CEMENT CORP	16,000	41.800	668,800.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	6,000	398.500	2,391,000.00	
AUO CORPORATION	51,800	16.600	859,880.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	4,000	184.500	738,000.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	83,000	44.850	3,722,550.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	13,067	181.000	2,365,127.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	20,450	17.850	365,032.50	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	13,000	45.000	585,000.00	
CHINA AIRLINES LTD	20,000	21.650	433,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	127,083	12.450	1,582,183.35	
CHINA STEEL CORP	99,000	26.100	2,583,900.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	28,000	120.500	3,374,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	36,000	31.200	1,123,200.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	151,000	27.500	4,152,500.00	
DELTA ELECTRONICS INC	19,000	312.500	5,937,500.00	
E INK HOLDINGS INC	6,000	178.500	1,071,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	119,136	25.600	3,049,881.60	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,000	577.000	577,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	2,460.000	2,460,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	18,000	32.350	582,300.00	
EVERGREEN MARINE	5,660	118.500	670,710.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	21,000	30.950	649,950.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	17,000	81.600	1,387,200.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,718	182.000	676,676.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	86,522	27.600	2,388,007.20	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	39,000	63.300	2,468,700.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	12,000	82.200	986,400.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	33,000	80.000	2,640,000.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	73,621	63.200	4,652,847.20	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	4,000	258.500	1,034,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	1,000	1,895.000	1,895,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	579.000	1,158,000.00	

HON HAI PRECISION INDUSTRY	115,200	101.500	11,692,800.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	3,040	701.000	2,131,040.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	70,314	22.100	1,553,939.40	
INNOLUX CORPORATION	75,558	12.900	974,698.20	
INVENTEC CO LTD	23,000	42.300	972,900.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	2,290.000	2,290,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	16,000	113.000	1,808,000.00	
MEDIATEK INC	14,000	943.000	13,202,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	94,197	39.250	3,697,232.25	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	5,000	179.000	895,000.00	
MOMO.COM INC	1,100	510.000	561,000.00	
NAN YA PLASTICS CORP	41,000	67.600	2,771,600.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	2,000	250.000	500,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	8,000	72.100	576,800.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	348.500	348,500.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	5,000	508.000	2,540,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,000	1,105.000	1,105,000.00	
PEGATRON CORP	16,000	81.700	1,307,200.00	
PHARMAESSENTIA CORP	2,000	338.000	676,000.00	
POU CHEN	7,000	31.100	217,700.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	32,000	28.800	921,600.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,000	271.000	1,355,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	25,000	203.000	5,075,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	4,000	444.500	1,778,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	8,802	36.600	322,153.20	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	150,244	8.840	1,328,156.96	
SILERGY CORP	3,000	410.500	1,231,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	110,435	19.250	2,125,873.75	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	8,000	67.700	541,600.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	91,124	17.900	1,631,119.60	
TAIWAN BUSINESS BANK	47,104	13.500	635,904.00	
TAIWAN CEMENT	71,090	34.600	2,459,714.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	89,516	26.750	2,394,553.00	

	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	30.200	181,200.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	14,000	99.100	1,387,400.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	218,000	570.000	124,260,000.00	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	35,000	45.850	1,604,750.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	45,000	74.100	3,334,500.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	11,000	174.500	1,919,500.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	93,000	48.550	4,515,150.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	8,000	78.700	629,600.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,535.000	1,535,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	24,000	37.000	888,000.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	3,795	51.100	193,924.50	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	17,000	27.400	465,800.00	
	WISTRON CORP	22,000	92.600	2,037,200.00	
	WIWYNN CORP	1,000	1,750.000	1,750,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	11,760	79.200	931,392.00	
	YAGEO CORPORATION	3,387	601.000	2,035,587.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	9,000	44.000	396,000.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	101,569	26.550	2,696,656.95	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	4,000	103.000	412,000.00	
台湾・ドル　小計		2,968,700		295,025,405.66 (1,366,439,669)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	10,352	159.640	1,652,593.28	
	ANGLO PLATINUM LTD	730	767.330	560,150.90	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	5,045	327.410	1,651,783.45	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	4,644	186.160	864,527.04	
	BID CORP LTD	2,644	409.950	1,083,907.80	
	BIDVEST GROUP LTD	1,934	236.610	457,603.74	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	828	1,932.810	1,600,366.68	
	CLICKS GROUP LTD	2,024	312.110	631,710.64	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	5,088	134.070	682,148.16	
	EXXARO RESOURCES LTD	1,516	187.670	284,507.72	
	FIRSTRAND LTD	50,239	66.500	3,340,893.50	
	GOLD FIELDS LTD	7,317	268.320	1,963,297.44	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	3,846	112.500	432,675.00	

	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	6,688	71.700	479,529.60	
	KUMBA IRON ORE LTD	436	588.560	256,612.16	
	MTN GROUP LTD	13,303	105.130	1,398,544.39	
	NASPERS LTD-N SHS	1,679	3,385.000	5,683,415.00	
	NEDBANK GROUP LTD	3,843	204.260	784,971.18	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	3,367	117.000	393,939.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	3,672	115.330	423,491.76	
	OLD MUTUAL LTD	28,719	11.750	337,448.25	
	OUTSURANCE GROUP LTD	6,649	43.000	285,907.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	14,569	18.770	273,460.13	
	REINET INVESTMENTS SCA	764	430.000	328,520.00	
	REMGRO LTD	3,116	149.000	464,284.00	
	SANLAM LIMITED	14,251	67.730	965,220.23	
	SASOL LTD	4,283	178.000	762,374.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	3,930	260.440	1,023,529.20	
	SIBANYE STILLWATER LTD	24,991	22.180	554,300.38	
	STANDARD BANK GROUP LTD	12,147	193.520	2,350,687.44	
	VODACOM GROUP LTD	6,605	99.000	653,895.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	6,896	68.300	470,996.80	
南アフリカ・ランド　小計		256,115		33,097,290.87 (253,525,248)	
合計		29,072,664		7,984,324,635 (7,984,324,635)	

（２）株式以外の有価証券

2023年12月11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	16,579.00	499,674.48	
		ISHARES MSCI QATAR CP ETF	32,967.00	558,460.98	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	63,049.00	2,525,112.45	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	57,122.00	818,558.26	
	アメリカ・ドル　小計		169,717.00	4,401,806.17 (640,022,617)	
投資信託受益証券　合計			169,717	640,022,617 (640,022,617)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	21,300.00	619,617.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	8,300.00	657,277.00	
	メキシコ・ペソ　小計		29,600.00	1,276,894.00 (10,701,266)	
投資証券　合計			29,600	10,701,266 (10,701,266)	
合計				650,723,883 (650,723,883)	

（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 42銘柄	2.52	－	－	10.08
	投資信託受益証券 4銘柄	－	7.01	－	
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.00	－	－	0.00
インド・ルピー	株式 131銘柄	15.99	－	－	16.92
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.81	－	－	1.92
オフショア・人民元	株式 235銘柄	4.26	－	－	4.51
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.09	－	－	0.10
タイ・バーツ	株式 37銘柄	1.65	－	－	1.74
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.14	－	－	0.14
チリ・ペソ	株式 11銘柄	0.46	－	－	0.48
トルコ・リラ	株式 17銘柄	0.65	－	－	0.69
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.25	－	－	0.26
フィリピン・ペソ	株式 14銘柄	0.57	－	－	0.60
ブラジル・レアル	株式 48銘柄	5.40	－	－	5.71
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.91	－	－	0.96
マレーシア・リンギット	株式 31銘柄	1.27	－	－	1.34
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄	2.41	－	－	2.68
	投資証券 2銘柄	－	－	0.12	
ユーロ	株式 11銘柄	0.47	－	－	0.49
韓国・ウォン	株式 102銘柄	11.83	－	－	12.51
香港・ドル	株式 179銘柄	19.00	－	－	20.10
台湾・ドル	株式 90銘柄	14.96	－	－	15.82
南アフリカ・ランド	株式 32銘柄	2.78	－	－	2.94

（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）

	2023年12月11日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	4,645,327
コール・ローン	506,554,791
国債証券	41,705,263,470
地方債証券	3,165,445,802
特殊債券	4,544,429,193
社債券	2,679,854,900
未収利息	125,142,252
前払費用	15,900,672
流動資産合計	52,747,236,407
資産合計	52,747,236,407
負債の部	
流動負債	
未払解約金	42,126,920
その他未払費用	1,289
流動負債合計	42,128,209
負債合計	42,128,209
純資産の部	
元本等	
元本	56,949,608,279
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△4,244,500,081
元本等合計	52,705,108,198
純資産合計	52,705,108,198
負債純資産合計	52,747,236,407

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12月11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12月11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	11,934,374,176円
	同期中一部解約元本額	27,413,848,288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）	33,558,908,824円
	ＤＣニッセイ日本債券インデックス	5,066,326,078円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	281,222,142円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	8,307,721,389円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	526,704,700円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	2,745,005,339円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	1,886,197,702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）	361,272,291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）	36,084,460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）	140,972,472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）	82,271,384円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	156,378,037円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	189,679,802円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	651,907,792円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	2,892,658,058円
	ＦＷニッセイ国内債インデックス	42,949,756円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	23,348,053円
	計	56,949,608,279円
２．	受益権の総数	56,949,608,279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4,244,500,081円であります。

（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	自　2022年12月13日 至　2023年12月11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	2023年12月11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	2023年12月11日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△966,673,330
地方債証券	△41,149,534
特殊債券	△48,626,471
社債券	△15,421,100
合計	△1,071,870,435

（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（2023年3月11日から2023年12月11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）

	2023年12月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9255円 (9,255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

2023年12月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	第４４４回　利付国債（２年）	170,000,000	170,044,200	
	第４４５回　利付国債（２年）	159,000,000	159,027,030	
	第４４６回　利付国債（２年）	159,000,000	159,009,540	
	第４４７回　利付国債（２年）	181,000,000	180,987,330	
	第４４８回　利付国債（２年）	181,000,000	180,961,990	
	第４４９回　利付国債（２年）	204,000,000	203,924,520	
	第４５０回　利付国債（２年）	212,000,000	211,900,360	
	第４５２回　利付国債（２年）	73,000,000	72,943,060	
	第４５３回　利付国債（２年）	395,000,000	394,569,450	
	第４５４回　利付国債（２年）	38,000,000	38,035,720	
	第１４３回　利付国債（５年）	278,000,000	278,369,740	
	第１４４回　利付国債（５年）	401,000,000	401,425,060	
	第１４５回　利付国債（５年）	466,000,000	466,410,080	
	第１４６回　利付国債（５年）	362,000,000	362,253,400	
	第１４７回　利付国債（５年）	231,000,000	230,607,300	
	第１４８回　利付国債（５年）	265,000,000	264,398,450	
	第１４９回　利付国債（５年）	320,000,000	319,068,800	
	第１５０回　利付国債（５年）	293,000,000	291,895,390	
	第１５１回　利付国債（５年）	195,000,000	194,048,400	
	第１５２回　利付国債（５年）	95,000,000	94,829,950	
	第１５３回　利付国債（５年）	335,000,000	332,946,450	
	第１５５回　利付国債（５年）	117,000,000	117,301,860	
	第１５６回　利付国債（５年）	231,000,000	230,676,600	
	第１６３回　利付国債（５年）	126,000,000	126,265,860	
	第１回　利付国債（４０年）	81,000,000	92,732,040	
	第２回　利付国債（４０年）	105,000,000	115,917,900	
	第３回　利付国債（４０年）	85,000,000	93,738,850	
	第４回　利付国債（４０年）	135,000,000	148,544,550	
	第５回　利付国債（４０年）	114,000,000	120,299,640	
	第６回　利付国債（４０年）	118,000,000	121,897,540	
	第７回　利付国債（４０年）	110,000,000	108,375,300	

第８回　利付国債（４０年）	125,000,000	114,082,500	
第９回　利付国債（４０年）	203,000,000	135,061,990	
第１０回　利付国債（４０年）	182,000,000	142,433,200	
第１１回　利付国債（４０年）	153,000,000	114,967,260	
第１２回　利付国債（４０年）	106,000,000	70,704,120	
第１３回　利付国債（４０年）	170,000,000	112,152,400	
第１４回　利付国債（４０年）	196,000,000	137,911,480	
第１５回　利付国債（４０年）	190,000,000	147,058,100	
第１６回　利付国債（４０年）	100,000,000	84,696,000	
第３３８回　利付国債（１０年）	368,000,000	369,887,840	
第３３９回　利付国債（１０年）	444,000,000	446,495,280	
第３４０回　利付国債（１０年）	500,000,000	503,095,000	
第３４１回　利付国債（１０年）	438,000,000	440,076,120	
第３４２回　利付国債（１０年）	399,000,000	399,179,550	
第３４３回　利付国債（１０年）	310,000,000	310,037,200	
第３４４回　利付国債（１０年）	325,000,000	324,909,000	
第３４５回　利付国債（１０年）	361,000,000	360,671,490	
第３４６回　利付国債（１０年）	336,000,000	335,398,560	
第３４７回　利付国債（１０年）	272,000,000	271,238,400	
第３４８回　利付国債（１０年）	338,000,000	336,668,280	
第３４９回　利付国債（１０年）	340,000,000	338,170,800	
第３５０回　利付国債（１０年）	435,000,000	431,785,350	
第３５１回　利付国債（１０年）	344,000,000	340,776,720	
第３５２回　利付国債（１０年）	291,000,000	287,583,660	
第３５３回　利付国債（１０年）	275,000,000	271,471,750	
第３５４回　利付国債（１０年）	254,000,000	250,454,160	
第３５５回　利付国債（１０年）	259,000,000	255,008,810	
第３５６回　利付国債（１０年）	250,000,000	245,767,500	
第３５７回　利付国債（１０年）	284,000,000	278,660,800	
第３５８回　利付国債（１０年）	245,000,000	239,916,250	

第３５９回　利付国債（１０年）	304,000,000	296,977,600	
第３６０回　利付国債（１０年）	382,000,000	372,110,020	
第３６１回　利付国債（１０年）	373,000,000	362,384,420	
第３６２回　利付国債（１０年）	384,000,000	371,792,640	
第３６３回　利付国債（１０年）	384,000,000	370,583,040	
第３６４回　利付国債（１０年）	392,000,000	377,021,680	
第３６５回　利付国債（１０年）	393,000,000	376,804,470	
第３６６回　利付国債（１０年）	177,000,000	170,615,610	
第３６７回　利付国債（１０年）	136,000,000	130,742,240	
第３６８回　利付国債（１０年）	364,000,000	348,955,880	
第３６９回　利付国債（１０年）	278,000,000	272,932,060	
第３７０回　利付国債（１０年）	438,000,000	429,064,800	
第３７１回　利付国債（１０年）	99,000,000	95,834,970	
第３７２回　利付国債（１０年）	316,000,000	316,717,320	
第１回　利付国債（３０年）	4,000,000	4,548,040	
第２回　利付国債（３０年）	43,000,000	48,166,880	
第３回　利付国債（３０年）	56,000,000	62,557,600	
第４回　利付国債（３０年）	27,000,000	31,409,100	
第５回　利付国債（３０年）	21,000,000	23,491,860	
第６回　利付国債（３０年）	25,000,000	28,431,750	
第７回　利付国債（３０年）	20,000,000	22,684,400	
第８回　利付国債（３０年）	29,000,000	31,765,440	
第９回　利付国債（３０年）	31,000,000	32,869,300	
第１０回　利付国債（３０年）	60,000,000	62,007,600	
第１１回　利付国債（３０年）	118,000,000	128,302,580	
第１２回　利付国債（３０年）	88,000,000	98,951,600	
第１３回　利付国債（３０年）	54,000,000	60,207,300	
第１４回　利付国債（３０年）	68,000,000	78,510,080	
第１５回　利付国債（３０年）	81,000,000	94,407,930	
第１６回　利付国債（３０年）	64,000,000	74,679,040	
第１７回　利付国債（３０年）	25,000,000	28,948,750	
第１８回　利付国債（３０年）	32,000,000	36,733,760	
第１９回　利付国債（３０年）	17,000,000	19,535,210	
第２０回　利付国債（３０年）	24,000,000	28,117,440	
第２１回　利付国債（３０年）	26,000,000	29,900,000	
第２２回　利付国債（３０年）	37,000,000	43,420,610	
第２３回　利付国債（３０年）	39,000,000	45,815,250	

第２４回　利付国債（３０年）	23,000,000	27,029,830	
第２５回　利付国債（３０年）	18,000,000	20,719,800	
第２６回　利付国債（３０年）	65,000,000	75,615,150	
第２７回　利付国債（３０年）	101,000,000	118,763,880	
第２８回　利付国債（３０年）	136,000,000	159,776,880	
第２９回　利付国債（３０年）	144,000,000	167,256,000	
第３０回　利付国債（３０年）	153,000,000	175,282,920	
第３１回　利付国債（３０年）	144,000,000	162,665,280	
第３２回　利付国債（３０年）	175,000,000	199,706,500	
第３３回　利付国債（３０年）	199,000,000	217,580,630	
第３４回　利付国債（３０年）	180,000,000	201,848,400	
第３５回　利付国債（３０年）	206,000,000	224,226,880	
第３６回　利付国債（３０年）	203,000,000	220,397,100	
第３７回　利付国債（３０年）	210,000,000	224,273,700	
第３８回　利付国債（３０年）	141,000,000	147,875,160	
第３９回　利付国債（３０年）	132,000,000	140,395,200	
第４０回　利付国債（３０年）	111,000,000	115,989,450	
第４１回　利付国債（３０年）	107,000,000	109,871,880	
第４２回　利付国債（３０年）	119,000,000	122,034,500	
第４３回　利付国債（３０年）	91,000,000	93,197,650	
第４４回　利付国債（３０年）	124,000,000	126,921,440	
第４５回　利付国債（３０年）	134,000,000	132,203,060	
第４６回　利付国債（３０年）	160,000,000	157,585,600	
第４７回　利付国債（３０年）	149,000,000	149,238,400	
第４８回　利付国債（３０年）	154,000,000	148,426,740	
第４９回　利付国債（３０年）	154,000,000	148,138,760	
第５０回　利付国債（３０年）	153,000,000	129,812,850	
第５１回　利付国債（３０年）	134,000,000	100,739,860	
第５２回　利付国債（３０年）	139,000,000	109,283,190	
第５３回　利付国債（３０年）	126,000,000	101,059,560	
第５４回　利付国債（３０年）	158,000,000	132,304,460	
第５５回　利付国債（３０年）	124,000,000	103,509,000	
第５６回　利付国債（３０年）	121,000,000	100,686,520	
第５７回　利付国債（３０年）	125,000,000	103,688,750	
第５８回　利付国債（３０年）	155,000,000	128,169,500	
第５９回　利付国債（３０年）	117,000,000	94,144,050	
第６０回　利付国債（３０年）	141,000,000	118,748,790	
第６１回　利付国債（３０年）	101,000,000	80,719,200	
第６２回　利付国債（３０年）	99,000,000	74,826,180	
第６３回　利付国債（３０年）	106,000,000	77,605,780	
第６４回　利付国債（３０年）	118,000,000	86,037,340	
第６５回　利付国債（３０年）	114,000,000	82,852,920	
第６６回　利付国債（３０年）	108,000,000	78,106,680	
第６７回　利付国債（３０年）	134,000,000	102,109,340	
第６８回　利付国債（３０年）	135,000,000	102,492,000	
第６９回　利付国債（３０年）	134,000,000	104,264,060	
第７０回　利付国債（３０年）	129,000,000	100,114,320	
第７１回　利付国債（３０年）	132,000,000	102,083,520	
第７２回　利付国債（３０年）	132,000,000	101,814,240	
第７３回　利付国債（３０年）	134,000,000	103,087,540	

第７４回　利付国債（３０年）	130,000,000	108,382,300	
第７５回　利付国債（３０年）	135,000,000	121,363,650	
第７６回　利付国債（３０年）	124,000,000	114,164,320	
第７７回　利付国債（３０年）	123,000,000	118,649,490	
第７８回　利付国債（３０年）	127,000,000	116,701,570	
第７９回　利付国債（３０年）	136,000,000	118,668,160	
第８０回　利付国債（３０年）	90,000,000	90,791,100	
第７５回　利付国債（２０年）	73,000,000	74,949,100	
第７６回　利付国債（２０年）	86,000,000	88,077,760	
第７７回　利付国債（２０年）	74,000,000	75,881,820	
第７８回　利付国債（２０年）	96,000,000	98,728,320	
第７９回　利付国債（２０年）	100,000,000	102,994,000	
第８０回　利付国債（２０年）	96,000,000	99,020,160	
第８１回　利付国債（２０年）	93,000,000	96,211,290	
第８２回　利付国債（２０年）	128,000,000	132,646,400	
第８３回　利付国債（２０年）	95,000,000	98,903,550	
第８４回　利付国債（２０年）	128,000,000	133,000,960	
第８５回　利付国債（２０年）	171,000,000	178,821,540	
第８６回　利付国債（２０年）	178,000,000	186,946,280	
第８７回　利付国債（２０年）	160,000,000	167,680,000	
第８８回　利付国債（２０年）	132,000,000	139,318,080	
第８９回　利付国債（２０年）	141,000,000	148,463,130	
第９０回　利付国債（２０年）	128,000,000	135,394,560	
第９１回　利付国債（２０年）	23,000,000	24,392,190	
第９２回　利付国債（２０年）	114,000,000	120,777,300	
第９３回　利付国債（２０年）	43,000,000	45,587,310	
第９４回　利付国債（２０年）	73,000,000	77,629,660	
第９５回　利付国債（２０年）	82,000,000	88,096,700	
第９６回　利付国債（２０年）	32,000,000	34,155,200	
第９７回　利付国債（２０年）	81,000,000	87,065,280	
第９８回　利付国債（２０年）	57,000,000	61,054,980	
第９９回　利付国債（２０年）	133,000,000	142,911,160	
第１００回　利付国債（２０年）	91,000,000	98,431,970	
第１０１回　利付国債（２０年）	49,000,000	53,415,390	
第１０２回　利付国債（２０年）	62,000,000	67,806,920	
第１０３回　利付国債（２０年）	55,000,000	59,906,000	
第１０４回　利付国債（２０年）	43,000,000	46,452,040	
第１０５回　利付国債（２０年）	91,000,000	98,544,810	
第１０６回　利付国債（２０年）	46,000,000	50,029,600	
第１０７回　利付国債（２０年）	84,000,000	91,276,920	
第１０８回　利付国債（２０年）	129,000,000	138,902,040	

第１０９回　利付国債（２０年）	29,000,000	31,317,100	
第１１０回　利付国債（２０年）	111,000,000	121,016,640	
第１１１回　利付国債（２０年）	21,000,000	23,085,300	
第１１２回　利付国債（２０年）	75,000,000	82,041,000	
第１１３回　利付国債（２０年）	138,000,000	151,406,700	
第１１４回　利付国債（２０年）	77,000,000	84,696,920	
第１１５回　利付国債（２０年）	17,000,000	18,799,280	
第１１６回　利付国債（２０年）	35,000,000	38,816,750	
第１１７回　利付国債（２０年）	93,000,000	102,573,420	
第１１８回　利付国債（２０年）	25,000,000	27,472,000	
第１１９回　利付国債（２０年）	15,000,000	16,287,900	
第１２０回　利付国債（２０年）	34,000,000	36,488,120	
第１２１回　利付国債（２０年）	126,000,000	137,826,360	
第１２２回　利付国債（２０年）	82,000,000	89,157,780	
第１２３回　利付国債（２０年）	177,000,000	196,344,330	
第１２４回　利付国債（２０年）	114,000,000	125,685,000	
第１２５回　利付国債（２０年）	122,000,000	136,354,520	
第１２６回　利付国債（２０年）	112,000,000	123,565,120	
第１２７回　利付国債（２０年）	108,000,000	118,396,080	
第１２８回　利付国債（２０年）	168,000,000	184,311,120	
第１２９回　利付国債（２０年）	110,000,000	119,885,700	
第１３０回　利付国債（２０年）	167,000,000	182,151,910	
第１３１回　利付国債（２０年）	107,000,000	115,912,030	
第１３２回　利付国債（２０年）	114,000,000	123,549,780	
第１３３回　利付国債（２０年）	142,000,000	154,981,640	

第１３４回　利付国債（２０年）	123,000,000	134,362,740	
第１３５回　利付国債（２０年）	90,000,000	97,605,900	
第１３６回　利付国債（２０年）	90,000,000	96,860,700	
第１３７回　利付国債（２０年）	98,000,000	106,349,600	
第１３８回　利付国債（２０年）	101,000,000	107,930,620	
第１３９回　利付国債（２０年）	108,000,000	116,330,040	
第１４０回　利付国債（２０年）	232,000,000	252,007,680	
第１４１回　利付国債（２０年）	187,000,000	203,126,880	
第１４２回　利付国債（２０年）	135,000,000	147,852,000	
第１４３回　利付国債（２０年）	183,000,000	197,248,380	
第１４４回　利付国債（２０年）	133,000,000	142,198,280	
第１４５回　利付国債（２０年）	252,000,000	274,002,120	
第１４６回　利付国債（２０年）	250,000,000	271,747,500	
第１４７回　利付国債（２０年）	238,000,000	256,259,360	
第１４８回　利付国債（２０年）	211,000,000	225,014,620	
第１４９回　利付国債（２０年）	222,000,000	236,505,480	
第１５０回　利付国債（２０年）	238,000,000	250,916,260	
第１５１回　利付国債（２０年）	195,000,000	201,269,250	
第１５２回　利付国債（２０年）	175,000,000	180,370,750	
第１５３回　利付国債（２０年）	180,000,000	187,221,600	
第１５４回　利付国債（２０年）	172,000,000	176,738,600	
第１５５回　利付国債（２０年）	185,000,000	185,595,700	
第１５６回　利付国債（２０年）	133,000,000	123,940,040	
第１５７回　利付国債（２０年）	136,000,000	123,070,480	
第１５８回　利付国債（２０年）	154,000,000	144,216,380	

第１５９回　利付国債（２０年）	137,000,000	129,418,420	
第１６０回　利付国債（２０年）	126,000,000	120,163,680	
第１６１回　利付国債（２０年）	127,000,000	119,104,410	
第１６２回　利付国債（２０年）	177,000,000	165,326,850	
第１６３回　利付国債（２０年）	207,000,000	192,553,470	
第１６４回　利付国債（２０年）	216,000,000	197,218,800	
第１６５回　利付国債（２０年）	196,000,000	178,152,240	
第１６６回　利付国債（２０年）	181,000,000	168,690,190	
第１６７回　利付国債（２０年）	194,000,000	174,714,460	
第１６８回　利付国債（２０年）	165,000,000	145,617,450	
第１６９回　利付国債（２０年）	162,000,000	139,992,300	
第１７０回　利付国債（２０年）	149,000,000	128,071,460	
第１７１回　利付国債（２０年）	176,000,000	150,369,120	
第１７２回　利付国債（２０年）	166,000,000	143,432,300	
第１７３回　利付国債（２０年）	213,000,000	182,947,830	
第１７４回　利付国債（２０年）	194,000,000	165,844,780	
第１７５回　利付国債（２０年）	187,000,000	161,861,590	
第１７６回　利付国債（２０年）	185,000,000	159,407,100	
第１７７回　利付国債（２０年）	194,000,000	163,371,280	
第１７８回　利付国債（２０年）	208,000,000	177,690,240	
第１７９回　利付国債（２０年）	217,000,000	184,512,930	
第１８０回　利付国債（２０年）	203,000,000	181,581,470	
第１８１回　利付国債（２０年）	207,000,000	187,908,390	
第１８２回　利付国債（２０年）	196,000,000	183,706,880	
第１８３回　利付国債（２０年）	199,000,000	195,764,260	

	第１８４回　利付国債（２０年）	198,000,000	184,506,300	
	第１８５回　利付国債（２０年）	196,000,000	182,099,680	
	第１８６回　利付国債（２０年）	136,000,000	135,174,480	
国債証券　合計		42,423,000,000	41,705,263,470	
地方債証券	第７６４回　東京都公募公債	100,000,000	99,877,100	
	第１４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	108,096,400	
	第３４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	93,064,100	
	第１８回　宮城県１号公募公債（５年）	100,000,000	99,163,000	
	第３０回　神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	100,772,400	
	第４４８回　大阪府公募公債	38,000,000	36,832,602	
	第４５５回　大阪府公募公債	180,000,000	174,588,300	
	第７回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	108,181,000	
	第１１回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	107,321,300	
	第１２回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	104,514,200	
	平成２９年度第５回　京都府公募公債（２０年）	100,000,000	92,340,200	
	第１５回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	106,726,000	
	第２１回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	105,563,200	
	平成２６年度第１１回　愛知県公募公債（１５年）	100,000,000	102,473,100	
	令和４年度第３回　愛知県公募公債	200,000,000	191,843,000	
	平成２０年度第１回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	108,366,200	
	平成２４年度第２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	106,811,400	
	令和４年度第１回　千葉県公募公債	300,000,000	287,809,500	
	第２２回　大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	90,759,200	
	第１回　名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	115,732,600	
	第２５回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	107,510,600	
	第２６回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	108,070,100	
	第３１回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	101,333,400	

	第９回　川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	109,845,600	
	第４回　川崎市公募公債（３０年）	100,000,000	108,755,900	
	平成３０年度第５回　広島市公募公債	200,000,000	197,205,600	
	平成２９年度第１回　仙台市公募公債	100,000,000	91,889,800	
地方債証券　合計		3,118,000,000	3,165,445,802	
特殊債券	第９回　新関西国際空港	300,000,000	308,781,300	
	第１６回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,627,400	
	第１７４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,176,000	
	第２０５回　政保道路機構債券	100,000,000	106,261,400	
	第２１２回　政保道路機構債券	100,000,000	105,834,500	
	第２３３回　政府道路機構債券	100,000,000	103,605,500	
	第２７８回　政保道路機構債券	100,000,000	90,113,500	
	第２９３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	91,353,300	
	第３１６回　政保道路機構債券	100,000,000	92,349,400	
	第３１９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,969,800	
	第１７回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	216,421,400	
	第３６回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	105,377,100	
	第１回　地方公共団体金融機構債券（３０年）	100,000,000	102,611,400	
	第８３回　政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	102,613,647	
	第１１６回　政保地方公共団体金融機構債券	138,000,000	135,496,266	
	第１２０回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,371,700	
	第１３６回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	193,076,000	
	第７２回　日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,814,000	
	第９７回　都市再生債券	100,000,000	102,459,200	
	第３３回　政保中部国際空港債券	100,000,000	99,542,500	
	第５９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	217,081,800	
	第１４３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,165,700	
	第３７回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,167,000	18,837,362	
	第４２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,708,000	47,074,669	

	第４６回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,560,000	54,714,960	
	第５４回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,134,000	45,502,154	
	第５５回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,622,000	51,041,189	
	第６０回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,022,000	52,343,468	
	第６１回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,733,000	26,304,272	
	第６２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	231,328,000	235,561,302	
	第６３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	143,315,000	145,249,752	
	第７３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,874,000	104,003,166	
	第７８回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,836,000	90,026,402	
	第１０９回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,936,000	183,636,484	
	い第８４５号　利付商工債券	200,000,000	199,693,000	
	い第８５４号　利付商工債券	200,000,000	198,916,200	
	い第８６２号　利付商工債券	100,000,000	99,417,000	
	第３９４回　利付信金中金債券	100,000,000	99,184,100	
	第６６回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	102,820,900	
特殊債券　合計		4,486,235,000	4,544,429,193	
社債券	第３６回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０２１）	100,000,000	95,684,400	
	第３８回　成田国際空港	200,000,000	192,612,400	
	第６９回　西日本高速道路	100,000,000	99,334,600	
	第１３回　日本たばこ産業	100,000,000	98,722,700	
	第５回　電通グループ	400,000,000	397,962,800	
	第２回　アステラス製薬	100,000,000	99,544,200	
	第１１回　ブリヂストン	100,000,000	99,474,600	
	第１９回　豊田通商	100,000,000	101,364,500	
	第１８回　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	96,673,100	
	第７８回　トヨタファイナンス	100,000,000	99,346,700	
	第５５回　日立キャピタル	100,000,000	101,343,000	
	第１７回　三井住友ファイナンス＆リース	100,000,000	99,065,100	
	第２回　三菱ＨＣキャピタル	100,000,000	98,891,900	
	第１３２回　三菱地所	100,000,000	97,828,300	
	第７回　野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	217,448,600	
	第１１回　ジャパンエクセレント投資法人	100,000,000	99,852,300	
	第１０６回　東日本旅客鉄道	100,000,000	96,596,600	
	第３回　東日本旅客鉄道（サステナビリティボンド）	100,000,000	94,004,700	

	第５１０回　関西電力	100,000,000	99,647,200	
	第４９４回　東北電力	100,000,000	99,631,200	
	第４５１回　九州電力	100,000,000	99,726,700	
	第４７回　大阪瓦斯（トランジションボンド）	100,000,000	95,099,300	
社債券　合計		2,700,000,000	2,679,854,900	
合計			52,094,993,365	

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）

	2023年12月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	973,234,234
金銭信託	2,805,664
コール・ローン	305,946,768
国債証券	105,901,308,617
派生商品評価勘定	2,194,722,341
未収利息	593,100,571
前払費用	69,150,441
流動資産合計	110,040,268,636
資産合計	110,040,268,636
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,757,064
未払金	961,268,735
未払解約金	887,229
その他未払費用	517
流動負債合計	963,913,545
負債合計	963,913,545
純資産の部	
元本等	
元本	111,074,787,262
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△1,998,432,171
元本等合計	109,076,355,091
純資産合計	109,076,355,091
負債純資産合計	110,040,268,636

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年12月13日 至　2023年12月11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12月11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	18,210,636,981円
	同期中一部解約元本額	14,242,425,173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）	95,792,879,195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）	2,770,369,646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）	2,790,486,251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）	2,733,524,328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）	2,722,088,373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）	2,431,393,591円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）	32,063,360円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンドⅡ２０２３－０５（適格機関投資家限定）	1,801,982,518円
	計	111,074,787,262円
２．	受益権の総数	111,074,787,262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1,998,432,171円であります。

（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	自　2022年12月13日 至　2023年12月11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	2023年12月11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	2023年12月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	733,922,637
合計	733,922,637

（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（2023年3月11日から2023年12月11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	2023年12月11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	107,430,287,482	－	105,239,135,166	2,191,152,316
アメリカ・ドル	50,636,874,024	－	49,897,896,332	738,977,692
イギリス・ポンド	5,519,847,421	－	5,390,270,416	129,577,005
イスラエル・シュケル	326,551,219	－	323,842,350	2,708,869
オーストラリア・ドル	1,497,902,104	－	1,463,312,576	34,589,528
オフショア・人民元	8,349,458,043	－	8,156,922,066	192,535,977
カナダ・ドル	2,158,000,997	－	2,117,574,689	40,426,308
シンガポール・ドル	1,013,017,789	－	992,177,917	20,839,872
スウェーデン・クローナ	219,068,780	－	215,663,970	3,404,810
デンマーク・クローネ	299,739,548	－	291,346,416	8,393,132
ニュージーランド・ドル	257,280,758	－	250,695,219	6,585,539
ノルウェー・クローネ	191,835,496	－	186,965,876	4,869,620
ポーランド・ズロチ	553,705,104	－	540,320,728	13,384,376
メキシコ・ペソ	995,413,720	－	980,570,752	14,842,968
ユーロ	35,411,592,479	－	34,431,575,859	980,016,620
買建	190,133,321	－	191,946,282	1,812,961
アメリカ・ドル	69,574,309	－	70,279,687	705,378
イギリス・ポンド	8,277,608	－	8,339,060	61,452
オフショア・人民元	16,087,200	－	16,178,320	91,120
カナダ・ドル	23,313,784	－	23,566,598	252,814
デンマーク・クローネ	3,466,845	－	3,494,924	28,079
メキシコ・ペソ	13,277,669	－	13,498,307	220,638
ユーロ	56,135,906	－	56,589,386	453,480
合計	107,620,420,803	－	105,431,081,448	2,192,965,277

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

（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）

	2023年12月11日現在
1口当たり純資産額	0.9820円
（1万口当たり純資産額）	(9,820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

2023年12月11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	385,578.00	
		US TREASURY N/B	2,510,000.00	2,364,972.20	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	2,704,975.00	
		US TREASURY N/B	290,000.00	298,700.00	
		US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,686,000.00	
		US TREASURY N/B	5,020,000.00	4,841,940.60	
		US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,160,015.00	
		US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,078,891.10	
		US TREASURY N/B	3,230,000.00	2,615,654.00	
		US TREASURY N/B	26,100,000.00	25,183,368.00	
		US TREASURY N/B	16,600,000.00	15,953,430.00	
		US TREASURY N/B	3,030,000.00	2,333,312.10	
		US TREASURY N/B	18,100,000.00	17,276,269.00	
		US TREASURY N/B	15,950,000.00	15,222,839.50	
		US TREASURY N/B	12,320,000.00	11,554,312.00	
		US TREASURY N/B	13,580,000.00	12,671,769.60	
		US TREASURY N/B	12,280,000.00	11,355,070.40	
		US TREASURY N/B	3,350,000.00	2,266,744.00	
		US TREASURY N/B	9,460,000.00	8,828,072.00	
		US TREASURY N/B	9,450,000.00	8,847,846.00	
		US TREASURY N/B	9,000,000.00	8,423,370.00	
		US TREASURY N/B	10,150,000.00	9,421,636.00	
		US TREASURY N/B	3,620,000.00	2,687,560.40	
		US TREASURY N/B	11,440,000.00	10,577,080.80	

		US TREASURY N/B	12,220,000.00	11,481,912.00	
		US TREASURY N/B	480,000.00	489,168.00	
		US TREASURY N/B	11,190,000.00	10,538,182.50	
		US TREASURY N/B	630,000.00	620,253.90	
		US TREASURY N/B	12,090,000.00	11,357,950.50	
		US TREASURY N/B	5,510,000.00	4,277,964.00	
		US TREASURY N/B	9,250,000.00	8,767,612.50	
		US TREASURY N/B	990,000.00	985,584.60	
		US TREASURY N/B	7,170,000.00	6,611,457.00	
		US TREASURY N/B	6,150,000.00	5,583,523.50	
		US TREASURY N/B	5,590,000.00	4,860,001.90	
		US TREASURY N/B	6,560,000.00	4,356,955.20	
		US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,009,176.00	
		US TREASURY N/B	5,530,000.00	4,700,278.80	
		US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,285,442.40	
		US TREASURY N/B	240,000.00	258,504.00	
		US TREASURY N/B	920,000.00	561,338.00	
		US TREASURY N/B	7,480,000.00	5,902,767.20	
		US TREASURY N/B	8,460,000.00	4,460,958.00	
		US TREASURY N/B	2,310,000.00	1,397,272.80	
		US TREASURY N/B	7,200,000.00	5,756,040.00	
		US TREASURY N/B	8,860,000.00	7,190,067.20	
		US TREASURY N/B	3,640,000.00	2,488,850.00	
		US TREASURY N/B	1,020,000.00	893,652.60	
		US TREASURY N/B	7,850,000.00	6,317,680.00	
		US TREASURY N/B	9,690,000.00	6,008,478.30	
		US TREASURY N/B	3,010,000.00	2,500,527.40	
		US TREASURY N/B	7,770,000.00	6,497,662.50	
		US TREASURY N/B	1,310,000.00	958,540.10	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,023,825.00	
		US TREASURY N/B	9,390,000.00	8,360,010.90	
		US TREASURY N/B	8,780,000.00	6,836,371.40	
		US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,611,225.00	
		US TREASURY N/B	450,000.00	445,059.00	
		WI TREASURY SEC.	1,040,000.00	1,031,222.40	
		WI TREASURY SEC.	7,000,000.00	5,572,350.00	
		WI TREASURY SEC.	2,620,000.00	2,587,538.20	
	アメリカ・ドル　小計		393,230,000.00 (57,175,642,000)	345,324,808.50 (50,210,227,155)	
	イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	750,000.00	626,430.00	
		UNITED KINGDOM GILT	1,410,000.00	1,472,674.50	
		UNITED KINGDOM GILT	570,000.00	503,298.60	
		UNITED KINGDOM GILT	560,000.00	362,264.00	
		UNITED KINGDOM GILT	1,070,000.00	999,198.10	
		UNITED KINGDOM GILT	1,330,000.00	980,835.10	
		UNITED KINGDOM GILT	1,430,000.00	1,377,790.70	
		UNITED KINGDOM GILT	1,170,000.00	1,179,886.50	
		UNITED KINGDOM GILT	1,690,000.00	1,533,928.50	

	UNITED KINGDOM GILT	1,090,000.00	1,049,561.00	
	UNITED KINGDOM GILT	860,000.00	773,570.00	
	UNITED KINGDOM GILT	790,000.00	374,136.10	
	UNITED KINGDOM GILT	620,000.00	366,940.80	
	UNITED KINGDOM GILT	890,000.00	471,255.00	
	UNITED KINGDOM GILT	950,000.00	880,165.50	
	UNITED KINGDOM GILT	1,010,000.00	851,722.90	
	UNITED KINGDOM GILT	3,780,000.00	3,571,381.80	
	UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	588,648.00	
	UNITED KINGDOM GILT	1,020,000.00	1,026,313.80	
	UNITED KINGDOM GILT	860,000.00	864,644.00	
	UNITED KINGDOM GILT	830,000.00	508,267.10	
	UNITED KINGDOM GILT	1,340,000.00	1,058,519.60	
	UNITED KINGDOM GILT	850,000.00	778,889.00	
	UNITED KINGDOM GILT	1,130,000.00	763,202.00	
	UNITED KINGDOM GILT	1,780,000.00	1,351,643.00	
	UNITED KINGDOM GILT	1,870,000.00	932,008.00	
	UNITED KINGDOM GILT	1,000,000.00	494,000.00	
	UNITED KINGDOM GILT	1,500,000.00	1,124,145.00	
	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	212,019.20	
	UNITED KINGDOM GILT	760,000.00	730,223.20	
	UNITED KINGDOM GILT	1,640,000.00	1,676,818.00	
	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	386,338.90	
イギリス・ポンド　小計		35,970,000.00 (6,564,165,300)	29,870,717.90 (5,451,107,310)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	1,590,000.00	1,526,161.50	
	ISRAEL FIXED BOND	1,610,000.00	1,360,691.50	
	ISRAEL FIXED BOND	1,990,000.00	1,829,805.00	
	ISRAEL FIXED BOND	470,000.00	341,173.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,950,000.00	1,870,635.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,050,000.00	987,210.00	
	ISRAEL FIXED BOND	700,000.00	571,235.00	
イスラエル・シュケル　小計		9,360,000.00 (367,495,128)	8,486,911.00 (333,215,646)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,180,000.00	1,138,558.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,570,000.00	1,596,768.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	870,000.00	876,290.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,310,000.00	1,223,173.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	950,000.00	885,514.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	630,000.00	482,932.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,450,000.00	1,322,298.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	704,232.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,470,000.00	1,219,453.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,850,000.00	1,461,703.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,820,000.00	1,693,764.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	830,000.00	459,512.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,140,000.00	1,021,679.40	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,380,000.00	1,416,432.00	
オーストラリア・ドル　小計		17,350,000.00 (1,658,486,500)	15,502,313.30 (1,481,866,128)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	22,000,000.00	21,974,260.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,610,224.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,900,000.00	18,886,581.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,800,000.00	6,918,796.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,800,000.00	8,881,136.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,200,000.00	17,245,236.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,500,000.00	8,886,070.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	11,278,191.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,800,000.00	17,733,428.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,000,000.00	11,917,800.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,500,000.00	11,479,530.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	12,897,690.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,461,300.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,500,000.00	6,418,880.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	9,958,700.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,900,000.00	18,846,702.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,501,595.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	2,870,450.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,900,000.00	3,274,825.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,900,000.00	4,011,774.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,100,000.00	13,164,452.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,900,000.00	15,121,116.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,083,350.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	6,684,685.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	7,566,636.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,120,500.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,297,699.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,553,405.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,180,358.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,900,000.00	9,413,085.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	5,938,409.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	6,975,290.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,632,480.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	6,088,288.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,900,000.00	2,900,522.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	7,547,636.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	13,931,960.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	8,996,490.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,800,000.00	16,734,312.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,600,000.00	11,846,384.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	6,160,146.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,469,475.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	9,482,814.00	
オフショア・人民元　小計		394,300,000.00 (7,974,875,220)	396,942,660.00 (8,028,324,076)	

カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT	1,620,000.00	1,536,699.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	384,041.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	227,444.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	468,820.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	260,000.00	235,310.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,820,000.00	3,709,525.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,350,000.00	1,275,331.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,520,000.00	1,393,399.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,460,000.00	1,372,838.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	218,536.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,660,000.00	1,290,002.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	940,000.00	886,918.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,130,000.00	988,682.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,770,000.00	1,631,816.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	1,837,311.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,250,000.00	904,100.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,525,019.00	
カナダ・ドル　小計		21,780,000.00 (2,330,895,600)	19,885,795.60 (2,128,177,845)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,580,000.00	1,648,587.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	980,000.00	953,765.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	410,000.00	410,287.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	600,000.00	590,340.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	650,000.00	627,380.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,169,160.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,310,000.00	1,297,555.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	940,000.00	753,880.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	150,000.00	152,070.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,360,000.00	1,361,224.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	200,080.00	
シンガポール・ドル　小計		9,380,000.00 (1,016,698,200)	9,164,329.20 (993,321,642)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	2,490,000.00	2,468,187.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,600,000.00	2,484,378.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	3,110,000.00	2,900,417.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,350,000.00	1,234,615.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,290,000.00	2,570,387.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	4,450,000.00	3,790,421.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	236,875.00	
スウェーデン・クローナ　小計		16,540,000.00 (229,740,600)	15,685,281.80 (217,868,564)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,960,000.00	1,924,759.20	
	KINGDOM OF DENMARK	1,680,000.00	1,562,920.80	
	KINGDOM OF DENMARK	1,620,000.00	1,454,209.20	
	KINGDOM OF DENMARK	900,000.00	482,202.00	
	KINGDOM OF DENMARK	3,210,000.00	2,655,408.30	

	KINGDOM OF DENMARK	4,890,000.00	6,058,807.80	
デンマーク・クローネ　小計		14,260,000.00 (299,460,000)	14,138,307.30 (296,904,453)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	400,000.00	387,236.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	430,000.00	394,559.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	420,000.00	326,646.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	550,000.00	436,601.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	330,000.00	270,949.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	224,410.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	300,000.00	197,025.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	510,000.00	458,714.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	141,934.50	
ニュージーランド・ドル　小計		3,340,000.00 (297,360,200)	2,838,076.70 (252,673,969)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,690,000.00	3,527,566.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,752,999.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,720,000.00	3,416,299.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,582,640.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,825,240.00	
ノルウェー・クローネ　小計		15,310,000.00 (204,235,400)	14,104,744.40 (188,157,290)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	920,000.00	966,018.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,450,000.00	1,408,008.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,980,000.00	2,802,451.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,810,000.00	3,505,962.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,570,000.00	2,350,573.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,710,000.00	1,518,565.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,260,000.00	2,553,558.00	
ポーランド・ズロチ　小計		16,700,000.00 (602,903,400)	15,105,136.90 (545,325,652)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,500,000.00	4,951,815.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	18,950,000.00	17,446,128.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,700,000.00	9,835,547.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	7,469,970.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	16,500,000.00	16,374,765.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,970,000.00	20,687,391.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,300,000.00	10,973,882.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	19,250,000.00	18,101,737.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,700,000.00	6,718,096.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,800,000.00	2,491,720.00	
メキシコ・ペソ　小計		123,170,000.00 (1,032,250,819)	115,051,051.90 (964,208,351)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,030,000.00	1,227,265.60	
	BELGIUM KINGDOM	290,000.00	310,923.50	
	BELGIUM KINGDOM	1,120,000.00	991,558.40	
	BELGIUM KINGDOM	540,000.00	522,271.80	

		BELGIUM KINGDOM	1,080,000.00	1,036,659.60	
		BELGIUM KINGDOM	420,000.00	304,323.60	
		BELGIUM KINGDOM	480,000.00	363,547.20	
		BELGIUM KINGDOM	1,320,000.00	1,242,278.40	
		BELGIUM KINGDOM	630,000.00	496,490.40	
		BELGIUM KINGDOM	410,000.00	336,974.90	
		BELGIUM KINGDOM	1,020,000.00	945,907.20	
		BELGIUM KINGDOM	650,000.00	595,491.00	
		BELGIUM KINGDOM	360,000.00	258,148.80	
		BELGIUM KINGDOM	440,000.00	374,382.80	
		BELGIUM KINGDOM	1,030,000.00	1,172,253.30	
		BELGIUM KINGDOM	570,000.00	461,420.70	
		BELGIUM KINGDOM	950,000.00	776,188.00	
		BELGIUM KINGDOM	360,000.00	231,451.20	
		BELGIUM KINGDOM	390,000.00	394,531.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	684,051.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,860,000.00	1,745,628.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	710,000.00	614,249.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	581,750.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,750,000.00	2,631,447.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	478,140.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,205,633.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,610,000.00	1,527,712.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	660,000.00	542,612.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,530,000.00	1,756,485.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,076,994.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,020,000.00	3,768,589.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,190,000.00	2,033,809.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,150,000.00	979,742.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,950,000.00	1,707,556.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	910,000.00	932,549.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,960,000.00	2,854,209.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	750,000.00	516,585.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	1,784,955.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,520,000.00	1,227,764.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,120,000.00	794,707.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	985,272.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	510,952.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,070,000.00	703,781.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,550,000.00	1,475,290.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,040,000.00	3,051,825.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,410,000.00	2,338,519.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,950,000.00	2,864,214.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,340,000.00	4,151,123.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,080,000.00	1,325,106.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,080,000.00	1,948,252.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,900,000.00	2,721,360.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	784,832.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	730,000.00	952,255.80	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,540,000.00	3,300,448.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,550,000.00	2,333,709.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,950,000.00	2,676,948.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,740,000.00	922,356.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	732,184.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,790,000.00	3,324,284.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	996,242.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,580,000.00	1,858,901.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	950,000.00	814,900.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,670,000.00	1,416,477.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,390,000.00	702,394.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	940,000.00	787,259.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,120,000.00	1,075,155.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	561,788.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,230,000.00	2,242,131.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	218,013.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	935,820.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,590,000.00	1,561,952.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5,460,000.00	5,319,350.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,120,000.00	1,807,194.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,490,000.00	2,433,402.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,220,000.00	1,406,184.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,260,000.00	952,572.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,420,000.00	2,289,586.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	314,640.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,280,000.00	1,130,265.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,740,000.00	1,671,235.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,180,000.00	1,010,528.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5,840,000.00	5,556,526.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,340,000.00	1,465,048.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,570,000.00	1,530,027.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	372,856.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,044,940.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,590,000.00	1,392,935.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,090,009.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,060,000.00	2,209,329.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	930,000.00	649,158.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,080,000.00	803,055.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,440,000.00	1,558,382.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,688,180.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	206,142.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	467,208.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,160,000.00	1,718,582.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	810,000.00	491,151.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,520,000.00	1,398,962.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3,130,000.00	2,909,929.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	216,240.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,550,000.00	2,292,373.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	528,892.30	

DEUTSCHLAND REP		430,000.00	522,544.60	
FINNISH GOVERNMENT		580,000.00	585,272.20	
FINNISH GOVERNMENT		200,000.00	193,324.00	
FINNISH GOVERNMENT		550,000.00	522,819.00	
FINNISH GOVERNMENT		210,000.00	194,764.50	
FINNISH GOVERNMENT		390,000.00	330,255.90	
FINNISH GOVERNMENT		570,000.00	417,849.90	
FINNISH GOVERNMENT		450,000.00	400,077.00	
FINNISH GOVERNMENT		420,000.00	267,443.40	
FINNISH GOVERNMENT		310,000.00	259,662.20	
FINNISH GOVERNMENT		370,000.00	303,662.70	
FINNISH GOVERNMENT		80,000.00	72,194.40	
FRANCE (GOVT OF)		1,420,000.00	1,429,386.20	
FRANCE (GOVT OF)		50,000.00	50,935.50	
FRANCE (GOVT OF)		1,130,000.00	1,330,620.20	
FRANCE (GOVT OF)		1,440,000.00	1,453,852.80	
FRANCE (GOVT OF)		3,940,000.00	3,923,058.00	
FRANCE (GOVT OF)		2,260,000.00	2,181,284.20	
FRANCE (GOVT OF)		2,670,000.00	2,581,115.70	
FRANCE (GOVT OF)		3,780,000.00	3,498,163.20	
FRANCE (GOVT OF)		550,000.00	373,835.00	
FRANCE (GOVT OF)		1,520,000.00	1,250,276.00	
FRANCE (GOVT OF)		2,620,000.00	2,445,455.60	
FRANCE (GOVT OF)		210,000.00	176,868.30	
FRANCE (GOVT OF)		2,410,000.00	2,285,668.10	
FRANCE (GOVT OF)		1,140,000.00	907,565.40	
FRANCE (GOVT OF)		3,860,000.00	3,571,580.80	
FRANCE (GOVT OF)		1,560,000.00	1,336,764.00	
FRANCE (GOVT OF)		2,240,000.00	2,054,886.40	
FRANCE (GOVT OF)		1,270,000.00	1,414,132.30	
FRANCE (GOVT OF)		1,590,000.00	1,883,641.20	
FRANCE (GOVT OF)		1,180,000.00	822,035.20	
FRANCE (GOVT OF)		5,900,000.00	5,289,704.00	
FRANCE (GOVT OF)		790,000.00	759,284.80	
FRANCE (GOVT OF)		1,140,000.00	622,075.20	
FRANCE (GOVT OF)		2,150,000.00	2,027,041.50	
FRANCE (GOVT OF)		3,160,000.00	3,216,848.40	
FRANCE (GOVT OF)		690,000.00	794,638.50	
FRANCE (GOVT OF)		1,310,000.00	873,560.40	
FRANCE (GOVT OF)		420,000.00	163,086.00	
FRANCE (GOVT OF)		890,000.00	475,767.30	
FRANCE (GOVT OF)		1,660,000.00	1,326,240.40	
FRANCE (GOVT OF)		1,440,000.00	1,778,385.60	
FRANCE (GOVT OF)		2,640,000.00	2,488,200.00	
FRANCE (GOVT OF)		1,200,000.00	1,367,352.00	
FRANCE (GOVT OF)		300,000.00	269,811.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND		710,000.00	592,012.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND		220,000.00	211,611.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND		160,000.00	138,548.80	

		IRELAND GOVERNMENT BOND	500,000.00	467,440.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	440,000.00	391,617.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	620,000.00	576,513.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	240,000.00	171,984.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	520,000.00	534,950.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	430,000.00	367,361.90	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	510,000.00	419,072.10	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	60,000.00	40,480.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	840,000.00	833,389.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	830,000.00	839,785.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	760,000.00	729,539.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,040,000.00	987,074.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,050,000.00	989,268.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,160,000.00	1,075,969.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	850,000.00	967,325.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	720,000.00	639,057.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,090,000.00	777,976.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	840,000.00	716,511.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	262,956.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	110,000.00	101,937.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	890,000.00	432,744.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,020,000.00	861,604.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	172,681.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	241,922.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	610,000.00	617,686.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	650,000.00	616,635.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	71,509.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	360,000.00	265,737.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1,190,000.00	1,105,498.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	770,000.00	863,516.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	980,000.00	880,853.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	650,000.00	679,412.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	340,000.00	289,159.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	570,000.00	331,409.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	240,000.00	144,804.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	690,000.00	568,918.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	550,000.00	528,418.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	730,000.00	630,260.10	
	ユーロ　小計		241,030,000.00 (37,740,477,400)	222,314,028.20 (34,809,930,536)	
国債証券　合計			117,494,685,767 (117,494,685,767)	105,901,308,617 (105,901,308,617)	
合計				105,901,308,617 (105,901,308,617)	

（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	61銘柄	46.03	47.41
イギリス・ポンド	国債証券	32銘柄	5.00	5.15
イスラエル・シュケル	国債証券	7銘柄	0.31	0.31
オーストラリア・ドル	国債証券	14銘柄	1.36	1.40
オフショア・人民元	国債証券	43銘柄	7.36	7.58
カナダ・ドル	国債証券	17銘柄	1.95	2.01
シンガポール・ドル	国債証券	11銘柄	0.91	0.94
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.20	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.27	0.28
ニュージーランド・ドル	国債証券	9銘柄	0.23	0.24
ノルウェー・クローネ	国債証券	5銘柄	0.17	0.18
ポーランド・ズロチ	国債証券	7銘柄	0.50	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券	10銘柄	0.88	0.91
ユーロ	国債証券	189銘柄	31.91	32.87

（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）

	2023年12月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	478,781,536
金銭信託	1,723,268
コール・ローン	187,915,709
国債証券	70,729,237,550
未収利息	436,794,208
前払費用	42,690,501
流動資産合計	71,877,142,772
資産合計	71,877,142,772
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,311,529
未払金	393,863,983
未払解約金	141,285,726
その他未払費用	646
流動負債合計	536,461,884
負債合計	536,461,884
純資産の部	
元本等	
元本	43,638,546,039
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	27,702,134,849
元本等合計	71,340,680,888
純資産合計	71,340,680,888
負債純資産合計	71,877,142,772

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12月11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12月11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	13,104,963,162円
	同期中一部解約元本額	6,623,907,844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）	3,472,318,305円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	6,254,100,145円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,573,410,443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）	909,289,063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）	2,063,856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）	6,142,779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）	4,498,514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	15,801,758,118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）	5,805,997,737円
	ＤＣニッセイ外国債券インデックス	4,331,670,668円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	302,552,148円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,957,760,348円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	347,741,033円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	558,492,187円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	63,854,546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）	205,715,273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）	20,424,002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）	46,573,746円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	234,006,367円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	153,320,420円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	302,437,462円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	202,671,872円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス	37,353,651円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	44,393,356円
	計	43,638,546,039円
２．	受益権の総数	43,638,546,039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　2022年12月13日 至　2023年12月11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	2023年12月11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	2023年12月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,104,393,117
合計	1,104,393,117

（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（2023年11月21日から2023年12月11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	2023年12月11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	34,422,821	－	33,111,292	△1,311,529
アメリカ・ドル	34,422,821	－	33,111,292	△1,311,529
合計	34,422,821	－	33,111,292	△1,311,529

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

（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）

	2023年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.6348円
（1万口当たり純資産額）	(16,348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

2023年12月11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	127,532.40	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	124,846.80	
		US TREASURY BONDS	180,000.00	192,789.00	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	102,753.00	

		US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,063,461.80	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,109,190.60	
		US TREASURY N/B	500,000.00	386,425.00	
		US TREASURY N/B	870,000.00	795,197.40	
		US TREASURY N/B	2,210,000.00	2,059,786.30	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,110,375.00	
		US TREASURY N/B	860,000.00	785,825.00	
		US TREASURY N/B	180,000.00	185,400.00	
		US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,172,800.00	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,253,889.00	
		US TREASURY N/B	670,000.00	526,258.20	
		US TREASURY N/B	730,000.00	714,940.10	
		US TREASURY N/B	870,000.00	887,800.20	
		US TREASURY N/B	500,000.00	535,390.00	
		US TREASURY N/B	320,000.00	330,297.60	
		US TREASURY N/B	480,000.00	422,865.60	
		US TREASURY N/B	490,000.00	439,177.20	
		US TREASURY N/B	610,000.00	493,978.00	
		US TREASURY N/B	11,560,000.00	11,154,012.80	
		US TREASURY N/B	7,710,000.00	7,409,695.50	
		US TREASURY N/B	420,000.00	343,824.60	
		US TREASURY N/B	510,000.00	448,040.10	
		US TREASURY N/B	480,000.00	405,336.00	
		US TREASURY N/B	540,000.00	427,399.20	
		US TREASURY N/B	700,000.00	505,827.00	
		US TREASURY N/B	360,000.00	283,935.60	
		US TREASURY N/B	480,000.00	369,633.60	
		US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,726,940.00	
		US TREASURY N/B	7,860,000.00	7,501,662.60	
		US TREASURY N/B	280,000.00	220,082.80	
		US TREASURY N/B	7,460,000.00	6,996,361.00	
		US TREASURY N/B	580,000.00	414,676.80	
		US TREASURY N/B	6,880,000.00	6,419,865.60	
		US TREASURY N/B	590,000.00	420,876.50	
		US TREASURY N/B	6,890,000.00	6,371,045.20	
		US TREASURY N/B	710,000.00	480,414.40	
		US TREASURY N/B	4,480,000.00	4,180,736.00	
		US TREASURY N/B	330,000.00	252,047.40	
		US TREASURY N/B	3,620,000.00	3,389,333.60	
		US TREASURY N/B	650,000.00	507,000.00	
		US TREASURY N/B	4,460,000.00	4,174,247.80	
		US TREASURY N/B	500,000.00	389,550.00	
		US TREASURY N/B	5,270,000.00	4,891,824.80	
		US TREASURY N/B	690,000.00	512,269.80	
		US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,630,631.30	
		US TREASURY N/B	150,000.00	151,306.50	
		US TREASURY N/B	730,000.00	541,681.90	
		US TREASURY N/B	3,320,000.00	3,222,724.00	
		US TREASURY N/B	5,640,000.00	5,299,344.00	

		US TREASURY N/B	170,000.00	173,247.00	
		US TREASURY N/B	820,000.00	637,386.00	
		US TREASURY N/B	2,870,000.00	2,783,670.40	
		US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,603,412.50	
		US TREASURY N/B	870,000.00	691,650.00	
		US TREASURY N/B	170,000.00	153,669.80	
		US TREASURY N/B	270,000.00	265,823.10	
		US TREASURY N/B	4,820,000.00	4,667,639.80	
		US TREASURY N/B	6,900,000.00	6,482,205.00	
		US TREASURY N/B	940,000.00	729,816.00	
		US TREASURY N/B	280,000.00	283,203.20	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,017,796.50	
		US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,606,587.50	
		US TREASURY N/B	990,000.00	823,630.50	
		US TREASURY N/B	300,000.00	298,662.00	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,824,000.00	
		US TREASURY N/B	4,740,000.00	4,370,754.00	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	814,894.50	
		US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,449,477.80	
		US TREASURY N/B	4,050,000.00	3,676,954.50	
		US TREASURY N/B	300,000.00	307,125.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	758,000.00	
		US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,005,329.80	
		US TREASURY N/B	3,630,000.00	3,155,958.30	
		US TREASURY N/B	970,000.00	644,244.90	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,166,671.80	
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,788,992.00	
		US TREASURY N/B	290,000.00	269,937.80	
		US TREASURY N/B	910,000.00	621,429.90	
		US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,969,483.20	
		US TREASURY N/B	3,790,000.00	3,221,348.40	
		US TREASURY N/B	280,000.00	272,669.60	
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	706,464.70	
		US TREASURY N/B	140,000.00	150,794.00	
		US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,831,453.20	
		US TREASURY N/B	890,000.00	543,033.50	
		US TREASURY N/B	300,000.00	310,242.00	
		US TREASURY N/B	2,170,000.00	1,895,104.40	
		US TREASURY N/B	4,980,000.00	3,929,917.20	
		US TREASURY N/B	1,450,000.00	764,585.00	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	659,319.20	
		US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,258,038.20	
		US TREASURY N/B	3,820,000.00	3,053,899.00	
		US TREASURY N/B	1,470,000.00	829,682.70	
		US TREASURY N/B	1,210,000.00	761,440.90	
		US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,009,756.80	
		US TREASURY N/B	2,330,000.00	1,890,841.60	
		US TREASURY N/B	1,610,000.00	969,075.10	
		US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,011,950.00	

	US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,087,852.00	
	US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,012,080.50	
	US TREASURY N/B	2,250,000.00	1,877,692.50	
	US TREASURY N/B	1,660,000.00	1,126,658.60	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,220,586.80	
	US TREASURY N/B	900,000.00	788,517.00	
	US TREASURY N/B	1,260,000.00	914,482.80	
	US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,028,096.00	
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	992,112.00	
	US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,104,337.60	
	US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,231,058.40	
	US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,487,920.40	
	US TREASURY N/B	2,390,000.00	1,929,829.40	
	US TREASURY N/B	1,530,000.00	918,000.00	
	US TREASURY N/B	300,000.00	249,222.00	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	957,028.90	
	US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,691,874.00	
	US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,331,124.80	
	US TREASURY N/B	2,330,000.00	1,948,462.50	
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	922,796.00	
	US TREASURY N/B	310,000.00	256,742.00	
	US TREASURY N/B	1,140,000.00	834,149.40	
	US TREASURY N/B	290,000.00	234,763.70	
	US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,008,871.50	
	US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,038,226.20	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	838,980.00	
	US TREASURY N/B	2,190,000.00	1,949,778.90	
	US TREASURY N/B	1,260,000.00	981,073.80	
	US TREASURY N/B	870,000.00	741,675.00	
	US TREASURY N/B	330,000.00	256,109.70	
	US TREASURY N/B	2,660,000.00	2,601,187.40	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,175,844.00	
	US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,186,957.80	
	US TREASURY N/B	880,000.00	819,975.20	
	US TREASURY NOTES	150,000.00	166,375.50	
	WI TREASURY SEC.	290,000.00	287,552.40	
	WI TREASURY SEC.	1,330,000.00	678,246.80	
	WI TREASURY SEC.	4,270,000.00	3,399,133.50	
	WI TREASURY SEC.	280,000.00	276,530.80	
	WI TREASURY SEC.	280,000.00	254,996.00	
アメリカ・ドル　小計		262,240,000.00 (38,129,696,000)	230,781,474.70 (33,555,626,419)	
イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	212,520.00	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	407,040.00	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	410,130.00	
	UNITED KINGDOM GILT	200,000.00	208,676.00	
	UNITED KINGDOM GILT	160,000.00	165,424.00	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	292,334.00	

		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	355,113.00	
		UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	389,101.50	
		UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	256,064.20	
		UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	297,367.50	
		UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	226,415.00	
		UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	336,178.80	
		UNITED KINGDOM GILT	420,000.00	238,639.80	
		UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	353,985.60	
		UNITED KINGDOM GILT	420,000.00	226,296.00	
		UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	366,126.20	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	342,873.00	
		UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	299,524.50	
		UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	365,902.00	
		UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	287,840.00	
		UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	146,812.90	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	153,878.40	
		UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	320,323.00	
		UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	285,824.00	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	283,621.00	
		UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	472,968.00	
		UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	164,145.00	
		UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	277,947.00	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	286,718.60	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	321,235.40	
		UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	323,756.40	
		UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	372,290.30	
		UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	412,214.00	
		UNITED KINGDOM GILT	550,000.00	336,803.50	
		UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	315,976.00	
		UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	148,715.00	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	311,555.60	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	290,615.00	
		UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	154,432.00	
		UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	317,438.00	
		UNITED KINGDOM GILT	610,000.00	463,203.50	
		UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	189,392.00	
		UNITED KINGDOM GILT	590,000.00	529,820.00	
		UNITED KINGDOM GILT	590,000.00	291,460.00	
		UNITED KINGDOM GILT	530,000.00	341,129.20	
		UNITED KINGDOM GILT	610,000.00	512,644.00	
		UNITED KINGDOM GILT	520,000.00	389,703.60	
		UNITED KINGDOM GILT	580,000.00	551,522.00	
		UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	191,334.40	
		UNITED KINGDOM GILT	780,000.00	620,607.00	
		UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	86,181.00	
		UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	288,246.00	
		UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	391,376.70	
		UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	490,776.00	
		UNITED KINGDOM GILT	710,000.00	708,012.00	

	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	384,334.00	
	UNITED KINGDOM GILT	740,000.00	697,294.60	
	UNITED KINGDOM GILT	670,000.00	657,638.50	
	UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	421,492.80	
イギリス・ポンド　小計		24,220,000.00 (4,419,907,800)	19,940,987.50 (3,639,030,809)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	180,000.00	184,428.00	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	489,164.00	
	ISRAEL FIXED BOND	630,000.00	612,202.50	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	354,717.00	
	ISRAEL FIXED BOND	560,000.00	537,516.00	
	ISRAEL FIXED BOND	680,000.00	574,702.00	
	ISRAEL FIXED BOND	430,000.00	512,173.00	
	ISRAEL FIXED BOND	560,000.00	514,920.00	
	ISRAEL FIXED BOND	480,000.00	348,432.00	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	498,836.00	
	ISRAEL FIXED BOND	420,000.00	394,884.00	
	ISRAEL FIXED BOND	240,000.00	172,776.00	
	ISRAEL FIXED BOND	440,000.00	359,062.00	
イスラエル・シュケル　小計		5,990,000.00 (235,181,177)	5,553,812.50 (218,055,453)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	410,000.00	380,709.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	170,000.00	173,593.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	424,547.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	539,036.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	453,253.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	257,073.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	444,748.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	252,104.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	230,000.00	197,903.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	354,205.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	383,200.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	237,633.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	302,854.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	410,000.00	382,464.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	510,000.00	465,084.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	250,393.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	540,000.00	447,962.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	640,000.00	505,670.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	356,884.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	409,481.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	430,000.00	238,060.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	690,000.00	542,229.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	550,000.00	501,270.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	488,712.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	448,105.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	490,000.00	502,936.00	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	400,617.00	
オーストラリア・ドル　小計		**11,640,000.00** **(1,112,667,600)**	**10,340,734.80** **(988,470,840)**	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	**14,000,000.00**	**13,983,620.00**	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,412,496.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	6,995,030.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,171,627.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	2,995,980.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,477,448.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,226,826.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	8,258,818.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	7,884,753.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,600,000.00	17,534,176.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,958,900.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	7,386,828.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	11,211,069.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,948,400.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,320,128.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	7,966,960.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,600,000.00	9,572,928.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,002,030.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	2,181,542.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,372,620.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	720,000.00	734,803.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,217,388.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,422,855.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,028,660.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,421,648.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,480,136.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,340,000.00	3,395,677.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	3,999,852.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,185,952.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,613,000.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,634,956.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,689,213.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,711,310.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,529,295.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,480,585.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,123,780.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,790,784.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,000,180.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,475,885.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,300,000.00	8,259,662.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,297,933.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	10,259,727.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	5,923,192.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,700,000.00	5,756,202.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,469,475.00	

	CHINA GOVERNMENT BOND	6,900,000.00	6,960,789.00	
オフショア・人民元　小計		264,970,000.00 (5,359,124,238)	266,725,119.50 (5,394,622,232)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	398,403.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	172,546.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	215,292.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	228,349.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	340,000.00	337,089.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	440,000.00	435,314.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	414,729.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	346,111.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	390,000.00	392,402.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	164,102.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	232,148.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	240,000.00	220,891.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	140,646.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	135,756.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	242,770.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	160,597.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	189,645.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	165,007.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	141,045.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	225,843.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	196,682.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	880,000.00	683,856.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	132,094.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	720,000.00	629,956.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	182,859.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	610,000.00	573,070.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	620,000.00	508,623.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	368,772.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	682,429.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	390,000.00	361,923.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	690,000.00	499,063.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	670,000.00	581,305.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	360,000.00	333,511.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	270,000.00	259,983.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	540,000.00	484,417.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	103,363.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	339,444.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	225,262.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	460,000.00	427,947.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	319,273.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	317,126.40	
カナダ・ドル　小計		14,230,000.00 (1,522,894,600)	13,169,657.30 (1,409,416,724)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	60,108.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	208,682.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	116,787.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	160,112.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	220,000.00	216,458.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	154,432.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	155,888.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	168,480.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	138,670.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	112,191.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	112,280.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	212,898.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	200,180.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	161,173.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	110,004.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	96,084.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	123,409.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	112,640.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	117,888.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	70,000.00	70,028.00	
シンガポール・ドル　小計		2,910,000.00 (315,414,900)	2,808,394.40 (304,401,869)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,780,000.00	1,764,407.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,850,000.00	1,767,730.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,110,000.00	1,102,396.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,610,000.00	1,501,502.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,530,000.00	1,399,230.90	
	SWEDISH GOVERNMENT	960,000.00	1,077,542.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,220,000.00	1,039,171.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	980,000.00	928,550.00	
スウェーデン・クローナ　小計		11,040,000.00 (153,345,600)	10,580,531.20 (146,963,578)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	690,000.00	673,226.10	
	KINGDOM OF DENMARK	1,370,000.00	1,345,367.40	
	KINGDOM OF DENMARK	1,450,000.00	1,348,949.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,250,000.00	1,122,075.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,300,000.00	696,514.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,550,000.00	1,282,206.50	
	KINGDOM OF DENMARK	2,330,000.00	2,886,916.60	
デンマーク・クローネ　小計		9,940,000.00 (208,740,000)	9,355,255.10 (196,460,357)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	110,000.00	108,220.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	240,000.00	232,341.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	98,984.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	229,395.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	130,000.00	101,104.90	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	140,000.00	111,134.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	140,000.00	114,948.40	

	NEW ZEALAND GOVERNMENT	270,000.00	242,362.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	61,359.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	98,512.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	290,000.00	260,837.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	180,000.00	144,804.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	113,547.60	
ニュージーランド・ドル　小計		2,220,000.00 (197,646,600)	1,917,553.00 (170,719,744)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	990,144.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,350,000.00	1,315,278.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,120,000.00	1,070,697.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,006,268.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	910,000.00	860,477.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	940,000.00	863,258.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,240,000.00	1,097,201.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	880,000.00	757,574.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	920,000.00	839,610.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	440,000.00	463,381.60	
ノルウェー・クローネ　小計		9,880,000.00 (131,799,200)	9,263,893.00 (123,580,333)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	630,000.00	661,512.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,030,000.00	1,000,171.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,128,504.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	710,000.00	653,342.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	820,000.00	749,988.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,040,000.00	923,572.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	570,000.00	587,316.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	770,000.00	725,917.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	880,000.00	689,304.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	730,000.00	640,516.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	613,672.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	730,000.00	702,792.90	
	POLAND GOVERNMENT BOND	960,000.00	1,055,568.00	
ポーランド・ズロチ　小計		10,870,000.00 (392,428,740)	10,132,177.80 (365,791,883)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	248,265.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	552,150.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	490,000.00	510,780.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	410,270.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	208,374.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	615,148.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	685,487.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	367,117.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	389,568.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	327,958.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	373,822.10	

	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	257,342.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	590,000.00	633,654.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT	530,000.00	536,360.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	342,335.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	500,000.00	549,320.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	365,180.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	440,000.00	443,889.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	395,841.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	250,000.00	252,487.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	460,000.00	456,513.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	540,000.00	519,220.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	589,369.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	314,085.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	390,000.00	381,685.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	420,000.00	452,613.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	166,398.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	338,742.00	
マレーシア・リンギット　小計		11,450,000.00 (355,847,680)	11,683,983.60 (363,119,516)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,300,000.00	2,149,649.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	600,000.00	549,702.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,350,000.00	1,306,813.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,120,000.00	1,908,699.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,310,000.00	8,571,158.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,670,000.00	5,782,489.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,850,000.00	9,054,218.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,840,000.00	5,132,308.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,840,000.00	4,803,264.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,650,000.00	1,750,237.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,620,000.00	7,175,144.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,240,000.00	6,059,913.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,810,000.00	4,523,083.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,020,000.00	7,149,509.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,200,000.00	3,016,192.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,900,000.00	3,402,672.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,550,000.00	4,938,945.00	
メキシコ・ペソ　小計		83,870,000.00 (702,889,309)	77,274,001.20 (647,610,222)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	236,424.00	
	BELGIUM KINGDOM	90,000.00	92,159.10	
	BELGIUM KINGDOM	440,000.00	524,268.80	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	235,873.00	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	229,383.00	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	211,278.90	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	345,274.80	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	280,467.90	
	BELGIUM KINGDOM	490,000.00	473,913.30	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	163,048.50	
	BELGIUM KINGDOM	360,000.00	345,553.20	

		BELGIUM KINGDOM	240,000.00	173,899.20	
		BELGIUM KINGDOM	200,000.00	151,478.00	
		BELGIUM KINGDOM	360,000.00	338,803.20	
		BELGIUM KINGDOM	160,000.00	126,092.80	
		BELGIUM KINGDOM	150,000.00	123,283.50	
		BELGIUM KINGDOM	460,000.00	515,075.80	
		BELGIUM KINGDOM	380,000.00	352,396.80	
		BELGIUM KINGDOM	250,000.00	218,582.50	
		BELGIUM KINGDOM	420,000.00	384,778.80	
		BELGIUM KINGDOM	250,000.00	179,270.00	
		BELGIUM KINGDOM	310,000.00	263,769.70	
		BELGIUM KINGDOM	200,000.00	128,834.00	
		BELGIUM KINGDOM	240,000.00	217,864.80	
		BELGIUM KINGDOM	370,000.00	421,100.70	
		BELGIUM KINGDOM	310,000.00	250,948.10	
		BELGIUM KINGDOM	140,000.00	59,210.20	
		BELGIUM KINGDOM	360,000.00	294,134.40	
		BELGIUM KINGDOM	240,000.00	154,300.80	
		BELGIUM KINGDOM	120,000.00	114,198.00	
		BELGIUM KINGDOM	390,000.00	394,531.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	536,263.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	190,000.00	194,865.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	562,083.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	130,000.00	133,681.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	420,031.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	676,836.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	515,544.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	496,188.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	569,188.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	479,685.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	497,410.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	591,408.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	498,672.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	380,661.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	286,400.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	620,000.00	593,271.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	545,079.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	417,334.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	531,378.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	620,000.00	583,060.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	337,077.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	516,613.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	646,196.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	506,228.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	436,479.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	417,455.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	472,861.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	472,098.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	461,151.00	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	462,844.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	474,070.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	266,665.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	499,184.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	531,452.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	303,063.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	441,541.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	436,179.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	170,000.00	81,251.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	533,832.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	227,059.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	410,530.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	250,000.00	159,672.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	457,305.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	444,538.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	487,386.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	263,096.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	534,168.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	475,900.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	260,000.00	248,037.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	508,260.90	
		BUNDESOBLIGATION	600,000.00	604,650.00	
		BUNDESOBLIGATION	610,000.00	586,551.60	
		BUNDESOBLIGATION	610,000.00	580,988.40	
		BUNDESOBLIGATION	160,000.00	152,680.00	
		BUNDESOBLIGATION	610,000.00	575,766.80	
		BUNDESOBLIGATION	530,000.00	495,422.80	
		BUNDESOBLIGATION	490,000.00	453,872.30	
		BUNDESOBLIGATION	650,000.00	627,308.50	
		BUNDESOBLIGATION	190,000.00	183,775.60	
		BUNDESOBLIGATION	550,000.00	548,801.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	140,000.00	140,841.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	120,000.00	103,944.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	560,000.00	576,066.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	290,000.00	293,601.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	692,684.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000.00	659,831.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	640,807.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	717,360.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	540,000.00	662,553.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	675,316.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	608,829.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	675,648.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	420,000.00	515,046.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	470,000.00	613,096.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	820,000.00	641,067.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	630,000.00	587,367.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	630,000.00	576,563.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	580,761.60	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	576,010.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	870,000.00	461,178.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	430,000.00	477,029.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	535,043.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	490,000.00	449,001.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	398,496.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	624,787.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	717,677.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	182,464.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	514,674.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	424,769.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	220,000.00	117,271.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	602,214.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	539,616.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	169,696.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	323,404.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	561,131.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	260,000.00	319,716.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	670,120.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	470,000.00	387,867.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	595,175.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	567,229.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	492,645.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	854,624.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	390,000.00	387,285.60	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	400,000.00	399,036.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	370,000.00	371,850.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	220,000.00	221,727.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	190,000.00	187,984.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	208,103.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	399,964.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	354,753.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	223,982.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	311,382.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	453,943.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	397,187.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	294,880.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	251,370.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	294,637.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	234,648.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	160,000.00	164,806.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	436,716.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	650,620.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	690,000.00	677,828.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	495,410.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	324,959.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	457,892.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	640,000.00	638,771.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	468,847.50	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	583,121.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	429,998.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	806,827.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	317,524.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	481,560.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	308,370.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	435,210.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	146,832.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	388,528.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	396,724.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	342,976.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	413,006.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	282,605.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	504,273.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	680,000.00	743,457.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	487,270.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	326,249.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	308,706.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	498,055.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	273,686.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	560,000.00	599,771.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	438,030.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	488,976.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	546,969.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	223,366.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	215,635.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	590,000.00	638,503.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	444,461.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	354,517.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	472,599.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	456,341.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	235,762.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	434,442.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	445,267.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	198,563.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	256,545.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	373,950.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	181,908.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	423,278.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	110,000.00	63,805.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	317,113.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	372,411.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	404,962.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	410,018.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	446,251.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	361,062.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	379,746.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	401,074.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	670,674.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	309,672.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	366,436.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	424,607.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	338,268.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	127,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	360,753.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	299,232.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	347,979.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	377,567.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	338,194.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	222,335.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	391,044.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	248,137.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	382,242.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	488,461.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	416,576.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	401,376.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	199,582.00	
		DEUTSCHLAND REP	380,000.00	429,293.60	
		DEUTSCHLAND REP	300,000.00	341,994.00	
		DEUTSCHLAND REP	300,000.00	332,754.00	
		DEUTSCHLAND REP	480,000.00	583,305.60	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	86,716.80	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	142,147.60	
		FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	70,940.80	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	121,090.80	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	112,909.20	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	96,083.90	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	135,326.80	
		FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	142,587.00	
		FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	139,117.50	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	84,681.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	95,299.10	
		FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	133,359.00	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	77,778.80	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	101,582.00	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	57,309.30	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	108,890.60	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	46,877.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	114,899.40	
		FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	136,057.50	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	83,679.30	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	62,996.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	117,315.90	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	96,195.00	
		FRANCE (GOVT OF)	480,000.00	454,070.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	995,390.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,250,000.00	1,258,262.50	
		FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	705,649.00	

		FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	845,529.30	
		FRANCE (GOVT OF)	640,000.00	753,625.60	
		FRANCE (GOVT OF)	310,000.00	328,203.20	
		FRANCE (GOVT OF)	670,000.00	676,445.40	
		FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	666,174.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,360,000.00	1,354,152.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	965,170.00	
		FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	802,369.30	
		FRANCE (GOVT OF)	1,360,000.00	1,258,598.40	
		FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	1,006,896.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,130,000.00	1,072,211.80	
		FRANCE (GOVT OF)	370,000.00	251,489.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,030,000.00	847,226.50	
		FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	821,374.40	
		FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	614,827.90	
		FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	863,053.10	
		FRANCE (GOVT OF)	660,000.00	525,432.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,380,000.00	1,276,886.40	
		FRANCE (GOVT OF)	960,000.00	822,624.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,310,000.00	1,201,741.60	
		FRANCE (GOVT OF)	590,000.00	656,959.10	
		FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	995,131.20	
		FRANCE (GOVT OF)	720,000.00	501,580.80	
		FRANCE (GOVT OF)	1,240,000.00	1,111,734.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,070,000.00	1,028,398.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,050,000.00	903,231.00	
		FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	398,346.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	952,238.10	
		FRANCE (GOVT OF)	980,000.00	997,630.20	
		FRANCE (GOVT OF)	440,000.00	506,726.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,270,000.00	1,062,189.90	
		FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	373,430.40	
		FRANCE (GOVT OF)	290,000.00	112,607.00	
		FRANCE (GOVT OF)	490,000.00	294,279.30	
		FRANCE (GOVT OF)	1,180,000.00	957,688.00	
		FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	829,035.00	
		FRANCE (GOVT OF)	690,000.00	368,853.30	
		FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	623,173.20	
		FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	674,464.00	
		FRANCE (GOVT OF)	370,000.00	291,989.20	
		FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	963,292.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,070,000.00	994,062.10	
		FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	951,925.00	
		FRANCE (GOVT OF)	440,000.00	501,362.40	
		FRANCE (GOVT OF)	290,000.00	260,817.30	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	240,000.00	200,116.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	208,643.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	260,000.00	250,086.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	147,208.10	

		IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	168,278.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	120,000.00	106,804.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	150,000.00	138,322.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	204,569.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	143,320.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	120,000.00	92,610.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	257,187.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	157,277.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	153,779.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	164,342.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	90,000.00	60,721.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	80,000.00	80,036.00	
		IRISH GOVERNMENT BOND	110,000.00	90,754.40	
		ITALIAN GOVT	220,000.00	244,439.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	267,875.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	170,401.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	110,000.00	118,693.30	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	455,305.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	340,000.00	338,456.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	440,000.00	422,364.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	420,000.00	398,626.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	348,599.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	430,000.00	398,850.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	443,831.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	239,646.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	249,809.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	264,426.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	468,748.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	324,345.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	189,629.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	330,000.00	274,117.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	156,850.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	323,840.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	238,966.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	293,222.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	253,413.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	190,000.00	163,825.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	80,650.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	71,222.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	94,048.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	201,461.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	115,201.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	192,394.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	290,000.00	281,671.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	340,000.00	322,547.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	220,000.00	162,958.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	320,000.00	298,755.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	35,754.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	95,960.80	

		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	235,970.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	260,117.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	340,000.00	381,293.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	269,649.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	198,597.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	255,141.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	122,098.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	84,469.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	44,124.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	272,091.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	36,013.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	192,152.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	106,359.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	185,341.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	270,000.00	233,109.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	86,482.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	127,992.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	320,000.00	321,904.00	
	ユーロ　小計		159,320,000.00 (24,946,325,600)	148,201,351.20 (23,205,367,571)	
国債証券　合計			78,183,909,044 (78,183,909,044)	70,729,237,550 (70,729,237,550)	
合計				70,729,237,550 (70,729,237,550)	

（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	142銘柄	47.04	47.44
イギリス・ポンド	国債証券	59銘柄	5.10	5.15
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	0.31	0.31
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	1.39	1.40
オフショア・人民元	国債証券	46銘柄	7.56	7.63
カナダ・ドル	国債証券	41銘柄	1.98	1.99
シンガポール・ドル	国債証券	20銘柄	0.43	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.21	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.28	0.28
ニュージーランド・ドル	国債証券	13銘柄	0.24	0.24
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.17	0.17
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.51	0.52
マレーシア・リンギット	国債証券	28銘柄	0.51	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券	17銘柄	0.91	0.92
ユーロ	国債証券	372銘柄	32.53	32.81

（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）

	2023年12月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	55,323,450
金銭信託	171,356
コール・ローン	18,685,758
国債証券	2,881,004,570
特殊債券	137,436,733
派生商品評価勘定	134,754
未収利息	31,978,088
前払費用	2,270,236
流動資産合計	3,127,004,945
資産合計	3,127,004,945
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	263,784
未払解約金	493,705
その他未払費用	44
流動負債合計	757,533
負債合計	757,533
純資産の部	
元本等	
元本	2,448,211,176
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	678,036,236
元本等合計	3,126,247,412
純資産合計	3,126,247,412
負債純資産合計	3,127,004,945

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12月11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12月11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	1,414,766,862円
同期中一部解約元本額	272,025,357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）	782,762,392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）	61,294,054円
ニッセイ新興国債券インデックス（ラップ専用）	1,565,698,374円
ＦＷニッセイ新興国債インデックス	38,456,356円
計	2,448,211,176円
２．　受益権の総数	2,448,211,176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　2022年12月13日 至　2023年12月11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	2023年12月11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	2023年12月11日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	100,540,320
特殊債券	2,512,803
合計	103,053,123

（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（2023年11月21日から2023年12月11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	2023年12月11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	32,603,425	－	32,474,395	△129,030
アメリカ・ドル	32,603,425	－	32,474,395	△129,030
合計	32,603,425	－	32,474,395	△129,030

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

（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）

	2023年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.2770円
（1万口当たり純資産額）	(12,770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

2023年12月11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	180,176.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	139,238.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	193,050.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	159,360.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	118,492.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	176,964.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	165,770.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	185,156.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	178,874.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	164,722.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	400,000.00	369,132.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	182,030.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	134,062.50	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	133,875.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	450,000.00	367,875.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	300,000.00	262,500.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	123,750.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	141,750.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	300,000.00	286,500.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	400,000.00	389,876.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	189,648.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	400,000.00	293,104.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	400,000.00	356,788.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	174,244.00	

		HUNGARY	200,000.00	156,742.00
		HUNGARY	200,000.00	129,058.00
		HUNGARY	200,000.00	197,390.00
		HUNGARY	200,000.00	205,004.00
		HUNGARY	200,000.00	208,568.00
		OMAN GOV INTERNTL BOND	200,000.00	204,616.00
		OMAN GOV INTERNTL BOND	200,000.00	207,422.00
		OMAN SOVEREIGN SUKUK	200,000.00	194,978.00
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN	200,000.00	196,830.00
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN	200,000.00	196,150.00
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	192,346.00
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	144,988.00
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	167,584.00
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	126,784.00
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	146,306.00
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	186,064.00
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	172,468.00
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	144,208.00
		REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	160,780.00
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	202,834.00
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	145,040.00
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	162,074.00
		REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	312,932.00
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	123,448.00
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	152,470.00
		REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	211,090.00
		REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	186,970.00
		REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	169,704.00
		REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	143,398.00
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	166,316.00
		REPUBLIC OF PANAMA	400,000.00	257,632.00
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	142,752.00
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	114,660.00
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	125,668.00
		REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	190,962.00
		REPUBLIC OF PERU	330,000.00	279,711.30
		REPUBLIC OF PERU	210,000.00	124,378.80
		REPUBLIC OF PERU	160,000.00	115,129.60
		REPUBLIC OF PERU	260,000.00	211,673.80
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	146,184.00
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	134,430.00
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	180,194.00
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	294,000.00
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	174,860.00
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY	300,000.00	318,360.00
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY	140,000.00	136,974.60
		ROMANIA	190,000.00	132,958.20
		ROMANIA	200,000.00	212,292.00
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	196,124.00

		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	142,846.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	181,212.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	162,876.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	161,242.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	131,562.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	208,060.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	199,688.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	199,292.00	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	178,578.00	
		STATE OF QATAR	200,000.00	195,588.00	
		STATE OF QATAR	600,000.00	552,462.00	
		STATE OF QATAR	400,000.00	383,484.00	
		STATE OF QATAR	400,000.00	346,812.00	
		STATE OF QATAR	200,000.00	195,384.00	
		UAE INT'L GOVT BOND	200,000.00	193,086.00	
		UAE INT'L GOVT BOND	200,000.00	205,414.00	
		UAE INT'L GOVT BOND	200,000.00	136,570.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	193,914.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	177,002.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	187,212.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	165,718.00	
		UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	328,520.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	126,320.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	128,810.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	157,454.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	150,348.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	186,972.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	163,904.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	203,564.00	
	アメリカ・ドル　小計		23,240,000.00 (3,379,096,000)	19,814,336.80 (2,881,004,570)	
国債証券　合計			3,379,096,000 (3,379,096,000)	2,881,004,570 (2,881,004,570)	
特殊債券	**アメリカ・ドル**	KSA SUKUK LTD	200,000.00	195,798.00	
		KSA SUKUK LTD	200,000.00	194,644.00	
		KSA SUKUK LTD	200,000.00	181,736.00	
		KSA SUKUK LTD	200,000.00	205,016.00	
		KSA SUKUK LTD	200,000.00	168,038.00	
	アメリカ・ドル　小計		1,000,000.00 (145,400,000)	945,232.00 (137,436,733)	
特殊債券　合計			145,400,000 (145,400,000)	137,436,733 (137,436,733)	
合計				3,018,441,303 (3,018,441,303)	

（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	102銘柄	92.16	100.00
	特殊債券	5銘柄	4.40	

（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）

	2023年12月11日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,101,507
コール・ローン	229,161,143
投資証券	30,626,454,100
未収配当金	210,115,201
流動資産合計	31,067,831,951
資産合計	31,067,831,951
負債の部	
流動負債	
未払解約金	110,140,010
その他未払費用	880
流動負債合計	110,140,890
負債合計	110,140,890
純資産の部	
元本等	
元本	16,635,955,175
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	14,321,735,886
元本等合計	30,957,691,061
純資産合計	30,957,691,061
負債純資産合計	31,067,831,951

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12月11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12月11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	4,839,542,504円
同期中一部解約元本額	5,167,119,864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）	56,827,516円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド	1,020,976,438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	8,841,147,750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）	1,636,704,714円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＡ	2,994,416,836円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＢ	1,821,444,624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）	177,088,168円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	19,474,682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）	7,077,222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）	14,881,866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）	40,324,694円
ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（安定型）	109,252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）	238,856円
ＦＷニッセイ国内リートインデックス	5,242,557円
計	16,635,955,175円
２．　受益権の総数	16,635,955,175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　2022年12月13日 至　2023年12月11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	2023年12月11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	2023年12月11日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	205,672,046
合計	205,672,046

（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（2023年11月14日から2023年12月11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）

	2023年12月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8609円 (18,609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

2023年12月11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	1,272	201,357,600	
	ＧＬＰ投資法人	9,980	1,381,232,000	
	ＫＤＸ不動産投資法人	8,503	1,373,234,500	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	2,995	379,766,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	515	136,681,000	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	1,474	175,700,800	
	いちごオフィスリート投資法人	2,421	202,637,700	
	いちごホテルリート投資法人	489	53,349,900	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,550	618,450,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,899	955,220,500	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,295	166,537,000	
	イオンリート投資法人	3,624	513,158,400	
	インヴィンシブル投資法人	14,306	844,054,000	
	エスコンジャパンリート投資法人	601	69,415,500	
	オリックス不動産投資法人	5,887	1,018,451,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,182	244,384,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,453	477,310,500	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	805	89,033,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	947	86,461,100	
	ザイマックス・リート投資法人	479	56,378,300	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,891	670,609,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,568	334,867,200	

	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,035	1,742,090,000	
	スターアジア不動産投資法人	4,554	267,775,200	
	スターツプロシード投資法人	512	103,936,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	1,401	140,100,000	
	トーセイ・リート投資法人	622	83,659,000	
	ヒューリックリート投資法人	2,764	413,218,000	
	フロンティア不動産投資法人	1,096	488,268,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	728	102,502,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	455	57,512,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,609	970,201,200	
	ラサールロジポート投資法人	3,777	564,661,500	
	阪急阪神リート投資法人	1,409	196,978,200	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,229	557,966,000	
	三菱地所物流リート投資法人	1,020	383,520,000	
	産業ファンド投資法人	4,508	618,948,400	
	森トラストリート投資法人	5,695	413,457,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,474	484,970,400	
	星野リゾート・リート投資法人	545	328,635,000	
	積水ハウス・リート投資法人	8,878	712,015,600	
	大江戸温泉リート投資法人	452	27,617,200	
	大和ハウスリート投資法人	4,454	1,187,436,400	
	大和証券オフィス投資法人	612	409,428,000	
	大和証券リビング投資法人	4,351	463,816,600	
	投資法人みらい	3,778	165,098,600	
	東海道リート投資法人	440	55,616,000	
	東急リアル・エステート投資法人	1,981	347,269,300	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,020	621,180,000	
	日本ビルファンド投資法人	3,447	2,133,693,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	2,021	723,518,000	
	日本プロロジスリート投資法人	5,147	1,381,454,800	
	日本リート投資法人	960	329,760,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,893	538,747,800	
	日本都市ファンド投資法人	14,162	1,416,200,000	
	福岡リート投資法人	1,528	255,940,000	
	平和不動産リート投資法人	2,208	300,067,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9,555	1,590,907,500	
投資証券　合計		186,456	30,626,454,100	
合計			30,626,454,100	

（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）

	2023年12月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	37,095,770
金銭信託	1,592,457
コール・ローン	173,651,265
株式	949,285
投資証券	9,297,096,641
派生商品評価勘定	28,863,998
未収入金	306,721
未収配当金	21,551,155
差入委託証拠金	174,209,693
流動資産合計	9,735,316,985
資産合計	9,735,316,985
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,751,148
未払解約金	54,077,457
その他未払費用	610
流動負債合計	66,829,215
負債合計	66,829,215
純資産の部	
元本等	
元本	6,367,125,666
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,301,362,104
元本等合計	9,668,487,770
純資産合計	9,668,487,770
負債純資産合計	9,735,316,985

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12月11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。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、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。 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．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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12月11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	3,024,005,044円
同期中一部解約元本額	881,115,219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）	1,674,441,619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）	222,889,628円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	24,871,669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）	8,938,900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）	51,201,248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）	53,979,159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）	2,185,476,244円
ＦＷニッセイ先進国リートインデックス	10,746,938円
ＤＣニッセイ先進国リートインデックス	2,134,580,261円
計	6,367,125,666円
２．　受益権の総数	6,367,125,666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　2022年12月13日 至　2023年12月11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	2023年12月11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	2023年12月11日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	78,202
投資証券	439,295,552
合計	439,373,754

（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（2023年11月21日から2023年12月11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	2023年12月11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	276,596,455	－	272,749,210	3,847,245
アメリカ・ドル	242,790,150	－	239,912,121	2,878,029
ユーロ	33,806,305	－	32,837,089	969,216
買建	387,950,088	－	375,634,260	△12,315,828
アメリカ・ドル	341,836,092	－	330,913,271	△10,922,821
ユーロ	46,113,996	－	44,720,989	△1,393,007
合計	664,546,543	－	648,383,470	△8,468,583

（注）為替予約取引

時価の算定方法

国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。ただし、当該日を超える先物相場が発表されていない場合は、当該為替予約は当該日に最も近い日に発表されている先物相場の仲値によって評価しております。

株式関連

種類	2023年12月11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	333,042,677	－	357,624,111	24,581,434
合計	333,042,677	－	357,624,111	24,581,434

（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）

	2023年12月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5185円 (15,185円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年12月11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	STAR HOLDINGS	498	13.110	6,528.78	
アメリカ・ドル　小計		498		6,528.78 (949,285)	
合計		498		949,285 (949,285)	

（２）株式以外の有価証券

2023年12月11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	4,205.00	66,481.05	
		AGREE REALTY CORP	4,755.00	280,021.95	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	3,655.00	63,341.15	

		ALEXANDER'S INC	148.00	27,972.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,822.00	934,259.68	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	337.00	5,644.75	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,110.00	45,386.10	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	15,714.00	551,247.12	
		AMERICOLD REALTY TRUST	12,813.00	363,632.94	
		APARTMENT INCOME REIT CO	7,709.00	252,701.02	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	6,838.00	48,823.32	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,847.00	183,314.30	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3,594.00	43,020.18	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,379.00	3,157.91	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,099.00	1,247,649.25	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,111.00	455,672.88	
		BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	2,430.00	5,564.70	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	9,527.00	47,444.46	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	14,974.00	340,059.54	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	9,590.00	157,084.20	
		BRT APARTMENTS CORP	345.00	6,534.30	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,295.00	495,876.75	
		CARETRUST REIT INC	4,952.00	111,816.16	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,202.00	28,162.86	
		CENTERSPACE	800.00	43,592.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	1,647.00	16,749.99	
		CITY OFFICE REIT INC	1,821.00	9,979.08	
		CLIPPER REALTY INC	93.00	513.36	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,103.00	31,126.66	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	5,338.00	131,528.32	
		COUSINS PROPERTIES INC	7,545.00	169,460.70	
		CTO REALTY GROWTH INC	1,289.00	22,402.82	
		CUBESMART	11,180.00	471,572.40	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	10,164.00	87,410.40	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	39,300.00	24,955.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,153.00	2,042,775.93	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	10,623.00	26,345.04	

DOUGLAS EMMETT INC		8,908.00	127,473.48	
EAGLE HOSPITALITY TRUST		20,300.00	20.30	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI		4,379.00	55,394.35	
EASTGROUP PROPERTIES		2,303.00	398,741.42	
ELME COMMUNITIES		4,201.00	57,343.65	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN		5,581.00	52,070.73	
EPR PROPERTIES		3,802.00	172,116.54	
EQUINIX INC		4,682.00	3,753,887.14	
EQUITY COMMONWEALTH		5,434.00	104,061.10	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		9,320.00	659,949.20	
EQUITY RESIDENTIAL		17,246.00	1,014,409.72	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY		7,387.00	179,577.97	
ESSEX PROPERTY TRUST INC		3,183.00	719,708.13	
EXTRA SPACE STORAGE INC		10,519.00	1,458,774.92	
FARMLAND PARTNERS INC		2,376.00	29,700.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST		3,766.00	373,285.92	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR		6,643.00	328,562.78	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST		4,325.00	104,751.50	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C		3,706.00	9,227.94	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		13,151.00	605,998.08	
GETTY REALTY CORP		2,378.00	68,819.32	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		1,705.00	22,864.05	
GLADSTONE LAND CORP		1,613.00	22,920.73	
GLOBAL MEDICAL REIT INC		2,426.00	25,545.78	
GLOBAL NET LEASE INC		9,409.00	85,621.90	
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A		18,939.00	300,751.32	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		28,027.00	525,506.25	
HIGHWOODS PROPERTIES INC		5,529.00	118,984.08	
HOST HOTELS AND RESORTS INC		35,460.00	637,925.40	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN		6,705.00	51,025.05	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN		11,449.00	167,384.38	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT		2,205.00	8,996.40	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER		1,397.00	122,768.36	

INVENTRUST PROPERTIES CORP	3,242.00	81,730.82	
INVITATION HOMES INC	28,889.00	955,648.12	
IRON MOUNTAIN INC	14,553.00	952,493.85	
JBG SMITH PROPERTIES	5,089.00	78,675.94	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	39,500.00	11,060.00	
KILROY REALTY CORP	5,254.00	202,751.86	
KIMCO REALTY CORP	31,184.00	631,164.16	
KITE REALTY GROUP TRUST	11,213.00	246,686.00	
LTC PROPERTIES INC	2,046.00	67,743.06	
LXP INDUSTRIAL TRUST	15,022.00	138,052.18	
MACERICH CO/THE	10,723.00	143,580.97	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	76,900.00	5,383.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29,864.00	140,062.16	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,929.00	753,753.77	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	4,206.00	154,991.10	
NATL HEALTH INVESTORS INC	2,172.00	119,481.72	
NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I	688.00	13,416.00	
NETSTREIT CORP	3,041.00	50,541.42	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	1,479.00	12,645.45	
NEXPOINT RESIDENTIAL	1,074.00	34,700.94	
NNN REIT INC	9,275.00	377,956.25	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,864.00	11,687.28	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	12,289.00	375,060.28	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	420.00	9,294.60	
ORION OFFICE REIT INC	2,499.00	13,969.41	
PARAMOUNT GROUP INC	6,289.00	33,897.71	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	10,233.00	155,336.94	
PEAKSTONE REALTY TRUST	1,807.00	31,730.92	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,508.00	73,917.36	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	5,868.00	209,018.16	
PHYSICIANS REALTY TRUST	12,093.00	152,009.01	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	6,624.00	44,182.08	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1,344.00	30,898.56	

		POSTAL REALTY TRUST INC-A	1,281.00	18,715.41	
		PRIME US REIT	33,400.00	6,145.60	
		PROLOGIS INC	46,205.00	5,537,669.25	
		PUBLIC STORAGE	7,876.00	2,156,527.56	
		REALTY INCOME CORP	35,418.00	1,907,613.48	
		REGENCY CENTERS CORP	8,369.00	535,281.24	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	6,411.00	86,035.62	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	10,373.00	543,752.66	
		RLJ LODGING TRUST	8,332.00	89,902.28	
		RPT REALTY	4,369.00	53,345.49	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3,038.00	318,230.50	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	11,637.00	164,547.18	
		SAFEHOLD INC	1,826.00	39,861.58	
		SAUL CENTERS INC	777.00	30,404.01	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	7,505.00	57,638.40	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	16,285.00	2,163,950.80	
		SITE CENTERS CORP	9,207.00	124,570.71	
		SL GREEN REALTY CORP	3,093.00	131,421.57	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	7,114.00	293,879.34	
		STAG INDUSTRIAL INC	9,275.00	335,940.50	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,513.00	28,838.07	
		SUN COMMUNITIES INC	6,179.00	788,687.56	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	10,161.00	103,134.15	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	5,251.00	139,676.60	
		TERRENO REALTY CORP	4,241.00	249,837.31	
		UDR INC	15,178.00	536,845.86	
		UMH PROPERTIES INC	3,218.00	47,497.68	
		UNITI GROUP INC	12,773.00	70,123.77	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	616.00	26,062.96	
		URBAN EDGE PROPERTIES	5,325.00	92,708.25	
		VENTAS INC	19,869.00	928,279.68	
		VERIS RESIDENTIAL INC	3,616.00	54,131.52	
		VICI PROPERTIES INC	50,711.00	1,547,192.61	
		VORNADO REALTY TRUST	7,933.00	221,886.01	
		WELLTOWER INC	25,957.00	2,276,948.04	
		WHITESTONE REIT	1,918.00	22,133.72	
		WP CAREY INC	10,706.00	669,767.36	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,244.00	66,231.72	

アメリカ・ドル　小計		1,312,342.00	49,986,385.79 (7,268,020,492)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	20,702.00	10,143.98	
	AEW UK REIT PLC	11,405.00	10,983.01	
	ASSURA PLC	147,290.00	64,807.60	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	28,171.00	19,212.62	
	BIG YELLOW GROUP PLC	8,779.00	99,817.23	
	BRITISH LAND CO PLC	46,107.00	173,454.53	
	CLS HOLDINGS PLC	8,747.00	8,484.59	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	23,657.00	20,297.70	
	DERWENT LONDON PLC	5,178.00	114,640.92	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	31,132.00	28,548.04	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	12,037.00	49,785.03	
	HAMMERSON PLC	189,121.00	50,873.54	
	HELICAL PLC	5,493.00	10,876.14	
	HOME REIT PLC	24,530.00	2.45	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	10,174.00	8,668.24	
	INTU PROPERTIES PLC	19,587.00	19.58	
	INVISTA FOUNDATION PROPERTY	30,095.00	13,422.37	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	37,641.00	242,332.75	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	22,085.00	13,206.83	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	50,637.00	95,602.65	
	LXI REIT PLC	91,108.00	85,003.76	
	NEWRIVER REIT PLC	14,320.00	11,856.96	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	26,370.00	17,404.20	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	68,879.00	67,501.42	
	PRS REIT PLC/THE	24,066.00	19,060.27	
	REGIONAL REIT LTD	23,182.00	7,302.33	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	10,982.00	86,922.53	
	SEGRO PLC	62,887.00	523,094.06	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	89,598.00	111,997.50	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	68,765.00	55,218.29	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	34,447.00	28,384.32	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	11,942.00	7,284.62	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	93,858.00	148,483.35	

	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	30,039.00	17,242.38	
	UNITE GROUP PLC	19,868.00	194,607.06	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	18,005.00	21,353.93	
	WAREHOUSE REIT PLC	17,617.00	15,080.15	
	WORKSPACE GROUP PLC	5,451.00	28,999.32	
イギリス・ポンド　小計		1,443,952.00	2,481,976.25 (452,935,846)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	32,068.00	53,617.69	
	REIT 1 LTD	9,030.00	145,834.50	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	10,535.00	87,335.15	
イスラエル・シュケル　小計		51,633.00	286,787.34 (11,259,931)	
オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	14,277.00	15,776.08	
	ABACUS STORAGE KING	14,277.00	16,918.24	
	ARENA REIT	17,176.00	60,631.28	
	BWP TRUST	25,681.00	91,937.98	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	31,854.00	50,807.13	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	24,972.00	79,660.68	
	CENTURIA OFFICE REIT	18,473.00	24,661.45	
	CHARTER HALL GROUP	24,008.00	261,687.20	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	36,730.00	131,493.40	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	29,051.00	100,516.46	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	12,357.00	34,723.17	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	100,346.00	44,653.97	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	11,104.00	31,091.20	
	DEXUS/AU	54,951.00	400,592.79	
	GDI PROPERTY GROUP	14,036.00	8,772.50	
	GOODMAN GROUP	85,292.00	1,978,774.40	
	GPT GROUP	95,145.00	411,977.85	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	11,360.00	28,627.20	
	HEALTHCO REIT	22,191.00	31,844.08	
	HMC CAPITAL LTD	12,624.00	69,053.28	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	95,900.00	116,039.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	10,250.00	29,212.50	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	17,699.00	72,211.92	
	MIRVAC GROUP	197,425.00	416,566.75	
	NATIONAL STORAGE REIT	63,544.00	149,963.84	
	REGION RE LTD	61,752.00	136,471.92	
	RURAL FUNDS GROUP	14,970.00	29,940.00	
	SCENTRE GROUP	265,866.00	741,766.14	

	STOCKLAND	119,284.00	499,799.96	
	VICINITY CENTRES	197,179.00	378,583.68	
	WAYPOINT REIT LTD	37,217.00	90,437.31	
オーストラリア・ドル　小計		1,736,991.00	6,535,193.36 (624,699,133)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	3,275.00	62,061.25	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,100.00	13,335.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,037.00	74,674.37	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	7,017.00	19,998.45	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,158.00	210,062.16	
	CHOICE PROPERTIES REIT	7,158.00	95,774.04	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3,092.00	41,494.64	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,757.00	38,460.15	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	6,581.00	86,935.01	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	1,000.00	9,160.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,726.00	68,432.48	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,623.00	118,722.45	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	5,411.00	50,755.18	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,647.00	46,863.95	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,254.00	40,459.30	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,344.00	20,858.88	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,457.00	20,907.95	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	800.00	6,040.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	6,395.00	28,649.60	
	PRIMARIS REIT	2,025.00	27,013.50	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	2,600.00	12,194.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,364.00	131,962.88	
	SLATE GROCERY REIT	1,757.00	18,887.75	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,554.00	84,478.58	

	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	156.00	1,399.32	
カナダ・ドル　小計		83,288.00	1,329,580.89 (142,291,747)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	37,800.00	49,518.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	180,400.00	514,140.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	116,242.00	111,592.32	
	CAPITALAND CHINA TRUST	56,700.00	49,045.50	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	256,728.00	487,783.20	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	42,600.00	44,304.00	
	EC WORLD REIT	17,800.00	4,984.00	
	ESR-LOGOS REIT	335,133.00	102,215.56	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	60,200.00	39,431.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	55,400.00	123,542.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	149,611.00	166,068.21	
	KEPPEL DC REIT	69,500.00	136,915.00	
	KEPPEL REIT	104,000.00	92,040.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	67,500.00	41,850.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	99,800.00	230,538.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	169,600.00	276,448.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	111,700.00	158,614.00	
	PARAGON REIT	60,300.00	50,652.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	18,700.00	66,385.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	43,800.00	29,565.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	82,800.00	43,470.00	
	SUNTEC REIT	111,100.00	129,987.00	
シンガポール・ドル　小計		2,247,414.00	2,949,087.79 (319,651,626)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	39,117.00	42,246.36	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	51,900.00	110,287.50	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	74,629.00	61,942.07	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	61,826.00	72,954.68	
ニュージーランド・ドル　小計		227,472.00	287,430.61 (25,589,947)	
ユーロ	AEDIFICA	2,422.00	150,285.10	
	ALTAREA	208.00	14,705.60	
	CARE PROPERTY INVEST	1,748.00	23,493.12	
	CARMILA	2,840.00	41,236.80	

		COFINIMMO	1,730.00	119,889.00	
		COVIVIO	2,449.00	114,172.38	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	1,883.00	40,258.54	
		GECINA SA	2,545.00	272,569.50	
		HAMBORNER REIT AG	4,272.00	28,836.00	
		ICADE	1,607.00	54,091.62	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,126.00	2,482.83	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	13,741.00	87,255.35	
		INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	799.00	16,499.35	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	21,950.00	21,950.00	
		KLEPIERRE	9,956.00	234,762.48	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	3,434.00	20,775.70	
		MERCIALYS	4,666.00	42,670.57	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	17,074.00	164,251.88	
		MONTEA NV	779.00	64,734.90	
		NSI NV	1,110.00	19,846.80	
		RETAIL ESTATES	499.00	31,287.30	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,340.00	337,594.80	
		VASTNED RETAIL NV	513.00	10,147.14	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	8,000.00	217,760.00	
		WERELDHAVE NV	1,686.00	24,227.82	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	1,585.00	49,848.25	
	ユーロ　小計		113,962.00	2,205,632.83 (345,357,989)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	89,000.00	224,280.00	
		FORTUNE REIT	72,000.00	338,400.00	
		LINK REIT	127,100.00	4,817,090.00	
		PROSPERITY REIT	98,000.00	129,360.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	60,000.00	123,000.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	113,000.00	129,950.00	
	香港・ドル　小計		559,100.00	5,762,080.00 (107,289,930)	
投資証券　合計			7,776,154	9,297,096,641 (9,297,096,641)	
合計				9,297,096,641 (9,297,096,641)	

（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	1銘柄	0.01	－	78.18
	投資証券	141銘柄	－	75.17	
イギリス・ポンド	投資証券	38銘柄	－	4.68	4.87
イスラエル・シュケル	投資証券	3銘柄	－	0.12	0.12
オーストラリア・ドル	投資証券	31銘柄	－	6.46	6.72
カナダ・ドル	投資証券	25銘柄	－	1.47	1.53
シンガポール・ドル	投資証券	22銘柄	－	3.31	3.44
ニュージーランド・ドル	投資証券	4銘柄	－	0.26	0.28
ユーロ	投資証券	26銘柄	－	3.57	3.71
香港・ドル	投資証券	6銘柄	－	1.11	1.15

（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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ＦＷニッセイ国内株インデックス

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	158,110,438円
Ⅱ　負債総額	2,856,171円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	155,254,267円
Ⅳ　発行済数量	122,063,452口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2719円

ＦＷニッセイ先進国株インデックス

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	211,956,268円
Ⅱ　負債総額	2,726,181円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	209,230,087円
Ⅳ　発行済数量	159,702,965口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3101円

ＦＷニッセイ新興国株インデックス

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	14,135,595円
Ⅱ　負債総額	727,525円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,408,070円
Ⅳ　発行済数量	12,260,999口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0936円

ＦＷニッセイ国内債インデックス

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	40,385,803円
Ⅱ　負債総額	920,532円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	39,465,271円
Ⅳ　発行済数量	41,608,651口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9485円

ＦＷニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	32,102,191円
Ⅱ　負債総額	808,393円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	31,293,798円
Ⅳ　発行済数量	38,020,150口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8231円

ＦＷニッセイ外国債インデックス

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	61,938,517円
Ⅱ　負債総額	1,516,590円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	60,421,927円
Ⅳ　発行済数量	55,673,454口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0853円

ＦＷニッセイ新興国債インデックス

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	49,575,237円
Ⅱ　負債総額	1,175,064円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	48,400,173円
Ⅳ　発行済数量	46,567,324口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0394円

ＦＷニッセイ国内リートインデックス

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	9,744,616円
Ⅱ　負債総額	218,332円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,526,284円
Ⅳ　発行済数量	9,854,269口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9667円

ＦＷニッセイ先進国リートインデックス

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	17,077,017円
Ⅱ　負債総額	346,656円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,730,361円
Ⅳ　発行済数量	14,809,951口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1297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12月29日現在

Ⅰ　資産総額	202,665,142,645円
Ⅱ　負債総額	496,657,829円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	202,168,484,816円
Ⅳ　発行済数量	72,232,067,501口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7989円

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	837,186,981,184円
Ⅱ　負債総額	2,451,080,834円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	834,735,900,350円
Ⅳ　発行済数量	220,946,865,950口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.7780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12月29日現在

Ⅰ　資産総額	9,634,541,729円
Ⅱ　負債総額	61,881,021円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,572,660,708円
Ⅳ　発行済数量	7,394,252,126口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2946円

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	54,098,869,595円
Ⅱ　負債総額	359,273,879円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	53,739,595,716円
Ⅳ　発行済数量	57,383,785,419口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9365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12月29日現在

Ⅰ　資産総額	111,537,371,086円
Ⅱ　負債総額	46,040,455円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	111,491,330,631円
Ⅳ　発行済数量	111,092,077,830口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0036円

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	72,919,820,064円
Ⅱ　負債総額	468,450,198円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	72,451,369,866円
Ⅳ　発行済数量	43,735,219,680口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6566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12月29日現在

Ⅰ　資産総額	3,323,162,989円
Ⅱ　負債総額	12,902,488円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,310,260,501円
Ⅳ　発行済数量	2,564,428,237口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2908円

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2023年12月29日現在

Ⅰ　資産総額	31,047,811,309円
Ⅱ　負債総額	249,974,086円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	30,797,837,223円
Ⅳ　発行済数量	16,596,279,940口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8557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12月29日現在

Ⅰ　資産総額	10,515,874,390円
Ⅱ　負債総額	8,741,896円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,507,132,494円
Ⅳ　発行済数量	6,542,343,212口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6060円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（２）受益者に対する特典

ありません。

（３）譲渡制限

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（４）受益権の譲渡

①　受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

②　前記①の申請のある場合には、前記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③　前記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付け、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。

第二部【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12月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。
委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。
最近５年間における資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

①　会社の意思決定機構

委託会社は最低３名で構成される取締役会により運営されます。取締役は委託会社の株主であることを要しません。取締役は株主総会の決議により選任され、その任期は就任後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。

②　投資運用の意思決定機構

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

ファンド毎の運用基本方針、具体的な運用ルールである運用内規および月次運用方針については、運用部門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12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	421	74,121
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	113	20,622
単位型公社債投資信託	0	0
合計	534	94,743

○　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．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

(1)　委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。
　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)　当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。
　中間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す。
　また、第29期事業年度に係る中間会計期間（自 2023年4月1日　至 2023年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

		前事業年度 (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									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	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									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	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	①　満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 ②　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。 ③　関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
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	①　有形固定資産 定率法(ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法)によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②　無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	①　賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。 ②　退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。 ③　役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

５．収益及び費用の計上基準	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。 ①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。 ②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。 ③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。
６．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
７．ヘッジ会計の方法	①ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ②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。 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 ③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。 ④ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。
８．グループ通算制度の適用	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。

(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

①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

①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

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

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				
その他有価証券	－	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△で示しております。

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				
その他有価証券	－	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△で示しております。

（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）
①現金・預金	38,492,350	―	―	―
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	6,250,000	11,070,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（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）
①現金・預金	31,522,565	―	―	―
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	5,100,000	18,340,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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	―	―	―
	① 国債・地方債等	―	―	―
	② 社債	―	―	―
	③ 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△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△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。

中間財務諸表

（1）中間貸借対照表

（単位：千円）

		第29期中間会計期間末 （2023年9月30日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		18,741,468
有価証券		4,104,124
前払費用		751,780
未収委託者報酬		6,599,931
未収運用受託報酬		5,398,961
未収投資助言報酬		266,359
未収還付法人税等		13,544
その他		27,898
流動資産合計		35,904,069
固定資産		
有形固定資産	※1	226,755
無形固定資産		3,177,724
投資その他の資産		
投資有価証券		43,703,580
関係会社株式		66,222
長期前払費用		7,403
差入保証金		364,445
繰延税金資産		1,592,859
その他		9,895
投資その他の資産合計		45,744,406
固定資産合計		49,148,886
資産合計		85,052,955

負債の部		
流動負債		
預り金		86,845
未払収益分配金		6,178
未払手数料		2,420,306
未払運用委託報酬		1,715,368
未払投資助言報酬		1,157,149
その他未払金		2,178,751
未払費用		170,292
未払法人税等		573,020
未払消費税等	※2	451,000
前受投資助言報酬		42,405
賞与引当金		652,050
その他		69,616
流動負債合計		9,522,985
固定負債		
退職給付引当金		2,494,028
役員退職慰労引当金		20,800
固定負債合計		2,514,828
負債合計		12,037,813
純資産の部		
株主資本		
資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		54,965,002
利益剰余金合計		55,644,809
株主資本合計		73,926,649
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△ 486,524
繰延ヘッジ損益		△424,983
評価・換算差額等合計		△911,507
純資産合計		73,015,142
負債・純資産合計		85,052,955

(2)中間損益計算書

（単位：千円）

		第29期中間会計期間 （自 2023年4月1日　至 2023年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		14,336,875
運用受託報酬		10,106,262
投資助言報酬		557,349
その他営業収益		8,170
営業収益計		25,008,658
営業費用		11,639,819
一般管理費	※1	6,327,756
営業利益		7,041,082
営業外収益	※2	231,266
営業外費用	※3	8,807
経常利益		7,263,541
特別利益	※4	60,023
特別損失		64
税引前中間純利益		7,323,500
法人税、住民税及び事業税		2,077,526
法人税等調整額		148,031
法人税等合計		2,225,558
中間純利益		5,097,942

(3)中間株主資本等変動計算書

第29期中間会計期間(自 2023年4月１日　至 2023年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	57,905,876	58,585,683	76,867,523
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△8,038,816	△8,038,816	△8,038,816
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	5,097,942	5,097,942	5,097,942
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	△2,940,873	△2,940,873	△2,940,873
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	54,965,002	55,644,809	73,926,649

	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	△254,732	△306,177	△560,910	76,306,613
当中間期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△8,038,816
中間純利益	-	-	-	5,097,942
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△231,791	△118,805	△350,597	△350,597
当中間期変動額合計	△231,791	△118,805	△350,597	△3,291,471
当中間期末残高	△486,524	△424,983	△911,507	73,015,142

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第29期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	①満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 ②その他有価証券 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 ③関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
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	①有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	①賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。 ②退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。 ③役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

５．収益及び費用の計上基準	**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。** **①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。** **当該契約については、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。** **②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。** **当該契約については、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います。** **③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。** **当該契約については、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います。**
６．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	**外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。**
７．ヘッジ会計の方法	**①ヘッジ会計の方法** **繰延ヘッジ処理によっております。** **②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。** **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** **③ヘッジ方針** **ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。** **④ヘッジ有効性評価の方法** **ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。**
８．グループ通算制度の適用	**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。**

（中間貸借対照表関係）

第29期中間会計期間末 （2023年9月30日現在）	
※１．有形固定資産の減価償却累計額	882,598千円
※２．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債の「未払消費税等」として表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第29期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
※１．減価償却の実施額	
有形固定資産	20,611千円
無形固定資産	302,812千円
※２．営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	51,567千円
為替差益	153,991千円
※３．営業外費用のうち主要なもの	
控除対象外消費税	2,693千円
※４．特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	30,731千円
投資有価証券売却益	29,291千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第29期中間会計期間
（自 2023年4月1日
至 2023年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

２．配当に関する事項
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額(千円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月26日定時株主総会	普通株式	8,038,816	74,126	2023年3月31日	2023年6月26日

（金融商品関係）

第29期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

１．金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
①有価証券			
満期保有目的の債券	4,104,124	4,104,490	365
その他有価証券	―	―	―
②投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,151,829	23,090,156	△61,673
その他有価証券	20,551,750	20,551,750	―
③デリバティブ取引(※)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	―	―	―
ヘッジ会計が適用されているもの	△56,928	△56,928	―

(※)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

関係会社株式（中間貸借対照表計上額66,222千円）は、市場価格のない株式等と認められるため、上表に記載しておりません。

２．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）時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融商品

第29期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

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				
その他有価証券	－	20,551,750	－	20,551,750
デリバティブ取引（※）				
為替予約	－	△56,928	－	△56,928
合計	－	20,494,821	－	20,494,821

(※)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。

（２）時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融商品

第29期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

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	－	27,194,646	－	27,194,646
合計	－	27,194,646	－	27,194,646

（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。

市場における取引価格が存在しない投資信託について、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額を時価とし、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。

（有価証券関係）

第29期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

１．満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	5,249,565	5,250,600	1,034
	(2)社債	－	－	－
	(3)その他	－	－	－
	小計	5,249,565	5,250,600	1,034
時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	22,006,388	21,944,046	△62,342
	(2)社債	－	－	－
	(3)その他	－	－	－
	小計	22,006,388	21,944,046	△62,342
合計		27,255,954	27,194,646	△61,308

２．その他有価証券

	種類	取得原価または償却原価（千円）	中間貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	－	－	－
	(2)債券	－	－	－
	①国債・地方債等	－	－	－
	②社債	－	－	－
	③その他	－	－	－
	(3)その他（注）	6,865,999	7,465,529	599,529
	小計	6,865,999	7,465,529	599,529
中間貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	－	－	－
	(2)債券	－	－	－
	①国債・地方債等	－	－	－
	②社債	－	－	－
	③その他	－	－	－
	(3)その他（注）	14,466,000	13,086,220	△1,379,779
	小計	14,466,000	13,086,220	△1,379,779
合計		21,331,999	20,551,750	△780,249

（注）投資信託受益証券等であります。

（デリバティブ取引関係）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第29期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

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

第29期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資有価証券	1,269,934	－	△56,928
合計			1,269,934	－	△56,928

（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。

（収益認識関係）

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。

区分	第29期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
営業収益	
投資信託委託業務	14,336,875千円
投資運用業務	10,106,262千円
投資助言業務	557,349千円
その他	8,170千円
計	25,008,658千円

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第29期中間会計期間（自 2023年4月1日　至 2023年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第29期中間会計期間（自 2023年4月1日　至 2023年9月30日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

３．主要な顧客ごとの情報

（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	3,036,913

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第29期中間会計期間（自 2023年4月1日　至 2023年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第29期中間会計期間（自 2023年4月1日　至 2023年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第29期中間会計期間（自 2023年4月1日　至 2023年9月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	第29期中間会計期間 （自 2023年4月１日 至 2023年9月30日）
1株当たり純資産額	673,273円29銭
1株当たり中間純利益金額	47,008円17銭

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

２．１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	5,097,942千円
普通株主に帰属しない金額	－
普通株式に係る中間純利益金額	5,097,942千円
期中平均株式数	108千株

（重要な後発事象）

第29期中間会計期間（自 2023年4月1日　至 2023年9月30日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます)。

② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

① 定款の変更等

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、前項のほかに必要に応じて会長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、前項のほかに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）

②　訴訟その他の重要事項

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

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【参考情報】

下記の書類が関東財務局長に提出されています。

2023年3月10日	**有価証券報告書**
	有価証券届出書
2023年9月8日	**半期報告書**
	有価証券届出書

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．ＸＢＲＬ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

2024年3月7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　百　瀬　和　政

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2022年12月13日から2023年12月11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2023年12月11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．ＸＢＲＬ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

2024年3月7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　百　瀬　和　政

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2022年12月13日から2023年12月11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2023年12月11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．ＸＢＲＬ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

2024年3月7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　百　瀬　和　政

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ニッセイ新興国株インデックスの2022年12月13日から2023年12月11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ニッセイ新興国株インデックスの2023年12月11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．ＸＢＲＬ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

2024年3月7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　百　瀬　和　政

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ニッセイ国内債インデックスの2022年12月13日から2023年12月11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ニッセイ国内債インデックスの2023年12月11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．ＸＢＲＬ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

2024年3月7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　百　瀬　和　政

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12月11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2023年12月11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．ＸＢＲＬ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

2024年3月7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　百　瀬　和　政

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の2022年12月13日から2023年12月11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の2023年12月11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．ＸＢＲＬ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

2024年3月7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　百　瀬　和　政

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2022年12月13日から2023年12月11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2023年12月11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．ＸＢＲＬ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

2024年3月7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　百　瀬　和　政

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2022年12月13日から2023年12月11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2023年12月11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．ＸＢＲＬ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

2024年3月7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　百　瀬　和　政

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12月11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ニッセイ先進国リートインデックスの2023年12月11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．ＸＢＲＬ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11月30日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
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

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、「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2023年4月1日から2024年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、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、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。

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。

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、企業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、監査役及び監査役会に対して、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。

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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。