【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年8月20日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　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】	投資信託業務部　　茶木　健
【電話番号】	０３－５５３３－４６０８
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額　上限１兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）
上記ファンドの愛称として「ファンドパック７」ということがあります。
（以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

①　契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。
　ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。
②　委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。基準価額は日々変動します。なお、便宜上１万口当りに換算した価額で表示されます。
基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。
なお、委託会社へは後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。
申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。
なお、販売会社につきましては、後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2024年8月21日から2025年2月20日まで
○　継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。
ニッセイアセットマネジメント株式会社
　コールセンター　０１２０-７６２-５０６
　（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）
　ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① 基本方針

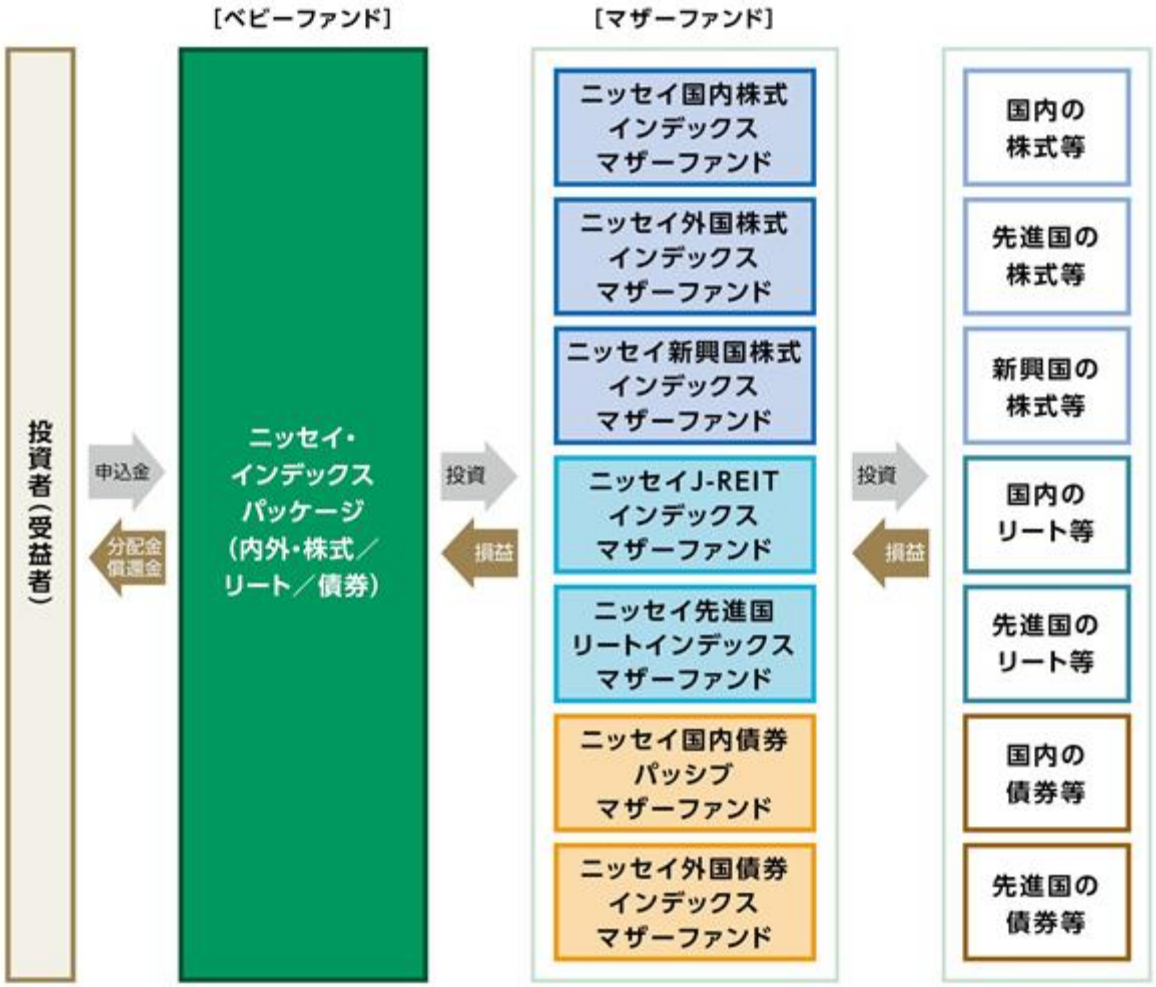
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

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 各マザーファンドへの投資を通じて、複数の資産に分散投資を行います。

- 投資対象とするマザーファンドは、各投資対象資産の指数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は、原則として対円での為替ヘッジ※を行いません。

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

【投資対象資産および投資対象とするマザーファンド】

投資対象資産	投資対象とするマザーファンド	マザーファンドの概要
国内株式	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	「TOPIX（東証株価指数）（配当込み）」の動きに連動する投資成果をめざします。
先進国株式	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	「MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）」の動きに連動する投資成果をめざします。
新興国株式	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド※	「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。
国内リート	ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド	「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。
先進国リート	ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	「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。
国内債券	ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	「NOMURA-BPI総合」の動きに連動する投資成果をめざします。
先進国債券	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）」の動きに連動する投資成果をめざします。

※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。

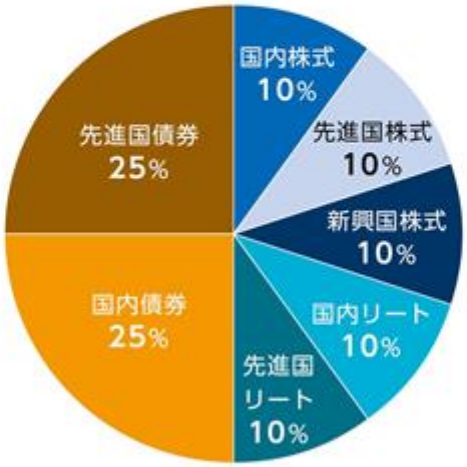
〈各マザーファンドの運用プロセス〉

2 各資産への投資割合は、基本投資割合を維持することを目標とします。

● ファンドは、各投資対象資産の指数を基本投資割合で組合せた合成ベンチマーク*の動きに連動する投資成果をめざします。

※各投資対象資産の指数の騰落率を基本投資割合で加重平均し、委託会社が独自に指数化したもの(以下「ベンチマーク」ということがあります)。各投資対象資産の指数は、国内株式:TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、先進国株式:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、新興国株式: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)、国内リート:東証REIT指数(配当込み)、先進国リート: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)、国内債券:NOMURA-BPI総合、先進国債券:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)。

【基本投資割合】



〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

ファンドは合成ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざしますが、基本投資割合と実際の投資割合がかい離すること、各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がずれること、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、基準価額と合成ベンチマークの動きは完全に一致するものではありません。

〈各指数について〉

●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。

●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。

●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。

●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。

●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）（「当インデックス」）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。

●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。

●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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

＜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

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

⑤　ファンドの分類

追加型投信／内外／資産複合／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 （資産複合（株式・ 不動産投信・ 債券）資産配分 固定型）） 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 （日本含む） 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 （合成ベンチマーク）

商品分類表

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
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

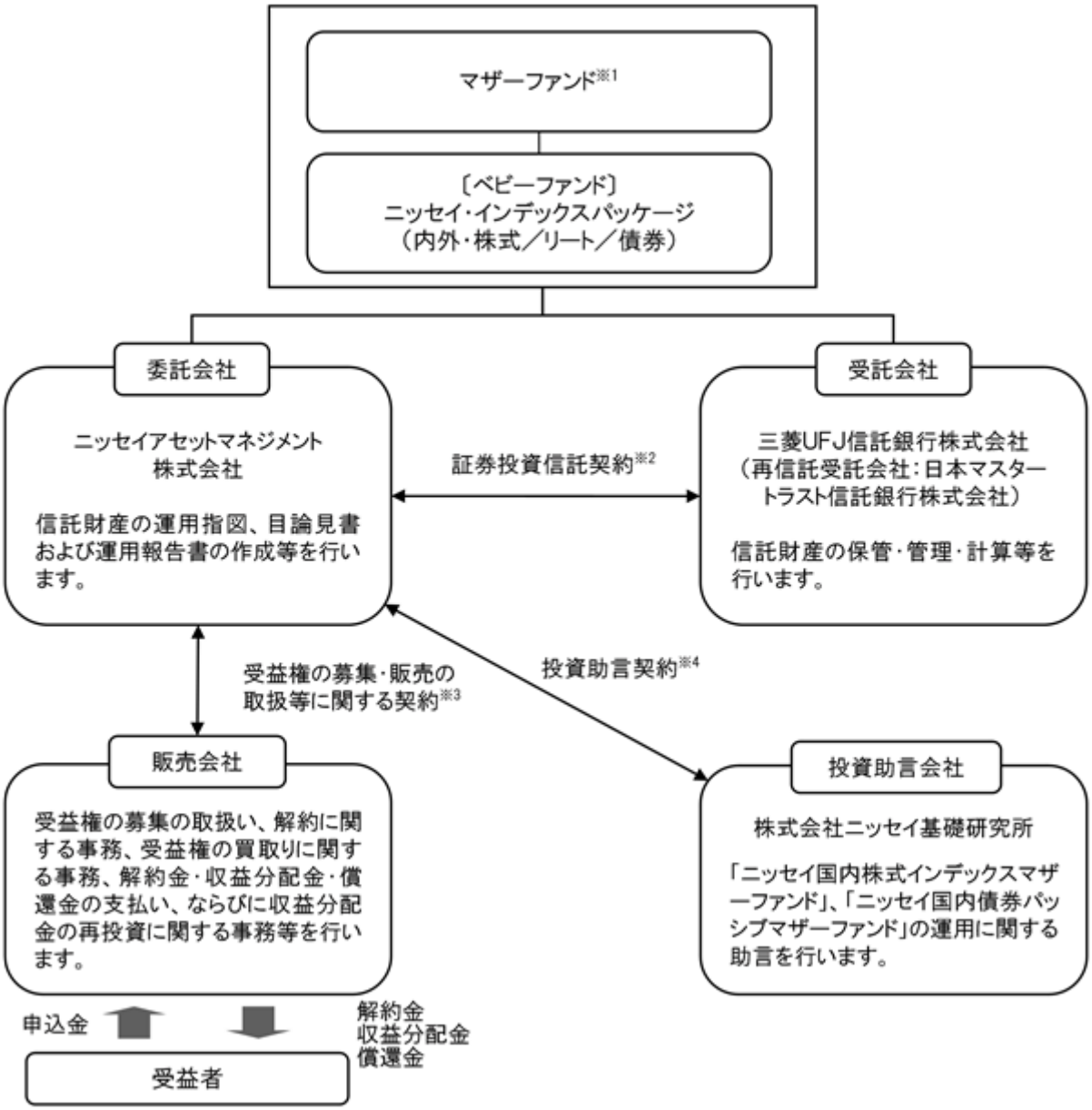
その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式・ 不動産投信・債券） 資産配分固定型））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、公社債等に投資する旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本含む）	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。
その他の指数 （合成ベンチマーク）	目論見書または約款において、合成ベンチマーク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】

2017年11月17日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



※１　ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド、ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

※２　委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託法（平成18年法律第108号）の適用を受けます。

※３　委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。

※４　委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

委託会社の概況（2024年5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】

① 複数のマザーファンド※への投資を通じ、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）、ＭＳＣＩコクサイ・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、円換算ベース）、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）および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）をそれぞれ10%、ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合およびＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）をそれぞれ25%ずつ組合せた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

※ ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド、ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

② 各マザーファンドへの基本投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド、ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンドおよびニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドへそれぞれ10%、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドおよびニッセイ外国債券インデックスマザーファンドへそれぞれ25%とします。

③ 各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

国内の証券取引所※上場株式を主要投資対象とします。

※　金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b　投資態度

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。

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

このマザーファンドは、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。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

ａ　投資対象

国内の証券取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）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。

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

このマザーファンドは、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。

※　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。

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。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

（1）基本方針

このマザーファンドは、主として国内の公社債への投資を行うことにより、ＮＯＭＵＲＡ-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。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

（1）基本方針

このマザーファンドは、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。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、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。

（２）【投資対象】

ａ　主な投資対象

複数のマザーファンド※を主要投資対象とします。なお直接、株式、上場不動産投資信託証券、公社債等に投資を行う場合があります。

※　ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド、ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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）

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

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

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

１．株券または新株引受権証書

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。

③　金融商品

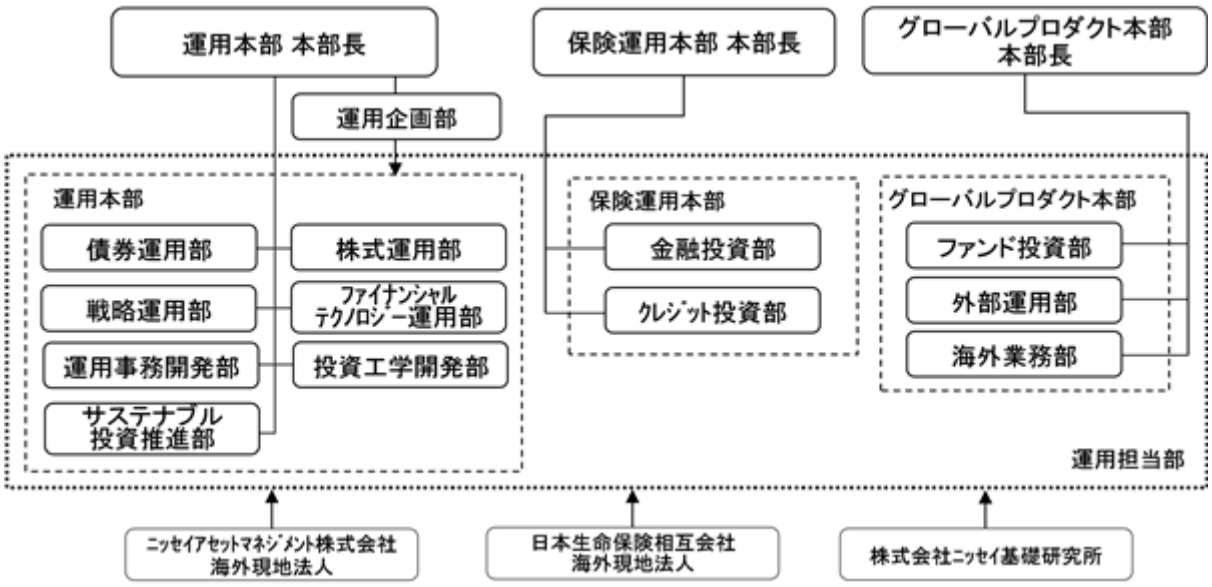
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

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。

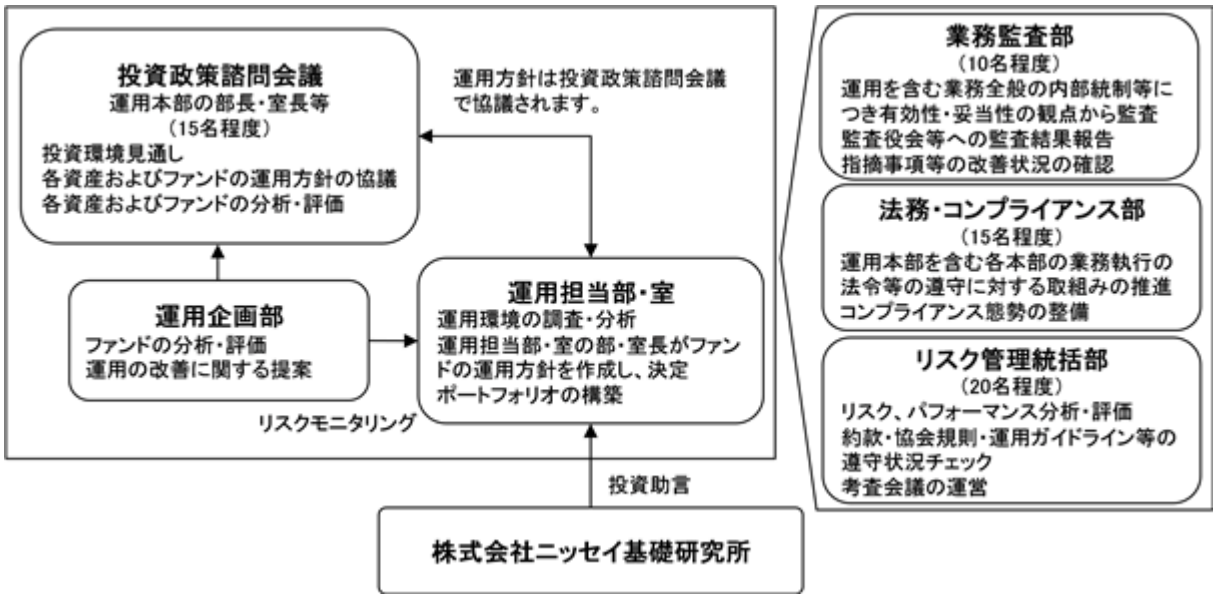
（３）【運用体制】

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



＜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。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

３．留保益の運用方針

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

②　分配時期

毎決算日とし、決算日は11月20日（年１回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

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水準について、保証するものではありません。

（５）【投資制限】

ａ　約款に定める主な投資制限

①　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45%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。

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は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

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。

ｂ　約款に定めるその他の投資制限

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、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

３．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

４．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c　法令に定める投資制限

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。

3【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。また、ベンチマークの動きに連動することを目標に運用しますので、ベンチマークの動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。
ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。
ファンドは、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。
ファンドのお取引に関しては、クーリング・オフ（金融商品取引法第37条の６の規定）の適用はありません。

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

リートの価格は、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。

・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

ファンドは合成ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざしますが、基本投資割合と実際の投資割合がかい離すること、各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がずれること、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、基準価額と合成ベンチマーク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合成ベンチマーク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

委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2023年10月末現在、ファンドの投資対象であるニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に28.1%保有しています。

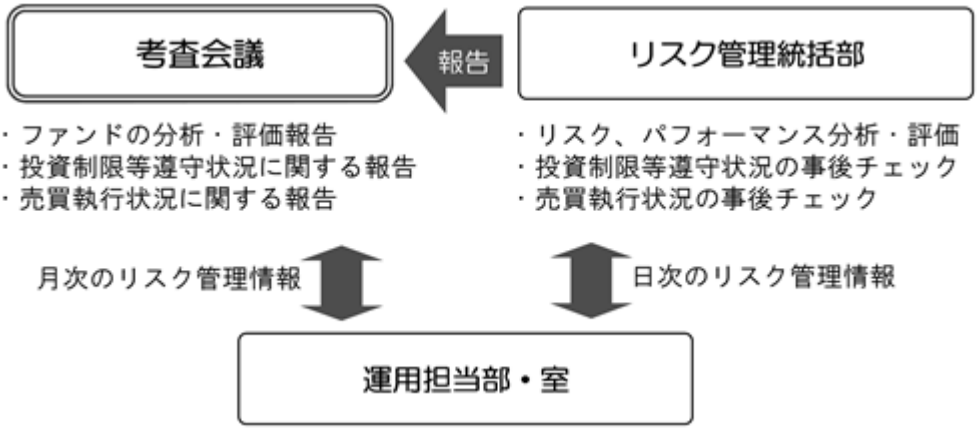
当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

・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。

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 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.3564%（税抜0.324%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.150%	0.150%	0.024%

・表に記載の料率には、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。

○ ファンドが実質的な投資対象とする上場不動産投資信託証券（リート）は、市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託証券の費用は表示しておりません。

（4）【その他の手数料等】

① 証券取引の手数料等

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

② 監査費用

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

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

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

ありません。

○ 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（配当控除の適用はありません）または申告分離課税を選択することもできます。
※　外国税額控除の適用となった場合には、当該分配時の税額が異なる場合があります。

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

税率（個人）

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

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

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

＜少額投資非課税制度について＞

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、当ファンドは、ＮＩＳＡの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」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。

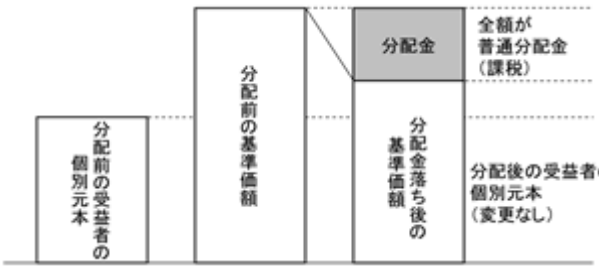
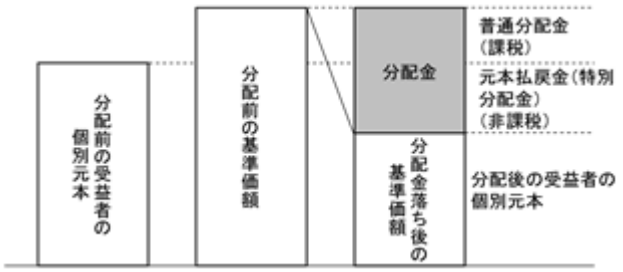
個別元本

- **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。

(参考情報)ファンドの総経費率

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.41%	0.35%	0.06%

・対象期間:2022年11月22日～2023年11月20日
・対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。
・費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。
・①運用管理費用の比率、②その他費用の比率および総経費率は、表示桁数未満を四捨五入しているため、①と②の合計が総経費率の数字と一致しないことがあります。

5【運用状況】

（1）【投資状況】

2024年5月31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		154,607,112	100.00
	内　日本	154,607,112	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△1,550	△0.00
純資産総額		154,605,562	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

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		239,161,164,520	97.55
	内　日本	239,161,164,520	97.55
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,000,529,427	2.45
純資産総額		245,161,693,947	100.00

その他資産の投資状況

2024年5月31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）		5,904,360,000	2.41
	内　日本	5,904,360,000	2.41

（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

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		991,964,049,225	95.24
	内　アメリカ	727,866,266,341	69.88
	内　イギリス	40,979,629,522	3.93
	内　カナダ	33,046,696,720	3.17
	内　フランス	30,492,371,971	2.93
	内　スイス	30,363,493,182	2.92
	内　ドイツ	23,699,937,418	2.28
	内　オランダ	19,064,276,698	1.83
	内　オーストラリア	18,479,282,910	1.77
	内　アイルランド	11,981,496,782	1.15
	内　デンマーク	10,509,689,800	1.01
	内　スウェーデン	8,828,830,430	0.85
	内　スペイン	7,643,450,536	0.73
	内　イタリア	6,685,238,445	0.64
	内　香港	4,651,586,793	0.45
	内　シンガポール	3,024,244,379	0.29
	内　フィンランド	2,894,844,983	0.28
	内　ベルギー	2,542,056,123	0.24
	内　ノルウェー	1,680,509,623	0.16
	内　ジャージィー	1,628,567,147	0.16
	内　イスラエル	1,460,843,984	0.14
	内　オランダ領キュラソー	1,081,756,244	0.10
	内　バミューダ	897,644,600	0.09
	内　ポルトガル	552,636,594	0.05
	内　オーストリア	541,184,058	0.05
	内　ニュージーランド	525,681,130	0.05
	内　ケイマン諸島	494,040,846	0.05
	内　ルクセンブルグ	347,791,966	0.03
投資証券		18,186,787,094	1.75
	内　アメリカ	15,504,187,793	1.49
	内　オーストラリア	1,272,229,037	0.12
	内　フランス	395,732,245	0.04
	内　シンガポール	342,137,882	0.03
	内　イギリス	324,616,007	0.03
	内　香港	185,810,677	0.02
	内　ベルギー	84,698,281	0.01
	内　カナダ	77,375,172	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		31,418,108,472	3.02
純資産総額		1,041,568,944,791	100.00

その他資産の投資状況

2024年5月31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）		29,640,084,384	2.85
	内　アメリカ	21,983,584,374	2.11
	内　ドイツ	5,467,739,433	0.52
	内　イギリス	2,188,760,577	0.21

（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

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		10,234,862,648	80.61
	内　インド	1,979,879,108	15.59
	内　台湾	1,969,724,925	15.51
	内　韓国	1,270,443,788	10.01
	内　中国	1,066,818,389	8.40
	内　香港	1,058,913,304	8.34
	内　ケイマン諸島	587,922,042	4.63
	内　ブラジル	512,466,608	4.04
	内　南アフリカ	304,481,972	2.40
	内　アメリカ	274,000,126	2.16
	内　メキシコ	262,181,945	2.06
	内　インドネシア	168,091,195	1.32
	内　タイ	159,856,533	1.26
	内　マレーシア	155,567,620	1.23
	内　ポーランド	108,167,930	0.85
	内　トルコ	88,042,828	0.69
	内　フィリピン	59,565,360	0.47
	内　ギリシャ	56,152,861	0.44
	内　チリ	52,157,460	0.41
	内　バミューダ	34,078,137	0.27
	内　ハンガリー	26,994,415	0.21
	内　チェコ	18,411,290	0.15
	内　コロンビア	10,960,272	0.09
	内　ペルー	6,321,007	0.05
	内　オランダ	3,661,828	0.03
	内　ロシア	1,652	0.00
	内　カザフスタン	29	0.00
	内　イギリス	20	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		751,485,297	5.92
	内　アメリカ	751,485,297	5.92
投資証券		9,934,317	0.08
	内　メキシコ	9,934,317	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,700,663,725	13.39
純資産総額		12,696,945,987	100.00

その他資産の投資状況

2024年5月31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）		1,673,512,980	13.18
	内　アメリカ	1,673,512,980	13.18

（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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		30,287,456,000	98.43
	内　日本	30,287,456,000	98.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		482,930,261	1.57
純資産総額		30,770,386,261	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

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		12,271,463,122	95.56
	内　アメリカ	9,454,812,193	73.63
	内　オーストラリア	950,108,413	7.40
	内　イギリス	647,976,187	5.05
	内　シンガポール	392,965,382	3.06
	内　フランス	244,725,707	1.91
	内　カナダ	167,623,228	1.31
	内　ベルギー	152,004,046	1.18
	内　香港	124,122,832	0.97
	内　スペイン	60,586,575	0.47
	内　ニュージーランド	35,090,277	0.27
	内　オランダ	20,933,285	0.16
	内　イスラエル	11,229,023	0.09
	内　ドイツ	5,149,171	0.04
	内　アイルランド	3,757,136	0.03
	内　イタリア	379,667	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		569,992,567	4.44
純資産総額		12,841,455,689	100.00

その他資産の投資状況

2024年5月31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）		555,894,129	4.33
	内　アメリカ	490,232,563	3.82
	内　ドイツ	65,661,566	0.51

（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

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		50,421,824,750	82.43
	内　日本	50,421,824,750	82.43
地方債証券		3,121,830,054	5.10
	内　日本	3,121,830,054	5.10
特殊債券		4,436,705,567	7.25
	内　日本	4,436,705,567	7.25
社債券		2,661,903,100	4.35
	内　日本	2,565,975,900	4.19
	内　フランス	95,927,200	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		526,529,850	0.86
純資産総額		61,168,793,321	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

2024年5月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		84,025,884,924	98.56
	内　アメリカ	39,621,405,094	46.47
	内　中国	7,781,547,833	9.13
	内　フランス	6,667,942,037	7.82
	内　イタリア	6,102,766,607	7.16
	内　ドイツ	5,148,174,339	6.04
	内　イギリス	4,329,004,739	5.08
	内　スペイン	4,082,325,830	4.79
	内　カナダ	1,712,973,350	2.01
	内　ベルギー	1,477,912,589	1.73
	内　オランダ	1,248,810,057	1.46
	内　オーストラリア	1,093,840,166	1.28
	内　オーストリア	974,201,766	1.14
	内　メキシコ	714,884,525	0.84
	内　ポーランド	446,385,265	0.52
	内　フィンランド	439,632,430	0.52
	内　アイルランド	425,355,428	0.50
	内　マレーシア	414,175,448	0.49
	内　シンガポール	349,098,144	0.41
	内　イスラエル	267,288,111	0.31
	内　デンマーク	220,451,264	0.26
	内　ニュージーランド	204,233,341	0.24
	内　スウェーデン	165,426,508	0.19
	内　ノルウェー	138,050,053	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,229,066,848	1.44
純資産総額		85,254,951,772	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2024年5月31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	21,927,658	1.6686 36,589,211	1.7711 38,836,075	－ －	25.12
2	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	41,771,394	0.9293 38,820,359	0.9067 37,874,122	－ －	24.50
3	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,536,547	3.8060 13,460,189	4.5403 16,056,984	－ －	10.39
4	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	9,473,908	1.5106 14,311,913	1.6781 15,898,165	－ －	10.28
5	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	10,496,120	1.3145 13,797,755	1.4911 15,650,764	－ －	10.12
6	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	4,712,511	2.8433 13,399,216	3.3142 15,618,203	－ －	10.10
7	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	8,055,339	1.8600 14,983,348	1.8215 14,672,799	－ －	9.49

（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

2024年5月31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

2024年5月31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	3,359,400	3,413.98 11,468,931,600	3,401.00 11,425,319,400	－ －	4.66
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	3,669,600	1,490.79 5,470,617,500	1,658.00 6,084,196,800	－ －	2.48
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	428,400	13,302.76 5,698,905,000	12,895.00 5,524,218,000	－ －	2.25

4	日立製作所 日本	株式 電気機器	297,000	12,339.93 3,664,962,000	16,145.00 4,795,065,000	－ －	1.96
5	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	129,500	34,641.61 4,486,089,000	33,630.00 4,355,085,000	－ －	1.78
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	422,000	8,081.67 3,410,465,800	10,290.00 4,342,380,000	－ －	1.77
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	61,200	69,062.43 4,226,621,000	70,690.00 4,326,228,000	－ －	1.76
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,242,900	3,131.66 3,892,350,700	3,303.00 4,105,298,700	－ －	1.67
9	三井物産 日本	株式 卸売業	484,800	6,405.08 3,105,185,800	7,970.00 3,863,856,000	－ －	1.58
10	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	453,000	5,920.21 2,681,857,600	7,948.00 3,600,444,000	－ －	1.47
11	任天堂 日本	株式 その他製品	386,300	8,255.85 3,189,237,400	8,555.00 3,304,796,500	－ －	1.35
12	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	435,100	6,608.65 2,875,423,900	7,410.00 3,224,091,000	－ －	1.32
13	信越化学工業 日本	株式 化学	549,600	6,118.67 3,362,825,200	5,855.00 3,217,908,000	－ －	1.31
14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	588,300	4,407.77 2,593,091,800	5,429.00 3,193,880,700	－ －	1.30
15	第一三共 日本	株式 医薬品	534,600	4,933.14 2,637,260,100	5,578.00 2,981,998,800	－ －	1.22
16	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	18,252,100	180.91 3,302,154,880	154.30 2,816,299,030	－ －	1.15
17	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	302,700	8,531.61 2,582,519,500	9,042.00 2,737,013,400	－ －	1.12
18	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	813,300	2,746.54 2,233,762,200	3,214.00 2,613,946,200	－ －	1.07
19	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,449,600	1,747.70 2,533,479,050	1,769.50 2,565,067,200	－ －	1.05
20	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	120,400	18,495.71 2,226,884,500	19,060.00 2,294,824,000	－ －	0.94
21	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	543,100	4,460.19 2,422,334,200	4,173.00 2,266,356,300	－ －	0.92
22	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	474,200	4,613.18 2,187,570,900	4,337.00 2,056,605,400	－ －	0.84
23	三菱電機 日本	株式 電気機器	687,800	2,318.13 1,594,414,400	2,730.00 1,877,694,000	－ －	0.77

24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	979,700	1,966.76 1,926,841,400	1,887.50 1,849,183,750	－ －	0.75
25	ディスコ 日本	株式 機械	29,800	44,420.63 1,323,735,000	61,490.00 1,832,402,000	－ －	0.75
26	ダイキン工業 日本	株式 機械	73,800	21,467.03 1,584,267,000	22,945.00 1,693,341,000	－ －	0.69
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	556,600	2,955.52 1,645,047,900	2,966.50 1,651,153,900	－ －	0.67
28	丸紅 日本	株式 卸売業	536,900	2,474.32 1,328,464,600	3,060.00 1,642,914,000	－ －	0.67
29	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	366,100	3,917.40 1,434,160,900	4,452.00 1,629,877,200	－ －	0.66
30	住友商事 日本	株式 卸売業	391,800	3,581.11 1,403,082,800	4,081.00 1,598,935,800	－ －	0.65

（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

2024年5月31日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	電気機器	16.94
		輸送用機器	8.61
		銀行業	7.86
		卸売業	7.62
		情報・通信業	6.69
		機械	5.47
		化学	5.43
		サービス業	4.28
		医薬品	4.21
		小売業	3.95
		食料品	3.04
		保険業	2.97
		その他製品	2.33
		陸運業	2.24
		精密機器	2.18
		建設業	1.99
		不動産業	1.91
		電気・ガス業	1.54
		その他金融業	1.14
		証券、商品先物取引業	0.93
		鉄鋼	0.87
		非鉄金属	0.78
		海運業	0.76
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.67
		石油・石炭製品	0.54
		金属製品	0.51
		空運業	0.37
		繊維製品	0.36
		鉱業	0.34
		パルプ・紙	0.15
		倉庫・運輸関連業	0.13
		水産・農林業	0.08
	小計		97.55
合　計（対純資産総額比）			97.55

（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

2024年5月31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	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	748,174	65,863.71 49,277,519,405	64,995.37 48,627,850,293	－ －	4.67
2	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	1,556,491	29,760.22 46,321,520,502	29,982.79 46,667,949,949	－ －	4.48
3	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	261,731	144,951.58 37,938,323,188	173,197.69 45,331,207,218	－ －	4.35
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	985,533	28,949.87 28,531,060,114	28,106.61 27,699,998,374	－ －	2.66
5	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	235,196	73,967.17 17,396,783,314	73,205.41 17,217,621,256	－ －	1.65
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	626,461	27,595.64 17,287,594,986	26,976.52 16,899,738,572	－ －	1.62
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	546,590	27,788.43 15,188,880,468	27,203.79 14,869,321,981	－ －	1.43
8	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	85,505	120,689.80 10,319,581,349	127,752.50 10,923,477,888	－ －	1.05
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	47,126	218,697.75 10,306,350,383	213,805.89 10,075,816,805	－ －	0.97
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	306,332	32,098.78 9,832,884,884	31,242.98 9,570,725,835	－ －	0.92
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	138,893	65,351.17 9,076,820,832	64,045.53 8,895,475,992	－ －	0.85

12	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	481,039	18,752.37 9,020,623,044	17,866.79 8,594,624,045	－ －	0.83
13	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・自動車部品	303,173	27,815.08 8,432,781,370	28,023.54 8,495,982,087	－ －	0.82
14	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	98,011	82,230.50 8,059,494,143	75,493.82 7,399,224,890	－ －	0.71
15	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	345,799	20,559.10 7,109,318,987	20,868.64 7,216,356,226	－ －	0.69
16	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サービス	167,723	43,902.87 7,363,521,735	42,523.56 7,132,179,389	－ －	0.68
17	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	42,717	144,822.33 6,186,375,897	149,576.17 6,389,445,681	－ －	0.61
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	249,756	26,275.89 6,562,562,081	25,482.78 6,364,479,499	－ －	0.61
19	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 金融サービス	88,735	72,142.71 6,401,584,241	69,294.75 6,148,869,996	－ －	0.59
20	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	47,019	124,735.25 5,864,927,161	127,796.39 6,008,858,536	－ －	0.58
21	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	255,088	24,238.27 6,182,892,736	22,771.18 5,808,656,600	－ －	0.56
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	105,464	53,951.47 5,689,938,401	51,595.67 5,441,486,078	－ －	0.52

23	MERCK & CO INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	268,522	20,562.72 5,521,542,860	19,518.83 5,241,235,860	－ －	0.50
24	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	470,711	10,133.24 4,769,828,004	10,170.85 4,787,535,022	－ －	0.46
25	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディア・娯楽	46,379	97,351.21 4,515,051,954	101,514.22 4,708,128,398	－ －	0.45
26	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネルギー	189,466	25,496.89 4,830,794,859	24,805.67 4,699,831,526	－ －	0.45
27	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	282,921	16,773.23 4,745,499,570	16,342.70 4,623,694,158	－ －	0.44
28	ABBVIE INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	187,093	26,084.67 4,880,259,313	24,500.02 4,583,784,000	－ －	0.44
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	754,674	6,158.31 4,647,519,912	6,054.86 4,569,450,094	－ －	0.44
30	ADVANCED MICRO DEVICES INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	171,186	25,779.02 4,413,008,652	26,136.39 4,474,184,914	－ －	0.43

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年5月31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	9.20
		半導体・半導体製造装置	9.07
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.66
		資本財	6.96
		メディア・娯楽	6.45
		金融サービス	6.41
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.95
		銀行	5.47
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.65
		エネルギー	4.47
		ヘルスケア機器・サービス	3.93
		素材	3.76
		食品・飲料・タバコ	3.14
		保険	2.99
		公益事業	2.59
		消費者サービス	1.85
		生活必需品流通・小売り	1.72
		運輸	1.55
		家庭用品・パーソナル用品	1.55
		自動車・自動車部品	1.54
		商業・専門サービス	1.52
		耐久消費財・アパレル	1.39
		電気通信サービス	1.08
		不動産管理・開発	0.28
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.03
		その他	0.03
	小計		95.24
投資証券	外国		1.75
	小計		1.75
合　計（対純資産総額比）			96.98

（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

2024年5月31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	237,000	2,841.56 673,450,658	4,045.69 958,830,046	－ －	7.55
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	64,000	6,288.18 402,444,154	7,378.40 472,217,600	－ －	3.72
3	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	68,249	6,278.61 428,509,313	6,266.46 427,679,983	－ －	3.37

4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	45,972	8,262.29 379,834,165	8,364.29 384,523,599	－ －	3.03
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	157,500	1,467.56 231,140,794	1,529.81 240,945,862	－ －	1.90
6	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネルギー	29,511	4,540.79 134,003,254	5,385.93 158,944,268	－ －	1.25
7	PDD HOLDINGS INC(ADR) アメリカ	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	5,841	18,695.66 109,201,363	23,829.18 139,186,253	－ －	1.10
8	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	63,122	2,343.25 147,911,202	2,173.98 137,226,205	－ －	1.08
9	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	5,321	15,041.59 80,036,316	22,270.65 118,502,181	－ －	0.93
10	MEITUAN-B 香港	株式 消費者サービス	50,660	2,066.73 104,700,592	2,183.44 110,613,323	－ －	0.87
11	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	50,548	1,763.02 89,117,458	2,104.89 106,398,131	－ －	0.84
12	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	124,200	494.46 61,413,048	852.10 105,831,652	－ －	0.83
13	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	939,000	91.30 85,735,800	112.28 105,430,920	－ －	0.83
14	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	35,767	2,766.19 98,938,377	2,619.12 93,678,258	－ －	0.74

15	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	15,000	4,466.96 67,004,452	6,227.86 93,417,930	－ －	0.74
16	ISHARES MSCI KUWAIT ETF アメリカ	投資信託受益証券 －	17,879	4,747.33 84,877,601	5,196.08 92,900,851	－ －	0.73
17	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	32,329	2,754.25 89,042,237	2,697.88 87,219,778	－ －	0.69
18	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	27,610	2,837.18 78,334,695	2,863.06 79,049,266	－ －	0.62
19	VALE SA ブラジル	株式 素材	33,654	2,214.81 74,537,302	1,903.42 64,057,791	－ －	0.50
20	TATA CONSULTANCY SVCS LTD インド	株式 ソフトウェア・サービス	8,913	6,704.38 59,756,163	7,061.22 62,936,734	－ －	0.50
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	8,359	6,616.53 55,307,624	6,919.03 57,836,255	－ －	0.46
22	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 電気通信サービス	22,202	1,827.18 40,567,171	2,602.81 57,787,665	－ －	0.46
23	NASPERS LTD-N SHS 南アフリカ	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	1,807	28,189.65 50,938,710	31,913.46 57,667,640	－ －	0.45
24	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	70,500	753.32 53,109,647	807.01 56,894,381	－ －	0.45
25	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	629,000	75.54 47,516,761	89.62 56,373,181	－ －	0.44
26	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	156,200	314.49 49,124,607	354.88 55,433,037	－ －	0.44
27	NETEASE INC 香港	株式 メディア・娯楽	19,300	3,585.84 69,206,736	2,800.98 54,059,010	－ －	0.43

28	BANK OF CHINA LTD - H 中国	株式 銀行	725,000	56.87 41,231,885	74.38 53,929,487	－ －	0.42
29	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	2,117.19 46,910,761	2,273.66 50,377,706	－ －	0.40
30	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR ブラジル	株式 エネルギー	44,100	1,100.92 48,550,822	1,136.21 50,107,063	－ －	0.39

（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

2024年5月31日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	銀行	11.81
		半導体・半導体製造装置	10.71
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.59
		素材	5.52
		メディア・娯楽	5.50
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.64
		エネルギー	4.17
		資本財	3.99
		自動車・自動車部品	3.33
		食品・飲料・タバコ	2.67
		金融サービス	2.37
		公益事業	2.32
		保険	2.22
		消費者サービス	2.15
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.87
		ソフトウェア・サービス	1.87
		電気通信サービス	1.80
		運輸	1.65
		生活必需品流通・小売り	1.13
		耐久消費財・アパレル	0.98
		不動産管理・開発	0.96
		家庭用品・パーソナル用品	0.66
		ヘルスケア機器・サービス	0.63
		商業・専門サービス	0.07
	小計		80.61
投資信託受益証券	外国		5.92
	小計		5.92
投資証券	外国		0.08
	小計		0.08
合　計（対純資産総額比）			86.61

（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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2024年5月31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	3,547	599,883.49 2,127,786,755	587,000.00 2,082,089,000	－ －	6.77
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,123	534,906.55 1,670,513,158	518,000.00 1,617,714,000	－ －	5.26
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	9,832	155,460.36 1,528,486,335	147,700.00 1,452,186,400	－ －	4.72
4	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	5,296	265,369.93 1,405,399,183	259,200.00 1,372,723,200	－ －	4.46
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	14,573	94,099.67 1,371,314,633	92,500.00 1,348,002,500	－ －	4.38
6	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	10,212	134,193.56 1,370,384,691	130,500.00 1,332,666,000	－ －	4.33
7	ＫＤＸ不動産投資法人 日本	投資証券	8,749	158,869.35 1,389,948,030	151,500.00 1,325,473,500	－ －	4.31
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,583	265,843.16 1,218,359,216	248,800.00 1,140,250,400	－ －	3.71
9	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	14,721	71,387.09 1,050,889,383	68,300.00 1,005,444,300	－ －	3.27
10	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,058	168,965.89 1,023,595,406	159,400.00 965,645,200	－ －	3.14
11	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	2,983	342,965.57 1,023,066,306	323,500.00 965,000,500	－ －	3.14
12	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	6,801	151,484.75 1,030,247,832	139,900.00 951,459,900	－ －	3.09
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	10,178	84,478.86 859,825,901	78,200.00 795,919,600	－ －	2.59
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	9,136	81,796.96 747,297,097	81,900.00 748,238,400	－ －	2.43
15	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	5,538	131,875.34 730,325,648	125,400.00 694,465,200	－ －	2.26
16	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,079	344,448.48 716,108,397	328,500.00 682,951,500	－ －	2.22
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	1,050	668,977.13 702,425,996	635,000.00 666,750,000	－ －	2.17
18	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,595	399,434.67 637,098,307	369,000.00 588,555,000	－ －	1.91
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,886	156,175.26 606,897,067	147,700.00 573,962,200	－ －	1.87
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	1,265	454,403.38 574,820,281	441,000.00 557,865,000	－ －	1.81

21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	1,941	280,663.74 544,768,336	271,600.00 527,175,600	－ －	1.71
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,128	457,993.95 516,617,184	447,500.00 504,780,000	－ －	1.64
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,729	136,592.87 509,354,847	133,200.00 496,702,800	－ －	1.61
24	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,495	343,944.27 514,196,697	321,000.00 479,895,000	－ －	1.56
25	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,575	136,980.93 489,706,836	130,900.00 467,967,500	－ －	1.52
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	4,477	106,695.22 477,674,533	103,900.00 465,160,300	－ －	1.51
27	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,845	152,677.35 434,367,076	144,400.00 410,818,000	－ －	1.34
28	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	5,860	72,690.33 425,965,349	70,000.00 410,200,000	－ －	1.33
29	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	1,050	401,448.17 421,520,585	383,000.00 402,150,000	－ －	1.31
30	ＮＴＴ都市開発リート投資法人 日本	投資証券	3,082	122,487.07 377,505,165	117,200.00 361,210,400	－ －	1.17

（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

2024年5月31日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
投資証券	国内		98.43
	小計		98.43
合　計（対純資産総額比）			98.43

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

2024年5月31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	55,526	17,588.93 976,642,979	16,860.52 936,197,333	－ －	7.29
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	5,643	121,956.47 688,200,404	119,221.14 672,764,928	－ －	5.24
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	33,257	13,936.59 463,489,426	16,010.99 532,477,527	－ －	4.15
4	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	19,573	19,793.25 387,413,364	23,266.48 455,394,922	－ －	3.55
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	18,208	21,255.59 387,021,864	22,576.82 411,078,913	－ －	3.20

6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	50,004	8,358.46 417,956,750	8,111.29 405,597,195	－ －	3.16
7	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	9,508	41,209.50 391,819,937	42,043.93 399,753,758	－ －	3.11
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	104,049	2,535.04 263,768,894	3,551.94 369,575,961	－ －	2.88
9	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	12,710	20,629.71 262,203,668	22,206.92 282,249,993	－ －	2.20
10	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	62,450	4,524.89 282,579,550	4,398.12 274,662,868	－ －	2.14
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	8,546	27,033.56 231,028,830	29,777.46 254,478,217	－ －	1.98
12	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	17,566	10,080.81 177,079,598	12,482.77 219,272,401	－ －	1.71
13	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	20,810	8,923.03 185,688,257	10,015.68 208,426,425	－ －	1.62
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	24,237	7,041.68 170,669,320	7,680.25 186,146,461	－ －	1.45
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	34,705	5,276.89 183,134,547	5,333.86 185,111,687	－ －	1.44
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	9,543	16,834.39 160,650,611	18,228.86 173,958,030	－ －	1.35
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	3,884	34,137.29 132,589,273	40,062.74 155,603,697	－ －	1.21
18	SEGRO PLC イギリス	投資証券	80,269	1,665.43 133,682,763	1,825.63 146,541,739	－ －	1.14
19	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	7,049	19,383.51 136,634,399	20,354.25 143,477,153	－ －	1.12
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	7,537	19,357.32 145,896,148	18,474.94 139,245,651	－ －	1.08
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	42,333	2,659.46 112,583,230	3,042.32 128,790,676	－ －	1.00
22	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証券	42,455	2,770.70 117,630,125	2,791.53 118,514,805	－ －	0.92
23	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証券	40,061	2,969.23 118,950,395	2,954.54 118,362,187	－ －	0.92
24	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	13,060	8,981.01 117,292,054	8,789.97 114,797,128	－ －	0.89
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIE アメリカ	投資証券	16,043	7,127.96 114,353,867	6,940.44 111,345,594	－ －	0.87
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	11,211	10,797.30 121,048,562	9,811.92 110,001,479	－ －	0.86
27	UDR INC アメリカ	投資証券	18,160	5,291.44 96,092,554	5,935.74 107,793,107	－ －	0.84
28	AMERICAN HOMES 4 RENT- A アメリカ	投資証券	19,170	5,653.48 108,377,278	5,587.78 107,117,761	－ －	0.83

29	LINK REIT 香港	投資証券	155,100	788.80 122,343,250	680.69 105,576,182	－ －	0.82
30	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	6,460	14,084.37 90,985,037	15,832.30 102,276,705	－ －	0.80

（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。

種類別及び業種別投資比率

2024年5月31日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
投資証券	外国		95.56
	小計		95.56
合　計（対純資産総額比）			95.56

（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。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2024年5月31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３７１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	563,000,000	95.87 539,779,200	95.10 535,418,630	0.4 2033/6/20	0.88
2	第３４５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	529,000,000	99.56 526,719,860	99.18 524,662,200	0.1 2026/12/20	0.86
3	第３７２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	526,000,000	100.55 528,926,990	98.25 516,826,560	0.8 2033/9/20	0.84
4	第３４４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	512,000,000	99.62 510,082,740	99.29 508,385,280	0.1 2026/9/20	0.83
5	第３７３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	528,000,000	97.92 517,065,430	96.13 507,598,080	0.6 2033/12/20	0.83
6	第３７０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	526,000,000	98.27 516,928,940	96.23 506,169,800	0.5 2033/3/20	0.83
7	第３４２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	494,000,000	99.79 493,003,900	99.55 491,796,760	0.1 2026/3/20	0.80
8	第３４０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	484,000,000	100.41 485,984,400	100.18 484,876,040	0.4 2025/9/20	0.79
9	第３４３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	484,000,000	99.77 482,933,090	99.40 481,100,840	0.1 2026/6/20	0.79
10	第１４９回　利付国債（５年） 日本	国債証券	479,000,000	99.49 476,571,120	99.07 474,578,830	0.005 2026/9/20	0.78
11	第１４７回　利付国債（５年） 日本	国債証券	469,000,000	99.57 467,016,720	99.38 466,110,960	0.005 2026/3/20	0.76
12	第３４１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	465,000,000	100.23 466,106,700	99.99 464,962,800	0.3 2025/12/20	0.76
13	第３４７回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	467,000,000	99.38 464,131,700	98.93 462,017,110	0.1 2027/6/20	0.76
14	第３５１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	470,000,000	98.82 464,492,220	98.23 461,718,600	0.1 2028/6/20	0.75
15	第３６９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	478,000,000	98.54 471,028,440	96.51 461,356,040	0.5 2032/12/20	0.75

16	第１４５回　利付国債（５年） 日本	国債証券	459,000,000	99.95 458,770,500	99.79 458,045,280	0.1 2025/9/20	0.75
17	第１４８回　利付国債（５年） 日本	国債証券	452,000,000	99.55 449,988,630	99.20 448,420,160	0.005 2026/6/20	0.73
18	第３５０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	431,000,000	99.18 427,487,350	98.43 424,263,470	0.1 2028/3/20	0.69
19	第３５３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	431,000,000	98.45 424,343,570	97.78 421,457,660	0.1 2028/12/20	0.69
20	第１４６回　利付国債（５年） 日本	国債証券	422,000,000	99.88 421,510,480	99.68 420,666,480	0.1 2025/12/20	0.69
21	第３６６回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	442,000,000	97.01 428,791,780	95.07 420,227,080	0.2 2032/3/20	0.69
22	第１５０回　利付国債（５年） 日本	国債証券	423,000,000	99.44 420,665,040	98.94 418,520,430	0.005 2026/12/20	0.68
23	第５回　電通グループ 日本	社債券	400,000,000	99.37 397,514,000	98.81 395,274,000	0.32 2027/7/8	0.65
24	第３６８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	413,000,000	96.48 398,466,530	94.41 389,921,560	0.2 2032/9/20	0.64
25	第３５４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	395,000,000	98.43 388,813,250	97.53 385,255,350	0.1 2029/3/20	0.63
26	第３６５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	398,000,000	96.50 384,070,000	94.64 376,691,080	0.1 2031/12/20	0.62
27	第１５３回　利付国債（５年） 日本	国債証券	379,000,000	99.19 375,943,120	98.64 373,872,130	0.005 2027/6/20	0.61
28	第３６４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	392,000,000	96.78 379,385,440	95.00 372,435,280	0.1 2031/9/20	0.61
29	第３６２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	384,000,000	97.41 374,085,120	95.67 367,384,320	0.1 2031/3/20	0.60
30	第３６３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	384,000,000	97.12 372,956,160	95.36 366,190,080	0.1 2031/6/20	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

2024年5月31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	82.43
		特殊債券	7.25
		地方債証券	5.10
		社債券	4.19
	小計		98.98
	外国	社債券	0.16
	小計		0.16
合　計（対純資産総額比）			99.14

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2024年5月31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	1,876,177,800	94.58 1,774,559,182	94.48 1,772,762,879	1.625 2026/2/15	2.08
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,791,538,200	96.11 1,722,025,781	96.03 1,720,575,371	2.25 2025/11/15	2.02
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,454,547,200	92.19 1,340,965,559	91.65 1,333,179,781	2.625 2029/2/15	1.56
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,274,296,200	93.90 1,196,589,617	93.64 1,193,352,905	2.25 2027/2/15	1.40
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,247,650,400	93.72 1,169,372,813	93.50 1,166,640,459	2 2026/11/15	1.37
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,206,898,000	96.36 1,163,038,997	96.33 1,162,713,464	2 2025/8/15	1.36
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,169,280,400	97.12 1,135,710,359	97.14 1,135,885,751	2.125 2025/5/15	1.33
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,144,202,000	93.80 1,073,289,297	93.31 1,067,723,538	2.875 2028/8/15	1.25
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,111,286,600	94.00 1,044,679,952	93.87 1,043,175,844	1.625 2026/5/15	1.22
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,103,449,600	93.12 1,027,620,543	92.96 1,025,855,024	1.5 2026/8/15	1.20
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,017,242,600	92.59 941,929,108	92.25 938,477,505	2.25 2027/11/15	1.10
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	981,192,400	94.06 923,007,690	93.63 918,749,315	2.875 2028/5/15	1.08
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	938,872,600	93.89 881,510,258	93.48 877,733,216	2.75 2028/2/15	1.03
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	876,176,600	94.52 828,236,652	94.01 823,702,383	3.125 2028/11/15	0.97
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	865,204,800	93.04 805,038,458	92.71 802,165,978	2.25 2027/8/15	0.94
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	755,486,800	97.49 736,539,191	97.47 736,418,313	2.75 2025/6/30	0.86
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	880,878,800	81.19 715,248,444	80.47 708,896,023	1.125 2031/2/15	0.83

18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	868,339,600	80.24 696,764,770	79.58 691,068,070	0.875 2030/11/15	0.81
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	730,408,400	93.82 685,283,706	93.53 683,158,280	2.375 2027/5/15	0.80
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	808,778,400	79.41 642,268,560	78.87 637,891,611	0.625 2030/8/15	0.75
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	634,797,000	90.75 576,090,048	90.26 572,974,120	2.375 2029/5/15	0.67
22	WI TREASURY SEC. アメリカ	国債証券	699,060,400	80.13 560,177,176	79.57 556,270,322	0.625 2030/5/15	0.65
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	609,718,600	85.26 519,876,564	84.67 516,303,613	1.5 2030/2/15	0.61
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	584,640,200	87.04 508,929,294	86.51 505,801,469	1.625 2029/8/15	0.59
25	CHINA GOVERNMENT BOND 中国	国債証券	462,314,900	100.57 464,959,341	100.58 465,014,819	2.22 2025/9/25	0.55
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	470,220,000	98.03 460,998,985	97.98 460,721,556	3.5 2025/9/15	0.54
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	520,376,800	87.31 454,372,206	86.71 451,260,353	1.75 2029/11/15	0.53
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	432,602,400	96.60 417,920,846	95.63 413,740,935	4 2034/2/15	0.49
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	404,389,200	100.51 406,471,804	99.51 402,427,912	4.5 2033/11/15	0.47
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	404,389,200	95.40 385,811,560	95.28 385,306,073	2.25 2026/3/31	0.45

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年5月31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	98.56
	小計		98.56
合　計（対純資産総額比）			98.56

（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】

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。

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。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】
該当事項はありません。

（参考）
ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2024年5月31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　０６０６月	買建	213	5,826,372,150	5,904,360,000	2.41

（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

2024年5月31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 202406	買建	534	22,293,049,478	21,983,584,374	2.11
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 202406	買建	645	5,541,133,289	5,467,739,433	0.52
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE 202406	買建	133	2,235,171,499	2,188,760,577	0.21

（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

2024年5月31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 202406	買建	200	1,664,373,470	1,673,512,980	13.18

（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

2024年5月31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 202406	買建	96	495,177,584	490,232,563	3.82
	ＥＵＲＥＸ取引所	THE STOXX 600 REAL ESTATE INDEX FUTURE 202406	買建	59	65,142,548	65,661,566	0.51

（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。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2024年5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(2018年11月20日)	10,387,974	10,387,974	0.9908	0.9908
第2計算期間末(2019年11月20日)	18,417,924	18,417,924	1.0701	1.0701
第3計算期間末(2020年11月20日)	31,744,500	31,744,500	1.0747	1.0747
第4計算期間末(2021年11月22日)	80,142,944	80,142,944	1.2395	1.2395
第5計算期間末(2022年11月21日)	116,288,349	116,288,349	1.2237	1.2237
第6計算期間末(2023年11月20日)	135,074,579	135,074,579	1.3119	1.3119
2023年5月末日	119,003,468	－	1.2472	－
6月末日	125,596,868	－	1.2949	－
7月末日	127,546,785	－	1.2927	－
8月末日	129,798,669	－	1.3035	－
9月末日	128,828,282	－	1.2811	－
10月末日	127,538,776	－	1.2540	－
11月末日	135,154,086	－	1.3093	－
12月末日	138,054,829	－	1.3219	－
2024年1月末日	142,025,212	－	1.3417	－
2月末日	146,414,763	－	1.3640	－
3月末日	150,658,288	－	1.3965	－
4月末日	153,240,413	－	1.4048	－
5月末日	154,605,562	－	1.4044	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
2023年11月21日～2024年5月20日	－

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	△0.9
第2計算期間	8.0
第3計算期間	0.4
第4計算期間	15.3
第5計算期間	△1.3
第6計算期間	7.2
2023年11月21日～2024年5月20日	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】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	16,395,406	5,910,777	10,484,629
第2計算期間	10,576,235	3,849,753	17,211,111
第3計算期間	18,571,996	6,244,753	29,538,354
第4計算期間	41,355,325	6,238,662	64,655,017
第5計算期間	38,537,601	8,160,088	95,032,530
第6計算期間	27,258,274	19,328,119	102,962,685
2023年11月21日～2024年5月20日	14,859,289	6,969,967	110,852,007

（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

2024年5月末現在

●基準価額・純資産の推移

基準価額	14,044円
純資産総額	154百万円

・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。

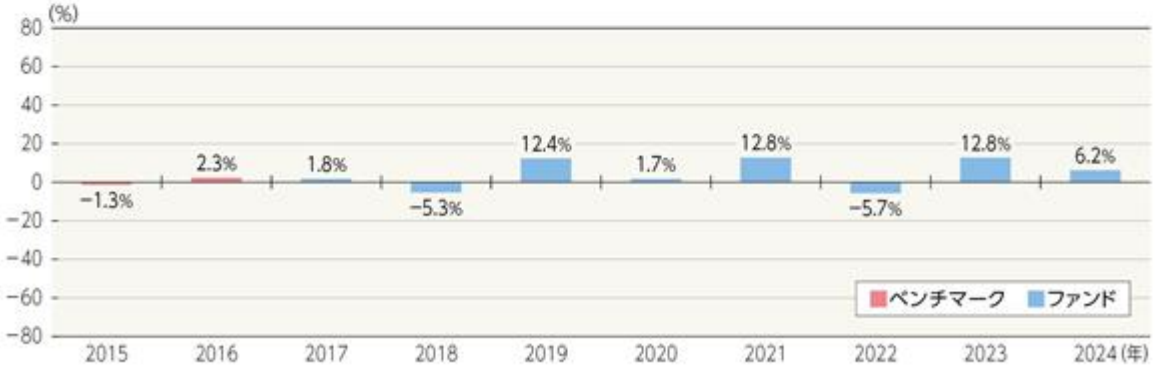
●分配の推移 1万口当り(税引前)

2019年11月	0円
2020年11月	0円
2021年11月	0円
2022年11月	0円
2023年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

●資産別組入比率

・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●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。
・2017年はファンド設定時から年末まで、2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。
・2016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

2024年5月末現在

●マザーファンドの状況

1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	4.8%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.5%
3	ソニーグループ	2.3%
4	日立製作所	2.0%
5	東京エレクトロン	1.8%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.4%
2	輸送用機器	8.8%
3	銀行業	8.1%
4	卸売業	7.8%
5	情報・通信業	6.9%

・比率は対組入株式評価額比です。

2.ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	マイクロソフト	情報技術	4.8%
2	アップル	情報技術	4.6%
3	エヌビディア	情報技術	4.5%
4	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.7%
5	メタ・プラットフォームズ	コミュニケーション・サービス	1.7%

・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。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	75.3%
2	イギリス	4.2%
3	フランス	3.3%
4	カナダ	3.2%
5	スイス	2.6%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入株式等評価額比です。

3.ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	台湾セミコンダクター（TSMC）	情報技術	8.7%
2	騰訊控股［テンセント・ホールディングス］	コミュニケーション・サービス	4.3%
3	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	3.9%
4	サムスン電子	情報技術	3.5%
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	2.2%

・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。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	中国	27.1%
2	台湾	18.0%
3	インド	18.0%
4	韓国	11.6%
5	その他	6.8%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。「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。

4.ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	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	5.3%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	4.8%
4	日本プロロジスリート投資法人	4.5%
5	日本都市ファンド投資法人	4.5%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.4%
短期金融資産等	1.6%

・比率は対純資産総額比です。

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

5. ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	7.6%
2	EQUINIX INC	アメリカ	5.5%
3	WELLTOWER INC	アメリカ	4.3%
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.7%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.3%

・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。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	77.0%
2	オーストラリア	7.7%
3	イギリス	5.3%
4	シンガポール	3.2%
5	フランス	2.0%

・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。

6. ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第371回　利付国債(10年)	2033/06/20	0.400%	0.9%
2	第345回　利付国債(10年)	2026/12/20	0.100%	0.9%
3	第372回　利付国債(10年)	2033/09/20	0.800%	0.9%
4	第344回　利付国債(10年)	2026/09/20	0.100%	0.8%
5	第373回　利付国債(10年)	2033/12/20	0.600%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入比率

種別	比率
債券	99.13%
債券先物	－
現金、その他	0.87%

・比率は対純資産総額比です。

7. ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	アメリカドル	2026/02/15	1.625%	2.1%
2	アメリカ国債	アメリカドル	2025/11/15	2.250%	2.0%
3	アメリカ国債	アメリカドル	2029/02/15	2.625%	1.6%
4	アメリカ国債	アメリカドル	2027/02/15	2.250%	1.4%
5	アメリカ国債	アメリカドル	2026/11/15	2.000%	1.4%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	47.2%
2	中国	9.3%
3	フランス	7.9%
4	イタリア	7.3%
5	ドイツ	6.1%

・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。
・比率は対組入債券評価額比です。

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

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。

○ 2024年11月5日以降は、原則として「午後3時30分」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する予定です。ただし、当該時刻は販売会社によって異なる場合があります。

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）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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、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 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

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。

○　2024年11月5日以降は、原則として「午後3時30分」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する予定です。ただし、当該時刻は販売会社によって異なる場合があります。

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

＜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。

⑤　信託財産留保額

ありません。

⑥　支払開始日

解約請求受付日または買取請求受付日から起算して、原則として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。
外国株式	金融商品取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価します。
国内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。
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。

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、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11月21日から翌年11月20日までとします。

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

（5）【その他】

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】

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6期計算期間（2022年11月22日から2023年11月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2022年11月21日現在	第6期 2023年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	532	4,548
コール・ローン	188,883	215,090
親投資信託受益証券	116,291,847	135,078,665
未収入金	25,870	223,818
流動資産合計	116,507,132	135,522,121
資産合計	116,507,132	135,522,121
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,731	214,422
未払受託者報酬	14,418	16,723
未払委託者報酬	180,703	209,515
その他未払費用	5,931	6,882
流動負債合計	218,783	447,542
負債合計	218,783	447,542
純資産の部		
元本等		
元本	95,032,530	102,962,685
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	21,255,819	32,111,894
（分配準備積立金）	6,558,867	13,333,689
元本等合計	116,288,349	135,074,579
純資産合計	116,288,349	135,074,579
負債純資産合計	116,507,132	135,522,121

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自　2021年11月23日 至　2022年11月21日	第6期 自　2022年11月22日 至　2023年11月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	△494,233	9,408,334
営業収益合計	△494,233	9,408,334
営業費用		
受託者報酬	26,352	32,477
委託者報酬	330,462	407,007
その他費用	10,837	13,379
営業費用合計	367,651	452,863
営業利益又は営業損失（△）	△861,884	8,955,471
経常利益又は経常損失（△）	△861,884	8,955,471
当期純利益又は当期純損失（△）	△861,884	8,955,471
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（△）	△53,433	354,048
期首剰余金又は期首欠損金（△）	15,487,927	21,255,819
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,499,869	6,549,367
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	8,499,869	6,549,367
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,923,526	4,294,715
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,923,526	4,294,715
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	21,255,819	32,111,894

（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6期 自　2022年11月22日 至　2023年11月20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11月20日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2022年11月22日から2023年11月20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5期 2022年11月21日現在	第6期 2023年11月20日現在
１．　期首元本額	64,655,017円	95,032,530円
期中追加設定元本額	38,537,601円	27,258,274円
期中一部解約元本額	8,160,088円	19,328,119円
２．　受益権の総数	95,032,530口	102,962,685口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第5期 自　2021年11月23日 至　2022年11月21日	第6期 自　2022年11月22日 至　2023年11月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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（14,696,952円）及び分配準備積立金（6,558,867円）より分配対象収益は21,255,819円（1万口当たり2,236.69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。	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（7,936,102円）、収益調整金（18,778,205円）及び分配準備積立金（5,397,587円）より分配対象収益は32,111,894円（1万口当たり3,118.79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5期 自　2021年11月23日 至　2022年11月21日	第6期 自　2022年11月22日 至　2023年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び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5期 2022年11月21日現在	第6期 2023年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
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5期 2022年11月21日現在	第6期 2023年11月20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	△550,550	8,571,135
合計	△550,550	8,571,135

（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5期 2022年11月21日現在	第6期 2023年11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2237円 (12,237円)	1.3119円 (13,119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11月20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	4,769,903	13,364,791	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	20,223,791	33,624,074	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	3,714,441	13,912,067	
	ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	7,006,300	13,115,092	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	35,730,073	33,221,821	
	ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド	9,414,551	14,003,203	
	ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド	10,602,726	13,837,617	
親投資信託受益証券　合計		91,461,785	135,078,665	
合計			135,078,665	

（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）

当ファンドは、「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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」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」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド」受益証券を主要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11月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	45,329,458
コール・ローン	2,143,716,858
株式	197,600,501,060
派生商品評価勘定	93,016,950
未収入金	68,190,746
未収配当金	1,780,853,535
差入委託証拠金	189,980,192
流動資産合計	201,921,588,799
資産合計	201,921,588,799
負債の部	
流動負債	
前受金	133,115,000
未払解約金	680,014,153
その他未払費用	2,801
流動負債合計	813,131,954
負債合計	813,131,954
純資産の部	
元本等	
元本	71,774,824,873
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	129,333,631,972
元本等合計	201,108,456,845
純資産合計	201,108,456,845
負債純資産合計	201,921,588,799

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11月22日 至　2023年11月20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11月20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	80,542,683,355円
同期中追加設定元本額	18,464,835,178円
同期中一部解約元本額	27,232,693,660円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイＴＯＰＩＸオープン	5,374,590,247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）	3,099,611,493円
ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	3,172,649円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,040,668,069円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,458,125,745円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	6,116,136,597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）	2,437,692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）	10,878,136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）	10,049,994円
ＤＣニッセイ国内株式インデックス	2,734,321,037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	24,643,648,889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）	3,377,354,321円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	353,302,002円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	227,959,293円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	410,483,123円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	635,103,845円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	40,891,710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）	121,182,140円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	9,858,104円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	13,124,731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）	4,769,903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）	10,024,955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）	27,338,395円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	278,873,319円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	179,525,613円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	355,141,819円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	200,556,897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）	13,903,403,991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）	25,064,068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）	49,914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）	108,841円
ＦＷニッセイ国内株インデックス	55,053,403円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	51,979,339円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	34,599円
計	71,774,824,873円
２．　受益権の総数	71,774,824,873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11月22日 至　2023年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	29,879,681,609
合計	29,879,681,609

（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11月20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11月20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	3,484,090,000	－	3,577,190,000	93,100,000
合計	3,484,090,000	－	3,577,190,000	93,100,000

（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11月20日現在
1口当たり純資産額	2.8019円
（1万口当たり純資産額）	(28,019円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年11月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,100	3,730.00	11,563,000	
ニッスイ	82,100	705.80	57,946,180	
マルハニチロ	12,200	2,733.50	33,348,700	
雪国まいたけ	7,000	934.00	6,538,000	
カネコ種苗	3,200	1,415.00	4,528,000	
サカタのタネ	9,300	4,015.00	37,339,500	
ホクト	6,600	1,736.00	11,457,600	
ショーボンドホールディングス	11,200	5,974.00	66,908,800	
ミライト・ワン	27,200	1,830.00	49,776,000	

タマホーム	5,200	3,630.00	18,876,000	
ファーストコーポレーション	1,300	753.00	978,900	
住石ホールディングス	8,300	632.00	5,245,600	
日鉄鉱業	3,300	5,370.00	17,721,000	
三井松島ホールディングス	4,900	2,760.00	13,524,000	
ＩＮＰＥＸ	303,600	2,097.00	636,649,200	
石油資源開発	9,500	5,590.00	53,105,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	3,700	2,177.00	8,054,900	
安藤・間	47,600	1,084.00	51,598,400	
東急建設	25,700	785.00	20,174,500	
コムシスホールディングス	26,200	3,184.00	83,420,800	
ビーアールホールディングス	14,900	352.00	5,244,800	
高松コンストラクショングループ	6,100	2,666.00	16,262,600	
東建コーポレーション	2,400	8,040.00	19,296,000	
ソネック	1,500	953.00	1,429,500	
ヤマウラ	4,400	1,424.00	6,265,600	
オリエンタル白石	30,400	327.00	9,940,800	
大成建設	53,700	5,375.00	288,637,500	
大林組	205,400	1,276.00	262,090,400	
清水建設	162,800	977.50	159,137,000	
飛島建設	5,900	1,288.00	7,599,200	
長谷工コーポレーション	52,700	1,811.50	95,466,050	
松井建設	7,000	768.00	5,376,000	
鹿島建設	127,300	2,284.50	290,816,850	
不動テトラ	4,000	2,063.00	8,252,000	
鉄建建設	4,100	1,981.00	8,122,100	
西松建設	11,000	3,686.00	40,546,000	
三井住友建設	42,700	399.00	17,037,300	
大豊建設	2,000	3,695.00	7,390,000	
佐田建設	2,100	615.00	1,291,500	
ナカノフドー建設	12,000	391.00	4,692,000	
奥村組	9,300	4,495.00	41,803,500	
東鉄工業	7,100	2,864.00	20,334,400	
淺沼組	4,200	3,650.00	15,330,000	
戸田建設	77,700	872.00	67,754,400	
熊谷組	9,600	3,460.00	33,216,000	
植木組	900	1,430.00	1,287,000	
矢作建設工業	7,800	1,268.00	9,890,400	
ピーエス三菱	7,300	932.00	6,803,600	
日本ハウスホールディングス	14,600	334.00	4,876,400	
大東建託	21,100	16,090.00	339,499,000	
新日本建設	8,100	1,102.00	8,926,200	
東亜道路工業	2,300	6,610.00	15,203,000	
日本道路	6,700	1,884.00	12,622,800	
東亜建設工業	4,400	3,690.00	16,236,000	
日本国土開発	16,300	600.00	9,780,000	
若築建設	2,000	2,929.00	5,858,000	
東洋建設	14,500	1,246.00	18,067,000	
五洋建設	81,400	798.70	65,014,180	
世紀東急工業	7,400	1,587.00	11,743,800	

福田組	2,200	5,150.00	11,330,000	
住友林業	49,600	3,804.00	188,678,400	
日本基礎技術	8,100	449.00	3,636,900	
巴コーポレーション	6,000	560.00	3,360,000	
大和ハウス工業	158,800	4,244.00	673,947,200	
ライト工業	11,800	1,961.00	23,139,800	
積水ハウス	174,200	3,021.00	526,258,200	
日特建設	5,500	1,025.00	5,637,500	
北陸電気工事	5,400	945.00	5,103,000	
ユアテック	12,700	965.00	12,255,500	
日本リーテック	4,500	1,259.00	5,665,500	
四電工	2,400	2,839.00	6,813,600	
中電工	8,900	2,397.00	21,333,300	
関電工	36,000	1,314.00	47,304,000	
きんでん	40,400	2,217.00	89,566,800	
東京エネシス	5,700	953.00	5,432,100	
トーエネック	1,900	4,035.00	7,666,500	
住友電設	5,500	2,527.00	13,898,500	
日本電設工業	10,800	1,979.00	21,373,200	
エクシオグループ	28,900	3,143.00	90,832,700	
新日本空調	3,700	2,175.00	8,047,500	
九電工	12,400	4,401.00	54,572,400	
三機工業	12,400	1,735.00	21,514,000	
日揮ホールディングス	56,800	1,660.50	94,316,400	
中外炉工業	2,600	2,150.00	5,590,000	
ヤマト	5,100	924.00	4,712,400	
太平電業	3,600	3,835.00	13,806,000	
高砂熱学工業	15,400	2,975.00	45,815,000	
三晃金属工業	1,000	4,675.00	4,675,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	22,900	2,150.00	49,235,000	
朝日工業社	2,700	2,719.00	7,341,300	
明星工業	11,100	1,113.00	12,354,300	
大氣社	6,600	4,240.00	27,984,000	
ダイダン	7,500	1,441.00	10,807,500	
日比谷総合設備	4,200	2,246.00	9,433,200	
ニップン	17,300	2,208.00	38,198,400	
日清製粉グループ本社	53,300	2,098.50	111,850,050	
日東富士製粉	1,100	4,690.00	5,159,000	
昭和産業	5,600	3,040.00	17,024,000	
中部飼料	8,000	1,054.00	8,432,000	
フィード・ワン	8,400	773.00	6,493,200	
日本甜菜製糖	3,400	1,972.00	6,704,800	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	5,700	3,005.00	17,128,500	
塩水港精糖	12,100	235.00	2,843,500	
ウェルネオシュガー	2,900	2,044.00	5,927,600	
ＬＩＦＵＬＬ	24,900	199.00	4,955,100	
ＭＩＸＩ	12,900	2,321.00	29,940,900	
ジェイエイシーリクルートメント	5,400	2,587.00	13,969,800	
日本M&Aセンターホールディングス	95,900	678.50	65,068,150	
メンバーズ	4,800	1,093.00	5,246,400	

ＵＴグループ	8,000	2,218.00	17,744,000	
アイティメディア	5,300	1,010.00	5,353,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	3,500	1,617.00	5,659,500	
オープンアップグループ	18,000	2,063.00	37,134,000	
コシダカホールディングス	18,000	1,070.00	19,260,000	
パソナグループ	7,300	2,266.00	16,541,800	
リンクアンドモチベーション	17,300	523.00	9,047,900	
エス・エム・エス	21,100	2,667.50	56,284,250	
パーソルホールディングス	612,800	245.50	150,442,400	
クックパッド	49,100	132.00	6,481,200	
森永製菓	12,300	5,373.00	66,087,900	
中村屋	1,800	3,065.00	5,517,000	
江崎グリコ	16,500	4,080.00	67,320,000	
名糖産業	3,400	1,613.00	5,484,200	
井村屋グループ	3,400	2,291.00	7,789,400	
不二家	4,000	2,538.00	10,152,000	
山崎製パン	38,600	3,153.00	121,705,800	
モロゾフ	1,900	3,820.00	7,258,000	
亀田製菓	3,300	3,845.00	12,688,500	
寿スピリッツ	27,300	2,372.00	64,755,600	
カルビー	26,400	2,717.50	71,742,000	
森永乳業	10,500	5,456.00	57,288,000	
六甲バター	4,200	1,391.00	5,842,200	
ヤクルト本社	82,400	3,385.00	278,924,000	
明治ホールディングス	70,700	3,417.00	241,581,900	
雪印メグミルク	13,900	2,203.00	30,621,700	
プリマハム	7,700	2,214.00	17,047,800	
日本ハム	24,800	4,322.00	107,185,600	
林兼産業	2,300	586.00	1,347,800	
丸大食品	5,800	1,591.00	9,227,800	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,400	3,185.00	20,384,000	
柿安本店	2,200	2,457.00	5,405,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	8,800	3,895.00	34,276,000	
学情	3,200	1,837.00	5,878,400	
スタジオアリス	3,000	2,040.00	6,120,000	
クロスキャット	5,400	1,132.00	6,112,800	
シミックホールディングス	3,200	2,643.00	8,457,600	
システナ	88,900	265.00	23,558,500	
ＮＪＳ	2,000	2,675.00	5,350,000	
デジタルアーツ	3,700	4,555.00	16,853,500	
日鉄ソリューションズ	10,000	4,625.00	46,250,000	
綜合警備保障	100,500	845.90	85,012,950	
キューブシステム	5,100	1,082.00	5,518,200	
いちご	66,400	342.00	22,708,800	
日本駐車場開発	61,000	205.00	12,505,000	
コア	3,300	1,726.00	5,695,800	
カカクコム	39,800	1,658.50	66,008,300	
アイロムグループ	3,200	1,922.00	6,150,400	
セントケア・ホールディング	6,500	914.00	5,941,000	
ルネサンス	6,200	863.00	5,350,600	

ディップ	9,200	3,125.00	28,750,000	
ＳＢＳホールディングス	5,200	2,520.00	13,104,000	
デジタルホールディングス	5,300	1,130.00	5,989,000	
新日本科学	5,500	1,619.00	8,904,500	
ベネフィット・ワン	20,900	1,483.50	31,005,150	
エムスリー	118,900	2,394.00	284,646,600	
アウトソーシング	38,600	1,161.50	44,833,900	
ワールドホールディングス	2,700	2,620.00	7,074,000	
ディー・エヌ・エー	21,400	1,471.50	31,490,100	
博報堂ＤＹホールディングス	76,800	1,085.50	83,366,400	
ぐるなび	20,500	302.00	6,191,000	
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	412.00	5,603,200	
ライク	4,000	1,429.00	5,716,000	
エスプール	17,300	401.00	6,937,300	
ＷＤＢホールディングス	3,100	2,217.00	6,872,700	
手間いらず	2,700	2,660.00	7,182,000	
アドウェイズ	10,200	547.00	5,579,400	
バリューコマース	5,300	1,316.00	6,974,800	
インフォマート	62,500	451.00	28,187,500	
サッポロホールディングス	19,000	5,673.00	107,787,000	
アサヒグループホールディングス	133,200	5,525.00	735,930,000	
キリンホールディングス	240,200	2,167.00	520,513,400	
宝ホールディングス	39,400	1,163.00	45,822,200	
オエノンホールディングス	17,200	386.00	6,639,200	
養命酒製造	2,900	1,830.00	5,307,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	45,200	1,919.50	86,761,400	
サントリー食品インターナショナル	40,600	4,728.00	191,956,800	
ダイドーグループホールディングス	3,300	5,940.00	19,602,000	
伊藤園	19,500	4,830.00	94,185,000	
キーコーヒー	6,500	2,064.00	13,416,000	
日清オイリオグループ	8,100	4,285.00	34,708,500	
不二製油グループ本社	13,400	2,426.00	32,508,400	
Ｊ－オイルミルズ	6,600	1,931.00	12,744,600	
ローソン	13,200	7,260.00	95,832,000	
サンエー	4,700	4,520.00	21,244,000	
カワチ薬品	4,800	2,408.00	11,558,400	
エービーシー・マート	27,100	2,426.00	65,744,600	
ハードオフコーポレーション	3,700	1,500.00	5,550,000	
高千穂交易	1,700	3,185.00	5,414,500	
アスクル	12,800	2,019.00	25,843,200	
ゲオホールディングス	6,900	2,313.00	15,959,700	
アダストリア	7,500	3,490.00	26,175,000	
伊藤忠食品	1,400	7,140.00	9,996,000	
くら寿司	7,300	3,650.00	26,645,000	
キャンドゥ	2,200	2,485.00	5,467,000	
エレマテック	5,600	1,669.00	9,346,400	
パルグループホールディングス	12,200	2,136.00	26,059,200	
エディオン	24,500	1,465.00	35,892,500	

あらた	4,700	6,220.00	29,234,000	
サーラコーポレーション	13,000	723.00	9,399,000	
トーメンデバイス	1,100	4,870.00	5,357,000	
ハローズ	2,800	4,380.00	12,264,000	
ＪＰホールディングス	15,700	388.00	6,091,600	
フジオフードグループ本社	6,900	1,445.00	9,970,500	
あみやき亭	1,500	3,640.00	5,460,000	
東京エレクトロン　デバイス	6,200	4,540.00	28,148,000	
円谷フィールズホールディングス	10,600	1,187.00	12,582,200	
双日	69,000	3,049.00	210,381,000	
アルフレッサ　ホールディングス	62,200	2,458.50	152,918,700	
大黒天物産	1,900	6,350.00	12,065,000	
ハニーズホールディングス	4,900	1,605.00	7,864,500	
ファーマライズホールディングス	7,000	657.00	4,599,000	
キッコーマン	38,200	9,438.00	360,531,600	
味の素	137,000	5,633.00	771,721,000	
ブルドックソース	3,100	2,069.00	6,413,900	
キユーピー	31,000	2,522.00	78,182,000	
ハウス食品グループ本社	19,900	3,350.00	66,665,000	
カゴメ	24,800	3,181.00	78,888,800	
アリアケジャパン	5,700	4,735.00	26,989,500	
エバラ食品工業	1,900	2,851.00	5,416,900	
ニチレイ	26,400	3,207.00	84,664,800	
横浜冷凍	16,900	1,083.00	18,302,700	
東洋水産	29,100	7,932.00	230,821,200	
イートアンドホールディングス	2,800	1,988.00	5,566,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,300	1,131.00	5,994,300	
日清食品ホールディングス	20,300	14,505.00	294,451,500	
永谷園ホールディングス	2,800	2,165.00	6,062,000	
一正蒲鉾	3,300	731.00	2,412,300	
フジッコ	5,900	1,944.00	11,469,600	
ロック・フィールド	6,500	1,619.00	10,523,500	
日本たばこ産業	350,400	3,758.00	1,316,803,200	
ケンコーマヨネーズ	4,000	1,577.00	6,308,000	
わらべや日洋ホールディングス	3,900	3,370.00	13,143,000	
なとり	3,600	2,012.00	7,243,200	
ファーマフーズ	8,300	1,409.00	11,694,700	
北の達人コーポレーション	27,400	194.00	5,315,600	
ユーグレナ	35,900	783.00	28,109,700	
紀文食品	5,000	1,157.00	5,785,000	
ピックルスホールディングス	4,600	1,201.00	5,524,600	
ＳＲＥホールディングス	2,600	2,628.00	6,832,800	
ＡＤワークスグループ	20,100	232.00	4,663,200	
片倉工業	5,400	1,705.00	9,207,000	
グンゼ	4,200	4,770.00	20,034,000	
ヒューリック	134,500	1,427.00	191,931,500	
アルペン	5,100	1,898.00	9,679,800	
ラクーンホールディングス	7,800	717.00	5,592,600	
クオールホールディングス	8,500	1,623.00	13,795,500	
アルコニックス	8,200	1,310.00	10,742,000	

神戸物産	47,900	3,631.00	173,924,900	
ソリトンシステムズ	5,000	1,214.00	6,070,000	
ジンズホールディングス	3,700	4,470.00	16,539,000	
ビックカメラ	33,000	1,174.00	38,742,000	
ＤＣＭホールディングス	32,700	1,200.00	39,240,000	
ハイパー	4,500	349.00	1,570,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	87,800	1,473.00	129,329,400	
東京一番フーズ	8,200	508.00	4,165,600	
あい　ホールディングス	9,900	2,346.00	23,225,400	
ディーブイエックス	4,000	1,022.00	4,088,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	71,100	1,410.00	100,251,000	
ドトール・日レスホールディングス	11,000	2,215.00	24,365,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	112,700	2,644.00	297,978,800	
ブロンコビリー	3,600	3,130.00	11,268,000	
ＺＯＺＯ	40,900	3,122.00	127,689,800	
トレジャー・ファクトリー	4,700	1,202.00	5,649,400	
物語コーポレーション	10,300	3,810.00	39,243,000	
三越伊勢丹ホールディングス	104,300	1,737.50	181,221,250	
東洋紡	25,300	1,040.00	26,312,000	
富士紡ホールディングス	2,600	3,585.00	9,321,000	
日清紡ホールディングス	44,500	1,100.50	48,972,250	
倉敷紡績	4,400	2,485.00	10,934,000	
ダイワボウホールディングス	27,400	2,913.00	79,816,200	
日東紡績	7,400	4,020.00	29,748,000	
トヨタ紡織	24,700	2,675.50	66,084,850	
マクニカホールディングス	14,700	6,815.00	100,180,500	
Ｈａｍｅｅ	5,800	1,018.00	5,904,400	
ラクト・ジャパン	2,800	2,010.00	5,628,000	
ウエルシアホールディングス	32,100	2,540.00	81,534,000	
クリエイトＳＤホールディングス	10,200	3,160.00	32,232,000	
グリムス	2,700	1,897.00	5,121,900	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9,400	1,013.00	9,522,200	
八洲電機	5,000	1,270.00	6,350,000	
メディアスホールディングス	7,200	749.00	5,392,800	
レスターホールディングス	5,300	2,705.00	14,336,500	
ジオリーブグループ	3,900	1,220.00	4,758,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	12,600	328.00	4,132,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	33,600	961.00	32,289,600	
ミサワ	2,300	628.00	1,444,400	
三洋貿易	7,000	1,272.00	8,904,000	
シュッピン	5,600	1,190.00	6,664,000	
ビューティガレージ	2,400	2,375.00	5,700,000	
オイシックス・ラ・大地	8,300	1,357.00	11,263,100	
ウイン・パートナーズ	5,000	1,230.00	6,150,000	
ネクステージ	14,100	2,228.00	31,414,800	
ジョイフル本田	18,000	1,773.00	31,914,000	
鳥貴族ホールディングス	2,300	2,948.00	6,780,400	
ホットランド	4,700	2,026.00	9,522,200	
すかいらーくホールディングス	84,700	2,238.50	189,600,950	

ＳＦＰホールディングス	3,400	2,258.00	7,677,200	
綿半ホールディングス	4,800	1,335.00	6,408,000	
日本毛織	15,500	1,354.00	20,987,000	
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	1,026.00	17,749,800	
野村不動産ホールディングス	32,100	3,729.00	119,700,900	
三重交通グループホールディングス	12,300	561.00	6,900,300	
サムティ	9,200	2,414.00	22,208,800	
ディア・ライフ	9,800	868.00	8,506,400	
コーセーアールイー	3,700	1,034.00	3,825,800	
地主	4,400	2,173.00	9,561,200	
プレサンスコーポレーション	9,100	1,484.00	13,504,400	
ハウスコム	4,000	818.00	3,272,000	
ＪＰＭＣ	4,900	1,113.00	5,453,700	
サンセイランディック	2,300	1,052.00	2,419,600	
エストラスト	7,500	626.00	4,695,000	
フージャースホールディングス	8,900	1,050.00	9,345,000	
オープンハウスグループ	21,100	4,135.00	87,248,500	
東急不動産ホールディングス	173,400	958.50	166,203,900	
飯田グループホールディングス	55,300	2,278.50	126,001,050	
ムゲンエステート	4,800	1,224.00	5,875,200	
帝国繊維	6,600	2,001.00	13,206,600	
日本コークス工業	59,600	121.00	7,211,600	
ＢＥＥＮＯＳ	3,800	1,504.00	5,715,200	
あさひ	5,700	1,300.00	7,410,000	
日本調剤	4,200	1,305.00	5,481,000	
コスモス薬品	6,100	15,715.00	95,861,500	
シップヘルスケアホールディングス	22,300	2,139.50	47,710,850	
ソフトクリエイトホールディングス	4,800	1,710.00	8,208,000	
セブン&アイ・ホールディングス	213,500	5,663.00	1,209,050,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	41,900	1,057.00	44,288,300	
明治電機工業	3,900	1,390.00	5,421,000	
ツルハホールディングス	13,000	12,305.00	159,965,000	
サンマルクホールディングス	5,000	2,018.00	10,090,000	
フェリシモ	4,400	903.00	3,973,200	
トリドールホールディングス	17,400	4,312.00	75,028,800	
帝人	56,400	1,341.50	75,660,600	
東レ	393,000	785.00	308,505,000	
クラレ	85,500	1,550.50	132,567,750	
旭化成	396,800	1,007.00	399,577,600	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	18,900	291.00	5,499,900	
稲葉製作所	3,600	1,514.00	5,450,400	
宮地エンジニアリンググループ	3,000	3,135.00	9,405,000	
トーカロ	17,400	1,436.00	24,986,400	
ＳＵＭＣＯ	107,400	2,137.00	229,513,800	
川田テクノロジーズ	1,400	6,560.00	9,184,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	4,000	2,448.00	9,792,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	5,600	1,053.00	5,896,800	
シーアールイー	3,500	1,583.00	5,540,500	

ケイアイスター不動産	2,800	3,355.00	9,394,000	
グッドコムアセット	5,900	959.00	5,658,100	
ジェイ・エス・ビー	2,900	2,497.00	7,241,300	
ロードスターキャピタル	3,800	2,030.00	7,714,000	
日本フエルト	5,500	416.00	2,288,000	
イチカワ	3,400	1,661.00	5,647,400	
芦森工業	1,800	2,178.00	3,920,400	
アツギ	10,200	447.00	4,559,400	
ＪＭホールディングス	4,700	2,004.00	9,418,800	
コメダホールディングス	15,200	2,805.00	42,636,000	
アレンザホールディングス	5,500	1,000.00	5,500,000	
バロックジャパンリミテッド	6,900	801.00	5,526,900	
クスリのアオキホールディングス	16,500	3,360.00	55,440,000	
力の源ホールディングス	2,100	1,739.00	3,651,900	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	33,000	2,818.50	93,010,500	
アセンテック	10,700	532.00	5,692,400	
セーレン	11,300	2,271.00	25,662,300	
ソトー	5,700	693.00	3,950,100	
東海染工	1,600	941.00	1,505,600	
小松マテーレ	8,500	808.00	6,868,000	
ワコールホールディングス	12,000	3,296.00	39,552,000	
ホギメディカル	7,800	3,400.00	26,520,000	
ＴＳＩホールディングス	19,700	842.00	16,587,400	
マツオカコーポレーション	3,200	1,554.00	4,972,800	
ワールド	8,300	1,568.00	13,014,400	
ＴＩＳ	64,200	3,180.00	204,156,000	
グリー	15,700	533.00	8,368,100	
コーエーテクモホールディングス	36,800	1,870.00	68,816,000	
三菱総合研究所	2,900	4,650.00	13,485,000	
ブレインパッド	6,700	1,022.00	6,847,400	
ＫＬａｂ	20,500	278.00	5,699,000	
ポールトゥウィンホールディングス	11,700	512.00	5,990,400	
ネクソン	131,200	3,038.00	398,585,600	
アイスタイル	17,400	478.00	8,317,200	
エムアップホールディングス	7,200	1,049.00	7,552,800	
エイチーム	9,100	666.00	6,060,600	
エニグモ	17,000	372.00	6,324,000	
コロプラ	22,800	592.00	13,497,600	
ブロードリーフ	27,900	574.00	16,014,600	
デジタルハーツホールディングス	6,100	901.00	5,496,100	
メディアドゥ	4,200	1,470.00	6,174,000	
じげん	17,100	514.00	8,789,400	
ブイキューブ	15,700	369.00	5,793,300	
フィックスターズ	6,600	1,206.00	7,959,600	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,600	1,235.00	5,681,000	
オプティム	6,700	844.00	5,654,800	
セレス	5,900	919.00	5,422,100	
ＳＨＩＦＴ	3,900	33,610.00	131,079,000	
特種東海製紙	3,200	3,555.00	11,376,000	

ティーガイア	6,100	1,779.00	10,851,900	
テクマトリックス	10,700	1,735.00	18,564,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15,300	2,183.50	33,407,550	
GMOペイメントゲートウェイ	11,700	8,114.00	94,933,800	
システムリサーチ	2,000	3,460.00	6,920,000	
インターネットイニシアティブ	28,100	2,564.00	72,048,400	
さくらインターネット	6,600	1,196.00	7,893,600	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,200	2,503.00	5,506,600	
ＳＲＡホールディングス	3,000	3,545.00	10,635,000	
朝日ネット	9,000	615.00	5,535,000	
ｅＢＡＳＥ	8,500	768.00	6,528,000	
アバントグループ	7,400	1,471.00	10,885,400	
アドソル日進	3,500	1,650.00	5,775,000	
フリービット	5,400	1,139.00	6,150,600	
コムチュア	8,500	2,018.00	17,153,000	
アステリア	8,100	713.00	5,775,300	
アイル	2,700	3,960.00	10,692,000	
王子ホールディングス	244,300	573.30	140,057,190	
日本製紙	33,100	1,291.00	42,732,100	
三菱製紙	4,900	528.00	2,587,200	
北越コーポレーション	28,800	1,319.00	37,987,200	
大王製紙	25,900	1,057.50	27,389,250	
阿波製紙	3,900	403.00	1,571,700	
マークラインズ	3,200	2,875.00	9,200,000	
メディカル・データ・ビジョン	8,200	688.00	5,641,600	
ｇｕｍｉ	12,700	416.00	5,283,200	
テラスカイ	3,700	1,593.00	5,894,100	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,500	1,609.00	5,631,500	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,500	1,723.00	6,030,500	
ラクス	27,800	2,605.00	72,419,000	
ダブルスタンダード	3,800	1,467.00	5,574,600	
オープンドア	7,300	835.00	6,095,500	
アカツキ	2,800	2,144.00	6,003,200	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,800	1,701.00	8,164,800	
カナミックネットワーク	11,700	405.00	4,738,500	
レンゴー	53,400	946.70	50,553,780	
トーモク	3,400	2,141.00	7,279,400	
ザ・パック	4,400	3,160.00	13,904,000	
チェンジホールディングス	12,800	1,558.00	19,942,400	
オークネット	3,100	1,810.00	5,611,000	
マクロミル	11,500	715.00	8,222,500	
ユーザーローカル	3,500	1,822.00	6,377,000	
マネーフォワード	13,100	4,576.00	59,945,600	
レゾナック・ホールディングス	56,700	2,693.50	152,721,450	
住友化学	435,300	387.20	168,548,160	
住友精化	2,800	4,990.00	13,972,000	
日産化学	27,600	5,600.00	154,560,000	

ラサ工業	2,700	2,086.00	5,632,200	
クレハ	4,300	8,170.00	35,131,000	
多木化学	2,300	3,130.00	7,199,000	
テイカ	5,100	1,329.00	6,777,900	
石原産業	9,700	1,357.00	13,162,900	
片倉コープアグリ	1,900	1,140.00	2,166,000	
日本曹達	6,900	5,250.00	36,225,000	
東ソー	78,300	1,913.00	149,787,900	
トクヤマ	18,900	2,356.50	44,537,850	
セントラル硝子	6,300	2,670.00	16,821,000	
東亞合成	29,400	1,347.00	39,601,800	
大阪ソーダ	4,100	9,080.00	37,228,000	
関東電化工業	11,300	792.00	8,949,600	
デンカ	21,300	2,597.00	55,316,100	
イビデン	30,800	7,198.00	221,698,400	
信越化学工業	531,900	5,160.00	2,744,604,000	
日本カーバイド工業	3,100	1,491.00	4,622,100	
プラスアルファ・コンサルティング	3,500	2,727.00	9,544,500	
電算システムホールディングス	2,600	2,781.00	7,230,600	
堺化学工業	4,500	1,835.00	8,257,500	
第一稀元素化学工業	6,400	968.00	6,195,200	
エア・ウォーター	55,300	1,953.50	108,028,550	
日本酸素ホールディングス	56,900	4,059.00	230,957,100	
日本化学工業	2,900	1,978.00	5,736,200	
日本パーカライジング	26,100	1,126.00	29,388,600	
高圧ガス工業	8,500	798.00	6,783,000	
四国化成ホールディングス	7,500	1,791.00	13,432,500	
ステラ　ケミファ	3,200	3,110.00	9,952,000	
保土谷化学工業	1,800	3,230.00	5,814,000	
日本触媒	8,900	5,305.00	47,214,500	
大日精化工業	4,100	2,153.00	8,827,300	
カネカ	14,900	3,758.00	55,994,200	
協和キリン	70,900	2,441.00	173,066,900	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	20,100	1,589.00	31,938,900	
三菱瓦斯化学	43,800	2,284.00	100,039,200	
三井化学	48,400	4,090.00	197,956,000	
ＪＳＲ	63,900	3,946.00	252,149,400	
東京応化工業	9,300	9,137.00	84,974,100	
大阪有機化学工業	4,900	2,685.00	13,156,500	
三菱ケミカルグループ	428,800	957.00	410,361,600	
ＫＨネオケム	8,900	2,295.00	20,425,500	
ダイセル	75,400	1,422.50	107,256,500	
住友ベークライト	8,700	6,858.00	59,664,600	
積水化学工業	118,900	2,120.00	252,068,000	
日本ゼオン	40,200	1,355.50	54,491,100	
アイカ工業	14,800	3,410.00	50,468,000	
ＵＢＥ	27,900	2,317.00	64,644,300	
積水樹脂	8,800	2,475.00	21,780,000	
タキロンシーアイ	15,000	585.00	8,775,000	
旭有機材	3,900	4,125.00	16,087,500	

ニチバン	3,200	1,745.00	5,584,000	
リケンテクノス	12,600	826.00	10,407,600	
大倉工業	2,700	2,730.00	7,371,000	
積水化成品工業	12,300	467.00	5,744,100	
群栄化学工業	1,700	3,090.00	5,253,000	
ダイキョーニシカワ	12,900	745.00	9,610,500	
森六ホールディングス	3,300	2,672.00	8,817,600	
恵和	4,200	1,317.00	5,531,400	
日本化薬	44,800	1,339.00	59,987,200	
カーリットホールディングス	6,300	940.00	5,922,000	
ＣＬホールディングス	6,800	822.00	5,589,600	
プレステージ・インターナショナル	28,200	666.00	18,781,200	
プロトコーポレーション	6,400	1,361.00	8,710,400	
ハイマックス	4,000	1,379.00	5,516,000	
アミューズ	3,700	1,476.00	5,461,200	
野村総合研究所	130,100	4,157.00	540,825,700	
ドリームインキュベータ	2,100	3,020.00	6,342,000	
サイバネットシステム	7,000	1,092.00	7,644,000	
クイック	4,200	2,142.00	8,996,400	
電通グループ	59,200	3,942.00	233,366,400	
インテージホールディングス	6,600	1,684.00	11,114,400	
ぴあ	2,100	3,350.00	7,035,000	
イオンファンタジー	2,200	2,665.00	5,863,000	
ソースネクスト	31,000	174.00	5,394,000	
シーティーエス	8,200	663.00	5,436,600	
インフォコム	7,600	2,506.00	19,045,600	
メディカルシステムネットワーク	12,200	533.00	6,502,600	
日本精化	3,900	2,654.00	10,350,600	
扶桑化学工業	6,200	4,090.00	25,358,000	
トリケミカル研究所	7,100	3,440.00	24,424,000	
シンプレクス・ホールディングス	8,800	2,582.00	22,721,600	
ＨＥＲＯＺ	3,900	1,395.00	5,440,500	
ラクスル	14,100	1,381.00	19,472,100	
メルカリ	35,600	3,112.00	110,787,200	
ＡＤＥＫＡ	20,500	2,823.00	57,871,500	
日油	18,100	6,813.00	123,315,300	
新日本理化	5,700	190.00	1,083,000	
ハリマ化成グループ	6,800	795.00	5,406,000	
イーソル	7,900	623.00	4,921,700	
ウイングアーク１ｓｔ	6,100	3,015.00	18,391,500	
サーバーワークス	1,800	3,395.00	6,111,000	
Ｓａｎｓａｎ	19,200	1,454.00	27,916,800	
ギフティ	5,100	1,767.00	9,011,700	
花王	132,600	5,519.00	731,819,400	
第一工業製薬	3,300	1,784.00	5,887,200	
石原ケミカル	3,300	1,859.00	6,134,700	
三洋化成工業	3,600	4,285.00	15,426,000	
メドレー	7,900	4,650.00	36,735,000	
ベース	2,000	3,570.00	7,140,000	
ＪＭＤＣ	10,000	4,600.00	46,000,000	

武田薬品工業	519,800	4,190.00	2,177,962,000	
アステラス製薬	515,200	1,808.50	931,739,200	
住友ファーマ	43,600	480.00	20,928,000	
塩野義製薬	74,100	7,097.00	525,887,700	
わかもと製薬	3,100	200.00	620,000	
日本新薬	15,400	5,367.00	82,651,800	
中外製薬	183,900	4,880.00	897,432,000	
科研製薬	10,100	3,225.00	32,572,500	
エーザイ	71,500	7,721.00	552,051,500	
理研ビタミン	5,000	2,293.00	11,465,000	
ロート製薬	56,900	3,123.00	177,698,700	
小野薬品工業	124,600	2,751.50	342,836,900	
久光製薬	13,100	4,540.00	59,474,000	
有機合成薬品工業	12,400	282.00	3,496,800	
持田製薬	6,700	3,195.00	21,406,500	
参天製薬	107,000	1,332.50	142,577,500	
扶桑薬品工業	2,800	1,893.00	5,300,400	
ツムラ	18,500	2,695.50	49,866,750	
テルモ	163,700	4,772.00	781,176,400	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	17,600	2,569.00	45,214,400	
キッセイ薬品工業	9,700	3,005.00	29,148,500	
生化学工業	10,000	757.00	7,570,000	
栄研化学	11,400	1,584.00	18,057,600	
鳥居薬品	3,200	3,615.00	11,568,000	
ＪＣＲファーマ	19,900	1,270.00	25,273,000	
東和薬品	9,000	2,444.00	21,996,000	
富士製薬工業	4,700	1,414.00	6,645,800	
ゼリア新薬工業	8,200	1,921.00	15,752,200	
そーせいグループ	18,900	1,403.00	26,516,700	
第一三共	511,700	3,947.00	2,019,679,900	
杏林製薬	12,700	1,789.00	22,720,300	
ダイト	4,500	1,925.00	8,662,500	
大塚ホールディングス	122,200	5,475.00	669,045,000	
大正製薬ホールディングス	13,100	5,547.00	72,665,700	
ペプチドリーム	28,500	1,261.00	35,938,500	
大日本塗料	6,500	941.00	6,116,500	
日本ペイントホールディングス	311,500	1,141.00	355,421,500	
関西ペイント	57,500	2,361.50	135,786,250	
中国塗料	12,000	1,427.00	17,124,000	
藤倉化成	12,300	445.00	5,473,500	
太陽ホールディングス	10,200	2,955.00	30,141,000	
ＤＩＣ	22,900	2,395.50	54,856,950	
サカタインクス	13,000	1,316.00	17,108,000	
東洋インキＳＣホールディングス	12,800	2,575.00	32,960,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5,600	1,419.00	7,946,400	
アルプス技研	5,700	2,686.00	15,310,200	
日本空調サービス	7,100	785.00	5,573,500	
オリエンタルランド	318,600	5,157.00	1,643,020,200	
フォーカスシステムズ	5,600	967.00	5,415,200	
ダスキン	13,400	3,171.00	42,491,400	

パーク２４	37,500	1,753.00	65,737,500	
明光ネットワークジャパン	7,800	709.00	5,530,200	
ファルコホールディングス	2,700	2,003.00	5,408,100	
クレスコ	4,800	1,902.00	9,129,600	
フジ・メディア・ホールディングス	56,400	1,466.00	82,682,400	
ラウンドワン	56,600	571.00	32,318,600	
リゾートトラスト	26,100	2,274.00	59,351,400	
オービック	19,600	22,090.00	432,964,000	
ジャストシステム	8,400	3,160.00	26,544,000	
ＴＤＣソフト	5,500	1,931.00	10,620,500	
ＬＩＮＥヤフー	836,000	428.00	357,808,000	
ビー・エム・エル	7,400	2,934.00	21,711,600	
トレンドマイクロ	27,800	7,259.00	201,800,200	
ＩＤホールディングス	4,000	1,456.00	5,824,000	
リソー教育	30,800	238.00	7,330,400	
日本オラクル	11,200	11,185.00	125,272,000	
早稲田アカデミー	3,900	1,589.00	6,197,100	
アルファシステムズ	2,000	2,823.00	5,646,000	
フューチャー	12,500	1,804.00	22,550,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,100	1,734.00	5,375,400	
ＳＢテクノロジー	2,600	2,377.00	6,180,200	
ユー・エス・エス	67,500	2,872.00	193,860,000	
オービックビジネスコンサルタント	8,300	6,561.00	54,456,300	
アイティフォー	7,500	1,056.00	7,920,000	
東京個別指導学院	10,900	480.00	5,232,000	
サイバーエージェント	133,000	819.70	109,020,100	
楽天グループ	515,500	562.00	289,711,000	
クリーク・アンド・リバー社	3,000	2,075.00	6,225,000	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	11,800	552.00	6,513,600	
テー・オー・ダブリュー	17,500	317.00	5,547,500	
大塚商会	29,100	5,959.00	173,406,900	
サイボウズ	8,100	2,131.00	17,261,100	
山田コンサルティンググループ	3,500	1,682.00	5,887,000	
セントラルスポーツ	2,300	2,417.00	5,559,100	
電通国際情報サービス	7,100	4,625.00	32,837,500	
ＡＣＣＥＳＳ	7,400	813.00	6,016,200	
デジタルガレージ	9,400	3,120.00	29,328,000	
イーエムシステムズ	9,800	671.00	6,575,800	
ウェザーニューズ	1,800	5,880.00	10,584,000	
ＣＩＪ	10,300	611.00	6,293,300	
WOWOW	5,000	1,048.00	5,240,000	
スカラ	7,200	742.00	5,342,400	
フルキャストホールディングス	5,700	1,985.00	11,314,500	
エン・ジャパン	9,800	2,287.00	22,412,600	
あすか製薬ホールディングス	6,000	1,785.00	10,710,000	
サワイグループホールディングス	13,500	4,931.00	66,568,500	
富士フイルムホールディングス	109,000	8,698.00	948,082,000	
コニカミノルタ	132,100	470.40	62,139,840	
資生堂	122,600	4,320.00	529,632,000	

ライオン	76,900	1,341.00	103,122,900	
高砂香料工業	4,400	3,400.00	14,960,000	
マンダム	12,700	1,271.00	16,141,700	
ミルボン	8,000	3,919.00	31,352,000	
ファンケル	25,700	2,312.50	59,431,250	
コーセー	11,900	10,570.00	125,783,000	
コタ	5,400	1,570.00	8,478,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	30,100	1,539.50	46,338,950	
ノエビアホールディングス	5,200	5,120.00	26,624,000	
アジュバンホールディングス	3,300	922.00	3,042,600	
新日本製薬	3,700	1,559.00	5,768,300	
エステー	4,500	1,491.00	6,709,500	
アグロ　カネショウ	4,100	1,325.00	5,432,500	
コニシ	9,800	2,479.00	24,294,200	
長谷川香料	11,200	3,270.00	36,624,000	
小林製薬	17,100	6,787.00	116,057,700	
荒川化学工業	5,400	1,010.00	5,454,000	
メック	4,800	4,050.00	19,440,000	
日本高純度化学	2,100	2,532.00	5,317,200	
タカラバイオ	15,800	1,201.00	18,975,800	
ＪＣＵ	6,600	3,720.00	24,552,000	
新田ゼラチン	500	795.00	397,500	
ＯＡＴアグリオ	2,900	1,929.00	5,594,100	
デクセリアルズ	14,700	4,342.00	63,827,400	
アース製薬	5,300	4,785.00	25,360,500	
北興化学工業	5,900	932.00	5,498,800	
大成ラミック	1,800	2,943.00	5,297,400	
クミアイ化学工業	23,300	1,102.00	25,676,600	
日本農薬	10,800	594.00	6,415,200	
ニチレキ	7,700	2,300.00	17,710,000	
ユシロ化学工業	3,700	1,653.00	6,116,100	
富士石油	17,400	350.00	6,090,000	
出光興産	65,300	4,120.00	269,036,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	929,800	596.50	554,625,700	
コスモエネルギーホールディングス	17,500	5,785.00	101,237,500	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	2,100	3,745.00	7,864,500	
テスホールディングス	12,400	445.00	5,518,000	
インフロニア・ホールディングス	66,200	1,612.00	106,714,400	
横浜ゴム	29,700	3,113.00	92,456,100	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	33,700	2,418.50	81,503,450	
ブリヂストン	171,900	5,925.00	1,018,507,500	
住友ゴム工業	57,600	1,655.00	95,328,000	
藤倉コンポジット	4,700	1,328.00	6,241,600	
オカモト	2,800	5,360.00	15,008,000	
アキレス	3,700	1,574.00	5,823,800	
フコク	2,600	1,315.00	3,419,000	
ニッタ	6,000	3,605.00	21,630,000	
住友理工	9,100	1,009.00	9,181,900	
三ツ星ベルト	7,100	4,375.00	31,062,500	
バンドー化学	8,700	1,535.00	13,354,500	

ＡＧＣ	54,800	5,387.00	295,207,600	
日本板硝子	28,000	637.00	17,836,000	
有沢製作所	10,300	1,048.00	10,794,400	
日本電気硝子	24,000	3,051.00	73,224,000	
オハラ	4,200	1,290.00	5,418,000	
住友大阪セメント	9,800	3,562.00	34,907,600	
太平洋セメント	34,700	2,750.00	95,425,000	
日本ヒューム	6,200	906.00	5,617,200	
日本コンクリート工業	17,700	328.00	5,805,600	
三谷セキサン	2,500	4,325.00	10,812,500	
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	1,087.50	58,942,500	
日本カーボン	3,100	4,585.00	14,213,500	
東洋炭素	4,100	4,410.00	18,081,000	
ノリタケカンパニーリミテド	3,300	6,580.00	21,714,000	
ＴＯＴＯ	38,800	3,910.00	151,708,000	
日本碍子	68,300	1,789.50	122,222,850	
日本特殊陶業	49,200	3,357.00	165,164,400	
ＭＡＲＵＷＡ	2,200	28,200.00	62,040,000	
品川リフラクトリーズ	7,200	1,647.00	11,858,400	
黒崎播磨	1,200	9,940.00	11,928,000	
ヨータイ	3,800	1,424.00	5,411,200	
ニッカトー	3,400	560.00	1,904,000	
フジミインコーポレーテッド	15,800	3,015.00	47,637,000	
クニミネ工業	900	993.00	893,700	
ニチアス	14,800	3,045.00	45,066,000	
日本製鉄	270,500	3,401.00	919,970,500	
神戸製鋼所	121,500	1,740.50	211,470,750	
中山製鋼所	13,800	818.00	11,288,400	
合同製鐵	3,400	4,320.00	14,688,000	
ＪＦＥホールディングス	168,000	2,228.00	374,304,000	
東京製鐵	17,000	1,794.00	30,498,000	
共英製鋼	6,900	2,038.00	14,062,200	
大和工業	11,400	7,314.00	83,379,600	
東京鐵鋼	2,700	3,775.00	10,192,500	
大阪製鐵	3,100	1,896.00	5,877,600	
淀川製鋼所	6,900	3,740.00	25,806,000	
中部鋼鈑	4,000	1,947.00	7,788,000	
丸一鋼管	18,400	3,796.00	69,846,400	
大同特殊鋼	7,600	6,337.00	48,161,200	
日本冶金工業	4,400	4,125.00	18,150,000	
山陽特殊製鋼	6,000	2,562.00	15,372,000	
愛知製鋼	3,500	3,395.00	11,882,500	
大平洋金属	5,100	1,333.00	6,798,300	
新日本電工	30,000	296.00	8,880,000	
栗本鐵工所	2,800	3,195.00	8,946,000	
日本製鋼所	16,300	2,576.00	41,988,800	
三菱製鋼	4,500	1,470.00	6,615,000	
日亜鋼業	10,400	305.00	3,172,000	
日本精線	1,100	4,700.00	5,170,000	

エンビプロ・ホールディングス	8,400	650.00	5,460,000	
大紀アルミニウム工業所	7,600	1,196.00	9,089,600	
日本軽金属ホールディングス	17,600	1,673.00	29,444,800	
三井金属鉱業	17,600	4,282.00	75,363,200	
東邦亜鉛	3,900	1,193.00	4,652,700	
三菱マテリアル	43,200	2,431.50	105,040,800	
住友金属鉱山	70,000	4,365.00	305,550,000	
ＤＯＷＡホールディングス	14,900	5,121.00	76,302,900	
古河機械金属	8,000	1,945.00	15,560,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,500	3,005.00	31,552,500	
東邦チタニウム	12,500	1,916.00	23,950,000	
ＵＡＣＪ	8,500	3,160.00	26,860,000	
ＣＫサンエツ	1,500	3,615.00	5,422,500	
古河電気工業	20,100	2,391.50	48,069,150	
住友電気工業	226,000	1,828.00	413,128,000	
フジクラ	71,300	1,126.00	80,283,800	
ＳＷＣＣ	6,800	2,614.00	17,775,200	
タツタ電線	10,800	685.00	7,398,000	
平河ヒューテック	3,900	1,382.00	5,389,800	
いよぎんホールディングス	68,600	964.70	66,178,420	
しずおかフィナンシャルグループ	128,100	1,219.00	156,153,900	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	48,600	1,113.50	54,116,100	
楽天銀行	20,100	2,613.00	52,521,300	
京都フィナンシャルグループ	18,300	8,680.00	158,844,000	
リョービ	6,400	3,125.00	20,000,000	
アーレスティ	5,200	823.00	4,279,600	
ＡＲＥホールディングス	22,700	1,929.00	43,788,300	
東洋製罐グループホールディングス	36,000	2,373.50	85,446,000	
ホッカンホールディングス	3,400	1,592.00	5,412,800	
コロナ	5,900	897.00	5,292,300	
横河ブリッジホールディングス	9,500	2,617.00	24,861,500	
三和ホールディングス	60,700	2,064.00	125,284,800	
文化シヤッター	15,800	1,358.00	21,456,400	
三協立山	6,900	830.00	5,727,000	
アルインコ	5,700	1,005.00	5,728,500	
ＬＩＸＩＬ	94,300	1,782.00	168,042,600	
日本フイルコン	3,000	484.00	1,452,000	
ノーリツ	10,000	1,520.00	15,200,000	
長府製作所	6,000	2,062.00	12,372,000	
リンナイ	29,600	2,984.50	88,341,200	
ユニプレス	10,500	951.00	9,985,500	
日東精工	9,300	559.00	5,198,700	
三洋工業	400	2,215.00	886,000	
岡部	10,800	695.00	7,506,000	
ジーテクト	7,700	1,723.00	13,267,100	
東プレ	10,600	1,893.00	20,065,800	
高周波熱錬	9,300	984.00	9,151,200	
東京製綱	4,000	1,373.00	5,492,000	
サンコール	11,000	469.00	5,159,000	
モリテックスチール	7,100	301.00	2,137,100	

パイオラックス	7,500	2,281.00	17,107,500	
エイチワン	6,900	750.00	5,175,000	
日本発条	53,400	1,116.50	59,621,100	
中央発條	7,300	711.00	5,190,300	
三浦工業	24,700	2,843.50	70,234,450	
タクマ	20,000	1,562.00	31,240,000	
テクノプロ・ホールディングス	35,600	3,427.00	122,001,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,000	1,510.00	6,040,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	3,700	5,870.00	21,719,000	
イー・ガーディアン	3,400	1,551.00	5,273,400	
ジャパンマテリアル	18,400	2,260.00	41,584,000	
ベクトル	7,400	1,117.00	8,265,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,000	1,192.00	5,960,000	
キャリアリンク	2,200	2,132.00	4,690,400	
ＩＢＪ	8,600	712.00	6,123,200	
アサンテ	3,400	1,580.00	5,372,000	
バリューＨＲ	5,300	1,405.00	7,446,500	
M&Aキャピタルパートナーズ	4,900	2,152.00	10,544,800	
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	1,310.00	10,611,000	
ウィルグループ	5,000	1,092.00	5,460,000	
メドピア	6,000	774.00	4,644,000	
リクルートホールディングス	445,600	5,118.00	2,280,580,800	
エラン	8,000	946.00	7,568,000	
ツガミ	13,100	1,205.00	15,785,500	
オークマ	5,200	6,291.00	32,713,200	
芝浦機械	5,900	3,525.00	20,797,500	
アマダ	94,400	1,457.50	137,588,000	
アイダエンジニアリング	13,700	887.00	12,151,900	
ＦＵＪＩ	27,800	2,418.00	67,220,400	
牧野フライス製作所	6,500	5,770.00	37,505,000	
オーエスジー	26,100	1,792.50	46,784,250	
ダイジェット工業	2,000	884.00	1,768,000	
旭ダイヤモンド工業	14,200	897.00	12,737,400	
DMG森精機	35,900	2,663.50	95,619,650	
ソディック	14,400	776.00	11,174,400	
ディスコ	28,500	31,730.00	904,305,000	
日東工器	2,900	1,802.00	5,225,800	
日進工具	5,500	1,019.00	5,604,500	
パンチ工業	3,300	422.00	1,392,600	
日本郵政	707,400	1,314.00	929,523,600	
ベルシステム２４ホールディングス	6,500	1,645.00	10,692,500	
鎌倉新書	9,400	590.00	5,546,000	
エアトリ	4,400	1,819.00	8,003,600	
アトラエ	4,200	788.00	3,309,600	
ストライク	2,500	3,810.00	9,525,000	
ソラスト	16,600	590.00	9,794,000	
インソース	13,100	985.00	12,903,500	

豊田自動織機	49,900	12,015.00	599,548,500	
リケンＮＰＲ	6,400	2,033.00	13,011,200	
東洋機械金属	4,900	644.00	3,155,600	
エンシュウ	4,500	672.00	3,024,000	
島精機製作所	9,400	1,639.00	15,406,600	
オプトラン	9,700	1,625.00	15,762,500	
ＮＣホールディングス	2,200	1,830.00	4,026,000	
イワキ	3,900	1,975.00	7,702,500	
フリュー	5,600	1,275.00	7,140,000	
ヤマシンフィルタ	17,900	322.00	5,763,800	
日阪製作所	6,500	926.00	6,019,000	
やまびこ	9,700	1,433.00	13,900,100	
野村マイクロ・サイエンス	2,000	10,300.00	20,600,000	
平田機工	2,800	6,310.00	17,668,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	10,600	484.00	5,130,400	
マルマエ	4,000	1,577.00	6,308,000	
タツモ	3,600	3,820.00	13,752,000	
ナブテスコ	37,100	2,708.50	100,485,350	
三井海洋開発	7,500	2,004.00	15,030,000	
レオン自動機	6,800	1,491.00	10,138,800	
ＳＭＣ	17,700	75,570.00	1,337,589,000	
ホソカワミクロン	3,800	4,250.00	16,150,000	
ユニオンツール	2,600	3,510.00	9,126,000	
オイレス工業	8,000	1,936.00	15,488,000	
日精エー・エス・ビー機械	2,400	5,040.00	12,096,000	
サトーホールディングス	8,400	2,000.00	16,800,000	
技研製作所	5,600	1,809.00	10,130,400	
日本エアーテック	4,000	1,394.00	5,576,000	
カワタ	3,900	1,085.00	4,231,500	
日精樹脂工業	5,200	1,064.00	5,532,800	
ワイエイシイホールディングス	2,300	2,593.00	5,963,900	
小松製作所	277,200	3,829.00	1,061,398,800	
住友重機械工業	35,000	3,444.00	120,540,000	
日立建機	23,600	4,025.00	94,990,000	
日工	8,800	665.00	5,852,000	
巴工業	2,300	2,835.00	6,520,500	
井関農機	5,500	1,097.00	6,033,500	
ＴＯＷＡ	6,600	6,660.00	43,956,000	
北川鉄工所	3,800	1,281.00	4,867,800	
シンニッタン	14,300	246.00	3,517,800	
ローツェ	3,100	13,880.00	43,028,000	
クボタ	310,400	2,129.50	660,996,800	
荏原実業	3,100	2,817.00	8,732,700	
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	1,294.00	10,352,000	
帝国電機製作所	4,200	2,734.00	11,482,800	
新東工業	12,000	1,099.00	13,188,000	
澁谷工業	5,500	2,500.00	13,750,000	
アイチコーポレーション	8,200	898.00	7,363,600	
小森コーポレーション	14,900	1,167.00	17,388,300	

鶴見製作所	4,500	3,790.00	17,055,000	
荏原製作所	24,300	8,253.00	200,547,900	
酉島製作所	5,100	2,030.00	10,353,000	
北越工業	5,900	2,046.00	12,071,400	
ダイキン工業	70,600	23,850.00	1,683,810,000	
オルガノ	7,100	5,630.00	39,973,000	
トーヨーカネツ	2,200	3,485.00	7,667,000	
栗田工業	33,100	4,960.00	164,176,000	
椿本チエイン	8,400	3,640.00	30,576,000	
大同工業	3,900	723.00	2,819,700	
日機装	13,600	962.00	13,083,200	
木村化工機	7,700	724.00	5,574,800	
レイズネクスト	8,300	1,356.00	11,254,800	
アネスト岩田	9,100	1,085.00	9,873,500	
ダイフク	99,800	2,728.00	272,254,400	
サムコ	1,600	4,960.00	7,936,000	
タダノ	34,000	1,190.00	40,460,000	
フジテック	13,800	3,432.00	47,361,600	
ＣＫＤ	16,400	2,188.00	35,883,200	
平和	17,500	2,019.00	35,332,500	
理想科学工業	4,700	2,650.00	12,455,000	
ＳＡＮＫＹＯ	14,500	6,068.00	87,986,000	
日本金銭機械	7,100	1,154.00	8,193,400	
マースグループホールディングス	3,000	2,360.00	7,080,000	
フクシマガリレイ	3,900	5,000.00	19,500,000	
ダイコク電機	2,900	3,550.00	10,295,000	
竹内製作所	10,700	4,350.00	46,545,000	
アマノ	16,800	3,126.00	52,516,800	
ＪＵＫＩ	9,200	521.00	4,793,200	
ジャノメ	7,500	675.00	5,062,500	
ブラザー工業	79,000	2,439.50	192,720,500	
マックス	8,300	2,856.00	23,704,800	
モリタホールディングス	10,300	1,511.00	15,563,300	
グローリー	14,200	2,711.00	38,496,200	
新晃工業	6,000	2,395.00	14,370,000	
大和冷機工業	9,100	1,383.00	12,585,300	
セガサミーホールディングス	52,800	2,222.00	117,321,600	
ＴＰＲ	7,500	1,736.00	13,020,000	
ツバキ・ナカシマ	11,800	752.00	8,873,600	
ホシザキ	34,900	4,719.00	164,693,100	
大豊工業	6,600	834.00	5,504,400	
日本精工	109,500	791.80	86,702,100	
ＮＴＮ	128,300	283.20	36,334,560	
ジェイテクト	52,600	1,342.00	70,589,200	
不二越	4,400	3,860.00	16,984,000	
ミネベアミツミ	102,900	2,826.00	290,795,400	
日本トムソン	16,100	552.00	8,887,200	
ＴＨＫ	34,100	2,958.00	100,867,800	
ユーシン精機	8,200	664.00	5,444,800	
前澤給装工業	4,500	1,285.00	5,782,500	

イーグル工業	6,500	1,639.00	10,653,500	
日本ピラー工業	5,500	4,395.00	24,172,500	
キッツ	19,800	1,114.00	22,057,200	
日立製作所	287,600	10,215.00	2,937,834,000	
東芝	47,500	4,600.00	218,500,000	
三菱電機	658,300	2,052.50	1,351,160,750	
富士電機	36,000	6,049.00	217,764,000	
安川電機	64,200	5,612.00	360,290,400	
シンフォニア　テクノロジー	6,500	1,948.00	12,662,000	
明電舎	11,000	2,395.00	26,345,000	
オリジン	1,600	1,175.00	1,880,000	
山洋電気	2,600	5,760.00	14,976,000	
デンヨー	4,500	2,245.00	10,102,500	
ＰＨＣホールディングス	11,000	1,405.00	15,455,000	
ソシオネクスト	8,600	14,590.00	125,474,000	
ベイカレント・コンサルティング	44,200	4,645.00	205,309,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	5,800	940.00	5,452,000	
アイモバイル	11,700	470.00	5,499,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	19,500	2,292.00	44,694,000	
ミダックホールディングス	3,600	1,815.00	6,534,000	
キュービーネットホールディングス	3,300	1,558.00	5,141,400	
ＲＰＡホールディングス	18,800	283.00	5,320,400	
三櫻工業	8,900	906.00	8,063,400	
マキタ	67,400	3,922.00	264,342,800	
東芝テック	7,600	2,950.00	22,420,000	
芝浦メカトロニクス	3,400	7,250.00	24,650,000	
マブチモーター	14,700	4,520.00	66,444,000	
ニデック	130,600	5,789.00	756,043,400	
トレックス・セミコンダクター	3,000	1,771.00	5,313,000	
東光高岳	3,600	2,001.00	7,203,600	
ダブル・スコープ	16,900	970.00	16,393,000	
ダイヘン	5,900	5,500.00	32,450,000	
ヤーマン	10,200	1,053.00	10,740,600	
ＪＶＣケンウッド	46,700	686.00	32,036,200	
Ｉ－ＰＥＸ	4,100	1,660.00	6,806,000	
大崎電気工業	12,900	621.00	8,010,900	
オムロン	45,200	6,140.00	277,528,000	
日東工業	8,000	3,400.00	27,200,000	
ＩＤＥＣ	8,700	2,824.00	24,568,800	
不二電機工業	300	1,121.00	336,300	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	19,400	2,490.00	48,306,000	
メルコホールディングス	1,900	3,305.00	6,279,500	
テクノメディカ	2,400	2,525.00	6,060,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	6,600	742.00	4,897,200	
日本電気	77,700	8,263.00	642,035,100	
富士通	54,400	20,600.00	1,120,640,000	
沖電気工業	26,700	977.00	26,085,900	

電気興業	2,600	2,287.00	5,946,200	
サンケン電気	5,500	7,252.00	39,886,000	
アイホン	3,200	2,769.00	8,860,800	
ルネサスエレクトロニクス	386,000	2,418.00	933,348,000	
セイコーエプソン	75,900	2,152.50	163,374,750	
ワコム	44,900	706.00	31,699,400	
アルバック	14,100	6,368.00	89,788,800	
ＥＩＺＯ	4,300	4,645.00	19,973,500	
ジャパンディスプレイ	254,900	36.00	9,176,400	
日本信号	13,500	948.00	12,798,000	
京三製作所	12,400	477.00	5,914,800	
能美防災	8,000	1,852.00	14,816,000	
ホーチキ	4,400	1,680.00	7,392,000	
エレコム	14,100	1,628.00	22,954,800	
パナソニック　ホールディングス	698,700	1,571.50	1,098,007,050	
シャープ	99,700	1,029.50	102,641,150	
アンリツ	41,700	1,233.00	51,416,100	
富士通ゼネラル	16,800	2,796.50	46,981,200	
ソニーグループ	414,200	12,930.00	5,355,606,000	
ＴＤＫ	93,600	6,505.00	608,868,000	
帝国通信工業	3,000	1,948.00	5,844,000	
タムラ製作所	23,600	564.00	13,310,400	
アルプスアルパイン	52,800	1,212.00	63,993,600	
日本電波工業	7,100	1,214.00	8,619,400	
鈴木	4,800	1,122.00	5,385,600	
メイコー	5,900	4,195.00	24,750,500	
ローランド　ディー．ジー．	3,200	3,490.00	11,168,000	
フォスター電機	6,100	1,145.00	6,984,500	
ＳＭＫ	2,200	2,421.00	5,326,200	
ヨコオ	5,200	1,505.00	7,826,000	
ホシデン	13,400	1,722.00	23,074,800	
ヒロセ電機	8,700	16,135.00	140,374,500	
日本航空電子工業	14,100	2,761.00	38,930,100	
ＴＯＡ	6,700	1,012.00	6,780,400	
マクセル	13,100	1,641.00	21,497,100	
古野電気	7,700	1,687.00	12,989,900	
スミダコーポレーション	7,900	1,180.00	9,322,000	
アイコム	2,300	3,195.00	7,348,500	
リオン	2,400	2,171.00	5,210,400	
横河電機	64,700	2,799.00	181,095,300	
新電元工業	2,300	2,963.00	6,814,900	
アズビル	40,900	4,927.00	201,514,300	
日本光電工業	25,100	3,687.00	92,543,700	
チノー	2,700	2,115.00	5,710,500	
共和電業	11,800	402.00	4,743,600	
日本電子材料	3,900	1,477.00	5,760,300	
堀場製作所	11,200	9,237.00	103,454,400	
アドバンテスト	167,800	4,644.00	779,263,200	
エスペック	4,700	2,274.00	10,687,800	
キーエンス	58,600	62,280.00	3,649,608,000	

日置電機	2,800	6,560.00	18,368,000	
シスメックス	50,500	7,786.00	393,193,000	
日本マイクロニクス	10,500	3,695.00	38,797,500	
メガチップス	4,600	3,740.00	17,204,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,200	3,660.00	11,712,000	
澤藤電機	3,300	1,238.00	4,085,400	
デンソー	483,100	2,462.00	1,189,392,200	
原田工業	4,500	779.00	3,505,500	
コーセル	7,000	1,181.00	8,267,000	
イリソ電子工業	5,400	3,880.00	20,952,000	
オプテックスグループ	10,700	1,761.00	18,842,700	
千代田インテグレ	2,300	2,922.00	6,720,600	
レーザーテック	26,800	31,060.00	832,408,000	
スタンレー電気	37,500	2,707.00	101,512,500	
ウシオ電機	29,700	1,915.50	56,890,350	
岡谷電機産業	100	275.00	27,500	
日本セラミック	4,800	2,756.00	13,228,800	
古河電池	6,000	910.00	5,460,000	
山一電機	5,300	1,843.00	9,767,900	
図研	5,100	4,005.00	20,425,500	
日本電子	14,700	5,655.00	83,128,500	
カシオ計算機	42,300	1,252.50	52,980,750	
ファナック	285,500	4,044.00	1,154,562,000	
日本シイエムケイ	12,400	709.00	8,791,600	
エンプラス	1,700	11,040.00	18,768,000	
大真空	8,700	735.00	6,394,500	
ローム	108,300	2,664.00	288,511,200	
浜松ホトニクス	47,000	5,868.00	275,796,000	
三井ハイテック	5,200	7,145.00	37,154,000	
新光電気工業	20,700	5,350.00	110,745,000	
京セラ	91,000	8,015.00	729,365,000	
太陽誘電	28,500	3,807.00	108,499,500	
村田製作所	532,800	2,870.00	1,529,136,000	
双葉電子工業	11,100	520.00	5,772,000	
日東電工	37,700	10,615.00	400,185,500	
北陸電気工業	2,800	1,342.00	3,757,600	
東海理化電機製作所	16,500	2,389.00	39,418,500	
ニチコン	15,400	1,389.00	21,390,600	
日本ケミコン	6,200	1,288.00	7,985,600	
ＫＯＡ	8,900	1,532.00	13,634,800	
三井Ｅ＆Ｓ	28,000	511.00	14,308,000	
日立造船	52,200	861.00	44,944,200	
三菱重工業	103,400	8,488.00	877,659,200	
川崎重工業	47,800	3,332.00	159,269,600	
ＩＨＩ	44,000	2,865.50	126,082,000	
名村造船所	12,800	1,133.00	14,502,400	
マネジメントソリューションズ	2,600	2,936.00	7,633,600	
プロレド・パートナーズ	13,500	374.00	5,049,000	
アンビスホールディングス	6,400	2,806.00	17,958,400	
カーブスホールディングス	16,400	640.00	10,496,000	

フォーラムエンジニアリング	4,100	1,511.00	6,195,100	
日本車輌製造	2,700	2,091.00	5,645,700	
三菱ロジスネクスト	9,300	1,234.00	11,476,200	
フルサト・マルカホールディングス	5,500	2,769.00	15,229,500	
ヤマエグループホールディングス	3,500	3,590.00	12,565,000	
ＦＰＧ	19,500	1,511.00	29,464,500	
島根銀行	6,000	526.00	3,156,000	
じもとホールディングス	3,600	577.00	2,077,200	
全国保証	15,100	4,804.00	72,540,400	
めぶきフィナンシャルグループ	286,200	449.00	128,503,800	
ジャパンインベストメントアドバイザー	4,700	1,583.00	7,440,100	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,400	4,240.00	31,376,000	
九州フィナンシャルグループ	111,600	824.20	91,980,720	
かんぽ生命保険	58,800	2,824.00	166,051,200	
ゆうちょ銀行	633,700	1,472.00	932,806,400	
富山第一銀行	18,300	894.00	16,360,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	309,400	686.50	212,403,100	
ジェイリース	2,900	1,806.00	5,237,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	32,500	1,646.00	53,495,000	
イントラスト	1,800	803.00	1,445,400	
アルヒ	6,600	811.00	5,352,600	
プレミアグループ	9,700	1,663.00	16,131,100	
日産自動車	831,800	596.20	495,919,160	
いすゞ自動車	170,200	1,892.50	322,103,500	
トヨタ自動車	3,215,300	2,780.00	8,938,534,000	
日野自動車	88,100	486.80	42,887,080	
三菱自動車工業	228,400	494.80	113,012,320	
エフテック	1,400	629.00	880,600	
武蔵精密工業	14,300	1,602.00	22,908,600	
日産車体	6,900	798.00	5,506,200	
新明和工業	16,900	1,191.00	20,127,900	
極東開発工業	9,700	1,881.00	18,245,700	
トピー工業	4,700	2,715.00	12,760,500	
ティラド	2,500	3,160.00	7,900,000	
タチエス	10,800	1,657.00	17,895,600	
ＮＯＫ	22,700	1,879.50	42,664,650	
フタバ産業	15,700	754.00	11,837,800	
カヤバ	5,600	4,460.00	24,976,000	
市光工業	10,500	519.00	5,449,500	
大同メタル工業	11,400	556.00	6,338,400	
プレス工業	23,400	610.00	14,274,000	
ミクニ	3,600	438.00	1,576,800	
太平洋工業	13,400	1,378.00	18,465,200	
アイシン	45,200	5,543.00	250,543,600	
マツダ	193,700	1,678.00	325,028,600	
今仙電機製作所	2,500	583.00	1,457,500	
本田技研工業	1,428,000	1,564.50	2,234,106,000	

スズキ	107,500	6,124.00	658,330,000	
ＳＵＢＡＲＵ	185,300	2,673.50	495,399,550	
ヤマハ発動機	84,400	3,662.00	309,072,800	
小糸製作所	63,400	2,303.50	146,041,900	
エクセディ	9,600	2,524.00	24,230,400	
ミツバ	11,000	852.00	9,372,000	
豊田合成	17,100	2,988.50	51,103,350	
愛三工業	9,700	1,261.00	12,231,700	
盟和産業	4,600	976.00	4,489,600	
ヨロズ	6,100	894.00	5,453,400	
エフ・シー・シー	10,400	1,792.00	18,636,800	
シマノ	23,800	22,445.00	534,191,000	
テイ・エス　テック	20,800	1,758.00	36,566,400	
三十三フィナンシャルグループ	5,200	1,862.00	9,682,400	
第四北越フィナンシャルグループ	9,100	3,890.00	35,399,000	
ひろぎんホールディングス	82,100	929.60	76,320,160	
マーキュリアホールディングス	1,400	749.00	1,048,600	
おきなわフィナンシャルグループ	4,900	2,402.00	11,769,800	
ダイレクトマーケティングミックス	14,100	459.00	6,471,900	
ポピンズ	4,500	1,376.00	6,192,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	4,700	2,083.00	9,790,100	
十六フィナンシャルグループ	7,500	3,840.00	28,800,000	
北國フィナンシャルホールディングス	6,100	4,650.00	28,365,000	
ネットプロテクションズホールディングス	20,700	276.00	5,713,200	
プロクレアホールディングス	6,600	1,921.00	12,678,600	
あいちフィナンシャルグループ	8,900	2,370.00	21,093,000	
ジャムコ	3,700	1,469.00	5,435,300	
小野建	6,100	1,658.00	10,113,800	
はるやまホールディングス	5,300	522.00	2,766,600	
南陽	1,400	2,036.00	2,850,400	
ノジマ	18,000	1,401.00	25,218,000	
佐鳥電機	3,000	1,893.00	5,679,000	
カッパ・クリエイト	9,700	1,626.00	15,772,200	
伯東	3,500	5,250.00	18,375,000	
コンドーテック	4,900	1,136.00	5,566,400	
中山福	13,500	351.00	4,738,500	
ライトオン	6,600	457.00	3,016,200	
ナガイレーベン	7,800	2,255.00	17,589,000	
三菱食品	5,700	4,545.00	25,906,500	
良品計画	67,600	2,084.00	140,878,400	
松田産業	4,700	2,455.00	11,538,500	
第一興商	24,000	2,192.50	52,620,000	
メディパルホールディングス	64,200	2,341.50	150,324,300	
アドヴァングループ	5,900	1,016.00	5,994,400	
ＳＰＫ	2,900	1,853.00	5,373,700	
萩原電気ホールディングス	2,600	4,575.00	11,895,000	
アルビス	2,200	2,521.00	5,546,200	
アズワン	9,700	5,038.00	48,868,600	
スズデン	2,500	2,187.00	5,467,500	

シモジマ	4,800	1,221.00	5,860,800	
ドウシシャ	5,700	2,097.00	11,952,900	
小津産業	2,300	1,582.00	3,638,600	
高速	3,700	1,965.00	7,270,500	
ハウス　オブ　ローゼ	2,800	1,603.00	4,488,400	
Ｇ－７ホールディングス	6,800	1,175.00	7,990,000	
イオン北海道	18,300	890.00	16,287,000	
コジマ	10,200	662.00	6,752,400	
ヒマラヤ	400	920.00	368,000	
コーナン商事	7,600	3,720.00	28,272,000	
ネットワンシステムズ	23,700	2,065.00	48,940,500	
エコス	2,500	2,186.00	5,465,000	
ワタミ	6,500	1,008.00	6,552,000	
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	3,394.00	424,589,400	
丸文	5,500	1,347.00	7,408,500	
西松屋チェーン	12,200	1,903.00	23,216,600	
ゼンショーホールディングス	30,500	8,817.00	268,918,500	
ハピネット	5,300	2,393.00	12,682,900	
橋本総業ホールディングス	4,500	1,160.00	5,220,000	
日本ライフライン	18,200	1,111.00	20,220,200	
サイゼリヤ	9,200	5,680.00	52,256,000	
ＶＴホールディングス	23,500	516.00	12,126,000	
アルゴグラフィックス	5,400	3,455.00	18,657,000	
魚力	2,500	2,182.00	5,455,000	
ＩＤＯＭ	16,400	899.00	14,743,600	
日本エム・ディ・エム	7,600	691.00	5,251,600	
フジ・コーポレーション	3,100	1,656.00	5,133,600	
ユナイテッドアローズ	7,300	1,786.00	13,037,800	
進和	3,800	2,358.00	8,960,400	
ダイトロン	2,400	2,850.00	6,840,000	
ハイデイ日高	9,200	2,709.00	24,922,800	
シークス	8,800	1,473.00	12,962,400	
コロワイド	26,600	2,320.50	61,725,300	
田中商事	7,100	702.00	4,984,200	
オーハシテクニカ	3,300	1,729.00	5,705,700	
壱番屋	4,900	5,320.00	26,068,000	
白銅	2,500	2,232.00	5,580,000	
スギホールディングス	12,500	6,358.00	79,475,000	
薬王堂ホールディングス	3,000	2,733.00	8,199,000	
島津製作所	77,800	3,785.00	294,473,000	
ＪＭＳ	10,300	516.00	5,314,800	
長野計器	4,300	2,074.00	8,918,200	
ブイ・テクノロジー	3,100	2,218.00	6,875,800	
スター精密	11,000	1,800.00	19,800,000	
東京計器	4,500	1,628.00	7,326,000	
愛知時計電機	2,600	2,294.00	5,964,400	
インターアクション	5,400	996.00	5,378,400	
東京精密	12,000	8,820.00	105,840,000	
マニー	23,400	2,154.00	50,403,600	

ニコン	84,700	1,442.00	122,137,400	
トプコン	28,500	1,535.50	43,761,750	
オリンパス	360,400	2,178.50	785,131,400	
理研計器	4,100	6,130.00	25,133,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	20,000	9,508.00	190,160,000	
キヤノン電子	6,500	1,913.00	12,434,500	
タムロン	3,600	4,305.00	15,498,000	
ＨＯＹＡ	116,300	16,580.00	1,928,254,000	
ノーリツ鋼機	5,500	3,085.00	16,967,500	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	8,500	1,850.00	15,725,000	
朝日インテック	65,400	2,862.50	187,207,500	
キヤノン	292,100	3,693.00	1,078,725,300	
リコー	146,800	1,179.00	173,077,200	
シチズン時計	53,900	864.00	46,569,600	
メニコン	20,100	2,083.50	41,878,350	
スノーピーク	8,400	1,003.00	8,425,200	
パラマウントベッドホールディングス	12,200	2,679.00	32,683,800	
トランザクション	3,900	2,054.00	8,010,600	
ニホンフラッシュ	6,200	911.00	5,648,200	
前田工繊	4,900	3,090.00	15,141,000	
アートネイチャー	6,700	787.00	5,272,900	
バンダイナムコホールディングス	160,400	3,021.00	484,568,400	
ＳＨＯＥＩ	13,200	1,916.00	25,291,200	
フランスベッドホールディングス	7,600	1,245.00	9,462,000	
マーベラス	9,500	686.00	6,517,000	
パイロットコーポレーション	8,200	4,508.00	36,965,600	
萩原工業	3,900	1,611.00	6,282,900	
エイベックス	10,000	1,341.00	13,410,000	
フジシールインターナショナル	11,900	1,681.00	20,003,900	
タカラトミー	26,600	2,042.00	54,317,200	
広済堂ホールディングス	2,600	3,290.00	8,554,000	
レック	7,500	908.00	6,810,000	
プロネクサス	6,100	1,148.00	7,002,800	
大建工業	1,600	2,995.00	4,792,000	
きもと	5,500	187.00	1,028,500	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	72,000	3,296.00	237,312,000	
大日本印刷	64,000	4,002.00	256,128,000	
共同印刷	1,700	3,665.00	6,230,500	
ＮＩＳＳＨＡ	10,000	1,477.00	14,770,000	
藤森工業	4,600	3,805.00	17,503,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,700	2,391.00	8,846,700	
前澤化成工業	3,800	1,560.00	5,928,000	
未来工業	2,100	3,325.00	6,982,500	
アシックス	49,900	5,428.00	270,857,200	
ツツミ	2,300	2,135.00	4,910,500	
ＪＳＰ	4,100	1,769.00	7,252,900	
ニチハ	7,400	2,774.00	20,527,600	
ローランド	4,300	4,430.00	19,049,000	
エフピコ	11,100	2,819.50	31,296,450	
小松ウオール工業	2,400	2,831.00	6,794,400	

ヤマハ	36,900	3,469.00	128,006,100	
河合楽器製作所	1,800	3,175.00	5,715,000	
クリナップ	7,800	672.00	5,241,600	
ピジョン	37,300	1,637.00	61,060,100	
天馬	4,300	2,376.00	10,216,800	
キングジム	6,100	870.00	5,307,000	
象印マホービン	15,900	1,523.00	24,215,700	
リンテック	11,800	2,445.00	28,851,000	
信越ポリマー	12,700	1,418.00	18,008,600	
東リ	11,300	362.00	4,090,600	
イトーキ	12,000	1,320.00	15,840,000	
任天堂	369,700	6,800.00	2,513,960,000	
三菱鉛筆	8,300	1,915.00	15,894,500	
松風	2,600	2,491.00	6,476,600	
タカラスタンダード	12,300	1,729.00	21,266,700	
コクヨ	24,000	2,354.00	56,496,000	
ナカバヤシ	10,600	525.00	5,565,000	
ニフコ	17,600	3,845.00	67,672,000	
グローブライド	5,300	1,987.00	10,531,100	
オカムラ	17,600	2,167.00	38,139,200	
バルカー	4,900	3,775.00	18,497,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,800	1,902.00	3,423,600	
伊藤忠商事	416,500	6,150.00	2,561,475,000	
丸紅	516,500	2,339.00	1,208,093,500	
スクロール	9,200	924.00	8,500,800	
ヨンドシーホールディングス	5,900	1,911.00	11,274,900	
長瀬産業	28,400	2,266.00	64,354,400	
蝶理	3,900	2,810.00	10,959,000	
豊田通商	54,300	8,497.00	461,387,100	
オンワードホールディングス	34,600	491.00	16,988,600	
三共生興	8,600	720.00	6,192,000	
兼松	25,900	2,007.00	51,981,300	
美津濃	5,800	3,975.00	23,055,000	
三井物産	466,800	5,551.00	2,591,206,800	
日本紙パルプ商事	3,000	4,655.00	13,965,000	
東京エレクトロン	123,900	23,905.00	2,961,829,500	
カメイ	6,600	1,614.00	10,652,400	
ＯＵＧホールディングス	1,700	2,375.00	4,037,500	
スターゼン	4,300	2,477.00	10,651,100	
セイコーグループ	8,200	2,500.00	20,500,000	
山善	18,800	1,198.00	22,522,400	
椿本興業	1,300	5,970.00	7,761,000	
住友商事	375,000	3,199.00	1,199,625,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	19,200	4,103.00	78,777,600	
内田洋行	2,500	7,210.00	18,025,000	
三菱商事	409,200	7,059.00	2,888,542,800	
第一実業	5,800	1,920.00	11,136,000	
キヤノンマーケティングジャパン	14,400	3,630.00	52,272,000	
西華産業	2,500	2,499.00	6,247,500	
佐藤商事	4,300	1,488.00	6,398,400	

菱洋エレクトロ	5,900	3,550.00	20,945,000	
東京産業	6,600	824.00	5,438,400	
ユアサ商事	4,800	4,315.00	20,712,000	
神鋼商事	1,600	5,610.00	8,976,000	
阪和興業	11,100	4,345.00	48,229,500	
正栄食品工業	4,100	4,415.00	18,101,500	
カナデン	4,700	1,439.00	6,763,300	
ＲＹＯＤＥＮ	5,000	2,521.00	12,605,000	
ニプロ	48,800	1,097.50	53,558,000	
岩谷産業	14,100	7,161.00	100,970,100	
ナイス	2,900	1,612.00	4,674,800	
極東貿易	3,700	1,790.00	6,623,000	
アステナホールディングス	11,600	499.00	5,788,400	
三愛オブリ	14,900	1,621.00	24,152,900	
稲畑産業	12,200	3,125.00	38,125,000	
ＧＳＩクレオス	3,300	2,002.00	6,606,600	
明和産業	8,400	649.00	5,451,600	
ゴールドウイン	10,400	10,885.00	113,204,000	
ユニ・チャーム	122,400	4,733.00	579,319,200	
デサント	10,100	4,450.00	44,945,000	
ワキタ	10,300	1,484.00	15,285,200	
ヤマトインターナショナル	14,100	297.00	4,187,700	
東邦ホールディングス	17,100	3,281.00	56,105,100	
サンゲツ	14,300	2,765.00	39,539,500	
ミツウロコグループホールディングス	7,900	1,302.00	10,285,800	
シナネンホールディングス	1,700	3,905.00	6,638,500	
伊藤忠エネクス	15,400	1,598.00	24,609,200	
サンリオ	17,600	6,622.00	116,547,200	
サンワ　テクノス	3,200	2,137.00	6,838,400	
リョーサン	4,400	4,650.00	20,460,000	
新光商事	8,300	1,129.00	9,370,700	
トーホー	2,400	3,065.00	7,356,000	
三信電気	2,500	2,173.00	5,432,500	
東陽テクニカ	6,300	1,308.00	8,240,400	
モスフードサービス	9,100	3,205.00	29,165,500	
加賀電子	5,700	6,120.00	34,884,000	
三益半導体工業	4,700	2,696.00	12,671,200	
都築電気	3,100	2,096.00	6,497,600	
立花エレテック	4,100	2,738.00	11,225,800	
木曽路	9,400	2,530.00	23,782,000	
ＳＲＳホールディングス	10,200	1,042.00	10,628,400	
リテールパートナーズ	9,200	1,794.00	16,504,800	
ケーヨー	8,600	1,297.00	11,154,200	
上新電機	6,100	2,260.00	13,786,000	
日本瓦斯	32,800	2,360.50	77,424,400	
ロイヤルホールディングス	10,900	2,646.00	28,841,400	
東天紅	5,400	807.00	4,357,800	
いなげや	6,000	1,590.00	9,540,000	
チヨダ	6,500	828.00	5,382,000	
ライフコーポレーション	6,500	3,405.00	22,132,500	

リンガーハット	8,000	2,319.00	18,552,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	8,900	617.00	5,491,300	
ＡＯＫＩホールディングス	13,300	1,068.00	14,204,400	
オークワ	8,900	831.00	7,395,900	
コメリ	9,500	3,215.00	30,542,500	
青山商事	13,200	1,477.00	19,496,400	
しまむら	7,300	14,885.00	108,660,500	
高島屋	42,800	2,041.50	87,376,200	
松屋	10,500	884.00	9,282,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	27,400	1,647.00	45,127,800	
近鉄百貨店	2,700	2,721.00	7,346,700	
丸井グループ	41,100	2,236.50	91,920,150	
クレディセゾン	36,500	2,352.00	85,848,000	
アクシアル　リテイリング	4,200	3,795.00	15,939,000	
イオン	210,000	3,080.00	646,800,000	
イズミ	11,000	3,574.00	39,314,000	
平和堂	10,400	2,244.00	23,337,600	
フジ	9,500	1,850.00	17,575,000	
ヤオコー	7,000	7,871.00	55,097,000	
ゼビオホールディングス	8,400	925.00	7,770,000	
ケーズホールディングス	43,800	1,280.00	56,064,000	
ＰＡＬＴＡＣ	8,400	4,777.00	40,126,800	
三谷産業	16,800	330.00	5,544,000	
日産東京販売ホールディングス	4,800	431.00	2,068,800	
あおぞら銀行	41,400	3,047.00	126,145,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	3,611,800	1,276.00	4,608,656,800	
りそなホールディングス	672,500	783.30	526,769,250	
三井住友トラスト・ホールディングス	103,600	5,366.00	555,917,600	
三井住友フィナンシャルグループ	410,000	7,466.00	3,061,060,000	
千葉銀行	160,700	1,105.50	177,653,850	
群馬銀行	111,900	675.90	75,633,210	
武蔵野銀行	8,000	2,740.00	21,920,000	
千葉興業銀行	9,500	845.00	8,027,500	
筑波銀行	25,300	261.00	6,603,300	
七十七銀行	16,800	3,325.00	55,860,000	
秋田銀行	3,900	1,988.00	7,753,200	
山形銀行	6,400	1,058.00	6,771,200	
岩手銀行	3,600	2,535.00	9,126,000	
東邦銀行	45,600	285.00	12,996,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	50,200	3,531.00	177,256,200	
スルガ銀行	50,900	700.00	35,630,000	
八十二銀行	123,800	788.40	97,603,920	
山梨中央銀行	6,500	1,914.00	12,441,000	
大垣共立銀行	11,000	1,879.00	20,669,000	
福井銀行	5,200	1,550.00	8,060,000	
清水銀行	3,400	1,566.00	5,324,400	
富山銀行	1,100	1,704.00	1,874,400	
滋賀銀行	9,600	3,765.00	36,144,000	
南都銀行	8,700	2,464.00	21,436,800	
百五銀行	54,300	535.00	29,050,500	

紀陽銀行	20,600	1,595.00	32,857,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	35,700	1,616.00	57,691,200	
山陰合同銀行	36,100	950.00	34,295,000	
百十四銀行	5,700	2,613.00	14,894,100	
四国銀行	8,500	1,012.00	8,602,000	
阿波銀行	8,100	2,514.00	20,363,400	
大分銀行	3,500	2,665.00	9,327,500	
宮崎銀行	3,500	2,731.00	9,558,500	
佐賀銀行	3,400	1,916.00	6,514,400	
琉球銀行	12,300	1,145.00	14,083,500	
セブン銀行	180,800	301.50	54,511,200	
みずほフィナンシャルグループ	778,400	2,562.00	1,994,260,800	
山口フィナンシャルグループ	56,500	1,292.00	72,998,000	
芙蓉総合リース	5,300	11,915.00	63,149,500	
みずほリース	9,700	4,855.00	47,093,500	
東京センチュリー	10,800	5,660.00	61,128,000	
ＳＢＩホールディングス	84,400	3,175.00	267,970,000	
日本証券金融	21,200	1,480.00	31,376,000	
アイフル	84,900	380.00	32,262,000	
名古屋銀行	3,700	5,860.00	21,682,000	
北洋銀行	87,400	374.00	32,687,600	
大光銀行	1,200	1,325.00	1,590,000	
愛媛銀行	7,800	1,040.00	8,112,000	
京葉銀行	24,200	690.00	16,698,000	
栃木銀行	28,800	328.00	9,446,400	
北日本銀行	2,400	2,141.00	5,138,400	
東和銀行	10,600	619.00	6,561,400	
リコーリース	5,500	4,535.00	24,942,500	
イオンフィナンシャルサービス	33,100	1,265.50	41,888,050	
アコム	102,900	336.90	34,667,010	
ジャックス	6,100	5,170.00	31,537,000	
オリエントコーポレーション	18,800	1,075.00	20,210,000	
オリックス	351,500	2,708.50	952,037,750	
三菱ＨＣキャピタル	257,000	960.20	246,771,400	
ジャフコ　グループ	17,200	1,676.50	28,835,800	
トモニホールディングス	46,600	479.00	22,321,400	
大和証券グループ本社	446,800	975.50	435,853,400	
野村ホールディングス	969,800	618.50	599,821,300	
岡三証券グループ	50,600	721.00	36,482,600	
丸三証券	19,200	880.00	16,896,000	
東洋証券	17,400	300.00	5,220,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	68,500	545.00	37,332,500	
光世証券	3,400	522.00	1,774,800	
水戸証券	17,000	439.00	7,463,000	
いちよし証券	10,800	719.00	7,765,200	
松井証券	28,400	752.00	21,356,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	91,400	6,507.00	594,739,800	
日本取引所グループ	150,500	3,078.00	463,239,000	
マネックスグループ	56,500	647.00	36,555,500	

極東証券	7,900	1,062.00	8,389,800	
岩井コスモホールディングス	6,600	1,750.00	11,550,000	
アイザワ証券グループ	8,300	1,178.00	9,777,400	
フィデアホールディングス	6,000	1,490.00	8,940,000	
池田泉州ホールディングス	80,000	359.00	28,720,000	
アニコム　ホールディングス	19,600	579.00	11,348,400	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	129,200	5,383.00	695,483,600	
スパークス・グループ	6,400	1,438.00	9,203,200	
第一生命ホールディングス	281,800	3,042.00	857,235,600	
東京海上ホールディングス	570,100	3,697.00	2,107,659,700	
イー・ギャランティ	9,400	1,803.00	16,948,200	
ＮＥＣキャピタルソリューション	2,800	3,255.00	9,114,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	167,700	2,309.50	387,303,150	
アドバンスクリエイト	5,700	977.00	5,568,900	
三井不動産	266,700	3,459.00	922,515,300	
三菱地所	377,000	1,942.00	732,134,000	
平和不動産	9,400	3,840.00	36,096,000	
東京建物	50,400	2,095.00	105,588,000	
京阪神ビルディング	10,800	1,332.00	14,385,600	
住友不動産	83,400	4,166.00	347,444,400	
テーオーシー	10,300	599.00	6,169,700	
東京楽天地	1,300	4,185.00	5,440,500	
レオパレス２１	57,800	444.00	25,663,200	
スターツコーポレーション	8,300	2,774.00	23,024,200	
フジ住宅	7,600	689.00	5,236,400	
空港施設	9,700	560.00	5,432,000	
ゴールドクレスト	4,700	2,006.00	9,428,200	
リログループ	30,200	1,537.50	46,432,500	
エスリード	2,700	3,055.00	8,248,500	
日神グループホールディングス	10,700	490.00	5,243,000	
日本エスコン	10,800	897.00	9,687,600	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	26,500	454.00	12,031,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	5,600	842.00	4,715,200	
イオンモール	29,900	1,714.50	51,263,550	
ファースト住建	1,500	1,106.00	1,659,000	
カチタス	15,500	2,183.00	33,836,500	
東祥	5,500	792.00	4,356,000	
トーセイ	9,600	1,891.00	18,153,600	
サンフロンティア不動産	8,500	1,553.00	13,200,500	
ＦＪネクストホールディングス	6,100	1,159.00	7,069,900	
グランディハウス	8,700	576.00	5,011,200	
東武鉄道	64,300	3,710.00	238,553,000	
相鉄ホールディングス	21,000	2,659.00	55,839,000	
東急	164,200	1,765.00	289,813,000	
京浜急行電鉄	72,500	1,315.50	95,373,750	
小田急電鉄	96,800	2,171.00	210,152,800	
京王電鉄	28,100	4,105.00	115,350,500	
京成電鉄	37,800	6,220.00	235,116,000	
富士急行	7,200	4,435.00	31,932,000	

東日本旅客鉄道	107,600	7,996.00	860,369,600	
西日本旅客鉄道	69,500	5,882.00	408,799,000	
東海旅客鉄道	225,500	3,514.00	792,407,000	
西武ホールディングス	70,800	1,695.50	120,041,400	
鴻池運輸	10,000	1,977.00	19,770,000	
西日本鉄道	15,600	2,406.50	37,541,400	
ハマキョウレックス	5,000	3,855.00	19,275,000	
サカイ引越センター	6,500	2,545.00	16,542,500	
近鉄グループホールディングス	58,500	4,136.00	241,956,000	
阪急阪神ホールディングス	78,000	4,592.00	358,176,000	
南海電気鉄道	26,100	2,940.50	76,747,050	
京阪ホールディングス	32,200	3,850.00	123,970,000	
神戸電鉄	2,000	2,907.00	5,814,000	
名古屋鉄道	60,300	2,107.50	127,082,250	
山陽電気鉄道	4,400	2,120.00	9,328,000	
アルプス物流	4,700	1,612.00	7,576,400	
トランコム	1,700	7,500.00	12,750,000	
ヤマトホールディングス	74,900	2,589.50	193,953,550	
山九	14,900	4,950.00	73,755,000	
日新	4,400	2,482.00	10,920,800	
丸全昭和運輸	3,600	3,825.00	13,770,000	
センコーグループホールディングス	31,000	1,047.00	32,457,000	
トナミホールディングス	1,300	4,370.00	5,681,000	
ニッコンホールディングス	18,700	3,226.00	60,326,200	
福山通運	6,700	3,625.00	24,287,500	
セイノーホールディングス	32,900	2,037.50	67,033,750	
神奈川中央交通	1,800	3,055.00	5,499,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	14,100	1,940.00	27,354,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	5,600	1,430.00	8,008,000	
日本郵船	167,600	3,770.00	631,852,000	
商船三井	126,900	3,883.00	492,752,700	
川崎汽船	49,400	4,784.00	236,329,600	
ＮＳユナイテッド海運	3,100	4,565.00	14,151,500	
明海グループ	3,400	665.00	2,261,000	
飯野海運	21,500	1,148.00	24,682,000	
共栄タンカー	600	818.00	490,800	
九州旅客鉄道	41,300	3,062.00	126,460,600	
ＳＧホールディングス	98,200	2,139.00	210,049,800	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	19,800	7,581.00	150,103,800	
ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス	3,600	3,305.00	11,898,000	
日本航空	143,600	2,886.50	414,501,400	
ＡＮＡホールディングス	159,100	3,105.00	494,005,500	
パスコ	600	1,576.00	945,600	
ＴＲＥホールディングス	11,500	1,154.00	13,271,000	
人・夢・技術グループ	3,300	1,795.00	5,923,500	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,600	6,290.00	10,064,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	2,700	5,080.00	13,716,000	
ＫＰＰグループホールディングス	16,000	694.00	11,104,000	

ナルミヤ・インターナショナル	3,300	1,121.00	3,699,300	
ギフトホールディングス	2,600	2,123.00	5,519,800	
三菱倉庫	14,400	4,327.00	62,308,800	
三井倉庫ホールディングス	5,500	4,630.00	25,465,000	
住友倉庫	15,800	2,422.00	38,267,600	
澁澤倉庫	2,700	2,746.00	7,414,200	
ヤマタネ	2,700	2,160.00	5,832,000	
乾汽船	6,900	1,103.00	7,610,700	
日本トランスシティ	11,800	617.00	7,280,600	
中央倉庫	5,100	1,086.00	5,538,600	
安田倉庫	4,300	1,088.00	4,678,400	
大栄環境	10,900	2,306.00	25,135,400	
日本管財ホールディングス	6,300	2,497.00	15,731,100	
上組	28,000	3,165.00	88,620,000	
キユーソー流通システム	5,700	923.00	5,261,100	
エーアイテイー	3,700	1,653.00	6,116,100	
内外トランスライン	2,300	2,431.00	5,591,300	
日本コンセプト	3,200	1,662.00	5,318,400	
ＴＢＳホールディングス	30,100	2,565.50	77,221,550	
日本テレビホールディングス	52,000	1,411.50	73,398,000	
朝日放送グループホールディングス	8,200	633.00	5,190,600	
テレビ朝日ホールディングス	14,300	1,595.00	22,808,500	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	45,600	660.00	30,096,000	
テレビ東京ホールディングス	4,200	2,841.00	11,932,200	
ビジョン	8,800	1,212.00	10,665,600	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,600	3,555.00	23,463,000	
日本通信	57,800	216.00	12,484,800	
日本電信電話	17,469,200	173.50	3,030,906,200	
ＫＤＤＩ	453,800	4,616.00	2,094,740,800	
ソフトバンク	944,800	1,750.50	1,653,872,400	
光通信	5,900	22,610.00	133,399,000	
エムティーアイ	5,200	576.00	2,995,200	
GMOインターネットグループ	21,700	2,337.00	50,712,900	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	31,000	2,724.00	84,444,000	
学研ホールディングス	9,800	937.00	9,182,600	
ゼンリン	10,000	875.00	8,750,000	
東京電力ホールディングス	527,800	665.90	351,462,020	
中部電力	215,800	1,807.00	389,950,600	
関西電力	226,100	1,953.50	441,686,350	
中国電力	101,700	982.20	99,889,740	
北陸電力	59,900	744.60	44,601,540	
東北電力	154,200	939.00	144,793,800	
四国電力	54,500	1,028.50	56,053,250	
九州電力	135,000	1,000.50	135,067,500	
北海道電力	56,600	634.70	35,924,020	
沖縄電力	15,000	1,046.00	15,690,000	
電源開発	48,100	2,292.00	110,245,200	
エフオン	2,400	480.00	1,152,000	
イーレックス	10,400	681.00	7,082,400	

レノバ	15,600	1,134.00	17,690,400	
東京瓦斯	123,800	3,285.00	406,683,000	
大阪瓦斯	118,600	2,876.00	341,093,600	
東邦瓦斯	25,400	2,614.50	66,408,300	
北海道瓦斯	3,500	2,275.00	7,962,500	
広島ガス	13,900	373.00	5,184,700	
西部ガスホールディングス	6,100	1,879.00	11,461,900	
静岡ガス	11,700	1,008.00	11,793,600	
メタウォーター	7,000	2,042.00	14,294,000	
M&A総研ホールディングス	2,900	3,555.00	10,309,500	
アイネット	3,600	1,789.00	6,440,400	
松竹	3,100	9,640.00	29,884,000	
東宝	32,700	5,058.00	165,396,600	
エイチ・アイ・エス	17,500	1,768.00	30,940,000	
東映	1,900	17,750.00	33,725,000	
ラックランド	2,700	2,641.00	7,130,700	
ＮＴＴデータグループ	153,600	1,852.00	284,467,200	
共立メンテナンス	9,400	6,149.00	57,800,600	
イチネンホールディングス	6,400	1,541.00	9,862,400	
建設技術研究所	3,100	4,635.00	14,368,500	
スペース	6,000	903.00	5,418,000	
アインホールディングス	8,500	4,277.00	36,354,500	
燦ホールディングス	5,600	1,058.00	5,924,800	
ピー・シー・エー	5,000	1,170.00	5,850,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,600	2,069.00	5,379,400	
ナガワ	1,900	6,400.00	12,160,000	
東京都競馬	5,000	4,275.00	21,375,000	
カナモト	9,300	2,530.00	23,529,000	
ＤＴＳ	12,500	3,285.00	41,062,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	26,800	5,177.00	138,743,600	
シーイーシー	7,400	1,709.00	12,646,600	
カプコン	52,500	5,047.00	264,967,500	
ニシオホールディングス	5,600	3,595.00	20,132,000	
アイ・エス・ビー	4,200	1,484.00	6,232,800	
日本空港ビルデング	20,400	6,923.00	141,229,200	
トランス・コスモス	7,500	3,110.00	23,325,000	
乃村工藝社	26,300	826.00	21,723,800	
ジャステック	3,600	1,517.00	5,461,200	
ＳＣＳＫ	41,100	2,750.50	113,045,550	
藤田観光	2,400	4,045.00	9,708,000	
トーカイ	5,300	1,896.00	10,048,800	
セコム	61,300	10,600.00	649,780,000	
ＮＳＷ	2,600	2,886.00	7,503,600	
セントラル警備保障	3,200	2,468.00	7,897,600	
アイネス	4,600	1,539.00	7,079,400	
丹青社	11,700	877.00	10,260,900	
メイテックグループホールディングス	21,700	2,894.50	62,810,650	
ＴＫＣ	9,300	3,470.00	32,271,000	
富士ソフト	11,800	5,650.00	66,670,000	

応用地質	5,600	2,089.00	11,698,400	
船井総研ホールディングス	12,500	2,524.00	31,550,000	
ＮＳＤ	21,000	2,617.00	54,957,000	
コナミグループ	22,000	7,456.00	164,032,000	
学究社	2,700	1,940.00	5,238,000	
ベネッセホールディングス	20,200	2,613.00	52,782,600	
イオンディライト	6,700	3,390.00	22,713,000	
ナック	5,700	971.00	5,534,700	
福井コンピュータホールディングス	3,600	2,588.00	9,316,800	
ダイセキ	12,300	4,120.00	50,676,000	
ステップ	3,200	1,851.00	5,923,200	
泉州電業	3,100	3,240.00	10,044,000	
元気寿司	3,500	3,305.00	11,567,500	
トラスコ中山	13,000	2,246.00	29,198,000	
ヤマダホールディングス	190,500	428.90	81,705,450	
オートバックスセブン	21,600	1,510.50	32,626,800	
モリト	4,400	1,361.00	5,988,400	
アークランズ	18,400	1,614.00	29,697,600	
ニトリホールディングス	22,600	15,615.00	352,899,000	
愛眼	1,400	171.00	239,400	
ケーユーホールディングス	5,000	1,124.00	5,620,000	
吉野家ホールディングス	22,800	3,392.00	77,337,600	
加藤産業	7,700	4,595.00	35,381,500	
イノテック	3,900	1,629.00	6,353,100	
イエローハット	9,800	1,726.00	16,914,800	
松屋フーズホールディングス	2,900	4,810.00	13,949,000	
ＪＢＣＣホールディングス	3,900	3,255.00	12,694,500	
ＪＫホールディングス	5,700	954.00	5,437,800	
サガミホールディングス	9,300	1,375.00	12,787,500	
日伝	4,200	2,500.00	10,500,000	
関西フードマーケット	4,200	1,402.00	5,888,400	
ミロク情報サービス	5,300	1,574.00	8,342,200	
北沢産業	10,100	287.00	2,898,700	
杉本商事	3,000	2,186.00	6,558,000	
因幡電機産業	16,100	3,190.00	51,359,000	
王将フードサービス	4,600	7,870.00	36,202,000	
ミニストップ	4,500	1,524.00	6,858,000	
アークス	11,400	2,725.00	31,065,000	
バローホールディングス	11,800	2,322.00	27,399,600	
東テク	2,100	4,785.00	10,048,500	
ミスミグループ本社	93,500	2,473.50	231,272,250	
ベルク	3,100	6,550.00	20,305,000	
大　庄	4,400	1,239.00	5,451,600	
ファーストリテイリング	27,900	36,820.00	1,027,278,000	
ソフトバンクグループ	289,700	6,160.00	1,784,552,000	
スズケン	23,600	5,006.00	118,141,600	
サンドラッグ	20,900	4,338.00	90,664,200	
サックスバー　ホールディングス	6,300	916.00	5,770,800	
ジェコス	5,700	981.00	5,591,700	
ヤマザワ	3,400	1,261.00	4,287,400	

ベルーナ	14,900	616.00	9,178,400	
合計	88,544,200		197,600,501,060	

（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11月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,715,957,241
金銭信託	376,584,134
コール・ローン	17,809,384,820
株式	780,690,036,233
投資証券	15,356,225,963
派生商品評価勘定	892,480,083
未収入金	251,177,431
未収配当金	950,156,766
差入委託証拠金	10,986,378,000
流動資産合計	829,028,380,671
資産合計	829,028,380,671
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	163,513,432
未払解約金	1,806,984,938
その他未払費用	18,403
流動負債合計	1,970,516,773
負債合計	1,970,516,773
純資産の部	
元本等	
元本	220,818,463,085
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	606,239,400,813
元本等合計	827,057,863,898
純資産合計	827,057,863,898
負債純資産合計	829,028,380,671

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11月22日 至　2023年11月20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11月20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	196,274,174,923円
同期中追加設定元本額	49,199,373,042円
同期中一部解約元本額	24,655,084,880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）	794,706,462円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,806,956,625円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,508,595,111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）	2,154,739,003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）	949,369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）	5,648,440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）	5,790,300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）	326,433,259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	158,220,790,915円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	39,070,481,438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）	2,629,645,151円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	395,039,390円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	177,542,196円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	454,908,719円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	677,865,953円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	13,655,388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）	94,377,931円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	7,675,694円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	10,219,362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）	3,714,441円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	21,299,634円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	312,220,561円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	199,356,481円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	390,015,492円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	184,195,638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）	161,299,099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）	253,851,314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）	162,468,312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）	159,155,707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）	158,496,026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）	141,595,628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）	30,410,953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）	6,069,453,038円
ＦＷニッセイ先進国株インデックス	56,059,397円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	58,158,827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）	100,296,022円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	395,809円
計	220,818,463,085円
２．　受益権の総数	220,818,463,085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11月22日 至　2023年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	37,287,559,381
投資証券	△253,774,971
合計	37,033,784,410

（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5月23日から2023年11月20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11月20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	15,040,401,421	－	14,963,312,969	△77,088,452
アメリカ・ドル	11,046,360,127	－	10,932,608,017	△113,752,110
イギリス・ポンド	1,312,924,405	－	1,322,947,925	10,023,520
ユーロ	2,681,116,889	－	2,707,757,027	26,640,138
合計	15,040,401,421	－	14,963,312,969	△77,088,452

（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11月20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	29,105,566,948	－	29,911,622,049	806,055,101
合計	29,105,566,948	－	29,911,622,049	806,055,101

（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11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.7454円 (37,454円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年11月20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	54,857	95.340	5,230,066.38	
	ABBOTT LABORATORIES	172,846	99.550	17,206,819.30	
	ABBVIE INC	175,364	138.300	24,252,841.20	
	ACCENTURE PLC	62,697	327.830	20,553,957.51	
	ADOBE INC	45,300	602.660	27,300,498.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	160,060	120.620	19,306,437.20	
	AECOM	13,116	86.980	1,140,829.68	
	AERCAP HOLDINGS NV	15,312	68.590	1,050,250.08	
	AES CORP	66,550	17.010	1,132,015.50	
	AFLAC INC	57,028	81.770	4,663,179.56	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,367	113.150	3,322,876.05	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	22,081	269.990	5,961,649.19	
	AIRBNB INC-CLASS A	40,989	127.150	5,211,751.35	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	15,119	112.370	1,698,922.03	
	ALBEMARLE CORP	11,663	127.390	1,485,749.57	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	31,455	21.010	660,869.55	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	7,225	206.640	1,492,974.00	
	ALLEGION PLC	8,744	106.350	929,924.40	
	ALLIANT ENERGY CORP	24,963	49.230	1,228,928.49	
	ALLSTATE CORP	26,137	134.190	3,507,324.03	
	ALLY FINANCIAL INC	26,904	27.510	740,129.04	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,382	163.730	2,027,304.86	
	ALPHABET INC-CL A	590,278	135.310	79,870,516.18	
	ALPHABET INC-CL C	525,637	136.940	71,980,730.78	
	ALTRIA GROUP INC	177,462	40.820	7,243,998.84	
	AMAZON.COM INC	917,816	145.180	133,248,526.88	
	AMCOR PLC	146,558	9.370	1,373,248.46	
	AMEREN CORPORATION	26,086	77.120	2,011,752.32	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	51,163	77.390	3,959,504.57	
	AMERICAN EXPRESS CO	62,795	162.560	10,207,955.20	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,198	109.160	785,733.68	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	71,869	64.480	4,634,113.12	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	19,341	132.100	2,554,946.10	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,344	347.830	3,597,953.52	
AMETEK INC	22,907	155.660	3,565,703.62	
AMGEN INC	53,110	265.390	14,094,862.90	
AMPHENOL CORP-CL A	59,174	89.700	5,307,907.80	
ANALOG DEVICES INC	49,846	183.050	9,124,310.30	
ANSYS INC	8,614	299.460	2,579,548.44	
AON PLC	20,301	329.740	6,694,051.74	
APA CORP	30,618	36.870	1,128,885.66	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	39,480	86.840	3,428,443.20	
APPLE INC	1,563,302	189.690	296,542,756.38	
APPLIED MATERIALS INC	83,459	148.590	12,401,172.81	
APTIV PLC	28,126	81.180	2,283,268.68	
ARAMARK	24,598	27.710	681,610.58	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	36,972	83.600	3,090,859.20	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,132	73.960	4,003,602.72	
ARES MANAGEMENT CORP - A	15,960	107.080	1,708,996.80	
ARISTA NETWORKS INC	26,046	214.630	5,590,252.98	
ARROW ELECTRONICS INC	5,705	123.490	704,510.45	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,295	245.450	5,226,857.75	
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,904	183.660	533,348.64	
ASSURANT INC	5,281	161.280	851,719.68	
AT&T INC	711,842	15.900	11,318,287.80	
ATLASSIAN CORP-CL A	15,096	184.990	2,792,609.04	
ATMOS ENERGY CORP	14,346	113.900	1,634,009.40	
AUTODESK INC	21,241	217.330	4,616,306.53	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	41,065	229.390	9,419,900.35	
AUTOZONE INC	1,804	2,627.050	4,739,198.20	
AVANTOR INC	67,132	19.340	1,298,332.88	
AVERY DENNISON CORP	8,028	189.960	1,524,998.88	
AXON ENTERPRISE INC	6,978	223.480	1,559,443.44	
BAKER HUGHES COMPANY	100,612	33.710	3,391,630.52	
BALL CORP	31,273	52.360	1,637,454.28	
BANK OF AMERICA CORP	712,853	29.980	21,371,332.94	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	77,380	47.200	3,652,336.00	
BATH & BODY WORKS INC	21,613	29.360	634,557.68	
BAXTER INTERNATIONAL INC	50,268	35.460	1,782,503.28	
BECTON DICKINSON & CO	28,228	233.270	6,584,745.56	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	21,005	52.890	1,110,954.45	

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	128,804	358.930	46,231,619.72	
BEST BUY CO INC	19,519	68.220	1,331,586.18	
BILL HOLDINGS, INC.	9,510	63.720	605,977.20	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,198	299.360	657,993.28	
BIO-TECHNE CORP	15,656	61.050	955,798.80	
BIOGEN INC	14,383	228.000	3,279,324.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18,662	87.520	1,633,298.24	
BLACKROCK INC	14,885	716.860	10,670,461.10	
BLACKSTONE INC	70,182	104.960	7,366,302.72	
BLOCK INC	54,114	58.190	3,148,893.66	
BOEING CO	56,802	208.040	11,817,088.08	
BOOKING HOLDINGS INC	3,671	3,135.250	11,509,502.75	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,012	126.820	1,650,181.84	
BORGWARNER INC	23,286	34.420	801,504.12	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	142,872	54.340	7,763,664.48	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	208,835	50.840	10,617,171.40	
BROADCOM INC	41,017	977.730	40,103,551.41	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	11,728	182.700	2,142,705.60	
BROWN & BROWN INC	23,958	73.010	1,749,173.58	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	30,841	58.510	1,804,506.91	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	12,728	133.590	1,700,333.52	
BUNGE GLOBAL SA	14,962	106.800	1,597,941.60	
BURLINGTON STORES INC	6,451	136.000	877,336.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,570	82.600	955,682.00	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	27,099	268.270	7,269,848.73	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,388	45.910	981,923.08	
CAMPBELL SOUP CO	19,287	40.880	788,452.56	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,942	107.680	4,085,594.56	
CARDINAL HEALTH INC	25,288	103.390	2,614,526.32	
CARLISLE COS INC	5,065	273.260	1,384,061.90	
CARLYLE GROUP INC/THE	21,579	31.850	687,291.15	
CARMAX INC	15,721	63.970	1,005,672.37	
CARNIVAL CORP	100,092	14.790	1,480,360.68	
CARRIER GLOBAL CORP	82,969	53.220	4,415,610.18	
CATALENT INC	17,927	39.870	714,749.49	
CATERPILLAR INC	51,222	253.070	12,962,751.54	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,489	176.660	1,852,986.74	
CBRE GROUP INC	30,892	78.140	2,413,900.88	
CDW CORP/DE	13,399	215.290	2,884,670.71	
CELANESE CORP-SERIES A	10,270	129.930	1,334,381.10	

CENCORA, INC.	17,078	195.000	3,330,210.00	
CENTENE CORP	54,564	72.610	3,961,892.04	
CENTERPOINT ENERGY INC	62,627	27.800	1,741,030.60	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14,638	69.290	1,014,267.02	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,359	77.460	1,499,548.14	
CHARLES RIVER LABORATORIES	5,089	189.040	962,024.56	
CHARLES SCHWAB CORP	149,463	56.780	8,486,509.14	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	9,726	407.700	3,965,290.20	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,291	142.360	1,322,666.76	
CHENIERE ENERGY INC	24,134	173.500	4,187,249.00	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,297	81.580	921,609.26	
CHEVRON CORP	180,337	144.460	26,051,483.02	
CHEWY INC - CLASS A	11,572	20.520	237,457.44	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,742	2,162.220	5,928,807.24	
CHUBB LTD	41,160	222.630	9,163,450.80	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,281	92.400	2,243,564.40	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,624	100.890	1,576,305.36	
CINTAS CORP	9,097	547.970	4,984,883.09	
CISCO SYSTEMS INC	405,041	47.755	19,342,732.95	
CITIGROUP INC	193,484	45.360	8,776,434.24	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	48,071	27.770	1,334,931.67	
CLARIVATE PLC	33,739	7.210	243,258.19	
CLEVELAND-CLIFFS INC	51,226	16.990	870,329.74	
CLOROX CO	12,292	139.170	1,710,677.64	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	27,332	72.690	1,986,763.08	
CME GROUP INC	35,757	213.420	7,631,258.94	
CMS ENERGY CORP	28,964	57.400	1,662,533.60	
COCA-COLA CO	408,394	57.260	23,384,640.44	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	20,486	60.080	1,230,798.88	
COGNEX CORP	17,166	36.940	634,112.04	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	50,429	69.530	3,506,328.37	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	16,718	99.050	1,655,917.90	
COLGATE-PALMOLIVE CO	78,369	75.580	5,923,129.02	
COMCAST CORP	413,412	42.420	17,536,937.04	
CONAGRA BRANDS INC	47,463	28.180	1,337,507.34	
CONFLUENT INC-CLASS A	16,266	19.010	309,216.66	
CONOCOPHILLIPS	120,264	114.590	13,781,051.76	
CONSOLIDATED EDISON INC	34,424	91.360	3,144,976.64	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,395	235.630	3,863,153.85	

CONSTELLATION ENERGY	32,232	121.690	3,922,312.08	
COOPER COS INC/THE	4,918	337.120	1,657,956.16	
COPART INC	85,394	50.220	4,288,486.68	
CORNING INC	80,312	28.480	2,287,285.76	
CORTEVA INC	70,661	47.320	3,343,678.52	
COSTAR GROUP INC	40,609	82.730	3,359,582.57	
COSTCO WHOLESALE CORP	44,046	577.150	25,421,148.90	
COTERRA ENERGY INC	75,285	26.750	2,013,873.75	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	22,277	207.090	4,613,343.93	
CROWN HOLDINGS INC	11,932	83.590	997,395.88	
CSX CORP	203,565	31.620	6,436,725.30	
CUMMINS INC	14,074	225.500	3,173,687.00	
CVS HEALTH CORP	127,446	68.810	8,769,559.26	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,148	189.270	785,091.96	
DANAHER CORP	69,678	207.780	14,477,694.84	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,019	155.860	1,873,281.34	
DARLING INTERNATIONAL INC	15,858	43.560	690,774.48	
DATADOG INC - CLASS A	25,031	109.540	2,741,895.74	
DAVITA INC	5,396	96.160	518,879.36	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,598	620.510	1,612,084.98	
DEERE & CO	27,684	384.150	10,634,808.60	
DELL TECHNOLOGIES -C	25,441	73.600	1,872,457.60	
DELTA AIR LINES INC	15,952	36.060	575,229.12	
DENTSPLY SIRONA INC	21,117	29.690	626,963.73	
DEVON ENERGY CORPORATION	63,789	45.360	2,893,469.04	
DEXCOM INC	38,529	104.970	4,044,389.13	
DIAMONDBACK ENERGY INC	17,081	156.150	2,667,198.15	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,224	118.080	734,929.92	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	25,235	86.380	2,179,799.30	
DOCUSIGN INC	20,116	42.950	863,982.20	
DOLLAR GENERAL CORP	21,806	121.110	2,640,924.66	
DOLLAR TREE INC	20,809	115.000	2,393,035.00	
DOMINION ENERGY INC	83,129	46.760	3,887,112.04	
DOMINO'S PIZZA INC	3,512	372.420	1,307,939.04	
DOORDASH INC - A	25,117	95.230	2,391,891.91	
DOVER CORP	13,906	137.790	1,916,107.74	
DOW INC	70,321	51.700	3,635,595.70	
DR HORTON INC	30,492	128.060	3,904,805.52	
DRAFTKINGS INC	41,355	38.370	1,586,791.35	
DROPBOX INC-CLASS A	25,714	27.140	697,877.96	
DTE ENERGY COMPANY	20,481	103.600	2,121,831.60	
DUKE ENERGY CORP	76,614	90.010	6,896,026.14	
DUPONT DE NEMOURS INC	45,594	71.220	3,247,204.68	
DYNATRACE INC	24,755	51.200	1,267,456.00	

EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,849	81.520	965,930.48	
EATON CORP PLC	39,617	227.800	9,024,752.60	
EBAY INC	53,138	40.140	2,132,959.32	
ECOLAB INC	25,472	184.350	4,695,763.20	
EDISON INTERNATIONAL	38,038	65.930	2,507,845.34	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	60,256	66.900	4,031,126.40	
ELECTRONIC ARTS INC	25,693	133.700	3,435,154.10	
ELEVANCE HEALTH, INC	23,563	462.950	10,908,490.85	
ELI LILLY & CO	80,197	591.710	47,453,366.87	
EMERSON ELECTRIC CO	56,799	89.270	5,070,446.73	
ENPHASE ENERGY INC	13,628	92.860	1,265,496.08	
ENTEGRIS INC	14,882	102.860	1,530,762.52	
ENTERGY CORP	21,020	99.110	2,083,292.20	
EOG RESOURCES INC	58,124	124.000	7,207,376.00	
EPAM SYSTEMS INC	5,757	258.240	1,486,687.68	
EQT CORP	35,930	40.370	1,450,494.10	
EQUIFAX INC	12,192	205.210	2,501,920.32	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,316	28.380	1,002,268.08	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,527	280.010	707,585.27	
ESSENTIAL UTILITIES INC	24,988	35.570	888,823.16	
ESTEE LAUDER COS INC	23,063	123.810	2,855,430.03	
ETSY INC	12,268	72.530	889,798.04	
EVEREST GROUP LTD	4,257	396.300	1,687,049.10	
EVERGY INC	22,818	50.390	1,149,799.02	
EVERSOURCE ENERGY	34,684	58.510	2,029,360.84	
EXACT SCIENCES CORP	17,930	66.300	1,188,759.00	
EXELON CORP	98,803	38.950	3,848,376.85	
EXPEDIA GROUP INC	14,168	136.380	1,932,231.84	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	15,176	118.980	1,805,640.48	
EXXON MOBIL CORP	401,789	104.960	42,171,773.44	
F5 INC	6,006	163.080	979,458.48	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,791	457.340	1,733,775.94	
FAIR ISAAC CORP	2,483	1,042.270	2,587,956.41	
FASTENAL CO	56,798	60.750	3,450,478.50	
FEDEX CORP	23,729	255.950	6,073,437.55	
FERGUSON PLC	20,323	166.480	3,383,373.04	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	25,714	45.050	1,158,415.70	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	58,915	54.670	3,220,883.05	
FIFTH THIRD BANCORP	67,677	27.560	1,865,178.12	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,074	1,460.110	1,568,158.14	
FIRST HORIZON NATIONAL CORP	52,806	12.350	652,154.10	

FIRST SOLAR INC	10,086	155.020	1,563,531.72	
FIRSTENERGY CORP	54,088	37.180	2,010,991.84	
FISERV INC	61,358	124.080	7,613,300.64	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,971	232.810	1,622,918.51	
FMC CORP	12,441	53.650	667,459.65	
FORD MOTOR CO	390,619	10.270	4,011,657.13	
FORTINET INC	66,327	51.260	3,399,922.02	
FORTIVE CORP	35,129	68.100	2,392,284.90	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	12,587	67.240	846,349.88	
FOX CORP - CLASS A	26,377	30.360	800,805.72	
FOX CORP- CLASS B	14,432	28.430	410,301.76	
FRANKLIN RESOURCES INC	29,838	24.270	724,168.26	
FREEPORT-MCMORAN INC	142,427	36.000	5,127,372.00	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,481	59.570	326,503.17	
GARMIN LTD	15,225	119.510	1,819,539.75	
GARTNER INC	7,854	417.610	3,279,908.94	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	40,664	73.000	2,968,472.00	
GEN DIGITAL INC	57,296	20.660	1,183,735.36	
GENERAC HOLDINGS INC	6,185	114.120	705,832.20	
GENERAL DYNAMICS CORP	23,183	244.690	5,672,648.27	
GENERAL ELECTRIC CO	108,217	119.930	12,978,464.81	
GENERAL MILLS INC	58,186	64.760	3,768,125.36	
GENERAL MOTORS CO	138,143	28.030	3,872,148.29	
GENUINE PARTS CO	13,971	137.410	1,919,755.11	
GILEAD SCIENCES INC	123,982	75.450	9,354,441.90	
GLOBAL PAYMENTS INC	26,039	112.050	2,917,669.95	
GLOBAL-E ONLINE LTD	8,980	30.520	274,069.60	
GLOBE LIFE INC	9,000	118.300	1,064,700.00	
GODADDY INC - CLASS A	14,543	92.110	1,339,555.73	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,038	339.190	11,206,159.22	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	186,303	3.310	616,662.93	
GRACO INC	16,745	80.590	1,349,479.55	
HALLIBURTON CO	89,652	37.990	3,405,879.48	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	30,804	76.540	2,357,738.16	
HASBRO INC	13,100	45.150	591,465.00	
HCA HEALTHCARE INC	20,512	246.380	5,053,746.56	
HEICO CORP	4,323	169.970	734,780.31	
HEICO CORP-CLASS A	7,401	136.150	1,007,646.15	
HENRY SCHEIN INC	13,016	68.750	894,850.00	
HERSHEY CO/THE	14,644	196.000	2,870,224.00	
HESS CORP	27,460	144.450	3,966,597.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	128,301	15.930	2,043,834.93	
HF SINCLAIR CORP	15,268	53.680	819,586.24	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	26,295	168.290	4,425,185.55	

HOLOGIC INC	24,454	71.870	1,757,508.98	
HOME DEPOT INC	99,929	307.270	30,705,183.83	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	66,175	191.210	12,653,321.75	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	110,300	3.290	362,887.00	
HORMEL FOODS CORP	29,920	32.520	972,998.40	
HOWMET AEROSPACE INC	38,971	51.470	2,005,837.37	
HP INC	88,178	28.310	2,496,319.18	
HUBBELL INC	5,325	300.860	1,602,079.50	
HUBSPOT INC	4,686	468.620	2,195,953.32	
HUMANA INC	12,419	498.090	6,185,779.71	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	143,562	11.080	1,590,666.96	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3,965	236.750	938,713.75	
HYATT HOTELS CORP - CL A	4,643	115.330	535,477.19	
IDEX CORP	7,516	198.010	1,488,243.16	
IDEXX LABORATORIES INC	8,249	463.690	3,824,978.81	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	30,212	239.920	7,248,463.04	
ILLUMINA INC	15,720	94.320	1,482,710.40	
INCYTE CORP	18,851	54.270	1,023,043.77	
INGERSOLL-RAND INC	40,222	70.320	2,828,411.04	
INSULET CORP	6,930	174.060	1,206,235.80	
INTEL CORP	414,567	43.810	18,162,180.27	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	55,644	111.400	6,198,741.60	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	90,256	152.890	13,799,239.84	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	25,391	73.940	1,877,410.54	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,792	33.380	1,094,596.96	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	38,381	30.340	1,164,479.54	
INTUIT INC	27,836	560.160	15,592,613.76	
INTUITIVE SURGICAL INC	34,825	305.280	10,631,376.00	
INVESCO LTD	34,139	13.840	472,483.76	
IQVIA HOLDINGS INC	18,442	204.790	3,776,737.18	
JABIL CIRCUIT INC	12,988	131.390	1,706,493.32	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,247	152.300	1,103,718.10	
JACOBS SOLUTIONS INC	12,603	135.320	1,705,437.96	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	15,800	39.800	628,840.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,371	120.560	768,087.76	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,235	178.080	1,466,488.80	
JM SMUCKER CO	10,145	111.690	1,133,095.05	
JOHNSON & JOHNSON	239,326	149.790	35,848,641.54	

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	68,202	52.240	3,562,872.48	
JPMORGAN CHASE & CO	290,442	152.820	44,385,346.44	
JUNIPER NETWORKS INC	31,986	26.990	863,302.14	
KELLANOVA	27,283	52.800	1,440,542.40	
KENVUE INC	152,304	19.680	2,997,342.72	
KEURIG DR PEPPER INC	90,747	31.730	2,879,402.31	
KEYCORP	93,076	12.320	1,146,696.32	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	17,732	133.180	2,361,547.76	
KIMBERLY-CLARK CORP	33,553	121.200	4,066,623.60	
KINDER MORGAN INC	200,529	16.960	3,400,971.84	
KKR & CO INC -A	60,044	66.920	4,018,144.48	
KLA CORPORATION	13,635	544.540	7,424,802.90	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	15,982	51.480	822,753.36	
KRAFT HEINZ CO/THE	85,405	33.660	2,874,732.30	
KROGER CO	67,762	42.440	2,875,819.28	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,845	185.690	3,499,328.05	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	8,805	211.720	1,864,194.60	
LAM RESEARCH CORP	13,352	700.340	9,350,939.68	
LAMB WESTON HOLDING INC	14,479	95.800	1,387,088.20	
LAS VEGAS SANDS CORP	34,175	49.080	1,677,309.00	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	13,678	58.070	794,281.46	
LEAR CORP	5,868	134.190	787,426.92	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,948	105.260	1,362,906.48	
LENNAR CORP-CL A	25,080	127.490	3,197,449.20	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,173	405.610	1,287,000.53	
LIBERTY BROADBAND-C	11,890	83.330	990,793.70	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	25,182	17.470	439,929.54	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	16,286	25.980	423,110.28	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	19,639	63.860	1,254,146.54	
LINDE PLC	48,664	407.880	19,849,072.32	
LIVE NATION INC	15,996	89.600	1,433,241.60	
LKQ CORP	26,550	45.530	1,208,821.50	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,657	444.680	10,075,114.76	
LOEWS CORP	19,181	67.000	1,285,127.00	
LOWE'S COS INC	58,239	203.700	11,863,284.30	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	7,717	224.460	1,732,157.82	
LUCID GROUP INC	90,587	4.250	384,994.75	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,515	422.440	4,864,396.60	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	25,862	97.230	2,514,562.26	
M&T BANK CORP	16,487	126.730	2,089,397.51	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	6,158	221.860	1,366,213.88	

MARATHON OIL CORP	61,258	25.560	1,565,754.48	
MARATHON PETROLEUM CORP	42,133	147.900	6,231,470.70	
MARKEL GROUP INC	1,259	1,403.480	1,766,981.32	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,745	228.180	854,534.10	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	25,622	205.770	5,272,238.94	
MARSH & MCLENNAN COS INC	49,172	197.860	9,729,171.92	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,158	462.060	2,845,365.48	
MARVELL TECHNOLOGY INC	85,483	55.580	4,751,145.14	
MASCO CORP	22,363	60.110	1,344,239.93	
MASTERCARD INC-CLASS A	84,114	400.300	33,670,834.20	
MATCH GROUP INC	27,678	32.430	897,597.54	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	24,965	66.360	1,656,677.40	
MCDONALD'S CORP	72,572	275.750	20,011,729.00	
MCKESSON CORP	13,464	450.200	6,061,492.80	
MEDTRONIC PLC	132,246	74.760	9,886,710.96	
MERCADOLIBRE INC	4,491	1,448.000	6,502,968.00	
MERCK & CO INC	252,208	101.750	25,662,164.00	
META PLATFORMS INC-A	219,865	335.040	73,663,569.60	
METLIFE INC	64,694	62.550	4,046,609.70	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,189	1,049.050	2,296,370.45	
MGM MIRAGE	28,885	39.800	1,149,623.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	54,100	83.530	4,518,973.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	108,864	77.560	8,443,491.84	
MICROSOFT CORP	702,073	369.850	259,661,699.05	
MODERNA INC	32,216	76.440	2,462,591.04	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,378	84.300	453,365.40	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,795	353.310	2,047,431.45	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	18,857	59.380	1,119,728.66	
MONDAY.COM LTD	2,159	169.700	366,382.30	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	135,359	70.630	9,560,406.17	
MONGODB INC	7,014	392.570	2,753,485.98	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,479	540.020	2,418,749.58	
MONSTER BEVERAGE CORP	78,032	54.790	4,275,373.28	
MOODY'S CORP	16,413	356.670	5,854,024.71	
MORGAN STANLEY	124,495	80.280	9,994,458.60	
MOSAIC CO/THE	32,988	36.150	1,192,516.20	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,671	318.250	5,305,545.75	
MSCI INC	7,957	521.420	4,148,938.94	
NASDAQ INC	34,150	53.480	1,826,342.00	
NETAPP INC	21,114	77.520	1,636,757.28	
NETFLIX INC	44,183	465.910	20,585,301.53	

NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,700	108.940	1,056,718.00	
NEWMONT CORP	78,934	36.350	2,869,250.90	
NEWS CORP - CLASS A	37,837	21.030	795,712.11	
NEXTERA ENERGY INC	201,125	57.370	11,538,541.25	
NIKE INC	122,476	105.960	12,977,556.96	
NISOURCE INC	40,981	26.080	1,068,784.48	
NORDSON CORP	5,101	233.460	1,190,879.46	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,625	211.040	4,774,780.00	
NORTHERN TRUST CORP	20,712	75.380	1,561,270.56	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,342	464.170	6,657,126.14	
NRG ENERGY INC	22,873	48.080	1,099,733.84	
NUCOR CORP	24,966	156.760	3,913,670.16	
NVIDIA CORP	245,496	492.980	121,024,618.08	
NVR INC	323	6,298.000	2,034,254.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	25,810	200.940	5,186,261.40	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,049	968.550	5,858,758.95	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	66,473	60.960	4,052,194.08	
OKTA INC	15,414	70.220	1,082,371.08	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,806	399.900	3,921,419.40	
OMNICOM GROUP	19,835	79.060	1,568,155.10	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	42,914	70.030	3,005,267.42	
ONEOK INC	44,461	66.630	2,962,436.43	
ORACLE CORP	161,859	115.360	18,672,054.24	
OTIS WORLDWIDE CORP	41,085	84.540	3,473,325.90	
OVINTIV INC	24,679	45.000	1,110,555.00	
OWENS CORNING	8,935	131.370	1,173,790.95	
PACCAR INC	51,940	91.360	4,745,238.40	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,936	155.310	1,387,850.16	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	180,121	20.490	3,690,679.29	
PALO ALTO NETWORKS INC	30,398	247.590	7,526,240.82	
PARAMOUNT GLOBAL	48,630	13.190	641,429.70	
PARKER HANNIFIN CORP	12,749	432.640	5,515,727.36	
PAYCHEX INC	32,258	117.520	3,790,960.16	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,179	177.500	919,272.50	
PAYLOCITY HOLDING CORP	4,439	152.540	677,125.06	
PAYPAL HOLDINGS INC	105,362	56.540	5,957,167.48	
PENTAIR PLC	16,379	62.940	1,030,894.26	
PEPSICO INC	136,832	166.760	22,818,104.32	
PFIZER INC	561,141	29.920	16,789,338.72	
PG&E CORP	188,333	17.920	3,374,927.36	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	154,301	91.950	14,187,976.95	
PHILLIPS 66	45,586	116.370	5,304,842.82	

PINTEREST INC- CLASS A	59,058	31.490	1,859,736.42	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	23,231	238.160	5,532,694.96	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,683	130.260	5,169,107.58	
POOL CORP	3,880	350.220	1,358,853.60	
PPG INDUSTRIES INC	23,403	135.870	3,179,765.61	
PPL CORPORATION	73,182	26.090	1,909,318.38	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,099	72.540	1,748,141.46	
PROCTER & GAMBLE CO	234,275	151.070	35,391,924.25	
PROGRESSIVE CORP	58,176	157.570	9,166,792.32	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	36,276	95.750	3,473,427.00	
PTC INC	11,169	153.940	1,719,355.86	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	49,577	63.750	3,160,533.75	
PULTE GROUP INC	22,142	88.300	1,955,138.60	
QORVO INC	9,797	94.080	921,701.76	
QUALCOMM INC	110,727	129.470	14,335,824.69	
QUANTA SERVICES INC	14,426	183.110	2,641,544.86	
QUEST DIAGNOSTICS	11,134	134.890	1,501,865.26	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,996	104.320	2,085,982.72	
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,723	802.430	8,604,456.89	
REGIONS FINANCIAL CORP	93,178	16.410	1,529,050.98	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	5,837	272.420	1,590,115.54	
REPLIGEN CORP	5,261	150.600	792,306.60	
REPUBLIC SERVICES INC	22,001	158.720	3,491,998.72	
RESMED INC	14,613	148.940	2,176,460.22	
REVVITY INC	12,476	87.970	1,097,513.72	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	64,869	16.700	1,083,312.30	
ROBERT HALF INC	10,714	80.850	866,226.90	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	42,404	8.100	343,472.40	
ROBLOX CORP -CLASS A	41,808	37.910	1,584,941.28	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,417	275.260	3,142,643.42	
ROKU INC	12,266	92.970	1,140,370.02	
ROLLINS INC	24,500	39.440	966,280.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,594	524.720	5,558,883.68	
ROSS STORES INC	33,856	128.820	4,361,329.92	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,864	105.540	2,413,066.56	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	37,902	26.600	1,008,193.20	
RPM INTERNATIONAL INC	12,812	101.920	1,305,799.04	
RTX CORPORATION	145,269	79.680	11,575,033.92	
S&P GLOBAL INC	32,603	408.120	13,305,936.36	
SALESFORCE INC	96,807	221.220	21,415,644.54	

SCHLUMBERGER LTD	141,660	52.850	7,486,731.00	
SEA LTD-ADR	36,288	37.570	1,363,340.16	
SEAGATE TECHNOLOGY	18,533	75.880	1,406,284.04	
SEAGEN INC	13,979	212.000	2,963,548.00	
SEALED AIR CORP	14,362	33.300	478,254.60	
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,222	57.990	650,763.78	
SEMPRA	62,547	72.260	4,519,646.22	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	15,205	32.620	495,987.10	
SERVICENOW INC	20,245	654.360	13,247,518.20	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,351	270.280	6,581,588.28	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	77,037	5.080	391,347.96	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,821	94.200	1,490,338.20	
SMITH (A.O.) CORP	12,383	76.380	945,813.54	
SNAP INC - A	100,962	11.890	1,200,438.18	
SNAP-ON INC	5,261	277.760	1,461,295.36	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	25,913	161.850	4,194,019.05	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5,605	78.990	442,738.95	
SOUTHERN CO	108,373	69.770	7,561,184.21	
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,867	24.810	368,850.27	
SPLUNK INC	15,632	151.010	2,360,588.32	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	22,284	55.000	1,225,620.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,228	91.760	1,397,321.28	
STARBUCKS CORP	113,952	105.570	12,029,912.64	
STATE STREET CORP	33,213	70.190	2,331,220.47	
STEEL DYNAMICS INC	15,954	110.930	1,769,777.22	
STERIS PLC	9,806	200.230	1,963,455.38	
STRYKER CORP	33,956	288.380	9,792,231.28	
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,695	288.590	1,354,930.05	
SYNCHRONY FINANCIAL	42,547	29.880	1,271,304.36	
SYNOPSYS INC	15,122	534.780	8,086,943.16	
SYSCO CORP	50,382	70.890	3,571,579.98	
T ROWE PRICE GROUP INC	22,322	97.790	2,182,868.38	
T-MOBILE US INC	53,889	147.710	7,959,944.19	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	16,830	154.390	2,598,383.70	
TARGA RESOURCES CORP	21,295	86.020	1,831,795.90	
TARGET CORP	45,885	129.890	5,960,002.65	
TE CONNECTIVITY LTD	31,325	131.460	4,117,984.50	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,680	390.490	1,827,493.20	
TELEFLEX INC	4,666	212.790	992,878.14	
TERADYNE INC	15,410	92.090	1,419,106.90	
TESLA, INC.	283,523	234.300	66,429,438.90	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	111,285	9.050	1,007,129.25	

TEXAS INSTRUMENTS INC	90,227	154.620	13,950,898.74	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	612	1,652.000	1,011,024.00	
TEXTRON INC	20,032	77.400	1,550,476.80	
THE CIGNA GROUP	29,406	282.560	8,308,959.36	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,340	466.420	17,882,542.80	
TJX COS INC	114,222	88.840	10,147,482.48	
TOAST INC-CLASS A	30,740	14.400	442,656.00	
TORO CO	10,340	85.330	882,312.20	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,890	202.610	2,206,422.90	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	44,214	66.470	2,938,904.58	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	10,831	93.420	1,011,832.02	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	22,668	228.620	5,182,358.16	
TRANSDIGM GROUP INC	5,459	957.630	5,227,702.17	
TRANSUNION	19,201	58.300	1,119,418.30	
TRAVELERS COS INC/THE	22,954	171.820	3,943,956.28	
TRIMBLE INC	24,640	43.330	1,067,651.20	
TRUIST FINANCIAL CORP	132,437	31.970	4,234,010.89	
TWILIO INC - A	17,095	63.110	1,078,865.45	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,167	411.340	1,714,053.78	
TYSON FOODS INC-CL A	28,407	48.740	1,384,557.18	
U-HAUL HOLDING CO	9,644	53.150	512,578.60	
UBER TECHNOLOGIES INC	181,030	54.440	9,855,273.20	
UIPATH INC - CLASS A	35,709	18.270	652,403.43	
ULTA BEAUTY INC	4,948	409.270	2,025,067.96	
UNION PACIFIC CORP	60,598	219.210	13,283,687.58	
UNITED PARCEL SERVICE INC	72,041	147.980	10,660,627.18	
UNITED RENTALS INC	6,830	480.980	3,285,093.40	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,655	228.940	1,065,715.70	
UNITEDHEALTH GROUP INC	92,542	536.290	49,629,349.18	
UNITY SOFTWARE INC	22,589	29.200	659,598.80	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,252	135.960	850,021.92	
US BANCORP	152,378	37.640	5,735,507.92	
VAIL RESORTS INC	4,015	225.440	905,141.60	
VALERO ENERGY CORP	35,914	124.110	4,457,286.54	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	14,489	176.540	2,557,888.06	
VERALTO CORP	23,225	70.990	1,648,742.75	
VERISIGN INC	9,305	210.120	1,955,166.60	
VERISK ANALYTICS INC	14,386	237.120	3,411,208.32	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	418,700	36.230	15,169,501.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,598	350.500	8,972,099.00	
VF CORP	32,942	17.210	566,931.82	

	VIATRIS INC	119,091	9.450	1,125,409.95	
	VISA INC-CLASS A SHARES	160,841	249.560	40,139,479.96	
	VISTRA CORP	33,307	34.860	1,161,082.02	
	VMWARE INC-CLASS A	23,521	149.620	3,519,212.02	
	VULCAN MATERIALS CO	13,220	212.350	2,807,267.00	
	WABTEC CORP	17,875	115.510	2,064,741.25	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	72,997	21.220	1,548,996.34	
	WALMART INC	147,207	155.350	22,868,607.45	
	WALT DISNEY CO	181,640	94.150	17,101,406.00	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	230,074	10.710	2,464,092.54	
	WASTE CONNECTIONS INC	25,601	134.840	3,452,038.84	
	WASTE MANAGEMENT INC	40,439	170.550	6,896,871.45	
	WATERS CORP	5,869	261.880	1,536,973.72	
	WATSCO INC	3,321	389.980	1,295,123.58	
	WEBSTER FINANCIAL CORP	17,349	43.180	749,129.82	
	WEC ENERGY GROUP INC	31,348	81.740	2,562,385.52	
	WELLS FARGO & CO	364,532	42.960	15,660,294.72	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,378	342.750	2,528,809.50	
	WESTERN DIGITAL CORP	31,811	46.620	1,483,028.82	
	WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,799	129.990	493,832.01	
	WESTROCK CO-WHEN ISSUED	25,486	37.910	966,174.26	
	WEYERHAEUSER CO	72,731	31.920	2,321,573.52	
	WHIRLPOOL CORP	5,451	112.490	613,182.99	
	WILLIAMS COS INC	121,052	35.430	4,288,872.36	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,577	242.030	2,559,951.31	
	WIX.COM LTD	5,359	96.790	518,697.61	
	WOLFSPEED INC	12,386	36.710	454,690.06	
	WORKDAY INC-CLASS A	20,470	231.660	4,742,080.20	
	WR BERKLEY CORP	20,718	70.210	1,454,610.78	
	WW GRAINGER INC	4,487	802.200	3,599,471.40	
	WYNN RESORTS LTD	10,173	86.870	883,728.51	
	XCEL ENERGY INC	54,698	60.560	3,312,510.88	
	XYLEM INC	23,790	101.160	2,406,596.40	
	YUM! BRANDS INC	27,845	127.660	3,554,692.70	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,114	218.020	1,114,954.28	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	15,255	39.090	596,317.95	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	20,744	111.670	2,316,482.48	
	ZOETIS INC	45,933	174.800	8,029,088.40	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	23,706	64.120	1,520,028.72	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	26,008	13.420	349,027.36	
	ZSCALER INC	8,701	187.470	1,631,176.47	
アメリカ・ドル　小計		33,944,589		3,882,866,675.22	

				(582,235,857,948)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	96,507	21.710	2,095,166.97	
	ABRDN PLC	193,695	1.722	333,542.79	
	ADMIRAL GROUP PLC	21,114	25.990	548,752.86	
	ANGLO AMERICAN PLC	126,337	22.340	2,822,368.58	
	ANTOFAGASTA PLC	39,143	13.790	539,781.97	
	ASHTEAD GROUP PLC	43,543	52.440	2,283,394.92	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,539	23.800	822,028.20	
	ASTRAZENECA PLC	154,044	102.600	15,804,914.40	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	91,196	7.068	644,573.32	
	AVIVA PLC	272,666	4.222	1,151,195.85	
	BAE SYSTEMS PLC	302,907	10.555	3,197,183.38	
	BARCLAYS PLC	1,545,329	1.428	2,206,729.81	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	97,037	4.840	469,659.08	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	10,565	45.210	477,643.65	
	BP PLC	1,724,217	4.777	8,236,584.60	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	211,211	25.215	5,325,685.36	
	BT GROUP PLC	647,047	1.189	769,338.88	
	BUNZL PLC	33,582	29.450	988,989.90	
	BURBERRY GROUP PLC	37,476	15.645	586,312.02	
	CENTRICA PLC	551,590	1.517	836,762.03	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	21,947	21.170	464,617.99	
	COMPASS GROUP PLC	172,302	20.920	3,604,557.84	
	CRH PLC	72,056	48.200	3,473,099.20	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,889	45.980	638,616.22	
	DCC PLC	9,817	53.480	525,013.16	
	DIAGEO PLC	223,361	28.095	6,275,327.29	
	ENDEAVOUR MINING PLC	18,353	17.270	316,956.31	
	ENTAIN PLC	63,487	8.558	543,321.74	
	EXPERIAN PLC	91,422	29.330	2,681,407.26	
	GLENCORE PLC	1,046,614	4.676	4,893,967.06	
	GSK PLC	406,939	14.106	5,740,281.53	
	HALEON PLC	550,595	3.268	1,799,344.46	
	HALMA PLC	37,744	20.530	774,884.32	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,394	7.256	256,818.86	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,429	17.605	289,232.54	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,964,442	6.154	12,089,176.06	
	IMPERIAL BRANDS PLC	85,819	18.520	1,589,367.88	
	INFORMA PLC	138,954	7.490	1,040,765.46	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	16,707	60.960	1,018,458.72	
	INTERTEK GROUP PLC	16,031	38.090	610,620.79	
	JD SPORTS FASHION PLC	257,514	1.387	357,171.91	
	JOHNSON MATTHEY PLC	18,241	15.240	277,992.84	

	KINGFISHER PLC	189,211	2.332	441,240.05	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	594,714	2.296	1,365,463.34	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,396,903	0.433	2,769,858.99	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	39,721	85.500	3,396,145.50	
	M&G PLC	224,104	2.052	459,861.40	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	134,196	5.220	700,503.12	
	MONDI PLC/WI	48,258	13.910	671,268.78	
	NATIONAL GRID PLC	365,857	10.160	3,717,107.12	
	NATWEST GROUP PLC	577,475	2.078	1,199,993.05	
	NEXT PLC	11,967	77.140	923,134.38	
	NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
	OCADO GROUP PLC	57,594	5.606	322,871.96	
	PEARSON PLC	64,035	9.524	609,869.34	
	PERSIMMON PLC	31,829	12.400	394,679.60	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	75,223	4.905	368,968.81	
	PRUDENTIAL PLC	273,573	9.450	2,585,264.85	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	71,310	53.960	3,847,887.60	
	RELX PLC	188,180	29.840	5,615,291.20	
	RENTOKIL INITIAL PLC	250,396	4.637	1,161,086.25	
	RIO TINTO PLC	111,898	54.460	6,093,965.08	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	836,256	2.440	2,040,464.64	
	SAGE GROUP PLC	101,671	9.844	1,000,849.32	
	SAINSBURY (J) PLC	164,322	2.663	437,589.48	
	SCHRODERS PLC	79,990	4.071	325,639.29	
	SEVERN TRENT PLC	25,054	26.970	675,706.38	
	SHELL PLC-NEW	666,337	26.085	17,381,400.64	
	SMITH & NEPHEW PLC	86,724	10.245	888,487.38	
	SMITHS GROUP PLC	34,715	16.525	573,665.37	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,337	89.400	655,927.80	
	SSE PLC	108,278	17.950	1,943,590.10	
	ST JAMES'S PLACE PLC	54,639	6.874	375,588.48	
	STANDARD CHARTERED PLC	235,535	6.600	1,554,531.00	
	TAYLOR WIMPEY PLC	351,774	1.257	442,179.91	
	TESCO PLC	712,236	2.760	1,965,771.36	
	UNILEVER PLC	249,975	38.160	9,539,046.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,674	10.840	733,586.16	
	VODAFONE GROUP PLC	2,316,957	0.750	1,737,717.75	
	WHITBREAD PLC	19,626	33.420	655,900.92	
	WISE PLC - A	61,116	7.146	436,734.93	
	WPP PLC	106,805	7.130	761,519.65	
イギリス・ポンド　小計		27,510,025		180,171,969.74 (33,636,305,031)	

イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	4,254	195.000	829,530.00	
	BANK HAPOALIM BM	126,198	30.020	3,788,463.96	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	152,563	26.870	4,099,367.81	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,644	742.000	1,961,848.00	
	ICL GROUP LTD	76,986	19.250	1,481,980.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	122,796	18.160	2,229,975.36	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	15,341	130.000	1,994,330.00	
	NICE LTD	6,286	721.500	4,535,349.00	
イスラエル・シュケル　小計		507,068		20,920,844.63 (843,706,283)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	23,653	33.550	793,558.15	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	298,677	24.070	7,189,155.39	
	APA GROUP	125,308	8.340	1,045,068.72	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	58,486	40.230	2,352,891.78	
	ASX LTD	19,281	57.130	1,101,523.53	
	AURIZON HOLDINGS LTD	182,771	3.640	665,286.44	
	BHP GROUP LIMITED	503,514	46.610	23,468,787.54	
	BLUESCOPE STEEL LTD	45,174	20.440	923,356.56	
	BRAMBLES LTD	137,914	13.170	1,816,327.38	
	COCHLEAR LTD	6,525	259.750	1,694,868.75	
	COLES GROUP LTD	133,023	15.420	2,051,214.66	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	166,608	102.470	17,072,321.76	
	COMPUTERSHARE LIMITED	57,003	23.650	1,348,120.95	
	CSL LIMITED	47,952	258.610	12,400,866.72	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	142,562	4.920	701,405.04	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	168,373	25.220	4,246,367.06	
	IDP EDUCATION LTD	24,930	23.790	593,084.70	
	IGO LTD	67,704	8.900	602,565.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	242,266	5.860	1,419,678.76	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	43,729	48.110	2,103,802.19	
	LOTTERY CORP LTD/THE	220,865	4.560	1,007,144.40	
	MACQUARIE GROUP LTD	36,489	167.420	6,108,988.38	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	273,674	3.550	971,542.70	
	MINERAL RESOURCES LTD	17,393	63.460	1,103,759.78	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	312,112	27.730	8,654,865.76	
	NEWMONT CORP-CDI	35,480	56.420	2,001,781.60	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	113,970	11.760	1,340,287.20	
	ORICA LTD	45,249	15.750	712,671.75	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	171,072	8.600	1,471,219.20	
	PILBARA MINERALS LTD	268,038	3.560	954,215.28	

	QANTAS AIRWAYS LTD	83,647	5.240	438,310.28	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	148,170	15.020	2,225,513.40	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	18,266	51.600	942,525.60	
	REA GROUP LTD	5,247	158.410	831,177.27	
	REECE LTD	22,493	19.450	437,488.85	
	RIO TINTO LTD	36,860	125.620	4,630,353.20	
	SANTOS LTD	322,740	6.990	2,255,952.60	
	SEEK LTD	35,372	23.180	819,922.96	
	SONIC HEALTHCARE LTD	44,468	29.480	1,310,916.64	
	SOUTH32 LTD	451,287	3.170	1,430,579.79	
	SUNCORP GROUP LTD	125,740	13.360	1,679,886.40	
	TELSTRA GROUP LTD	411,252	3.840	1,579,207.68	
	TRANSURBAN GROUP	306,394	12.990	3,980,058.06	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	71,837	10.610	762,190.57	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	23,316	33.480	780,619.68	
	WESFARMERS LIMITED	112,788	53.000	5,977,764.00	
	WESTPAC BANKING CORP	348,848	21.100	7,360,692.80	
	WISETECH GLOBAL LTD	16,481	67.250	1,108,347.25	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	188,723	31.400	5,925,902.20	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	121,115	35.320	4,277,781.80	
	XERO LTD	14,286	101.240	1,446,314.64	
オーストラリア・ドル　小計		6,899,125		158,118,233.40 (15,427,596,033)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	48,979	66.370	3,250,736.23	
	AIR CANADA	17,690	17.890	316,474.10	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	65,730	8.180	537,671.40	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	77,778	78.240	6,085,350.72	
	ALTAGAS LTD	28,265	27.500	777,287.50	
	ARC RESOURCES LTD	60,846	21.400	1,302,104.40	
	BANK OF MONTREAL	71,085	112.030	7,963,652.55	
	BANK OF NOVA SCOTIA	118,802	61.090	7,257,614.18	
	BARRICK GOLD CORP	174,679	21.550	3,764,332.45	
	BCE INC	8,736	54.190	473,403.84	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	34,990	46.060	1,611,639.40	
	BROOKFIELD CORPORATION-A	140,184	46.450	6,511,546.80	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	13,621	35.600	484,907.60	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,638	102.830	374,095.54	
	CAE INC	31,760	28.840	915,958.40	
	CAMECO CORP	43,079	61.190	2,636,004.01	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	90,440	54.220	4,903,656.80	

CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	56,077	158.140	8,868,016.78	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	110,190	91.280	10,058,143.20	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	92,656	98.390	9,116,423.84	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,266	147.820	778,420.12	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	13,561	31.280	424,188.08	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	14,961	58.280	871,927.08	
CENOVUS ENERGY INC	142,582	24.800	3,536,033.60	
CGI INC	21,120	138.890	2,933,356.80	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,004	3,154.170	6,320,956.68	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	8,524	111.240	948,209.76	
DOLLARAMA INC	28,294	98.570	2,788,939.58	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	38,998	20.900	815,058.20	
EMERA INC	27,488	49.090	1,349,385.92	
EMPIRE CO LTD 'A'	14,771	38.610	570,308.31	
ENBRIDGE INC	201,807	46.220	9,327,519.54	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,125	1,198.560	2,546,940.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	58,597	15.310	897,120.07	
FIRSTSERVICE CORP	4,033	209.780	846,042.74	
FORTIS INC	48,578	56.460	2,742,713.88	
FRANCO-NEVADA CORP	19,125	165.160	3,158,685.00	
GEORGE WESTON LTD	6,283	164.440	1,033,176.52	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	23,223	41.360	960,503.28	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,872	48.970	875,191.84	
GREAT-WEST LIFECO INC	28,204	42.710	1,204,592.84	
HYDRO ONE LTD	33,227	38.370	1,274,919.99	
IA FINANCIAL CORP INC	10,291	87.330	898,713.03	
IGM FINANCIAL INC	8,636	33.840	292,242.24	
IMPERIAL OIL LTD	20,409	79.110	1,614,555.99	
INTACT FINANCIAL CORP	17,515	209.040	3,661,335.60	
IVANHOE MINES LTD-CL A	60,783	11.010	669,220.83	
KEYERA CORP	23,044	32.140	740,634.16	
KINROSS GOLD CORP	121,906	7.300	889,913.80	
LOBLAW COS LTD	15,992	121.760	1,947,185.92	
LUNDIN MINING CORP	65,526	8.980	588,423.48	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,131	76.890	2,086,102.59	
MANULIFE FINANCIAL CORP	183,522	26.290	4,824,793.38	
METRO INC	23,256	70.160	1,631,640.96	
NATIONAL BANK OF CANADA	33,757	91.340	3,083,364.38	
NORTHLAND POWER INC	25,422	22.520	572,503.44	

	NUTRIEN LTD	49,367	77.570	3,829,398.19	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	6,316	26.940	170,153.04	
	ONEX CORPORATION	6,850	88.640	607,184.00	
	OPEN TEXT CORP	27,032	53.140	1,436,480.48	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	36,267	19.640	712,283.88	
	PARKLAND CORP	14,106	43.590	614,880.54	
	PEMBINA PIPELINE CORP	55,125	44.470	2,451,408.75	
	POWER CORP OF CANADA	58,009	36.630	2,124,869.67	
	QUEBECOR INC -CL B	15,501	30.990	480,375.99	
	RB GLOBAL INC	18,128	84.480	1,531,453.44	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	29,491	97.530	2,876,257.23	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	35,744	58.670	2,097,100.48	
	ROYAL BANK OF CANADA	137,956	120.490	16,622,318.44	
	SAPUTO INC	25,433	27.010	686,945.33	
	SHOPIFY INC - CLASS A	119,244	93.870	11,193,434.28	
	STANTEC INC	11,141	96.440	1,074,438.04	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	58,643	69.480	4,074,515.64	
	SUNCOR ENERGY INC	131,244	46.330	6,080,534.52	
	TC ENERGY CORP	101,394	50.340	5,104,173.96	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	45,330	49.400	2,239,302.00	
	TFI INTERNATIONAL INC	7,692	155.360	1,195,029.12	
	THOMSON REUTERS CORP	15,864	188.360	2,988,143.04	
	TMX GROUP LTD	28,035	28.980	812,454.30	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	8,269	113.730	940,433.37	
	TORONTO-DOMINION BANK	182,966	84.780	15,511,857.48	
	TOURMALINE OIL CORP	32,092	66.340	2,128,983.28	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,688	104.900	596,671.20	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	45,070	62.710	2,826,339.70	
	WSP GLOBAL INC	12,456	190.240	2,369,629.44	
カナダ・ドル　小計		4,007,511		242,290,888.20 (26,470,279,536)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	258,500	3.090	798,765.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	49,400	6.180	305,292.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	180,000	32.690	5,884,200.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	600,300	0.935	561,280.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9,800	29.770	291,746.00	
	KEPPEL CORP LTD	144,500	6.470	934,915.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	336,400	12.970	4,363,108.00	
	SEATRIUM LTD	4,403,052	0.107	471,126.56	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	88,300	5.090	449,447.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	147,700	6.240	921,648.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	85,200	9.540	812,808.00	

	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	155,500	3.870	601,785.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	828,800	2.330	1,931,104.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	125,600	27.350	3,435,160.00	
	UOL Group Limited	45,900	6.150	282,285.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	190,900	3.680	702,512.00	
シンガポール・ドル　小計		7,649,852		22,747,182.06 (2,537,903,102)	
スイス・フラン	ABB LTD	158,932	33.780	5,368,722.96	
	ADECCO GROUP AG-REG	15,891	41.300	656,298.30	
	ALCON INC	49,646	62.480	3,101,882.08	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	3,359	71.600	240,504.40	
	BALOISE HOLDING AG	4,543	131.300	596,495.90	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,986	101.600	303,377.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	355	1,485.000	527,175.00	
	BKW AG	2,086	155.900	325,207.40	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	95	10,850.000	1,030,750.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	108,400.000	1,084,000.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	51,881	112.600	5,841,800.60	
	CLARIANT AG	21,463	13.350	286,531.05	
	DUFRY AG-REG	9,562	31.690	303,019.78	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	701	620.000	434,620.00	
	GEBERIT AG-REG	3,325	476.400	1,584,030.00	
	GIVAUDAN-REG	917	3,229.000	2,960,993.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	3,676	123.600	454,353.60	
	HOLCIM LTD	51,760	61.760	3,196,697.60	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20,458	55.720	1,139,919.76	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,400	246.400	1,330,560.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	16,341	75.540	1,234,399.14	
	LONZA GROUP AG	7,403	355.000	2,628,065.00	
	NESTLE SA	265,382	98.990	26,270,164.18	
	NOVARTIS AG	203,705	84.100	17,131,590.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,256	1,126.000	2,540,256.00	
	ROCHE HOLDING AG	69,818	237.600	16,588,756.80	
	ROCHE HOLDING AG-BR	3,195	253.000	808,335.00	
	SANDOZ GROUP AG	40,741	25.540	1,040,525.14	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,373	185.500	440,191.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,013	193.200	775,311.60	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	14,900	73.800	1,099,620.00	

	SIG GROUP AG	30,404	20.960	637,267.84	
	SIKA AG-BEARER	14,548	235.400	3,424,599.20	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,165	232.100	1,198,796.50	
	STRAUMANN HOLDING AG	11,092	119.950	1,330,485.40	
	SWATCH GROUP AG	2,860	236.000	674,960.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,931	577.600	1,692,945.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,617	85.000	647,445.00	
	SWISS RE AG	29,967	99.980	2,996,100.66	
	SWISSCOM AG	2,619	509.000	1,333,071.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	6,340	69.320	439,488.80	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,318	44.750	237,980.50	
	UBS GROUP AG	326,790	23.140	7,561,920.60	
	VAT GROUP AG	2,684	378.600	1,016,162.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,953	437.000	6,534,461.00	
スイス・フラン　小計		1,500,461		131,049,838.39 (22,176,253,652)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	28,710	381.500	10,952,865.00	
	ASSA ABLOY AB	99,543	263.500	26,229,580.50	
	ATLAS COPCO AB	155,179	136.800	21,228,487.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	266,882	159.100	42,460,926.20	
	BEIJER REF AB	38,271	121.100	4,634,618.10	
	BIOVITRUM	19,408	242.800	4,712,262.40	
	BOLIDEN AB	27,153	294.800	8,004,704.40	
	EPIROC AB-A	65,385	191.550	12,524,496.75	
	EPIROC AB-B	38,867	161.900	6,292,567.30	
	EQT AB	35,339	247.600	8,749,936.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	60,491	255.500	15,455,450.50	
	EVOLUTION AB	18,214	1,068.200	19,456,194.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	64,761	61.880	4,007,410.68	
	GETINGE AB-B SHS	22,702	219.200	4,976,278.40	
	HENNES & MAURITZ AB	64,167	167.840	10,769,789.28	
	HEXAGON AB-B SHS	206,383	101.850	21,020,108.55	
	HOLMEN AB-B SHARES	9,298	429.800	3,996,280.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	34,672	78.640	2,726,606.08	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	13,095	304.300	3,984,808.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	15,050	304.000	4,575,200.00	
	INDUTRADE AB	27,204	225.600	6,137,222.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,771	220.000	3,249,620.00	
	INVESTOR AB	171,816	211.350	36,313,311.60	
	LIFCO AB-B SHS	23,155	226.100	5,235,345.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,491	480.000	3,595,680.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	150,675	65.400	9,854,145.00	
	NORDEA BANK ABP	320,025	120.400	38,531,010.00	
	SAAB AB-B	7,940	555.800	4,413,052.00	

	SAGAX AB-B	19,617	232.900	4,568,799.30	
	SANDVIK AB	105,890	202.300	21,421,547.00	
	SECURITAS AB	48,746	89.880	4,381,290.48	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	157,487	126.200	19,874,859.40	
	SKANSKA AB-B SHS	33,750	166.600	5,622,750.00	
	SKF AB	33,817	190.000	6,425,230.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB	60,146	161.700	9,725,608.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	144,769	98.500	14,259,746.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	84,243	184.350	15,530,197.05	
	TELE2 AB	55,425	81.400	4,511,595.00	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	290,983	52.210	15,192,222.43	
	TELIA CO AB	247,423	24.160	5,977,739.68	
	VOLVO AB	149,451	232.700	34,777,247.70	
	VOLVO AB-A SHS	20,312	239.400	4,862,692.80	
	VOLVO CAR AB-B	59,205	36.290	2,148,549.45	
スウェーデン・クローナ　小計		3,517,911		513,368,032.93 (7,315,494,469)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	478	10,310.000	4,928,180.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	304	10,210.000	3,103,840.00	
	CARLSBERG AS-B	9,778	848.600	8,297,610.80	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,485	547.200	5,737,392.00	
	COLOPLAST-B	11,810	745.400	8,803,174.00	
	DANSKE BANK A/S	68,502	177.400	12,152,254.80	
	DEMANT A/S	10,007	275.300	2,754,927.10	
	DSV A/S	18,495	1,085.000	20,067,075.00	
	GENMAB A/S	6,564	2,217.000	14,552,388.00	
	NOVO-NORDISK A/S	324,349	694.300	225,195,510.70	
	NOVOZYMES A/S	20,343	360.000	7,323,480.00	
	ORSTED A/S	18,805	312.800	5,882,204.00	
	PANDORA A/S	8,396	921.400	7,736,074.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	913	1,655.500	1,511,471.50	
	TRYGVESTA AS	34,862	143.050	4,987,009.10	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	100,398	177.640	17,834,700.72	
デンマーク・クローネ　小計		644,489		350,867,292.12 (7,694,519,716)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	123,721	7.730	956,363.33	
	EBOS GROUP LTD	15,234	38.600	588,032.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	57,515	21.970	1,263,604.55	
	MERCURY NZ LTD	68,532	6.050	414,618.60	
	MERIDIAN ENERGY LTD	127,643	5.000	638,215.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	187,726	5.025	943,323.15	
ニュージーランド・ドル　小計		580,371		4,804,157.03 (432,181,966)	

ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	28,983	108.900	3,156,248.70	
	AKER BP ASA	31,382	307.800	9,659,379.60	
	DNB BANK ASA	91,784	203.500	18,678,044.00	
	EQUINOR ASA	89,489	349.000	31,231,661.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,855	176.700	3,508,378.50	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,699	466.800	4,060,693.20	
	MOWI ASA	43,657	186.350	8,135,481.95	
	NORSK HYDRO ASA	131,657	64.900	8,544,539.30	
	ORKLA ASA	74,324	77.860	5,786,866.64	
	SALMAR ASA	7,216	576.000	4,156,416.00	
	TELENOR ASA	71,520	113.150	8,092,488.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,391	373.100	6,115,482.10	
ノルウェー・クローネ　小計		614,957		111,125,678.99 (1,541,313,168)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	39,981	12.695	507,558.79	
	ACCIONA SA	2,456	129.100	317,069.60	
	ACCOR	18,375	31.370	576,423.75	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,720	35.890	779,530.80	
	ADIDAS AG	16,101	179.640	2,892,383.64	
	ADP	2,950	115.800	341,610.00	
	ADYEN NV	2,158	1,037.600	2,239,140.80	
	AEGON LTD	167,461	4.963	831,108.94	
	AENA SME SA	7,449	153.050	1,140,069.45	
	AGEAS	15,862	38.480	610,369.76	
	AIB GROUP PLC	142,789	4.192	598,571.48	
	AIR LIQUIDE	52,049	170.260	8,861,862.74	
	AIRBUS SE	58,915	132.260	7,792,097.90	
	AKZO NOBEL NV	16,936	68.840	1,165,874.24	
	ALLIANZ SE	40,075	228.500	9,157,137.50	
	ALSTOM RGPT	28,476	12.365	352,105.74	
	AMADEUS IT GROUP SA	44,758	62.580	2,800,955.64	
	AMPLIFON SPA	12,377	27.520	340,615.04	
	AMUNDI SA	6,097	55.600	338,993.20	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	86,326	56.230	4,854,110.98	
	ARCELORMITTAL	50,722	21.925	1,112,079.85	
	ARGENX SE	5,562	452.300	2,515,692.60	
	ARKEMA	5,955	93.280	555,482.40	
	ASM INTERNATIONAL NV	4,665	465.400	2,171,091.00	
	ASML HOLDING NV	40,068	628.700	25,190,751.60	
	ASR NEDERLAND NV	15,852	36.800	583,353.60	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	100,600	19.460	1,957,676.00	
	AXA SA	182,367	28.385	5,176,487.29	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	592,641	8.284	4,909,438.04	

BANCO SANTANDER SA	1,607,679	3.723	5,985,388.91	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	104,885	8.592	901,171.92	
BASF SE	88,860	44.285	3,935,165.10	
BAYER AG	97,627	41.450	4,046,639.15	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29,877	95.200	2,844,290.40	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	5,760	87.000	501,120.00	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	7,654	119.800	916,949.20	
BECHTLE AG	8,139	47.130	383,591.07	
BEIERSDORF AG	10,004	124.650	1,246,998.60	
BIOMERIEUX	4,115	95.860	394,463.90	
BNP PARIBAS	104,258	56.730	5,914,556.34	
BOLLORE SE	73,269	5.320	389,791.08	
BOUYGUES	18,979	34.830	661,038.57	
BRENNTAG SE	14,587	76.260	1,112,404.62	
BUREAU VERITAS SA	29,301	22.120	648,138.12	
CAIXABANK	410,055	4.049	1,660,312.69	
CAPGEMINI SA	16,388	177.900	2,915,425.20	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,007	86.620	347,086.34	
CARREFOUR SA	59,266	17.015	1,008,410.99	
CELLNEX TELECOM SAU	56,452	32.530	1,836,383.56	
CIE DE SAINT-GOBAIN	45,953	58.370	2,682,276.61	
CNH INDUSTRIAL NV	101,659	9.368	952,341.51	
COMMERZBANK AG	105,615	11.185	1,181,303.77	
CONTINENTAL AG	10,926	68.860	752,364.36	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	6,521	27.140	176,979.94	
COVESTRO AG	19,190	48.000	921,120.00	
CREDIT AGRICOLE SA	120,163	11.766	1,413,837.85	
D'IETEREN GROUP	2,137	155.800	332,944.60	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	49,051	29.190	1,431,798.69	
DANONE	63,981	57.540	3,681,466.74	
DASSAULT AVIATION SA	2,047	187.600	384,017.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	66,585	42.050	2,799,899.25	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	51,886	10.275	533,128.65	
DELIVERY HERO SE	17,430	32.895	573,359.85	
DEUTSCHE BANK AG	192,391	11.172	2,149,392.25	
DEUTSCHE BOERSE AG	18,878	168.750	3,185,662.50	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	59,301	7.999	474,348.69	
DEUTSCHE TELEKOM AG	323,457	21.555	6,972,115.63	
DHL GROUP	98,495	40.515	3,990,524.92	
DIASORIN ITALIA SPA	2,229	88.760	197,846.04	
DR ING HC F PORSCHE AG	11,321	90.920	1,029,305.32	
DSM-FIRMENICH AG	18,497	91.880	1,699,504.36	
E.ON SE	222,981	11.555	2,576,545.45	

EDENRED	24,801	50.020	1,240,546.02	
EDP RENOVAVEIS SA	30,591	16.325	499,398.07	
EIFFAGE	7,294	90.740	661,857.56	
ELIA GROUP SA/NV	2,922	102.200	298,628.40	
ELISA OYJ	14,567	41.920	610,648.64	
ENAGAS SA	24,755	16.170	400,288.35	
ENDESA SA	31,458	19.590	616,262.22	
ENEL SPA	808,065	6.405	5,175,656.32	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	311,784	4.279	1,334,123.73	
ENGIE	181,543	15.600	2,832,070.80	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	234,678	15.012	3,522,986.13	
ERSTE GROUP BANK AG	34,131	35.900	1,225,302.90	
ESSILORLUXOTTICA	29,302	179.380	5,256,192.76	
EURAZEO	4,318	59.050	254,977.90	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,416	52.640	706,218.24	
EURONEXT NV	8,523	73.350	625,162.05	
EVONIK INDUSTRIES AG	20,903	18.495	386,600.98	
EXOR NV	10,707	86.360	924,656.52	
FERRARI NV	12,525	329.600	4,128,240.00	
FERROVIAL SE	50,516	30.260	1,528,614.16	
FINECOBANK SPA	60,715	12.300	746,794.50	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	17,553	145.000	2,545,185.00	
FORTUM OYJ	44,586	12.675	565,127.55	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	20,393	35.840	730,885.12	
FRESENIUS SE & CO KGAA	41,965	27.320	1,146,483.80	
GALP ENERGIA SGPS SA	48,747	13.465	656,378.35	
GEA GROUP AG	15,232	34.980	532,815.36	
GETLINK SE - REGR	35,511	16.290	578,474.19	
GRIFOLS SA	29,627	12.660	375,077.82	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,481	72.520	687,562.12	
HANNOVER RUECK SE	5,985	208.900	1,250,266.50	
HEIDELBERG MATERIALS AG	14,349	71.280	1,022,796.72	
HEINEKEN HOLDING NV	12,864	71.000	913,344.00	
HEINEKEN NV	28,614	83.220	2,381,257.08	
HELLOFRESH SE	15,429	16.030	247,326.87	
HENKEL AG & CO KGAA	10,416	62.880	654,958.08	
HENKEL KGAA-VORZUG	16,752	71.280	1,194,082.56	
HERMES INTERNATIONAL	3,148	1,924.600	6,058,640.80	
IBERDROLA SA	604,800	11.070	6,695,136.00	
IMCD NV	5,666	134.300	760,943.80	
INDITEX SA	108,393	35.660	3,865,294.38	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	129,772	33.580	4,357,743.76	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	34,714	10.700	371,439.80	
ING GROEP NV-CVA	359,564	12.754	4,585,879.25	

INTESA SANPAOLO	1,544,239	2.684	4,144,737.47	
IPSEN	3,739	107.300	401,194.70	
JDE PEET'S BV	12,470	25.560	318,733.20	
JERONIMO MARTINS	28,109	21.760	611,651.84	
KBC GROEP NV	24,871	53.240	1,324,132.04	
KERING	7,401	404.300	2,992,224.30	
KERRY GROUP PLC-A	15,837	72.860	1,153,883.82	
KESKO OYJ-B SHS	27,143	17.140	465,231.02	
KINGSPAN GROUP PLC	15,368	69.040	1,061,006.72	
KNORR-BREMSE AG	7,210	55.720	401,741.20	
KONE OYJ	33,780	41.320	1,395,789.60	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	96,432	26.625	2,567,502.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	92,297	19.388	1,789,454.23	
L'OREAL SA	23,972	423.950	10,162,929.40	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10,476	32.620	341,727.12	
LEG IMMOBILIEN SE	7,370	70.580	520,174.60	
LEGRAND SA	26,508	87.560	2,321,040.48	
LOTUS BAKERIES	41	7,530.000	308,730.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	27,446	711.600	19,530,573.60	
MEDIOBANCA SPA	54,759	11.765	644,239.63	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	79,730	58.600	4,672,178.00	
MERCK KGAA	12,843	156.950	2,015,708.85	
METSO CORPORATION	65,863	9.054	596,323.60	
MICHELIN (C.G.D.E.)	67,425	29.650	1,999,151.25	
MONCLER SPA	20,468	50.440	1,032,405.92	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	5,347	186.000	994,542.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	13,554	377.900	5,122,056.60	
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,466	26.980	336,332.68	
NEMETSCHEK SE	5,739	79.380	455,561.82	
NESTE OYJ	42,047	34.480	1,449,780.56	
NEXI SPA	58,783	6.922	406,895.92	
NN GROUP NV	24,913	32.080	799,209.04	
NOKIA OYJ	531,387	3.270	1,737,635.49	
OCI NV	10,483	21.230	222,554.09	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	6,772	85.350	577,990.20	
OMV AG	14,641	40.830	597,792.03	
ORANGE S.A.	188,200	11.076	2,084,503.20	
ORION OYJ-CLASS B	10,703	37.630	402,753.89	
PERNOD-RICARD	20,323	167.350	3,401,054.05	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	15,212	46.150	702,033.80	
POSTE ITALIANE SPA	51,865	10.170	527,467.05	
PROSUS	151,939	30.240	4,594,635.36	

PRYSMIAN SPA	26,080	35.760	932,620.80	
PUBLICIS GROUPE	22,740	73.900	1,680,486.00	
PUMA AG	10,493	52.900	555,079.70	
QIAGEN NV	22,632	36.080	816,562.56	
RANDSTAD NV	10,949	53.500	585,771.50	
RATIONAL AG	509	609.000	309,981.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	10,390	45.180	469,420.20	
REDEIA CORPORACION SA	40,580	15.110	613,163.80	
REMY COINTREAU	2,272	112.750	256,168.00	
RENAULT SA	19,062	35.560	677,844.72	
REPSOL SA	126,671	13.795	1,747,426.44	
RHEINMETALL AG	4,327	279.100	1,207,665.70	
ROYAL KPN NV	329,716	3.167	1,044,210.57	
RWE AG	62,789	38.340	2,407,330.26	
SAFRAN SA	33,965	160.560	5,453,420.40	
SAMPO OYJ	45,677	38.840	1,774,094.68	
SANOFI	112,913	85.890	9,698,097.57	
SAP SE	103,773	137.220	14,239,731.06	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,604	273.800	712,975.20	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,750	200.200	550,550.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	54,090	166.020	8,980,021.80	
SCOUT24 SE	7,427	63.160	469,089.32	
SEB SA	2,472	101.300	250,413.60	
SIEMENS AG	75,530	148.460	11,213,183.80	
SIEMENS ENERGY AG	51,649	11.680	603,260.32	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	28,037	50.040	1,402,971.48	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,837	31.750	820,324.75	
SNAM SPA	200,247	4.498	900,711.00	
SOCIETE GENERALE	72,239	22.605	1,632,962.59	
SODEXO	8,792	101.350	891,069.20	
SOFINA	1,539	200.200	308,107.80	
SOLVAY SA	7,347	103.350	759,312.45	
STELLANTIS NV	219,838	18.470	4,060,407.86	
STMICROELECTRONICS NV	67,901	41.925	2,846,749.42	
STORA ENSO OYJ	57,786	12.175	703,544.55	
SYMRISE AG	13,200	97.040	1,280,928.00	
TALANX AG	6,257	63.950	400,135.15	
TELECOM ITALIA SPA	1,007,864	0.259	261,036.77	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	95,640	2.348	224,562.72	
TELEFONICA SA	521,276	3.753	1,956,348.82	
TELEPERFORMANCE	5,882	135.100	794,658.20	
TENARIS SA	46,818	15.665	733,403.97	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	139,500	7.520	1,049,040.00	
THALES SA	10,441	138.150	1,442,424.15	
TOTALENERGIES SE	223,453	61.810	13,811,629.93	
UCB SA	12,557	68.520	860,405.64	

	UMICORE	20,840	23.290	485,363.60	
	UNICREDIT SPA	183,146	25.035	4,585,060.11	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	81,423	23.970	1,951,709.31	
	UPM-KYMMENE OYJ	53,020	33.000	1,749,660.00	
	VALEO SA	20,572	13.495	277,619.14	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	67,531	28.070	1,895,595.17	
	VINCI SA	52,830	109.380	5,778,545.40	
	VIVENDI SA	67,364	8.794	592,399.01	
	VOESTALPINE AG	11,507	26.200	301,483.40	
	VOLKSWAGEN AG	2,963	120.850	358,078.55	
	VOLKSWAGEN AG	20,463	108.840	2,227,192.92	
	VONOVIA SE	72,935	25.190	1,837,232.65	
	WACKER CHEMIE AG	1,814	120.800	219,131.20	
	WARTSILA OYJ	46,946	11.885	557,953.21	
	WENDEL	2,633	73.850	194,447.05	
	WOLTERS KLUWER NV	25,576	122.500	3,133,060.00	
	WORLDLINE SA	23,892	13.745	328,395.54	
	ZALANDO SE	22,283	23.060	513,845.98	
ユーロ　小計		17,877,094		462,124,715.53 (75,575,875,978)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,148,075	72.900	83,694,667.50	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	368,039	21.300	7,839,230.70	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	171,300	15.220	2,607,186.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	195,909	38.400	7,522,905.60	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	266,409	40.200	10,709,641.80	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	63,000	38.200	2,406,600.00	
	CLP HOLDINGS LTD	163,143	59.550	9,715,165.65	
	ESR GROUP LIMITED	217,800	10.080	2,195,424.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	216,810	43.100	9,344,511.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	179,157	11.020	1,974,310.14	
	HANG SENG BANK LTD	76,012	89.400	6,795,472.80	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	144,641	21.850	3,160,405.85	
	HKT TRUST AND HKT LTD	390,000	8.250	3,217,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,115,437	5.510	6,146,057.87	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	119,611	285.400	34,136,979.40	
	MTR CORP	154,755	29.600	4,580,748.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	149,917	15.260	2,287,733.42	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	138,087	39.800	5,495,862.60	
	SANDS CHINA LTD	240,980	21.400	5,156,972.00	
	SINO LAND CO	366,000	8.080	2,957,280.00	

	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	133,000	12.260	1,630,580.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	144,023	78.650	11,327,408.95	
	SWIRE PACIFIC LTD	42,366	50.100	2,122,536.60	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,200	15.260	1,773,212.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	137,000	81.150	11,117,550.00	
	WH GROUP LTD	827,000	4.690	3,878,630.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	166,733	26.500	4,418,424.50	
	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	164,000	9.390	1,539,960.00	
香港・ドル　小計		7,615,404		249,752,956.38 (4,802,749,351)	
合計		112,868,857		780,690,036,233 (780,690,036,233)	

（２）株式以外の有価証券

2023年11月20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	16,349.00	1,695,718.28	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	32,282.00	1,166,025.84	
		AMERICAN TOWER REIT INC	46,330.00	9,161,294.20	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	49,139.00	875,165.59	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,107.00	2,384,647.28	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,810.00	815,734.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,614.00	927,132.90	
		CROWN CASTLE INC	43,127.00	4,481,757.84	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	28,959.00	3,895,854.27	
		EQUINIX INC	9,295.00	7,200,278.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,562.00	1,221,261.48	
		EQUITY RESIDENTIAL	35,765.00	1,982,453.95	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,376.00	1,345,463.52	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	21,001.00	2,693,588.26	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	26,080.00	1,184,292.80	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	37,960.00	540,930.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,361.00	895,325.67	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	70,647.00	1,219,367.22	
		INVITATION HOMES INC	60,791.00	2,038,322.23	
		IRON MOUNTAIN INC	28,970.00	1,802,803.10	
		KIMCO REALTY CORP	61,625.00	1,158,550.00	

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,593.00	1,407,622.06	
	PROLOGIS INC	91,789.00	10,103,215.23	
	PUBLIC STORAGE	15,727.00	4,052,847.90	
	REALTY INCOME CORP	66,961.00	3,542,906.51	
	REGENCY CENTERS CORP	16,477.00	1,018,278.60	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,770.00	2,517,056.70	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	32,494.00	3,953,869.92	
	SUN COMMUNITIES INC	12,373.00	1,518,167.10	
	UDR INC	31,077.00	1,019,947.14	
	VENTAS INC	39,746.00	1,770,286.84	
	VICI PROPERTIES INC	99,851.00	2,853,741.58	
	WELLTOWER INC	49,394.00	4,321,481.06	
	WP CAREY INC	21,267.00	1,202,436.18	
アメリカ・ドル　小計		1,185,669.00	87,967,824.85 (13,190,775,336)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	70,014.00	457,471.47	
	SEGRO PLC	115,800.00	952,339.20	
イギリス・ポンド　小計		185,814.00	1,409,810.67 (263,197,554)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	106,855.00	764,013.25	
	GOODMAN GROUP	168,453.00	3,896,317.89	
	GPT GROUP	189,991.00	790,362.56	
	LENDLEASE GROUP	68,492.00	469,170.20	
	MIRVAC GROUP	391,330.00	802,226.50	
	SCENTRE GROUP	515,008.00	1,369,921.28	
	STOCKLAND	236,546.00	943,818.54	
	VICINITY CENTRES	383,997.00	710,394.45	
オーストラリア・ドル　小計		2,060,672.00	9,746,224.67 (950,939,141)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,435.00	380,840.25	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,286.00	267,810.72	
カナダ・ドル　小計		23,721.00	648,650.97 (70,865,118)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	370,200.00	1,036,560.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	528,690.00	983,363.40	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	343,600.00	542,888.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	235,800.00	325,404.00	
シンガポール・ドル　小計		1,478,290.00	2,888,215.40 (322,238,192)	
ユーロ	COVIVIO	5,080.00	226,060.00	
	GECINA SA	4,558.00	454,432.60	

		KLEPIERRE	21,345.00	492,856.05	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,726.00	641,646.72	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	16,467.00	420,896.52	
	ユーロ　小計		59,176.00	2,235,891.89 (365,657,760)	
	香港・ドル	LINK REIT	251,271.00	10,013,149.35	
	香港・ドル　小計		251,271.00	10,013,149.35 (192,552,862)	
投資証券　合計			5,244,613	15,356,225,963 (15,356,225,963)	
合計				15,356,225,963 (15,356,225,963)	

（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	605銘柄	70.40	－	74.80
	投資証券	34銘柄	－	1.59	
イギリス・ポンド	株式	82銘柄	4.07	－	4.26
	投資証券	2銘柄	－	0.03	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.10	－	0.11
オーストラリア・ドル	株式	51銘柄	1.87	－	2.06
	投資証券	8銘柄	－	0.11	
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.20	－	3.33
	投資証券	2銘柄	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.31	－	0.36
	投資証券	4銘柄	－	0.04	
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.68	－	2.79
スウェーデン・クローナ	株式	43銘柄	0.88	－	0.92
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.93	－	0.97
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.05	－	0.05
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.19	－	0.19
ユーロ	株式	222銘柄	9.14	－	9.54
	投資証券	5銘柄	－	0.04	
香港・ドル	株式	28銘柄	0.58	－	0.63
	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11月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	91,950,419
金銭信託	19,071,274
コール・ローン	901,917,064
株式	7,389,780,711
投資信託受益証券	599,918,870
投資証券	6,980,034
派生商品評価勘定	23,457,822
未収入金	12,135,124
未収配当金	8,747,913
差入委託証拠金	294,997,317
流動資産合計	9,348,956,548
資産合計	9,348,956,548
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,342,601
未払解約金	48,509,343
その他未払費用	932
流動負債合計	59,852,876
負債合計	59,852,876
純資産の部	
元本等	
元本	7,117,768,792
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,171,334,880
元本等合計	9,289,103,672
純資産合計	9,289,103,672
負債純資産合計	9,348,956,548

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11月22日 至　2023年11月20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11月20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	4,729,645,782円
同期中追加設定元本額	3,508,693,484円
同期中一部解約元本額	1,120,570,474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	2,915,896,360円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	21,977,301円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	29,170,813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）	10,602,726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）	60,797,503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）	613,202,841円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	1,803,005,099円
ＦＷニッセイ新興国株インデックス	10,439,849円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	141,867円
ＤＣニッセイ新興国株式インデックス	1,652,534,433円
計	7,117,768,792円
２．　受益権の総数	7,117,768,792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11月22日 至　2023年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	223,941,827
投資信託受益証券	△30,028,224
投資証券	366,082
合計	194,279,685

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年11月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	886,347,454	－	877,592,634	△8,754,820
アメリカ・ドル	886,347,454	－	877,592,634	△8,754,820
合計	886,347,454	－	877,592,634	△8,754,820

（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11月20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	1,247,937,882	－	1,268,807,923	20,870,041
合計	1,247,937,882	－	1,268,807,923	20,870,041

（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11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3051円 (13,051円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年11月20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	26.820	14,321.88	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	533	8.780	4,679.74	
	CREDICORP LTD	495	127.760	63,241.20	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	400	26.980	10,792.00	
	H WORLD GROUP LIMITED (ADR)	1,493	36.150	53,971.95	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	9,900	1.363	13,493.70	
	IQIYI INC-ADR	3,200	5.080	16,256.00	
	JOYY INC	334	41.580	13,887.72	
	KANZHUN LTD	1,900	16.560	31,464.00	
	KE HOLDINGS INC	5,299	15.290	81,021.71	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	567	64.560	36,605.52	
	LUFAX HOLDING LTD	5,900	0.909	5,363.10	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,892	0.000	0.18	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	700	26.650	18,655.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	2,982	0.000	0.29	
	NIO INC - ADR	11,342	7.390	83,817.38	

	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)	4,741	115.150	545,926.15	
	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	16.870	8,435.00	
	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	2.175	9,396.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	719	74.750	53,745.25	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	5,163	0.000	0.51	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	2,824	9.500	26,828.00	
	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	8.370	49,994.01	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	2,625	15.520	40,740.00	
	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	11.700	3,907.80	
	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	45.890	157,219.14	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,347	22.550	75,474.85	
アメリカ・ドル　小計		181,818		1,419,248.05 (212,816,245)	
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	4,285.050	2,215,370.85	
	ADANI ENTERPRISES LTD	1,562	2,208.800	3,450,145.60	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	2,770	936.100	2,592,997.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	3,805	810.050	3,082,240.25	
	ADANI POWER LTD	5,133	387.300	1,988,010.90	

AMBUJA CEMENTS LTD	5,084	421.100	2,140,872.40	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	825	5,478.950	4,520,133.75	
ASHOK LEYLAND LTD	11,457	174.300	1,996,955.10	
ASIAN PAINTS LTD	3,050	3,168.900	9,665,145.00	
ASTRAL LTD	1,023	1,911.400	1,955,362.20	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	1,152	730.200	841,190.40	
AUROBINDO PHARMA LTD	2,097	1,007.350	2,112,412.95	
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,325	3,810.900	5,049,442.50	
AXIS BANK LTD	18,643	994.350	18,537,667.05	
BAJAJ AUTO LTD	593	5,631.500	3,339,479.50	
BAJAJ FINANCE LTD	2,274	7,221.000	16,420,554.00	
BAJAJ FINSERV LTD	3,227	1,615.900	5,214,509.30	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	215	7,347.800	1,579,777.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	331	2,643.650	875,048.15	
BANDHAN BANK LTD	3,556	217.000	771,652.00	
BANK OF BARODA	9,496	196.800	1,868,812.80	
BERGER PAINTS INDIA LTD	2,366	587.800	1,390,734.80	
BHARAT ELECTRONICS LTD	24,074	146.100	3,517,211.40	
BHARAT FORGE LTD	1,798	1,060.400	1,906,599.20	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,051	390.250	1,971,152.75	
BHARTI AIRTEL LTD	18,195	947.300	17,236,123.50	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	878	4,718.300	4,142,667.40	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LIMITED	4,728	389.150	1,839,901.20	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	3,680	1,126.400	4,145,152.00	
CIPLA LIMITED	4,391	1,249.400	5,486,115.40	
COAL INDIA LTD	13,639	345.250	4,708,864.75	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	740	2,165.450	1,602,433.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,694	750.700	1,271,685.80	
CUMMINS INDIA LTD	1,068	1,829.650	1,954,066.20	
DABUR INDIA LTD	4,295	540.700	2,322,306.50	
DIVI'S LABORATORIES LTD	805	3,600.850	2,898,684.25	
DLF LTD	4,558	631.150	2,876,781.70	
DR. REDDY'S LABORATORIES	819	5,611.550	4,595,859.45	
EICHER MOTORS LTD	1,105	3,865.300	4,271,156.50	
GAIL INDIA LTD	14,833	126.250	1,872,666.25	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,986	996.950	2,976,892.70	
GODREJ PROPERTIES LTD	606	1,862.900	1,128,917.40	
GRASIM INDUSTRIES LTD	1,672	1,970.550	3,294,759.60	
HAVELLS INDIA LTD	1,686	1,280.750	2,159,344.50	

HCL TECHNOLOGIES LTD	7,787	1,309.150	10,194,351.05	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	787	2,906.700	2,287,572.90	
HDFC BANK LTD	22,524	1,505.100	33,900,872.40	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	8,298	651.800	5,408,636.40	
HERO MOTOCORP LTD	827	3,334.750	2,757,838.25	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	10,041	497.750	4,997,907.75	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	1,478	2,126.000	3,142,228.00	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1,930	310.000	598,300.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	6,817	2,528.800	17,238,829.60	
ICICI BANK LTD	41,599	921.850	38,348,038.15	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,651	1,446.150	2,387,593.65	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,346	559.850	1,313,408.10	
IDFC BANK LTD	26,252	85.100	2,234,045.20	
INDIAN HOTELS CO LTD	7,731	411.200	3,178,987.20	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	25,665	102.700	2,635,795.50	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	1,331	707.350	941,482.85	
INDRAPRASTHA GAS LTD	1,088	388.650	422,851.20	
INFO EDGE INDIA LTD	593	4,805.300	2,849,542.90	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	26,710	1,437.550	38,396,960.50	
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,092	2,606.550	2,846,352.60	
ITC LTD	23,567	439.250	10,351,804.75	
JINDAL STEEL & POWER LTD	2,793	647.100	1,807,350.30	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	21,528	220.800	4,753,382.40	
JSW STEEL LTD	5,271	768.800	4,052,344.80	
JUBILANT FOODWORKS LTD	2,065	528.050	1,090,423.25	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	8,800	1,764.600	15,528,480.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	5,360	3,109.000	16,664,240.00	
LTIMINDTREE LIMITED	625	5,518.500	3,449,062.50	
LUPIN LTD	907	1,196.300	1,085,044.10	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	7,667	1,584.550	12,148,744.85	
MARICO LTD	4,615	529.950	2,445,719.25	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,109	10,523.500	11,670,561.50	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	6,533	607.750	3,970,430.75	
MPHASIS LTD	416	2,325.400	967,366.40	
MRF LTD	7	111,475.300	780,327.10	
MUTHOOT FINANCE LTD	448	1,339.350	600,028.80	
NESTLE INDIA LTD	272	24,373.050	6,629,469.60	
NTPC LTD	38,270	251.600	9,628,732.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	27,953	196.350	5,488,571.55	

PAGE INDUSTRIES LTD	55	37,495.600	2,062,258.00	
PETRONET LNG LTD	6,694	196.050	1,312,358.70	
PI INDUSTRIES LTD	717	3,726.500	2,671,900.50	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,522	2,510.300	3,820,676.60	
POWER FINANCE CORPORATION	9,573	316.250	3,027,461.25	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	39,426	209.500	8,259,747.00	
REC LTD	9,057	339.800	3,077,568.60	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	24,408	2,355.550	57,494,264.40	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	24,494	90.050	2,205,684.70	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	2,791	732.850	2,045,384.35	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	3,698	1,413.950	5,228,787.10	
SHREE CEMENT LTD	75	26,199.800	1,964,985.00	
SHRIRAM FINANCE LIMITED	2,256	1,994.800	4,500,268.80	
SIEMENS LTD	622	3,570.750	2,221,006.50	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	3,909	585.800	2,289,892.20	
SRF LTD	1,334	2,361.350	3,150,040.90	
STATE BANK OF INDIA	14,800	563.050	8,333,140.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	7,199	1,194.600	8,599,925.40	
SUPREME INDUSTRIES LTD	503	4,187.700	2,106,413.10	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	7,365	3,502.450	25,795,544.25	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	3,817	930.850	3,553,054.45	
TATA ELXSI LTD	210	8,306.600	1,744,386.00	
TATA MOTORS LTD	13,971	681.550	9,521,935.05	
TATA POWER CO LTD	13,851	262.650	3,637,965.15	
TATA STEEL LTD	59,823	125.200	7,489,839.60	
TECH MAHINDRA LTD	4,711	1,202.750	5,666,155.25	
TITAN CO LTD	2,648	3,338.850	8,841,274.80	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	514	2,082.350	1,070,327.90	
TRENT LTD	1,299	2,576.400	3,346,743.60	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	898	3,164.850	2,842,035.30	
TVS MOTOR CO LTD	2,017	1,747.600	3,524,909.20	
ULTRATECH CEMENT LTD	930	8,790.950	8,175,583.50	
UNITED SPIRITS LTD	1,802	1,056.450	1,903,722.90	
UPL LTD	4,658	561.750	2,616,631.50	
VARUN BEVERAGES LTD	4,070	1,043.450	4,246,841.50	
VEDANTA LTD	4,714	239.500	1,129,003.00	
WIPRO LTD	10,622	395.400	4,199,938.80	
YES BANK LTD	92,528	20.800	1,924,582.40	

	ZOMATO LTD	26,053	122.200	3,183,676.60	
インド・ルピー　小計		958,189		687,767,446.90 (1,244,859,079)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	84,200	2,540.000	213,868,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	53,200	1,635.000	86,982,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	173,400	5,700.000	988,380,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	464,200	9,075.000	4,212,615,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	310,700	5,900.000	1,833,130,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	110,400	4,980.000	549,792,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	575,700	5,225.000	3,008,032,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	272,598	1,165.000	317,576,670.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	45,500	5,500.000	250,250,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	6,968,800	84.000	585,379,200.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	8,500.000	51,000,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	9,600	10,475.000	100,560,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	10,400	6,425.000	66,820,000.00	
	INTERNATIONAL NICKEL INDONES	18,100	4,590.000	83,079,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	176,100	1,620.000	285,282,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	113,600	2,360.000	268,096,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	162,600	980.000	159,348,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	9,400	6,625.000	62,275,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	99,800	2,890.000	288,422,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	400,000	3,550.000	1,420,000,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	49,100	3,470.000	170,377,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	10,600	22,875.000	242,475,000.00	
インドネシア・ルピア　小計		10,123,998		15,243,739,370.00 (147,864,272)	
オフショア・人民元	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,500	9.520	42,840.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	528	167.780	88,587.84	
	AECC AVIATION POWER CO-A	3,100	37.170	115,227.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	71,800	3.630	260,634.00	

AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	4,637	17.430	80,822.91	
AIR CHINA LTD-A	10,100	8.130	82,113.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	14,800	5.820	86,136.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	23.420	23,420.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	258.240	77,472.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	140	145.390	20,354.60	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS	9,200	3.450	31,740.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	8,600	4.470	38,442.00	
BANK OF CHINA LTD-A	32,100	3.950	126,795.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	22,200	5.790	128,538.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	7,800	6.680	52,104.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,800	7.650	67,320.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	4,300	24.880	106,984.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	4,500	6.000	27,000.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	5,700	6.180	35,226.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	218	327.480	71,390.64	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,000	50.160	100,320.00	
BEIJING UNITED INFORMATION-A	1,305	37.840	49,381.20	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	560	48.600	27,216.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	24,200	4.900	118,580.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	45,400	3.980	180,692.00	
BYD CO LTD -A	1,300	236.760	307,788.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	7,500	8.220	61,650.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	158.170	15,817.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	12,300	5.800	71,340.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,600	6.380	61,248.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	3,200	25.710	82,272.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6,800	4.210	28,628.00	

CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	37,000	2.920	108,040.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	6,900	13.430	92,667.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	2,400	43.950	105,480.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1,000	31.570	31,570.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	10,800	30.330	327,564.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	10,500	14.320	150,360.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	10.800	20,520.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	21,200	3.800	80,560.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	7.060	74,836.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	1,600	21.120	33,792.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,000	24.160	96,640.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	25,900	5.440	140,896.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	8,800	5.810	51,128.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	10,871	4.670	50,767.57	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	1,473	52.520	77,361.96	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	4,800	30.800	147,840.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4,700	6.130	28,811.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	22,900	5.090	116,561.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	12,800	4.720	60,416.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	800	93.580	74,864.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	8,100	11.620	94,122.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	13,400	22.620	303,108.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	500	69.830	34,915.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	24,600	2.500	61,500.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	5,850	16.510	96,583.50	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	600	64.350	38,610.00	
CITIC SECURITIES CO-A	6,700	22.520	150,884.00	

CMOC GROUP LTD-A	11,300	5.250	59,325.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	1,300	53.670	69,771.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,280	180.730	412,064.40	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	5,070	9.690	49,128.30	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,600	26.330	68,458.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,200	15.150	63,630.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	6,013	15.300	91,998.90	
EVE ENERGY CO LTD-A	900	45.510	40,959.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	6.640	39,176.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	2,554	38.100	97,307.40	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	11,600	10.050	116,580.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	6,300	16.350	103,005.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	2,800	37.200	104,160.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	2,800	44.050	123,340.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	13,200	3.890	51,348.00	
GEM CO LTD-A	13,300	5.940	79,002.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	14.810	54,797.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	196	104.980	20,576.08	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	200	69.710	13,942.00	
GOERTEK INC -A	1,000	19.240	19,240.00	
GOLDWIND SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A	3,900	9.050	35,295.00	
GONGNIU GROUP CO LTD-A	700	97.660	68,362.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,800	23.410	42,138.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,500	27.940	97,790.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,200	32.500	104,000.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,000	44.790	44,790.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	5,400	7.460	40,284.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	8,700	9.930	86,391.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,300	29.510	38,363.00	

GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,000	27.220	27,220.00	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL HOLDINGS GROUP CO LTD-A	9,800	6.630	64,974.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,200	9.840	110,208.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,300	15.270	50,391.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,500	22.220	122,210.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	12,600	10.010	126,126.00	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,176	25.980	30,552.48	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	25.410	20,328.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	7,900	14.050	110,995.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2,800	13.400	37,520.00	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	5,700	7.000	39,900.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	700	150.580	105,406.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	400	54.600	21,840.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,300	41.330	53,729.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	7,700	7.710	59,367.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,500	15.840	134,640.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	4,100	8.160	33,456.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	5.560	34,472.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	17.630	24,682.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	138.200	69,100.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	1,183	32.500	38,447.50	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	49.200	59,040.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	100	326.380	32,638.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	54,400	4.780	260,032.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	14,000	14.710	205,940.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	1.600	51,840.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	4.010	8,421.00	

INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	2,800	26.950	75,460.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,372	22.920	31,446.24	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	2,900	10.420	30,218.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,000	58.630	58,630.00	
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS CO LTD-A	3,384	47.140	159,521.76	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,300	54.310	70,603.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	900	116.370	104,733.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,200	14.220	31,284.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	17.890	35,780.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	6,076	10.030	60,942.28	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	6,600	14.570	96,162.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	600	1,753.420	1,052,052.00	
LB GROUP CO LTD-A	2,900	17.690	51,301.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	2,400	13.550	32,520.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	13,900	6.780	94,242.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,480	23.590	152,863.20	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	3,089	31.900	98,539.10	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	900	208.300	187,470.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,300	27.970	36,361.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	480	135.800	65,184.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	3.220	66,010.00	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	974	59.910	58,352.34	
MUYUAN FOODS CO LTD-A	2,190	36.950	80,920.50	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,110	22.200	69,042.00	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	247.000	49,400.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	32.230	29,007.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	9.890	17,802.00	
NINESTAR CORP-A	1,700	28.370	48,229.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	5,400	14.120	76,248.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	72.890	51,023.00	

NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	4,400	14.360	63,184.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	4,500	8.990	40,455.00	
PETROCHINA CO LTD-A	29,700	7.040	209,088.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	675	34.190	23,078.25	
PICC HOLDING CO-A	14,900	5.230	77,927.00	
PING AN BANK CO LTD-A	9,700	10.150	98,455.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	4,900	42.660	209,034.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	10.840	29,268.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	12,200	4.500	54,900.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	5.120	51,200.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	2,700	16.710	45,117.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,000	11.080	33,240.00	
S F HOLDING CO LTD-A	2,200	40.950	90,090.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,000	14.480	115,840.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	5,100	14.630	74,613.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	14.210	42,630.00	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	4,600	15.840	72,864.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	13,700	7.110	97,407.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	2,300	12.190	28,037.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	4,700	18.480	86,856.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	460	22.760	10,469.60	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,900	29.860	56,734.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	30,200	2.960	89,392.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,560	43.230	67,438.80	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	4.540	28,602.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	28.200	101,520.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,600	4.880	41,968.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	5,100	10.890	55,539.00	

SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	5,500	18.010	99,055.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	18,900	6.860	129,654.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	1,160	24.650	28,594.00	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	14,800	5.750	85,100.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	5,600	5.780	32,368.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	480	235.980	113,270.40	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	7,900	10.670	84,293.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	140	76.150	10,661.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11,000	4.620	50,820.00	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	160	75.900	12,144.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,500	61.400	92,100.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	480	29.960	14,380.80	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	500	285.500	142,750.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	336	123.540	41,509.44	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,800	23.090	41,562.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	500	87.460	43,730.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	121.880	19,500.80	
TBEA CO LTD-A	2,860	14.090	40,297.40	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4,400	4.170	18,348.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	1,875	18.600	34,875.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	7,200	10.670	76,824.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	1,300	54.110	70,343.00	
TONGWEI CO LTD-A	3,900	27.300	106,470.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	1,092	30.450	33,251.40	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	600	78.460	47,076.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	419	77.540	32,489.26	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	980	21.530	21,099.40	

WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	1,500	82.300	123,450.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	3,400	14.580	49,572.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1,800	18.260	32,868.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.790	65,863.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	405	107.000	43,335.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	50.070	10,014.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	5,100	4.640	23,664.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	5,200	8.020	41,704.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	2,300	155.000	356,500.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	1,872	85.360	159,793.92	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2,600	5.690	14,794.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	4,700	17.570	82,579.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	5,200	19.720	102,544.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	1,300	34.500	44,850.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,690	17.470	29,524.30	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	2,500	13.540	33,850.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	700	50.280	35,196.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	300	65.890	19,767.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	300	248.700	74,610.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	1,100	23.280	25,608.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	3,000	20.790	62,370.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	650	36.280	23,582.00	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	800	44.990	35,992.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,008	16.540	16,672.32	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2,000	10.330	20,660.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	12,400	7.320	90,768.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	7,100	11.970	84,987.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9,400	6.490	61,006.00	

	ZTE CORP-A	700	27.560	19,292.00	
オフショア・人民元　小計		1,399,171		17,861,446.79 (370,771,485)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	2,517	30,200.000	76,013,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,540	27,780.000	126,121,200.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,462	15,860.000	23,187,320.00	
コロンビア・ペソ　小計		8,519		225,321,920.00 (8,251,289)	
タイ・バーツ	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	11,200	218.000	2,441,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	38,000	69.000	2,622,000.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-FOREIGN	88,100	3.640	320,684.00	
	B GRIMM POWER PCL-FOREIGN	3,100	26.250	81,375.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	93,400	26.500	2,475,100.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	71,300	8.150	581,095.00	
	BANPU PUBLIC CO LTD-FOR REG	85,600	8.100	693,360.00	
	BERLI JUCKER PUB CO-FORGN	6,000	27.750	166,500.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	57,400	7.350	421,890.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	4,400	219.000	963,600.00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	14,300	66.500	950,950.00	
	CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN	15,700	39.500	620,150.00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	26,800	18.800	503,840.00	
	CP ALL PCL-FOREIGN	50,500	56.750	2,865,875.00	
	CP AXTRA PUBLIC COMPANY LIMITED (F)	19,900	29.500	587,050.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN	25,500	81.250	2,071,875.00	
	ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R	1,000	127.500	127,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN	19,200	47.500	912,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F	8,800	47.250	415,800.00	
	GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	19,600	46.500	911,400.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	44,400	12.200	541,680.00	

	INDORAMA VENTURES-FOREIGN	12,200	25.500	311,100.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6,300	71.750	452,025.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	4,900	133.000	651,700.00	
	KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	32,300	18.400	594,320.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN	15,500	45.750	709,125.00	
	LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	28,500	7.650	218,025.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	18,500	27.500	508,750.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG	2,100	43.750	91,875.00	
	OSOTSPA PCL-FOREIGN	3,200	24.300	77,760.00	
	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	9,000	158.500	1,426,500.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	14,300	38.000	543,400.00	
	PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN	32,900	19.900	654,710.00	
	PTT PCL/FOREIGN	75,300	34.250	2,579,025.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	16,500	32.500	536,250.00	
	SCB X PCL-FOREIGN	6,800	99.000	673,200.00	
	SCG PACKAGING PCL-FOREIGN	7,300	37.500	273,750.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	7,000	291.000	2,037,000.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	9,300	50.000	465,000.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-FOREIGN	60,798	6.100	370,867.80	
タイ・バーツ　小計		1,066,898		34,449,706.80 (147,100,248)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	1,396	988.500	1,379,946.00	
	KOMERCNI BANKA AS	654	679.000	444,066.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	91.000	102,284.00	
チェコ・コルナ　小計		3,174		1,926,296.00 (12,844,156)	
チリ・ペソ	BANCO DE CHILE	347,416	94.610	32,869,027.76	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	683	23,015.000	15,719,245.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	627,335	42.050	26,379,436.75	
	CENCOSUD SA	9,218	1,579.000	14,555,222.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	273	5,150.000	1,405,950.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	92,857	51.590	4,790,492.63	
	EMPRESAS CMPC SA	10,124	1,767.000	17,889,108.00	
	EMPRESAS COPEC SA	3,034	6,505.000	19,736,170.00	
	ENEL CHILE SA	90,486	55.300	5,003,875.80	

	ENERSIS SA	205,266	98.000	20,116,068.00	
	FALABELLA SA	7,564	2,010.000	15,203,640.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,062	44,260.000	47,004,120.00	
チリ・ペソ　小計		1,395,318		220,672,355.94 (37,227,647)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	29,310	30.080	881,644.80	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	11,662	42.220	492,369.64	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	2,552	308.250	786,654.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,135	38.280	311,407.80	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	593	849.000	503,457.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	6,843	58.550	400,657.65	
	HEKTAS TICARET T.A.S	9,137	20.640	188,587.68	
	KOC HOLDING AS	5,853	142.200	832,296.60	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	412	736.000	303,232.00	
	SASA POLYESTER SANAYI	8,293	43.880	363,896.84	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	1,087	247.000	268,489.00	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,587	153.500	1,318,104.50	
	TURK HAVA YOLLARI AO	3,748	254.250	952,929.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	10,503	48.900	513,596.70	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,833	56.650	670,339.45	
	TURKIYE IS BANKASI-C	32,580	20.540	669,193.20	
	YAPI VE KREDI BANKASI	39,247	16.890	662,881.83	
トルコ・リラ　小計		190,375		10,119,737.69 (52,966,707)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	4,259	2,812.000	11,976,308.00	
	OTP BANK RT	1,815	13,880.000	25,192,200.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	875	8,730.000	7,638,750.00	
ハンガリー・フォリント　小計		6,949		44,807,258.00 (19,320,666)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	6,310	47.200	297,832.00	
	AYALA CORPORATION	1,795	647.000	1,161,365.00	
	AYALA LAND INC	55,300	29.700	1,642,410.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	15,205	105.500	1,604,127.50	
	BDO UNIBANK INC	21,458	130.200	2,793,831.60	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	9,230	211.000	1,947,530.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	18,558	38.400	712,627.20	

	JOLLIBEE FOODS CORP	1,380	230.000	317,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,370	378.000	517,860.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	15,127	52.100	788,116.70	
	PLDT INC	585	1,240.000	725,400.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,795	855.000	1,534,725.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	105,700	31.500	3,329,550.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	7,280	111.800	813,904.00	
フィリピン・ペソ　小計		261,093		18,186,679.00 (48,974,908)	
ブラジル・レアル	AMBEV SA	36,500	13.600	496,400.00	
	ATACADAO SA	1,900	10.670	20,273.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	17,203	13.740	236,369.22	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	41,379	15.430	638,477.97	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	9,200	33.460	307,832.00	
	BANCO DO BRASIL SA	6,500	50.660	329,290.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	3,000	30.910	92,730.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	4,400	31.780	139,832.00	
	BM&FBOVESPA SA	47,700	12.730	607,221.00	
	CCR SA	6,800	13.110	89,148.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,600	44.210	114,946.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	10,100	40.410	408,141.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	8,475	13.370	113,310.75	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,500	64.660	161,650.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	5,100	14.860	75,786.00	
	COSAN SA	10,400	17.940	186,576.00	
	CPFL ENERGIA SA	3,000	36.480	109,440.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,300	51.690	118,887.00	
	ENEVA SA	8,300	12.840	106,572.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	675	43.060	29,065.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	8,600	34.250	294,550.00	
	GERDAU SA-PREF	10,020	24.510	245,590.20	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	43,506	4.580	199,257.48	
	HYPERA S.A	2,900	33.950	98,455.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	40,650	30.450	1,237,792.50	
	ITAUSA SA	41,316	9.840	406,549.44	
	JBS SA	7,100	21.640	153,644.00	
	KLABIN SA - UNIT	4,000	23.130	92,520.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	7,395	60.800	449,616.00	

	LOJAS RENNER S.A.	5,962	14.350	85,554.70	
	MAGAZINE LUIZA SA	15,200	2.220	33,744.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	7,300	15.260	111,398.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	32,000	39.520	1,264,640.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	36,600	36.710	1,343,586.00	
	PRIO S.A.	6,700	46.480	311,416.00	
	RAIA DROGASIL SA	10,936	27.350	299,099.60	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	5,300	25.210	133,613.00	
	RUMO SA	8,200	23.250	190,650.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	11,700	13.110	153,387.00	
	SUZANO S.A.	5,622	52.940	297,628.68	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	3,100	50.360	156,116.00	
	TIM SA	3,500	16.580	58,030.00	
	TOTVS SA	4,400	32.530	143,132.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	5,200	24.620	128,024.00	
	VALE SA	27,554	74.240	2,045,608.96	
	VIBRA ENERGIA SA	7,800	21.480	167,544.00	
	WEG SA	12,420	33.260	413,089.20	
ブラジル・レアル　小計		603,013		14,896,183.20 (454,768,556)	
ポーランド・ズロチ	ALLEGRO.EU SA	3,469	29.200	101,294.80	
	BANK PEKAO SA	1,334	138.750	185,092.50	
	BUDIMEX	97	544.000	52,768.00	
	CD PROJEKT SA	427	113.150	48,315.05	
	CYFROWY POLSAT SA	1,022	12.365	12,637.03	
	DINO POLSKA SA	331	441.600	146,169.60	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,585	115.750	183,463.75	
	LPP SA	9	15,250.000	137,250.00	
	MBANK SA	114	559.000	63,726.00	
	ORLEN SA	4,634	62.260	288,512.84	
	PEPCO GROUP NV	1,508	19.370	29,209.96	
	PGE SA	8,858	7.108	62,962.66	
	PKO BANK POLSKI SA	7,140	47.680	340,435.20	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	4,925	46.990	231,425.75	
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	361	488.800	176,456.80	
ポーランド・ズロチ　小計		35,814		2,059,719.94 (76,754,640)	
マレーシア・リンギット	AMBANK HOLDINGS BHD	9,700	3.930	38,121.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	20,500	2.420	49,610.00	
	CELCOMDIGI BERHAD	22,500	4.260	95,850.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	59,300	5.800	343,940.00	
	DIALOG GROUP BHD	14,900	2.140	31,886.00	

	GAMUDA BHD	18,800	4.660	87,608.00	
	GENTING BHD	6,700	4.330	29,011.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	11,300	2.540	28,702.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	4,500	19.100	85,950.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,900	16.700	31,730.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	17,200	5.950	102,340.00	
	INARI AMERTRON BHD	16,600	2.970	49,302.00	
	IOI CORPORATION BHD	19,700	4.000	78,800.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	3,400	22.000	74,800.00	
	MALAYAN BANKING BHD	46,500	9.120	424,080.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	4,900	7.430	36,407.00	
	MAXIS BHD	19,600	4.080	79,968.00	
	MISC BHD	5,000	7.390	36,950.00	
	MR DIY GROUP M BHD	16,300	1.590	25,917.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	122.700	73,620.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	28,500	7.220	205,770.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,300	22.740	75,042.00	
	PETRONAS GAS BHD	5,400	17.140	92,556.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,680	14.800	84,064.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	26,100	4.880	127,368.00	
	PUBLIC BANK BHD	122,600	4.230	518,598.00	
	QL RESOURCES BHD	3,000	5.600	16,800.00	
	RHB BANK BHD	17,000	5.630	95,710.00	
	SIME DARBY BERHAD	4,800	2.440	11,712.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	19,000	4.380	83,220.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	12,500	5.230	65,375.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	23,600	9.960	235,056.00	
マレーシア・リンギット　小計		591,380		3,415,863.00 (109,361,245)	
メキシコ・ペソ	ALFA S.A.B.-A	17,900	11.670	208,893.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	158,600	15.230	2,415,478.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,000	178.070	712,280.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	5,900	58.510	345,209.00	
	CEMEX SAB-CPO	125,400	12.060	1,512,324.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	3,275	145.500	476,512.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	15,000	218.160	3,272,400.00	
	GRUMA S.A.B.-B	1,200	324.450	389,340.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	1,580	397.240	627,639.20	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	2,800	244.510	684,628.00	

	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	10,100	83.560	843,956.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	5,300	137.180	727,054.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	21,200	161.000	3,413,200.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	16,600	41.560	689,896.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	24,300	78.430	1,905,849.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	14,000	7.980	111,720.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,160	233.110	270,407.60	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	10,000	34.090	340,900.00	
	OPERADORA DE SITES MEX-A-1	12,000	20.070	240,840.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	12,500	33.370	417,125.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,765	168.740	297,826.10	
	WALMART DE MEXICO-SER V	42,700	68.170	2,910,859.00	
メキシコ・ペソ　小計		507,280		22,814,336.40 (198,585,110)	
ユーロ	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	12,628	1.515	19,131.42	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	17,393	1.670	29,046.31	
	FF GROUP	129	4.800	619.20	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,778	12.660	22,509.48	
	JUMBO SA	1,127	26.640	30,023.28	
	MOTOR OIL (HELLAS) SA	567	22.240	12,610.08	
	MYTILINEOS S.A.	713	34.440	24,555.72	
	NATIONAL BANK OF GREECE	4,601	6.120	28,158.12	
	OPAP SA	2,062	14.750	30,414.50	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	5,508	3.140	17,295.12	
	PUBLIC POWER CORP	1,420	10.290	14,611.80	
ユーロ　小計		47,926		228,975.03 (37,446,576)	
韓国・ウォン	AMOREPACIFIC CORP	353	135,700.000	47,902,100.00	
	BGF RETAIL CO LTD/NEW	15	133,500.000	2,002,500.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	931	74,100.000	68,987,100.00	
	CELLTRION INC	918	168,400.000	154,591,200.00	
	CELLTRION PHARM INC	175	82,300.000	14,402,500.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	61	319,000.000	19,459,000.00	

COSMOAM&T CO LTD	205	159,000.000	32,595,000.00	
COWAY CO LTD	312	51,900.000	16,192,800.00	
DAUM COMMUNICATIONS CORP	2,482	47,500.000	117,895,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	363	81,600.000	29,620,800.00	
DOOSAN BOBCAT INC	272	40,900.000	11,124,800.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,365	14,390.000	48,422,350.00	
ECOPRO BM CO LTD	417	238,000.000	99,246,000.00	
ECOPRO CO LTD	159	679,000.000	107,961,000.00	
F&F CO LTD / NEW	90	88,400.000	7,956,000.00	
GS HOLDINGS CORP	407	42,500.000	17,297,500.00	
HANA FINANCIAL GROUP	2,407	41,600.000	100,131,200.00	
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	531	44,850.000	23,815,350.00	
HANMI PHARM CO LTD	59	301,500.000	17,788,500.00	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	367	62,800.000	23,047,600.00	
HANON SYSTEMS	960	7,190.000	6,902,400.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	330	121,300.000	40,029,000.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	968	31,750.000	30,734,000.00	
HD HYUNDAI	361	59,300.000	21,407,300.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	128	111,400.000	14,259,200.00	
HD KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	337	98,200.000	33,093,400.00	
HLB INC	646	30,800.000	19,896,800.00	
HMM CO LTD	2,204	15,500.000	34,162,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	264	65,800.000	17,371,200.00	
HYBE CO LTD	157	190,300.000	29,877,100.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	474	36,700.000	17,395,800.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	131	175,500.000	22,990,500.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	212	75,400.000	15,984,800.00	
HYUNDAI MOBIS	494	229,500.000	113,373,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,075	184,400.000	198,230,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	239	107,800.000	25,764,200.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	107,400.000	18,258,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	528	35,150.000	18,559,200.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,205	11,680.000	25,754,400.00	
JYP ENTERTAINMENT CORP	217	90,300.000	19,595,100.00	
KAKAO GAMES CORP	157	24,600.000	3,862,200.00	
KAKAOBANK CORP	1,670	23,700.000	39,579,000.00	
KAKAOPAY CORP	248	41,800.000	10,366,400.00	
KANGWON LAND INC	358	15,360.000	5,498,880.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	2,982	54,600.000	162,817,200.00	
KIA CORPORATION	2,099	85,200.000	178,834,800.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	515	46,000.000	23,690,000.00	

KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,118	17,780.000	37,658,040.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	481	57,900.000	27,849,900.00	
KOREA ZINC CO LTD	53	488,500.000	25,890,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,198	22,550.000	27,014,900.00	
KRAFTON INC	240	193,100.000	46,344,000.00	
KT CORP	746	33,050.000	24,655,300.00	
KT&G CORP	789	90,700.000	71,562,300.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	101	131,100.000	13,241,100.00	
L&F CO LTD	197	148,100.000	29,175,700.00	
LG CHEM LTD	402	484,000.000	194,568,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	56	299,000.000	16,744,000.00	
LG CORP	857	85,300.000	73,102,100.00	
LG DISPLAY CO LTD	1,329	13,610.000	18,087,690.00	
LG ELECTRONICS INC	917	105,700.000	96,926,900.00	
LG ENERGY SOLUTION	383	432,000.000	165,456,000.00	
LG H AND H CO LTD	100	337,500.000	33,750,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	83	249,000.000	20,667,000.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	1,340	10,400.000	13,936,000.00	
LG UPLUS CORP	815	10,440.000	8,508,600.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	113	154,900.000	17,503,700.00	
LOTTE ENERGY MATERIALS CORPORATION	126	41,350.000	5,210,100.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	848	55,900.000	47,403,200.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	1,312	7,370.000	9,669,440.00	
NAVER CORP	1,087	202,000.000	219,574,000.00	
NCSOFT CORPORATION	137	244,000.000	33,428,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	47,950.000	2,781,100.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	234	120,600.000	28,220,400.00	
PEARL ABYSS CORP	159	41,400.000	6,582,600.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	270	286,000.000	77,220,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	588	463,500.000	272,538,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	426	58,300.000	24,835,800.00	
S-OIL CORPORATION	300	67,800.000	20,340,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	145	723,000.000	104,835,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	701	117,900.000	82,647,900.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	502	139,400.000	69,978,800.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	37,944	72,500.000	2,750,940,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	6,746	57,500.000	387,895,000.00	

	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,205	25,250.000	30,426,250.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	201	245,000.000	49,245,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,102	7,400.000	37,754,800.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	495	69,100.000	34,204,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	448	444,000.000	198,912,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	365	147,600.000	53,874,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	452	38,800.000	17,537,600.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	3,586	36,100.000	129,454,600.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	152	85,700.000	13,026,400.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	115	67,100.000	7,716,500.00	
	SK HYNIX INC	4,394	129,900.000	570,780,600.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	181	67,500.000	12,217,500.00	
	SK INC	336	163,000.000	54,768,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	492	136,100.000	66,961,200.00	
	SK SQUARE CO LTD	542	48,600.000	26,341,200.00	
	SKC CO LTD	129	98,400.000	12,693,600.00	
	STX PAN OCEAN CO LTD	1,852	4,110.000	7,611,720.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	4,321	12,510.000	54,055,710.00	
	YUHAN CORP	448	61,600.000	27,596,800.00	
韓国・ウォン　小計		122,735		8,620,643,230.00 (996,546,357)	
香港・ドル	3SBIO INC	15,500	7.090	109,895.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	3,500	20.400	71,400.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	217,000	2.840	616,280.00	
	AIR CHINA LIMITED-H	10,000	5.340	53,400.00	
	AKESO INC	4,000	46.800	187,200.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	131,200	73.250	9,610,400.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	52,000	4.590	238,680.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	3.990	95,760.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	11,500	18.960	218,040.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	700	128.800	90,160.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	10,800	81.650	881,820.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	4,000	3.580	14,320.00	
	BAIDU INC-CLASS A	18,600	103.500	1,925,100.00	
	BANK OF CHINA LTD - H	618,000	2.830	1,748,940.00	

BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	77,000	4.580	352,660.00	
BEIGENE LTD	5,800	115.000	667,000.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	4,000	2.950	11,800.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	4,500	26.650	119,925.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	1.630	26,080.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	1,920	107.100	205,632.00	
BOC AVIATION LTD	1,900	52.700	100,130.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	16,000	3.080	49,280.00	
BYD CO LTD	8,000	244.200	1,953,600.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	6,500	38.500	250,250.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	6,000	17.520	105,120.00	
CGN POWER CO LTD-H	65,000	1.870	121,550.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	28,000	0.790	22,120.00	
CHINA CITIC BANK	77,000	3.510	270,270.00	
CHINA COAL ENERGY CO - H	20,000	6.130	122,600.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	3.370	26,960.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	8,500	6.150	52,275.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	769,000	4.530	3,483,570.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	30,150	7.780	234,567.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	12,000	2.200	26,400.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	15,000	2.680	40,200.00	
CHINA FEIHE LTD	32,000	4.750	152,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	11,500	4.450	51,175.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	26,800	7.150	191,620.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	14,000	6.810	95,340.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	13,200	13.800	182,160.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	56,000	0.870	48,720.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	62,000	10.920	677,040.00	
CHINA LITERATURE LTD	3,600	28.800	103,680.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	6.490	207,680.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	8,000	13.640	109,120.00	

CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	2,000	5.020	10,040.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	28,000	24.500	686,000.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	33,500	29.550	989,925.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	10,000	10.060	100,600.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	55,900	2.590	144,781.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	42,000	3.700	155,400.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	8.520	102,240.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	35,500	14.640	519,720.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	5,000	6.690	33,450.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	22,200	17.220	382,284.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	184,000	4.110	756,240.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	74,880	6.850	512,928.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	33,000	2.990	98,670.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	28,000	3.540	99,120.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	14,000	38.800	543,200.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	18,000	1.850	33,300.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	8,200	24.700	202,540.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	26,000	29.000	754,000.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	4,400	29.200	128,480.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	18,000	4.920	88,560.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	16,000	15.780	252,480.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	52,000	1.850	96,200.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	26,000	24.850	646,100.00	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	14,000	7.960	111,440.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	3.860	92,640.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	12,000	8.960	107,520.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	6,600	7.230	47,718.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	600	89.300	53,580.00	

CHINA TOWER CORP LTD-H	402,000	0.780	313,560.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	6,000	3.550	21,300.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	13,800	7.890	108,882.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	12,000	6.200	74,400.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	13,200	11.580	152,856.00	
CITIC LTD	50,000	7.030	351,500.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	16,500	16.720	275,880.00	
CMOC GROUP LIMITED-H	24,000	4.340	104,160.00	
COSCO PACIFIC LTD	6,000	5.040	30,240.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	21,000	7.140	149,940.00	
CRRC CORP LTD H	34,000	3.230	109,820.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	18,000	3.690	66,420.00	
DONGYUE GROUP	8,000	5.460	43,680.00	
EAST BUY HOLDING LIMITED	3,000	28.650	85,950.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	5,800	56.400	327,120.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	5.910	41,370.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	3,000	14.640	43,920.00	
FOSUN INTERNATIONAL	17,000	4.550	77,350.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3,200	36.400	116,480.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	2,200	27.900	61,380.00	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	170,000	1.180	200,600.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	5,700	10.900	62,130.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	57,000	9.550	544,350.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	23.650	236,500.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	4,800	10.220	49,056.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	15,000	11.580	173,700.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	11,500	8.040	92,460.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	30,000	5.500	165,000.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	19,600	3.640	71,344.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	16,000	16.120	257,920.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	18,000	22.600	406,800.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	5,000	19.460	97,300.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	10,000	4.600	46,000.00	

HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	8,000	14.680	117,440.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	4,500	27.700	124,650.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	18.200	54,600.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	14,000	3.940	55,160.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	5,400	10.860	58,644.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	2,000	48.750	97,500.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	515,000	3.750	1,931,250.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	9,000	44.650	401,850.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	10,550	37.850	399,317.50	
JD LOGISTICS INC	22,100	9.820	217,022.00	
JD.COM INC - CL A	19,157	105.400	2,019,147.80	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	6.760	13,520.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	9,000	10.840	97,560.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	9,000	8.280	74,520.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	4,000	19.160	76,640.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	2,500	7.340	18,350.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	23,000	11.540	265,420.00	
KINGSOFT CORP LTD	8,000	30.500	244,000.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	19,700	58.600	1,154,420.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	36,000	7.140	257,040.00	
LEGEND GROUP LTD	58,000	9.640	559,120.00	
LI AUTO INC-CLASS A	9,100	157.100	1,429,610.00	
LI NING CO LTD	20,500	23.100	473,550.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	15,500	12.780	198,090.00	
MEITUAN-B	40,760	107.300	4,373,548.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	5,300	13.340	70,702.00	
MINTH GROUP LTD	4,000	18.060	72,240.00	
NETEASE INC	15,600	179.400	2,798,640.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	6,000	16.380	98,280.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	11,100	53.550	594,405.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,000	4.050	12,150.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	15,000	45.050	675,750.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	1,000	94.500	94,500.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	23,000	2.560	58,880.00	

PETROCHINA CO LTD-H	138,000	5.110	705,180.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	47,000	9.150	430,050.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1,600	18.480	29,568.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	55,000	38.100	2,095,500.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	3,800	22.600	85,880.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	67,000	3.540	237,180.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	11,000	9.090	99,990.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	5,750	14.720	84,640.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,400	7.930	130,052.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	3,000	18.260	54,780.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	11.640	31,428.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	1,500	5.530	8,295.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	6,800	81.500	554,200.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	94,000	3.830	360,020.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	10,000	18.700	187,000.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	6,000	16.960	101,760.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	21,000	6.480	136,080.00	
SUNNY OPTICAL TECH	6,000	73.250	439,500.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	53,500	315.200	16,863,200.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	12,000	9.980	119,760.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	8,000	14.600	116,800.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	18,000	6.570	118,260.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	10,000	12.560	125,600.00	
TRIP.COM GROUP LTD	4,500	274.000	1,233,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,000	54.600	218,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	3,000	5.440	16,320.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	28,000	4.480	125,440.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	12,000	14.120	169,440.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	2,840	93.100	264,404.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	32,500	47.250	1,535,625.00	

	XIAOMI CORP-CLASS B	129,400	15.940	2,062,636.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	44,000	4.980	219,120.00	
	XPENG INC - CLASS A SHARES	7,400	65.150	482,110.00	
	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	5.160	46,440.00	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	10,000	14.860	148,600.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	15,000	13.700	205,500.00	
	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	2,000	12.980	25,960.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	17,200	7.550	129,860.00	
	ZAI LAB LTD	7,800	21.550	168,090.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	12,500	9.460	118,250.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	5.170	10,340.00	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	7,700	20.550	158,235.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,500	19.260	125,190.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	3,900	25.150	98,085.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	48,000	11.780	565,440.00	
	ZTE CORP-H	6,200	18.560	115,072.00	
香港・ドル　小計		6,371,507		89,174,239.30 (1,714,820,619)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	4,000	532.000	2,128,000.00	
	ACER INC	21,000	34.150	717,150.00	
	ADVANTECH CO LTD	3,408	348.000	1,185,984.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	1,100.000	1,100,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	24,000	125.500	3,012,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	16,000	41.450	663,200.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	6,000	392.500	2,355,000.00	
	AUO CORPORATION	51,800	16.600	859,880.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	4,000	191.500	766,000.00	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	83,000	45.800	3,801,400.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	13,067	177.500	2,319,392.50	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	20,450	17.700	361,965.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	13,000	46.550	605,150.00	
	CHINA AIRLINES LTD	20,000	21.800	436,000.00	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	127,083	11.950	1,518,641.85	
	CHINA STEEL CORP	99,000	25.200	2,494,800.00	

CHUNGHWA TELECOM CO LTD	28,000	117.000	3,276,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	36,000	30.350	1,092,600.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	151,000	26.850	4,054,350.00	
DELTA ELECTRONICS INC	15,000	305.000	4,575,000.00	
E INK HOLDINGS INC	6,000	181.000	1,086,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	119,136	25.150	2,996,270.40	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,000	578.000	578,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	2,475.000	2,475,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	18,000	32.150	578,700.00	
EVERGREEN MARINE	5,660	115.000	650,900.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	21,000	30.750	645,750.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	8,000	79.200	633,600.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,718	184.000	684,112.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	86,522	27.550	2,383,681.10	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	27,000	64.200	1,733,400.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	12,000	83.700	1,004,400.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	33,000	80.800	2,666,400.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	60,621	63.200	3,831,247.20	
GIANT MANUFACTURING	2,000	173.500	347,000.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	4,000	230.500	922,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	1,000	1,735.000	1,735,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	532.000	1,064,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	100,200	102.500	10,270,500.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,040	683.000	1,393,320.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	70,314	21.600	1,518,782.40	
INNOLUX CORPORATION	75,558	12.800	967,142.40	
INVENTEC CO LTD	23,000	42.650	980,950.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	2,120.000	2,120,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	16,000	109.500	1,752,000.00	
MEDIATEK INC	12,000	904.000	10,848,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	94,197	39.200	3,692,522.40	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	5,000	166.000	830,000.00	
MOMO.COM INC	1,100	508.000	558,800.00	
NAN YA PLASTICS CORP	41,000	68.200	2,796,200.00	

NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	2,000	237.000	474,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	8,000	67.400	539,200.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	334.000	334,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	5,000	495.000	2,475,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,000	1,050.000	1,050,000.00	
PEGATRON CORP	16,000	80.800	1,292,800.00	
PHARMAESSENTIA CORP	2,000	362.000	724,000.00	
POU CHEN	7,000	30.800	215,600.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	32,000	29.050	929,600.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,000	267.500	1,337,500.00	
QUANTA COMPUTER INC	21,000	208.500	4,378,500.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	4,000	428.000	1,712,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	8,802	36.900	324,793.80	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	56,244	9.050	509,008.20	
SILERGY CORP	3,000	418.500	1,255,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	69,435	18.850	1,308,849.75	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	8,000	67.100	536,800.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	91,124	18.000	1,640,232.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	47,104	13.300	626,483.20	
TAIWAN CEMENT	50,090	33.200	1,662,988.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	89,516	26.450	2,367,698.20	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	30.300	181,800.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	14,000	97.700	1,367,800.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	197,000	580.000	114,260,000.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	35,000	45.800	1,603,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	35,000	71.000	2,485,000.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	11,000	159.000	1,749,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	93,000	49.750	4,626,750.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	8,000	73.800	590,400.00	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,495.000	1,495,000.00	

	WALSIN LIHWA CORP	24,000	38.000	912,000.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	3,795	47.250	179,313.75	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	17,000	27.650	470,050.00	
	WISTRON CORP	22,000	99.000	2,178,000.00	
	WIWYNN CORP	1,000	1,830.000	1,830,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	11,760	71.200	837,312.00	
	YAGEO CORPORATION	2,387	547.000	1,305,689.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	9,000	41.800	376,200.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	68,569	25.350	1,738,224.15	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	4,000	104.500	418,000.00	
台湾・ドル　小計		2,680,700		265,364,283.30 (1,250,476,112)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	6,859	176.690	1,211,916.71	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	654	167.080	109,270.32	
	ANGLO PLATINUM LTD	730	703.090	513,255.70	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	3,195	312.750	999,236.25	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	2,248	171.970	386,588.56	
	BID CORP LTD	2,644	414.060	1,094,774.64	
	BIDVEST GROUP LTD	1,934	284.640	550,493.76	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	828	1,957.800	1,621,058.40	
	CLICKS GROUP LTD	2,024	295.580	598,253.92	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	5,088	136.990	697,005.12	
	EXXARO RESOURCES LTD	1,516	188.120	285,189.92	
	FIRSTRAND LTD	39,223	65.000	2,549,495.00	
	GOLD FIELDS LTD	7,317	239.970	1,755,860.49	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	3,846	101.200	389,215.20	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	6,688	81.310	543,801.28	
	KUMBA IRON ORE LTD	436	559.970	244,146.92	
	MTN GROUP LTD	13,303	93.700	1,246,491.10	
	NASPERS LTD-N SHS	1,557	3,371.010	5,248,662.57	
	NEDBANK GROUP LTD	3,843	208.930	802,917.99	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	3,367	109.500	368,686.50	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	3,672	116.940	429,403.68	
	OLD MUTUAL LTD	28,719	12.340	354,392.46	
	OUTSURANCE GROUP LTD	6,649	43.610	289,962.89	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	14,569	18.660	271,857.54	
	REINET INVESTMENTS SCA	764	436.460	333,455.44	
	REMGRO LTD	3,116	143.570	447,364.12	

	SANLAM LIMITED	14,251	69.560	991,299.56	
	SASOL LTD	4,283	225.520	965,902.16	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	3,930	249.370	980,024.10	
	SIBANYE STILLWATER LTD	24,991	23.690	592,036.79	
	STANDARD BANK GROUP LTD	12,147	193.070	2,345,221.29	
	VODACOM GROUP LTD	6,605	102.810	679,060.05	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	6,896	66.950	461,687.20	
南アフリカ・ランド　小計		237,892		30,357,987.63 (248,024,759)	
合計		26,795,664		7,389,780,711 (7,389,780,711)	

（２）株式以外の有価証券

2023年11月20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	14,779.00	443,370.00	
		ISHARES MSCI QATAR CP ETF	29,567.00	521,266.21	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	57,149.00	2,268,815.30	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	51,122.00	767,341.22	
	アメリカ・ドル　小計		152,617.00	4,000,792.73 (599,918,870)	
投資信託受益証券　合計			152,617	599,918,870 (599,918,870)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	21,300.00	613,440.00	
	メキシコ・ペソ　小計		21,300.00	613,440.00 (5,339,627)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	19,627.00	200,784.21	
	南アフリカ・ランド　小計		19,627.00	200,784.21 (1,640,407)	
投資証券　合計			40,927	6,980,034 (6,980,034)	
合計				606,898,904 (606,898,904)	

（注）投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）

１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

２．合計欄における（　）内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率（%）	組入投資信託受益証券時価比率（%）	組入投資証券時価比率（%）	有価証券の合計金額に対する比率（%）
アメリカ・ドル	株式 43銘柄	2.29	－	－	10.16
	投資信託受益証券 4銘柄	－	6.46	－	
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.00	－	－	0.00
インド・ルピー	株式 122銘柄	13.40	－	－	15.57
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.59	－	－	1.85
オフショア・人民元	株式 229銘柄	3.99	－	－	4.64
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.09	－	－	0.10
タイ・バーツ	株式 40銘柄	1.58	－	－	1.84
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.14	－	－	0.16
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.40	－	－	0.47
トルコ・リラ	株式 17銘柄	0.57	－	－	0.66
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.21	－	－	0.24
フィリピン・ペソ	株式 14銘柄	0.53	－	－	0.61
ブラジル・レアル	株式 47銘柄	4.90	－	－	5.69
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.83	－	－	0.96
マレーシア・リンギット	株式 32銘柄	1.18	－	－	1.37
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄	2.14	－	－	2.55
	投資証券 1銘柄	－	－	0.06	
ユーロ	株式 11銘柄	0.40	－	－	0.47
韓国・ウォン	株式 103銘柄	10.73	－	－	12.46
香港・ドル	株式 186銘柄	18.46	－	－	21.44
台湾・ドル	株式 90銘柄	13.46	－	－	15.64
南アフリカ・ランド	株式 33銘柄	2.67	－	－	3.12
	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11月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	6,983,159
コール・ローン	330,246,960
投資証券	30,896,880,200
未収配当金	238,168,495
流動資産合計	31,472,278,814
資産合計	31,472,278,814
負債の部	
流動負債	
未払解約金	176,961,138
その他未払費用	377
流動負債合計	176,961,515
負債合計	176,961,515
純資産の部	
元本等	
元本	16,718,367,652
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	14,576,949,647
元本等合計	31,295,317,299
純資産合計	31,295,317,299
負債純資産合計	31,472,278,814

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11月22日 至　2023年11月20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11月20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	16,947,494,605円
同期中追加設定元本額	4,795,280,722円
同期中一部解約元本額	5,024,407,675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）	56,838,270円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド	1,054,500,352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	8,886,535,625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）	1,637,135,143円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＡ	3,012,479,571円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＢ	1,807,202,742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）	176,915,992円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	19,278,121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）	7,006,300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）	14,723,022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）	40,147,804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）	108,480円
ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（積極型）	236,527円
ＦＷニッセイ国内リートインデックス	5,259,703円
計	16,718,367,652円
２．　受益権の総数	16,718,367,652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11月22日 至　2023年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	476,098,146
合計	476,098,146

（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11月20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11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8719円 (18,719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11月20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	205,809,600	
	ＧＬＰ投資法人	9,980	1,388,218,000	
	ＫＤＸ不動産投資法人	8,503	1,401,294,400	

ＮＴＴ都市開発リート投資法人	2,995	383,060,500	
Ｏｎｅリート投資法人	515	135,239,000	
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	1,474	177,469,600	
いちごオフィスリート投資法人	2,421	203,848,200	
いちごホテルリート投資法人	489	51,491,700	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,550	637,050,000	
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	162,134,000	
イオンリート投資法人	3,624	515,695,200	
インヴィンシブル投資法人	14,306	858,360,000	
エスコンジャパンリート投資法人	601	71,398,800	
オリックス不動産投資法人	5,887	1,007,854,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,182	242,856,600	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,453	456,242,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	805	87,020,500	
サンケイリアルエステート投資法人	947	84,945,900	
ザイマックス・リート投資法人	479	56,138,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,891	698,304,600	
ジャパンエクセレント投資法人	2,568	335,380,800	
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	269,141,400	
スターツプロシード投資法人	512	104,960,000	
タカラレーベン不動産投資法人	1,401	136,877,700	
トーセイ・リート投資法人	622	84,281,000	
ヒューリックリート投資法人	2,764	416,258,400	
フロンティア不動産投資法人	1,096	495,940,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	728	103,230,400	
マリモ地方創生リート投資法人	455	58,012,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,609	1,015,803,300	
ラサールロジポート投資法人	3,777	561,262,200	
阪急阪神リート投資法人	1,409	202,191,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,229	582,546,000	
三菱地所物流リート投資法人	1,020	389,640,000	
産業ファンド投資法人	4,508	616,243,600	
森トラストリート投資法人	5,695	420,291,000	
森ヒルズリート投資法人	3,474	485,317,800	
星野リゾート・リート投資法人	545	337,900,000	

	積水ハウス・リート投資法人	8,878	710,240,000	
	大江戸温泉リート投資法人	452	29,334,800	
	大和ハウスリート投資法人	4,454	1,224,850,000	
	大和証券オフィス投資法人	612	411,876,000	
	大和証券リビング投資法人	4,351	469,472,900	
	投資法人みらい	3,778	166,043,100	
	東海道リート投資法人	440	55,440,000	
	東急リアル・エステート投資法人	1,981	353,014,200	
	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	2,126,799,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	2,021	704,318,500	
	日本プロロジスリート投資法人	5,147	1,408,219,200	
	日本リート投資法人	960	336,000,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,893	540,830,100	
	日本都市ファンド投資法人	14,162	1,406,286,600	
	福岡リート投資法人	1,528	252,120,000	
	平和不動産リート投資法人	2,208	310,886,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9,555	1,632,949,500	
投資証券　合計		186,456	30,896,880,200	
合計			30,896,880,200	

（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11月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	29,293,390
金銭信託	6,792,186
コール・ローン	321,215,500
株式	898,341
投資証券	8,817,010,783
派生商品評価勘定	24,579,905
未収入金	7,573,854
未収配当金	12,866,575
差入委託証拠金	161,541,352
流動資産合計	9,381,771,886
資産合計	9,381,771,886
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,507,253
未払金	3,363,888
未払解約金	81,623,291
その他未払費用	277
流動負債合計	87,494,709
負債合計	87,494,709
純資産の部	
元本等	
元本	6,248,675,491
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,045,601,686
元本等合計	9,294,277,177
純資産合計	9,294,277,177
負債純資産合計	9,381,771,886

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11月22日 至　2023年11月20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11月20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	4,144,508,902円
同期中追加設定元本額	2,938,566,020円
同期中一部解約元本額	834,399,431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）	1,674,789,330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）	239,219,115円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	25,900,702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）	9,414,551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）	53,976,772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）	53,464,777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）	2,047,968,511円
ＦＷニッセイ先進国リートインデックス	10,622,530円
ＤＣニッセイ先進国リートインデックス	2,133,319,203円
計	6,248,675,491円
２．　受益権の総数	6,248,675,491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11月22日 至　2023年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△551,021
投資証券	△464,145,405
合計	△464,696,426

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年11月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	49,619,861	－	49,390,000	229,861
アメリカ・ドル	44,235,515	－	44,013,911	221,604
ユーロ	5,384,346	－	5,376,089	8,257
買建	300,082,392	－	298,051,395	△2,030,997
アメリカ・ドル	265,510,095	－	263,188,270	△2,321,825
ユーロ	34,572,297	－	34,863,125	290,828
合計	349,702,253	－	347,441,395	△1,801,136

（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11月20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	427,429,003	－	451,302,791	23,873,788
合計	427,429,003	－	451,302,791	23,873,788

（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11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4874円 (14,874円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年11月20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	12.030	5,990.94	
アメリカ・ドル　小計		498		5,990.94 (898,341)	
合計		498		898,341 (898,341)	

（２）株式以外の有価証券

2023年11月20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	4,055.00	60,825.00	
		AGREE REALTY CORP	4,585.00	265,333.95	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	3,524.00	58,498.40	
		ALEXANDER'S INC	148.00	28,592.12	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,542.00	782,256.24	

ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	337.00	5,398.74	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,110.00	40,575.30	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	15,152.00	547,290.24	
AMERICOLD REALTY TRUST	12,355.00	338,403.45	
APARTMENT INCOME REIT CO	7,433.00	223,064.33	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	6,838.00	44,515.38	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,459.00	172,468.91	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	3,594.00	38,383.92	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,379.00	3,240.65	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,845.00	1,157,078.80	
BOSTON PROPERTIES INC	6,857.00	377,683.56	
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	2,430.00	5,589.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	9,527.00	39,537.05	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	14,439.00	312,748.74	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	9,247.00	141,479.10	
BRT APARTMENTS CORP	345.00	5,982.30	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5,106.00	446,009.10	
CARETRUST REIT INC	4,775.00	109,586.25	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,202.00	27,297.42	
CENTERSPACE	800.00	42,496.00	
CHATHAM LODGING TRUST	1,647.00	16,799.40	
CITY OFFICE REIT INC	1,821.00	8,358.39	
CLIPPER REALTY INC	93.00	451.05	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,103.00	29,383.92	
COPT DEFENSE PROPERTIES	5,147.00	125,483.86	
COUSINS PROPERTIES INC	7,275.00	145,354.50	
CTO REALTY GROWTH INC	1,289.00	21,423.18	
CUBESMART	10,780.00	420,959.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	9,801.00	82,524.42	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	39,300.00	22,401.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	14,611.00	1,965,617.83	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	10,623.00	22,520.76	
DOUGLAS EMMETT INC	8,590.00	101,447.90	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,300.00	20.30	

		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	4,379.00	50,883.98	
		EASTGROUP PROPERTIES	2,221.00	377,570.00	
		ELME COMMUNITIES	4,051.00	53,432.69	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	5,581.00	48,889.56	
		EPR PROPERTIES	3,666.00	168,269.40	
		EQUINIX INC	4,515.00	3,497,499.60	
		EQUITY COMMONWEALTH	5,240.00	99,769.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,987.00	624,955.98	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,630.00	921,800.90	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	7,123.00	165,965.90	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,069.00	647,620.38	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,143.00	1,300,941.18	
		FARMLAND PARTNERS INC	2,376.00	28,440.72	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,631.00	336,012.74	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	6,406.00	287,373.16	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	4,170.00	94,283.70	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	3,706.00	8,931.46	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12,681.00	575,844.21	
		GETTY REALTY CORP	2,293.00	65,969.61	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,705.00	21,022.65	
		GLADSTONE LAND CORP	1,613.00	23,243.33	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,426.00	23,604.98	
		GLOBAL NET LEASE INC	9,073.00	80,477.51	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	18,262.00	260,233.50	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	27,025.00	445,101.75	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	962.00	9,543.04	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,331.00	99,743.01	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	34,193.00	590,171.18	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	6,705.00	36,810.45	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	11,040.00	144,734.40	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2,205.00	6,460.65	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,347.00	106,022.37	

INVENTRUST PROPERTIES CORP	3,126.00	78,118.74	
INVITATION HOMES INC	27,856.00	934,011.68	
IRON MOUNTAIN INC	14,033.00	873,273.59	
JBG SMITH PROPERTIES	4,907.00	66,538.92	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	39,500.00	11,060.00	
KILROY REALTY CORP	5,066.00	156,691.38	
KIMCO REALTY CORP	30,069.00	565,297.20	
KITE REALTY GROUP TRUST	10,812.00	223,484.04	
LTC PROPERTIES INC	1,973.00	64,497.37	
LXP INDUSTRIAL TRUST	14,485.00	119,066.70	
MACERICH CO/THE	10,340.00	117,048.80	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	76,900.00	7,305.50	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	28,797.00	132,754.17	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,717.00	694,158.14	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	4,056.00	134,821.44	
NATL HEALTH INVESTORS INC	2,094.00	112,384.98	
NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I	688.00	10,884.16	
NETSTREIT CORP	3,041.00	48,108.62	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	1,479.00	12,275.70	
NEXPOINT RESIDENTIAL	1,074.00	32,638.86	
NNN REIT INC	8,943.00	347,524.98	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,864.00	9,916.48	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,850.00	374,697.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	420.00	8,257.20	
ORION OFFICE REIT INC	2,499.00	12,844.86	
PARAMOUNT GROUP INC	6,289.00	29,558.30	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	9,867.00	140,999.43	
PEAKSTONE REALTY TRUST	1,807.00	31,170.75	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	5,311.00	67,131.04	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	5,658.00	199,048.44	
PHYSICIANS REALTY TRUST	11,661.00	130,603.20	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	6,624.00	40,870.08	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1,344.00	28,264.32	

		POSTAL REALTY TRUST INC-A	1,281.00	18,010.86	
		PRIME US REIT	33,400.00	5,377.40	
		PROLOGIS INC	44,553.00	4,903,948.71	
		PUBLIC STORAGE	7,594.00	1,956,973.80	
		REALTY INCOME CORP	34,152.00	1,806,982.32	
		REGENCY CENTERS CORP	8,070.00	498,726.00	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	6,182.00	75,482.22	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	10,002.00	469,993.98	
		RLJ LODGING TRUST	8,034.00	83,553.60	
		RPT REALTY	4,369.00	49,500.77	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,929.00	283,322.17	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	11,221.00	160,460.30	
		SAFEHOLD INC	1,826.00	33,908.82	
		SAUL CENTERS INC	777.00	27,940.92	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	7,237.00	52,612.99	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,703.00	1,910,741.04	
		SITE CENTERS CORP	8,878.00	118,432.52	
		SL GREEN REALTY CORP	2,982.00	102,014.22	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	6,860.00	276,663.80	
		STAG INDUSTRIAL INC	8,943.00	319,801.68	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,513.00	28,431.90	
		SUN COMMUNITIES INC	5,958.00	731,046.60	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,798.00	97,294.14	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	5,063.00	129,511.54	
		TERRENO REALTY CORP	4,089.00	226,612.38	
		UDR INC	14,635.00	480,320.70	
		UMH PROPERTIES INC	3,218.00	45,245.08	
		UNITI GROUP INC	12,316.00	66,506.40	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	616.00	24,695.44	
		URBAN EDGE PROPERTIES	5,135.00	86,370.70	
		VENTAS INC	19,159.00	853,341.86	
		VERIS RESIDENTIAL INC	3,616.00	49,105.28	
		VICI PROPERTIES INC	48,898.00	1,397,504.84	
		VORNADO REALTY TRUST	7,649.00	172,790.91	
		WELLTOWER INC	25,029.00	2,189,787.21	
		WHITESTONE REIT	1,918.00	21,040.46	
		WP CAREY INC	10,323.00	583,662.42	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,057.00	63,768.77	

アメリカ・ドル　小計		1,278,352.00	45,655,493.87 (6,846,041,305)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	20,702.00	9,936.96	
	AEW UK REIT PLC	11,405.00	11,427.81	
	ASSURA PLC	142,025.00	64,621.37	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	28,171.00	19,240.79	
	BIG YELLOW GROUP PLC	8,465.00	89,390.40	
	BRITISH LAND CO PLC	44,459.00	163,253.44	
	CLS HOLDINGS PLC	8,747.00	8,440.85	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	23,657.00	21,291.30	
	DERWENT LONDON PLC	4,993.00	110,345.30	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	31,132.00	29,201.81	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	11,607.00	48,610.11	
	HAMMERSON PLC	182,361.00	49,419.83	
	HELICAL PLC	5,493.00	12,743.76	
	HOME REIT PLC	24,530.00	2.45	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	10,174.00	8,719.11	
	INTU PROPERTIES PLC	19,587.00	19.58	
	INVISTA FOUNDATION PROPERTY	30,095.00	13,001.04	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	36,296.00	237,158.06	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	22,085.00	14,664.44	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	48,827.00	88,474.52	
	LXI REIT PLC	87,851.00	85,654.72	
	NEWRIVER REIT PLC	14,320.00	12,458.40	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	26,370.00	17,931.60	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	66,417.00	65,686.41	
	PRS REIT PLC/THE	24,066.00	20,576.43	
	REGIONAL REIT LTD	23,182.00	7,163.23	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	10,589.00	82,594.20	
	SEGRO PLC	60,639.00	498,695.13	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	86,395.00	106,697.82	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	66,307.00	54,968.50	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	34,447.00	29,452.18	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	11,942.00	7,595.11	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	90,503.00	138,469.59	

	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	30,039.00	17,422.62	
	UNITE GROUP PLC	19,158.00	189,281.04	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	18,005.00	21,317.92	
	WAREHOUSE REIT PLC	17,617.00	14,622.11	
	WORKSPACE GROUP PLC	5,451.00	31,997.37	
イギリス・ポンド　小計		1,408,109.00	2,402,547.31 (448,531,557)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	32,068.00	48,839.56	
	REIT 1 LTD	9,030.00	139,513.50	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	10,535.00	83,226.50	
イスラエル・シュケル　小計		51,633.00	271,579.56 (10,952,396)	
オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	14,277.00	15,133.62	
	ABACUS STORAGE KING	14,277.00	16,061.62	
	ARENA REIT	17,176.00	58,054.88	
	BWP TRUST	24,763.00	86,422.87	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	31,854.00	44,754.87	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	24,972.00	76,664.04	
	CENTURIA OFFICE REIT	18,473.00	23,275.98	
	CHARTER HALL GROUP	23,150.00	247,705.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	35,417.00	121,126.14	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	28,013.00	92,442.90	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	12,357.00	32,869.62	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	100,346.00	43,148.78	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	11,104.00	29,425.60	
	DEXUS/AU	52,987.00	378,857.05	
	GDI PROPERTY GROUP	14,036.00	8,000.52	
	GOODMAN GROUP	82,243.00	1,902,280.59	
	GPT GROUP	91,744.00	381,655.04	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	11,360.00	26,128.00	
	HEALTHCO REIT	22,191.00	31,067.40	
	HMC CAPITAL LTD	12,624.00	62,362.56	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	92,472.00	105,880.44	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	10,250.00	28,392.50	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	17,699.00	76,105.70	
	MIRVAC GROUP	190,368.00	390,254.40	
	NATIONAL STORAGE REIT	61,273.00	134,187.87	
	REGION RE LTD	59,545.00	128,021.75	
	RURAL FUNDS GROUP	14,970.00	27,769.35	
	SCENTRE GROUP	256,363.00	681,925.58	

	STOCKLAND	115,020.00	458,929.80	
	VICINITY CENTRES	190,131.00	351,742.35	
	WAYPOINT REIT LTD	35,887.00	85,052.19	
オーストラリア・ドル　小計		1,687,342.00	6,145,699.01 (599,635,852)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	3,275.00	56,166.25	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,100.00	13,356.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,037.00	68,721.99	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	7,017.00	20,138.79	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,009.00	181,006.35	
	CHOICE PROPERTIES REIT	6,902.00	90,692.28	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3,092.00	41,123.60	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,757.00	37,908.75	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	6,346.00	78,817.32	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	1,000.00	9,090.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,726.00	65,313.32	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,565.00	108,830.10	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	5,411.00	49,348.32	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,647.00	44,201.64	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,254.00	38,836.42	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,344.00	19,286.40	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,457.00	19,742.35	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	800.00	5,952.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	6,395.00	28,138.00	
	PRIMARIS REIT	2,025.00	27,175.50	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	2,600.00	11,960.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,101.00	124,409.52	
	SLATE GROCERY REIT	1,757.00	18,272.80	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,427.00	79,129.43	

	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	900.00	1,197.00	
カナダ・ドル　小計		82,944.00	1,238,814.13 (135,340,444)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	37,800.00	48,384.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	174,000.00	487,200.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	112,042.00	102,518.43	
	CAPITALAND CHINA TRUST	56,700.00	46,210.50	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	247,528.00	460,402.08	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	42,600.00	43,026.00	
	EC WORLD REIT	17,800.00	4,984.00	
	ESR-LOGOS REIT	323,133.00	96,939.90	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	60,200.00	38,528.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	53,400.00	116,946.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	144,311.00	155,855.88	
	KEPPEL DC REIT	67,000.00	125,290.00	
	KEPPEL REIT	100,300.00	85,255.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	67,500.00	38,812.50	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	96,200.00	218,374.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	163,500.00	258,330.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	107,700.00	148,626.00	
	PARAGON REIT	60,300.00	50,652.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	18,700.00	66,572.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	43,800.00	30,441.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	82,800.00	40,572.00	
	SUNTEC REIT	107,100.00	119,952.00	
シンガポール・ドル　小計		2,184,414.00	2,783,871.29 (310,596,520)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	39,117.00	44,202.21	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	50,045.00	104,844.27	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	74,629.00	61,568.92	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	61,826.00	71,718.16	
ニュージーランド・ドル　小計		225,617.00	282,333.56 (25,398,727)	
ユーロ	AEDIFICA	2,335.00	136,247.25	
	ALTAREA	208.00	14,643.20	
	CARE PROPERTY INVEST	1,748.00	22,758.96	
	CARMILA	2,840.00	41,293.60	

		COFINIMMO	1,668.00	108,253.20	
		COVIVIO	2,361.00	105,064.50	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	1,883.00	40,107.90	
		GECINA SA	2,454.00	244,663.80	
		HAMBORNER REIT AG	4,272.00	28,579.68	
		ICADE	1,550.00	50,685.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,126.00	2,449.05	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	13,250.00	78,307.50	
		INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	799.00	16,379.50	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	21,950.00	21,225.65	
		KLEPIERRE	9,600.00	221,664.00	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	3,434.00	19,985.88	
		MERCIALYS	4,666.00	39,987.62	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	16,464.00	147,517.44	
		MONTEA NV	751.00	53,396.10	
		NSI NV	1,110.00	19,314.00	
		RETAIL ESTATES	499.00	31,985.90	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,149.00	281,753.28	
		VASTNED RETAIL NV	513.00	9,849.60	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,714.00	197,169.84	
		WERELDHAVE NV	1,686.00	25,408.02	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	1,528.00	47,597.20	
	ユーロ　小計		111,558.00	2,006,287.67 (328,108,286)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	89,000.00	223,390.00	
		FORTUNE REIT	72,000.00	345,600.00	
		LINK REIT	122,600.00	4,885,610.00	
		PROSPERITY REIT	98,000.00	131,320.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	60,000.00	127,200.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	113,000.00	132,210.00	
	香港・ドル　小計		554,600.00	5,845,330.00 (112,405,696)	
投資証券　合計			7,584,569	8,817,010,783 (8,817,010,783)	
合計				8,817,010,783 (8,817,010,783)	

（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	－	77.65
	投資証券 142銘柄	－	73.66	
イギリス・ポンド	投資証券 38銘柄	－	4.83	5.09
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	－	6.45	6.80
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	－	1.46	1.53
シンガポール・ドル	投資証券 22銘柄	－	3.34	3.52
ニュージーランド・ドル	投資証券 4銘柄	－	0.27	0.29
ユーロ	投資証券 26銘柄	－	3.53	3.72
香港・ドル	投資証券 6銘柄	－	1.21	1.27

（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11月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	11,593,704
コール・ローン	548,288,479
国債証券	41,469,282,630
地方債証券	3,176,600,876
特殊債券	4,565,358,861
社債券	2,683,675,500
未収利息	104,112,796
前払費用	10,169,607
流動資産合計	52,569,082,453
資産合計	52,569,082,453
負債の部	
流動負債	
未払解約金	51,908,657
その他未払費用	511
流動負債合計	51,909,168
負債合計	51,909,168
純資産の部	
元本等	
元本	56,480,299,522
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△3,963,126,237
元本等合計	52,517,173,285
純資産合計	52,517,173,285
負債純資産合計	52,569,082,453

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11月22日 至　2023年11月20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11月20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	72,708,390,073円
	同期中追加設定元本額	11,624,785,428円
	同期中一部解約元本額	27,852,875,979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）	33,345,049,016円
	ＤＣニッセイ日本債券インデックス	5,039,474,958円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	273,077,819円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	8,198,623,082円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	516,568,133円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	2,715,339,337円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	1,899,556,382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）	360,943,581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）	35,730,073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）	140,196,412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）	81,917,066円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	153,104,029円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	183,984,410円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	642,223,683円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	2,826,107,042円
	ＦＷニッセイ国内債インデックス	45,950,590円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	22,453,909円
	計	56,480,299,522円
２．	受益権の総数	56,480,299,522口
３．	元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,963,126,237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11月22日 至　2023年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△722,763,630
地方債証券	△29,994,460
特殊債券	△34,883,818
社債券	△11,600,500
合計	△799,242,408

（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11月20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11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9298円 (9,298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11月20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第４４３回　利付国債（２年）	120,000,000	120,116,400	
	第４４４回　利付国債（２年）	170,000,000	170,159,800	
	第４４５回　利付国債（２年）	159,000,000	159,131,970	
	第４４６回　利付国債（２年）	159,000,000	159,130,380	
	第４４７回　利付国債（２年）	181,000,000	181,146,610	
	第４４８回　利付国債（２年）	181,000,000	181,130,320	
	第４４９回　利付国債（２年）	221,000,000	221,134,810	
	第４５０回　利付国債（２年）	229,000,000	229,109,920	
	第４５３回　利付国債（２年）	395,000,000	394,849,900	
	第１４２回　利付国債（５年）	286,000,000	286,569,140	
	第１４３回　利付国債（５年）	278,000,000	278,589,360	
	第１４４回　利付国債（５年）	401,000,000	401,886,210	
	第１４５回　利付国債（５年）	466,000,000	466,978,600	
	第１４６回　利付国債（５年）	362,000,000	362,676,940	
	第１４７回　利付国債（５年）	231,000,000	230,838,300	
	第１４８回　利付国債（５年）	265,000,000	264,623,700	
	第１４９回　利付国債（５年）	320,000,000	319,321,600	
	第１５０回　利付国債（５年）	293,000,000	292,144,440	
	第１５１回　利付国債（５年）	195,000,000	194,223,900	
	第１５２回　利付国債（５年）	95,000,000	94,921,150	
	第１５３回　利付国債（５年）	335,000,000	333,211,100	
	第１５５回　利付国債（５年）	117,000,000	117,425,880	
	第１５６回　利付国債（５年）	231,000,000	230,905,290	
	第１回　利付国債（４０年）	81,000,000	94,244,310	
	第２回　利付国債（４０年）	105,000,000	117,626,250	
	第３回　利付国債（４０年）	85,000,000	95,063,150	
	第４回　利付国債（４０年）	135,000,000	150,830,100	
	第５回　利付国債（４０年）	114,000,000	122,410,920	
	第６回　利付国債（４０年）	118,000,000	124,074,640	
	第７回　利付国債（４０年）	110,000,000	110,331,100	
	第８回　利付国債（４０年）	125,000,000	116,147,500	

第９回　利付国債（４０年）	203,000,000	137,743,620	
第１０回　利付国債（４０年）	182,000,000	145,157,740	
第１１回　利付国債（４０年）	153,000,000	117,181,170	
第１２回　利付国債（４０年）	106,000,000	72,189,180	
第１３回　利付国債（４０年）	170,000,000	114,421,900	
第１４回　利付国債（４０年）	196,000,000	140,941,640	
第１５回　利付国債（４０年）	190,000,000	150,407,800	
第１６回　利付国債（４０年）	100,000,000	86,788,000	
第３３６回　利付国債（１０年）	161,000,000	162,017,520	
第３３７回　利付国債（１０年）	250,000,000	251,037,500	
第３３８回　利付国債（１０年）	368,000,000	370,244,800	
第３３９回　利付国債（１０年）	444,000,000	447,081,360	
第３４０回　利付国債（１０年）	500,000,000	503,795,000	
第３４１回　利付国債（１０年）	438,000,000	440,636,760	
第３４２回　利付国債（１０年）	399,000,000	399,602,490	
第３４３回　利付国債（１０年）	310,000,000	310,316,200	
第３４４回　利付国債（１０年）	325,000,000	325,182,000	
第３４５回　利付国債（１０年）	361,000,000	361,000,000	
第３４６回　利付国債（１０年）	336,000,000	335,721,120	
第３４７回　利付国債（１０年）	272,000,000	271,466,880	
第３４８回　利付国債（１０年）	338,000,000	336,904,880	
第３４９回　利付国債（１０年）	340,000,000	338,487,000	
第３５０回　利付国債（１０年）	435,000,000	432,481,350	
第３５１回　利付国債（１０年）	344,000,000	341,509,440	
第３５２回　利付国債（１０年）	291,000,000	288,296,610	
第３５３回　利付国債（１０年）	275,000,000	271,975,000	
第３５４回　利付国債（１０年）	254,000,000	250,875,800	
第３５５回　利付国債（１０年）	259,000,000	255,456,880	
第３５６回　利付国債（１０年）	250,000,000	246,147,500	

第３５７回　利付国債（１０年）	284,000,000	279,024,320	
第３５８回　利付国債（１０年）	245,000,000	240,168,600	
第３５９回　利付国債（１０年）	304,000,000	297,296,800	
第３６０回　利付国債（１０年）	382,000,000	372,644,820	
第３６１回　利付国債（１０年）	373,000,000	362,798,450	
第３６２回　利付国債（１０年）	384,000,000	372,222,720	
第３６３回　利付国債（１０年）	384,000,000	371,020,800	
第３６４回　利付国債（１０年）	392,000,000	377,621,440	
第３６５回　利付国債（１０年）	393,000,000	377,566,890	
第３６６回　利付国債（１０年）	177,000,000	170,978,460	
第３６７回　利付国債（１０年）	136,000,000	130,973,440	
第３６８回　利付国債（１０年）	364,000,000	349,589,240	
第３６９回　利付国債（１０年）	278,000,000	273,485,280	
第３７０回　利付国債（１０年）	438,000,000	429,953,940	
第３７１回　利付国債（１０年）	99,000,000	96,074,550	
第３７２回　利付国債（１０年）	163,000,000	163,894,870	
第１回　利付国債（３０年）	4,000,000	4,561,200	
第２回　利付国債（３０年）	43,000,000	48,287,280	
第３回　利付国債（３０年）	56,000,000	62,713,840	
第４回　利付国債（３０年）	27,000,000	31,476,600	
第５回　利付国債（３０年）	21,000,000	23,552,760	
第６回　利付国債（３０年）	25,000,000	28,531,750	
第７回　利付国債（３０年）	20,000,000	22,747,600	
第８回　利付国債（３０年）	29,000,000	31,849,830	
第９回　利付国債（３０年）	31,000,000	32,950,830	
第１０回　利付国債（３０年）	60,000,000	62,155,200	
第１１回　利付国債（３０年）	118,000,000	128,707,320	
第１２回　利付国債（３０年）	88,000,000	99,330,880	
第１３回　利付国債（３０年）	52,000,000	58,254,560	
第１４回　利付国債（３０年）	66,000,000	76,583,100	
第１５回　利付国債（３０年）	79,000,000	92,594,320	
第１６回　利付国債（３０年）	62,000,000	72,758,240	
第１７回　利付国債（３０年）	23,000,000	26,786,030	
第１８回　利付国債（３０年）	29,000,000	33,499,930	
第１９回　利付国債（３０年）	15,000,000	17,347,350	

第２０回　利付国債（３０年）	23,000,000	27,122,980	
第２１回　利付国債（３０年）	24,000,000	27,781,680	
第２２回　利付国債（３０年）	35,000,000	41,350,750	
第２３回　利付国債（３０年）	37,000,000	43,738,070	
第２４回　利付国債（３０年）	21,000,000	24,850,350	
第２５回　利付国債（３０年）	18,000,000	20,875,500	
第２６回　利付国債（３０年）	65,000,000	76,193,000	
第２７回　利付国債（３０年）	101,000,000	119,697,120	
第２８回　利付国債（３０年）	132,000,000	156,418,680	
第２９回　利付国債（３０年）	143,000,000	167,555,960	
第３０回　利付国債（３０年）	153,000,000	176,962,860	
第３１回　利付国債（３０年）	144,000,000	164,247,840	
第３２回　利付国債（３０年）	175,000,000	201,829,250	
第３３回　利付国債（３０年）	197,000,000	217,998,230	
第３４回　利付国債（３０年）	180,000,000	204,206,400	
第３５回　利付国債（３０年）	206,000,000	227,036,720	
第３６回　利付国債（３０年）	203,000,000	223,204,590	
第３７回　利付国債（３０年）	210,000,000	227,169,600	
第３８回　利付国債（３０年）	140,000,000	148,629,600	
第３９回　利付国債（３０年）	128,000,000	137,728,000	
第４０回　利付国債（３０年）	109,000,000	115,318,730	
第４１回　利付国債（３０年）	107,000,000	111,245,760	
第４２回　利付国債（３０年）	119,000,000	123,669,560	
第４３回　利付国債（３０年）	91,000,000	94,455,270	
第４４回　利付国債（３０年）	124,000,000	128,650,000	
第４５回　利付国債（３０年）	134,000,000	134,000,000	
第４６回　利付国債（３０年）	160,000,000	159,870,400	
第４７回　利付国債（３０年）	149,000,000	151,428,700	
第４８回　利付国債（３０年）	154,000,000	150,599,680	
第４９回　利付国債（３０年）	154,000,000	150,322,480	
第５０回　利付国債（３０年）	153,000,000	131,780,430	
第５１回　利付国債（３０年）	134,000,000	102,306,320	
第５２回　利付国債（３０年）	139,000,000	111,017,910	
第５３回　利付国債（３０年）	126,000,000	102,684,960	
第５４回　利付国債（３０年）	158,000,000	134,584,400	
第５５回　利付国債（３０年）	124,000,000	105,304,520	
第５６回　利付国債（３０年）	121,000,000	102,443,440	
第５７回　利付国債（３０年）	125,000,000	105,507,500	
第５８回　利付国債（３０年）	155,000,000	130,430,950	
第５９回　利付国債（３０年）	117,000,000	95,722,380	
第６０回　利付国債（３０年）	141,000,000	120,777,780	
第６１回　利付国債（３０年）	101,000,000	82,085,730	
第６２回　利付国債（３０年）	99,000,000	76,016,160	
第６３回　利付国債（３０年）	106,000,000	78,834,320	
第６４回　利付国債（３０年）	118,000,000	87,407,320	
第６５回　利付国債（３０年）	114,000,000	84,179,880	
第６６回　利付国債（３０年）	108,000,000	79,361,640	
第６７回　利付国債（３０年）	134,000,000	103,878,140	
第６８回　利付国債（３０年）	135,000,000	104,274,000	
第６９回　利付国債（３０年）	134,000,000	106,102,540	

第７０回　利付国債（３０年）	129,000,000	101,796,480	
第７１回　利付国債（３０年）	132,000,000	103,899,840	
第７２回　利付国債（３０年）	132,000,000	103,635,840	
第７３回　利付国債（３０年）	134,000,000	104,940,760	
第７４回　利付国債（３０年）	130,000,000	110,281,600	
第７５回　利付国債（３０年）	135,000,000	123,543,900	
第７６回　利付国債（３０年）	124,000,000	116,240,080	
第７７回　利付国債（３０年）	123,000,000	120,841,350	
第７８回　利付国債（３０年）	127,000,000	118,845,330	
第７３回　利付国債（２０年）	98,000,000	100,206,960	
第７４回　利付国債（２０年）	73,000,000	74,722,800	
第７５回　利付国債（２０年）	73,000,000	75,092,180	
第７６回　利付国債（２０年）	86,000,000	88,236,860	
第７７回　利付国債（２０年）	74,000,000	76,022,420	
第７８回　利付国債（２０年）	96,000,000	98,940,480	
第７９回　利付国債（２０年）	100,000,000	103,221,000	
第８０回　利付国債（２０年）	96,000,000	99,243,840	
第８１回　利付国債（２０年）	93,000,000	96,429,840	
第８２回　利付国債（２０年）	128,000,000	132,954,880	
第８３回　利付国債（２０年）	95,000,000	99,127,750	
第８４回　利付国債（２０年）	128,000,000	133,295,360	
第８５回　利付国債（２０年）	103,000,000	107,942,970	
第８６回　利付国債（２０年）	109,000,000	114,737,760	
第８７回　利付国債（２０年）	93,000,000	97,678,830	
第８８回　利付国債（２０年）	132,000,000	139,609,800	
第８９回　利付国債（２０年）	90,000,000	94,957,200	
第９０回　利付国債（２０年）	128,000,000	135,662,080	
第９１回　利付国債（２０年）	23,000,000	24,441,640	
第９２回　利付国債（２０年）	114,000,000	121,017,840	
第９３回　利付国債（２０年）	43,000,000	45,678,040	
第９４回　利付国債（２０年）	73,000,000	77,788,070	
第９５回　利付国債（２０年）	82,000,000	88,273,820	
第９６回　利付国債（２０年）	32,000,000	34,220,800	
第９７回　利付国債（２０年）	81,000,000	87,223,230	
第９８回　利付国債（２０年）	57,000,000	61,162,710	
第９９回　利付国債（２０年）	133,000,000	143,195,780	
第１００回　利付国債（２０年）	91,000,000	98,699,510	
第１０１回　利付国債（２０年）	49,000,000	53,565,820	
第１０２回　利付国債（２０年）	52,000,000	57,073,120	
第１０３回　利付国債（２０年）	46,000,000	50,279,380	
第１０４回　利付国債（２０年）	32,000,000	34,687,360	
第１０５回　利付国債（２０年）	48,000,000	52,163,040	
第１０６回　利付国債（２０年）	19,000,000	20,738,500	

第１０７回　利付国債（２０年）	23,000,000	25,064,940	
第１０８回　利付国債（２０年）	70,000,000	75,584,600	
第１０９回　利付国債（２０年）	29,000,000	31,399,460	
第１１０回　利付国債（２０年）	52,000,000	56,846,920	
第１１１回　利付国債（２０年）	21,000,000	23,144,520	
第１１２回　利付国債（２０年）	75,000,000	82,248,000	
第１１３回　利付国債（２０年）	138,000,000	151,797,240	
第１１４回　利付国債（２０年）	77,000,000	84,894,810	
第１１５回　利付国債（２０年）	17,000,000	18,843,990	
第１１６回　利付国債（２０年）	35,000,000	38,899,000	
第１１７回　利付国債（２０年）	93,000,000	102,785,460	
第１１８回　利付国債（２０年）	25,000,000	27,528,250	
第１１９回　利付国債（２０年）	15,000,000	16,319,700	
第１２０回　利付国債（２０年）	34,000,000	36,556,460	
第１２１回　利付国債（２０年）	126,000,000	138,151,440	
第１２２回　利付国債（２０年）	82,000,000	89,364,420	
第１２３回　利付国債（２０年）	162,000,000	180,090,540	
第１２４回　利付国債（２０年）	108,000,000	119,320,560	
第１２５回　利付国債（２０年）	115,000,000	128,860,950	
第１２６回　利付国債（２０年）	105,000,000	116,130,000	
第１２７回　利付国債（２０年）	102,000,000	112,091,880	
第１２８回　利付国債（２０年）	161,000,000	177,005,010	
第１２９回　利付国債（２０年）	103,000,000	112,488,360	
第１３０回　利付国債（２０年）	161,000,000	176,040,620	
第１３１回　利付国債（２０年）	101,000,000	109,677,920	

第１３２回　利付国債（２０年）	114,000,000	123,900,900	
第１３３回　利付国債（２０年）	142,000,000	155,428,940	
第１３４回　利付国債（２０年）	123,000,000	134,757,570	
第１３５回　利付国債（２０年）	90,000,000	97,888,500	
第１３６回　利付国債（２０年）	90,000,000	97,136,100	
第１３７回　利付国債（２０年）	98,000,000	106,620,080	
第１３８回　利付国債（２０年）	101,000,000	108,194,230	
第１３９回　利付国債（２０年）	108,000,000	116,620,560	
第１４０回　利付国債（２０年）	232,000,000	252,657,280	
第１４１回　利付国債（２０年）	187,000,000	203,657,960	
第１４２回　利付国債（２０年）	135,000,000	148,246,200	
第１４３回　利付国債（２０年）	173,000,000	186,957,640	
第１４４回　利付国債（２０年）	124,000,000	132,916,840	
第１４５回　利付国債（２０年）	239,000,000	260,686,860	
第１４６回　利付国債（２０年）	236,000,000	257,586,920	
第１４７回　利付国債（２０年）	233,000,000	252,031,440	
第１４８回　利付国債（２０年）	206,000,000	220,700,160	
第１４９回　利付国債（２０年）	217,000,000	232,380,960	
第１５０回　利付国債（２０年）	233,000,000	246,931,070	
第１５１回　利付国債（２０年）	184,000,000	191,003,040	
第１５２回　利付国債（２０年）	171,000,000	177,273,990	
第１５３回　利付国債（２０年）	175,000,000	183,107,750	
第１５４回　利付国債（２０年）	168,000,000	173,666,640	
第１５５回　利付国債（２０年）	180,000,000	181,663,200	
第１５６回　利付国債（２０年）	133,000,000	124,652,920	

第１５７回　利付国債（２０年）	136,000,000	123,773,600	
第１５８回　利付国債（２０年）	154,000,000	145,160,400	
第１５９回　利付国債（２０年）	121,000,000	115,135,130	
第１６０回　利付国債（２０年）	122,000,000	117,212,720	
第１６１回　利付国債（２０年）	110,000,000	103,931,300	
第１６２回　利付国債（２０年）	177,000,000	166,574,700	
第１６３回　利付国債（２０年）	204,000,000	191,213,280	
第１６４回　利付国債（２０年）	216,000,000	198,851,760	
第１６５回　利付国債（２０年）	196,000,000	179,643,800	
第１６６回　利付国債（２０年）	178,000,000	167,321,780	
第１６７回　利付国債（２０年）	194,000,000	176,320,780	
第１６８回　利付国債（２０年）	165,000,000	146,960,550	
第１６９回　利付国債（２０年）	162,000,000	141,286,680	
第１７０回　利付国債（２０年）	149,000,000	129,267,930	
第１７１回　利付国債（２０年）	176,000,000	151,884,480	
第１７２回　利付国債（２０年）	166,000,000	144,999,340	
第１７３回　利付国債（２０年）	213,000,000	185,086,350	
第１７４回　利付国債（２０年）	194,000,000	167,804,180	
第１７５回　利付国債（２０年）	187,000,000	163,800,780	
第１７６回　利付国債（２０年）	185,000,000	161,332,950	
第１７７回　利付国債（２０年）	194,000,000	165,350,080	
第１７８回　利付国債（２０年）	208,000,000	179,876,320	
第１７９回　利付国債（２０年）	217,000,000	186,800,110	
第１８０回　利付国債（２０年）	203,000,000	183,893,640	
第１８１回　利付国債（２０年）	207,000,000	190,336,500	

	第１８２回　利付国債（２０年）	193,000,000	183,278,590	
	第１８３回　利付国債（２０年）	199,000,000	198,401,010	
	第１８４回　利付国債（２０年）	198,000,000	186,832,800	
	第１８５回　利付国債（２０年）	192,000,000	180,512,640	
	第１８６回　利付国債（２０年）	71,000,000	71,436,650	
国債証券　合計		41,980,000,000	41,469,282,630	
地方債証券	第７６４回　東京都公募公債	100,000,000	100,002,400	
	第１４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	108,379,400	
	第３４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	93,819,200	
	第１８回　宮城県１号公募公債（５年）	100,000,000	99,246,600	
	第３０回　神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	101,306,900	
	第４４８回　大阪府公募公債	38,000,000	36,883,256	
	第４５５回　大阪府公募公債	180,000,000	174,756,420	
	第７回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	108,411,900	
	第１１回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	107,683,000	
	第１２回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	105,046,400	
	平成２９年度第５回　京都府公募公債（２０年）	100,000,000	93,082,700	
	第１５回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	106,941,400	
	第２１回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	106,070,700	
	平成２６年度第１１回　愛知県公募公債（１５年）	100,000,000	102,646,600	
	令和４年度第３回　愛知県公募公債	200,000,000	192,129,600	
	平成２０年度第１回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	108,731,100	
	平成２４年度第２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	107,028,500	
	令和４年度第１回　千葉県公募公債	300,000,000	288,255,000	
	第２２回　大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	91,250,700	
	第１回　名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	116,386,400	
	第２５回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	107,732,200	

	第２６回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	108,363,600	
	第３１回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	101,892,000	
	第９回　川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	110,067,800	
	第４回　川崎市公募公債（３０年）	100,000,000	110,288,100	
	平成３０年度第５回　広島市公募公債	200,000,000	197,564,600	
	平成２９年度第１回　仙台市公募公債	100,000,000	92,634,400	
地方債証券　合計		3,118,000,000	3,176,600,876	
特殊債券	第９回　新関西国際空港	300,000,000	310,253,700	
	第１６回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,295,200	
	第１７４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,407,000	
	第２０５回　政保道路機構債券	100,000,000	106,656,300	
	第２１２回　政保道路機構債券	100,000,000	106,292,300	
	第２３３回　政府道路機構債券	100,000,000	104,142,200	
	第２７８回　政保道路機構債券	100,000,000	90,591,600	
	第２９３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	91,890,100	
	第３１６回　政保道路機構債券	100,000,000	93,091,200	
	第３１９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,700,800	
	第１７回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	216,883,000	
	第３６回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	105,868,600	
	第１回　地方公共団体金融機構債券（３０年）	100,000,000	103,894,400	
	第８３回　政保地方公共団体金融機構債券	103,000,000	102,717,162	
	第１１６回　政保地方公共団体金融機構債券	138,000,000	135,716,238	
	第１２０回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,501,800	
	第１３６回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	193,285,600	
	第７２回　日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,045,100	
	第９７回　都市再生債券	100,000,000	102,656,600	
	第３３回　政保中部国際空港債券	100,000,000	99,706,400	
	第５９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	217,492,400	
	第１４３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,431,700	

	第３７回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,335,000	19,046,398	
	第４２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,998,000	47,474,535	
	第４６回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,013,000	55,287,257	
	第５４回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,434,000	45,904,765	
	第５５回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,042,000	51,573,285	
	第６０回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,444,000	52,879,286	
	第６１回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,893,000	26,522,199	
	第６２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	232,768,000	237,563,020	
	第６３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,405,000	146,672,158	
	第７３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,555,000	104,934,276	
	第７８回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,487,000	90,874,048	
	第１０９回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,857,000	185,269,134	
	い第８４５号　利付商工債券	200,000,000	199,942,000	
	い第８５４号　利付商工債券	200,000,000	199,094,000	
	い第８６２号　利付商工債券	100,000,000	99,503,600	
	第３９４回　利付信金中金債券	100,000,000	99,279,800	
	第６６回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,019,700	
特殊債券　合計		4,493,231,000	4,565,358,861	
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	95,487,300	
	第３８回　成田国際空港	200,000,000	193,088,000	
	第６９回　西日本高速道路	100,000,000	99,604,300	
	第１３回　日本たばこ産業	100,000,000	98,979,700	
	第５回　電通グループ	400,000,000	398,298,800	
	第２回　アステラス製薬	100,000,000	99,655,500	
	第１１回　ブリヂストン	100,000,000	99,582,300	
	第１９回　豊田通商	100,000,000	101,511,000	
	第１８回　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	96,758,600	
	第７８回　トヨタファイナンス	100,000,000	99,418,000	
	第５５回　日立キャピタル	100,000,000	101,440,700	
	第１７回　三井住友ファイナンス＆リース	100,000,000	99,183,500	
	第２回　三菱ＨＣキャピタル	100,000,000	98,968,300	
	第１３２回　三菱地所	100,000,000	97,958,200	
	第７回　野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	218,014,200	

	第１１回　ジャパンエクセレント投資法人	100,000,000	99,953,100	
	第１０６回　東日本旅客鉄道	100,000,000	97,130,000	
	第３回　東日本旅客鉄道（サステナビリティボンド）	100,000,000	94,177,900	
	第５１０回　関西電力	100,000,000	99,715,900	
	第４９４回　東北電力	100,000,000	99,707,000	
	第４５１回　九州電力	100,000,000	99,813,700	
	第４７回　大阪瓦斯（トランジションボンド）	100,000,000	95,229,500	
社債券　合計		2,700,000,000	2,683,675,500	
合計			51,894,917,867	

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11月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	403,383,670
金銭信託	4,179,846
コール・ローン	197,672,914
国債証券	71,335,288,110
未収入金	551,463
未収利息	429,300,020
前払費用	38,485,569
流動資産合計	72,408,861,592
資産合計	72,408,861,592
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	391,646
未払金	140,977,474
未払解約金	146,301,983
その他未払費用	285
流動負債合計	287,671,388
負債合計	287,671,388
純資産の部	
元本等	
元本	43,378,960,163
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	28,742,230,041
元本等合計	72,121,190,204
純資産合計	72,121,190,204
負債純資産合計	72,408,861,592

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11月22日 至　2023年11月20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11月20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	36,786,269,889円
	同期中追加設定元本額	13,020,633,114円
	同期中一部解約元本額	6,427,942,840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）	3,461,059,032円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	6,218,098,531円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,547,097,324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）	912,607,004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）	2,067,561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）	6,149,747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）	4,503,470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	15,831,877,263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）	5,727,201,586円
	ＤＣニッセイ外国債券インデックス	4,257,065,641円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	293,816,747円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,933,271,698円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	341,078,933円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	552,481,112円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	64,415,551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）	205,521,429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）	20,223,791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）	46,373,044円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	229,109,652円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	148,732,633円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	297,949,699円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	198,032,837円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス	37,526,371円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	42,699,507円
	計	43,378,960,163円
２．	受益権の総数	43,378,960,163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11月22日 至　2023年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,265,020,202
合計	△1,265,020,202

（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5月23日から2023年11月20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11月20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	36,136,125	－	35,744,479	△391,646
アメリカ・ドル	34,422,821	－	34,038,176	△384,645
メキシコ・ペソ	1,713,304	－	1,706,303	△7,001
合計	36,136,125	－	35,744,479	△391,646

（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11月20日現在
1口当たり純資産額	1.6626円
（1万口当たり純資産額）	(16,626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11月20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	126,792.00	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	123,960.00	
		US TREASURY BONDS	180,000.00	190,272.60	

		US TREASURY BONDS	100,000.00	102,398.00	
		US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,031,049.80	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,059,080.40	
		US TREASURY N/B	500,000.00	372,105.00	
		US TREASURY N/B	870,000.00	767,496.60	
		US TREASURY N/B	2,210,000.00	2,026,282.70	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,059,773.40	
		US TREASURY N/B	860,000.00	758,004.00	
		US TREASURY N/B	180,000.00	181,447.20	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,004,177.00	
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,041,182.00	
		US TREASURY N/B	670,000.00	505,454.70	
		US TREASURY N/B	580,000.00	548,279.80	
		US TREASURY N/B	480,000.00	407,059.20	
		US TREASURY N/B	490,000.00	422,678.90	
		US TREASURY N/B	610,000.00	473,793.10	
		US TREASURY N/B	7,280,000.00	7,069,244.00	
		US TREASURY N/B	8,420,000.00	8,100,882.00	
		US TREASURY N/B	7,710,000.00	7,386,488.40	
		US TREASURY N/B	420,000.00	330,926.40	
		US TREASURY N/B	530,000.00	447,929.50	
		US TREASURY N/B	480,000.00	389,284.80	
		US TREASURY N/B	540,000.00	409,741.20	
		US TREASURY N/B	700,000.00	483,847.00	
		US TREASURY N/B	360,000.00	271,951.20	
		US TREASURY N/B	480,000.00	353,640.00	
		US TREASURY N/B	5,760,000.00	5,476,262.40	
		US TREASURY N/B	7,890,000.00	7,498,813.80	
		US TREASURY N/B	280,000.00	210,632.80	
		US TREASURY N/B	7,490,000.00	6,991,390.70	
		US TREASURY N/B	580,000.00	395,937.00	
		US TREASURY N/B	6,880,000.00	6,382,782.40	
		US TREASURY N/B	590,000.00	401,589.40	
		US TREASURY N/B	6,890,000.00	6,331,221.00	
		US TREASURY N/B	710,000.00	457,893.20	
		US TREASURY N/B	4,160,000.00	3,855,779.20	
		US TREASURY N/B	330,000.00	240,847.20	
		US TREASURY N/B	3,590,000.00	3,339,238.50	
		US TREASURY N/B	650,000.00	484,451.50	
		US TREASURY N/B	4,460,000.00	4,146,194.40	
		US TREASURY N/B	500,000.00	372,245.00	
		US TREASURY N/B	5,270,000.00	4,858,044.10	
		US TREASURY N/B	690,000.00	488,713.20	
		US TREASURY N/B	6,090,000.00	5,587,575.00	
		US TREASURY N/B	150,000.00	147,222.00	
		US TREASURY N/B	730,000.00	516,701.30	
		US TREASURY N/B	3,320,000.00	3,213,394.80	
		US TREASURY N/B	5,640,000.00	5,259,469.20	
		US TREASURY N/B	170,000.00	168,565.20	

		US TREASURY N/B	820,000.00	608,333.40	
		US TREASURY N/B	2,870,000.00	2,776,036.20	
		US TREASURY N/B	5,770,000.00	5,390,853.30	
		US TREASURY N/B	870,000.00	660,477.90	
		US TREASURY N/B	170,000.00	148,967.60	
		US TREASURY N/B	270,000.00	257,901.30	
		US TREASURY N/B	4,920,000.00	4,749,128.40	
		US TREASURY N/B	6,900,000.00	6,426,660.00	
		US TREASURY N/B	940,000.00	696,370.80	
		US TREASURY N/B	280,000.00	274,769.60	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,013,943.00	
		US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,188,918.50	
		US TREASURY N/B	990,000.00	786,733.20	
		US TREASURY N/B	300,000.00	289,626.00	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,816,058.00	
		US TREASURY N/B	4,740,000.00	4,329,136.80	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	777,483.00	
		US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,436,887.40	
		US TREASURY N/B	4,050,000.00	3,636,130.50	
		US TREASURY N/B	300,000.00	297,831.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	722,810.00	
		US TREASURY N/B	2,140,000.00	1,993,773.80	
		US TREASURY N/B	3,630,000.00	3,118,242.60	
		US TREASURY N/B	970,000.00	612,690.80	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,159,590.60	
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,754,368.00	
		US TREASURY N/B	290,000.00	261,203.00	
		US TREASURY N/B	910,000.00	591,390.80	
		US TREASURY N/B	2,130,000.00	1,955,340.00	
		US TREASURY N/B	3,790,000.00	3,182,235.60	
		US TREASURY N/B	280,000.00	264,096.00	
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	671,333.00	
		US TREASURY N/B	140,000.00	147,163.80	
		US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,817,232.30	
		US TREASURY N/B	890,000.00	520,712.30	
		US TREASURY N/B	300,000.00	300,726.00	
		US TREASURY N/B	2,170,000.00	1,879,502.10	
		US TREASURY N/B	4,980,000.00	3,875,236.80	
		US TREASURY N/B	1,450,000.00	722,607.50	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	632,156.40	
		US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,246,577.20	
		US TREASURY N/B	2,420,000.00	1,907,903.80	
		US TREASURY N/B	1,470,000.00	786,273.60	
		US TREASURY N/B	1,210,000.00	731,614.40	
		US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,000,525.50	
		US TREASURY N/B	2,330,000.00	1,862,345.70	
		US TREASURY N/B	1,610,000.00	920,147.20	
		US TREASURY N/B	1,480,000.00	974,358.00	
		US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,078,304.00	

		US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,002,880.50	
		US TREASURY N/B	2,250,000.00	1,849,815.00	
		US TREASURY N/B	1,660,000.00	1,072,575.80	
		US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,209,619.70	
		US TREASURY N/B	900,000.00	781,272.00	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	881,357.40	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	1,997,100.00	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	941,360.00	
		US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,061,869.50	
		US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,222,449.60	
		US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,473,283.20	
		US TREASURY N/B	2,390,000.00	1,899,667.60	
		US TREASURY N/B	1,530,000.00	870,003.90	
		US TREASURY N/B	300,000.00	240,327.00	
		US TREASURY N/B	1,390,000.00	920,763.80	
		US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,674,608.00	
		US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,317,460.00	
		US TREASURY N/B	2,330,000.00	1,917,240.50	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	876,092.00	
		US TREASURY N/B	310,000.00	247,634.20	
		US TREASURY N/B	1,140,000.00	803,027.40	
		US TREASURY N/B	290,000.00	226,208.70	
		US TREASURY N/B	1,330,000.00	960,446.20	
		US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,006,450.60	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	808,750.00	
		US TREASURY N/B	2,190,000.00	1,918,812.30	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	934,705.80	
		US TREASURY N/B	870,000.00	715,331.40	
		US TREASURY N/B	330,000.00	246,391.20	
		US TREASURY N/B	2,590,000.00	2,524,732.00	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,143,350.00	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,161,245.10	
		US TREASURY N/B	880,000.00	791,648.00	
		US TREASURY NOTES	150,000.00	164,500.50	
		WI TREASURY SEC.	290,000.00	278,829.20	
		WI TREASURY SEC.	1,330,000.00	640,727.50	
		WI TREASURY SEC.	4,270,000.00	3,350,754.40	
		WI TREASURY SEC.	280,000.00	267,660.40	
		WI TREASURY SEC.	280,000.00	246,257.20	
	アメリカ・ドル　小計		261,780,000.00 (39,253,911,000)	227,170,098.50 (34,064,156,270)	
	イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	211,531.00	
		UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	294,706.70	
		UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	389,818.00	
		UNITED KINGDOM GILT	80,000.00	82,912.00	
		UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	291,711.00	
		UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	342,104.40	
		UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	385,560.00	

		UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	254,031.30	
		UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	296,918.00	
		UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	225,606.50	
		UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	335,941.20	
		UNITED KINGDOM GILT	420,000.00	236,145.00	
		UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	350,592.00	
		UNITED KINGDOM GILT	420,000.00	225,036.00	
		UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	363,299.00	
		UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	332,250.60	
		UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	298,864.50	
		UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	363,918.40	
		UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	286,934.40	
		UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	146,254.90	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	152,313.20	
		UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	317,967.00	
		UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	283,274.90	
		UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	283,350.60	
		UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	471,415.50	
		UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	162,598.10	
		UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	276,804.00	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	285,341.60	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	320,813.80	
		UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	320,776.50	
		UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	369,334.00	
		UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	409,048.80	
		UNITED KINGDOM GILT	550,000.00	332,090.00	
		UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	313,920.00	
		UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	141,540.50	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	311,385.60	
		UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	289,329.80	
		UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	152,057.00	
		UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	313,894.20	
		UNITED KINGDOM GILT	610,000.00	459,452.00	
		UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	181,718.10	
		UNITED KINGDOM GILT	590,000.00	528,846.50	
		UNITED KINGDOM GILT	590,000.00	288,215.00	
		UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	324,482.40	
		UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	502,092.00	
		UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	363,741.70	
		UNITED KINGDOM GILT	680,000.00	645,496.80	
		UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	189,181.00	
		UNITED KINGDOM GILT	780,000.00	615,864.60	
		UNITED KINGDOM GILT	220,000.00	81,844.40	
		UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	286,236.00	
		UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	391,794.00	
		UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	488,366.40	
		UNITED KINGDOM GILT	710,000.00	707,976.50	
		UNITED KINGDOM GILT	420,000.00	390,272.40	
		UNITED KINGDOM GILT	740,000.00	692,240.40	

	UNITED KINGDOM GILT	650,000.00	637,747.50	
	UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	418,368.00	
イギリス・ポンド　小計		23,780,000.00 (4,439,488,200)	19,415,325.70 (3,624,647,155)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	180,000.00	181,683.00	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	482,404.00	
	ISRAEL FIXED BOND	630,000.00	609,399.00	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	352,407.00	
	ISRAEL FIXED BOND	560,000.00	534,968.00	
	ISRAEL FIXED BOND	530,000.00	442,152.50	
	ISRAEL FIXED BOND	430,000.00	489,318.50	
	ISRAEL FIXED BOND	560,000.00	486,108.00	
	ISRAEL FIXED BOND	480,000.00	333,768.00	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	497,042.00	
	ISRAEL FIXED BOND	420,000.00	390,684.00	
	ISRAEL FIXED BOND	300,000.00	290,610.00	
	ISRAEL FIXED BOND	190,000.00	132,667.50	
	ISRAEL FIXED BOND	360,000.00	288,018.00	
イスラエル・シュケル　小計		6,010,000.00 (242,374,285)	5,511,229.50 (222,259,619)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	360,000.00	328,982.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	149,031.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	420,389.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	532,051.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	451,624.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	252,522.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	443,902.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	247,241.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	230,000.00	193,623.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	350,000.00	323,428.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	380,288.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	231,235.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	300,060.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	410,000.00	378,331.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	510,000.00	459,280.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	244,032.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	540,000.00	441,244.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	640,000.00	497,638.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	351,727.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	576,396.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	407,303.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	430,000.00	230,067.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	690,000.00	533,673.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	550,000.00	497,678.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	481,104.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	441,370.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	490,000.00	500,280.20	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	394,686.60	
オーストラリア・ドル　小計		**12,140,000.00** **(1,184,499,800)**	**10,689,193.80** **(1,042,944,639)**	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	14,001,120.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,432,824.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,014,700.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,186,920.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,000,330.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,480,808.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,261,404.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	8,262,847.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	7,899,684.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,600,000.00	17,587,328.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,969,100.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	7,394,006.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	11,255,817.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,491,765.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,334,144.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,992,520.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,989,920.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,372,320.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	720,000.00	737,092.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,221,384.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,419,679.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,028,740.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,437,400.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,498,172.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,340,000.00	3,394,475.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	4,006,240.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,196,128.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,613,910.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,646,044.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,703,819.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,704,182.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,535,955.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,489,220.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,130,586.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,807,344.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,001,690.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,477,775.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,300,000.00	8,280,412.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,302,226.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	10,287,331.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	5,887,232.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,700,000.00	5,763,555.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,487,100.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,900,000.00	6,964,101.00	
オフショア・人民元　小計		**241,970,000.00**	**243,949,351.00**	

		(5,022,861,654)	(5,063,949,418)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	388,151.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	144,744.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	213,578.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	216,781.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	340,000.00	335,593.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	440,000.00	428,947.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	412,608.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	340,000.00	327,715.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	370,140.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	70,000.00	70,663.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	240,000.00	208,492.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	135,996.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	126,153.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	241,427.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	159,101.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	186,884.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	153,836.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	138,978.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	220,745.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	188,074.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	880,000.00	641,775.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	129,822.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	720,000.00	616,464.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	181,926.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	610,000.00	568,678.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	620,000.00	496,446.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	365,188.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	666,276.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	390,000.00	358,020.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	690,000.00	466,978.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	650,000.00	550,355.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	360,000.00	329,364.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	270,000.00	258,687.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	540,000.00	472,456.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	101,449.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	335,247.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	223,831.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	460,000.00	417,233.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	314,476.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	315,072.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	316,096.00	
カナダ・ドル　小計		14,150,000.00 (1,545,887,500)	12,794,459.90 (1,397,794,744)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	59,808.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	206,954.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	116,530.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	159,408.00	

	SINGAPORE GOVERNMENT	220,000.00	216,326.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	153,760.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	155,840.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	166,320.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	138,110.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	111,164.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	112,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	212,793.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	198,760.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	161,013.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	109,080.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	80,709.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	123,175.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	114,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	116,880.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	70,000.00	69,860.00	
シンガポール・ドル　小計		2,890,000.00 (322,437,300)	2,782,892.60 (310,487,327)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,780,000.00	1,758,301.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,850,000.00	1,752,135.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,110,000.00	1,077,066.30	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,610,000.00	1,480,073.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,530,000.00	1,373,710.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	960,000.00	1,045,257.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,220,000.00	1,016,308.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	830,000.00	765,625.20	
スウェーデン・クローナ　小計		10,890,000.00 (155,182,500)	10,268,478.20 (146,325,814)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	640,000.00	608,320.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,370,000.00	1,338,284.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,450,000.00	1,333,536.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,250,000.00	1,102,262.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,270,000.00	620,649.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,550,000.00	1,251,237.50	
	KINGDOM OF DENMARK	2,330,000.00	2,778,175.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	1,355,116.00	
デンマーク・クローネ　小計		11,260,000.00 (246,931,800)	10,387,581.00 (227,799,651)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	110,000.00	108,340.10	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	240,000.00	232,368.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	80,000.00	79,430.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	229,630.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	130,000.00	100,938.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	140,000.00	111,092.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	140,000.00	115,007.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	270,000.00	242,184.60	

	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	61,183.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	78,690.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	290,000.00	261,011.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	180,000.00	144,729.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	90,000.00	85,126.50	
ニュージーランド・ドル　小計		2,140,000.00 (192,514,400)	1,849,731.70 (166,401,864)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	965,685.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,350,000.00	1,310,404.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,070,000.00	1,015,836.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	994,788.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	850,000.00	792,072.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	940,000.00	848,632.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,240,000.00	1,074,348.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	880,000.00	739,200.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	920,000.00	819,048.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	440,000.00	446,824.40	
ノルウェー・クローネ　小計		9,770,000.00 (135,509,900)	9,006,840.60 (124,924,879)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	450,000.00	467,860.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,030,000.00	997,266.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,120,824.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	710,000.00	647,363.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	820,000.00	741,698.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,040,000.00	911,955.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	570,000.00	581,268.90	
	POLAND GOVERNMENT BOND	770,000.00	723,492.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	880,000.00	680,856.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	730,000.00	634,443.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	604,672.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	730,000.00	696,996.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND	930,000.00	1,013,160.60	
ポーランド・ズロチ　小計		10,660,000.00 (397,240,636)	9,821,857.50 (366,007,591)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	244,420.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	550,214.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	490,000.00	507,566.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	408,085.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	206,254.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	615,490.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	685,528.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	366,760.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	387,296.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	326,332.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	373,052.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	252,316.80	

	MALAYSIA GOVERNMENT	590,000.00	630,887.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	530,000.00	535,167.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	342,332.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	500,000.00	545,985.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	361,814.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	440,000.00	440,699.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	389,206.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	250,000.00	252,477.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	460,000.00	451,982.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	540,000.00	507,870.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	579,561.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	312,194.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	390,000.00	379,126.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	420,000.00	445,279.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	160,000.00	165,025.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	338,609.40	
マレーシア・リンギット　小計		11,450,000.00 (366,579,765)	11,601,538.70 (371,431,383)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,000,000.00	1,872,980.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	600,000.00	542,280.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,050,000.00	1,016,379.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,120,000.00	1,883,217.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,310,000.00	8,503,847.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,670,000.00	5,632,014.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,850,000.00	9,047,717.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,840,000.00	5,007,741.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,840,000.00	4,801,570.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,650,000.00	1,721,412.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,620,000.00	7,158,837.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,240,000.00	6,023,784.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,810,000.00	4,418,898.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,020,000.00	7,122,562.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,200,000.00	3,006,592.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,500,000.00	2,984,065.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,950,000.00	4,363,276.50	
メキシコ・ペソ　小計		82,270,000.00 (716,110,988)	75,107,175.40 (653,762,898)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	192,857.70	
	BELGIUM KINGDOM	90,000.00	87,428.70	
	BELGIUM KINGDOM	440,000.00	509,018.40	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	223,152.60	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	213,518.00	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	205,407.30	
	BELGIUM KINGDOM	380,000.00	328,369.40	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	279,171.90	
	BELGIUM KINGDOM	490,000.00	472,252.20	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	155,748.70	
	BELGIUM KINGDOM	350,000.00	333,287.50	
	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	162,489.60	

		BELGIUM KINGDOM	200,000.00	139,536.00	
		BELGIUM KINGDOM	360,000.00	335,167.20	
		BELGIUM KINGDOM	160,000.00	117,012.80	
		BELGIUM KINGDOM	150,000.00	118,044.00	
		BELGIUM KINGDOM	460,000.00	510,232.00	
		BELGIUM KINGDOM	380,000.00	347,487.20	
		BELGIUM KINGDOM	240,000.00	203,743.20	
		BELGIUM KINGDOM	420,000.00	378,029.40	
		BELGIUM KINGDOM	250,000.00	166,555.00	
		BELGIUM KINGDOM	310,000.00	257,991.30	
		BELGIUM KINGDOM	200,000.00	121,424.00	
		BELGIUM KINGDOM	240,000.00	214,951.20	
		BELGIUM KINGDOM	370,000.00	402,008.70	
		BELGIUM KINGDOM	310,000.00	244,094.00	
		BELGIUM KINGDOM	140,000.00	53,468.80	
		BELGIUM KINGDOM	360,000.00	285,746.40	
		BELGIUM KINGDOM	240,000.00	142,089.60	
		BELGIUM KINGDOM	120,000.00	109,114.80	
		BELGIUM KINGDOM	390,000.00	384,025.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	523,476.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	190,000.00	187,879.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	478,531.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	80,000.00	81,096.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	402,272.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	505,904.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	668,900.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	520,390.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	490,356.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	566,114.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	477,696.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	488,469.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	588,342.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	495,301.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	361,785.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	268,835.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	620,000.00	588,107.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	539,670.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	397,614.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	525,224.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	620,000.00	575,558.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	311,680.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	498,078.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	633,441.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	499,316.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	429,744.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	404,632.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	464,292.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	463,270.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	439,240.70	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	460,920.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	468,674.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	248,915.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	472,429.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	510,819.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	289,159.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	438,406.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	426,535.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	170,000.00	74,823.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	526,764.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	218,336.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	392,926.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	230,000.00	139,265.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	434,462.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	417,518.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	503,669.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	228,778.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	516,527.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	464,915.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	210,000.00	191,547.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	475,171.20	
		BUNDESOBLIGATION	500,000.00	497,130.00	
		BUNDESOBLIGATION	480,000.00	459,556.80	
		BUNDESOBLIGATION	610,000.00	577,060.00	
		BUNDESOBLIGATION	160,000.00	151,542.40	
		BUNDESOBLIGATION	610,000.00	571,173.50	
		BUNDESOBLIGATION	530,000.00	490,647.50	
		BUNDESOBLIGATION	490,000.00	448,781.20	
		BUNDESOBLIGATION	650,000.00	620,509.50	
		BUNDESOBLIGATION	190,000.00	181,467.10	
		BUNDESOBLIGATION	550,000.00	542,223.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	140,000.00	137,274.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	80,213.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	480,648.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	180,000.00	178,639.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	653,830.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000.00	657,702.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	618,182.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	712,252.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	540,000.00	645,089.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	669,160.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	602,634.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	668,088.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	420,000.00	495,558.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	470,000.00	589,774.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	810,000.00	590,708.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	588,883.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	630,000.00	567,951.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	553,542.20	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	565,558.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	870,000.00	421,889.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	420,000.00	444,456.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	524,484.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	490,000.00	443,538.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	369,085.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	611,647.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	693,124.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	178,632.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	519,653.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	407,584.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	220,000.00	107,254.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	587,610.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	531,264.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	165,552.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	275,304.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	546,699.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	260,000.00	315,208.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	626,241.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	450,000.00	354,694.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	580,543.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	557,625.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	530,000.00	424,233.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	833,042.50	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	390,000.00	386,322.30	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	400,000.00	397,772.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	370,000.00	370,273.80	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	50,000.00	50,142.50	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	190,000.00	187,663.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	171,671.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	398,748.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	352,555.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	219,810.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	306,292.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	443,564.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	372,086.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	190,000.00	191,666.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	220,213.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	160,000.00	158,686.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	120,000.00	120,321.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,645.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	411,418.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	605,102.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	690,000.00	657,390.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	494,530.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	313,138.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	455,768.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	589,398.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	458,315.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	576,482.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	427,446.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	792,764.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	305,411.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	477,485.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	298,797.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	430,721.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	138,501.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	378,804.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	392,251.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	329,828.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	408,190.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	273,091.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	497,632.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	680,000.00	732,876.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	480,405.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	317,499.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	296,656.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	490,492.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	264,185.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	560,000.00	582,484.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	430,040.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	488,328.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	529,645.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	213,699.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	208,562.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	590,000.00	623,264.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	442,731.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	347,621.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	469,816.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	447,319.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	226,463.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	352,508.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	431,153.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	435,450.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	183,902.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	247,357.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	365,354.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	174,318.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	435,993.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	110,000.00	60,018.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	312,307.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	363,786.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	400,936.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	405,578.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	442,435.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	355,588.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	376,420.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	399,237.50	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	664,266.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	304,596.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	357,489.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	422,285.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	337,004.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	121,414.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	359,077.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	295,798.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	345,960.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	351,416.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	333,039.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	198,066.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	386,224.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	241,775.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	380,250.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	477,881.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	410,176.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	396,592.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	192,660.00	
		DEUTSCHLAND REP	380,000.00	425,315.00	
		DEUTSCHLAND REP	300,000.00	339,276.00	
		DEUTSCHLAND REP	300,000.00	328,953.00	
		DEUTSCHLAND REP	480,000.00	573,057.60	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	83,706.30	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	108,806.50	
		FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	69,878.90	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	119,440.80	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	108,236.40	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	93,914.70	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	134,603.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	132,314.00	
		FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	137,356.50	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	82,239.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	89,906.70	
		FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	130,996.50	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	74,926.50	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	101,227.00	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	54,574.20	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	106,492.10	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	43,047.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	112,060.20	
		FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	133,930.50	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	82,958.40	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	59,533.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	114,389.60	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	95,116.00	
		FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	352,128.00	
		FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	918,477.30	
		FRANCE (GOVT OF)	1,230,000.00	1,224,772.50	

		FRANCE (GOVT OF)	610,000.00	605,565.30	
		FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	823,194.00	
		FRANCE (GOVT OF)	640,000.00	730,969.60	
		FRANCE (GOVT OF)	140,000.00	144,198.60	
		FRANCE (GOVT OF)	670,000.00	639,367.60	
		FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	664,284.60	
		FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	786,240.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,340,000.00	1,308,630.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,020,000.00	980,444.40	
		FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	797,472.30	
		FRANCE (GOVT OF)	1,340,000.00	1,211,748.60	
		FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	993,238.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,110,000.00	1,044,643.20	
		FRANCE (GOVT OF)	370,000.00	230,428.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,030,000.00	814,328.30	
		FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	813,498.40	
		FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	585,919.90	
		FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	844,236.00	
		FRANCE (GOVT OF)	660,000.00	491,165.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,380,000.00	1,258,284.00	
		FRANCE (GOVT OF)	980,000.00	812,910.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,310,000.00	1,182,694.20	
		FRANCE (GOVT OF)	590,000.00	630,828.00	
		FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	950,888.40	
		FRANCE (GOVT OF)	720,000.00	465,141.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,220,000.00	1,074,929.80	
		FRANCE (GOVT OF)	1,070,000.00	1,025,156.30	
		FRANCE (GOVT OF)	1,050,000.00	885,391.50	
		FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	364,291.90	
		FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	944,986.30	
		FRANCE (GOVT OF)	980,000.00	991,975.60	
		FRANCE (GOVT OF)	440,000.00	472,428.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,270,000.00	1,037,120.10	
		FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	352,906.40	
		FRANCE (GOVT OF)	260,000.00	90,651.60	
		FRANCE (GOVT OF)	430,000.00	241,040.80	
		FRANCE (GOVT OF)	1,160,000.00	916,052.00	
		FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	820,089.00	
		FRANCE (GOVT OF)	690,000.00	336,457.80	
		FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	605,303.40	
		FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	671,895.00	
		FRANCE (GOVT OF)	370,000.00	278,687.70	
		FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	941,873.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	925,089.30	
		FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	917,560.00	
		FRANCE (GOVT OF)	440,000.00	469,092.80	
		FRANCE (GOVT OF)	280,000.00	238,420.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	240,000.00	187,464.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	203,901.60	

		IRELAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	238,542.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	140,923.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	165,720.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	120,000.00	103,374.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	150,000.00	134,962.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	191,656.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	132,054.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	120,000.00	88,971.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	257,170.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	155,247.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	149,922.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	159,456.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	90,000.00	56,991.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	80,000.00	76,792.00	
		IRISH GOVERNMENT BOND	110,000.00	87,800.90	
		ITALIAN GOVT	220,000.00	242,772.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	250,000.00	241,515.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	170,000.00	167,371.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	103,002.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	429,718.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	340,182.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	440,000.00	420,116.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	420,000.00	394,926.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	344,499.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	430,000.00	393,174.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	430,439.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	235,294.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	237,429.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	258,753.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	448,486.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	320,943.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	172,789.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	330,000.00	267,283.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	149,874.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	320,638.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	234,891.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	281,700.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	246,738.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	190,000.00	152,003.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	75,828.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	70,000.00	69,996.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	92,299.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	195,396.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	108,319.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	183,572.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	290,000.00	280,096.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	309,962.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	220,000.00	153,507.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	320,000.00	295,289.60	

		REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	33,006.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	88,857.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	234,007.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	256,337.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	340,000.00	369,631.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	264,936.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	197,638.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	249,402.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	112,954.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	80,115.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	41,587.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	265,445.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	32,889.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	191,174.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	102,318.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	156,142.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	270,000.00	227,269.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	110,000.00	81,208.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	126,826.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	274,573.60	
	ユーロ　小計		158,390,000.00 (25,903,100,600)	144,016,111.40 (23,552,394,858)	
国債証券　合計			80,124,630,328 (80,124,630,328)	71,335,288,110 (71,335,288,110)	
合計				71,335,288,110 (71,335,288,110)	

（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	140銘柄	47.23	47.75
イギリス・ポンド	国債証券	58銘柄	5.03	5.08
イスラエル・シュケル	国債証券	14銘柄	0.31	0.31
オーストラリア・ドル	国債証券	28銘柄	1.45	1.46
オフショア・人民元	国債証券	44銘柄	7.02	7.10
カナダ・ドル	国債証券	41銘柄	1.94	1.96
シンガポール・ドル	国債証券	20銘柄	0.43	0.44
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.20	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	0.32	0.32
ニュージーランド・ドル	国債証券	13銘柄	0.23	0.23
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.17	0.18
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.51	0.51
マレーシア・リンギット	国債証券	28銘柄	0.52	0.52
メキシコ・ペソ	国債証券	17銘柄	0.91	0.92
ユーロ	国債証券	375銘柄	32.66	33.02

（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。

中間財務諸表

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2023年11月21日から2024年5月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）】
（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 2023年11月20日現在	第7期中間計算期間 2024年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,548	2,066
コール・ローン	215,090	246,065
親投資信託受益証券	135,078,665	157,598,726
未収入金	223,818	267,898
流動資産合計	135,522,121	158,114,755
資産合計	135,522,121	158,114,755
負債の部		
流動負債		
未払解約金	214,422	256,940
未払受託者報酬	16,723	18,913
未払委託者報酬	209,515	237,092
その他未払費用	6,882	7,815
流動負債合計	447,542	520,760
負債合計	447,542	520,760
純資産の部		
元本等		
元本	102,962,685	110,852,007
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	32,111,894	46,741,988
（分配準備積立金）	13,333,689	12,491,328
元本等合計	135,074,579	157,593,995
純資産合計	135,074,579	157,593,995
負債純資産合計	135,522,121	158,114,755

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期中間計算期間 自　2022年11月22日 至　2023年5月21日	第7期中間計算期間 自　2023年11月21日 至　2024年5月20日
営業収益		
受取利息	－	6
有価証券売買等損益	2,581,923	12,083,789
営業収益合計	2,581,923	12,083,795
営業費用		
受託者報酬	15,667	18,913
委託者報酬	196,408	237,092
その他費用	6,461	7,815
営業費用合計	218,536	263,820
営業利益又は営業損失（△）	2,363,387	11,819,975
経常利益又は経常損失（△）	2,363,387	11,819,975
中間純利益又は中間純損失（△）	2,363,387	11,819,975
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	62,386	340,257
期首剰余金又は期首欠損金（△）	21,255,819	32,111,894
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,961,158	5,335,996
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,961,158	5,335,996
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,164,960	2,185,620
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,164,960	2,185,620
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	23,353,018	46,741,988

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第7期中間計算期間 自　2023年11月21日 至　2024年5月20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。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第6期 2023年11月20日現在	第7期中間計算期間 2024年5月20日現在
１．　期首元本額	95,032,530円	102,962,685円
期中追加設定元本額	27,258,274円	14,859,289円
期中一部解約元本額	19,328,119円	6,969,967円
２．　受益権の総数	102,962,685口	110,852,007口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 2023年11月20日現在	第7期中間計算期間 2024年5月20日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第6期 2023年11月20日現在	第7期中間計算期間 2024年5月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3119円 (13,119円)	1.4217円 (14,217円)

（参考）

当ファンドは、「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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」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」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

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

	2024年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	42,727,166
コール・ローン	5,089,911,768
株式	235,341,663,720
派生商品評価勘定	80,096,150
未収入金	14,875,170
未収配当金	2,401,194,089
差入委託証拠金	324,336,422
流動資産合計	243,294,804,485
資産合計	243,294,804,485
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,924,100
前受金	17,315,000
未払解約金	528,933,393
流動負債合計	548,172,493
負債合計	548,172,493
純資産の部	
元本等	
元本	73,367,709,089
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	169,378,922,903
元本等合計	242,746,631,992
純資産合計	242,746,631,992
負債純資産合計	243,294,804,485

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年5月20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		2024年5月20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	71,774,824,873円
	同期中追加設定元本額	11,291,168,088円
	同期中一部解約元本額	9,698,283,872円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイＴＯＰＩＸオープン	5,238,959,523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）	3,023,509,846円
	ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	2,957,952円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,919,216,190円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,160,686,675円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	6,272,716,438円
	ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	1,909,963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）	2,959,278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）	8,706,910円
	ＤＣニッセイ国内株式インデックス	3,691,570,748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	24,830,170,634円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（４資産均等型）	4,153,418,812円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	397,847,816円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	217,688,583円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	453,593,257円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	599,954,742円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	29,341,268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）	120,213,215円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	11,485,810円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	13,619,539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）	4,745,769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）	9,856,282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）	26,551,785円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	325,245,361円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	208,421,416円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	387,171,058円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	167,627,611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）	13,872,563,808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）	26,564,753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）	31,887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）	71,360円
	ＦＷニッセイ国内株インデックス	75,420,201円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	105,897,672円
	ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	6,912,271円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	100,656円
	計	73,367,709,089円
２．	受益権の総数	73,367,709,089口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2024年5月20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	7,371,635,000	－	7,449,955,000	78,320,000
合計	7,371,635,000	－	7,449,955,000	78,320,000

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年5月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.3086円 (33,086円)

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	3,886,147,807
金銭信託	33,335,005
コール・ローン	3,971,062,207
株式	1,001,595,830,639
投資証券	18,727,471,055
派生商品評価勘定	614,330,809
未収入金	380,470,071
未収配当金	1,558,336,522
差入委託証拠金	15,507,436,295
流動資産合計	1,046,274,420,410
資産合計	1,046,274,420,410
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	708,111
未払金	78,145,469
未払解約金	1,077,158,555
流動負債合計	1,156,012,135
負債合計	1,156,012,135
純資産の部	
元本等	
元本	228,048,095,816
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	817,070,312,459
元本等合計	1,045,118,408,275
純資産合計	1,045,118,408,275
負債純資産合計	1,046,274,420,410

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年5月20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	2024年5月20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	220,818,463,085円
同期中追加設定元本額	25,884,972,967円
同期中一部解約元本額	18,655,340,236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）	720,702,893円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,580,736,522円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,527,363,070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）	2,265,361,143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）	717,286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）	1,481,647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）	4,956,740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）	276,571,803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	159,016,124,732円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	42,297,137,819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）	3,116,935,119円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	428,827,079円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	163,494,295円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	483,337,366円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	604,206,448円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	9,185,720円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	90,244,548円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	8,618,660円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	10,216,477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）	3,560,283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）	19,919,959円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	350,311,034円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	222,929,633円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	410,462,916円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	139,376,601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）	125,459,580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）	269,094,147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）	126,373,750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）	123,783,639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）	123,264,303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）	110,110,042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）	29,921,792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）	8,992,598,946円
ＦＷニッセイ先進国株インデックス	41,283,222円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	114,129,388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）	80,215,070円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	80,689,194円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド２０２４－０２（適格機関投資家限定）	78,284,448円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	108,502円
計	228,048,095,816円
２．　受益権の総数	228,048,095,816口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年5月20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	32,285,207	－	32,371,627	△86,420
カナダ・ドル	1,672,615	－	1,691,734	△19,119
スイス・フラン	27,339,692	－	27,396,128	△56,436
ユーロ	3,272,900	－	3,283,765	△10,865
買建	1,722,751,033	－	1,745,560,756	22,809,723
アメリカ・ドル	810,885,931	－	821,335,356	10,449,425
イギリス・ポンド	542,938,531	－	550,779,600	7,841,069
ユーロ	368,926,571	－	373,445,800	4,519,229
合計	1,755,036,240	－	1,777,932,383	22,723,303

（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	2024年5月20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	21,270,518,660	－	21,861,418,058	590,899,398
合計	21,270,518,660	－	21,861,418,058	590,899,398

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年5月20日現在
1口当たり純資産額	4.5829円
（1万口当たり純資産額）	(45,829円)

ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	111,932,916
金銭信託	7,710,416
コール・ローン	918,510,211
株式	10,585,609,224
投資信託受益証券	785,305,571
投資証券	10,569,869
派生商品評価勘定	82,349,975
未収入金	928,854
未収配当金	24,841,636
差入委託証拠金	376,383,125
流動資産合計	12,904,141,797
資産合計	12,904,141,797
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	853
未払金	3,095,283
未払解約金	38,068,335
流動負債合計	41,164,471
負債合計	41,164,471
純資産の部	
元本等	
元本	8,340,398,782
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,522,578,544
元本等合計	12,862,977,326
純資産合計	12,862,977,326
負債純資産合計	12,904,141,797

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年5月20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		2024年5月20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	7,117,768,792円
	同期中追加設定元本額	2,176,395,688円
	同期中一部解約元本額	953,765,698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	2,876,915,355円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	25,657,741円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	30,327,982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）	10,567,744円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	59,125,885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）	621,258,313円
	ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	2,857,476,020円
	ＦＷニッセイ新興国株インデックス	30,175,849円
	ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	29,543,678円
	ＤＣニッセイ新興国株式インデックス	1,799,350,215円
	計	8,340,398,782円
２．	受益権の総数	8,340,398,782口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目		2024年5月20日現在
１．	貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．	時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．	金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年5月20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	910,242,777	－	921,148,480	10,905,703
アメリカ・ドル	910,242,777	－	921,148,480	10,905,703
合計	910,242,777	－	921,148,480	10,905,703

（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	2024年5月20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	1,399,567,431	－	1,471,010,850	71,443,419
合計	1,399,567,431	－	1,471,010,850	71,443,419

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年5月20日現在
1口当たり純資産額	1.5422円
（1万口当たり純資産額）	(15,422円)

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,252,709
コール・ローン	268,355,921
投資証券	30,984,657,700
未収配当金	256,386,243
流動資産合計	31,511,652,573
資産合計	31,511,652,573
負債の部	
流動負債	
未払解約金	104,168,932
流動負債合計	104,168,932
負債合計	104,168,932
純資産の部	
元本等	
元本	16,836,724,247
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	14,570,759,394
元本等合計	31,407,483,641
純資産合計	31,407,483,641
負債純資産合計	31,511,652,573

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年5月20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	2024年5月20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	16,718,367,652円
同期中追加設定元本額	3,822,878,208円
同期中一部解約元本額	3,704,521,613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）	55,848,760円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド	889,625,410円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＪリートインデックスファンド	8,852,176,776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）	1,605,978,794円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＡ	3,192,629,549円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＢ	1,938,581,990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）	204,318,562円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	23,290,849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）	8,115,661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）	16,853,532円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	45,404,867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）	108,865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）	243,598円
ＦＷニッセイ国内リートインデックス	3,547,034円
計	16,836,724,247円
２．　受益権の総数	16,836,724,247口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年5月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8654円 (18,654円)

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	28,691,938
金銭信託	2,598,534
コール・ローン	309,552,728
投資証券	12,289,157,819
派生商品評価勘定	27,212,563
未収入金	4,427,296
未収配当金	16,285,939
差入委託証拠金	260,263,456
流動資産合計	12,938,190,273
資産合計	12,938,190,273
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	130,850
未払金	4,301,452
未払解約金	22,206,151
流動負債合計	26,638,453
負債合計	26,638,453
純資産の部	
元本等	
元本	7,487,727,213
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,423,824,607
元本等合計	12,911,551,820
純資産合計	12,911,551,820
負債純資産合計	12,938,190,273

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年5月20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．　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	2024年5月20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	6,248,675,491円
同期中追加設定元本額	1,929,054,986円
同期中一部解約元本額	690,003,264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）	1,671,789,320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）	241,800,566円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	27,372,594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）	9,539,483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）	53,369,946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）	51,001,076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）	3,113,823,097円
ＦＷニッセイ先進国リートインデックス	21,462,694円
ＤＣニッセイ先進国リートインデックス	2,297,568,437円
計	7,487,727,213円
２．　受益権の総数	7,487,727,213口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年5月20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	306,032,141	－	308,964,780	2,932,639
アメリカ・ドル	268,360,561	－	270,944,280	2,583,719
ユーロ	37,671,580	－	38,020,500	348,920
合計	306,032,141	－	308,964,780	2,932,639

（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	2024年5月20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	576,104,231	－	600,253,306	24,149,075
合計	576,104,231	－	600,253,306	24,149,075

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年5月20日現在
1口当たり純資産額	1.7244円
（1万口当たり純資産額）	(17,244円)

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,747,638
コール・ローン	446,440,697
国債証券	47,237,122,810
地方債証券	3,142,731,244
特殊債券	4,457,708,556
社債券	2,667,827,900
未収利息	126,863,817
前払費用	8,762,668
流動資産合計	58,091,205,330
資産合計	58,091,205,330
負債の部	
流動負債	
未払解約金	45,938,385
流動負債合計	45,938,385
負債合計	45,938,385
純資産の部	
元本等	
元本	63,541,871,403
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△5,496,604,458
元本等合計	58,045,266,945
純資産合計	58,045,266,945
負債純資産合計	58,091,205,330

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年5月20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	2024年5月20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	56,480,299,522円
同期中追加設定元本額	10,458,886,902円
同期中一部解約元本額	3,397,315,021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）	36,831,960,990円
ＤＣニッセイ日本債券インデックス	5,337,243,394円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	393,381,993円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	9,261,840,629円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	717,866,467円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	3,857,277,387円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	1,205,148,783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）	423,724,479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）	42,073,129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）	163,092,508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）	94,159,240円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	234,271,662円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	260,844,695円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	925,100,318円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	3,688,682,808円
ＦＷニッセイ国内債インデックス	51,007,772円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	54,143,970円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	51,179円
計	63,541,871,403円
２．　受益権の総数	63,541,871,403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5,496,604,458円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年5月20日現在
1口当たり純資産額	0.9135円
（1万口当たり純資産額）	(9,135円)

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	440,190,512
金銭信託	2,200,870
コール・ローン	262,180,589
国債証券	83,760,829,875
派生商品評価勘定	812,085
未収入金	37,568
未収利息	541,830,182
前払費用	59,806,052
流動資産合計	85,067,887,733
資産合計	85,067,887,733
負債の部	
流動負債	
未払金	211,251,132
未払解約金	119,298,281
流動負債合計	330,549,413
負債合計	330,549,413
純資産の部	
元本等	
元本	47,657,979,877
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	37,079,358,443
元本等合計	84,737,338,320
純資産合計	84,737,338,320
負債純資産合計	85,067,887,733

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年5月20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		2024年5月20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	43,378,960,163円
	同期中追加設定元本額	9,227,858,412円
	同期中一部解約元本額	4,948,838,698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）	3,571,978,013円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	6,655,657,355円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,914,264,746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）	942,605,699円
	ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	1,777,663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）	1,835,888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）	4,376,708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	16,154,195,001円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（４資産均等型）	7,728,797,722円
	ＤＣニッセイ外国債券インデックス	4,753,002,151円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	363,056,367円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	2,025,836,758円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	413,553,895円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	579,154,714円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	48,544,233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）	223,721,845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）	22,081,125円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	49,412,780円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	295,081,541円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	190,125,380円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	358,961,804円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	192,208,047円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス	72,195,863円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	95,463,748円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	90,831円
	計	47,657,979,877円
２．	受益権の総数	47,657,979,877口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年5月20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	137,357,001	－	138,169,086	812,085
アメリカ・ドル	80,230,452	－	80,841,083	610,631
イギリス・ポンド	4,091,140	－	4,115,136	23,996
オフショア・人民元	12,914,400	－	12,929,760	15,360
カナダ・ドル	3,419,754	－	3,432,241	12,487
デンマーク・クローネ	570,537	－	572,835	2,298
メキシコ・ペソ	1,585,323	－	1,599,075	13,752
ユーロ	34,545,395	－	34,678,956	133,561
合計	137,357,001	－	138,169,086	812,085

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年5月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7780円 (17,780円)

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	156,434,743円
Ⅱ　負債総額	1,829,181円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	154,605,562円
Ⅳ　発行済数量	110,090,418口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4044円

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	249,405,870,619円
Ⅱ　負債総額	4,244,176,672円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	245,161,693,947円
Ⅳ　発行済数量	73,973,504,182口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3142円

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,042,720,551,437円
Ⅱ　負債総額	1,151,606,646円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,041,568,944,791円
Ⅳ　発行済数量	229,404,764,781口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.5403円

ニッセイ新興国株式インデックス　マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	12,736,894,583円
Ⅱ　負債総額	39,948,596円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	12,696,945,987円
Ⅳ　発行済数量	8,514,909,301口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4911円

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	30,947,653,187円
Ⅱ　負債総額	177,266,926円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	30,770,386,261円
Ⅳ　発行済数量	16,893,222,508口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8215円

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	12,867,985,101円
Ⅱ　負債総額	26,529,412円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	12,841,455,689円
Ⅳ　発行済数量	7,652,380,865口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6781円

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	**62,465,178,560円**
Ⅱ　負債総額	**1,296,385,239円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**61,168,793,321円**
Ⅳ　発行済数量	**67,465,921,612口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**0.9067円**

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2024年5月31日現在

Ⅰ　資産総額	**85,851,587,797円**
Ⅱ　負債総額	**596,636,025円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**85,254,951,772円**
Ⅳ　発行済数量	**48,136,147,949口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.7711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。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2024年5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。

2024年5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	417	78,687
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	113	19,501
単位型公社債投資信託	0	0
合計	530	98,188

○　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.財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

２.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第29期事業年度（自2023年4月1日　至2024年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

		前事業年度 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金		31,522,565		23,594,998
有価証券		5,099,877		4,958,109
前払費用		595,955		645,436
未収委託者報酬		5,813,921		7,068,985
未収運用受託報酬		3,456,007		7,149,867
未収投資助言報酬		259,830		308,690
その他		18,700		58,384
流動資産合計		46,766,858		43,784,472
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	※1	150,182	※1	143,306
車両	※1	482	※1	0
器具備品	※1	92,889	※1	67,645
有形固定資産合計		243,554		210,951
無形固定資産				
ソフトウェア		1,803,047		1,890,946
ソフトウェア仮勘定		1,198,151		1,968,913
その他		8,013		8,032
無形固定資産合計		3,009,212		3,867,892
投資その他の資産				
投資有価証券		37,635,584		47,543,934
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		11,881		27,817
差入保証金		367,613		360,305
繰延税金資産		1,600,306		1,809,123
その他		10,037		12,801
投資その他の資産合計		39,691,645		49,820,204
固定資産合計		42,944,413		53,899,049
資産合計		89,711,272		97,683,522

負債の部				
流動負債				
預り金		53,649		89,613
未払収益分配金		7,080		6,178
未払手数料	※2	2,148,508	※2	2,551,424
未払運用委託報酬	※2	1,868,264	※2	4,921,643
未払投資助言報酬	※2	801,755	※2	895,917
その他未払金	※2	2,880,396	※2	1,753,139
未払費用	※2	122,649	※2	181,100
未払法人税等		1,689,458		3,839,095
未払消費税等		321,144		937,421
賞与引当金		1,047,233		1,342,646
その他		46,054		34,063
流動負債合計		10,986,194		16,552,244
固定負債				
退職給付引当金		2,402,314		2,474,312
役員退職慰労引当金		16,150		21,250
固定負債合計		2,418,464		2,495,562
負債合計		13,404,658		19,047,806
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		57,905,876		60,488,508
利益剰余金合計		58,585,683		61,168,315
株主資本合計		76,867,523		79,450,155
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		△ 254,732		△ 484,519
繰延ヘッジ損益		△ 306,177		△ 329,920
評価・換算差額等合計		△ 560,910		△ 814,439
純資産合計		76,306,613		78,635,715
負債・純資産合計		89,711,272		97,683,522

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	27,807,455	29,505,710
運用受託報酬	18,365,703	24,242,291
投資助言報酬	1,146,302	1,181,976
その他営業収益	4,497	11,333
営業収益計	47,323,959	54,941,312
営業費用		
支払手数料	10,826,133	11,188,210
広告宣伝費	34,423	46,512
公告費	125	375
調査費	9,426,129	14,344,571
支払運用委託報酬	3,994,350	8,375,976
支払投資助言報酬	3,279,321	3,524,180
委託調査費	143,143	140,696
調査費	2,009,314	2,303,717
委託計算費	278,897	281,167
営業雑経費	876,260	980,132
通信費	60,541	72,591
印刷費	166,600	174,220
協会費	37,646	37,566
その他営業雑経費	611,472	695,754
営業費用計	21,441,969	26,840,969
一般管理費		
役員報酬	114,167	242,750
給料・手当	5,179,604	5,515,210
賞与引当金繰入額	1,033,669	1,325,993
賞与	357,187	329,794
福利厚生費	988,302	1,094,736
退職給付費用	411,161	446,711
役員退職慰労引当金繰入額	5,850	8,700
役員退職慰労金	2,550	821
その他人件費	214,336	192,956
不動産賃借料	803,805	805,677
その他不動産経費	35,247	37,672
交際費	27,169	28,219
旅費交通費	133,750	177,813
固定資産減価償却費	663,401	687,280
租税公課	367,046	393,138
業務委託費	438,018	414,081
器具備品費	769,903	1,022,398
保険料	49,248	49,463
寄付金	10,762	4,382
諸経費	279,825	352,612
一般管理費計	11,885,008	13,130,414
営業利益	13,996,981	14,969,928
営業外収益		

受取利息		950		825
有価証券利息		15,666		61,304
受取配当金	※1	191,353	※1	61,395
為替差益		22,628		182,640
その他営業外収益		20,449		8,780
営業外収益計		251,049		314,945
営業外費用				
金融派生商品費用		-		185,184
控除対象外消費税		5,712		11,281
その他営業外費用		314		14,042
営業外費用計		6,026		210,509
経常利益		14,242,004		15,074,365
特別利益				
投資有価証券売却益		97,919		220,932
投資有価証券償還益		45,181		65,698
特別利益計		143,100		286,630
特別損失				
投資有価証券売却損		73,703		5,154
投資有価証券償還損		71,887		55,591
固定資産除却損	※2	1,757	※2	8,209
事故損失賠償金	※3	2,015	※3	71
特別損失計		149,364		69,028
税引前当期純利益		14,235,739		15,291,967
法人税、住民税及び事業税		4,112,329		4,785,139
法人税等調整額		74,919		△ 114,620
法人税等合計		4,187,249		4,670,518
当期純利益		10,048,489		10,621,448

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度(自2023年4月1日　至2024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	57,905,876	58,585,683	76,867,523
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△ 8,038,816	△ 8,038,816	△ 8,038,816
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	10,621,448	10,621,448	10,621,448
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	2,582,632	2,582,632	2,582,632
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	60,488,508	61,168,315	79,450,155

	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
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△ 8,038,816
当期純利益	-	-	-	10,621,448
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 229,786	△ 23,743	△ 253,529	△ 253,529
当期変動額合計	△ 229,786	△ 23,743	△ 253,529	2,329,102
当期末残高	△ 484,519	△ 329,920	△ 814,439	78,635,715

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024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。

（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 （2023年3月31日）	当事業年度 （2024年3月31日）
建物附属設備	340,233千円	350,825千円
車両	6,246	6,729
器具備品	516,937	463,698
計	863,417	821,253

（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 （2023年3月31日）	当事業年度 （2024年3月31日）
受取配当金	174,180千円	42,264千円

※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　2022年4月1日 至　2023年3月31日)	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
器具備品	1,749	6,353
ソフトウェア	8	1,856
計	1,757	8,209

※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

当事業年度（自2023年4月1日　至2024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

2023年6月26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	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

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

2024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	8,497,226千円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	78,353円
基準日	2024年3月31日
効力発生日	2024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（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。

当事業年度（2024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	28,036,676	27,975,611	61,065
その他有価証券	24,465,367	24,465,367	－
資産計	52,502,043	52,440,978	61,065
デリバティブ取引（※）			
ヘッジ会計が適用されているもの	△10,936	△10,936	－
デリバティブ取引計	△10,936	△10,936	－

（※）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(2023年3月31日)
関係会社株式	66,222

(単位：千円)

区分	当事業年度(2024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（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。

当事業年度（2024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	3,473,100	20,992,267	－	24,465,367
デリバティブ取引（※）				
為替予約	－	△10,936	－	△10,936
合計	－	24,454,430	－	24,454,430

(※)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（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

当事業年度（2024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	－	27,975,611	－	27,975,611
合計	－	27,975,611	－	27,975,611

（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

国債・地方債は相場価格を用いて評価しております。国債は、市場での取引頻度が高く、活発な市場における相場価格と認められるため、その時価をレベル１の時価に分類しております。一方、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。

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(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。

当事業年度(2024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	23,594,998	―	―	―
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	4,950,000	23,050,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
国債・地方債等	―	―	―	3,000,000
その他（注）	8,363,707	9,339,165	2,160,208	928,678
合計	36,908,706	32,389,165	2,160,208	3,928,678

（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（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

当事業年度（2024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	1,094,587	1,098,374	3,786
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	1,094,587	1,098,374	3,786
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	26,942,089	26,877,237	△64,852
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	26,942,089	26,877,237	△64,852
合計		28,036,676	27,975,611	△61,065

２．その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度（2024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	3,473,100	3,459,180	13,920
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	6,089,659	5,473,000	616,659
	小計	9,562,759	8,932,180	630,579
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）	14,902,608	16,307,000	△1,404,391
	小計	14,902,608	16,307,000	△1,404,391
合計		24,465,367	25,239,180	△773,812

（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

当事業年度（自2023年4月1日　至2024年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	－	－	－
(2)債券	－	－	－
(3)その他	2,529,777	220,932	5,154
合計	2,529,777	220,932	5,154

（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（2023年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2024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（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。

当事業年度（2024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	916,030	-	△ 10,936
合計			916,030	-	△ 10,936

（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　2022年4月1日 至　2023年3月31日)	当事業年度 (自　2023年4月1日 至　2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,324,488 千円	2,226,246 千円
勤務費用	261,043	295,775
利息費用	7,886	14,661
数理計算上の差異の発生額	△51,020	△16,051
退職給付の支払額	△318,533	△240,354
その他	2,382	4,124
退職給付債務の期末残高	2,226,246	2,284,401

（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　2022年4月1日 至　2023年3月31日)	当事業年度 (自　2023年4月1日 至　2024年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	147,543千円	162,914千円
退職給付費用	18,835	16,453
退職給付の支払額	△1,081	△15,208
その他	△2,382	△4,124
退職給付引当金の期末残高	162,914	160,035

（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 （2023年3月31日）	当事業年度 （2024年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,389,160千円	2,444,436千円
未認識数理計算上の差異	13,153	29,875
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,402,314	2,474,312
退職給付引当金	2,402,314	2,474,312
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,402,314	2,474,312

（４）退職給付費用

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
簡便法で計算した退職給付費用	18,835千円	16,453千円
勤務費用	261,043	295,775
利息費用	7,886	14,661
数理計算上の差異の当期費用処理額	10,874	670
確定給付制度に係る退職給付費用	298,639	327,560

（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　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
割引率	0.66 %	0.88%

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75,867千円、当事業年度において81,815千円であり、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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	320,663　千円	411,118　千円
未払事業税	113,779	154,657
退職給付引当金	735,588	757,634
税務上の繰延資産償却超過額	2,055	1,901
役員退職慰労引当金	4,945	6,506
投資有価証券評価差額	314,276	459,720
減価償却超過額	48,992	1,035
その他	180,561	203,947
小計	1,720,862	1,996,521
評価性引当額	△12,818	△7,242
繰延税金資産合計	1,708,043	1,989,278
繰延税金負債		
特別分配金否認	10,817	15,934
投資有価証券評価差額	96,919	164,220
繰延税金負債合計	107,737	180,154
繰延税金資産(△は負債)の純額	1,600,306	1,809,123

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、日本生命保険相互会社を通算親会社として、グループ通算制度を適用しております。
これにより、法人税および地方法人税の会計処理またはこれらに関する税効果会計の会計処理は、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（企業会計基準委員会実務対応報告第42号　2021年8月12日）に従っております。

（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

当事業年度（自2023年4月1日　至2024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	6,138,470

[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 2022年4月1日 至2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至2024年3月31日）
営業収益		
投資信託委託業務	27,807,455	29,505,710
投資運用業務（注）	18,365,703	24,242,291
投資助言業務	1,146,302	1,181,976
その他営業収益	4,497	11,333
計	47,323,959	54,941,312

（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

当事業年度（自2023年4月1日　至2024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	6,088,919	未収運用受託報酬	1,590,885
								投資助言報酬の受取	117,195	未収投資助言報酬	11,015
								グループ通算に伴う支払	624,787	その他未払金	624,787

（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　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
１株当たり純資産額	703,623円97銭	725,100円65銭
１株当たり当期純利益金額	92,657円21銭	97,940円47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　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
当期純利益	10,048,489千円	10,621,448千円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	10,048,489千円	10,621,448千円
期中平均株式数	108千株	108千株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

該当事項はありません。

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

2024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

2024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：2024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
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	54,323	
光世証券株式会社	12,000	
株式会社スマートプラス※１	100	
楽天証券株式会社	19,495	
内藤証券株式会社	3,002	
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	135,000	
マネックス証券株式会社	12,200	
松井証券株式会社	11,945	
日本生命保険相互会社※２	1,450,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。
ニッセイアセットマネジメント株式会社※３	10,000	金融商品取引法に定める第二種金融商品取引業を営んでいます。

※１　ニッセイアセットマネジメント株式会社と協働で業務を行うにあたり、ファンドの募集の取扱いおよび契約締結行為等を行います。

※２　株式会社スマートプラスとニッセイアセットマネジメント株式会社が協働で業務を行うにあたり、ファンドの募集の取扱いを行います（契約締結行為等は行いません）。

※３　株式会社スマートプラスと協働で業務を行うにあたり、ファンドの募集を行います（契約締結行為等は行いません）。

（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

2024年3月末現在、450百万円

ｃ．事業の内容

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

２【関係業務の概要】

（１）受託会社

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

（２）販売会社

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

（３）投資助言会社（参考情報）

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

３【資本関係】

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

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

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

第３【その他】

（１）目論見書の表紙に図案や委託会社の名称およびロゴマーク、イラストを使用すること、またファンドの基本的性格および形態の一部、キャッチコピー、当該届出書に係る目論見書の使用開始日を記載することがあります。
（２）届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関連する箇所に記載することがあります。
（３）投資者へ投資信託の仕組み等を説明するため、また届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について投資者の関係法人への照会方法を明確にするため、交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。
・　ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律に基づいて組成された金融商品であり、同法では商品内容の重大な変更に際しては、事前に受益者（既にファンドをお持ちの投資者）の意向を確認する手続きが規定されています。また、ファンドの信託財産は、受託会社により保管されますが、信託法によって受託会社の固有財産との分別管理等が義務付けられています。
・　商品内容・販売会社に関するお問合せは、委託会社のコールセンターで承っております。
・　基準価額については、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊および委託会社のコールセンター・ホームページにてご確認いただけます。
なお、委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）への照会先は下記の通りです。
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）
ホームページ　　https://www.nam.co.jp/
（４）目論見書に以下の内容を記載することがあります。
投資信託説明書（請求目論見書）は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
（５）目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第１ ファンドの状況 ２ 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
（６）目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
（７）目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2024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2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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2月16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」に掲げられているニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）の2022年11月22日から2023年11月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
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・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）の2023年11月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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

2024年8月16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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）の2023年11月21日から2024年5月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）の2024年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年11月21日から2024年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

利害関係

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

以　上

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