

【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11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】	DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト
【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】

DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト

(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】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

(3)【発行(売出)価額の総額】

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11月21日から2025年5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)

(9) 【払込期日】

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

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

(1 0) 【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)

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

基本方針

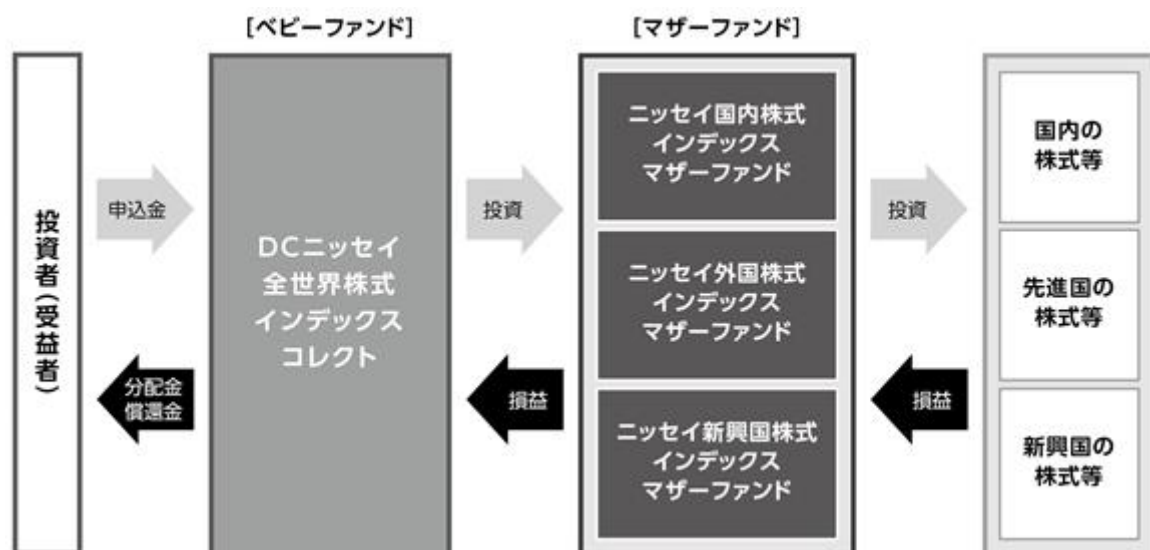
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



ファンドの特色

1 全世界の株式に分散投資を行います。

- ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ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への投資を通じて、世界の株式へ投資します。

【投資対象とするマザーファンド】

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。
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。
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。

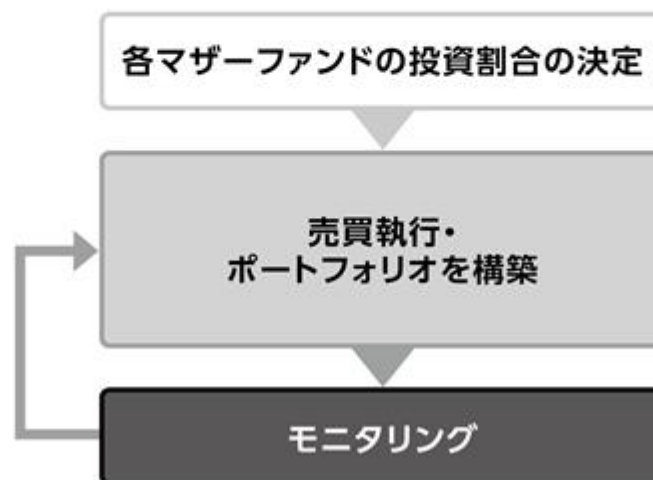
※投資対象には、DR(預託証券)もしくは株式等と同等の投資効果が得られる証券および証書等を含みます。DR(預託証券)とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し海外で発行される証券をいい、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。

- 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ*を行いません。

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

- ②国内株式、先進国株式(除く日本)、新興国株式への投資割合は、MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックスの時価総額の比率に基づき決定します。

<当ファンドの運用プロセス>



<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。

●MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス

MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックスはMSCI Inc.が公表している指数であり、先進国(含む日本)および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。

<MSCI指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

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せん。

ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 株式に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
追 加 型	海 外	債 券
	内 外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回	グローバル (日本含む)		
債券 一般	年 2 回	日 本		
公債	年 4 回	北 米	ファミリー ファンド	あ り ()
社債	年 6 回 (隔月)	欧 州		
その他債券 クレジット属性 ()	年 12 回 (毎月)	ア ジ ア		
不動産投信	日 々	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (株式(一般)))	日 々	中 南 米	ファンド・ オブ・ ファンズ	な し
資産複合 ()	その他 ()	ア フ リ カ		
資産配分固定型		中 近 東 (中東)		
資産配分変更型		エマ- ジ ン グ		

商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
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。
株式	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 （投資信託証券 （株式（一般）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本含む）	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

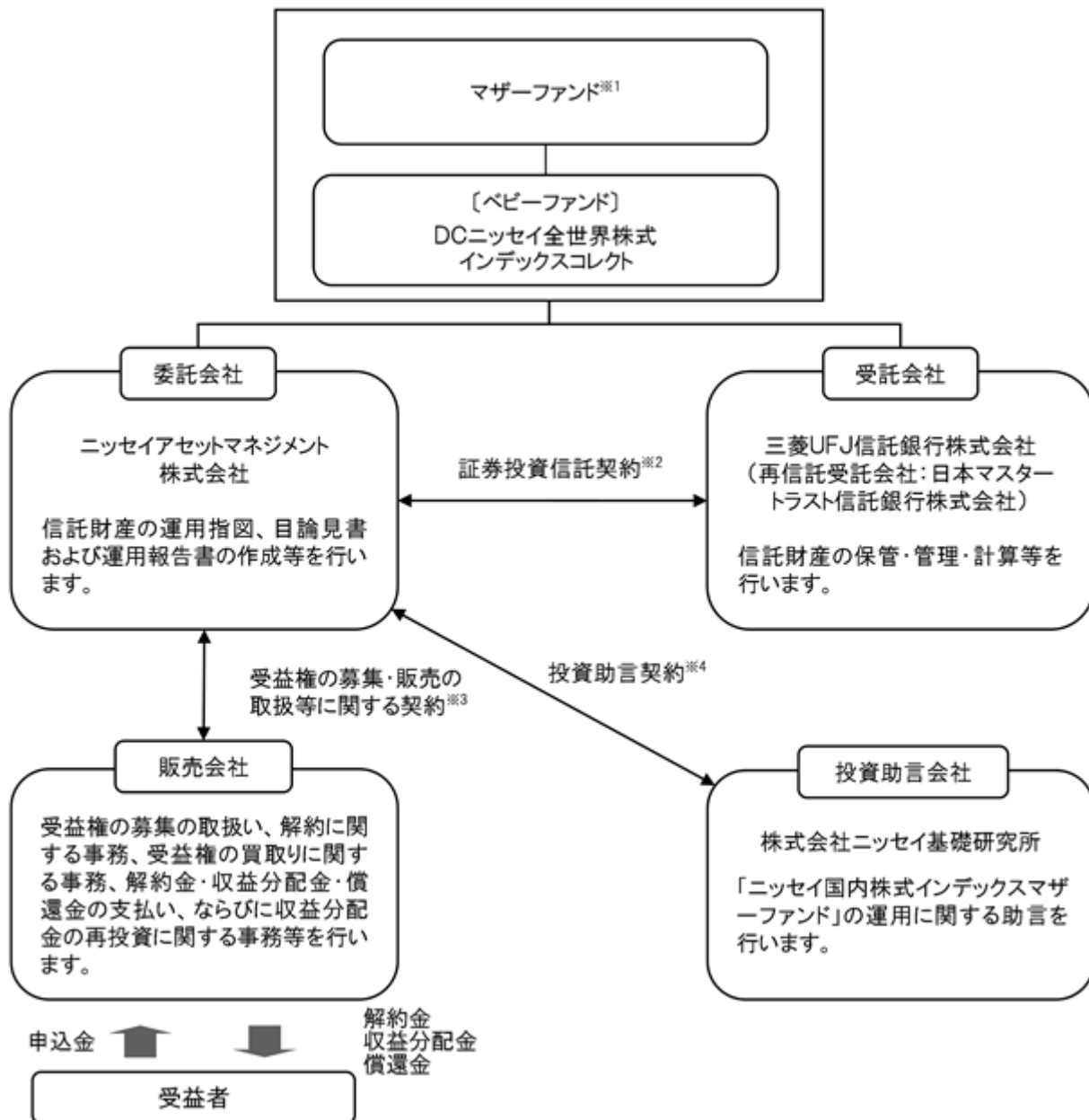
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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

（2）【ファンドの沿革】

2023年9月15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
- 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8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】

主として、複数のマザーファンドへの投資を通じて、世界全体の株式市場の動きを捉えることを目標に運用を行います。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ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

各マザーファンドはそれぞれ以下インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

マザーファンド	インデックス
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）
ニッセイ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）

各マザーファンドの基本組入比率は、MSCIの各地域の時価総額の比率に基づき決定するものとします。また、各マザーファンドの組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。

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。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(参考) マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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（預託証券）を含みます）を主要投資対象とします。

b 投資態度

主として新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、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。

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

(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、株式等（DR（預託証券）を含みます）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

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの
 なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに12.および17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品

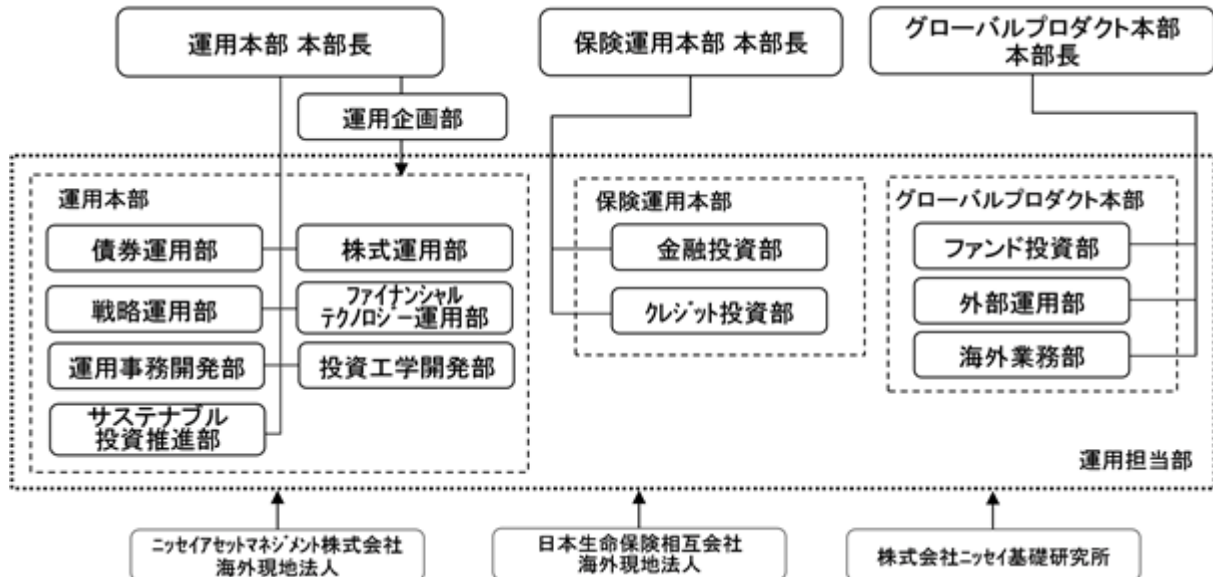
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

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

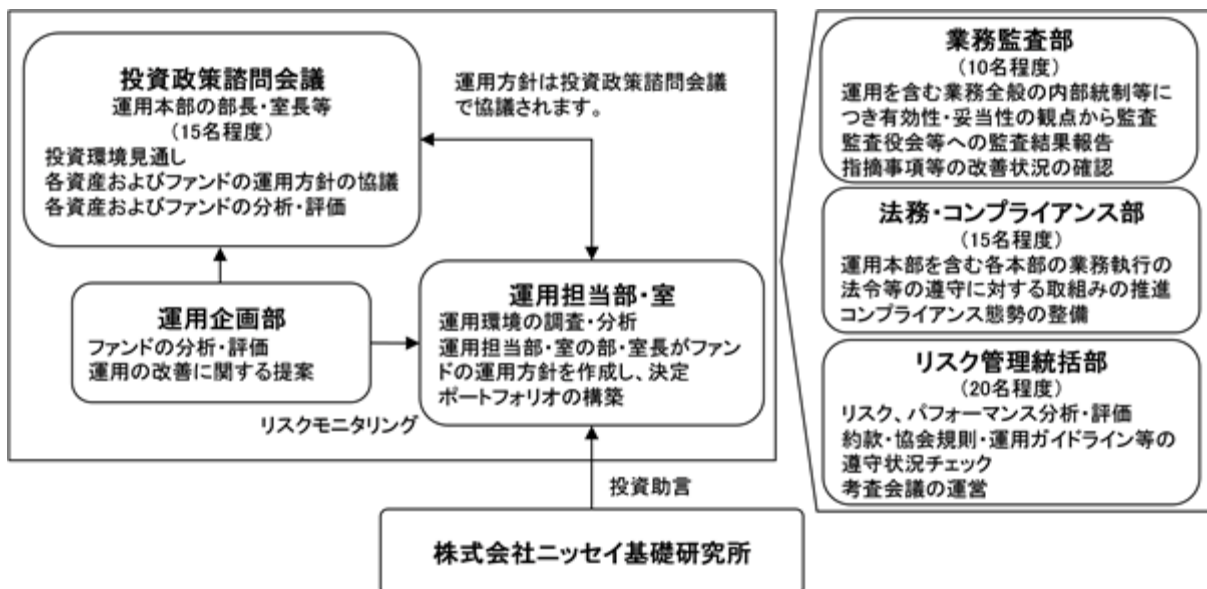
（3）【運用体制】

委託会社の組織体制



社内規程として、投資信託財産及び投資法人資産に係る運用業務規程およびポートフォリオ・マネジャー/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】

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

分配時期

毎決算日とし、決算日は2月20日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

支払方法

< 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。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

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

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

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

信用取引の範囲

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

先物取引等

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

1．金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

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

有価証券の貸付けおよび範囲

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

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

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

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

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

有価証券の空売り

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

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

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

有価証券の借入れ

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

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

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

4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

外国為替予約等

1．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

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

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

資金の借入れ

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

c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

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

3【投資リスク】

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

・流動性リスク

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

・新興国の株式投資に関する留意点

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

・ストックコネクトを通じた取引に関する留意点

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、ファンドの資産価値が減少する要因となることがあります。また、ストックコネクトでは、投資者が不利益を被る大きな制度変更が行われる可能性があります。

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

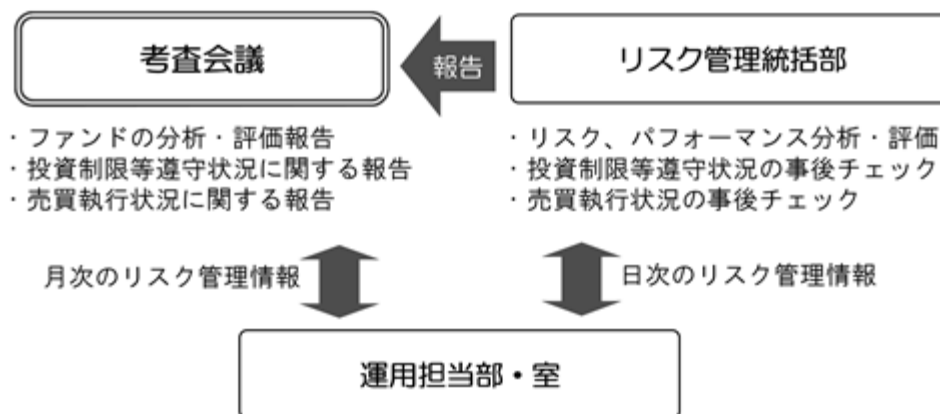
委託会社は2024年2月20日現在、ファンドを1百万円(受益権口数1百万口、ファンド全体の1.2%)保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

・流動性に関する留意点

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

これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受付けを中止する、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



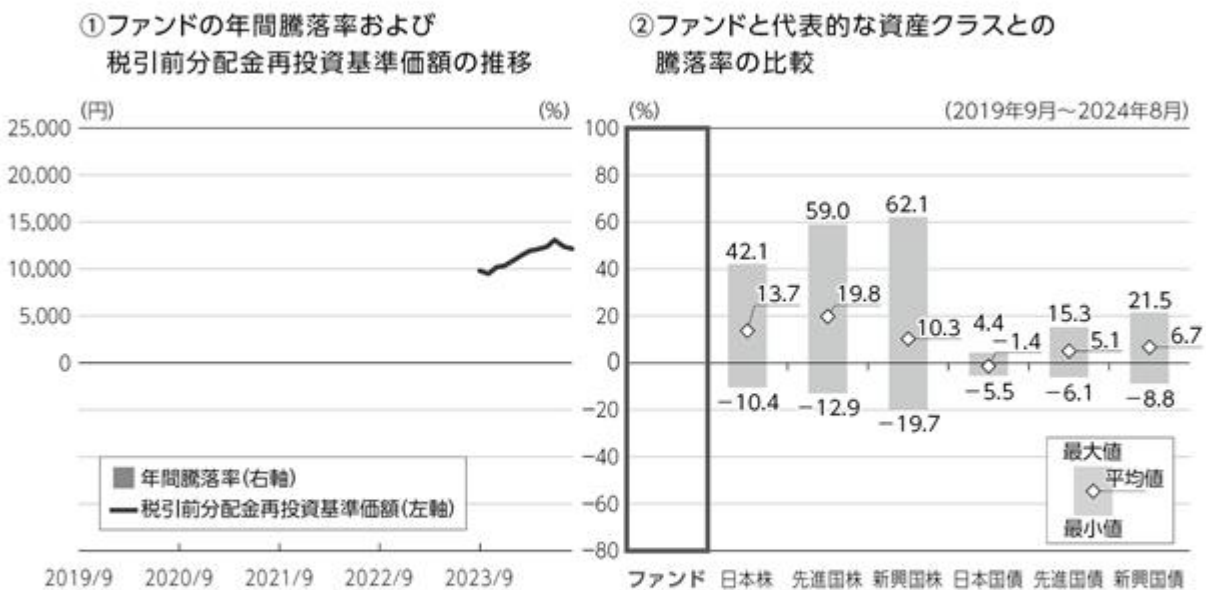
1. リスク管理統括部が、以下の通り管理を行います。
 - ・運用状況をモニタリングし、リスク、パフォーマンスの分析・評価、ファンドの投資制限等遵守状況の事後チェックを行います。また、その情報を運用担当部・室に日々連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
 - ・売買執行状況の事後チェックを行います。また、その情報を必要に応じて運用担当部・室に連絡するとともに、月次の審査会議で報告します。
2. 運用担当部・室は上記の連絡・報告を受けて、必要に応じてポートフォリオの改善を行います。

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

< 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。



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

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】

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0.1045%（税抜0.095%）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
0.0375%	0.0375%	0.0200%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.0011%（税抜0.001%）の率をかけた額とし、信託財産中から支払います。

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

上記の、およびの費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「4 手数料等及び税金」に記載している費用と税金の合計額、その上限額、計算方法についても、運用状況および保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

<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】

確定拠出年金としてファンドを取得した場合

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

確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合

課税対象

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

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

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

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

分 配 時： 分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収され申告不要制度が適用されます。

なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません）または申告分離課税を選択することもできます。

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

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

税率（個人）

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

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

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

<少額投資非課税制度について>

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

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
0.16%	0.11%	0.06%

- ・対象期間:2023年9月15日～2024年2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8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	1,062,149,971	100.00
内 日本	1,062,149,971	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,932	0.00
純資産総額	1,062,147,039	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8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	246,759,461,720	97.52
内 日本	246,759,461,720	97.52
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,276,582,490	2.48
純資産総額	253,036,044,210	100.00

その他資産の投資状況

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	6,272,805,000	2.48
内 日本	6,272,805,000	2.48

（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8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	998,932,837,569	94.93
内 アメリカ	737,324,430,691	70.07
内 イギリス	40,634,445,726	3.86
内 カナダ	33,710,469,105	3.20
内 スイス	31,588,247,984	3.00
内 フランス	28,748,459,025	2.73
内 ドイツ	23,846,105,950	2.27
内 オーストラリア	19,081,033,845	1.81
内 オランダ	17,905,800,973	1.70
内 アイルランド	11,908,546,631	1.13
内 デンマーク	10,236,668,532	0.97
内 スウェーデン	8,896,108,012	0.85
内 スペイン	7,414,047,549	0.70
内 イタリア	6,411,911,806	0.61
内 香港	4,263,307,024	0.41
内 シンガポール	2,919,180,707	0.28
内 フィンランド	2,806,460,970	0.27
内 ベルギー	2,679,292,585	0.25
内 ノルウェー	1,597,541,032	0.15
内 イスラエル	1,512,099,020	0.14
内 ジャージー	1,331,061,398	0.13
内 オランダ領キュラソー	992,989,715	0.09
内 パミュータ	865,449,252	0.08
内 オーストリア	521,951,025	0.05
内 ポルトガル	519,856,514	0.05
内 ニュージーランド	492,260,168	0.05
内 ケイマン諸島	443,063,307	0.04
内 ルクセンブルグ	282,049,023	0.03
投資証券	19,729,844,632	1.87
内 アメリカ	17,139,938,369	1.63
内 オーストラリア	1,283,068,279	0.12
内 フランス	371,314,381	0.04
内 イギリス	318,300,901	0.03
内 シンガポール	267,904,044	0.03
内 香港	190,505,410	0.02
内 カナダ	85,685,085	0.01
内 ベルギー	73,128,163	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	33,618,769,860	3.19
純資産総額	1,052,281,452,061	100.00

その他資産の投資状況

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	32,433,810,544	3.08
内 アメリカ	24,004,292,400	2.28
内 ドイツ	6,042,290,730	0.57
内 イギリス	2,387,227,414	0.23

（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8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	10,667,271,906	79.24
内 インド	2,292,531,473	17.03
内 台湾	2,144,279,025	15.93
内 韓国	1,341,355,904	9.96
内 中国	1,018,687,441	7.57
内 香港	978,128,133	7.27
内 ケイマン諸島	582,573,390	4.33
内 ブラジル	518,285,462	3.85
内 南アフリカ	359,398,714	2.67
内 メキシコ	221,846,165	1.65
内 インドネシア	204,202,031	1.52
内 アメリカ	202,524,260	1.50
内 マレーシア	176,396,003	1.31
内 タイ	174,317,824	1.29
内 ポーランド	102,973,152	0.76
内 トルコ	78,590,696	0.58
内 フィリピン	63,362,342	0.47
内 ギリシャ	56,745,947	0.42
内 チリ	46,961,667	0.35
内 ハンガリー	31,243,874	0.23
内 バミューダ	30,696,542	0.23
内 チェコ	16,140,953	0.12
内 コロンビア	12,658,245	0.09
内 オランダ	9,258,223	0.07
内 ペルー	4,112,864	0.03
内 ロシア	1,526	0.00
内 カザフスタン	27	0.00
内 イギリス	19	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	773,653,187	5.75
内 アメリカ	773,653,187	5.75
投資証券	7,392,870	0.05
内 メキシコ	7,392,870	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,013,029,106	14.95
純資産総額	13,461,347,069	100.00

その他資産の投資状況

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	2,004,008,832	14.89
内 アメリカ	2,004,008,832	14.89

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	200,526,416	4.4745 897,260,926	4.4712 896,593,711	- -	84.41
2	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	73,752,851	1.4653 108,071,633	1.4402 106,218,856	- -	10.00
3	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	18,270,593	3.2227 58,881,594	3.2477 59,337,404	- -	5.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年8月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	3,433,500	3,387.24 11,630,122,192	2,759.50 9,474,743,250	- -	3.74
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	452,300	13,300.83 6,015,968,973	14,200.00 6,422,660,000	- -	2.54
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	3,873,900	1,494.31 5,788,830,098	1,528.00 5,919,319,200	- -	2.34
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	1,567,600	2,522.03 3,953,535,108	3,572.00 5,599,467,200	- -	2.21
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	64,600	68,943.02 4,453,719,230	69,610.00 4,496,806,000	- -	1.78

6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	478,200	6,051.58 2,893,867,836	9,047.00 4,326,275,400	- -	1.71
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	445,500	8,177.58 3,643,113,230	9,550.00 4,254,525,000	- -	1.68
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,312,200	3,124.30 4,099,711,680	3,013.00 3,953,658,600	- -	1.56
9	信越化学工業 日本	株式 化学	580,200	6,128.12 3,555,539,893	6,422.00 3,726,044,400	- -	1.47
10	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	459,400	6,644.46 3,052,465,440	7,706.00 3,540,136,400	- -	1.40
11	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	136,700	34,404.18 4,703,052,184	25,805.00 3,527,543,500	- -	1.39
12	第一三共 日本	株式 医薬品	564,400	4,973.03 2,806,779,910	6,108.00 3,447,355,200	- -	1.36
13	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	621,100	4,468.87 2,775,616,352	5,506.00 3,419,776,600	- -	1.35
14	任天堂 日本	株式 その他製品	407,800	8,249.66 3,364,214,832	7,902.00 3,222,435,600	- -	1.27
15	三井物産 日本	株式 卸売業	1,023,700	3,206.14 3,282,127,830	3,123.00 3,197,015,100	- -	1.26
16	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	19,268,500	179.36 3,456,123,636	155.70 3,000,105,450	- -	1.19
17	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	319,500	8,550.11 2,731,762,540	8,405.00 2,685,397,500	- -	1.06
18	HOYA 日本	株式 精密機器	127,200	18,535.89 2,357,766,086	20,595.00 2,619,684,000	- -	1.04
19	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	858,600	2,764.42 2,373,531,150	3,009.00 2,583,527,400	- -	1.02
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	573,400	4,444.23 2,548,323,200	4,333.00 2,484,542,200	- -	0.98
21	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,530,300	1,738.50 2,660,431,466	1,588.00 2,430,116,400	- -	0.96
22	KDDI 日本	株式 情報・通信業	476,500	4,610.52 2,196,917,172	4,911.00 2,340,091,500	- -	0.92
23	三菱重工業 日本	株式 機械	1,140,800	1,187.56 1,354,775,302	1,942.50 2,216,004,000	- -	0.88
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	1,034,900	1,964.15 2,032,702,282	2,038.00 2,109,126,200	- -	0.83
25	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	38,400	41,548.87 1,595,476,720	46,650.00 1,791,360,000	- -	0.71

26	村田製作所 日本	株式 電気機器	577,000	2,959.30 1,707,520,500	3,033.00 1,750,041,000	- -	0.69
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	714,600	2,317.38 1,656,005,270	2,441.00 1,744,338,600	- -	0.69
28	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	386,400	3,931.32 1,519,064,732	4,203.00 1,624,039,200	- -	0.64
29	キヤノン 日本	株式 電気機器	322,100	4,228.50 1,362,001,376	5,017.00 1,615,975,700	- -	0.64
30	富士通 日本	株式 電気機器	600,300	2,321.75 1,393,747,685	2,677.50 1,607,303,250	- -	0.64

(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8月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	電気機器	17.11
		銀行業	7.38
		輸送用機器	7.33
		情報・通信業	7.29
		卸売業	7.13
		化学	5.55
		機械	5.21
		医薬品	4.97
		サービス業	4.65
		小売業	4.20
		食料品	3.08
		保険業	3.05
		その他製品	2.41
		精密機器	2.36
		陸運業	2.27
		建設業	2.10
		不動産業	2.00
		電気・ガス業	1.40
		その他金融業	1.18
		証券、商品先物取引業	0.85
		鉄鋼	0.84
		海運業	0.79
		非鉄金属	0.75
		ガラス・土石製品	0.65
		ゴム製品	0.58
	石油・石炭製品	0.54	
金属製品	0.49		
繊維製品	0.36		
空運業	0.36		
鉱業	0.29		
パルプ・紙	0.14		
倉庫・運輸関連業	0.14		
水産・農林業	0.08		
	小計		97.52
合計(対純資産総額比)			97.52

(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8月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハード ウェアおよび機器	1,599,949	27,579.35 44,125,554,725	33,273.59 53,236,050,246	- -	5.06
2	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,726,613	13,473.46 36,736,921,272	17,027.03 46,426,126,802	- -	4.41
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	769,874	60,848.22 46,845,470,101	59,819.77 46,053,690,228	- -	4.38
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	1,021,112	26,718.14 27,282,215,301	24,922.97 25,449,149,869	- -	2.42
5	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メデ ィア・娯 楽	238,974	68,307.35 16,323,682,387	75,038.25 17,932,192,189	- -	1.70
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メデ ィア・娯 楽	642,696	25,474.08 16,372,089,351	23,425.74 15,055,631,965	- -	1.43
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メデ ィア・娯 楽	556,668	25,655.88 14,281,812,500	23,660.31 13,170,943,013	- -	1.25
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	88,142	111,626.95 9,839,022,780	136,140.95 11,999,736,496	- -	1.14
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	480,153	20,215.34 9,706,460,555	22,723.46 10,910,739,409	- -	1.04
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	313,230	29,683.04 9,297,620,730	32,176.00 10,078,490,985	- -	0.96
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	142,973	60,440.12 8,641,306,603	67,819.97 9,696,425,428	- -	0.92

12	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部 品	312,619	25,827.78 8,074,257,026	29,869.34 9,337,724,451	- -	0.89
13	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ サービス	100,563	76,093.12 7,652,152,844	85,659.33 8,614,159,806	- -	0.82
14	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネル ギー	489,247	17,319.62 8,473,573,622	17,105.22 8,368,679,526	- -	0.80
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	355,913	19,431.37 6,915,880,670	19,836.52 7,060,076,054	- -	0.67
16	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サー ビス	172,496	40,500.80 6,986,226,967	39,721.53 6,851,806,073	- -	0.65
17	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 金融サー ビス	90,870	66,603.30 6,052,242,215	69,619.83 6,326,354,860	- -	0.60
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用 品・パー ソナル用 品	256,643	24,254.01 6,224,623,994	24,620.34 6,318,638,945	- -	0.60
19	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	262,829	22,400.30 5,887,448,453	23,780.50 6,250,206,085	- -	0.59
20	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	48,369	115,290.63 5,576,492,655	128,384.02 6,209,806,856	- -	0.59
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	43,579	136,703.67 5,957,409,261	132,042.11 5,754,263,547	- -	0.55
22	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	108,088	49,892.14 5,392,742,220	53,150.28 5,744,908,329	- -	0.55

23	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	193,127	24,148.06 4,663,643,829	28,262.06 5,458,167,634	- -	0.52
24	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	483,354	9,375.44 4,531,661,230	11,065.61 5,348,609,756	- -	0.51
25	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	47,222	89,939.57 4,247,126,730	100,271.10 4,735,002,073	- -	0.45
26	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	276,236	18,943.70 5,232,932,517	17,008.20 4,698,279,345	- -	0.45
27	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲 料・タバ コ	446,740	9,140.11 4,083,255,380	10,432.83 4,660,766,941	- -	0.44
28	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲 料・タバ コ	291,192	16,477.93 4,798,243,780	15,563.52 4,531,973,680	- -	0.43
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	774,502	5,695.52 4,411,191,884	5,816.61 4,504,980,725	- -	0.43
30	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	169,074	23,101.88 3,905,927,779	25,313.51 4,279,857,742	- -	0.41

(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8月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	ソフトウェア・サービス	9.31
		半導体・半導体製造装置	8.64
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.03
		資本財	6.73
		金融サービス	6.57
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.50
		メディア・娯楽	6.04
		銀行	5.49
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.48
		エネルギー	4.21
		ヘルスケア機器・サービス	4.10
		素材	3.54
		食品・飲料・タバコ	3.12
		保険	3.05
		公益事業	2.60
		消費者サービス	1.80
		生活必需品流通・小売り	1.75
		商業・専門サービス	1.58
		家庭用品・パーソナル用品	1.56
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.51
耐久消費財・アパレル	1.28		
電気通信サービス	1.11		
不動産管理・開発	0.28		
その他	0.06		
エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.03		
	小計		94.93
投資証券	外国		1.87
	小計		1.87
合 計 (対純資産総額比)			96.81

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	257,000	2,750.15 706,789,329	4,274.71 1,098,601,318	- -	8.16
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア ア・娯楽	69,200	5,889.09 407,525,579	7,012.03 485,232,614	- -	3.60
3	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	74,649	5,801.07 433,044,514	6,132.27 457,768,569	- -	3.40
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	49,772	7,892.30 392,815,690	8,036.39 399,987,700	- -	2.97
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	163,900	1,360.53 222,992,107	1,467.95 240,598,398	- -	1.79
6	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネル ギー	32,104	4,244.28 136,258,503	5,292.81 169,920,661	- -	1.26
7	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	63,122	2,164.75 136,643,754	2,148.83 135,638,573	- -	1.01
8	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフト ウェア・ サービス	35,185	2,531.14 89,058,193	3,364.02 118,363,360	- -	0.88
9	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	54,909	1,649.04 90,547,294	2,126.10 116,742,354	- -	0.87
10	MEITUAN-B 香港	株式 消費者 サービス	53,960	1,916.62 103,420,918	2,148.54 115,935,704	- -	0.86

11	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	131,200	481.12 63,123,145	836.35 109,730,031	- -	0.82
12	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	1,025,000	86.11 88,265,954	104.54 107,162,827	- -	0.80
13	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	5,771	14,837.47 85,627,081	18,429.41 106,356,182	- -	0.79
14	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	35,767	2,555.47 91,401,537	2,548.47 91,151,484	- -	0.68
15	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	16,000	4,282.11 68,513,790	5,666.37 90,662,000	- -	0.67
16	ISHARES MSCI KUWAIT ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	18,779	4,404.76 82,717,159	4,744.37 89,094,561	- -	0.66
17	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	29,941	2,614.74 78,288,185	2,851.07 85,364,096	- -	0.63
18	PDD HOLDINGS INC(ADR) アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	6,241	17,554.81 109,559,624	13,527.21 84,423,355	- -	0.63
19	TATA CONSULTANCY SVCS LTD インド	株式 ソフト ウェア・ サービス	9,633	6,194.94 59,675,908	7,850.53 75,624,174	- -	0.56
20	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 電気通信 サービス	24,097	1,735.49 41,820,182	2,724.66 65,656,276	- -	0.49
21	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	630,400	85.98 54,205,706	96.11 60,590,896	- -	0.45
22	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 テクノロジー・ ハード ウェアおよび機器	9,139	6,334.30 57,889,249	6,526.85 59,648,973	- -	0.44
23	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	693,000	71.09 49,269,070	85.79 59,454,826	- -	0.44

24	VALE SA ブラジル	株式 素材	36,854	1,868.94 68,878,199	1,524.74 56,192,964	- -	0.42
25	BANK OF CHINA LTD - H 中国	株式 銀行	849,000	55.02 46,719,117	65.73 55,811,392	- -	0.41
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	291.28 45,498,451	350.60 54,763,969	- -	0.41
27	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	27,415.95 49,540,631	29,287.51 52,922,537	- -	0.39
28	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	54,550	792.54 43,233,313	950.33 51,840,518	- -	0.39
29	AXIS BANK LTD インド	株式 銀行	24,415	1,784.80 43,576,039	2,045.19 49,933,460	- -	0.37
30	NETEASE INC 香港	株式 メディア・娯楽	21,100	3,256.08 68,703,497	2,356.53 49,722,846	- -	0.37

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年8月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	銀行	11.93
		半導体・半導体製造装置	10.91
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.51
		素材	5.13
		メディア・娯楽	5.12
		エネルギー	4.00
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.97
		資本財	3.88
		自動車・自動車部品	3.23
		公益事業	2.46
		金融サービス	2.42
		食品・飲料・タバコ	2.41
		保険	2.38
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.22
		ソフトウェア・サービス	2.19
		消費者サービス	2.06
		電気通信サービス	1.83
		運輸	1.45
		生活必需品流通・小売り	1.06
		耐久消費財・アパレル	0.88
不動産管理・開発	0.80		
家庭用品・パーソナル用品	0.69		
ヘルスケア機器・サービス	0.65		
商業・専門サービス	0.05		
	小計		79.24
投資信託受益証券	外国		5.75
	小計		5.75
投資証券	外国		0.05
	小計		0.05
合計（対純資産総額比）			85.05

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

【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。

【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8月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物 0609月	買建	231	6,146,972,050	6,272,805,000	2.48

(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8月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P 500 EMINI FUTURE 202409	買建	591	23,649,658,376	24,004,292,400	2.28
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 202409	買建	757	5,926,271,592	6,042,290,730	0.57
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE 202409	買建	149	2,345,819,197	2,387,227,414	0.23

(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8月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	NYSE LIFFEUS	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202409	買建	252	1,988,638,167	2,004,008,832	14.89

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2024年8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 (2024年2月20日)	95,473,855	95,473,855	1.1326	1.1326
2023年9月末日	981,603	-	0.9816	-
10月末日	949,733	-	0.9497	-
11月末日	4,409,095	-	1.0201	-
12月末日	5,674,581	-	1.0356	-
2024年1月末日	11,226,720	-	1.0930	-
2月末日	121,688,424	-	1.1470	-
3月末日	262,074,609	-	1.1934	-
4月末日	373,537,132	-	1.2119	-
5月末日	511,362,814	-	1.2376	-
6月末日	654,350,981	-	1.3088	-
7月末日	794,714,216	-	1.2391	-
8月末日	1,062,147,039	-	1.2157	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
2024年2月21日～2024年8月20日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.3
2024年2月21日～2024年8月20日	8.2

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

(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	89,499,860	5,204,039	84,295,821
2024年2月21日～ 2024年8月20日	756,600,017	103,198,383	737,697,455

(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8月末現在

●基準価額・純資産の推移



基準価額	12,157円
純資産総額	10億円

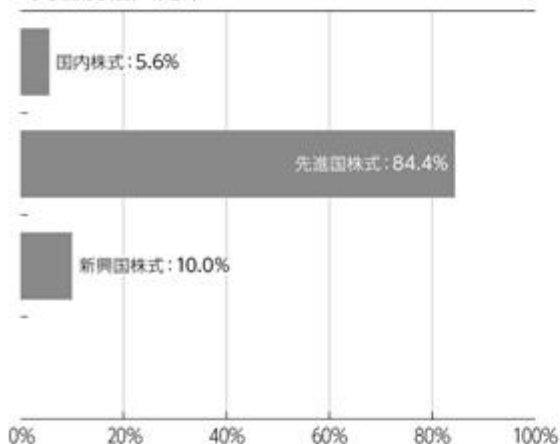
●分配の推移 1万口当り(税引前)

2024年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

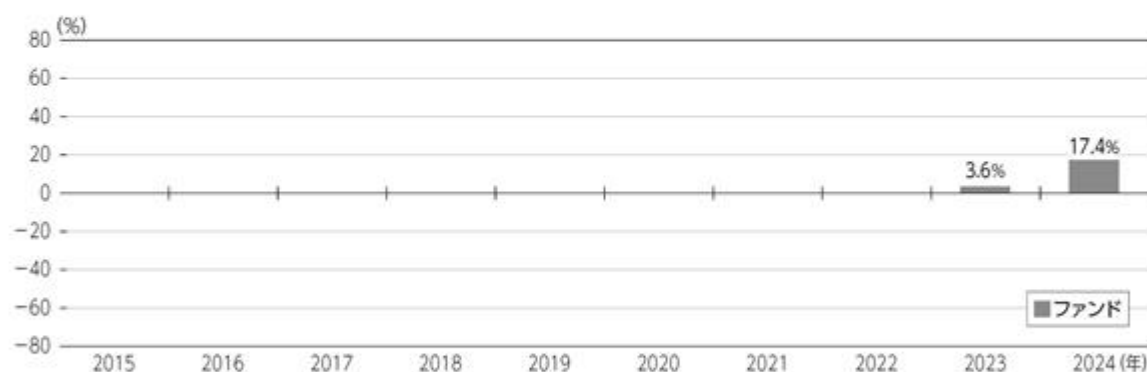
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

●資産別組入比率



・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



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2023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。

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

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

3.運用実績

2024年8月末現在

●マザーファンドの状況

1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.8%
2	ソニーグループ	2.6%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.4%
4	日立製作所	2.3%
5	キーエンス	1.8%

・比率は対組入株式評価額比です。

2.ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	5.2%
2	エヌビディア	情報技術	4.6%
3	マイクロソフト	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	2.5%
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	1.8%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

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	9.6%
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	4.2%
3	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	4.0%
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	2.1%

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&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。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.5%
2	銀行業	7.6%
3	輸送用機器	7.5%
4	情報・通信業	7.5%
5	卸売業	7.3%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	75.9%
2	イギリス	4.0%
3	カナダ	3.2%
4	フランス	3.1%
5	スイス	2.7%

・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。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	中国	24.2%
2	インド	20.0%
3	台湾	18.9%
4	韓国	11.7%
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。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

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

原則として午後3時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します。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ので、詳しくは販売会社にご確認ください。

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。

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。

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

2【換金（解約）手続等】

換金受付

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

原則として午後3時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します。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ので、詳しくは販売会社にご確認ください。

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。

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

< 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

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

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

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

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

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

(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2月21日から翌年2月20日までとします。

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

(5)【その他】

繰上償還

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

・受益権の口数が30億口または純資産総額が30億円を下回っている場合

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

4. 前記2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
 5. 前記2. から4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記2. から4. までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。
 6. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
 7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「 約款の変更等 2. 」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
 8. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記「 約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
 9. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目(償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目)までにお支払いします。
- 約款の変更等
1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「 約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
 2. 委託会社は、前記1. の事項(前記1. の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
 3. 前記2. の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3. において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。
 4. 前記2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
 5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
 6. 前記2. から5. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
 7. 前記1. から6. までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
 8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記1. から7. までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2023年9月15日から2024年2月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1 【財務諸表】

【DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2024年2月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託		17
コール・ローン		1,780
親投資信託受益証券		95,474,135
未収入金		3,367,956
流動資産合計		98,843,888
資産合計		98,843,888
負債の部		
流動負債		
未払解約金		3,366,060
未払受託者報酬		733
未払委託者報酬		2,917
その他未払費用		323
流動負債合計		3,370,033
負債合計		3,370,033
純資産の部		
元本等		
元本		84,295,821
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,178,034
（分配準備積立金）		1,940,365
元本等合計		95,473,855
純資産合計		95,473,855
負債純資産合計		98,843,888

（ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2023年9月15日 至 2024年2月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	2,067,128
営業収益合計	2,067,128
営業費用	
受託者報酬	733
委託者報酬	2,917
その他費用	323
営業費用合計	3,973
営業利益又は営業損失（ ）	2,063,155
経常利益又は経常損失（ ）	2,063,155
当期純利益又は当期純損失（ ）	2,063,155
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（ ）	122,790
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,611,232
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	9,611,232
剰余金減少額又は欠損金増加額	373,563
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	373,563
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,178,034

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期
	自 2023年9月15日 至 2024年2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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	2024年2月20日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	88,499,860円
期中一部解約元本額	5,204,039円
2. 受益権の総数	84,295,821口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2023年9月15日 至 2024年2月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,940,365円）、収益調整金（9,237,669円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は11,178,034円（1万口当たり1,326.05円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期
	自 2023年9月15日 至 2024年2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。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期
	2024年2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	第1期
	2024年2月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,957,563
合計	1,957,563

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期
	2024年2月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1326円 (11,326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

2024年2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	1,691,941	5,268,535	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	19,431,874	80,572,322	
	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	7,058,898	9,633,278	
親投資信託受益証券	合計	28,182,713	95,474,135	
合計			95,474,135	

(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」受益証券及び「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2024年2月20日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	27,403,413
コール・ローン	2,799,118,521
株式	221,415,671,790
派生商品評価勘定	160,569,900
未収配当金	313,885,151
差入委託証拠金	107,093,834
流動資産合計	224,823,742,609
資産合計	224,823,742,609
負債の部	
流動負債	
前受金	165,945,000
未払解約金	655,205,252
その他未払費用	2,709
流動負債合計	821,152,961
負債合計	821,152,961
純資産の部	
元本等	
元本	71,936,737,810
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	152,065,851,838
元本等合計	224,002,589,648
純資産合計	224,002,589,648
負債純資産合計	224,823,742,609

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9月15日 至 2024年2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2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	71,047,038,768円
同期中追加設定元本額	9,112,747,375円
同期中一部解約元本額	8,223,048,333円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,323,486,715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)	3,051,320,322円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,075,264円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,981,344,929円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,282,848,201円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	6,199,571,181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)	2,308,680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)	3,096,064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)	9,707,823円
DCニッセイ国内株式インデックス	3,111,356,570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	24,329,146,106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)	3,680,342,973円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	383,217,945円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	223,827,805円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	437,206,012円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	600,148,942円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	32,113,164円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	118,398,630円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	10,306,061円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	13,314,440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)	4,770,388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)	9,699,744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)	26,586,216円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	309,317,472円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	197,083,804円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	372,094,171円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	169,589,950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)	13,880,206,106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)	25,302,789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)	34,366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)	75,807円
FWニッセイ国内株インデックス	68,973,915円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	75,173,314円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	1,691,941円
計	71,936,737,810円
2. 受益権の総数	71,936,737,810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 2023年9月15日 至 2024年2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	2024年2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	2024年2月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	51,477,666,919	
合計	51,477,666,919	

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月21日から2024年2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	2024年2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	2,004,185,000	-	2,164,800,000	160,615,000
合計	2,004,185,000	-	2,164,800,000	160,615,000

（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）

	2024年2月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1139円 (31,139円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年2月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,100	3,560.00	11,036,000	
ニッセイ	83,100	929.30	77,224,830	
マルハニチロ	12,300	2,900.00	35,670,000	
雪国まいたけ	7,100	960.00	6,816,000	
カネコ種苗	2,800	1,457.00	4,079,600	
サカタのタネ	9,500	3,740.00	35,530,000	
ホクト	6,700	1,848.00	12,381,600	
ショーボンドホールディングス	11,300	6,189.00	69,935,700	
ミライト・ワン	27,500	1,760.50	48,413,750	

タマホーム	5,200	3,970.00	20,644,000
ファーストコーポレーション	1,300	790.00	1,027,000
住石ホールディングス	9,400	2,129.00	20,012,600
日鉄鉱業	3,300	5,160.00	17,028,000
三井松島ホールディングス	5,000	3,010.00	15,050,000
I N P E X	307,400	2,019.00	620,640,600
石油資源開発	9,600	6,110.00	58,656,000
K & O エナジーグループ	3,800	2,463.00	9,359,400
安藤・間	48,200	1,229.00	59,237,800
東急建設	26,000	810.00	21,060,000
コムシスホールディングス	26,500	3,321.00	88,006,500
ビーアールホールディングス	17,100	377.00	6,446,700
高松コンストラクショングループ	6,200	2,716.00	16,839,200
東建コーポレーション	2,100	9,590.00	20,139,000
ソネック	1,500	925.00	1,387,500
ヤマウラ	4,200	1,500.00	6,300,000
オリエンタル白石	30,800	384.00	11,827,200
大成建設	54,400	4,796.00	260,902,400
大林組	208,000	1,418.50	295,048,000
清水建設	164,900	893.40	147,321,660
飛鳥建設	6,000	1,470.00	8,820,000
長谷工コーポレーション	53,300	1,878.00	100,097,400
松井建設	7,600	875.00	6,650,000
鹿島建設	128,900	2,788.50	359,437,650
不動テトラ	4,000	2,211.00	8,844,000
鉄建建設	4,200	2,471.00	10,378,200
西松建設	11,100	4,570.00	50,727,000
三井住友建設	43,300	429.00	18,575,700
大豊建設	2,000	3,200.00	6,400,000
佐田建設	2,100	717.00	1,505,700
ナカノフドー建設	100	645.00	64,500
奥村組	9,400	5,050.00	47,470,000
東鉄工業	7,200	3,040.00	21,888,000
浅沼組	4,300	4,165.00	17,909,500
戸田建設	78,700	960.30	75,575,610
熊谷組	9,600	3,845.00	36,912,000
植木組	900	1,817.00	1,635,300
矢作建設工業	7,900	1,598.00	12,624,200
ピーエス三菱	7,400	1,052.00	7,784,800
日本ハウスホールディングス	21,000	307.00	6,447,000
大東建託	21,400	17,175.00	367,545,000
新日本建設	8,200	1,242.00	10,184,400
東亜道路工業	2,300	6,460.00	14,858,000
日本道路	6,800	2,022.00	13,749,600
東亜建設工業	4,500	4,655.00	20,947,500
日本国土開発	16,500	522.00	8,613,000
若築建設	2,100	3,140.00	6,594,000
東洋建設	14,600	1,316.00	19,213,600
五洋建設	82,400	762.10	62,797,040
世紀東急工業	7,500	1,936.00	14,520,000

福田組	2,200	5,330.00	11,726,000
住友林業	50,300	4,083.00	205,374,900
日本基礎技術	8,100	452.00	3,661,200
巴コーポレーション	6,000	660.00	3,960,000
大和ハウス工業	160,800	4,342.00	698,193,600
ライト工業	12,000	1,883.00	22,596,000
積水ハウス	176,400	3,290.00	580,356,000
日特建設	5,600	1,161.00	6,501,600
北陸電気工事	5,500	1,248.00	6,864,000
ユアテック	12,800	1,263.00	16,166,400
日本リーテック	5,100	1,260.00	6,426,000
四電工	2,400	3,995.00	9,588,000
中電工	9,000	2,957.00	26,613,000
関電工	36,400	1,566.00	57,002,400
きんでん	40,900	2,620.00	107,158,000
東京エネシス	6,200	1,156.00	7,167,200
トーエネック	1,900	5,380.00	10,222,000
住友電設	5,500	3,105.00	17,077,500
日本電設工業	10,900	2,090.00	22,781,000
エクシオグループ	28,400	3,124.00	88,721,600
新日本空調	3,800	2,851.00	10,833,800
九電工	12,600	5,559.00	70,043,400
三機工業	12,600	1,931.00	24,330,600
日揮ホールディングス	57,500	1,398.50	80,413,750
中外炉工業	2,400	2,826.00	6,782,400
ヤマト	2,100	981.00	2,060,100
太平電業	3,600	4,290.00	15,444,000
高砂熱学工業	15,600	4,370.00	68,172,000
NEC ネットエスアイ	23,200	2,400.00	55,680,000
朝日工業社	2,700	3,050.00	8,235,000
明星工業	11,300	1,227.00	13,865,100
大気社	6,700	4,840.00	32,428,000
ダイダン	7,600	1,816.00	13,801,600
日比谷総合設備	4,200	2,563.00	10,764,600
ニッポン	17,500	2,375.00	41,562,500
日清製粉グループ本社	54,000	2,124.00	114,696,000
日東富士製粉	1,200	5,300.00	6,360,000
昭和産業	5,700	3,420.00	19,494,000
中部飼料	8,100	1,261.00	10,214,100
フィード・ワン	8,500	1,042.00	8,857,000
日本甜菜製糖	3,400	2,122.00	7,214,800
DM三井製糖ホールディングス	5,800	3,245.00	18,821,000
ウェルネオシュガー	2,900	2,257.00	6,545,300
L I F U L L	32,200	167.00	5,377,400
M I X I	13,100	2,411.00	31,584,100
ジェイエイシーリクルートメント	22,000	753.00	16,566,000
日本M&Aセンターホールディングス	97,100	1,045.50	101,518,050
メンバーズ	6,400	939.00	6,009,600
UTグループ	7,900	3,380.00	26,702,000
アイティメディア	6,000	1,966.00	11,796,000

ケアネット	9,400	685.00	6,439,000
E・Jホールディングス	3,600	1,682.00	6,055,200
オープンアップグループ	18,300	2,197.00	40,205,100
コシダカホールディングス	18,200	911.00	16,580,200
パソナグループ	7,400	2,742.00	20,290,800
リンクアンドモチベーション	17,500	612.00	10,710,000
エス・エム・エス	21,400	2,575.00	55,105,000
パーソルホールディングス	620,400	221.80	137,604,720
クックパッド	53,600	131.00	7,021,600
森永製菓	25,000	2,701.00	67,525,000
中村屋	2,000	3,135.00	6,270,000
江崎グリコ	16,700	4,668.00	77,955,600
名糖産業	3,700	1,845.00	6,826,500
井村屋グループ	3,500	2,463.00	8,620,500
不二家	4,000	2,510.00	10,040,000
山崎製パン	39,100	3,821.00	149,401,100
モロゾフ	1,900	4,145.00	7,875,500
亀田製菓	3,300	4,400.00	14,520,000
寿スピリッツ	27,600	1,952.50	53,889,000
カルビー	26,700	3,149.00	84,078,300
森永乳業	20,400	3,182.00	64,912,800
六甲バター	4,700	1,382.00	6,495,400
ヤクルト本社	83,400	3,164.00	263,877,600
明治ホールディングス	71,600	3,418.00	244,728,800
雪印メグミルク	14,100	2,259.00	31,851,900
プリマハム	7,800	2,298.00	17,924,400
日本ハム	25,100	5,258.00	131,975,800
林兼産業	1,900	567.00	1,077,300
丸大食品	5,900	1,664.00	9,817,600
S Foods	6,400	3,195.00	20,448,000
柿安本店	2,500	2,631.00	6,577,500
伊藤ハム米久ホールディングス	8,900	4,200.00	37,380,000
学情	3,600	1,858.00	6,688,800
スタジオアリス	3,000	2,060.00	6,180,000
クロスキャット	5,400	1,210.00	6,534,000
システナ	90,000	285.00	25,650,000
N J S	2,300	2,717.00	6,249,100
デジタルアーツ	3,800	4,710.00	17,898,000
日鉄ソリューションズ	10,100	4,970.00	50,197,000
総合警備保障	101,800	812.40	82,702,320
キューブシステム	5,600	1,119.00	6,266,400
いちご	67,200	405.00	27,216,000
日本駐車場開発	61,800	181.00	11,185,800
コア	3,500	1,839.00	6,436,500
カカクコム	40,300	1,739.50	70,101,850
セントケア・ホールディング	6,600	933.00	6,157,800
ルネサンス	6,900	1,092.00	7,534,800
ディップ	9,300	2,700.00	25,110,000
S B Sホールディングス	5,300	2,407.00	12,757,100
新日本科学	5,500	1,641.00	9,025,500

ベネフィット・ワン	21,200	2,169.00	45,982,800	
エムスリー	120,400	2,100.00	252,840,000	
アウトソーシング	39,100	1,732.50	67,740,750	
ワールドホールディングス	2,700	2,500.00	6,750,000	
ディー・エヌ・エー	21,700	1,257.50	27,287,750	
博報堂DYホールディングス	77,700	1,445.00	112,276,500	
ぐるなび	23,500	303.00	7,120,500	
ファンコミュニケーションズ	15,900	406.00	6,455,400	
ライク	4,200	1,567.00	6,581,400	
エスプール	20,500	315.00	6,457,500	
WDBホールディングス	3,100	2,317.00	7,182,700	
アドウェイズ	12,400	467.00	5,790,800	
バリューコマース	5,300	1,161.00	6,153,300	
インフォマート	63,300	392.00	24,813,600	
サッポロホールディングス	19,200	6,729.00	129,196,800	
アサヒグループホールディングス	134,900	5,325.00	718,342,500	
キリンホールディングス	243,200	2,150.50	523,001,600	
宝ホールディングス	39,800	1,193.00	47,481,400	
オエノンホールディングス	17,400	349.00	6,072,600	
養命酒製造	3,400	1,868.00	6,351,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	45,700	1,949.50	89,092,150	
サントリー食品インターナショナル	41,100	4,822.00	198,184,200	
ダイドーグループホールディングス	6,600	3,045.00	20,097,000	
伊藤園	19,800	4,226.00	83,674,800	
キーコーヒー	6,500	2,052.00	13,338,000	
日清オイリオグループ	8,200	5,000.00	41,000,000	
不二製油グループ本社	13,600	2,382.50	32,402,000	
J-オイルミルズ	6,700	1,936.00	12,971,200	
ローソン	13,300	10,255.00	136,391,500	
サンエー	4,800	4,545.00	21,816,000	
カワチ薬品	4,900	2,744.00	13,445,600	
エービーシー・マート	27,400	2,531.50	69,363,100	
ハードオフコーポレーション	3,400	1,766.00	6,004,400	
高千穂交易	2,000	3,930.00	7,860,000	
アスクル	15,100	2,049.00	30,939,900	
ゲオホールディングス	7,000	2,025.00	14,175,000	
アダストリア	7,600	3,485.00	26,486,000	
伊藤忠食品	1,400	7,710.00	10,794,000	
くら寿司	7,300	4,035.00	29,455,500	
キャンドゥ	2,400	2,723.00	6,535,200	
エレマテック	5,600	1,799.00	10,074,400	
パルグループホールディングス	12,300	2,224.00	27,355,200	
エディオン	24,800	1,497.00	37,125,600	
あらた	9,600	3,170.00	30,432,000	
サーラコーポレーション	13,200	813.00	10,731,600	
トーメンデバイス	1,200	5,110.00	6,132,000	
ハローズ	2,800	4,290.00	12,012,000	
J Pホールディングス	15,600	475.00	7,410,000	
フジオフードグループ本社	7,000	1,365.00	9,555,000	

あみやき亭	1,500	4,345.00	6,517,500	
東京エレクトロニクス デバイス	6,300	6,770.00	42,651,000	
円谷フィールズホールディングス	10,800	1,598.00	17,258,400	
双日	69,800	3,773.00	263,355,400	
アルフレッサ ホールディングス	63,000	2,319.00	146,097,000	
大黒天物産	1,900	8,670.00	16,473,000	
ハニーズホールディングス	5,600	1,612.00	9,027,200	
キッコーマン	38,700	9,261.00	358,400,700	
味の素	138,700	5,788.00	802,795,600	
ブルドックソース	3,100	2,130.00	6,603,000	
キュービー	31,400	2,723.50	85,517,900	
ハウス食品グループ本社	20,100	3,140.00	63,114,000	
カゴメ	25,100	3,582.00	89,908,200	
アリアケジャパン	5,800	5,420.00	31,436,000	
エバラ食品工業	2,200	2,914.00	6,410,800	
ニチレイ	26,800	3,802.00	101,893,600	
横浜冷凍	17,100	1,065.00	18,211,500	
東洋水産	29,500	8,419.00	248,360,500	
イトアンドホールディングス	3,000	2,137.00	6,411,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,400	1,224.00	7,833,600	
日清食品ホールディングス	61,600	4,474.00	275,598,400	
永谷園ホールディングス	2,900	2,227.00	6,458,300	
フジッコ	6,000	1,943.00	11,658,000	
ロック・フィールド	7,100	1,668.00	11,842,800	
日本たばこ産業	354,700	3,905.00	1,385,103,500	
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,100.00	8,400,000	
わらべや日洋ホールディングス	3,900	2,835.00	11,056,500	
なとり	3,700	2,169.00	8,025,300	
ファーマフーズ	8,400	990.00	8,316,000	
北の達人コーポレーション	26,500	227.00	6,015,500	
ユージェナ	36,300	631.00	22,905,300	
紀文食品	5,300	1,172.00	6,211,600	
ピククルスホールディングス	5,100	1,264.00	6,446,400	
S R Eホールディングス	2,500	3,460.00	8,650,000	
A Dワークスグループ	20,100	237.00	4,763,700	
片倉工業	5,500	1,826.00	10,043,000	
グンゼ	4,200	5,580.00	23,436,000	
ヒューリック	136,200	1,515.50	206,411,100	
アルペン	5,200	1,995.00	10,374,000	
ラクーンホールディングス	9,200	696.00	6,403,200	
クオールホールディングス	8,600	1,646.00	14,155,600	
アルコニックス	8,300	1,388.00	11,520,400	
神戸物産	48,500	3,763.00	182,505,500	
ソリトンシステムズ	4,600	1,390.00	6,394,000	
ジンズホールディングス	3,700	3,820.00	14,134,000	
ピックカメラ	33,400	1,300.00	43,420,000	
D C Mホールディングス	33,100	1,399.00	46,306,900	
ハイパー	4,500	308.00	1,386,000	
Monotaro	88,900	1,540.00	136,906,000	
東京一番フーズ	8,200	523.00	4,288,600	

あい ホールディングス	10,000	2,445.00	24,450,000	
ディービーエックス	4,000	1,083.00	4,332,000	
J.フロント リテイリング	72,000	1,562.00	112,464,000	
ドトール・日レスホールディングス	11,100	2,082.00	23,110,200	
マツキヨココカラ&カンパニー	114,100	2,676.50	305,388,650	
ブロンコビリー	3,700	3,275.00	12,117,500	
ZOZO	40,000	3,426.00	137,040,000	
トレジャー・ファクトリー	4,800	1,491.00	7,156,800	
物語コーポレーション	10,500	4,590.00	48,195,000	
三越伊勢丹ホールディングス	105,600	2,139.50	225,931,200	
東洋紡	25,700	1,087.00	27,935,900	
富士紡ホールディングス	2,600	4,475.00	11,635,000	
日清紡ホールディングス	45,000	1,248.50	56,182,500	
倉敷紡績	4,200	3,135.00	13,167,000	
ダイワボウホールディングス	27,800	2,674.00	74,337,200	
日東紡績	7,500	5,400.00	40,500,000	
トヨタ紡織	25,000	2,428.00	60,700,000	
マクニカホールディングス	14,800	8,160.00	120,768,000	
Hamee	5,700	1,095.00	6,241,500	
ラクト・ジャパン	2,800	2,223.00	6,224,400	
ウエルシアホールディングス	32,500	2,647.50	86,043,750	
クリエイトSDホールディングス	8,900	3,185.00	28,346,500	
グリムス	3,000	1,931.00	5,793,000	
パイタルケーエスケー・ホールディングス	9,500	1,298.00	12,331,000	
八洲電機	5,100	1,334.00	6,803,400	
メディアスホールディングス	8,300	742.00	6,158,600	
レスターホールディングス	5,300	2,971.00	15,746,300	
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	34,100	1,003.00	34,202,300	
ミサワ	2,300	626.00	1,439,800	
三洋貿易	7,100	1,335.00	9,478,500	
シュッピン	6,100	1,043.00	6,362,300	
ビューティガレージ	2,900	2,249.00	6,522,100	
オイシックス・ラ・大地	8,400	1,379.00	11,583,600	
ウイン・パートナーズ	5,100	1,273.00	6,492,300	
ネクステージ	14,300	2,180.00	31,174,000	
ジョイフル本田	18,200	2,012.00	36,618,400	
鳥貴族ホールディングス	2,300	4,075.00	9,372,500	
ホットランド	4,800	1,830.00	8,784,000	
すかいらーくホールディングス	85,700	2,186.50	187,383,050	
SFPホールディングス	3,400	2,093.00	7,116,200	
綿半ホールディングス	4,900	1,472.00	7,212,800	
日本毛織	15,200	1,352.00	20,550,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17,500	997.00	17,447,500	
野村不動産ホールディングス	32,500	3,705.00	120,412,500	
三重交通グループホールディングス	12,500	604.00	7,550,000	
サムティ	9,300	2,496.00	23,212,800	
ディア・ライフ	10,000	926.00	9,260,000	

コーセーアールイー	3,700	894.00	3,307,800
地主	4,500	2,111.00	9,499,500
プレサンスコーポレーション	9,300	1,664.00	15,475,200
ハウスコム	4,000	966.00	3,864,000
JPMC	5,500	1,228.00	6,754,000
サンセイランディック	2,300	1,035.00	2,380,500
エストラスト	7,500	656.00	4,920,000
フージャースホールディングス	9,000	1,065.00	9,585,000
オープンハウスグループ	21,400	4,907.00	105,009,800
東急不動産ホールディングス	175,500	977.70	171,586,350
飯田グループホールディングス	55,900	1,936.00	108,222,400
帝国繊維	6,700	2,147.00	14,384,900
日本コークス工業	60,400	117.00	7,066,800
B E E N O S	4,200	1,413.00	5,934,600
あさひ	5,800	1,278.00	7,412,400
日本調剤	4,500	1,441.00	6,484,500
コスモス薬品	5,300	15,030.00	79,659,000
シップヘルスケアホールディングス	22,500	2,197.50	49,443,750
ソフトクリエイトホールディングス	4,900	1,917.00	9,393,300
セブン&アイ・ホールディングス	216,200	6,382.00	1,379,788,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	42,500	1,084.00	46,070,000
明治電機工業	4,400	1,493.00	6,569,200
ツルハホールディングス	13,200	11,045.00	145,794,000
サンマルクホールディングス	5,000	2,208.00	11,040,000
フェリシモ	4,400	925.00	4,070,000
トリドールホールディングス	17,600	4,151.00	73,057,600
帝人	57,100	1,252.50	71,517,750
東レ	397,900	690.20	274,630,580
クラレ	86,500	1,504.50	130,139,250
旭化成	401,800	1,052.00	422,693,600
T O K Y O B A S E	19,800	295.00	5,841,000
稲葉製作所	4,200	1,511.00	6,346,200
宮地エンジニアリンググループ	3,100	3,980.00	12,338,000
トーカロ	17,600	1,667.00	29,339,200
S U M C O	108,700	2,246.50	244,194,550
川田テクノロジーズ	1,400	8,980.00	12,572,000
R S T e c h n o l o g i e s	4,100	2,651.00	10,869,100
A n d D o ホールディングス	5,600	1,101.00	6,165,600
シーアールイー	4,400	1,323.00	5,821,200
ケイアイスター不動産	2,800	3,725.00	10,430,000
グッドコムアセット	8,200	752.00	6,166,400
ジェイ・エス・ビー	2,900	2,750.00	7,975,000
ロードスターキャピタル	3,800	2,192.00	8,329,600
霞ヶ関キャピタル	1,600	13,310.00	21,296,000
日本フェルト	5,500	438.00	2,409,000
イチカワ	3,400	1,727.00	5,871,800
芦森工業	1,800	2,763.00	4,973,400
アツギ	10,200	598.00	6,099,600
J Mホールディングス	4,700	2,437.00	11,453,900

コメダホールディングス	15,400	2,749.00	42,334,600
アレンザホールディングス	5,800	1,145.00	6,641,000
パロックジャパンリミテッド	7,700	823.00	6,337,100
クスリのアオキホールディングス	18,900	3,050.00	57,645,000
力の源ホールディングス	4,500	1,687.00	7,591,500
FOOD & LIFE COMPANIES	33,500	3,045.00	102,007,500
アセンテック	10,500	617.00	6,478,500
セーレン	11,500	2,450.00	28,175,000
ソトー	5,700	693.00	3,950,100
東海染工	1,600	824.00	1,318,400
小松マテール	8,600	788.00	6,776,800
ワコールホールディングス	12,200	3,638.00	44,383,600
ホギメディカル	7,800	3,560.00	27,768,000
T S Iホールディングス	19,300	697.00	13,452,100
マツオカコーポレーション	3,200	1,543.00	4,937,600
ワールド	8,400	1,978.00	16,615,200
T I S	65,000	3,369.00	218,985,000
グリー	19,900	523.00	10,407,700
コーエーテクモホールディングス	37,300	1,851.50	69,060,950
三菱総合研究所	2,900	4,950.00	14,355,000
ポールトゥウィンホールディングス	12,300	520.00	6,396,000
ネクソン	133,100	2,538.50	337,874,350
アイスタイル	19,400	458.00	8,885,200
エムアップホールディングス	7,300	1,030.00	7,519,000
エイチーム	11,100	582.00	6,460,200
エニグモ	17,900	349.00	6,247,100
コロプラ	23,100	585.00	13,513,500
ブロードリーフ	28,200	580.00	16,356,000
デジタルハーツホールディングス	6,200	1,052.00	6,522,400
メディアドゥ	4,700	1,274.00	5,987,800
じげん	17,300	529.00	9,151,700
ブイキューブ	20,600	325.00	6,695,000
フィックスターズ	6,700	1,819.00	12,187,300
CARTA HOLDINGS	200	1,456.00	291,200
オブティム	6,700	1,078.00	7,222,600
セレス	5,500	1,643.00	9,036,500
S H I F T	4,000	26,635.00	106,540,000
特種東海製紙	3,200	3,810.00	12,192,000
ティーガイア	6,200	2,126.00	13,181,200
テクマトリックス	10,900	2,044.00	22,279,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15,500	2,263.00	35,076,500
GMOペイメントゲートウェイ	11,900	8,504.00	101,197,600
システムリサーチ	2,100	3,425.00	7,192,500
インターネットイニシアティブ	28,400	2,925.00	83,070,000
さくらインターネット	6,700	5,290.00	35,443,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,200	2,765.00	6,083,000
S R Aホールディングス	3,000	3,955.00	11,865,000

朝日ネット	10,200	636.00	6,487,200
e B A S E	9,000	739.00	6,651,000
アバントグループ	7,500	1,363.00	10,222,500
アドソル日進	4,000	1,683.00	6,732,000
コムチュア	8,600	1,958.00	16,838,800
アステリア	10,700	655.00	7,008,500
アイル	2,800	3,690.00	10,332,000
王子ホールディングス	247,400	554.50	137,183,300
日本製紙	33,500	1,141.00	38,223,500
三菱製紙	4,500	539.00	2,425,500
北越コーポレーション	29,200	1,307.00	38,164,400
大王製紙	26,200	1,085.50	28,440,100
阿波製紙	3,900	500.00	1,950,000
マークライNZ	3,200	3,305.00	10,576,000
メディカル・データ・ビジョン	9,900	583.00	5,771,700
g u m i	15,600	399.00	6,224,400
テラスカイ	4,200	1,562.00	6,560,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	3,700	1,900.00	7,030,000
ラクス	28,100	2,164.00	60,808,400
ダブルスタンダード	3,900	1,856.00	7,238,400
オープンドア	7,500	801.00	6,007,500
アカツキ	2,800	2,461.00	6,890,800
U b i c o mホールディングス	4,300	1,413.00	6,075,900
カナミックネットワーク	15,300	517.00	7,910,100
レンゴー	54,100	1,006.00	54,424,600
トーモク	3,400	2,315.00	7,871,000
ザ・パック	4,400	3,815.00	16,786,000
チェンジホールディングス	12,900	1,517.00	19,569,300
オークネット	3,000	2,086.00	6,258,000
マクロミル	11,700	802.00	9,383,400
オロ	2,100	2,747.00	5,768,700
マネーフォワード	13,200	5,749.00	75,886,800
レゾナック・ホールディングス	57,400	3,254.00	186,779,600
住友化学	440,700	312.00	137,498,400
住友精化	2,800	5,050.00	14,140,000
日産化学	27,900	6,282.00	175,267,800
ラサ工業	2,700	2,341.00	6,320,700
クレハ	13,000	2,681.00	34,853,000
多木化学	2,300	3,630.00	8,349,000
テイカ	5,100	1,390.00	7,089,000
石原産業	9,800	1,513.00	14,827,400
日本曹達	7,000	5,930.00	41,510,000
東ソー	79,300	2,016.00	159,868,800
トクヤマ	19,200	2,349.00	45,100,800
セントラル硝子	6,300	2,884.00	18,169,200
東亜合成	28,600	1,523.50	43,572,100
大阪ソーダ	4,100	11,430.00	46,863,000
関東電化工業	11,500	929.00	10,683,500
デンカ	21,600	2,523.00	54,496,800

イビデン	31,200	7,350.00	229,320,000
信越化学工業	538,500	6,126.00	3,298,851,000
日本カーバイド工業	4,200	1,845.00	7,749,000
プラスアルファ・コンサルティング	3,500	2,537.00	8,879,500
電算システムホールディングス	2,600	2,672.00	6,947,200
堺化学工業	4,500	1,969.00	8,860,500
第一稀元素化学工業	6,500	923.00	5,999,500
エア・ウォーター	56,000	2,177.00	121,912,000
日本酸素ホールディングス	57,600	4,124.00	237,542,400
日本化学工業	3,200	2,158.00	6,905,600
日本パーライジング	26,500	1,266.00	33,549,000
高压ガス工業	8,600	882.00	7,585,200
四国化成ホールディングス	7,600	1,783.00	13,550,800
ステラ ケミファ	3,200	3,805.00	12,176,000
保土谷化学工業	1,900	3,585.00	6,811,500
日本触媒	8,600	5,669.00	48,753,400
大日精化学工業	4,100	2,754.00	11,291,400
カネカ	15,100	3,691.00	55,734,100
協和キリン	71,800	2,894.50	207,825,100
A P P I E R G R O U P	20,300	1,896.00	38,488,800
三菱瓦斯化学	44,300	2,625.00	116,287,500
三井化学	49,000	4,051.00	198,499,000
J S R	64,700	4,079.00	263,911,300
東京応化工業	28,300	4,163.00	117,812,900
大阪有機化学工業	5,000	2,985.00	14,925,000
三菱ケミカルグループ	434,100	864.50	375,279,450
K H ネオケム	9,100	2,280.00	20,748,000
ビジョナル	4,600	9,370.00	43,102,000
ダイセル	76,300	1,444.50	110,215,350
住友ベークライト	8,300	8,125.00	67,437,500
積水化学工業	119,300	2,085.50	248,800,150
日本ゼオン	40,700	1,286.00	52,340,200
アイカ工業	15,000	3,550.00	53,250,000
U B E	28,300	2,573.00	72,815,900
積水樹脂	8,900	2,531.00	22,525,900
タキロンシーアイ	15,100	631.00	9,528,100
旭有機材	4,000	4,125.00	16,500,000
ニチバン	3,700	1,857.00	6,870,900
リケンテクノス	12,800	965.00	12,352,000
大倉工業	2,800	3,180.00	8,904,000
積水化成品工業	12,600	463.00	5,833,800
群栄化学工業	1,900	3,615.00	6,868,500
ダイキョーニシカワ	13,100	734.00	9,615,400
森六ホールディングス	3,100	2,761.00	8,559,100
恵和	4,500	1,195.00	5,377,500
日本化薬	45,400	1,297.00	58,883,800
カーリットホールディングス	6,600	990.00	6,534,000
プレステージ・インターナショナル	28,500	606.00	17,271,000
プロトコーポレーション	6,500	1,310.00	8,515,000
ハイマックス	4,500	1,398.00	6,291,000

アミューズ	4,000	1,514.00	6,056,000
野村総合研究所	131,700	4,082.00	537,599,400
ドリームインキュベータ	2,100	3,080.00	6,468,000
クイック	4,200	2,405.00	10,101,000
日本システム技術	2,200	3,370.00	7,414,000
電通グループ	59,900	4,313.00	258,348,700
インテージホールディングス	6,700	1,807.00	12,106,900
ぴあ	2,100	3,140.00	6,594,000
イオンファンタジー	2,500	2,488.00	6,220,000
ソースネクスト	42,300	138.00	5,837,400
シーティーエス	9,400	732.00	6,880,800
インフォコム	7,700	2,257.00	17,378,900
メディカルシステムネットワーク	10,200	625.00	6,375,000
日本精化	3,900	2,635.00	10,276,500
扶桑化学工業	6,300	4,605.00	29,011,500
トリケミカル研究所	7,200	4,165.00	29,988,000
シンプレクス・ホールディングス	9,000	2,552.00	22,968,000
HEROZ	3,900	1,865.00	7,273,500
ラクスル	14,300	1,083.00	15,486,900
メルカリ	28,900	2,144.50	61,976,050
ADEKA	20,700	2,924.50	60,537,150
日油	17,900	6,964.00	124,655,600
新日本理化	5,700	210.00	1,197,000
ハリマ化成グループ	7,300	912.00	6,657,600
イーソル	10,900	1,030.00	11,227,000
ウイングアーク1st	6,200	3,020.00	18,724,000
サーバーワークス	1,700	4,045.00	6,876,500
Sansan	19,500	1,514.00	29,523,000
ギフトィ	5,200	1,519.00	7,898,800
花王	134,300	5,641.00	757,586,300
第一工業製薬	3,100	3,260.00	10,106,000
石原ケミカル	3,000	1,914.00	5,742,000
三洋化成工業	3,700	4,165.00	15,410,500
メドレー	8,000	4,880.00	39,040,000
ベース	2,100	3,605.00	7,570,500
JMDC	10,100	3,700.00	37,370,000
武田薬品工業	526,200	4,472.00	2,353,166,400
アステラス製薬	521,600	1,685.00	878,896,000
住友ファーマ	44,200	367.00	16,221,400
塩野義製薬	75,000	7,144.00	535,800,000
わかもと製薬	3,100	212.00	657,200
日本新薬	15,600	4,950.00	77,220,000
中外製薬	186,100	5,842.00	1,087,196,200
科研製薬	10,200	3,584.00	36,556,800
エーザイ	72,300	6,268.00	453,176,400
理研ビタミン	5,000	2,388.00	11,940,000
ロート製薬	57,600	2,943.00	169,516,800
小野薬品工業	126,200	2,457.50	310,136,500
久光製薬	13,200	4,030.00	53,196,000
持田製薬	6,800	3,190.00	21,692,000

参天製薬	108,400	1,524.50	165,255,800
扶桑薬品工業	2,900	2,206.00	6,397,400
ツムラ	18,700	2,762.00	51,649,400
テルモ	165,800	5,608.00	929,806,400
H・U・グループホールディングス	17,800	2,730.00	48,594,000
キッセイ薬品工業	9,800	3,310.00	32,438,000
生化学工業	10,100	758.00	7,655,800
栄研化学	10,900	1,874.00	20,426,600
鳥居薬品	3,200	4,040.00	12,928,000
JCRファーマ	20,100	927.00	18,632,700
東和薬品	9,100	3,000.00	27,300,000
富士製薬工業	4,400	1,771.00	7,792,400
ゼリア新薬工業	8,200	2,178.00	17,859,600
そーせいグループ	19,500	1,439.00	28,060,500
第一三共	518,000	4,924.00	2,550,632,000
杏林製薬	12,900	1,784.00	23,013,600
ダイト	4,600	1,993.00	9,167,800
大塚ホールディングス	123,700	5,559.00	687,648,300
大正製薬ホールディングス	13,200	8,594.00	113,440,800
ペプチドリーム	28,800	1,614.00	46,483,200
大日本塗料	6,600	1,088.00	7,180,800
日本ペイントホールディングス	315,300	1,122.50	353,924,250
関西ペイント	58,200	2,318.50	134,936,700
中国塗料	12,200	2,090.00	25,498,000
藤倉化成	14,000	456.00	6,384,000
太陽ホールディングス	10,300	3,145.00	32,393,500
DIC	23,200	2,950.00	68,440,000
サカタインクス	13,200	1,381.00	18,229,200
artience	12,900	3,000.00	38,700,000
T&K TOKA	5,700	1,409.00	8,031,300
アルプス技研	5,800	2,941.00	17,057,800
日本空調サービス	7,500	897.00	6,727,500
オリエンタルランド	322,500	5,391.00	1,738,597,500
フォーカスシステムズ	6,000	1,077.00	6,462,000
ダスキン	13,600	3,379.00	45,954,400
パーク24	37,900	1,725.00	65,377,500
明光ネットワークジャパン	8,900	731.00	6,505,900
ファルコホールディングス	2,900	2,298.00	6,664,200
クレスコ	4,900	1,927.00	9,442,300
フジ・メディア・ホールディングス	57,100	1,940.00	110,774,000
ラウンドワン	57,400	694.00	39,835,600
リゾートトラスト	26,500	2,535.50	67,190,750
オービック	19,900	22,200.00	441,780,000
ジャストシステム	8,500	2,575.00	21,887,500
TDCソフト	5,600	2,116.00	11,849,600
LINEヤフー	846,500	422.70	357,815,550
ビー・エム・エル	7,500	2,744.00	20,580,000
トレンドマイクロ	28,100	7,269.00	204,258,900
IDホールディングス	4,000	1,645.00	6,580,000
リソー教育	31,100	233.00	7,246,300

日本オラクル	11,400	11,600.00	132,240,000	
アルファシステムズ	2,100	3,500.00	7,350,000	
フューチャー	12,700	1,657.00	21,043,900	
C A C H o l d i n g s	3,600	1,800.00	6,480,000	
S B テクノロジー	2,600	2,130.00	5,538,000	
ユー・エス・エス	68,400	2,607.00	178,318,800	
オービックビジネスコンサルタント	8,400	6,939.00	58,287,600	
アイティフォー	7,600	1,398.00	10,624,800	
東京個別指導学院	14,200	449.00	6,375,800	
サイバーエージェント	134,700	1,052.00	141,704,400	
楽天グループ	522,400	749.70	391,643,280	
クリーク・アンド・リバー社	3,200	1,937.00	6,198,400	
S B I グローバルアセットマネジメント	11,900	738.00	8,782,200	
テー・オー・ダブリュー	18,900	361.00	6,822,900	
大塚商会	29,500	6,478.00	191,101,000	
サイボウズ	8,200	2,029.00	16,637,800	
山田コンサルティンググループ	3,600	1,720.00	6,192,000	
セントラルスポーツ	2,600	2,445.00	6,357,000	
電通総研	7,200	5,540.00	39,888,000	
A C C E S S	8,100	939.00	7,605,900	
デジタルガレージ	9,500	3,370.00	32,015,000	
イーエムシステムズ	9,900	745.00	7,375,500	
ウェザーニューズ	1,800	5,130.00	9,234,000	
C I J	9,900	708.00	7,009,200	
WOWOW	5,600	1,133.00	6,344,800	
スカラ	8,300	716.00	5,942,800	
フルキャストホールディングス	5,800	1,478.00	8,572,400	
エン・ジャパン	9,900	2,762.00	27,343,800	
セルソース	3,900	1,298.00	5,062,200	
あすか製薬ホールディングス	6,100	2,051.00	12,511,100	
サワイグループホールディングス	13,600	6,006.00	81,681,600	
富士フイルムホールディングス	110,300	9,367.00	1,033,180,100	
コニカミノルタ	133,700	470.80	62,945,960	
資生堂	124,200	4,148.00	515,181,600	
ライオン	77,800	1,320.00	102,696,000	
高砂香料工業	4,500	3,470.00	15,615,000	
マンダム	12,800	1,325.00	16,960,000	
ミルボン	8,100	3,418.00	27,685,800	
ファンケル	26,000	2,145.00	55,770,000	
コーセー	12,100	8,573.00	103,733,300	
コタ	5,500	1,590.00	8,745,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	30,500	1,462.50	44,606,250	
ノエビアホールディングス	5,300	5,230.00	27,719,000	
新日本製薬	3,600	1,738.00	6,256,800	
エステー	4,600	1,562.00	7,185,200	
アグロ カネショウ	4,500	1,292.00	5,814,000	
コニシ	17,200	1,388.00	23,873,600	
長谷川香料	11,400	3,185.00	36,309,000	
小林製薬	17,300	6,101.00	105,547,300	

荒川化学工業	5,800	1,117.00	6,478,600
メック	4,900	4,215.00	20,653,500
日本高純度化学	2,400	2,747.00	6,592,800
タカラバイオ	16,000	1,086.00	17,376,000
JCU	6,600	4,135.00	27,291,000
新田ゼラチン	500	674.00	337,000
OATアグリオ	3,200	1,700.00	5,440,000
デクセリアルズ	14,900	5,850.00	87,165,000
アース製薬	5,400	4,225.00	22,815,000
北興化学工業	6,100	1,064.00	6,490,400
大成ラミック	2,100	3,070.00	6,447,000
クミアイ化学工業	23,600	829.00	19,564,400
日本農薬	10,900	707.00	7,706,300
ニチレキ	7,800	2,404.00	18,751,200
ユシロ化学工業	3,400	2,139.00	7,272,600
富士石油	17,400	337.00	5,863,800
出光興産	330,200	926.80	306,029,360
ENEOSホールディングス	941,400	646.40	608,520,960
コスモエネルギーホールディングス	17,700	6,548.00	115,899,600
ANYCOLOR	6,300	3,110.00	19,593,000
テスホールディングス	13,600	453.00	6,160,800
インフロニア・ホールディングス	67,000	1,497.00	100,299,000
横浜ゴム	30,100	4,002.00	120,460,200
TOYO TIRE	34,200	2,891.00	98,872,200
ブリヂストン	174,100	6,300.00	1,096,830,000
住友ゴム工業	58,300	1,762.00	102,724,600
藤倉コンポジット	4,600	1,429.00	6,573,400
オカモト	2,800	4,855.00	13,594,000
アキレス	4,000	1,478.00	5,912,000
フコク	3,100	1,620.00	5,022,000
ニッタ	6,000	3,715.00	22,290,000
住友理工	9,200	1,096.00	10,083,200
三ツ星ベルト	7,200	4,920.00	35,424,000
バンドー化学	8,800	1,725.00	15,180,000
AGC	53,000	5,424.00	287,472,000
日本板硝子	28,400	539.00	15,307,600
有沢製作所	10,400	1,159.00	12,053,600
日本電気硝子	24,300	3,572.00	86,799,600
オハラ	5,400	1,177.00	6,355,800
住友大阪セメント	9,900	3,599.00	35,630,100
太平洋セメント	35,200	3,195.00	112,464,000
日本ヒューム	7,100	882.00	6,262,200
日本コンクリート工業	13,900	454.00	6,310,600
三谷セキサン	2,500	5,840.00	14,600,000
アジアパイルホールディングス	8,400	790.00	6,636,000
東海カーボン	54,900	1,021.00	56,052,900
日本カーボン	3,100	5,420.00	16,802,000
東洋炭素	4,200	7,170.00	30,114,000
ノリタケカンパニーリミテド	3,300	8,030.00	26,499,000
TOTO	39,200	3,728.00	146,137,600

日本碍子	69,200	1,905.50	131,860,600	
日本特殊陶業	49,800	4,316.00	214,936,800	
MARUWA	2,200	30,900.00	67,980,000	
品川リフラクトリーズ	7,300	2,046.00	14,935,800	
黒崎播磨	1,200	13,820.00	16,584,000	
ヨータイ	4,400	1,451.00	6,384,400	
ニッカトー	1,900	582.00	1,105,800	
フジインコーポレーテッド	16,000	3,320.00	53,120,000	
クニミネ工業	900	1,012.00	910,800	
ニチアス	15,000	3,775.00	56,625,000	
日本製鉄	273,900	3,610.00	988,779,000	
神戸製鋼所	123,000	2,048.50	251,965,500	
中山製鋼所	14,000	926.00	12,964,000	
合同製鐵	3,400	5,920.00	20,128,000	
JFEホールディングス	170,100	2,351.00	399,905,100	
東京製鐵	17,200	1,690.00	29,068,000	
共英製鋼	7,000	2,291.00	16,037,000	
大和工業	11,500	8,480.00	97,520,000	
東京鐵鋼	2,700	5,260.00	14,202,000	
大阪製鐵	2,800	2,370.00	6,636,000	
淀川製鋼所	7,000	4,275.00	29,925,000	
中部鋼鈹	4,000	2,509.00	10,036,000	
丸一鋼管	18,600	4,046.00	75,255,600	
大同特殊鋼	38,500	1,788.00	68,838,000	
日本冶金工業	4,500	4,630.00	20,835,000	
山陽特殊製鋼	6,100	2,223.00	13,560,300	
愛知製鋼	3,500	3,530.00	12,355,000	
大平洋金属	5,200	1,407.00	7,316,400	
新日本電工	30,500	302.00	9,211,000	
栗本鐵工所	2,800	3,340.00	9,352,000	
日本製鋼所	16,500	2,536.00	41,844,000	
三菱製鋼	4,500	1,444.00	6,498,000	
日亜鋼業	10,400	338.00	3,515,200	
日本精線	1,200	5,800.00	6,960,000	
エンピプロ・ホールディングス	10,100	497.00	5,019,700	
大紀アルミニウム工業所	7,700	1,235.00	9,509,500	
日本輕金属ホールディングス	17,800	1,728.00	30,758,400	
三井金属鈹業	17,800	4,423.00	78,729,400	
東邦亜鉛	5,500	1,078.00	5,929,000	
三菱マテリアル	43,700	2,619.00	114,450,300	
住友金属鈹山	70,900	4,153.00	294,447,700	
DOWAホールディングス	15,100	5,594.00	84,469,400	
古河機械金属	8,100	1,753.00	14,199,300	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,600	2,704.00	28,662,400	
東邦チタニウム	12,600	1,749.00	22,037,400	
UACJ	8,600	4,170.00	35,862,000	
CKサンエツ	1,700	3,895.00	6,621,500	
古河電氣工業	20,400	2,822.00	57,568,800	
住友電氣工業	228,800	2,148.50	491,576,800	
フジクラ	72,200	1,745.00	125,989,000	

SWCC	6,800	3,320.00	22,576,000
タツタ電線	10,900	695.00	7,575,500
平河ヒューテック	4,600	1,318.00	6,062,800
いよぎんホールディングス	69,500	1,081.00	75,129,500
しずおかフィナンシャルグループ	129,700	1,444.00	187,286,800
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	49,200	1,127.50	55,473,000
楽天銀行	20,300	2,665.00	54,099,500
京都フィナンシャルグループ	74,000	2,524.00	186,776,000
リョービ	6,500	2,561.00	16,646,500
AREホールディングス	23,000	1,962.00	45,126,000
東洋製罐グループホールディングス	35,100	2,468.00	86,626,800
ホッカインホールディングス	1,300	1,839.00	2,390,700
コロナ	6,600	974.00	6,428,400
横河ブリッジホールディングス	9,600	2,739.00	26,294,400
三和ホールディングス	61,500	2,587.00	159,100,500
文化シャッター	16,000	1,585.00	25,360,000
三協立山	7,700	891.00	6,860,700
アルインコ	6,000	1,050.00	6,300,000
LIXIL	95,500	1,958.50	187,036,750
日本フィルコン	100	548.00	54,800
ノーリツ	10,100	1,650.00	16,665,000
長府製作所	6,100	2,096.00	12,785,600
リンナイ	29,300	3,534.00	103,546,200
ユニプレス	10,600	1,064.00	11,278,400
日東精工	11,700	580.00	6,786,000
岡部	10,900	806.00	8,785,400
ジーテクト	7,800	2,010.00	15,678,000
東プレ	10,800	2,330.00	25,164,000
高周波熱錬	9,400	1,075.00	10,105,000
東京製綱	4,700	1,544.00	7,256,800
サンコール	13,300	471.00	6,264,300
モリテックスチール	100	264.00	26,400
パイオラックス	7,600	2,708.00	20,580,800
エイチワン	7,700	688.00	5,297,600
日本発条	54,100	1,448.50	78,363,850
中央発條	8,800	733.00	6,450,400
三浦工業	25,000	2,939.00	73,475,000
タクマ	20,200	1,887.00	38,117,400
テクノプロ・ホールディングス	35,700	3,290.00	117,453,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	1,395.00	5,719,500
Keeper 技研	3,800	6,620.00	25,156,000
イー・ガーディアン	4,000	1,376.00	5,504,000
ジャパンマテリアル	18,600	2,643.00	49,159,800
ベクトル	7,500	1,256.00	9,420,000
チャーム・ケア・コーポレーション	5,300	1,374.00	7,282,200
キャリアリンク	2,400	2,652.00	6,364,800
IBJ	9,000	599.00	5,391,000
アサンテ	3,800	1,684.00	6,399,200
パリュールHR	5,300	1,366.00	7,239,800

M & Aキャピタルパートナーズ	4,900	2,493.00	12,215,700	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,100	1,066.00	6,502,600	
シグマクシス・ホールディングス	8,200	1,657.00	13,587,400	
ウィルグループ	5,300	1,147.00	6,079,100	
メドピア	9,100	818.00	7,443,800	
リクルートホールディングス	451,200	5,890.00	2,657,568,000	
エラン	8,100	956.00	7,743,600	
ツガミ	13,300	1,154.00	15,348,200	
オークマ	5,200	7,192.00	37,398,400	
芝浦機械	6,000	3,455.00	20,730,000	
アマダ	95,500	1,630.50	155,712,750	
アイダエンジニアリング	13,900	838.00	11,648,200	
F U J I	28,200	2,625.50	74,039,100	
牧野フライス製作所	6,600	5,890.00	38,874,000	
オーエスジー	26,400	2,136.50	56,403,600	
旭ダイヤモンド工業	13,800	871.00	12,019,800	
D M G 森精機	36,300	3,351.00	121,641,300	
ソディック	14,600	726.00	10,599,600	
ディスコ	28,800	44,100.00	1,270,080,000	
日東工器	3,300	1,935.00	6,385,500	
日進工具	6,100	1,005.00	6,130,500	
パンチ工業	200	428.00	85,600	
日本郵政	716,200	1,406.00	1,006,977,200	
ベルシステム24ホールディングス	6,500	1,787.00	11,615,500	
鎌倉新書	10,400	576.00	5,990,400	
エアトリ	4,500	1,608.00	7,236,000	
アトラエ	9,300	490.00	4,557,000	
ストライク	2,600	5,180.00	13,468,000	
ソラスト	16,800	537.00	9,021,600	
インソース	13,200	800.00	10,560,000	
豊田自動織機	50,600	14,615.00	739,519,000	
リケンNPR	6,500	2,863.00	18,609,500	
島精機製作所	9,500	1,403.00	13,328,500	
オプトラン	9,800	1,845.00	18,081,000	
イワキ	4,000	2,382.00	9,528,000	
フリュー	5,600	1,240.00	6,944,000	
ヤマシンフィルタ	18,800	358.00	6,730,400	
日阪製作所	6,500	984.00	6,396,000	
やまびこ	9,800	1,803.00	17,669,400	
野村マイクロ・サイエンス	2,000	14,510.00	29,020,000	
平田機工	2,900	7,600.00	22,040,000	
P E G A S U S	14,100	459.00	6,471,900	
マルマエ	3,400	1,869.00	6,354,600	
タツモ	3,600	3,785.00	13,626,000	
ナブテスコ	37,600	2,476.00	93,097,600	
三井海洋開発	7,600	2,934.00	22,298,400	
レオン自動機	6,900	1,428.00	9,853,200	
S M C	17,900	86,860.00	1,554,794,000	
ホソカワミクロン	3,800	4,240.00	16,112,000	

ユニオンツール	2,600	3,965.00	10,309,000
瑞光	4,300	1,762.00	7,576,600
オイレス工業	8,100	2,052.00	16,621,200
日精エー・エス・ビー機械	2,400	4,405.00	10,572,000
サトーホールディングス	8,500	2,262.00	19,227,000
技研製作所	5,600	2,071.00	11,597,600
日本エアテック	5,100	1,155.00	5,890,500
日精樹脂工業	5,600	1,140.00	6,384,000
ワイエイシーホールディングス	2,600	2,326.00	6,047,600
小松製作所	280,700	4,321.00	1,212,904,700
住友重機械工業	35,400	4,553.00	161,176,200
日立建機	23,800	4,229.00	100,650,200
日工	8,900	771.00	6,861,900
巴工業	2,300	3,795.00	8,728,500
井関農機	5,600	1,009.00	5,650,400
TOWA	6,700	7,770.00	52,059,000
北川鉄工所	4,100	1,566.00	6,420,600
シンニッタン	14,300	276.00	3,946,800
ローツェ	3,100	20,260.00	62,806,000
クボタ	313,000	2,221.00	695,173,000
荏原実業	3,200	3,120.00	9,984,000
東洋エンジニアリング	8,500	826.00	7,021,000
三菱化工機	2,100	3,755.00	7,885,500
月島ホールディングス	8,100	1,320.00	10,692,000
帝国電機製作所	4,200	2,747.00	11,537,400
新東工業	12,100	1,170.00	14,157,000
澁谷工業	5,600	3,110.00	17,416,000
アイチコーポレーション	8,300	1,099.00	9,121,700
小森コーポレーション	14,700	1,294.00	19,021,800
鶴見製作所	4,600	3,365.00	15,479,000
酒井重工業	900	6,440.00	5,796,000
荏原製作所	24,600	11,270.00	277,242,000
西島製作所	5,200	2,527.00	13,140,400
北越工業	6,000	2,455.00	14,730,000
ダイキン工業	71,500	21,450.00	1,533,675,000
オルガノ	7,200	6,900.00	49,680,000
トーヨーカネツ	2,000	4,475.00	8,950,000
栗田工業	33,500	5,882.00	197,047,000
椿本チエイン	8,500	4,705.00	39,992,500
日機装	13,800	1,183.00	16,325,400
木村化工機	8,700	712.00	6,194,400
レイズネクスト	8,400	2,361.00	19,832,400
アネスト岩田	9,300	1,333.00	12,396,900
ダイフク	101,100	3,377.00	341,414,700
サムコ	1,600	4,995.00	7,992,000
タダノ	34,500	1,328.00	45,816,000
フジテック	14,000	3,693.00	51,702,000
C K D	16,600	2,789.00	46,297,400
平和	17,700	2,092.00	37,028,400
理想科学工業	4,800	3,230.00	15,504,000

SANKYO	13,800	8,904.00	122,875,200
日本金銭機械	7,200	1,423.00	10,245,600
マースグループホールディングス	3,000	2,865.00	8,595,000
フクシマガリレイ	3,900	5,790.00	22,581,000
ダイコク電機	2,900	4,250.00	12,325,000
竹内製作所	10,900	5,140.00	56,026,000
アマノ	17,000	3,739.00	63,563,000
JUKI	14,200	502.00	7,128,400
ジャノメ	9,100	687.00	6,251,700
ブラザー工業	80,000	2,479.00	198,320,000
マックス	8,400	3,135.00	26,334,000
モリタホールディングス	10,400	1,632.00	16,972,800
グローリー	14,400	2,920.50	42,055,200
新晃工業	6,000	3,145.00	18,870,000
大和冷機工業	9,200	1,486.00	13,671,200
セガサミーホールディングス	53,500	1,801.00	96,353,500
TPR	7,600	2,113.00	16,058,800
ツバキ・ナカシマ	12,000	780.00	9,360,000
ホシザキ	35,300	5,313.00	187,548,900
大豊工業	7,500	832.00	6,240,000
日本精工	110,900	806.60	89,451,940
NTN	129,900	294.80	38,294,520
ジェイテクト	53,300	1,371.00	73,074,300
不二越	4,400	3,385.00	14,894,000
ミネベアミツミ	104,200	3,034.00	316,142,800
日本トムソン	16,300	615.00	10,024,500
THK	34,500	3,194.00	110,193,000
ユーシン精機	9,400	683.00	6,420,200
前澤給装工業	4,900	1,291.00	6,325,900
イーグル工業	6,600	1,779.00	11,741,400
日本ピラー工業	5,600	5,460.00	30,576,000
キッツ	20,000	1,321.00	26,420,000
日立製作所	287,800	12,265.00	3,529,867,000
三菱電機	666,500	2,312.00	1,540,948,000
富士電機	36,400	8,895.00	323,778,000
安川電機	65,000	5,616.00	365,040,000
シンフォニアテクノロジー	6,600	2,565.00	16,929,000
明電舎	11,100	2,672.00	29,659,200
オリジン	1,600	1,218.00	1,948,800
山洋電気	2,600	6,130.00	15,938,000
デンヨー	4,600	2,318.00	10,662,800
PHCホールディングス	11,200	1,296.00	14,515,200
KOKUSAI ELECTRIC	23,100	4,650.00	107,415,000
ソシオネクスト	43,500	3,811.00	165,778,500
ベイカレント・コンサルティング	44,800	3,178.00	142,374,400
Orchestra Holdings	6,300	1,131.00	7,125,300
アイモバイル	14,100	466.00	6,570,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	19,700	2,276.00	44,837,200

ミダックホールディングス	3,700	1,646.00	6,090,200
キュービーネットホールディングス	4,200	1,342.00	5,636,400
R P Aホールディングス	24,900	263.00	6,548,700
三櫻工業	9,100	1,051.00	9,564,100
マキタ	68,300	3,878.00	264,867,400
東芝テック	7,700	3,075.00	23,677,500
芝浦メカトロニクス	3,400	6,600.00	22,440,000
マブチモーター	29,400	2,735.50	80,423,700
ニデック	132,200	5,792.00	765,702,400
トレックス・セミコンダクター	3,500	1,876.00	6,566,000
東光高岳	3,600	2,390.00	8,604,000
ダブル・スコープ	17,100	774.00	13,235,400
ダイヘン	6,000	7,150.00	42,900,000
ヤーマン	11,600	1,011.00	11,727,600
J V Cケンウッド	47,300	707.00	33,441,100
I - P E X	4,200	1,840.00	7,728,000
大崎電気工業	13,100	677.00	8,868,700
オムロン	45,700	5,721.00	261,449,700
日東工業	8,100	4,265.00	34,546,500
I D E C	8,800	2,869.00	25,247,200
不二電機工業	300	1,144.00	343,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	23,400	2,712.50	63,472,500
メルコホールディングス	1,900	3,215.00	6,108,500
テクノメディカ	3,200	1,774.00	5,676,800
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	9,100	684.00	6,224,400
日本電気	78,600	9,754.00	766,664,400
富士通	55,100	23,095.00	1,272,534,500
沖電気工業	27,100	1,091.00	29,566,100
電気興業	2,700	2,108.00	5,691,600
サンケン電気	5,600	7,780.00	43,568,000
アイホン	3,200	2,824.00	9,036,800
ルネサスエレクトロニクス	390,800	2,452.50	958,437,000
セイコーエプソン	76,800	2,438.00	187,238,400
ワコム	45,500	656.00	29,848,000
アルバック	13,100	8,706.00	114,048,600
E I Z O	4,400	5,060.00	22,264,000
日本信号	13,600	973.00	13,232,800
京三製作所	13,700	460.00	6,302,000
能美防災	8,100	2,235.00	18,103,500
ホーチキ	4,500	2,249.00	10,120,500
エレコム	14,300	1,623.00	23,208,900
パナソニック ホールディングス	707,400	1,424.50	1,007,691,300
シャープ	100,900	825.20	83,262,680
アンリツ	42,200	1,168.00	49,289,600
富士通ゼネラル	17,000	1,994.50	33,906,500
ソニーグループ	419,400	13,315.00	5,584,311,000
T D K	94,800	7,796.00	739,060,800
帝国通信工業	3,100	1,899.00	5,886,900
タムラ製作所	23,900	567.00	13,551,300

アルプスアルパイン	53,500	1,051.50	56,255,250
日本電波工業	7,200	1,364.00	9,820,800
鈴木	5,400	1,161.00	6,269,400
メイコー	5,900	4,560.00	26,904,000
ローランド ディー . ジー .	3,300	5,020.00	16,566,000
フォスター電機	5,800	1,088.00	6,310,400
S M K	2,500	2,437.00	6,092,500
ヨコオ	5,300	1,581.00	8,379,300
ホシデン	13,600	1,986.00	27,009,600
ヒロセ電機	8,800	16,090.00	141,592,000
日本航空電子工業	14,300	2,681.00	38,338,300
T O A	6,800	1,129.00	7,677,200
マクセル	13,200	1,585.00	20,922,000
古野電気	7,800	2,153.00	16,793,400
スミダコーポレーション	8,000	1,203.00	9,624,000
アイコム	2,300	3,480.00	8,004,000
リオン	2,600	2,700.00	7,020,000
横河電機	65,500	3,037.00	198,923,500
新電元工業	2,300	3,085.00	7,095,500
アズビル	40,800	4,574.00	186,619,200
日本光電工業	25,400	4,149.00	105,384,600
チノー	2,700	2,327.00	6,282,900
共和電業	4,200	425.00	1,785,000
日本電子材料	3,600	1,988.00	7,156,800
堀場製作所	11,300	13,945.00	157,578,500
アドバンテスト	169,900	6,727.00	1,142,917,300
エスベック	4,700	2,719.00	12,779,300
キーエンス	59,300	69,040.00	4,094,072,000
日置電機	2,800	6,900.00	19,320,000
シスメックス	51,200	7,989.00	409,036,800
日本マイクロニクス	10,600	5,990.00	63,494,000
メガチップス	4,700	4,245.00	19,951,500
O B A R A G R O U P	3,200	3,720.00	11,904,000
澤藤電機	3,300	1,299.00	4,286,700
デンソー	489,100	2,704.50	1,322,770,950
原田工業	4,500	760.00	3,420,000
コーセル	6,300	1,525.00	9,607,500
イリソ電子工業	5,500	3,140.00	17,270,000
オブテックスグループ	10,900	1,837.00	20,023,300
千代田インテグレ	2,300	2,647.00	6,088,100
レーザーテック	27,200	39,770.00	1,081,744,000
スタンレー電気	38,000	2,572.50	97,755,000
ウシオ電機	30,100	2,025.50	60,967,550
岡谷電機産業	100	276.00	27,600
日本セラミック	4,800	2,594.00	12,451,200
古河電池	7,000	963.00	6,741,000
山一電機	5,300	2,201.00	11,665,300
図研	5,200	4,390.00	22,828,000
日本電子	14,900	6,454.00	96,164,600
カシオ計算機	42,800	1,192.50	51,039,000

ファナック	289,100	4,218.00	1,219,423,800	
日本シイエムケイ	12,600	607.00	7,648,200	
エンプラス	1,700	8,730.00	14,841,000	
大真空	8,800	882.00	7,761,600	
ローム	109,600	2,645.50	289,946,800	
浜松ホトニクス	47,600	5,400.00	257,040,000	
三井ハイテック	5,200	8,041.00	41,813,200	
新光電気工業	21,000	5,500.00	115,500,000	
京セラ	368,400	2,215.50	816,190,200	
太陽誘電	28,900	3,389.00	97,942,100	
村田製作所	539,400	2,957.50	1,595,275,500	
双葉電子工業	12,400	519.00	6,435,600	
日東電工	38,200	13,850.00	529,070,000	
北陸電気工業	2,800	1,396.00	3,908,800	
東海理化電機製作所	16,700	2,350.00	39,245,000	
ニチコン	15,600	1,227.00	19,141,200	
日本ケミコン	6,300	1,351.00	8,511,300	
K O A	9,000	1,511.00	13,599,000	
三井E & S	29,700	1,155.00	34,303,500	
日立造船	52,800	1,082.00	57,129,600	
三菱重工業	104,700	11,480.00	1,201,956,000	
川崎重工業	48,400	3,888.00	188,179,200	
I H I	44,600	3,146.00	140,311,600	
名村造船所	14,800	1,803.00	26,684,400	
マネジメントソリューションズ	2,600	2,990.00	7,774,000	
プロレド・パートナーズ	17,700	356.00	6,301,200	
アンビスホールディングス	6,500	2,605.00	16,932,500	
カーブスホールディングス	16,600	739.00	12,267,400	
フォーラムエンジニアリング	8,300	962.00	7,984,600	
日本車輛製造	2,900	2,309.00	6,696,100	
三菱ロジスネクスト	9,500	1,466.00	13,927,000	
フルサト・マルカホールディングス	5,600	2,251.00	12,605,600	
ヤマエグループホールディングス	3,500	2,517.00	8,809,500	
F P G	19,700	1,842.00	36,287,400	
じもとホールディングス	2,500	546.00	1,365,000	
全国保証	15,300	5,501.00	84,165,300	
めぶきフィナンシャルグループ	289,700	439.10	127,207,270	
ジャパンインベストメントアドバイザー	9,500	898.00	8,531,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,500	4,115.00	30,862,500	
九州フィナンシャルグループ	113,000	964.70	109,011,100	
かんぽ生命保険	59,500	2,678.50	159,370,750	
ゆうちょ銀行	641,600	1,536.00	985,497,600	
富山第一銀行	18,500	868.00	16,058,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	313,300	729.00	228,395,700	
ジェイリース	1,800	2,644.00	4,759,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	32,900	1,623.00	53,396,700	
イントラスト	100	808.00	80,800	

SBIアルヒ	7,400	906.00	6,704,400
プレミアグループ	9,800	1,774.00	17,385,200
日産自動車	800,100	566.20	453,016,620
いすゞ自動車	172,400	2,153.50	371,263,400
トヨタ自動車	3,255,400	3,414.00	11,113,935,600
日野自動車	89,200	473.10	42,200,520
三菱自動車工業	231,300	451.70	104,478,210
エフテック	1,400	705.00	987,000
武蔵精密工業	14,500	1,622.00	23,519,000
日産車体	6,400	972.00	6,220,800
新明和工業	17,100	1,191.00	20,366,100
極東開発工業	9,800	2,371.00	23,235,800
トビー工業	4,800	2,928.00	14,054,400
ティラド	1,700	3,850.00	6,545,000
タチエス	10,900	2,014.00	21,952,600
NOK	23,000	2,088.00	48,024,000
フタバ産業	15,900	1,033.00	16,424,700
カヤバ	5,700	4,915.00	28,015,500
市光工業	10,900	532.00	5,798,800
大同メタル工業	11,600	553.00	6,414,800
プレス工業	23,700	654.00	15,499,800
ミクニ	3,600	463.00	1,666,800
太平洋工業	13,600	1,456.00	19,801,600
アイシン	45,700	5,457.00	249,384,900
マツダ	196,100	1,732.00	339,645,200
今仙電機製作所	2,500	669.00	1,672,500
本田技研工業	1,445,800	1,748.00	2,527,258,400
スズキ	108,900	6,579.00	716,453,100
SUBARU	183,900	3,359.00	617,720,100
ヤマハ発動機	256,200	1,382.50	354,196,500
小糸製作所	61,400	1,971.50	121,050,100
エクセディ	9,700	2,883.00	27,965,100
ミツバ	11,100	1,334.00	14,807,400
豊田合成	17,000	2,956.50	50,260,500
愛三工業	9,800	1,457.00	14,278,600
盟和産業	1,300	1,026.00	1,333,800
ヨロズ	6,800	935.00	6,358,000
エフ・シー・シー	10,500	2,116.00	22,218,000
シマノ	23,900	20,245.00	483,855,500
テイ・エス テック	21,100	1,961.50	41,387,650
三十三フィナンシャルグループ	5,200	1,932.00	10,046,400
第四北越フィナンシャルグループ	9,200	4,215.00	38,778,000
ひろぎんホールディングス	83,100	1,037.00	86,174,700
マーキュリアホールディングス	1,400	758.00	1,061,200
おきなわフィナンシャルグループ	5,000	2,453.00	12,265,000
ダイレクトマーケティングミックス	14,300	339.00	4,847,700
ポピンズ	5,600	1,437.00	8,047,200
LITALICO	4,700	2,125.00	9,987,500
十六フィナンシャルグループ	7,600	4,250.00	32,300,000
北國フィナンシャルホールディングス	6,100	4,710.00	28,731,000

ネットプロテクションズホールディングス	34,600	195.00	6,747,000	
プロクレアホールディングス	6,700	1,831.00	12,267,700	
F Pパートナー	1,200	6,880.00	8,256,000	
あいちフィナンシャルグループ	9,000	2,615.00	23,535,000	
ジャムコ	4,000	1,368.00	5,472,000	
小野建	6,200	1,762.00	10,924,400	
はるやまホールディングス	5,300	598.00	3,169,400	
南陽	1,400	2,458.00	3,441,200	
ノジマ	18,200	1,660.00	30,212,000	
佐鳥電機	3,500	2,563.00	8,970,500	
カップ・クリエイト	9,900	1,668.00	16,513,200	
伯東	3,600	5,950.00	21,420,000	
コンドーテック	5,100	1,215.00	6,196,500	
中山福	100	365.00	36,500	
ライトオン	6,600	413.00	2,725,800	
ナガイレーベン	7,900	2,364.00	18,675,600	
三菱食品	5,800	5,030.00	29,174,000	
良品計画	68,500	2,325.00	159,262,500	
松田産業	4,800	2,400.00	11,520,000	
第一興商	24,300	1,915.50	46,546,650	
メディカルホールディングス	63,800	2,370.50	151,237,900	
アドヴァングループ	6,000	1,166.00	6,996,000	
S P K	3,200	2,058.00	6,585,600	
萩原電気ホールディングス	2,700	4,930.00	13,311,000	
アルビス	2,400	2,631.00	6,314,400	
アズワン	9,800	5,289.00	51,832,200	
スズデン	2,600	2,217.00	5,764,200	
シモジマ	4,800	1,278.00	6,134,400	
ドウシシャ	5,800	2,128.00	12,342,400	
小津産業	2,300	1,675.00	3,852,500	
高速	3,700	2,412.00	8,924,400	
ハウス オブ ローゼ	400	1,628.00	651,200	
G - 7ホールディングス	6,800	1,439.00	9,785,200	
イオン北海道	18,500	930.00	17,205,000	
コジマ	10,400	752.00	7,820,800	
ヒマラヤ	400	943.00	377,200	
コーナン商事	7,700	3,890.00	29,953,000	
ネットワンシステムズ	24,000	2,577.50	61,860,000	
エコス	2,600	2,370.00	6,162,000	
ワタミ	6,600	1,034.00	6,824,400	
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	126,700	3,476.00	440,409,200	
丸文	5,600	1,515.00	8,484,000	
西松屋チェーン	12,300	2,088.00	25,682,400	
ゼンショーホールディングス	31,900	6,628.00	211,433,200	
ハビネット	5,300	3,275.00	17,357,500	
橋本総業ホールディングス	4,700	1,301.00	6,114,700	
日本ライフライン	18,400	1,272.00	23,404,800	
サイゼリヤ	9,300	4,940.00	45,942,000	

VTホールディングス	23,800	514.00	12,233,200
アルゴグラフィックス	5,500	4,315.00	23,732,500
魚力	2,700	2,380.00	6,426,000
IDOM	16,600	888.00	14,740,800
日本エム・ディ・エム	8,300	702.00	5,826,600
フジ・コーポレーション	3,600	1,742.00	6,271,200
ユナイテッドアローズ	7,400	1,790.00	13,246,000
進和	3,800	2,428.00	9,226,400
ダイトロン	2,500	2,925.00	7,312,500
ハイデイ日高	9,300	2,711.00	25,212,300
シークス	8,900	1,621.00	14,426,900
コロワイド	27,000	2,235.00	60,345,000
オーハシテクニカ	3,600	1,736.00	6,249,600
壱番屋	5,000	6,090.00	30,450,000
白銅	2,600	2,632.00	6,843,200
スギホールディングス	12,600	7,265.00	91,539,000
薬王堂ホールディングス	3,100	2,840.00	8,804,000
島津製作所	78,800	3,845.00	302,986,000
JMS	12,000	514.00	6,168,000
長野計器	4,300	2,214.00	9,520,200
ブイ・テクノロジー	3,100	2,664.00	8,258,400
スター精密	11,200	1,671.00	18,715,200
東京計器	4,500	2,275.00	10,237,500
愛知時計電機	2,600	2,565.00	6,669,000
インターアクション	4,300	1,132.00	4,867,600
東京精密	12,100	9,631.00	116,535,100
マニー	23,700	2,070.00	49,059,000
ニコン	85,700	1,530.00	131,121,000
トプコン	28,800	1,771.50	51,019,200
オリンパス	364,900	2,170.00	791,833,000
理研計器	4,200	7,830.00	32,886,000
SCREENホールディングス	20,300	18,450.00	374,535,000
キヤノン電子	6,600	2,246.00	14,823,600
タムロン	3,600	6,290.00	22,644,000
HOYA	116,700	18,495.00	2,158,366,500
ノーリツ鋼機	5,600	3,040.00	17,024,000
A&Dホロンホールディングス	8,600	2,105.00	18,103,000
朝日インテック	72,300	2,868.00	207,356,400
キヤノン	295,700	4,206.00	1,243,714,200
リコー	148,600	1,273.00	189,167,800
シチズン時計	54,500	1,068.00	58,206,000
メニコン	20,400	1,746.50	35,628,600
スノーピーク	8,500	1,138.00	9,673,000
パラマウントベッドホールディングス	12,300	2,484.00	30,553,200
トランザクション	3,900	2,549.00	9,941,100
ニホンフラッシュ	6,800	956.00	6,500,800
前田工織	5,000	3,360.00	16,800,000
アートネイチャー	7,900	789.00	6,233,100
フルヤ金属	1,400	9,840.00	13,776,000
パンダイナムコホールディングス	162,400	2,919.00	474,045,600

SHOEI	13,400	2,098.00	28,113,200
フランスベッドホールディングス	7,700	1,305.00	10,048,500
マーベラス	9,700	740.00	7,178,000
パイロットコーポレーション	8,300	3,890.00	32,287,000
エイベックス	10,100	1,295.00	13,079,500
フジシールインターナショナル	12,000	2,025.00	24,300,000
タカラトミー	27,000	2,327.50	62,842,500
広済堂ホールディングス	15,300	669.00	10,235,700
レック	7,600	1,091.00	8,291,600
プロネクサス	6,100	1,221.00	7,448,100
きもと	4,000	208.00	832,000
TOPPANホールディングス	72,900	3,512.00	256,024,800
大日本印刷	64,800	4,497.00	291,405,600
共同印刷	1,900	3,155.00	5,994,500
NISSHA	10,100	1,507.00	15,220,700
藤森工業	4,700	3,895.00	18,306,500
TAKARA & COMPANY	3,500	2,812.00	9,842,000
前澤化成工業	4,000	1,588.00	6,352,000
未来工業	2,100	5,220.00	10,962,000
アシックス	50,500	5,849.00	295,374,500
ツツミ	3,000	2,096.00	6,288,000
JSP	4,200	2,189.00	9,193,800
ニチハ	7,400	3,455.00	25,567,000
ローランド	4,400	4,905.00	21,582,000
エフピコ	11,200	2,835.50	31,757,600
小松ウオール工業	2,400	3,340.00	8,016,000
ヤマハ	37,400	3,220.00	120,428,000
河合楽器製作所	1,800	3,390.00	6,102,000
クリナップ	7,000	758.00	5,306,000
ピジョン	37,800	1,595.50	60,309,900
天馬	4,300	2,400.00	10,320,000
キングジム	7,300	880.00	6,424,000
象印マホービン	16,100	1,438.00	23,151,800
リンテック	11,900	3,020.00	35,938,000
信越ポリマー	12,800	1,595.00	20,416,000
イトーキ	12,100	1,996.00	24,151,600
任天堂	374,300	8,263.00	3,092,840,900
三菱鉛筆	8,400	2,439.00	20,487,600
松風	2,700	2,681.00	7,238,700
タカラスタANDARD	12,500	1,847.00	23,087,500
コクヨ	24,300	2,474.50	60,130,350
ナカバヤシ	11,700	533.00	6,236,100
ニフコ	17,800	3,732.00	66,429,600
グローブライド	5,300	2,027.00	10,743,100
オカムラ	17,800	2,187.00	38,928,600
バルカー	5,000	4,505.00	22,525,000
MUTOHホールディングス	1,800	2,296.00	4,132,800
伊藤忠商事	421,700	6,595.00	2,781,111,500
丸紅	523,000	2,462.50	1,287,887,500
スクロール	9,300	929.00	8,639,700

ヨンドシーホールディングス	5,900	1,947.00	11,487,300	
長瀬産業	28,800	2,453.50	70,660,800	
蝶理	3,900	2,987.00	11,649,300	
豊田通商	54,900	9,174.00	503,652,600	
オンワードホールディングス	35,000	524.00	18,340,000	
三共生興	8,700	769.00	6,690,300	
兼松	26,200	2,355.00	61,701,000	
美津濃	5,900	5,250.00	30,975,000	
三井物産	472,600	6,370.00	3,010,462,000	
日本紙パルプ商事	3,000	5,020.00	15,060,000	
東京エレクトロン	125,500	34,650.00	4,348,575,000	
カメイ	6,700	1,878.00	12,582,600	
OUGホールディングス	1,700	2,656.00	4,515,200	
スターゼン	4,300	2,762.00	11,876,600	
セイコーグループ	8,300	3,080.00	25,564,000	
山善	19,000	1,288.00	24,472,000	
椿本興業	1,300	6,870.00	8,931,000	
住友商事	379,600	3,569.00	1,354,792,400	
BIPROGY	19,500	4,627.00	90,226,500	
内田洋行	2,500	7,870.00	19,675,000	
三菱商事	1,242,900	3,129.00	3,889,034,100	
第一実業	5,900	1,982.00	11,693,800	
キャノンマーケティングジャパン	14,500	4,265.00	61,842,500	
西華産業	2,500	2,980.00	7,450,000	
佐藤商事	4,300	1,760.00	7,568,000	
菱洋エレクトロ	5,900	3,980.00	23,482,000	
東京産業	8,500	738.00	6,273,000	
ユアサ商事	4,900	5,050.00	24,745,000	
神鋼商事	1,600	7,210.00	11,536,000	
阪和興業	11,300	5,620.00	63,506,000	
正栄食品工業	4,200	4,650.00	19,530,000	
カナデン	4,700	1,553.00	7,299,100	
RYODEN	5,100	2,633.00	13,428,300	
ニプロ	49,400	1,275.00	62,985,000	
岩谷産業	14,300	7,345.00	105,033,500	
ナイス	2,900	1,600.00	4,640,000	
極東貿易	3,700	2,141.00	7,921,700	
アステナホールディングス	13,200	475.00	6,270,000	
三愛オブリ	15,100	1,923.00	29,037,300	
稲畑産業	12,400	3,160.00	39,184,000	
G S Iクレオス	3,400	2,402.00	8,166,800	
明和産業	9,500	708.00	6,726,000	
ゴールドウイン	10,500	8,917.00	93,628,500	
ユニ・チャーム	123,900	5,172.00	640,810,800	
デサント	10,300	3,195.00	32,908,500	
ワキタ	10,400	1,595.00	16,588,000	
ヤマトインターナショナル	14,100	305.00	4,300,500	
東邦ホールディングス	17,400	3,236.00	56,306,400	
サンゲツ	14,400	3,585.00	51,624,000	
ミツウロコグループホールディングス	8,000	1,512.00	12,096,000	

シナネンホールディングス	1,700	4,175.00	7,097,500	
伊藤忠エネクス	15,500	1,515.00	23,482,500	
サンリオ	17,800	7,474.00	133,037,200	
サンワテクノス	3,200	2,282.00	7,302,400	
リョーサン	4,400	5,150.00	22,660,000	
新光商事	8,400	1,228.00	10,315,200	
トーホー	2,400	2,871.00	6,890,400	
三信電気	2,600	2,317.00	6,024,200	
東陽テクニカ	6,400	1,500.00	9,600,000	
モスフードサービス	9,200	3,475.00	31,970,000	
加賀電子	5,700	6,480.00	36,936,000	
三益半導体工業	5,500	3,120.00	17,160,000	
都築電気	3,100	2,393.00	7,418,300	
ソーダニッカ	5,300	1,177.00	6,238,100	
立花エレテック	4,200	3,110.00	13,062,000	
木曽路	9,500	2,589.00	24,595,500	
S R Sホールディングス	10,300	1,178.00	12,133,400	
リテールパートナーズ	9,300	1,765.00	16,414,500	
上新電機	6,200	2,364.00	14,656,800	
日本瓦斯	33,200	2,343.50	77,804,200	
ロイヤルホールディングス	11,100	2,406.00	26,706,600	
いなげや	6,100	1,294.00	7,893,400	
チヨダ	7,200	886.00	6,379,200	
ライフコーポレーション	6,600	3,715.00	24,519,000	
リンガーハット	8,100	2,370.00	19,197,000	
MrMaxHD	10,200	630.00	6,426,000	
AOKIホールディングス	13,400	1,152.00	15,436,800	
オークワ	9,000	868.00	7,812,000	
コメリ	9,700	3,320.00	32,204,000	
青山商事	13,400	1,633.00	21,882,200	
しまむら	14,800	8,157.00	120,723,600	
高島屋	43,400	2,284.00	99,125,600	
松屋	10,600	963.00	10,207,800	
エイチ・ツー・オーリテイリング	27,800	1,826.00	50,762,800	
近鉄百貨店	2,700	2,523.00	6,812,100	
丸井グループ	41,600	2,475.00	102,960,000	
クレディセゾン	37,000	2,820.00	104,340,000	
アクシアルリテイリング	4,300	4,035.00	17,350,500	
イオン	212,600	3,588.00	762,808,800	
イズミ	11,100	3,755.00	41,680,500	
平和堂	10,500	2,064.00	21,672,000	
フジ	9,600	1,984.00	19,046,400	
ヤオコー	7,100	8,260.00	58,646,000	
ゼビオホールディングス	8,500	968.00	8,228,000	
ケーズホールディングス	42,100	1,234.50	51,972,450	
PALTAC	8,500	4,359.00	37,051,500	
三谷産業	17,200	394.00	6,776,800	
日産東京販売ホールディングス	4,800	500.00	2,400,000	
あおぞら銀行	42,000	2,215.00	93,030,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,555,900	1,487.50	5,289,401,250	

りそなホールディングス	680,900	817.70	556,771,930	
三井住友トラスト・ホールディングス	209,800	2,969.50	623,001,100	
三井住友フィナンシャルグループ	415,200	8,068.00	3,349,833,600	
千葉銀行	162,700	1,176.00	191,335,200	
群馬銀行	113,300	776.50	87,977,450	
武蔵野銀行	8,100	2,769.00	22,428,900	
千葉興業銀行	11,000	833.00	9,163,000	
七十七銀行	17,000	3,685.00	62,645,000	
秋田銀行	3,900	2,047.00	7,983,300	
山形銀行	6,500	1,099.00	7,143,500	
岩手銀行	3,700	2,523.00	9,335,100	
東邦銀行	46,200	312.00	14,414,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	50,900	3,672.00	186,904,800	
スルガ銀行	51,500	778.00	40,067,000	
八十二銀行	125,300	876.30	109,800,390	
山梨中央銀行	6,500	1,715.00	11,147,500	
大垣共立銀行	11,100	2,068.00	22,954,800	
福井銀行	5,200	1,776.00	9,235,200	
清水銀行	4,000	1,566.00	6,264,000	
富山銀行	1,100	1,797.00	1,976,700	
滋賀銀行	9,700	3,955.00	38,363,500	
南都銀行	8,800	2,693.00	23,698,400	
百五銀行	54,900	605.00	33,214,500	
紀陽銀行	20,900	1,855.00	38,769,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	36,100	1,679.00	60,611,900	
山陰合同銀行	36,500	1,015.00	37,047,500	
百十四銀行	5,700	2,698.00	15,378,600	
四国銀行	8,600	1,060.00	9,116,000	
阿波銀行	8,200	2,437.00	19,983,400	
大分銀行	3,500	2,628.00	9,198,000	
宮崎銀行	3,500	2,724.00	9,534,000	
佐賀銀行	3,400	1,906.00	6,480,400	
琉球銀行	12,400	1,130.00	14,012,000	
セブン銀行	183,000	299.00	54,717,000	
みずほフィナンシャルグループ	788,100	2,736.00	2,156,241,600	
山口フィナンシャルグループ	57,300	1,498.00	85,835,400	
芙蓉総合リース	5,400	13,755.00	74,277,000	
みずほリース	9,800	5,360.00	52,528,000	
東京センチュリー	43,600	1,599.50	69,738,200	
SBIホールディングス	85,600	4,000.00	342,400,000	
日本証券金融	21,500	1,632.00	35,088,000	
アイフル	86,000	432.00	37,152,000	
名古屋銀行	3,800	5,890.00	22,382,000	
北洋銀行	88,500	346.00	30,621,000	
大光銀行	1,200	1,398.00	1,677,600	
愛媛銀行	7,900	1,110.00	8,769,000	
京葉銀行	24,500	711.00	17,419,500	
栃木銀行	29,200	305.00	8,906,000	
北日本銀行	2,800	2,127.00	5,955,600	
東和銀行	10,700	659.00	7,051,300	

リコーリース	5,500	5,100.00	28,050,000	
イオンフィナンシャルサービス	33,500	1,342.00	44,957,000	
アコム	104,200	397.50	41,419,500	
ジャックス	6,200	5,540.00	34,348,000	
オリエントコーポレーション	19,100	1,068.00	20,398,800	
オリックス	355,900	3,082.00	1,096,883,800	
三菱HCキャピタル	260,200	1,041.00	270,868,200	
ジャフコ グループ	17,400	1,746.50	30,389,100	
トモニホールディングス	55,300	401.00	22,175,300	
大和証券グループ本社	452,300	1,082.50	489,614,750	
野村ホールディングス	981,900	831.20	816,155,280	
岡三証券グループ	51,300	731.00	37,500,300	
丸三証券	19,400	973.00	18,876,200	
東洋証券	19,200	359.00	6,892,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	69,300	575.00	39,847,500	
光世証券	1,100	650.00	715,000	
水戸証券	17,200	470.00	8,084,000	
いちよし証券	10,900	788.00	8,589,200	
松井証券	28,700	853.00	24,481,100	
S O M P Oホールディングス	87,800	8,833.00	775,537,400	
日本取引所グループ	152,300	3,800.00	578,740,000	
マネックスグループ	57,200	881.00	50,393,200	
極東証券	8,000	1,018.00	8,144,000	
岩井コスモホールディングス	6,700	2,184.00	14,632,800	
アイザワ証券グループ	8,400	1,175.00	9,870,000	
フィデアホールディングス	6,000	1,589.00	9,534,000	
池田泉州ホールディングス	81,000	355.00	28,755,000	
アニコム ホールディングス	19,800	598.00	11,840,400	
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	130,700	7,361.00	962,082,700	
スパークス・グループ	6,500	1,821.00	11,836,500	
第一生命ホールディングス	285,300	3,402.00	970,590,600	
東京海上ホールディングス	577,200	4,391.00	2,534,485,200	
イー・ギャランティ	9,500	1,886.00	17,917,000	
N E Cキャピタルソリューション	2,900	3,700.00	10,730,000	
T & Dホールディングス	156,800	2,526.00	396,076,800	
アドバンスクリエイト	3,300	1,042.00	3,438,600	
三井不動産	270,000	4,072.00	1,099,440,000	
三菱地所	381,700	2,133.00	814,166,100	
平和不動産	9,500	4,020.00	38,190,000	
東京建物	51,000	2,158.00	110,058,000	
京阪神ビルディング	10,900	1,583.00	17,254,700	
住友不動産	84,400	4,596.00	387,902,400	
テーオーシー	10,400	681.00	7,082,400	
東京楽天地	1,000	6,700.00	6,700,000	
レオパレス21	58,400	423.00	24,703,200	
スターツコーポレーション	8,400	3,035.00	25,494,000	
フジ住宅	8,900	711.00	6,327,900	
空港施設	10,400	604.00	6,281,600	

ゴールドクレスト	4,800	2,246.00	10,780,800
リログループ	30,500	1,308.50	39,909,250
エスリード	2,700	3,410.00	9,207,000
日神グループホールディングス	12,200	508.00	6,197,600
日本エスコン	10,900	987.00	10,758,300
MIRARTHホールディングス	26,800	492.00	13,185,600
AVANTIA	3,500	892.00	3,122,000
イオンモール	30,300	1,826.50	55,342,950
ファースト住建	1,500	1,101.00	1,651,500
カチタス	15,700	1,982.00	31,117,400
東祥	7,000	803.00	5,621,000
トーセイ	9,700	2,058.00	19,962,600
サンフロンティア不動産	8,600	1,710.00	14,706,000
FJネクストホールディングス	6,100	1,180.00	7,198,000
グランディハウス	9,700	649.00	6,295,300
東武鉄道	65,100	3,870.00	251,937,000
相鉄ホールディングス	21,200	2,723.00	57,727,600
東急	166,300	1,773.00	294,849,900
京浜急行電鉄	73,400	1,304.00	95,713,600
小田急電鉄	98,000	2,107.00	206,486,000
京王電鉄	28,500	4,208.00	119,928,000
京成電鉄	38,200	7,452.00	284,666,400
富士急行	7,300	3,880.00	28,324,000
東日本旅客鉄道	108,900	8,949.00	974,546,100
西日本旅客鉄道	70,300	6,215.00	436,914,500
東海旅客鉄道	228,400	3,754.00	857,413,600
西武ホールディングス	71,700	2,161.50	154,979,550
鴻池運輸	10,100	1,802.00	18,200,200
西日本鉄道	15,800	2,404.00	37,983,200
ハマキョウレックス	5,100	3,895.00	19,864,500
サカイ引越センター	6,600	2,583.00	17,047,800
近鉄グループホールディングス	59,200	4,500.00	266,400,000
阪急阪神ホールディングス	78,900	4,306.00	339,743,400
南海電気鉄道	26,400	2,918.00	77,035,200
京阪ホールディングス	32,600	3,474.00	113,252,400
神戸電鉄	2,200	2,851.00	6,272,200
名古屋鉄道	61,100	2,132.50	130,295,750
山陽電気鉄道	4,500	2,124.00	9,558,000
アルプス物流	4,700	1,900.00	8,930,000
トランコム	1,700	6,340.00	10,778,000
ヤマトホールディングス	75,800	2,403.50	182,185,300
山九	15,100	5,353.00	80,830,300
日新	4,500	2,855.00	12,847,500
丸全昭和運輸	3,700	4,430.00	16,391,000
センコーグループホールディングス	31,300	1,078.00	33,741,400
トナミホールディングス	1,000	4,420.00	4,420,000
ニッコンホールディングス	18,900	3,174.00	59,988,600
福山通運	6,800	4,215.00	28,662,000
セイノーホールディングス	33,300	2,233.00	74,358,900
神奈川中央交通	2,100	3,035.00	6,373,500

A Z - C O M丸和ホールディングス	15,100	1,430.00	21,593,000	
C & F ロジホールディングス	5,700	1,804.00	10,282,800	
日本郵船	169,700	4,824.00	818,632,800	
商船三井	128,500	5,324.00	684,134,000	
川崎汽船	47,500	7,146.00	339,435,000	
N S ユナイテッド海運	3,200	5,260.00	16,832,000	
明海グループ	2,500	788.00	1,970,000	
飯野海運	21,700	1,348.00	29,251,600	
共栄タンカー	600	1,131.00	678,600	
九州旅客鉄道	41,800	3,353.00	140,155,400	
S G ホールディングス	99,400	1,925.00	191,345,000	
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	20,100	8,061.00	162,026,100	
I D & E ホールディングス	3,700	3,720.00	13,764,000	
日本航空	145,400	2,790.00	405,666,000	
A N A ホールディングス	161,100	3,229.00	520,191,900	
パスコ	400	1,860.00	744,000	
T R E ホールディングス	11,700	1,231.00	14,402,700	
人・夢・技術グループ	3,300	1,763.00	5,817,900	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	1,600	6,730.00	10,768,000	
G e n k y D r u g S t o r e s	2,700	6,220.00	16,794,000	
K P P グループホールディングス	16,200	632.00	10,238,400	
ナルミヤ・インターナショナル	3,300	1,242.00	4,098,600	
ギフトホールディングス	2,700	2,929.00	7,908,300	
三菱倉庫	14,500	4,604.00	66,758,000	
三井倉庫ホールディングス	5,500	4,645.00	25,547,500	
住友倉庫	16,000	2,610.00	41,760,000	
澁澤倉庫	2,700	3,065.00	8,275,500	
ヤマタネ	2,800	2,555.00	7,154,000	
乾汽船	6,900	1,052.00	7,258,800	
日本トランスシティ	11,900	623.00	7,413,700	
中央倉庫	2,300	1,145.00	2,633,500	
安田倉庫	5,200	1,199.00	6,234,800	
大栄環境	11,100	2,649.00	29,403,900	
日本管財ホールディングス	6,400	2,583.00	16,531,200	
上組	27,300	3,443.00	93,993,900	
キューソー流通システム	6,700	928.00	6,217,600	
エーアイテイ	3,700	1,856.00	6,867,200	
内外トランスライン	2,600	2,421.00	6,294,600	
日本コンセプト	3,700	1,908.00	7,059,600	
T B S ホールディングス	29,900	4,254.00	127,194,600	
日本テレビホールディングス	52,600	2,185.00	114,931,000	
朝日放送グループホールディングス	9,500	690.00	6,555,000	
テレビ朝日ホールディングス	14,400	2,096.00	30,182,400	
スカパーJ S A T ホールディングス	46,200	896.00	41,395,200	
テレビ東京ホールディングス	4,300	3,015.00	12,964,500	
ビジョン	9,000	1,116.00	10,044,000	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	6,700	4,495.00	30,116,500	

日本通信	58,500	219.00	12,811,500
日本電信電話	17,686,900	181.60	3,211,941,040
KDDI	459,500	4,622.00	2,123,809,000
ソフトバンク	956,900	1,969.00	1,884,136,100
光通信	6,000	25,465.00	152,790,000
エムティーアイ	10,600	755.00	8,003,000
GMOインターネットグループ	22,000	2,569.00	56,518,000
KADOKAWA	31,400	3,133.00	98,376,200
学研ホールディングス	9,900	995.00	9,850,500
ゼンリン	10,200	851.00	8,680,200
東京電力ホールディングス	534,400	795.00	424,848,000
中部電力	218,500	1,916.00	418,646,000
関西電力	228,900	1,949.00	446,126,100
中国電力	103,000	989.60	101,928,800
北陸電力	60,600	720.50	43,662,300
東北電力	156,100	988.90	154,367,290
四国電力	55,200	1,041.00	57,463,200
九州電力	136,700	1,128.00	154,197,600
北海道電力	57,300	635.40	36,408,420
沖縄電力	15,100	1,094.00	16,519,400
電源開発	48,700	2,469.00	120,240,300
エフオン	14,100	411.00	5,795,100
イーレックス	10,500	750.00	7,875,000
レノバ	15,800	1,237.00	19,544,600
東京瓦斯	125,300	3,249.00	407,099,700
大阪瓦斯	120,100	3,089.00	370,988,900
東邦瓦斯	25,700	2,976.00	76,483,200
北海道瓦斯	3,500	2,274.00	7,959,000
広島ガス	1,800	385.00	693,000
西部ガスホールディングス	6,200	1,885.00	11,687,000
静岡ガス	11,800	908.00	10,714,400
メタウォーター	7,100	2,211.00	15,698,100
M&A総研ホールディングス	2,900	6,770.00	19,633,000
アイネット	3,600	2,182.00	7,855,200
松竹	3,100	10,060.00	31,186,000
東宝	33,100	4,950.00	163,845,000
エイチ・アイ・エス	17,700	1,685.00	29,824,500
東映	2,000	19,910.00	39,820,000
ラックランド	2,800	2,592.00	7,257,600
NTTデータグループ	155,500	2,336.00	363,248,000
共立メンテナンス	9,600	6,306.00	60,537,600
イチネンホールディングス	6,500	1,663.00	10,809,500
建設技術研究所	3,100	6,050.00	18,755,000
スペース	6,700	986.00	6,606,200
アインホールディングス	8,600	4,698.00	40,402,800
燦ホールディングス	5,700	1,038.00	5,916,600
ピー・シー・エー	5,300	1,613.00	8,548,900
ビジネスブレイン太田昭和	2,900	2,294.00	6,652,600
ナガワ	1,900	7,150.00	13,585,000
東京都競馬	5,100	4,200.00	21,420,000

カナモト	9,400	2,954.00	27,767,600	
D T S	12,500	3,885.00	48,562,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	27,200	6,614.00	179,900,800	
シーイーシー	7,500	1,815.00	13,612,500	
カブコン	53,200	5,877.00	312,656,400	
ニシオホールディングス	5,700	3,845.00	21,916,500	
アイ・エス・ビー	4,000	1,403.00	5,612,000	
日本空港ビルデング	20,700	5,853.00	121,157,100	
トランス・コスモス	7,600	2,990.00	22,724,000	
乃村工藝社	26,600	878.00	23,354,800	
ジャステック	4,700	1,366.00	6,420,200	
S C S K	41,600	2,693.50	112,049,600	
藤田観光	2,400	6,590.00	15,816,000	
トーカイ	5,400	2,138.00	11,545,200	
セコム	62,100	11,050.00	686,205,000	
N S W	2,600	2,948.00	7,664,800	
セントラル警備保障	3,300	2,612.00	8,619,600	
アイネス	4,600	1,488.00	6,844,800	
丹青社	11,800	799.00	9,428,200	
メイテックグループホールディングス	21,900	3,026.00	66,269,400	
T K C	9,400	3,700.00	34,780,000	
富士ソフト	12,000	6,140.00	73,680,000	
応用地質	5,700	2,345.00	13,366,500	
船井総研ホールディングス	12,700	2,661.00	33,794,700	
N S D	21,200	2,710.00	57,452,000	
コナミグループ	22,300	9,598.00	214,035,400	
学究社	3,100	2,090.00	6,479,000	
ベネッセホールディングス	20,500	2,595.50	53,207,750	
イオンディライト	6,500	3,535.00	22,977,500	
ナック	12,000	529.00	6,348,000	
福井コンピュータホールディングス	3,700	2,639.00	9,764,300	
ダイセキ	12,400	4,005.00	49,662,000	
ステップ	1,000	2,059.00	2,059,000	
泉州電業	2,900	3,760.00	10,904,000	
元気寿司	3,500	3,490.00	12,215,000	
トラスコ中山	13,200	2,339.00	30,874,800	
ヤマダホールディングス	192,900	433.40	83,602,860	
オートバックスセブン	21,800	1,644.00	35,839,200	
モリト	4,500	1,417.00	6,376,500	
アークランズ	18,700	1,657.00	30,985,900	
ニトリホールディングス	22,800	21,655.00	493,734,000	
愛眼	1,400	184.00	257,600	
ケーユーホールディングス	5,400	1,182.00	6,382,800	
吉野家ホールディングス	23,100	3,267.00	75,467,700	
加藤産業	7,800	4,805.00	37,479,000	
イノテック	3,900	1,911.00	7,452,900	
イエローハット	10,000	1,891.00	18,910,000	
松屋フーズホールディングス	3,000	5,570.00	16,710,000	
J B C Cホールディングス	3,900	3,815.00	14,878,500	

ＪＫホールディングス	5,900	1,031.00	6,082,900	
サガミホールディングス	9,400	1,494.00	14,043,600	
日伝	4,200	2,796.00	11,743,200	
関西フードマーケット	4,400	1,624.00	7,145,600	
ミロク情報サービス	5,400	1,994.00	10,767,600	
北沢産業	10,100	337.00	3,403,700	
杉本商事	3,000	2,256.00	6,768,000	
因幡電機産業	16,300	3,530.00	57,539,000	
王将フードサービス	4,600	7,720.00	35,512,000	
ミニストップ	4,600	1,631.00	7,502,600	
アークス	11,500	3,040.00	34,960,000	
パローホールディングス	12,000	2,459.00	29,508,000	
東テク	2,100	6,990.00	14,679,000	
ミスミグループ本社	94,700	2,095.00	198,396,500	
ベルク	3,100	6,570.00	20,367,000	
大 庄	4,700	1,317.00	6,189,900	
ファーストリテイリング	28,200	41,700.00	1,175,940,000	
ソフトバンクグループ	293,300	8,539.00	2,504,488,700	
スズケン	23,900	4,924.00	117,683,600	
サンドラッグ	21,200	4,530.00	96,036,000	
サクスパー ホールディングス	7,600	858.00	6,520,800	
ジェコス	5,800	1,162.00	6,739,600	
ヤマザワ	3,400	1,265.00	4,301,000	
ペルーナ	15,100	616.00	9,301,600	
合計	91,102,700		221,415,671,790	

(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)

2024年2月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,357,640,334
金銭信託	170,945,383
コール・ローン	17,461,196,954
株式	877,694,563,813
投資証券	16,762,695,473
派生商品評価勘定	1,462,162,594
未収入金	5,450,026
未収配当金	779,176,142
差入委託証拠金	12,431,713,910
流動資産合計	929,125,544,629
資産合計	
929,125,544,629	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,881,334
未払金	19,888
未払解約金	1,296,113,939
その他未払費用	10,746
流動負債合計	1,309,025,907
負債合計	
1,309,025,907	
純資産の部	
元本等	
元本	223,761,836,770
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	704,054,681,952
元本等合計	927,816,518,722
純資産合計	927,816,518,722
負債純資産合計	929,125,544,629

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9月15日 至 2024年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年2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	215,358,796,125円
同期中追加設定元本額	23,433,309,637円
同期中一部解約元本額	15,030,268,992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）	739,366,735円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,623,446,613円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,470,053,201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）	2,207,236,540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）	861,524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）	1,540,509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）	5,442,175円
ニッセイ外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	328,265,066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	157,574,659,757円
DCニッセイ外国株式インデックス	41,196,435,387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)	2,746,722,741円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	410,690,495円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	167,050,693円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	463,192,121円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	600,701,400円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	9,986,247円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)	88,365,540円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,804,800円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	10,084,248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)	3,613,549円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	20,142,830円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	331,146,180円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	209,596,916円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	392,170,483円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	140,138,125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)	161,215,453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)	258,753,732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)	162,384,060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)	159,073,167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)	158,413,828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)	141,522,171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)	30,763,743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)	7,700,481,694円
FWニッセイ先進国株インデックス	40,109,836円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	80,720,509円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド 2023-05 (適格機関投資家限定)	100,252,828円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	19,431,874円
計	223,761,836,770円
2. 受益権の総数	223,761,836,770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 2023年9月15日 至 2024年2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	2024年2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	2024年2月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	80,386,037,938	
投資証券	1,054,709,943	
合計	81,440,747,881	

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年11月21日から2024年2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	2024年2月20日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	15,146,185,868	-		15,247,504,496	101,318,628
アメリカ・ドル	10,694,356,604	-		10,769,691,803	75,335,199
イギリス・ポンド	1,564,252,732	-		1,572,145,877	7,893,145
ユーロ	2,887,576,532	-		2,905,666,816	18,090,284
合計	15,146,185,868	-		15,247,504,496	101,318,628

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2024年2月20日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	30,506,536,731	-		31,854,499,363	1,347,962,632
合計	30,506,536,731	-		31,854,499,363	1,347,962,632

（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）

	2024年2月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4,1464円 (41,464円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2024年2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	56,060	91.250	5,115,475.00	
	ABBOTT LABORATORIES	176,180	114.010	20,086,281.80	
	ABBVIE INC	179,201	177.490	31,806,385.49	
	ACCENTURE PLC	63,716	369.480	23,541,787.68	
	ADOBE INC	46,219	546.660	25,266,078.54	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	164,024	173.870	28,518,852.88	
	AECOM	13,377	89.190	1,193,094.63	
	AERCAP HOLDINGS NV	20,290	77.640	1,575,315.60	
	AES CORP	68,024	16.770	1,140,762.48	
	AFLAC INC	57,276	79.380	4,546,568.88	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,717	134.840	4,007,040.28	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	22,558	226.850	5,117,282.30	
	AIRBNB INC-CLASS A	43,282	152.510	6,600,937.82	
	AKAMA I TECHNOLOGIES INC	15,388	109.190	1,680,215.72	
	ALBEMARLE CORP	11,916	122.590	1,460,782.44	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	35,030	21.580	755,947.40	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	7,382	308.770	2,279,340.14	
	ALLEGION PLC	8,911	132.420	1,179,994.62	
	ALLIANT ENERGY CORP	25,623	48.350	1,238,872.05	
	ALLSTATE CORP	26,554	161.780	4,295,906.12	
	ALLY FINANCIAL INC	27,543	35.980	990,997.14	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,699	147.000	1,866,753.00	
	ALPHABET INC-CL A	601,929	140.520	84,583,063.08	
	ALPHABET INC-CL C	530,388	141.760	75,187,802.88	
	ALTRIA GROUP INC	180,212	40.180	7,240,918.16	
	AMAZON.COM INC	942,706	169.510	159,798,094.06	
	AMCOR PLC	147,058	9.040	1,329,404.32	
	AMEREN CORPORATION	26,655	69.510	1,852,789.05	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	52,292	81.350	4,253,954.20	
	AMERICAN EXPRESS CO	63,555	212.560	13,509,250.80	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,329	123.440	904,691.76	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	72,214	70.040	5,057,868.56	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	19,762	122.820	2,427,168.84	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,412	397.800	4,141,893.60	
AMETEK INC	23,424	173.890	4,073,199.36	
AMGEN INC	54,304	283.700	15,406,044.80	
AMPHENOL CORP-CL A	60,563	105.520	6,390,607.76	
ANALOG DEVICES INC	50,601	188.240	9,525,132.24	
ANSYS INC	8,810	329.850	2,905,978.50	
AON PLC	20,593	311.240	6,409,365.32	
APA CORP	31,087	31.570	981,416.59	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	40,299	112.710	4,542,100.29	
APPLE INC	1,587,177	182.310	289,358,238.87	
APPLIED MATERIALS INC	84,915	199.570	16,946,486.55	
APTIV PLC	28,721	78.960	2,267,810.16	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	37,831	86.110	3,257,627.41	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,435	53.650	2,920,437.75	
ARES MANAGEMENT CORP - A	16,577	134.970	2,237,397.69	
ARISTA NETWORKS INC	26,718	261.750	6,993,436.50	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,884	239.220	5,235,090.48	
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,946	182.750	538,381.50	
ASSURANT INC	5,376	173.720	933,918.72	
AT&T INC	727,029	16.970	12,337,682.13	
ATLISSIAN CORP-CL A	15,752	207.840	3,273,895.68	
ATMOS ENERGY CORP	15,066	113.950	1,716,770.70	
AUTODESK INC	21,697	258.300	5,604,335.10	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	41,831	252.970	10,581,988.07	
AUTOZONE INC	1,813	2,727.830	4,945,555.79	
AVANTOR INC	68,626	23.760	1,630,553.76	
AVERY DENNISON CORP	8,183	208.830	1,708,855.89	
AXON ENTERPRISE INC	7,214	269.800	1,946,337.20	
BAKER HUGHES COMPANY	102,495	29.150	2,987,729.25	
BALL CORP	31,987	62.090	1,986,072.83	
BANK OF AMERICA CORP	726,022	34.090	24,750,089.98	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	79,017	55.150	4,357,787.55	
BATH & BODY WORKS INC	21,922	45.400	995,258.80	
BAXTER INTERNATIONAL INC	51,421	41.220	2,119,573.62	
BECTON DICKINSON & CO	29,450	240.760	7,090,382.00	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	21,580	53.160	1,147,192.80	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	132,789	405.990	53,911,006.11	

BEST BUY CO INC	19,883	73.750	1,466,371.25	
BILL HOLDINGS, INC.	9,745	63.490	618,710.05	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,196	340.520	747,781.92	
BIO-TECHNE CORP	16,083	71.610	1,151,703.63	
BIOGEN INC	14,698	219.080	3,220,037.84	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	19,111	88.770	1,696,483.47	
BLACKROCK INC	15,157	794.000	12,034,658.00	
BLACKSTONE INC	72,059	127.890	9,215,625.51	
BLOCK INC	55,791	65.640	3,662,121.24	
BOEING CO	58,174	203.890	11,861,096.86	
BOOKING HOLDINGS INC	3,624	3,716.840	13,469,828.16	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,299	145.590	1,936,201.41	
BORGWARNER INC	23,863	30.610	730,446.43	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	148,622	65.820	9,782,300.04	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	212,099	49.860	10,575,256.14	
BROADCOM INC	45,052	1,245.480	56,111,364.96	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	11,991	197.920	2,373,258.72	
BROWN & BROWN INC	24,467	82.690	2,023,176.23	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	31,513	57.870	1,823,657.31	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	12,689	183.790	2,332,111.31	
BUNGE GLOBAL SA	15,288	91.680	1,401,603.84	
BURLINGTON STORES INC	6,584	195.170	1,284,999.28	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,811	72.250	853,344.75	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	27,591	290.300	8,009,667.30	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,861	42.510	929,311.11	
CAMPBELL SOUP CO	19,675	41.450	815,528.75	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,716	137.230	5,312,996.68	
CARDINAL HEALTH INC	25,004	104.450	2,611,667.80	
CARLISLE COS INC	5,067	341.920	1,732,508.64	
CARLYLE GROUP INC/THE	21,920	44.580	977,193.60	
CARMAX INC	16,104	71.880	1,157,555.52	
CARNIVAL CORP	102,267	14.800	1,513,551.60	
CARRIER GLOBAL CORP	85,040	54.000	4,592,160.00	
CATALENT INC	18,309	58.140	1,064,485.26	
CATERPILLAR INC	51,789	321.910	16,671,396.99	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,701	186.690	1,997,769.69	
CBRE GROUP INC	31,458	93.130	2,929,683.54	
CDW CORP/DE	13,608	241.370	3,284,562.96	
CELANESE CORP-SERIES A	10,491	151.060	1,584,770.46	
CELSIUS HOLDINGS INC	15,231	64.410	981,028.71	
CENCORA, INC.	17,327	231.720	4,015,012.44	

CENTENE CORP	54,981	78.740	4,329,203.94	
CENTERPOINT ENERGY INC	64,006	27.880	1,784,487.28	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,576	77.700	1,521,055.20	
CHARLES RIVER LABORATORIES	5,209	244.960	1,275,996.64	
CHARLES SCHWAB CORP	152,759	64.400	9,837,679.60	
CHARTER COMMUNICATIONS- CL A	9,874	293.000	2,893,082.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,485	162.770	1,543,873.45	
CHENIERE ENERGY INC	24,414	160.370	3,915,273.18	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,398	78.730	897,364.54	
CHEVRON CORP	184,199	154.630	28,482,691.37	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,801	2,598.430	7,278,202.43	
CHUBB LTD	41,691	250.900	10,460,271.90	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,984	97.780	2,442,935.52	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,923	111.860	1,781,146.78	
CINTAS CORP	9,305	614.660	5,719,411.30	
CISCO SYSTEMS INC	411,218	48.440	19,919,399.92	
CITIGROUP INC	195,473	54.850	10,721,694.05	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	47,925	31.560	1,512,513.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	51,641	19.870	1,026,106.67	
CLOROX CO	12,596	151.050	1,902,625.80	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	28,216	98.520	2,779,840.32	
CME GROUP INC	36,521	212.260	7,751,947.46	
CMS ENERGY CORP	29,580	57.270	1,694,046.60	
CNH INDUSTRIAL NV	101,405	12.150	1,232,070.75	
COCA-COLA CO	417,105	59.390	24,771,865.95	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	20,924	67.600	1,414,462.40	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	51,252	77.000	3,946,404.00	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	17,356	180.310	3,129,460.36	
COLGATE-PALMOLIVE CO	79,749	83.480	6,657,446.52	
COMCAST CORP	417,819	41.240	17,230,855.56	
CONAGRA BRANDS INC	48,579	27.210	1,321,834.59	
CONFLUENT INC-CLASS A	18,410	33.960	625,203.60	
CONOCOPHILLIPS	121,560	110.570	13,440,889.20	
CONSOLIDATED EDISON INC	35,003	87.320	3,056,461.96	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,779	243.840	4,091,391.36	
CONSTELLATION ENERGY	32,640	131.160	4,281,062.40	
COOPER COS INC/THE	5,024	372.010	1,868,978.24	
COPART INC	87,478	48.960	4,282,922.88	
CORNING INC	82,312	31.910	2,626,575.92	

CORTEVA INC	72,068	54.800	3,949,326.40	
COSTAR GROUP INC	41,464	81.400	3,375,169.60	
COSTCO WHOLESALE CORP	44,947	723.990	32,541,178.53	
COTERRA ENERGY INC	76,631	24.680	1,891,253.08	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	22,949	329.240	7,555,728.76	
CROWN HOLDINGS INC	12,237	72.260	884,245.62	
CSX CORP	203,625	36.720	7,477,110.00	
CUMMINS INC	14,384	266.480	3,833,048.32	
CVS HEALTH CORP	130,406	77.100	10,054,302.60	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,237	260.430	1,103,441.91	
DANAHER CORP	71,215	250.000	17,803,750.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,221	162.460	1,985,423.66	
DARLING INTERNATIONAL INC	16,199	42.610	690,239.39	
DATADOG INC - CLASS A	25,809	129.740	3,348,459.66	
DAVITA INC	5,556	122.220	679,054.32	
DAYFORCE, INC.	15,011	73.260	1,099,705.86	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,653	862.980	2,289,485.94	
DEERE & CO	27,776	360.680	10,018,247.68	
DELL TECHNOLOGIES -C	25,985	84.210	2,188,196.85	
DELTA AIR LINES INC	16,279	40.120	653,113.48	
DEVON ENERGY CORPORATION	65,039	43.460	2,826,594.94	
DEXCOM INC	39,381	117.050	4,609,546.05	
DIAMONDBACK ENERGY INC	17,227	179.420	3,090,868.34	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,238	169.150	1,055,157.70	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	25,371	110.490	2,803,241.79	
DOCUSIGN INC	20,621	50.220	1,035,586.62	
DOLLAR GENERAL CORP	22,286	141.500	3,153,469.00	
DOLLAR TREE INC	21,218	143.370	3,042,024.66	
DOMINION ENERGY INC	84,976	45.860	3,896,999.36	
DOMINO'S PIZZA INC	3,541	421.850	1,493,770.85	
DOORDASH INC - A	26,001	116.010	3,016,376.01	
DOVER CORP	14,198	161.460	2,292,409.08	
DOW INC	71,397	55.480	3,961,105.56	
DR HORTON INC	30,902	141.270	4,365,525.54	
DRAFTKINGS INC	42,388	44.570	1,889,233.16	
DROPBOX INC-CLASS A	26,243	25.080	658,174.44	
DTE ENERGY COMPANY	20,927	107.800	2,255,930.60	
DUKE ENERGY CORP	78,243	91.880	7,188,966.84	
DUPONT DE NEMOURS INC	46,572	68.450	3,187,853.40	
DYNATRACE INC	25,297	51.090	1,292,423.73	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,038	85.190	1,025,517.22	
EATON CORP PLC	40,508	277.520	11,241,780.16	
EBAY INC	53,976	43.450	2,345,257.20	
ECOLAB INC	26,043	215.380	5,609,141.34	

EDISON INTERNATIONAL	38,899	66.310	2,579,392.69	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	61,708	86.100	5,313,058.80	
ELECTRONIC ARTS INC	26,122	142.280	3,716,638.16	
ELEVANCE HEALTH, INC	23,925	512.630	12,264,672.75	
ELI LILLY & CO	81,917	782.060	64,064,009.02	
EMERSON ELECTRIC CO	58,027	106.150	6,159,566.05	
ENPHASE ENERGY INC	13,849	131.870	1,826,267.63	
ENTEGRIS INC	15,243	136.810	2,085,394.83	
ENTERGY CORP	21,463	100.150	2,149,519.45	
EOG RESOURCES INC	59,105	113.560	6,711,963.80	
EPAM SYSTEMS INC	5,886	311.980	1,836,314.28	
EQT CORP	39,646	34.700	1,375,716.20	
EQUIFAX INC	12,459	258.080	3,215,418.72	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,179	34.210	1,203,473.59	
ERIE INDEMNITY COMPANY- CL A	2,581	359.810	928,669.61	
ESSENTIAL UTILITIES INC	25,557	36.190	924,907.83	
ESTEE LAUDER COS INC	23,583	146.370	3,451,843.71	
ETSY INC	12,493	76.570	956,589.01	
EVEREST GROUP LTD	4,402	367.870	1,619,363.74	
EVERGY INC	23,311	50.030	1,166,249.33	
EVERSOURCE ENERGY	35,458	58.870	2,087,412.46	
EXACT SCIENCES CORP	18,347	60.970	1,118,616.59	
EXELON CORP	100,985	34.910	3,525,386.35	
EXPEDIA GROUP INC	13,988	135.250	1,891,877.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	15,000	124.160	1,862,400.00	
EXXON MOBIL CORP	406,712	103.730	42,188,235.76	
F5 INC	6,015	182.350	1,096,835.25	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,871	458.420	1,774,543.82	
FAIR ISAAC CORP	2,522	1,282.060	3,233,355.32	
FASTENAL CO	58,000	70.240	4,073,920.00	
FEDEX CORP	24,241	237.590	5,759,419.19	
FERGUSON PLC	20,707	198.990	4,120,485.93	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	26,261	52.390	1,375,813.79	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	60,175	63.650	3,830,138.75	
FIFTH THIRD BANCORP	69,127	33.930	2,345,479.11	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,097	1,514.990	1,661,944.03	
FIRST SOLAR INC	10,305	156.975	1,617,627.37	
FIRSTENERGY CORP	55,297	37.390	2,067,554.83	
FISERV INC	61,890	148.040	9,162,195.60	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,128	271.620	1,936,107.36	
FMC CORP	12,696	52.340	664,508.64	

FORD MOTOR CO	399,137	12.300	4,909,385.10	
FORTINET INC	67,768	68.480	4,640,752.64	
FORTIVE CORP	35,730	84.320	3,012,753.60	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	12,869	79.310	1,020,640.39	
FOX CORP - CLASS A	25,034	30.440	762,034.96	
FOX CORP- CLASS B	14,715	27.950	411,284.25	
FRANKLIN RESOURCES INC	30,386	27.270	828,626.22	
FREEMONT-MCMORAN INC	145,521	38.830	5,650,580.43	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,600	52.285	292,796.00	
GARMIN LTD	15,556	122.200	1,900,943.20	
GARTNER INC	8,003	448.610	3,590,225.83	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	41,550	86.020	3,574,131.00	
GEN DIGITAL INC	58,402	21.360	1,247,466.72	
GENERAL DYNAMICS CORP	23,564	269.440	6,349,084.16	
GENERAL ELECTRIC CO	110,480	149.160	16,479,196.80	
GENERAL MILLS INC	59,039	64.100	3,784,399.90	
GENERAL MOTORS CO	139,626	38.700	5,403,526.20	
GENUINE PARTS CO	14,266	142.930	2,039,039.38	
GILEAD SCIENCES INC	126,499	71.580	9,054,798.42	
GLOBAL PAYMENTS INC	26,395	134.190	3,541,945.05	
GLOBAL-E ONLINE LTD	9,179	40.980	376,155.42	
GLOBE LIFE INC	9,595	125.530	1,204,460.35	
GODADDY INC - CLASS A	14,145	109.980	1,555,667.10	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,465	384.440	12,865,284.60	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	192,551	3.530	679,705.03	
GRACO INC	17,162	88.150	1,512,830.30	
HALLIBURTON CO	91,207	35.310	3,220,519.17	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	31,007	93.060	2,885,511.42	
HASBRO INC	13,400	50.780	680,452.00	
HCA HEALTHCARE INC	20,709	308.550	6,389,761.95	
HEICO CORP	4,418	194.010	857,136.18	
HEICO CORP-CLASS A	7,669	157.190	1,205,490.11	
HENRY SCHEIN INC	13,250	75.650	1,002,362.50	
HERSHEY CO/THE	15,222	191.160	2,909,837.52	
HESS CORP	28,054	148.430	4,164,055.22	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	130,183	14.930	1,943,632.19	
HF SINCLAIR CORP	14,926	60.110	897,201.86	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	26,544	197.570	5,244,298.08	
HOLOGIC INC	24,858	73.790	1,834,271.82	
HOME DEPOT INC	101,531	362.350	36,789,757.85	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	67,412	197.170	13,291,624.04	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	112,300	3.240	363,852.00	
HORMEL FOODS CORP	30,568	28.990	886,166.32	

HOWMET AEROSPACE INC	39,734	62.820	2,496,089.88	
HP INC	90,267	28.580	2,579,830.86	
HUBBELL INC	5,445	358.880	1,954,101.60	
HUBSPOT INC	4,824	613.500	2,959,524.00	
HUMANA INC	12,580	366.920	4,615,853.60	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	147,113	12.870	1,893,344.31	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,049	285.090	1,154,329.41	
HYATT HOTELS CORP - CL A	4,658	132.830	618,722.14	
IDEX CORP	7,680	227.470	1,746,969.60	
IDEXX LABORATORIES INC	8,428	555.540	4,682,091.12	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	30,704	253.920	7,796,359.68	
ILLUMINA INC	16,081	143.410	2,306,176.21	
INCYTE CORP	19,331	57.960	1,120,424.76	
INGERSOLL-RAND INC	41,073	89.470	3,674,801.31	
INSULET CORP	7,092	191.010	1,354,642.92	
INTEL CORP	425,153	43.510	18,498,407.03	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	58,087	137.120	7,964,889.44	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	92,487	187.640	17,354,260.68	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	25,933	81.190	2,105,500.27	
INTERNATIONAL PAPER CO	33,364	35.800	1,194,431.20	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	39,126	32.450	1,269,638.70	
INTUIT INC	28,452	655.740	18,657,114.48	
INTUITIVE SURGICAL INC	35,671	378.630	13,506,110.73	
IQVIA HOLDINGS INC	18,593	238.600	4,436,289.80	
JABIL CIRCUIT INC	13,279	138.500	1,839,141.50	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,395	172.480	1,275,489.60	
JACOBS SOLUTIONS INC	12,777	147.540	1,885,118.58	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,100	41.280	664,608.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,076	126.780	770,315.28	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,388	211.700	1,775,739.60	
JM SMUCKER CO	10,783	124.090	1,338,062.47	
JOHNSON & JOHNSON	244,468	156.550	38,271,465.40	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,082	56.860	3,928,002.52	
JPMORGAN CHASE & CO	295,014	179.030	52,816,356.42	
JUNIPER NETWORKS INC	32,653	36.920	1,205,548.76	
KELLANOVA	27,846	55.470	1,544,617.62	
KENVUE INC	175,033	19.050	3,334,378.65	
KEURIG DR PEPPER INC	106,425	30.970	3,295,982.25	
KEYCORP	95,100	14.070	1,338,057.00	

KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	18,036	155.220	2,799,547.92	
KIMBERLY-CLARK CORP	34,350	118.290	4,063,261.50	
KINDER MORGAN INC	203,601	17.110	3,483,613.11	
KKR & CO INC -A	58,378	95.660	5,584,439.48	
KLA CORPORATION	13,838	661.350	9,151,761.30	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16,354	56.820	929,234.28	
KRAFT HEINZ CO/THE	87,306	34.810	3,039,121.86	
KROGER CO	69,357	47.640	3,304,167.48	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,210	211.980	4,072,135.80	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	8,981	216.640	1,945,643.84	
LAM RESEARCH CORP	13,423	926.030	12,430,100.69	
LAMB WESTON HOLDING INC	14,716	101.230	1,489,700.68	
LAS VEGAS SANDS CORP	34,914	55.250	1,928,998.50	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	14,001	73.240	1,025,433.24	
LEAR CORP	5,967	136.300	813,302.10	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,244	123.830	1,640,004.52	
LENNAR CORP-CL A	25,384	150.220	3,813,184.48	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,242	448.410	1,453,745.22	
LIBERTY BROADBAND-C	12,140	60.370	732,891.80	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	23,924	18.950	453,359.80	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	16,618	30.010	498,706.18	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	20,016	69.180	1,384,706.88	
LINDE PLC	49,538	431.630	21,382,086.94	
LIVE NATION INC	16,356	93.250	1,525,197.00	
LKQ CORP	27,165	50.040	1,359,336.60	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,671	424.070	9,614,090.97	
LOEWS CORP	19,370	74.340	1,439,965.80	
LOWE'S COS INC	58,588	226.850	13,290,687.80	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	7,680	257.660	1,978,828.80	
LUCID GROUP INC	92,996	3.710	345,015.16	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,711	449.600	5,265,265.60	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,326	97.700	2,572,050.20	
M&T BANK CORP	16,842	138.310	2,329,417.02	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	6,255	243.810	1,525,031.55	
MARATHON OIL CORP	61,312	23.380	1,433,474.56	
MARATHON PETROLEUM CORP	40,554	170.010	6,894,585.54	
MARKEL GROUP INC	1,278	1,461.500	1,867,797.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,824	219.040	837,608.96	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	25,732	241.630	6,217,623.16	
MARSH & MCLENNAN COS INC	50,149	200.300	10,044,844.70	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,274	539.870	3,387,144.38	

MARVELL TECHNOLOGY INC	87,601	66.290	5,807,070.29	
MASCO CORP	22,816	73.160	1,669,218.56	
MASTERCARD INC-CLASS A	85,417	468.130	39,986,260.21	
MATCH GROUP INC	28,223	37.590	1,060,902.57	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	25,525	66.150	1,688,478.75	
MCDONALD'S CORP	73,992	292.020	21,607,143.84	
MCKESSON CORP	13,693	511.060	6,997,944.58	
MEDTRONIC PLC	135,086	84.420	11,403,960.12	
MERCADOLIBRE INC	4,577	1,768.780	8,095,706.06	
MERCK & CO INC	257,618	127.790	32,921,004.22	
META PLATFORMS INC-A	225,631	473.320	106,795,664.92	
METLIFE INC	64,898	68.770	4,463,035.46	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,221	1,187.440	2,637,304.24	
MGM MIRAGE	28,473	42.540	1,211,241.42	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	55,262	81.610	4,509,931.82	
MICRON TECHNOLOGY INC	111,472	79.500	8,862,024.00	
MICROSOFT CORP	716,549	404.060	289,528,788.94	
MODERNA INC	32,862	88.370	2,904,014.94	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,920	401.720	2,378,182.40	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	19,266	62.150	1,197,381.90	
MONDAY.COM LTD	2,696	225.300	607,408.80	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	138,120	71.980	9,941,877.60	
MONGODB INC	7,242	465.060	3,367,964.52	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,610	730.500	3,367,605.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	79,769	55.020	4,388,890.38	
MOODY'S CORP	16,763	370.760	6,215,049.88	
MORGAN STANLEY	126,174	86.500	10,914,051.00	
MOSAIC CO/THE	33,713	30.550	1,029,932.15	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,960	320.490	5,435,510.40	
MSCI INC	8,029	568.750	4,566,493.75	
NASDAQ INC	34,906	55.420	1,934,490.52	
NETAPP INC	21,191	85.710	1,816,280.61	
NETFLIX INC	44,989	583.950	26,271,326.55	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,914	132.310	1,311,721.34	
NEWMONT CORP	116,932	33.430	3,909,036.76	
NEWS CORP - CLASS A	38,684	26.240	1,015,068.16	
NEXTERA ENERGY INC	208,232	57.030	11,875,470.96	
NIKE INC	124,266	103.510	12,862,773.66	
NISOURCE INC	41,878	25.900	1,084,640.20	
NORDSON CORP	5,211	264.070	1,376,068.77	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,046	252.040	5,808,513.84	
NORTHERN TRUST CORP	21,016	79.950	1,680,229.20	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,593	450.960	6,580,859.28	

NRG ENERGY INC	23,246	51.900	1,206,467.40	
NUCOR CORP	25,250	185.580	4,685,895.00	
NVIDIA CORP	250,753	726.130	182,079,275.89	
NVR INC	331	7,390.650	2,446,305.15	
NXP SEMICONDUCTORS NV	26,169	232.160	6,075,395.04	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,116	1,051.050	6,428,221.80	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	67,356	60.520	4,076,385.12	
OKTA INC	15,912	88.860	1,413,940.32	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,982	423.450	4,226,877.90	
OMNICOM GROUP	20,069	87.510	1,756,238.19	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	43,810	78.640	3,445,218.40	
ONEOK INC	59,126	71.990	4,256,480.74	
ORACLE CORP	166,858	111.310	18,572,963.98	
OTIS WORLDWIDE CORP	41,805	91.240	3,814,288.20	
OVINTIV INC	26,261	44.830	1,177,280.63	
OWENS CORNING	9,108	139.950	1,274,664.60	
PACCAR INC	53,078	107.770	5,720,216.06	
PACKAGING CORP OF AMERICA	9,123	167.980	1,532,481.54	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	187,363	24.440	4,579,151.72	
PALO ALTO NETWORKS INC	31,327	366.410	11,478,526.07	
PARAMOUNT GLOBAL	49,644	12.000	595,728.00	
PARKER HANNIFIN CORP	13,039	520.060	6,781,062.34	
PAYCHEX INC	33,016	123.380	4,073,514.08	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,529	190.820	1,055,043.78	
PAYLOCITY HOLDING CORP	4,566	177.390	809,962.74	
PAYPAL HOLDINGS INC	105,901	59.140	6,262,985.14	
PENTAIR PLC	16,750	74.920	1,254,910.00	
PEPSICO INC	139,592	166.320	23,216,941.44	
PFIZER INC	573,221	27.620	15,832,364.02	
PG&E CORP	205,674	16.430	3,379,223.82	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	157,622	89.650	14,130,812.30	
PHILLIPS 66	45,183	143.810	6,497,767.23	
PINTEREST INC- CLASS A	59,058	35.280	2,083,566.24	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	23,686	231.570	5,484,967.02	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,443	148.850	6,019,940.55	
POOL CORP	3,965	387.300	1,535,644.50	
PPG INDUSTRIES INC	23,913	141.910	3,393,493.83	
PPL CORPORATION	74,752	26.640	1,991,393.28	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,529	80.040	1,963,301.16	
PROCTER & GAMBLE CO	239,282	157.510	37,689,307.82	

PROGRESSIVE CORP	59,420	189.090	11,235,727.80	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	36,856	107.280	3,953,911.68	
PTC INC	12,060	178.190	2,148,971.40	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	50,639	59.790	3,027,705.81	
PULTE GROUP INC	22,254	101.450	2,257,668.30	
QORVO INC	9,926	112.170	1,113,399.42	
QUALCOMM INC	113,295	152.690	17,299,013.55	
QUANTA SERVICES INC	14,745	211.440	3,117,682.80	
QUEST DIAGNOSTICS	11,393	124.000	1,412,732.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	20,131	118.490	2,385,322.19	
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,836	948.050	10,273,069.80	
REGIONS FINANCIAL CORP	95,227	18.480	1,759,794.96	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	5,942	326.430	1,939,647.06	
REPLIGEN CORP	5,382	208.420	1,121,716.44	
REPUBLIC SERVICES INC	22,476	180.430	4,055,344.68	
RESMED INC	14,939	180.460	2,695,891.94	
REVVITY INC	12,615	102.460	1,292,532.90	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	66,888	16.300	1,090,274.40	
ROBERT HALF INC	10,870	80.840	878,730.80	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	43,807	14.000	613,298.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	43,158	42.910	1,851,909.78	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,662	279.720	3,262,094.64	
ROKU INC	12,602	72.000	907,344.00	
ROLLINS INC	29,551	41.050	1,213,068.55	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,832	545.570	5,909,614.24	
ROSS STORES INC	34,375	144.080	4,952,750.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	24,699	116.090	2,867,306.91	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	38,744	29.920	1,159,220.48	
RPM INTERNATIONAL INC	13,084	108.440	1,418,828.96	
RTX CORPORATION	147,788	91.010	13,450,185.88	
S&P GLOBAL INC	33,037	423.570	13,993,482.09	
SALESFORCE INC	98,777	289.720	28,617,672.44	
SCHLUMBERGER LTD	144,282	48.570	7,007,776.74	
SEA LTD-ADR	37,195	44.990	1,673,403.05	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,045	87.520	1,754,338.40	
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,370	65.870	748,941.90	
SEMPRA	63,883	70.490	4,503,112.67	
SERVICENOW INC	20,739	765.000	15,865,335.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,801	309.080	7,665,493.08	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	78,142	4.800	375,081.60	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,176	103.750	1,678,260.00	
SMITH (A.O.) CORP	12,641	80.090	1,012,417.69	
SNAP INC - A	104,193	11.170	1,163,835.81	

SNAP-ON INC	5,370	267.240	1,435,078.80	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	28,450	230.310	6,552,319.50	
SOUTHERN CO	110,705	66.480	7,359,668.40	
SOUTHWEST AIRLINES CO	15,198	33.930	515,668.14	
SPLUNK INC	16,247	155.370	2,524,296.39	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	22,650	63.460	1,437,369.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,558	88.350	1,374,549.30	
STARBUCKS CORP	116,285	93.220	10,840,087.70	
STATE STREET CORP	32,338	72.490	2,344,181.62	
STEEL DYNAMICS INC	15,973	123.340	1,970,109.82	
STERIS PLC	10,029	231.230	2,319,005.67	
STRYKER CORP	34,699	349.300	12,120,360.70	
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,834	803.320	3,883,248.88	
SYNCHRONY FINANCIAL	42,398	39.560	1,677,264.88	
SYNOPSYS INC	15,438	552.910	8,535,824.58	
SYSCO CORP	51,205	79.500	4,070,797.50	
T ROWE PRICE GROUP INC	22,770	108.860	2,478,742.20	
T-MOBILE US INC	54,009	160.410	8,663,583.69	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	17,241	153.380	2,644,424.58	
TARGA RESOURCES CORP	21,540	96.940	2,088,087.60	
TARGET CORP	46,870	149.610	7,012,220.70	
TE CONNECTIVITY LTD	31,876	142.400	4,539,142.40	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,782	432.260	2,067,067.32	
TELEFLEX INC	4,768	251.070	1,197,101.76	
TERADYNE INC	15,632	102.240	1,598,215.68	
TESLA, INC.	290,003	199.950	57,986,099.85	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	113,699	13.020	1,480,360.98	
TEXAS INSTRUMENTS INC	92,191	160.380	14,785,592.58	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	624	1,511.810	943,369.44	
TEXTRON INC	20,096	85.690	1,722,026.24	
THE CIGNA GROUP	30,047	341.090	10,248,731.23	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	39,184	547.840	21,466,562.56	
TJX COS INC	116,144	98.040	11,386,757.76	
TOAST INC-CLASS A	33,407	22.420	748,984.94	
TORO CO	10,553	93.760	989,449.28	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,048	236.490	2,612,741.52	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	45,307	88.930	4,029,151.51	
TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A	11,049	101.510	1,121,583.99	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	23,187	272.170	6,310,805.79	
TRANSDIGM GROUP INC	5,603	1,146.390	6,423,223.17	
TRANSUNION	19,629	75.070	1,473,549.03	

TRAVELERS COS INC/THE	23,238	217.530	5,054,962.14	
TRIMBLE INC	25,216	60.290	1,520,272.64	
TRUIST FINANCIAL CORP	135,232	36.100	4,881,875.20	
TWILIO INC - A	17,467	58.590	1,023,391.53	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,272	440.980	1,883,866.56	
TYSON FOODS INC-CL A	29,017	53.120	1,541,383.04	
U-HAUL HOLDING CO	9,852	65.350	643,828.20	
UBER TECHNOLOGIES INC	186,708	78.410	14,639,774.28	
UIPATH INC - CLASS A	39,336	24.960	981,826.56	
ULTA BEAUTY INC	4,995	532.090	2,657,789.55	
UNION PACIFIC CORP	61,868	246.590	15,256,030.12	
UNITED PARCEL SERVICE INC	73,431	148.410	10,897,894.71	
UNITED RENTALS INC	6,930	650.310	4,506,648.30	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,763	214.730	1,022,758.99	
UNITEDHEALTH GROUP INC	94,041	521.550	49,047,083.55	
UNITY SOFTWARE INC	25,317	33.900	858,246.30	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,304	162.160	1,022,256.64	
US BANCORP	155,642	41.490	6,457,586.58	
VAIL RESORTS INC	3,876	225.480	873,960.48	
VALERO ENERGY CORP	35,827	139.540	4,999,299.58	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	15,497	219.350	3,399,266.95	
VERALTO CORP	23,741	86.090	2,043,862.69	
VERISIGN INC	9,413	194.240	1,828,381.12	
VERISK ANALYTICS INC	14,719	244.700	3,601,739.30	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	427,380	40.490	17,304,616.20	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,202	422.200	11,062,484.40	
VERTIV HOLDINGS CO	34,772	62.970	2,189,592.84	
VF CORP	33,588	16.650	559,240.20	
VIATRIS INC	121,679	13.060	1,589,127.74	
VISA INC-CLASS A SHARES	163,121	278.560	45,438,985.76	
VISTRA CORP	33,532	45.580	1,528,388.56	
VULCAN MATERIALS CO	13,489	255.150	3,441,718.35	
WABTEC CORP	18,190	134.280	2,442,553.20	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	74,638	21.980	1,640,543.24	
WALMART INC	150,286	170.360	25,602,722.96	
WALT DISNEY CO	185,764	111.600	20,731,262.40	
WARNER BROS DISCOVERY INC	235,170	9.830	2,311,721.10	
WASTE CONNECTIONS INC	26,156	167.870	4,390,807.72	
WASTE MANAGEMENT INC	41,122	201.540	8,287,727.88	
WATERS CORP	6,000	325.210	1,951,260.00	
WATSCO INC	3,407	381.460	1,299,634.22	
WEC ENERGY GROUP INC	32,012	78.070	2,499,176.84	

	WELLS FARGO & CO	371,419	51.910	19,280,360.29	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,499	362.050	2,715,012.95	
	WESTERN DIGITAL CORP	32,906	54.000	1,776,924.00	
	WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,887	144.150	560,311.05	
	WESTROCK CO-WHEN ISSUED	26,050	43.710	1,138,645.50	
	WEYERHAEUSER CO	74,137	32.990	2,445,779.63	
	WILLIAMS COS INC	123,472	34.310	4,236,324.32	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,638	277.310	2,950,023.78	
	WIX.COM LTD	5,507	127.260	700,820.82	
	WORKDAY INC-CLASS A	21,010	302.670	6,359,096.70	
	WR BERKLEY CORP	20,895	82.610	1,726,135.95	
	WW GRAINGER INC	4,568	935.800	4,274,734.40	
	WYNN RESORTS LTD	10,404	105.130	1,093,772.52	
	XCEL ENERGY INC	55,971	59.070	3,306,206.97	
	XYLEM INC	24,454	123.790	3,027,160.66	
	YUM! BRANDS INC	28,450	134.550	3,827,947.50	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,212	275.460	1,435,697.52	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	15,526	54.800	850,824.80	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	21,203	124.710	2,644,226.13	
	ZOETIS INC	46,736	188.390	8,804,595.04	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	24,186	62.120	1,502,434.32	
	ZSCALER INC	8,964	252.750	2,265,651.00	
アメリカ・ドル	小計	34,528,546		4,399,015,174.37 (661,523,901,919)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	98,613	24.640	2,429,824.32	
	ABRDN PLC	192,013	1.606	308,372.87	
	ADMIRAL GROUP PLC	26,429	25.670	678,432.43	
	ANGLO AMERICAN PLC	128,982	17.780	2,293,299.96	
	ANTOFAGASTA PLC	39,990	17.650	705,823.50	
	ASHTAD GROUP PLC	44,451	53.760	2,389,685.76	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,965	22.910	801,048.15	
	ASTRAZENECA PLC	157,348	104.180	16,392,514.64	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	92,806	7.264	674,142.78	
	AVIVA PLC	278,344	4.303	1,197,714.23	
	BAE SYSTEMS PLC	308,611	12.480	3,851,465.28	
	BARCLAYS PLC	1,532,683	1.490	2,283,697.67	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	99,076	4.778	473,385.12	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	10,785	47.480	512,071.80	
	BP PLC	1,731,921	4.748	8,223,160.90	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	215,730	23.695	5,111,722.35	
	BT GROUP PLC	661,688	1.067	706,021.09	

BUNZL PLC	34,285	32.260	1,106,034.10	
BURBERRY GROUP PLC	36,912	13.195	487,053.84	
CENTRICA PLC	555,104	1.308	726,076.03	
COCA-COLA HBC AG-CDI	22,426	24.780	555,716.28	
COMPASS GROUP PLC	173,977	21.910	3,811,836.07	
CRH PLC	71,799	61.560	4,419,946.44	
CRODA INTERNATIONAL PLC	14,186	49.850	707,172.10	
DCC PLC	10,022	57.600	577,267.20	
DIAGEO PLC	228,207	29.405	6,710,426.83	
ENDEAVOUR MINING PLC	18,674	13.020	243,135.48	
ENTAIN PLC	64,884	9.220	598,230.48	
EXPERIAN PLC	93,371	34.050	3,179,282.55	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17,939	168.650	3,025,412.35	
GLENCORE PLC	1,062,384	3.954	4,200,666.33	
GSK PLC	415,616	16.692	6,937,462.27	
HALEON PLC	562,409	3.229	1,816,018.66	
HALMA PLC	38,554	22.750	877,103.50	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,110	8.166	294,874.26	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,787	19.875	333,641.62	
HSBC HOLDINGS PLC	1,977,771	6.382	12,622,134.52	
IMPERIAL BRANDS PLC	86,468	18.420	1,592,740.56	
INFORMA PLC	140,516	8.196	1,151,669.13	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	16,762	79.100	1,325,874.20	
INTERTEK GROUP PLC	16,363	44.790	732,898.77	
JD SPORTS FASHION PLC	263,056	1.131	297,516.33	
KINGFISHER PLC	192,045	2.226	427,492.17	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	607,799	2.387	1,450,816.21	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,445,775	0.428	2,758,791.70	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	42,270	88.640	3,746,812.80	
M&G PLC	228,750	2.243	513,086.25	
MELROSE INDUSTRIES PLC	136,607	6.186	845,050.90	
MONDI PLC/WI	44,785	13.795	617,809.07	
NATIONAL GRID PLC	374,296	10.215	3,823,433.64	
NATWEST GROUP PLC	584,848	2.250	1,315,908.00	
NEXT PLC	12,219	85.000	1,038,615.00	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
OCADO GROUP PLC	58,882	5.346	314,783.17	
PEARSON PLC	64,847	9.654	626,032.93	
PERSIMMON PLC	32,469	14.200	461,059.80	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	77,163	5.026	387,821.23	
PRUDENTIAL PLC	279,396	8.212	2,294,399.95	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	72,836	57.700	4,202,637.20	

	RELX PLC	191,759	34.120	6,542,817.08	
	RENTOKIL INITIAL PLC	256,209	4.210	1,078,639.89	
	RIO TINTO PLC	114,272	54.280	6,202,684.16	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	854,283	3.342	2,855,013.78	
	SAGE GROUP PLC	104,168	11.845	1,233,869.96	
	SAINSBURY (J) PLC	168,093	2.540	426,956.22	
	SCHRODERS PLC	81,699	4.044	330,390.75	
	SEVERN TRENT PLC	27,296	25.430	694,137.28	
	SHELL PLC-NEW	671,756	25.080	16,847,640.48	
	SMITH & NEPHEW PLC	88,602	11.325	1,003,417.65	
	SMITHS GROUP PLC	35,216	16.445	579,127.12	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,498	104.250	781,666.50	
	SSE PLC	110,795	15.980	1,770,504.10	
	ST JAMES'S PLACE PLC	55,883	6.568	367,039.54	
	STANDARD CHARTERED PLC	232,460	5.996	1,393,830.16	
	TAYLOR WIMPEY PLC	359,336	1.461	524,989.89	
	TESCO PLC	720,785	2.811	2,026,126.63	
	UNILEVER PLC	253,843	40.460	10,270,487.78	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	69,124	10.415	719,926.46	
	VODAFONE GROUP PLC	2,370,413	0.671	1,590,547.12	
	WHITBREAD PLC	19,581	35.140	688,076.34	
	WISE PLC - A	62,463	8.466	528,811.75	
	WPP PLC	109,133	7.830	854,511.39	
	イギリス・ポンド 小計	27,853,429		191,498,339.55 (36,250,635,677)	
イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	4,344	247.100	1,073,402.40	
	BANK HAPOLIM BM	128,890	32.290	4,161,858.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	154,726	27.920	4,319,949.92	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,707	742.200	2,009,135.40	
	ICL GROUP LTD	78,651	18.200	1,431,448.20	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	125,515	17.920	2,249,228.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	15,690	137.600	2,158,944.00	
	NICE LTD	6,427	820.500	5,273,353.50	
	イスラエル・シュケル 小計	516,950		22,677,320.32 (938,562,130)	
オーストラリ ア・ドル	AMPOL LTD	24,132	37.880	914,120.16	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	305,029	28.500	8,693,326.50	
	APA GROUP	130,491	8.040	1,049,147.64	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	59,246	44.130	2,614,525.98	
	ASX LTD	19,657	63.970	1,257,458.29	
	AURIZON HOLDINGS LTD	186,458	3.910	729,050.78	
	BHP GROUP LIMITED	514,521	46.040	23,688,546.84	
	BLUESCOPE STEEL LTD	45,748	22.330	1,021,552.84	
	BRAMBLES LTD	140,900	15.270	2,151,543.00	
	CARSALES.COM LTD	36,380	34.550	1,256,929.00	

COCHLEAR LTD	6,648	327.820	2,179,347.36	
COLES GROUP LTD	135,813	16.030	2,177,082.39	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	170,165	117.130	19,931,426.45	
COMPUTERSHARE LIMITED	55,160	26.370	1,454,569.20	
CSL LIMITED	49,048	281.030	13,783,959.44	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	145,555	5.410	787,452.55	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	171,935	28.400	4,882,954.00	
IDP EDUCATION LTD	26,879	19.560	525,753.24	
IGO LTD	69,265	7.250	502,171.25	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	247,009	6.170	1,524,045.53	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	44,670	56.570	2,526,981.90	
LOTTERY CORP LTD/THE	225,580	5.030	1,134,667.40	
MACQUARIE GROUP LTD	37,275	192.010	7,157,172.75	
MEDIBANK PRIVATE LTD	279,175	3.800	1,060,865.00	
MINERAL RESOURCES LTD	17,847	60.100	1,072,604.70	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	317,684	33.170	10,537,578.28	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	116,315	13.130	1,527,215.95	
ORICA LTD	46,176	16.890	779,912.64	
ORIGIN ENERGY LIMITED	174,689	8.690	1,518,047.41	
PILBARA MINERALS LTD	290,166	3.620	1,050,400.92	
QANTAS AIRWAYS LTD	85,178	5.730	488,069.94	
QBE INSURANCE GROUP LTD	151,542	16.710	2,532,266.82	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	18,638	50.820	947,183.16	
REA GROUP LTD	5,364	188.280	1,009,933.92	
REECE LTD	22,976	23.290	535,111.04	
RIO TINTO LTD	37,633	130.960	4,928,417.68	
SANTOS LTD	329,395	7.330	2,414,465.35	
SEEK LTD	36,149	25.380	917,461.62	
SONIC HEALTHCARE LTD	45,768	31.710	1,451,303.28	
SOUTH32 LTD	459,947	2.940	1,352,244.18	
SUNCORP GROUP LTD	128,853	14.430	1,859,348.79	
TELSTRA GROUP LTD	420,984	3.900	1,641,837.60	
TRANSURBAN GROUP	313,623	13.170	4,130,414.91	
TREASURY WINE ESTATES LTD	81,048	11.690	947,451.12	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	23,767	34.150	811,643.05	
WESFARMERS LIMITED	115,180	63.990	7,370,368.20	
WESTPAC BANKING CORP	356,262	25.240	8,992,052.88	
WISETECH GLOBAL LTD	16,938	78.590	1,331,157.42	

	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	192,777	30.530	5,885,481.81	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	123,955	35.700	4,425,193.50	
	XERO LTD	14,603	114.800	1,676,424.40	
	オーストラリア・ドル 小計	7,070,196		175,138,240.06 (17,200,326,556)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	50,343	64.460	3,245,109.78	
	AIR CANADA	18,039	18.000	324,702.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	67,324	8.120	546,670.88	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	78,595	82.000	6,444,790.00	
	ALTAGAS LTD	28,902	28.250	816,481.50	
	ARC RESOURCES LTD	61,797	22.400	1,384,252.80	
	BANK OF MONTREAL	73,415	127.030	9,325,907.45	
	BANK OF NOVA SCOTIA	122,757	63.860	7,839,262.02	
	BARRICK GOLD CORP	178,320	19.740	3,520,036.80	
	BCE INC	9,057	50.830	460,367.31	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	35,792	55.080	1,971,423.36	
	BROOKFIELD CORPORATION-A	141,636	54.430	7,709,247.48	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	13,940	34.200	476,748.00	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,525	89.790	316,509.75	
	CAE INC	32,476	25.660	833,334.16	
	CAMECO CORP	44,035	56.860	2,503,830.10	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	94,264	61.930	5,837,769.52	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	56,700	175.060	9,925,902.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	110,866	85.160	9,441,348.56	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	94,708	115.190	10,909,414.52	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,395	140.010	755,353.95	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	13,833	30.180	417,479.94	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	15,322	58.380	894,498.36	
	CENOVUS ENERGY INC	144,777	23.500	3,402,259.50	
	CGI INC	21,311	154.800	3,298,942.80	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,047	3,710.830	7,596,069.01	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	8,728	117.050	1,021,612.40	
	DOLLARAMA INC	28,814	103.340	2,977,638.76	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	39,850	22.590	900,211.50	
	EMERA INC	28,119	48.380	1,360,397.22	
	EMPIRE CO LTD 'A'	14,934	34.660	517,612.44	
	ENBRIDGE INC	216,400	46.460	10,053,944.00	

FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,168	1,374.970	2,980,934.96	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	59,932	12.120	726,375.84	
FIRSTSERVICE CORP	4,127	222.990	920,279.73	
FORTIS INC	49,726	52.950	2,632,991.70	
FRANCO-NEVADA CORP	19,538	147.120	2,874,430.56	
GEORGE WESTON LTD	6,379	173.650	1,107,713.35	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	23,729	49.850	1,182,890.65	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,959	46.560	836,171.04	
GREAT-WEST LIFECO INC	28,730	41.780	1,200,339.40	
HYDRO ONE LTD	33,995	40.580	1,379,517.10	
IA FINANCIAL CORP INC	10,434	92.640	966,605.76	
IGM FINANCIAL INC	8,941	35.100	313,829.10	
IMPERIAL OIL LTD	20,261	80.750	1,636,075.75	
INTACT FINANCIAL CORP	18,160	228.670	4,152,647.20	
IVANHOE MINES LTD-CL A	62,210	14.470	900,178.70	
KEYERA CORP	23,584	32.740	772,140.16	
KINROSS GOLD CORP	124,626	6.830	851,195.58	
LOBLAW COS LTD	16,070	137.760	2,213,803.20	
LUNDIN MINING CORP	67,181	11.690	785,345.89	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,743	74.110	2,056,033.73	
MANULIFE FINANCIAL CORP	185,325	33.300	6,171,322.50	
MEG ENERGY CORP	29,083	25.870	752,377.21	
METRO INC	23,574	71.020	1,674,225.48	
NATIONAL BANK OF CANADA	34,496	103.710	3,577,580.16	
NORTHLAND POWER INC	26,125	24.000	627,000.00	
NUTRIEN LTD	50,276	68.920	3,465,021.92	
ONEX CORPORATION	6,889	102.740	707,775.86	
OPEN TEXT CORP	27,670	53.930	1,492,243.10	
PAN AMERICAN SILVER CORP	37,026	17.670	654,249.42	
PARKLAND CORP	14,360	45.710	656,395.60	
PEMBINA PIPELINE CORP	56,195	45.910	2,579,912.45	
POWER CORP OF CANADA	58,958	38.320	2,259,270.56	
QUEBECOR INC -CL B	16,334	31.770	518,931.18	
RB GLOBAL INC	18,521	92.980	1,722,082.58	
RESTAURANT BRANDS INTERN	29,289	104.110	3,049,277.79	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	36,542	61.550	2,249,160.10	
ROYAL BANK OF CANADA	141,884	131.940	18,720,174.96	
SAPUTO INC	25,995	28.220	733,578.90	
SHOPIFY INC - CLASS A	122,178	109.620	13,393,152.36	
STANTEC INC	11,377	112.570	1,280,708.89	
SUN LIFE FINANCIAL INC	59,884	72.770	4,357,758.68	
SUNCOR ENERGY INC	132,245	44.580	5,895,482.10	
TC ENERGY CORP	104,692	53.320	5,582,177.44	
TECK RESOURCES LTD-CL B	46,836	52.220	2,445,775.92	
TFI INTERNATIONAL INC	8,297	197.060	1,635,006.82	

	THOMSON REUTERS CORP	16,255	216.260	3,515,306.30	
	TMX GROUP LTD	28,616	34.180	978,094.88	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	8,448	124.580	1,052,451.84	
	TORONTO-DOMINION BANK	184,951	80.870	14,956,987.37	
	TOURMALINE OIL CORP	32,867	57.230	1,880,978.41	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,813	107.530	625,071.89	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	46,053	59.910	2,759,035.23	
	WSP GLOBAL INC	12,741	207.950	2,649,490.95	
カナダ・ドル 小計		4,121,309		262,136,686.12 (29,196,784,100)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	264,000	2.880	760,320.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	50,400	6.110	307,944.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	183,800	34.130	6,273,094.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	613,000	1.060	649,780.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,000	26.330	263,300.00	
	KEPPEL CORP LTD	148,000	7.330	1,084,840.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	343,600	13.330	4,580,188.00	
	SEATRIUM LTD	4,496,352	0.090	404,671.68	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	90,300	5.750	519,225.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	150,900	7.300	1,101,570.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	86,800	9.370	813,316.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	158,400	3.900	617,760.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	848,300	2.370	2,010,471.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	128,300	29.420	3,774,586.00	
UOL Group Limited	46,800	6.150	287,820.00		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,800	3.250	633,100.00		
シンガポール・ドル 小計		7,813,752		24,081,985.68 (2,689,235,341)	
スイス・フラン	ABB LTD	162,355	40.030	6,499,070.65	
	ADECCO GROUP AG-REG	16,239	36.420	591,424.38	
	ALCON INC	50,710	68.420	3,469,578.20	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	3,436	66.000	226,776.00	
	BALOISE HOLDING AG	4,641	143.300	665,055.30	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,050	106.900	326,045.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	362	1,306.000	472,772.00	
	BKW AG	2,134	133.500	284,889.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	97	11,300.000	1,096,100.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	11	112,000.000	1,232,000.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON- REG	52,999	135.900	7,202,564.10	

	CLARIANT AG	21,886	11.000	240,746.00	
	DUFREY AG-REG	9,888	35.510	351,122.88	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	715	628.000	449,020.00	
	GEBERIT AG-REG	3,393	509.600	1,729,072.80	
	GIVAUDAN-REG	937	3,704.000	3,470,648.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	3,761	123.200	463,355.20	
	HOLCIM LTD	52,879	68.400	3,616,923.60	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20,905	48.770	1,019,536.85	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,515	284.400	1,568,466.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	16,687	77.120	1,286,901.44	
	LONZA GROUP AG	7,562	456.000	3,448,272.00	
	NESTLE SA	271,054	98.610	26,728,634.94	
	NOVARTIS AG	208,063	89.560	18,634,122.28	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,303	1,241.000	2,858,023.00	
	ROCHE HOLDING AG	71,310	232.000	16,543,920.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	3,264	246.200	803,596.80	
	SANDOZ GROUP AG	41,555	28.960	1,203,432.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,419	221.800	536,534.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,099	230.500	944,819.50	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	15,216	84.660	1,288,186.56	
	SIG GROUP AG	31,061	18.070	561,272.27	
	SIKA AG-BEARER	15,481	258.000	3,994,098.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,144	285.600	1,469,126.40	
	STRAUMANN HOLDING AG	11,335	144.950	1,643,008.25	
	SWATCH GROUP AG	2,926	219.200	641,379.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,994	640.600	1,917,956.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,775	85.750	666,706.25	
	SWISS RE AG	30,605	100.150	3,065,090.75	
	SWISSCOM AG	2,679	516.400	1,383,435.60	
	TEMENOS GROUP AG-REG	6,482	65.960	427,552.72	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,388	42.300	227,912.40	
	UBS GROUP AG	333,762	24.500	8,177,169.00	
	VAT GROUP AG	2,743	431.100	1,182,507.30	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,857	440.500	6,544,508.50	
スイス・フラン	小計	1,532,677		141,153,332.52 (24,039,824,061)	
スウェーデン・ クローナ	ALFA LAVAL AB	29,333	377.300	11,067,340.90	
	ASSA ABLOY AB	101,654	288.900	29,367,840.60	
	ATLAS COPCO AB	158,545	152.950	24,249,457.75	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	272,562	176.800	48,188,961.60	

BEIJER REF AB	39,146	145.400	5,691,828.40		
BIOVITRUM	19,706	260.000	5,123,560.00		
BOLIDEN AB	27,716	276.050	7,651,001.80		
EPIROC AB-A	66,819	194.800	13,016,341.20		
EPIROC AB-B	39,664	173.800	6,893,603.20		
EQT AB	36,110	280.300	10,121,633.00		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	61,776	240.400	14,850,950.40		
EVOLUTION AB	18,611	1,300.800	24,209,188.80		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	66,149	65.940	4,361,865.06		
GETINGE AB-B SHS	23,193	205.900	4,775,438.70		
HENNES & MAURITZ AB	65,536	142.060	9,310,044.16		
HEXAGON AB-B SHS	210,768	117.900	24,849,547.20		
HOLMEN AB-B SHARES	7,708	404.400	3,117,115.20		
HUSQVARNA AB-B SHS	35,432	78.500	2,781,412.00		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	13,351	342.900	4,578,057.90		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,543	342.800	4,985,340.40		
INDUTRADE AB	27,781	279.100	7,753,677.10		
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	15,060	265.800	4,002,948.00		
INVESTOR AB	175,580	256.200	44,983,596.00		
LIFCO AB-B SHS	23,662	276.500	6,542,543.00		
LUNDBERGS AB-B SHS	7,639	560.000	4,277,840.00		
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	153,937	58.440	8,996,078.28		
SAAB AB-B	8,116	797.000	6,468,452.00		
SAGAX AB-B	20,082	255.900	5,138,983.80		
SANDVIK AB	108,145	223.400	24,159,593.00		
SECURITAS AB	49,811	107.350	5,347,210.85		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	160,900	152.100	24,472,890.00		
SKANSKA AB-B SHS	34,491	185.000	6,380,835.00		
SKF AB	34,535	217.700	7,518,269.50		
SVENSKA CELLULOSA AB	61,401	142.150	8,728,152.15		
SVENSKA HANDELSBANKEN	147,855	123.500	18,260,092.50		
SWEDBANK AB - A SHARES	86,104	218.400	18,805,113.60		
TELE2 AB	56,411	83.440	4,706,933.84		
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	297,160	56.090	16,667,704.40		
TELIA CO AB	249,402	24.620	6,140,277.24		
VOLVO AB	152,689	270.850	41,355,815.65		
VOLVO AB-A SHS	20,739	277.400	5,752,998.60		
VOLVO CAR AB-B	60,370	38.700	2,336,319.00		
スウェーデン・クローナ 小計	3,260,192		537,986,851.78 (7,779,289,877)		
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	488	10,740.000	5,241,120.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	312	10,550.000	3,291,600.00	
	CARLSBERG AS-B	9,988	947.800	9,466,626.40	
	COLOPLAST-B	13,874	885.200	12,281,264.80	

	DANSKE BANK A/S	69,967	193.500	13,538,614.50	
	DEMANT A/S	10,214	364.500	3,723,003.00	
	DSV A/S	18,893	1,146.000	21,651,378.00	
	GENMAB A/S	6,710	2,033.000	13,641,430.00	
	NOVO-NORDISK A/S	331,293	858.000	284,249,394.00	
	NOVOZYMES A/S	37,174	372.400	13,843,597.60	
	ORSTED A/S	19,227	397.600	7,644,655.20	
	PANDORA A/S	8,575	1,144.500	9,814,087.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	933	2,207.000	2,059,131.00	
	TRYGVESTA AS	35,513	144.600	5,135,179.80	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	102,529	184.500	18,916,600.50	
デンマーク・クローネ 小計		665,690		424,497,682.30 (9,220,089,660)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	133,749	8.150	1,090,054.35	
	EBOS GROUP LTD	15,569	36.710	571,537.99	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	58,983	23.950	1,412,642.85	
	MERCURY NZ LTD	70,246	6.685	469,594.51	
	MERIDIAN ENERGY LTD	130,900	5.620	735,658.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	191,016	5.100	974,181.60	
ニュージーランド・ドル 小計		600,463		5,253,669.30 (485,071,286)	
ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	35,506	114.000	4,047,684.00	
	AKER BP ASA	32,035	262.300	8,402,780.50	
	DNB BANK ASA	93,748	206.800	19,387,086.40	
	EQUINOR ASA	91,374	267.600	24,451,682.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20,217	171.800	3,473,280.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,909	662.500	5,902,212.50	
	MOWI ASA	47,177	201.700	9,515,600.90	
	NORSK HYDRO ASA	134,553	57.040	7,674,903.12	
	ORKLA ASA	70,763	75.520	5,344,021.76	
	SALMAR ASA	7,361	628.600	4,627,124.60	
	TELENOR ASA	65,886	115.100	7,583,478.60	
YARA INTERNATIONAL ASA	16,744	354.700	5,939,096.80		
ノルウェー・クローネ 小計		624,273		106,348,952.18 (1,523,980,485)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	48,205	14.825	714,639.12	
	ACCIONA SA	2,506	107.500	269,395.00	
	ACCOR	20,104	37.250	748,874.00	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,149	36.450	770,881.05	
	ADIDAS AG	16,443	179.720	2,955,135.96	
	ADP	3,512	124.700	437,946.40	
	ADYEN NV	2,205	1,494.800	3,296,034.00	
	AEGON LTD	164,722	5.358	882,580.47	
	AENA SME SA	7,604	168.250	1,279,373.00	

AGEAS	16,190	39.010	631,571.90	
AIB GROUP PLC	159,180	4.218	671,421.24	
AIR LIQUIDE	53,163	171.680	9,127,023.84	
AIRBUS SE	60,177	144.300	8,683,541.10	
AKZO NOBEL NV	17,295	68.720	1,188,512.40	
ALLIANZ SE	40,936	248.650	10,178,736.40	
ALSTOM RGPT	29,275	11.350	332,271.25	
AMADEUS IT GROUP SA	45,719	60.720	2,776,057.68	
AMPLIFON SPA	12,641	31.480	397,938.68	
AMUNDI SA	6,244	60.350	376,825.40	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	88,158	58.230	5,133,440.34	
ARCELORMITTAL	51,763	24.855	1,286,569.36	
ARGENX SE	5,999	369.000	2,213,631.00	
ARKEMA	6,081	97.120	590,586.72	
ASM INTERNATIONAL NV	4,765	568.900	2,710,808.50	
ASML HOLDING NV	40,925	859.500	35,175,037.50	
ASR NEDERLAND NV	16,085	43.030	692,137.55	
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	102,793	20.800	2,138,094.40	
AXA SA	183,134	31.010	5,678,985.34	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	605,295	9.026	5,463,392.67	
BANCO BPM SPA	122,757	4.920	603,964.44	
BANCO SANTANDER SA	1,641,828	3.737	6,135,511.23	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	107,147	8.524	913,321.02	
BASF SE	90,640	45.775	4,149,046.00	
BAYER AG	99,732	28.900	2,882,254.80	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,330	102.820	3,324,170.60	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,013	96.950	582,960.35	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	7,823	158.550	1,240,336.65	
BECHTLE AG	8,308	46.510	386,405.08	
BEIERSDORF AG	10,218	136.450	1,394,246.10	
BIOMERIEUX	4,200	103.800	435,960.00	
BNP PARIBAS	106,614	54.770	5,839,248.78	
BOLLORE SE	74,922	6.215	465,640.23	
BOUYGUES	19,359	34.260	663,239.34	
BRENTAG SE	14,108	80.800	1,139,926.40	
BUREAU VERITAS SA	29,937	25.280	756,807.36	
CAIXABANK	418,779	4.038	1,691,029.60	
CAPGEMINI SA	15,857	221.500	3,512,325.50	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,092	111.400	455,848.80	
CARREFOUR SA	58,329	15.330	894,183.57	
CELLNEX TELECOM SAU	57,662	33.150	1,911,495.30	

CIE DE SAINT-GOBAIN	46,241	68.550	3,169,820.55	
COMMERZBANK AG	106,875	10.730	1,146,768.75	
CONTINENTAL AG	11,152	74.020	825,471.04	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	6,655	20.900	139,089.50	
COVESTRO AG	19,629	46.980	922,170.42	
CREDIT AGRICOLE SA	108,335	12.364	1,339,453.94	
D'ETEREN GROUP	2,187	171.000	373,977.00	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	54,281	35.160	1,908,519.96	
DANONE	65,332	61.520	4,019,224.64	
DASSAULT AVIATION SA	2,048	180.900	370,483.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	67,825	43.540	2,953,100.50	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	53,049	9.820	520,941.18	
DELIVERY HERO SE	17,884	22.600	404,178.40	
DEUTSCHE BANK AG	196,556	11.996	2,357,885.77	
DEUTSCHE BOERSE AG	19,280	187.100	3,607,288.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	60,583	7.337	444,497.47	
DEUTSCHE TELEKOM AG	330,482	22.270	7,359,834.14	
DHL GROUP	100,606	42.995	4,325,554.97	
DIASORIN ITALIA SPA	2,273	89.440	203,297.12	
DR ING HC F PORSCHE AG	11,566	79.640	921,116.24	
DSM-FIRMENICH AG	18,883	103.900	1,961,943.70	
E.ON SE	227,789	11.840	2,697,021.76	
EDENRED	25,340	55.140	1,397,247.60	
EDP RENOVAVEIS SA	31,263	14.065	439,714.09	
EIFFAGE	7,442	96.680	719,492.56	
ELIA GROUP SA/NV	2,985	104.300	311,335.50	
ELISA OYJ	14,895	42.260	629,462.70	
ENAGAS SA	25,256	14.550	367,474.80	
ENDESA SA	32,157	16.580	533,163.06	
ENEL SPA	825,296	5.861	4,837,059.85	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	318,469	3.754	1,195,532.62	
ENGIE	185,472	14.320	2,655,959.04	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	239,714	14.170	3,396,747.38	
ERSTE GROUP BANK AG	34,864	39.000	1,359,696.00	
ESSILORLUXOTTICA	29,932	188.840	5,652,358.88	
EURAZEO	4,396	78.400	344,646.40	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,702	57.820	792,249.64	
EURONEXT NV	8,694	81.450	708,126.30	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,688	17.125	405,657.00	
EXOR NV	9,414	98.640	928,596.96	
FERRARI NV	12,796	361.600	4,627,033.60	
FERROVIAL SE	51,989	35.160	1,827,933.24	
FINECOBANK SPA	62,040	13.010	807,140.40	
FORTUM OYJ	45,565	10.985	500,531.52	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	20,839	39.460	822,306.94	
FRESENIUS SE & CO KGAA	42,870	26.670	1,143,342.90	

GALP ENERGIA SGPS SA	45,924	14.525	667,046.10	
GEA GROUP AG	16,607	37.490	622,596.43	
GETLINK SE - REGR	36,231	15.325	555,240.07	
GRIFOLS SA	30,251	10.970	331,853.47	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,891	70.900	630,371.90	
HANNOVER RUECK SE	6,116	227.800	1,393,224.80	
HEIDELBERG MATERIALS AG	14,133	85.800	1,212,611.40	
HEINEKEN HOLDING NV	13,116	73.950	969,928.20	
HEINEKEN NV	29,210	89.460	2,613,126.60	
HELLOFRESH SE	15,782	12.105	191,041.11	
HENKEL AG & CO KGAA	10,620	63.320	672,458.40	
HENKEL KGAA-VORZUG	17,118	70.580	1,208,188.44	
HERMES INTERNATIONAL	3,216	2,212.500	7,115,400.00	
IBERDROLA SA	612,173	10.795	6,608,407.53	
IMCD NV	5,787	142.500	824,647.50	
INDITEX SA	110,725	39.670	4,392,460.75	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	132,574	33.140	4,393,502.36	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	35,679	10.725	382,657.27	
ING GROEP NV-CVA	367,290	12.458	4,575,698.82	
INTESA SANPAOLO	1,577,252	2.839	4,477,818.42	
IPSEN	3,819	106.100	405,195.90	
JDE PEET'S BV	9,843	23.000	226,389.00	
JERONIMO MARTINS	28,751	21.960	631,371.96	
KBC GROEP NV	25,414	62.900	1,598,540.60	
KERING	7,559	428.000	3,235,252.00	
KERRY GROUP PLC-A	16,163	78.680	1,271,704.84	
KESKO OYJ-B SHS	27,730	17.900	496,367.00	
KINGSPAN GROUP PLC	15,696	83.040	1,303,395.84	
KNORR-BREMSE AG	7,353	58.800	432,356.40	
KONE OYJ	34,499	46.230	1,594,888.77	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	97,430	27.450	2,674,453.50	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	80,068	18.860	1,510,082.48	
L'OREAL SA	24,486	441.300	10,805,671.80	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10,686	38.920	415,899.12	
LEG IMMOBILIEN SE	7,525	70.820	532,920.50	
LEGRAND SA	26,898	89.680	2,412,212.64	
LEONARDO SPA	40,963	19.190	786,079.97	
LOTUS BAKERIES	42	9,080.000	381,360.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	28,034	821.900	23,041,144.60	
MEDIOBANCA SPA	55,997	11.780	659,644.66	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	81,458	67.630	5,509,004.54	
MERCK KGAA	13,119	155.750	2,043,284.25	
METSO CORPORATION	67,372	10.165	684,836.38	
MICHELIN (C.G.D.E.)	68,853	33.000	2,272,149.00	

MONCLER SPA	20,920	62.560	1,308,755.20	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	5,463	225.100	1,229,721.30	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	13,847	407.400	5,641,267.80	
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,729	22.900	291,494.10	
NEMETSCHKE SE	5,858	85.980	503,670.84	
NESTE OYJ	42,931	27.330	1,173,304.23	
NEXI SPA	59,992	7.116	426,903.07	
NN GROUP NV	27,469	37.200	1,021,846.80	
NOKIA OYJ	548,357	3.270	1,793,127.39	
NORDEA BANK ABP	324,909	11.100	3,606,489.90	
OCI NV	10,743	25.680	275,880.24	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS- A	6,912	63.000	435,456.00	
OMV AG	14,953	40.970	612,624.41	
ORANGE S.A.	192,253	10.846	2,085,176.03	
ORION OYJ-CLASS B	10,930	39.100	427,363.00	
PERNOD-RICARD	20,759	157.450	3,268,504.55	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	15,519	46.060	714,805.14	
POSTE ITALIANE SPA	53,034	10.100	535,643.40	
PROSUS	148,489	28.720	4,264,604.08	
PRYSMIAN SPA	26,631	43.240	1,151,524.44	
PUBLICIS GROUPE	23,243	98.100	2,280,138.30	
PUMA AG	10,713	42.580	456,159.54	
QIAGEN NV	22,420	39.590	887,607.80	
RANDSTAD NV	11,188	51.600	577,300.80	
RATIONAL AG	520	758.500	394,420.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	10,609	51.240	543,605.16	
REDEIA CORPORACION SA	41,383	14.820	613,296.06	
REMY COINTREAU	2,343	99.340	232,753.62	
RENAULT SA	19,466	38.085	741,362.61	
REPSOL SA	129,291	13.810	1,785,508.71	
RHEINMETALL AG	4,421	404.100	1,786,526.10	
ROYAL KPN NV	349,731	3.342	1,168,801.00	
RWE AG	64,134	31.210	2,001,622.14	
SAFRAN SA	34,694	189.120	6,561,329.28	
SAMPO OYJ	45,806	41.285	1,891,100.71	
SANOFI	115,546	86.220	9,962,376.12	
SAP SE	105,997	164.240	17,408,947.28	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,663	331.600	883,050.80	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,812	255.700	719,028.40	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	55,247	203.000	11,215,141.00	
SCOUT24 SE	7,585	66.280	502,733.80	
SEB SA	2,520	112.500	283,500.00	
SIEMENS AG	77,153	169.580	13,083,605.74	
SIEMENS ENERGY AG	52,751	14.000	738,514.00	

SIEMENS HEALTHINEERS AG	28,639	55.400	1,586,600.60	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	26,394	38.380	1,013,001.72	
SNAM SPA	204,658	4.428	906,225.62	
SOCIETE GENERALE	74,930	21.925	1,642,840.25	
SODEXO	8,977	75.700	679,558.90	
SOFINA	1,571	215.200	338,079.20	
STELLANTIS NV	224,545	23.615	5,302,630.17	
STMICROELECTRONICS NV	69,361	41.760	2,896,515.36	
STORA ENSO OYJ	59,002	11.165	658,757.33	
SYENSQO SA	7,506	84.010	630,579.06	
SYMRISE AG	13,477	98.320	1,325,058.64	
TALANX AG	6,535	65.150	425,755.25	
TELECOM ITALIA SPA	1,032,214	0.294	303,470.91	
TELEFONICA SA	503,932	3.626	1,827,257.43	
TELEPERFORMANCE	6,044	134.750	814,429.00	
TENARIS SA	47,824	14.925	713,773.20	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	142,598	7.456	1,063,210.68	
THALES SA	10,666	134.000	1,429,244.00	
TOTALENERGIES SE	232,587	59.690	13,883,118.03	
UCB SA	12,825	95.400	1,223,505.00	
UMICORE	21,255	20.340	432,326.70	
UNICREDIT SPA	162,986	29.810	4,858,612.66	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	83,211	27.070	2,252,521.77	
UPM-KYMMENE OYJ	54,159	29.070	1,574,402.13	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	69,010	29.000	2,001,290.00	
VINCI SA	51,541	114.120	5,881,858.92	
VIVENDI SA	67,932	10.235	695,284.02	
VOESTALPINE AG	11,774	25.460	299,766.04	
VOLKSWAGEN AG	3,033	136.100	412,791.30	
VOLKSWAGEN AG	20,884	119.980	2,505,662.32	
VONOVIA SE	74,456	26.740	1,990,953.44	
WACKER CHEMIE AG	1,856	102.300	189,868.80	
WARTSILA OYJ	47,972	14.560	698,472.32	
WOLTERS KLUWER NV	25,211	145.800	3,675,763.80	
WORLDLINE SA	24,415	11.810	288,341.15	
ZALANDO SE	22,769	19.585	445,930.86	
ユーロ 小計	18,441,648		507,670,343.44 (82,212,135,417)	
香港・ドル				
AIA GROUP LTD	1,165,275	64.200	74,810,655.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	375,039	19.280	7,230,751.92	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	174,900	13.080	2,287,692.00	
CK ASSET HOLDINGS LTD	197,909	35.550	7,035,664.95	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	271,909	41.700	11,338,605.30	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	64,000	46.200	2,956,800.00	

CLP HOLDINGS LTD	166,643	64.100	10,681,816.30	
ESR GROUP LIMITED	221,000	9.340	2,064,140.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	221,810	44.250	9,815,092.50	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	182,157	8.210	1,495,508.97	
HANG SENG BANK LTD	77,512	81.000	6,278,472.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	147,641	21.100	3,115,225.10	
HKT TRUST AND HKT LTD	401,000	9.130	3,661,130.00	
HONG KONG & CHINA GAS	1,137,437	5.940	6,756,375.78	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	122,211	246.200	30,088,348.20	
MTR CORP	157,755	25.200	3,975,426.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	152,917	9.390	1,435,890.63	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	140,587	46.000	6,467,002.00	
SANDS CHINA LTD	246,180	23.600	5,809,848.00	
SINO LAND CO	374,000	8.090	3,025,660.00	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	136,000	12.780	1,738,080.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	147,023	71.800	10,556,251.40	
SWIRE PACIFIC LTD	43,366	63.200	2,740,731.20	
SWIRE PROPERTIES LTD	119,200	15.200	1,811,840.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	139,500	82.350	11,487,825.00	
WH GROUP LTD	843,000	4.700	3,962,100.00	
WHARF HOLDINGS LTD	109,000	26.550	2,893,950.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	169,733	25.400	4,311,218.20	
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	172,000	6.880	1,183,360.00	
香港・ドル 小計	7,876,704		241,015,460.45 (4,634,727,304)	
合計	114,905,829		877,694,563,813 (877,694,563,813)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年2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	16,705.00	1,992,572.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	32,992.00	1,135,914.56	
		AMERICAN TOWER REIT INC	47,325.00	8,855,927.25	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	50,179.00	936,340.14	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,408.00	2,551,944.96	
		BOSTON PROPERTIES INC	15,132.00	1,019,291.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,844.00	1,042,759.04	
		CROWN CASTLE INC	44,033.00	4,765,251.26	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	30,728.00	4,185,768.16	
	EQUINIX INC	9,497.00	8,131,616.31	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,943.00	1,187,467.74	
	EQUITY RESIDENTIAL	36,545.00	2,193,796.35	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,510.00	1,532,258.70	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	21,454.00	3,037,242.78	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	26,674.00	1,205,398.06	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	55,561.00	953,426.76	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	72,209.00	1,423,961.48	
	INVITATION HOMES INC	62,107.00	2,030,898.90	
	IRON MOUNTAIN INC	29,631.00	2,014,315.38	
	KIMCO REALTY CORP	62,977.00	1,236,238.51	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,845.00	1,530,018.65	
	PROLOGIS INC	93,801.00	12,512,115.39	
	PUBLIC STORAGE	16,065.00	4,522,618.80	
	REALTY INCOME CORP	72,024.00	3,769,015.92	
	REGENCY CENTERS CORP	16,844.00	1,024,283.64	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	10,999.00	2,274,593.20	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	33,217.00	4,981,221.32	
	SUN COMMUNITIES INC	12,633.00	1,642,290.00	
	UDR INC	31,782.00	1,146,694.56	
	VENTAS INC	40,824.00	1,786,458.24	
	VICI PROPERTIES INC	102,968.00	3,040,645.04	
	WELLTOWER INC	52,644.00	4,902,735.72	
	WP CAREY INC	21,731.00	1,247,359.40	
アメリカ・ドル	小計	1,180,831.00	95,812,440.14 (14,408,274,748)	
イギリス・ポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	71,973.00	464,369.79	
	SEGRO PLC	118,491.00	1,024,710.16	
イギリス・ポ ンド	小計	190,464.00	1,489,079.95 (281,882,835)	
オーストラ リア・ドル	DEXUS/AU	109,312.00	836,236.80	
	GOODMAN GROUP	173,414.00	4,869,465.12	
	GPT GROUP	194,418.00	843,774.12	
	MIRVAC GROUP	400,368.00	892,820.64	
	SCENTRE GROUP	526,252.00	1,578,756.00	
	STOCKLAND	241,955.00	1,112,993.00	
	VICINITY CENTRES	392,507.00	796,789.21	
オーストラ リア・ドル	小計	2,038,226.00	10,930,834.89 (1,073,517,295)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,683.00	437,189.05	

	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,718.00	291,254.54	
カナダ・ドル 小計		24,401.00	728,443.59 (81,134,047)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	378,100.00	1,035,994.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	540,290.00	1,058,968.40	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	352,000.00	538,560.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	241,000.00	339,810.00	
シンガポール・ドル 小計		1,511,390.00	2,973,332.40 (332,032,029)	
ユーロ	COVIVIO	5,172.00	215,879.28	
	GECINA SA	4,657.00	437,990.85	
	KLEPIERRE	21,823.00	518,950.94	
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	11,967.00	845,348.88	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	16,834.00	432,633.80	
ユーロ 小計		60,453.00	2,450,803.75 (396,883,159)	
香港・ドル	LINK REIT	259,971.00	9,826,903.80	
香港・ドル 小計		259,971.00	9,826,903.80 (188,971,360)	
投資証券 合計		5,265,736	16,762,695,473 (16,762,695,473)	
合計			16,762,695,473 (16,762,695,473)	

(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 589銘柄	71.30	-	75.57
	投資証券 33銘柄	-	1.55	
イギリス・ポンド	株式 82銘柄	3.91	-	4.08
	投資証券 2銘柄	-	0.03	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	-	0.10
オーストラリア・ドル	株式 51銘柄	1.85	-	2.04
	投資証券 7銘柄	-	0.12	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.15	-	3.27
	投資証券 2銘柄	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 16銘柄	0.29	-	0.34
	投資証券 4銘柄	-	0.04	
スイス・フラン	株式 45銘柄	2.59	-	2.69
スウェーデン・クローナ	株式 42銘柄	0.84	-	0.87
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.99	-	1.03
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	0.16	-	0.17
ユーロ	株式 220銘柄	8.86	-	9.24
	投資証券 5銘柄	-	0.04	
香港・ドル	株式 29銘柄	0.50	-	0.54
	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)

2024年2月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	85,540,823
金銭信託	7,845,259
コール・ローン	801,353,069
株式	8,587,933,852
投資信託受益証券	720,872,641
投資証券	11,205,395
派生商品評価勘定	33,437,192
未収入金	6,574
未収配当金	11,829,804
差入委託証拠金	320,881,071
流動資産合計	10,580,905,680
資産合計	10,580,905,680
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,359,403
未払解約金	53,512,075
その他未払費用	498
流動負債合計	54,871,976
負債合計	54,871,976
純資産の部	
元本等	
元本	7,713,247,784
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,812,785,920
元本等合計	10,526,033,704
純資産合計	10,526,033,704
負債純資産合計	10,580,905,680

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9月15日 至 2024年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年2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	6,629,487,488円
同期中追加設定元本額	1,796,758,594円
同期中一部解約元本額	712,998,298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	2,881,146,141円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	24,089,999円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式ノリート）	31,043,674円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式ノリートノ債券）	11,126,221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）	62,019,091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）	619,460,456円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	2,367,256,288円
FWニッセイ新興国株インデックス	27,231,799円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	7,058,898円
DCニッセイ新興国株式インデックス	1,682,815,217円
計	7,713,247,784円
2. 受益権の総数	7,713,247,784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 2023年9月15日 至 2024年2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	2024年2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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つた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年2月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	341,567,215	
投資信託受益証券	53,649,035	
投資証券	317,934	
合計	395,534,184	

(注)「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2023年11月21日から2024年2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	2024年2月20日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	745,081,822	-	-	750,579,946	5,498,124
	745,081,822	-	-	750,579,946	5,498,124
合計	745,081,822	-	-	750,579,946	5,498,124

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2024年2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	1,154,041,684	-	1,180,621,349	26,579,665
合計	1,154,041,684	-	1,180,621,349	26,579,665

(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)

2024年2月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3647円 (13,647円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年2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	27.170	14,508.78	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	533	15.250	8,128.25	
	CREDICORP LTD	695	170.210	118,295.95	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	400	19.620	7,848.00	
	H WORLD GROUP LIMITED (ADR)	1,493	36.940	55,151.42	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	9,900	1.885	18,661.50	
	IQIYI INC-ADR	3,200	3.590	11,488.00	
	JOYY INC	334	33.140	11,068.76	

KANZHUN LTD	1,900	14.870	28,253.00	
KE HOLDINGS INC	5,299	14.110	74,768.89	
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	567	58.110	32,948.37	
LUFAX HOLDING LTD	1,475	2.570	3,790.75	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,892	0.000	0.18	
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	2,982	0.000	0.29	
NIO INC - ADR	11,342	6.140	69,639.88	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	468	0.000	0.04	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	729	0.000	0.07	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	300	0.000	0.03	
PDD HOLDINGS INC(ADR)	5,341	135.260	722,423.66	
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	
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	1,915	0.000	0.19	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	460	0.000	0.04	
QIFU TECHNOLOGY INC(ADR)	500	15.210	7,605.00	
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	2.071	8,946.72	
SOUTHERN COPPER CORP	719	83.690	60,173.11	
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	5,163	0.000	0.51	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	2,824	14.170	40,016.08	
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	10.120	60,446.76	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	2,625	16.880	44,310.00	
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	9.300	3,106.20	
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	41.340	141,630.84	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC- ADR	3,347	18.480	61,852.56	
アメリカ・ドル 小計	179,408		1,605,073.62 (241,370,971)	

インド・ルピー	ABB INDIA LTD	517	4,488.850	2,320,735.45	
	ADANI ENTERPRISES LTD	1,562	3,258.800	5,090,245.60	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	2,770	1,955.050	5,415,488.50	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	3,805	1,307.000	4,973,135.00	
	ADANI POWER LTD	5,133	567.650	2,913,747.45	
	AMBUJA CEMENTS LTD	5,084	584.850	2,973,377.40	
	APL APOLLO TUBES LTD	1,926	1,431.500	2,757,069.00	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	825	6,657.150	5,492,148.75	
	ASHOK LEYLAND LTD	11,457	172.200	1,972,895.40	
	ASIAN PAINTS LTD	3,704	2,998.100	11,104,962.40	
	ASTRAL LTD	1,023	1,966.700	2,011,934.10	
	AU SMALL FINANCE BANK LTD	1,152	599.350	690,451.20	
	AUROBINDO PHARMA LTD	2,097	1,040.900	2,182,767.30	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	1,325	3,707.250	4,912,106.25	
	AXIS BANK LTD	20,928	1,062.950	22,245,417.60	
	BAJAJ AUTO LTD	593	8,509.700	5,046,252.10	
	BAJAJ FINANCE LTD	2,517	6,712.800	16,896,117.60	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,227	1,620.150	5,228,224.05	
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	215	8,876.250	1,908,393.75	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	331	2,323.850	769,194.35	
	BANDHAN BANK LTD	3,556	203.750	724,535.00	
	BANK OF BARODA	9,496	270.700	2,570,567.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,366	556.900	1,317,625.40	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	40,951	188.750	7,729,501.25	
	BHARAT FORGE LTD	1,798	1,124.750	2,022,300.50	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	5,051	652.550	3,296,030.05	
	BHARTI AIRTEL LTD	20,558	1,142.200	23,481,347.60	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	878	4,925.250	4,324,369.50	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LIMITED	4,728	436.300	2,062,826.40	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	3,680	1,133.350	4,170,728.00	
	CIPLA LIMITED	4,391	1,470.350	6,456,306.85	
	COAL INDIA LTD	13,639	461.000	6,287,579.00	
	COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	740	2,571.300	1,902,762.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,694	1,010.250	1,711,363.50	
	CUMMINS INDIA LTD	1,068	2,658.750	2,839,545.00	
	DABUR INDIA LTD	7,985	547.650	4,372,985.25	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	1,272	3,723.450	4,736,228.40	
	DLF LTD	4,558	848.600	3,867,918.80	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	819	6,417.150	5,255,645.85	

EICHER MOTORS LTD	1,105	3,902.850	4,312,649.25	
GAIL INDIA LTD	14,833	183.850	2,727,047.05	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,986	1,230.000	3,672,780.00	
GODREJ PROPERTIES LTD	606	2,280.150	1,381,770.90	
GRASIM INDUSTRIES LTD	2,865	2,168.600	6,213,039.00	
HAVELLS INDIA LTD	1,686	1,410.550	2,378,187.30	
HCL TECHNOLOGIES LTD	7,787	1,675.250	13,045,171.75	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	787	3,734.500	2,939,051.50	
HDFC BANK LTD	25,367	1,417.100	35,947,575.70	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	8,298	585.200	4,855,989.60	
HERO MOTOCORP LTD	827	4,852.600	4,013,100.20	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	10,041	512.300	5,144,004.30	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	1,478	3,021.750	4,466,146.50	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1,930	554.700	1,070,571.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	7,662	2,387.150	18,290,343.30	
ICICI BANK LTD	46,653	1,043.750	48,694,068.75	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,651	1,642.950	2,712,510.45	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,346	514.700	1,207,486.20	
IDFC BANK LTD	26,252	82.150	2,156,601.80	
INDIAN HOTELS CO LTD	7,731	542.450	4,193,680.95	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	25,665	188.500	4,837,852.50	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,327	946.950	4,097,452.65	
INDRAPRASTHA GAS LTD	1,088	439.700	478,393.60	
INDUSIND BANK LTD	3,140	1,483.600	4,658,504.00	
INFO EDGE INDIA LTD	593	5,338.450	3,165,700.85	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	29,902	1,699.750	50,825,924.50	
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,092	3,068.050	3,350,310.60	
ITC LTD	27,630	409.250	11,307,577.50	
JINDAL STEEL & POWER LTD	2,793	759.000	2,119,887.00	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	31,385	274.000	8,599,490.00	
JSW STEEL LTD	5,271	820.200	4,323,274.20	
JUBILANT FOODWORKS LTD	2,065	496.500	1,025,272.50	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	10,177	1,731.400	17,620,457.80	
LARSEN & TOUBRO LTD	6,191	3,339.850	20,677,011.35	
LTIMINDTREE LIMITED	943	5,514.050	5,199,749.15	
LUPIN LTD	2,422	1,588.100	3,846,378.20	
MACROTECH DEVELOPERS LTD	2,725	1,093.000	2,978,425.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	7,667	1,848.550	14,172,832.85	
MARICO LTD	4,615	526.500	2,429,797.50	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,109	11,483.350	12,735,035.15	

MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	6,533	842.750	5,505,685.75	
MPHASIS LTD	416	2,779.350	1,156,209.60	
MRF LTD	24	148,902.300	3,573,655.20	
MUTHOOT FINANCE LTD	448	1,354.950	607,017.60	
NESTLE INDIA LTD	2,720	2,513.250	6,836,040.00	
NTPC LTD	38,270	338.750	12,963,962.50	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	27,953	274.650	7,677,291.45	
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	2,496	358.350	894,441.60	
PAGE INDUSTRIES LTD	55	36,667.200	2,016,696.00	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	558	8,736.300	4,874,855.40	
PETRONET LNG LTD	6,694	282.750	1,892,728.50	
PI INDUSTRIES LTD	717	3,667.950	2,629,920.15	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,522	2,711.150	4,126,370.30	
POLYCAB INDIA LTD	517	4,768.600	2,465,366.20	
POWER FINANCE CORPORATION	15,725	431.150	6,779,833.75	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	39,426	276.350	10,895,375.10	
REC LTD	14,200	468.100	6,647,020.00	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	27,254	2,948.000	80,344,792.00	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	24,494	113.150	2,771,496.10	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	2,791	728.400	2,032,964.40	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	3,698	1,488.850	5,505,767.30	
SHREE CEMENT LTD	75	26,815.300	2,011,147.50	
SHRIRAM FINANCE LIMITED	2,256	2,439.900	5,504,414.40	
SIEMENS LTD	622	4,416.600	2,747,125.20	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	3,909	614.800	2,403,253.20	
SRF LTD	1,334	2,347.050	3,130,964.70	
STATE BANK OF INDIA	14,800	759.250	11,236,900.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	9,129	1,530.100	13,968,282.90	
SUPREME INDUSTRIES LTD	503	4,056.350	2,040,344.05	
SUZLON ENERGY LTD	90,666	46.150	4,184,235.90	
TATA COMMUNICATIONS LTD	1,415	1,815.500	2,568,932.50	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	8,255	4,103.800	33,876,869.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	6,156	1,155.000	7,110,180.00	
TATA ELXSI LTD	210	7,708.650	1,618,816.50	
TATA MOTORS LTD	13,971	932.600	13,029,354.60	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	5,780	613.150	3,544,007.00	
TATA POWER CO LTD	13,851	380.500	5,270,305.50	

	TATA STEEL LTD	59,823	141.950	8,491,874.85	
	TECH MAHINDRA LTD	4,711	1,310.000	6,171,410.00	
	TITAN CO LTD	3,423	3,695.050	12,648,156.15	
	TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	514	2,615.000	1,344,110.00	
	TRENT LTD	1,299	4,047.150	5,257,247.85	
	TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	898	3,713.150	3,334,408.70	
	TVS MOTOR CO LTD	2,017	2,120.400	4,276,846.80	
	ULTRATECH CEMENT LTD	930	9,902.200	9,209,046.00	
	UNITED SPIRITS LTD	1,802	1,156.900	2,084,733.80	
	UPL LTD	4,658	497.550	2,317,587.90	
	VARUN BEVERAGES LTD	4,070	1,438.300	5,853,881.00	
	VEDANTA LTD	4,714	270.150	1,273,487.10	
	WIPRO LTD	10,622	535.950	5,692,860.90	
	YES BANK LTD	92,528	27.100	2,507,508.80	
	ZOMATO LTD	50,036	157.500	7,880,670.00	
インド・ルピー	小計	1,174,598		908,692,382.90 (1,653,820,137)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	84,200	2,430.000	204,606,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	75,300	7,825.000	589,222,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	53,200	1,515.000	80,598,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	173,400	5,125.000	888,675,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	521,400	9,875.000	5,148,825,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	366,500	7,150.000	2,620,475,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	110,400	5,875.000	648,600,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	652,800	6,100.000	3,982,080,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	272,598	1,000.000	272,598,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	45,500	4,750.000	216,125,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	6,968,800	84.000	585,379,200.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	7,850.000	47,100,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	9,600	11,575.000	111,120,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	10,400	6,475.000	67,340,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	176,100	1,470.000	258,867,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	113,600	2,330.000	264,688,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	162,600	875.000	142,275,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	9,400	6,325.000	59,455,000.00	

	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	99,800	2,750.000	274,450,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	499,200	4,160.000	2,076,672,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	49,100	2,800.000	137,480,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	10,600	22,950.000	243,270,000.00	
インドネシア・ルピア 小計		10,470,498		18,919,900,700.00 (183,523,037)	
オフショア・人 民元	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,500	7.780	35,010.00	
	ADVANCED MICRO- FABRICATION-A	528	125.570	66,300.96	
	AECC AVIATION POWER CO-A	3,100	32.710	101,401.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	71,800	4.080	292,944.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	4,637	14.190	65,799.03	
	AIR CHINA LTD-A	10,100	7.390	74,639.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	14,800	5.900	87,320.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	24.140	24,140.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	221.330	66,399.00	
	ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	140	92.910	13,007.40	
	AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS	9,200	3.090	28,428.00	
	BANK OF BEIJING CO LTD - A	8,600	5.100	43,860.00	
	BANK OF CHINA LTD-A	32,100	4.510	144,771.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	22,200	6.250	138,750.00	
	BANK OF JIANGSU CO LTD-A	7,800	7.490	58,422.00	
	BANK OF NANJING CO LTD - A	8,800	8.400	73,920.00	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	4,300	21.280	91,504.00	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD- A	4,500	6.460	29,070.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO- A	33,200	6.440	213,808.00	
	BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	218	246.570	53,752.26	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,000	44.280	88,560.00		
BEIJING UNITED INFORMATION-A	1,305	17.900	23,359.50		
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	560	60.730	34,008.80		

BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	24,200	5.100	123,420.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	45,400	3.950	179,330.00	
BYD CO LTD -A	1,300	183.500	238,550.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	7,500	7.610	57,075.00	
CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A	38,200	5.430	207,426.00	
CGN POWER CO LTD-A	67,200	3.880	260,736.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	121.770	12,177.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	12,300	5.210	64,083.00	
CHINA BAOAN GROUP-A	17,200	11.960	205,712.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK- A	9,600	7.040	67,584.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD- A	3,200	32.910	105,312.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6,800	3.800	25,840.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	37,000	3.190	118,030.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	6,900	11.340	78,246.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	2,400	33.630	80,712.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO- A	1,000	30.980	30,980.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	10,800	31.620	341,496.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	10,500	13.810	145,005.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	8.960	17,024.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	21,200	4.010	85,012.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	8.620	91,372.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	11,500	18.530	213,095.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,000	26.330	105,320.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	25,900	6.280	162,652.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD- A	8,800	6.340	55,792.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	10,871	4.620	50,224.02	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	1,473	40.320	59,391.36	

CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	4,800	39.810	191,088.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4,700	5.840	27,448.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	22,900	5.180	118,622.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	57,100	4.640	264,944.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	800	85.290	68,232.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	8,100	9.840	79,704.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	13,400	25.200	337,680.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	500	47.170	23,585.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	24,600	2.710	66,666.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	5,850	13.480	78,858.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	3,200	53.790	172,128.00	
CITIC SECURITIES CO-A	6,700	20.850	139,695.00	
CMOC GROUP LTD-A	11,300	5.970	67,461.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	1,300	46.190	60,047.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,280	160.090	365,005.20	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	5,070	10.280	52,119.60	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,600	22.690	58,994.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,200	15.100	63,420.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	6,013	13.230	79,551.99	
EVE ENERGY CO LTD-A	900	35.150	31,635.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	6.230	36,757.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	2,554	37.780	96,490.12	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	11,600	6.910	80,156.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	6,300	17.270	108,801.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	2,800	40.980	114,744.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	2,800	35.180	98,504.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	13,200	4.650	61,380.00	
GEM CO LTD-A	13,300	5.100	67,830.00	

GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	13.900	51,430.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	196	66.950	13,122.20	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	200	60.500	12,100.00	
GOERTEK INC -A	1,000	16.090	16,090.00	
GOLDWIND SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A	3,900	7.310	28,509.00	
GONGNIU GROUP CO LTD-A	700	100.090	70,063.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD- A	1,800	18.810	33,858.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD- A	3,500	22.080	77,280.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,200	36.980	118,336.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO- A	1,000	42.300	42,300.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	5,400	7.100	38,340.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	8,700	8.680	75,516.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,300	29.380	38,194.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,000	18.450	18,450.00	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL HOLDINGS GROUP CO LTD-A	9,800	5.890	57,722.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,200	8.220	92,064.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,300	14.790	48,807.00	
HAIER SMART HOME CO LTD- A	5,500	23.580	129,690.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	12,600	8.920	112,392.00	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,176	24.140	28,388.64	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	29.310	23,448.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	7,900	12.570	99,303.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2,800	11.850	33,180.00	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	5,700	7.190	40,983.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	700	128.800	90,160.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	400	47.150	18,860.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD- A	1,300	32.550	42,315.00	

HUANENG POWER INTL INC-A	7,700	8.990	69,223.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,500	14.010	119,085.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	4,100	7.500	30,750.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	6.140	38,068.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	16.980	23,772.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	89.150	44,575.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	1,183	22.270	26,345.41	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	46.540	55,848.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	100	324.000	32,400.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	54,400	5.270	286,688.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD - A	14,000	16.180	226,520.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	1.520	49,248.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	3.860	8,106.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	2,800	28.330	79,324.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,372	17.760	24,366.72	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	2,900	10.700	31,030.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,000	55.620	55,620.00	
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS CO LTD-A	3,384	41.660	140,977.44	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,300	49.860	64,818.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY - A	900	98.000	88,200.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,200	12.280	27,016.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	18.830	37,660.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	6,076	8.230	50,005.48	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	6,600	14.350	94,710.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	700	1,695.430	1,186,801.00	
LB GROUP CO LTD-A	2,900	17.680	51,272.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	2,400	11.590	27,816.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	13,900	5.220	72,558.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,480	20.190	130,831.20	

LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	3,089	27.490	84,916.61	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	900	155.150	139,635.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,300	23.950	31,135.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	480	95.800	45,984.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	3.250	66,625.00	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	974	51.950	50,599.30	
MUYUAN FOODS CO LTD-A	2,190	37.400	81,906.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,110	22.690	70,565.90	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	258.500	51,700.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	31.190	28,071.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	8.520	15,336.00	
NINESTAR CORP-A	1,700	19.990	33,983.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	5,400	11.510	62,154.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	48.750	34,125.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	4,400	14.500	63,800.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	4,500	8.500	38,250.00	
PETROCHINA CO LTD-A	29,700	8.650	256,905.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	675	21.270	14,357.25	
PICC HOLDING CO-A	14,900	5.140	76,586.00	
PING AN BANK CO LTD-A	9,700	9.810	95,157.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	4,900	42.730	209,377.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	9.810	26,487.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	12,200	4.800	58,560.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	4.990	49,900.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	2,700	15.140	40,878.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,000	10.160	30,480.00	
S F HOLDING CO LTD-A	2,200	37.840	83,248.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,000	14.550	116,400.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	5,100	12.000	61,200.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	14.140	42,420.00	

SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	4,600	15.910	73,186.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	13,700	6.630	90,831.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	12,900	14.710	189,759.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	2,300	9.770	22,471.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	4,700	25.370	119,239.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	460	21.240	9,770.40	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,900	26.690	50,711.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	30,200	2.990	90,298.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,560	43.700	68,172.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	4.080	25,704.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	23.980	86,328.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,600	5.430	46,698.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	5,100	10.700	54,570.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	5,500	17.640	97,020.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	18,900	7.120	134,568.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	1,160	16.720	19,395.20	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	14,800	6.380	94,424.00	
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,296	144.000	186,624.00	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	24,900	5.900	146,910.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	5,600	5.140	28,784.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	480	224.820	107,913.60	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	7,900	9.060	71,574.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	140	56.860	7,960.40	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11,000	4.400	48,400.00	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	160	37.790	6,046.40	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,500	62.370	93,555.00	

SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	480	23.600	11,328.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	500	298.480	149,240.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	336	155.800	52,348.80	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,800	20.830	37,494.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	500	85.390	42,695.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	117.100	18,736.00	
TBEA CO LTD-A	2,860	14.850	42,471.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4,400	4.340	19,096.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	1,875	12.060	22,612.50	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	7,200	8.800	63,360.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	1,300	45.780	59,514.00	
TONGWEI CO LTD-A	3,900	26.000	101,400.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	1,092	23.690	25,869.48	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	600	76.600	45,960.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	419	56.040	23,480.76	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	980	17.750	17,395.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	1,500	74.610	111,915.00	
WEICHAO POWER CO LTD-A	3,400	15.780	53,652.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1,800	19.100	34,380.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	9,700	6.260	60,722.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	405	85.650	34,688.25	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	34.950	6,990.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	5,100	4.530	23,103.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	5,200	5.990	31,148.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	2,300	136.150	313,145.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-A	1,872	50.050	93,693.60	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2,600	6.170	16,042.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	4,700	16.170	75,999.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	5,200	25.120	130,624.00	

	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	1,300	31.810	41,353.00	
	YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,690	11.480	19,401.20	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	2,500	12.410	31,025.00	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	700	49.870	34,909.00	
	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	300	42.350	12,705.00	
	ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	300	212.310	63,693.00	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	1,100	19.590	21,549.00	
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	3,000	18.120	54,360.00	
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	650	25.450	16,542.50	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI -A	800	34.080	27,264.00	
	ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,008	17.300	17,438.40	
	ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2,000	9.820	19,640.00	
	ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	12,400	6.650	82,460.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	21,100	12.850	271,135.00	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9,400	7.920	74,448.00	
	ZTE CORP-A	700	24.700	17,290.00	
オフショア・人民元 小計		1,659,267		19,222,819.88 (400,632,401)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	2,517	30,600.000	77,020,200.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,540	29,220.000	132,658,800.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,462	16,600.000	24,269,200.00	
コロンビア・ペソ 小計		8,519		233,948,200.00 (8,982,675)	
タイ・パーツ	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	11,200	209.000	2,340,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	38,000	63.250	2,403,500.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-FOREIGN	88,100	3.900	343,590.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	93,400	28.000	2,615,200.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	71,300	7.750	552,575.00	

BANPU PUBLIC CO LTD-FOR REG	85,600	5.950	509,320.00	
BERLI JUCKER PUB CO- FORGN	6,000	25.000	150,000.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	57,400	5.600	321,440.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL- FOREIGN	4,400	243.000	1,069,200.00	
CENTRAL PATTANA PUB CO- FOREI	14,300	64.750	925,925.00	
CENTRAL RETAIL CORP- FOREIGN	15,700	34.000	533,800.00	
CHAROEN POKPHAND FOOD- FORGN	26,800	17.800	477,040.00	
CP ALL PCL-FOREIGN	50,500	55.000	2,777,500.00	
CP AXTRA PUBLIC COMPANY LIMITED (F)	19,900	32.750	651,725.00	
DELTA ELECTRONICS THAI- FORGN	25,500	78.000	1,989,000.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL- FOREIGN	19,200	37.750	724,800.00	
GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F	8,800	52.250	459,800.00	
GULF ENERGY DEVELOPM- FOREIGN	42,400	43.750	1,855,000.00	
HOME PRODUCT CENTER PCL- FOR	44,400	10.900	483,960.00	
INDORAMA VENTURES- FOREIGN	12,200	23.600	287,920.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6,300	73.750	464,625.00	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	4,900	119.500	585,550.00	
KRUNG THAI BANK PUB CO- FOREI	32,300	15.800	510,340.00	
KRUNGTHAI CARD PCL- FOREIGN	15,500	43.000	666,500.00	
LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	154,500	7.450	1,151,025.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL- FOR	18,500	30.750	568,875.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL- FOREIG	2,100	44.250	92,925.00	
OSOTSPA PCL-FOREIGN	3,200	21.100	67,520.00	
PTT EXPLORATION & PROD- FOR	15,800	150.500	2,377,900.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- FOR	14,300	37.500	536,250.00	
PTT OIL & RETAIL BUS- FOREIGN	32,900	18.600	611,940.00	
PTT PCL/FOREIGN	102,600	35.750	3,667,950.00	
SCB X PCL-FOREIGN	6,800	103.500	703,800.00	

	SCG PACKAGING PCL-FOREIGN	7,300	30.750	224,475.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	7,000	264.000	1,848,000.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	9,300	58.750	546,375.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-FOREIGN	60,798	6.650	404,306.70	
タイ・パーツ 小計		1,229,198		36,500,451.70 (151,841,879)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	1,396	818.500	1,142,626.00	
	KOMERCNI BANKA AS	654	840.000	549,360.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	101.800	114,423.20	
チェコ・コルナ 小計		3,174		1,806,409.20 (11,479,911)	
チリ・ペソ	BANCO DE CHILE	347,416	114.000	39,605,424.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	683	27,200.000	18,577,600.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	627,335	48.450	30,394,380.75	
	CENCOSUD SA	9,218	1,780.000	16,408,040.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	92,857	62.300	5,784,991.10	
	EMPRESAS CMPC SA	10,124	1,656.000	16,765,344.00	
	EMPRESAS COPEC SA	3,034	6,244.900	18,947,026.60	
	ENEL CHILE SA	90,486	58.200	5,266,285.20	
	ENERSIS SA	205,266	100.200	20,567,653.20	
	FALABELLA SA	7,564	2,372.000	17,941,808.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,584	43,100.000	68,270,400.00	
チリ・ペソ 小計		1,395,567		258,528,952.85 (40,217,022)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	29,310	41.540	1,217,537.40	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	11,662	58.500	682,227.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,758	390.000	1,855,620.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	8,135	48.320	393,083.20	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	593	959.500	568,983.50	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	6,843	78.200	535,122.60	
	HEKTAS TICARET T.A.S	9,137	21.720	198,455.64	
	KOC HOLDING AS	5,853	173.400	1,014,910.20	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	412	821.500	338,458.00	
	SASA POLYESTER SANAYI	8,293	43.140	357,760.02	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	1,087	257.250	279,630.75	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,587	173.000	1,485,551.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	6,115	278.500	1,703,027.50	

	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	10,503	52.550	551,932.65	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,833	66.750	789,852.75	
	TURKIYE IS BANKASI-C	32,580	27.380	892,040.40	
	YAPI VE KREDI BANKASI	39,247	23.800	934,078.60	
トルコ・リラ 小計		194,948		13,798,271.21 (67,256,913)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	4,259	2,968.000	12,640,712.00	
	OTP BANK RT	2,423	17,260.000	41,820,980.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	875	9,780.000	8,557,500.00	
ハンガリー・フォリント 小計		7,557		63,019,192.00 (26,237,852)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	6,310	45.300	285,843.00	
	AYALA CORPORATION	1,795	703.500	1,262,782.50	
	AYALA LAND INC	55,300	33.950	1,877,435.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	15,205	116.700	1,774,423.50	
	BDO UNIBANK INC	21,458	153.100	3,285,219.80	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	9,230	276.000	2,547,480.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	18,558	39.050	724,689.90	
	JOLLIBEE FOODS CORP	7,320	259.000	1,895,880.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,370	364.000	498,680.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	15,127	58.700	887,954.90	
	PLDT INC	585	1,270.000	742,950.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,795	900.000	1,615,500.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	105,700	33.050	3,493,385.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	7,280	114.500	833,560.00	
フィリピン・ペソ 小計		267,033		21,725,783.60 (58,275,069)	
ブラジル・リアル	AMBEV SA	47,600	12.810	609,756.00	
	ATACADA0 SA	1,900	10.840	20,596.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	17,203	12.310	211,768.93	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	48,479	13.650	661,738.35	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	9,200	36.890	339,388.00	
	BANCO DO BRASIL SA	6,500	58.920	382,980.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	3,000	29.090	87,270.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	4,400	32.770	144,188.00	
	BM&FBOVESPA SA	56,500	12.690	716,985.00	
	CCR SA	6,800	13.190	89,692.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,600	47.450	123,370.00	

CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	10,100	42.850	432,785.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	8,475	11.890	100,767.75	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	13,900	10.330	143,587.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,500	81.880	204,700.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	5,100	18.920	96,492.00	
COSAN SA	10,400	18.810	195,624.00	
CPFL ENERGIA SA	3,000	35.860	107,580.00	
ENERGISA SA-UNITS	2,300	50.450	116,035.00	
ENEVA SA	8,300	12.340	102,422.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	675	41.240	27,837.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	8,600	33.990	292,314.00	
GERDAU SA-PREF	10,020	21.260	213,025.20	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	43,506	3.490	151,835.94	
HYPERA S.A	2,900	32.530	94,337.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	45,050	34.920	1,573,146.00	
ITAUSA SA	43,381	10.540	457,235.74	
JBS SA	7,100	22.210	157,691.00	
KLABIN SA - UNIT	4,000	21.530	86,120.00	
LOCALIZA RENT A CAR	7,395	52.560	388,681.20	
LOJAS RENNER S.A.	13,362	14.590	194,951.58	
MAGAZINE LUIZA SA	15,200	2.090	31,768.00	
NATURA &CO HOLDING SA	7,300	16.250	118,625.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	32,000	44.490	1,423,680.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	44,100	42.900	1,891,890.00	
PRIO S.A.	6,700	45.890	307,463.00	
RAIA DROGASIL SA	10,936	24.900	272,306.40	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	5,300	25.320	134,196.00	
RUMO SA	13,500	23.240	313,740.00	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	11,700	13.540	158,418.00	
SUZANO S.A.	7,622	53.040	404,270.88	
TELEFONICA BRASIL S.A.	3,100	52.860	163,866.00	
TIM SA	10,500	17.480	183,540.00	
TOTVS SA	4,400	30.870	135,828.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	5,200	29.820	155,064.00	
VALE SA	30,754	67.490	2,075,587.46	
VIBRA ENERGIA SA	7,800	24.000	187,200.00	
WEG SA	16,320	33.490	546,556.80	
ブラジル・リアル 小計	686,678		17,028,899.23 (516,033,545)	

ポーランド・ズロチ	ALLEGRO.EU SA	3,469	32.255	111,892.59	
	BANK PEKAO SA	2,397	163.350	391,549.95	
	BUDIMEX	97	687.000	66,639.00	
	CD PROJEKT SA	427	114.100	48,720.70	
	CYFROWY POLSAT SA	1,022	11.315	11,563.93	
	DINO POLSKA SA	331	452.600	149,810.60	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,585	112.000	177,520.00	
	LPP SA	9	16,950.000	152,550.00	
	MBANK SA	114	640.000	72,960.00	
	ORLEN SA	4,634	67.670	313,582.78	
	PEPCO GROUP NV	1,508	21.660	32,663.28	
	PGE SA	8,858	7.904	70,013.63	
	PKO BANK POLSKI SA	7,140	53.940	385,131.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	4,925	48.430	238,517.75	
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	361	516.000	186,276.00	
ポーランド・ズロチ 小計	36,877		2,409,391.81 (90,151,972)		
マレーシア・リンギット	AMBANK HOLDINGS BHD	9,700	4.380	42,486.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	20,500	2.790	57,195.00	
	CELCOMDIGI BERHAD	51,800	4.330	224,294.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	59,300	6.400	379,520.00	
	DIALOG GROUP BHD	14,900	1.860	27,714.00	
	GAMUDA BHD	18,800	5.080	95,504.00	
	GENTING BHD	33,300	4.940	164,502.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	11,300	2.870	32,431.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	4,500	19.400	87,300.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	17,200	6.190	106,468.00	
	INARI AMERTRON BHD	16,600	3.210	53,286.00	
	IOI CORPORATION BHD	19,700	3.980	78,406.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	3,400	22.520	76,568.00	
	MALAYAN BANKING BHD	46,500	9.460	439,890.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	4,900	8.000	39,200.00	
	MAXIS BHD	19,600	3.790	74,284.00	
	MISC BHD	5,000	7.650	38,250.00	
	MR DIY GROUP M BHD	16,300	1.550	25,265.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	121.900	73,140.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	28,500	6.840	194,940.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,300	22.800	75,240.00	
	PETRONAS GAS BHD	5,400	18.100	97,740.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,680	15.140	85,995.20	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	26,100	4.650	121,365.00	
PUBLIC BANK BHD	159,700	4.430	707,471.00		

	QL RESOURCES BHD	3,000	5.860	17,580.00	
	RHB BANK BHD	17,000	5.630	95,710.00	
	SIME DARBY BERHAD	4,800	2.510	12,048.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	19,000	4.500	85,500.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	12,500	5.870	73,375.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	23,600	11.200	264,320.00	
マレーシア・リンギット 小計		682,480		3,946,987.20 (123,890,402)	
メキシコ・ペソ	ALFA S.A.B.-A	17,900	13.270	237,533.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	158,600	15.850	2,513,810.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,000	190.150	760,600.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	5,900	66.860	394,474.00	
	CEMEX SAB-CPO	125,400	13.490	1,691,646.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	3,275	178.810	585,602.75	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	17,700	227.830	4,032,591.00	
	GRUMA S.A.B.-B	1,200	317.760	381,312.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	1,580	521.740	824,349.20	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	3,800	155.030	589,114.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL- B SH	4,425	258.560	1,144,128.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	10,100	79.090	798,809.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV- SER A1	5,300	152.110	806,183.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	24,000	187.590	4,502,160.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	16,600	54.800	909,680.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	30,200	87.820	2,652,164.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,160	218.040	252,926.40	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	10,000	38.570	385,700.00	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	12,000	20.090	241,080.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	12,500	33.320	416,500.00	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,765	179.660	317,099.90		
WALMART DE MEXICO-SER V	48,800	68.410	3,338,408.00		
メキシコ・ペソ 小計		516,205		27,775,870.25 (245,005,396)	

ユーロ	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	25,965	1.717	44,581.90	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	17,393	1.920	33,394.56	
	FF GROUP	129	4.800	619.20	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,778	13.930	24,767.54	
	JUMBO SA	1,127	27.740	31,262.98	
	MOTOR OIL (HELLAS) SA	567	28.000	15,876.00	
	MYTILINEOS S.A.	713	37.420	26,680.46	
	NATIONAL BANK OF GREECE	8,342	7.230	60,312.66	
	OPAP SA	2,062	16.450	33,919.90	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	5,508	3.978	21,910.82	
	PUBLIC POWER CORP	1,420	11.970	16,997.40	
ユーロ 小計	65,004		310,323.42 (50,253,775)		
韓国・ウォン	AMOREPACIFIC CORP	353	127,500.000	45,007,500.00	
	CELLTRION INC	1,336	182,400.000	243,686,400.00	
	CELLTRION PHARM INC	183	102,400.000	18,739,200.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	61	304,000.000	18,544,000.00	
	COSMOAM&T CO LTD	205	170,400.000	34,932,000.00	
	COWAY CO LTD	312	57,500.000	17,940,000.00	
	DAUM COMMUNICATIONS CORP	3,225	58,200.000	187,695,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	363	102,100.000	37,062,300.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	272	48,400.000	13,164,800.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	3,365	15,630.000	52,594,950.00	
	ECOPRO BM CO LTD	417	244,000.000	101,748,000.00	
	ECOPRO CO LTD	159	605,000.000	96,195,000.00	
	F&F CO LTD / NEW	90	70,200.000	6,318,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	407	51,500.000	20,960,500.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	2,407	58,900.000	141,772,300.00	
	HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	531	56,200.000	29,842,200.00	
	HANMI PHARM CO LTD	60	336,500.000	20,190,000.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	367	74,500.000	27,341,500.00	
	HANON SYSTEMS	960	6,490.000	6,230,400.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	330	151,900.000	50,127,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	968	33,250.000	32,186,000.00	
	HD HYUNDAI	361	72,200.000	26,064,200.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	128	110,900.000	14,195,200.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	337	119,500.000	40,271,500.00	
HLB INC	646	78,800.000	50,904,800.00		
HMM CO LTD	2,204	18,680.000	41,170,720.00		

HOTEL SHILLA CO LTD	264	61,500.000	16,236,000.00	
HYBE CO LTD	157	204,000.000	32,028,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	474	34,800.000	16,495,200.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	131	183,100.000	23,986,100.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	212	63,700.000	13,504,400.00	
HYUNDAI MOBIS	630	244,000.000	153,720,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,370	252,500.000	345,925,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	239	167,100.000	39,936,900.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	162,100.000	27,557,000.00	
HYUNDAI STEEL CO	528	36,400.000	19,219,200.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,205	14,020.000	30,914,100.00	
JYP ENTERTAINMENT CORP	217	77,100.000	16,730,700.00	
KAKAOBANK CORP	1,670	30,000.000	50,100,000.00	
KAKAOPAY CORP	248	48,800.000	12,102,400.00	
KANGWON LAND INC	358	18,020.000	6,451,160.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	3,666	68,800.000	252,220,800.00	
KIA CORPORATION	2,485	117,600.000	292,236,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	515	53,400.000	27,501,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,118	23,200.000	49,137,600.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	481	70,900.000	34,102,900.00	
KOREA ZINC CO LTD	53	468,500.000	24,830,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	1,198	23,400.000	28,033,200.00	
KRAFTON INC	240	235,000.000	56,400,000.00	
KT CORP	746	42,200.000	31,481,200.00	
KT&G CORP	789	91,100.000	71,877,900.00	
KUM YANG CO LTD	347	91,500.000	31,750,500.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	101	161,500.000	16,311,500.00	
L&F CO LTD	197	152,000.000	29,944,000.00	
LG CHEM LTD	481	508,000.000	244,348,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	56	318,500.000	17,836,000.00	
LG CORP	857	103,500.000	88,699,500.00	
LG DISPLAY CO LTD	1,329	12,020.000	15,974,580.00	
LG DISPLAY CO LTD-RIGHTS	422	2,010.000	848,220.00	
LG ELECTRONICS INC	917	99,800.000	91,516,600.00	
LG ENERGY SOLUTION	461	397,500.000	183,247,500.00	
LG H AND H CO LTD	100	340,000.000	34,000,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	83	195,400.000	16,218,200.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	1,340	11,770.000	15,771,800.00	
LG UPLUS CORP	815	10,380.000	8,459,700.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	113	138,400.000	15,639,200.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	848	78,600.000	66,652,800.00	

MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	1,312	9,020.000	11,834,240.00	
NAVER CORP	1,228	203,500.000	249,898,000.00	
NCISOFT CORPORATION	137	213,000.000	29,181,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	64,600.000	3,746,800.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	234	97,700.000	22,861,800.00	
PEARL ABYSS CORP	159	34,950.000	5,557,050.00	
POSCO DX CO LTD	586	58,600.000	34,339,600.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	270	296,500.000	80,055,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	665	444,500.000	295,592,500.00	
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	426	58,000.000	24,708,000.00	
S-OIL CORPORATION	300	74,800.000	22,440,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	191	821,000.000	156,811,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	701	170,400.000	119,450,400.00	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO	502	137,100.000	68,824,200.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	42,329	73,800.000	3,123,880,200.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	7,536	62,500.000	471,000,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,205	24,250.000	29,221,250.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	334	317,500.000	106,045,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,102	7,310.000	37,295,620.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	495	85,000.000	42,075,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	535	394,500.000	211,057,500.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	365	163,100.000	59,531,500.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	452	41,700.000	18,848,400.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	3,586	45,050.000	161,549,300.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	152	86,500.000	13,148,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	115	64,800.000	7,452,000.00	
SK HYNIX INC	4,946	151,300.000	748,329,800.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	181	70,000.000	12,670,000.00	
SK INC	336	207,500.000	69,720,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	492	128,900.000	63,418,800.00	
SK SQUARE CO LTD	1,151	69,600.000	80,109,600.00	
SK TELECOM CO LTD	720	52,900.000	38,088,000.00	
SKC CO LTD	129	85,300.000	11,003,700.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	6,866	15,060.000	103,401,960.00	
YUHAN CORP	470	63,300.000	29,751,000.00	
韓国・ウォン 小計	133,944		10,487,725,050.00 (1,178,820,296)	

香港・ドル	3SBIO INC	15,500	5.500	85,250.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	3,500	18.480	64,680.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	217,000	3.160	685,720.00	
	AIR CHINA LIMITED-H	10,000	4.280	42,800.00	
	AKESO INC	4,000	44.050	176,200.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	145,100	71.500	10,374,650.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	52,000	3.300	171,600.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	3.910	93,840.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	11,500	16.180	186,070.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	700	103.420	72,394.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	13,000	75.800	985,400.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	4,000	3.100	12,400.00	
	BAIDU INC-CLASS A	20,900	103.600	2,165,240.00	
	BANK OF CHINA LTD - H	725,000	3.030	2,196,750.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	77,000	4.890	376,530.00	
	BEIGENE LTD	5,800	89.650	519,970.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	4,500	28.750	129,375.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	1.880	30,080.00	
	BILIBILI INC-CLASS Z	1,920	78.300	150,336.00	
	BOC AVIATION LTD	1,900	58.050	110,295.00	
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	16,000	3.830	61,280.00	
	BYD CO LTD	9,500	186.400	1,770,800.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	6,500	29.500	191,750.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	6,000	12.840	77,040.00	
	CGN POWER CO LTD-H	65,000	2.330	151,450.00	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	276,000	0.760	209,760.00	
	CHINA CITIC BANK	77,000	4.070	313,390.00	
	CHINA COAL ENERGY CO - H	20,000	8.910	178,200.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	3.300	26,400.00	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	875,000	4.730	4,138,750.00	
	CHINA COSCO HOLDINGS-H	30,150	8.380	252,657.00	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	12,000	2.390	28,680.00	

CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	15,000	2.790	41,850.00	
CHINA FEIHE LTD	32,000	3.770	120,640.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	11,500	3.920	45,080.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	26,800	6.720	180,096.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	14,000	5.950	83,300.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	13,200	9.350	123,420.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO- H	62,000	9.470	587,140.00	
CHINA LITERATURE LTD	3,600	23.700	85,320.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	4.840	154,880.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	8,000	11.820	94,560.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	28,000	18.440	516,320.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	40,500	30.050	1,217,025.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	10,000	9.560	95,600.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	55,900	2.680	149,812.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	42,000	2.860	120,120.00	
CHINA OILFIELD SERVICES- H	12,000	6.790	81,480.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	35,500	11.640	413,220.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	5,000	5.520	27,600.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	22,200	15.540	344,988.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	230,000	4.260	979,800.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	74,880	6.110	457,516.80	
CHINA POWER INTERNATIONAL	33,000	3.040	100,320.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	28,000	3.710	103,880.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	14,000	30.350	424,900.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	8,200	22.250	182,450.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	34,000	24.600	836,400.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	10,000	22.100	221,000.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	18,000	5.120	92,160.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	16,000	16.000	256,000.00	

CHINA RUYI HOLDINGS LTD	52,000	1.650	85,800.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	32,500	31.150	1,012,375.00	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	14,000	7.410	103,740.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	2.990	71,760.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	12,000	8.680	104,160.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	6,600	6.580	43,428.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	600	77.600	46,560.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	402,000	0.920	369,840.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	6,000	3.430	20,580.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	13,800	6.130	84,594.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	12,000	4.700	56,400.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	29,800	11.860	353,428.00	
CITIC LTD	50,000	7.780	389,000.00	
CITIC SECURITIES CO LTD- H	16,500	14.760	243,540.00	
CMOC GROUP LIMITED-H	24,000	4.490	107,760.00	
COSCO PACIFIC LTD	6,000	4.590	27,540.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	21,000	5.720	120,120.00	
CRRC CORP LTD H	34,000	3.760	127,840.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	18,000	3.130	56,340.00	
EAST BUY HOLDING LIMITED	3,000	24.100	72,300.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	5,800	57.000	330,600.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	6.000	42,000.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD- H	3,000	13.660	40,980.00	
FOSUN INTERNATIONAL	17,000	4.680	79,560.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3,200	36.200	115,840.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	2,200	21.250	46,750.00	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	170,000	1.020	173,400.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	5,700	6.720	38,304.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	57,000	8.100	461,700.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	13.560	135,600.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	4,800	8.020	38,496.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	15,000	8.420	126,300.00	

GREENTOWN CHINA HOLDINGS	11,500	6.050	69,575.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	30,000	4.560	136,800.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	19,600	3.260	63,896.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	16,000	13.820	221,120.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	25,400	23.250	590,550.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	5,000	18.160	90,800.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	10,000	3.660	36,600.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	8,000	13.220	105,760.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	4,500	24.750	111,375.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	15.780	47,340.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	14,000	4.150	58,100.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	5,400	9.030	48,762.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	2,000	27.600	55,200.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	590,000	3.920	2,312,800.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	12,500	38.750	484,375.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	10,550	28.150	296,982.50	
JD LOGISTICS INC	22,100	7.470	165,087.00	
JD.COM INC - CL A	22,157	91.850	2,035,120.45	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	7.880	15,760.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	9,000	11.240	101,160.00	
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	4,000	15.560	62,240.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	2,500	5.130	12,825.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	23,000	7.950	182,850.00	
KINGSOFT CORP LTD	8,000	21.100	168,800.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	19,700	43.550	857,935.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	36,000	7.040	253,440.00	
LEGEND GROUP LTD	58,000	8.370	485,460.00	
LI AUTO INC-CLASS A	10,800	124.800	1,347,840.00	
LI NING CO LTD	20,500	19.420	398,110.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	15,500	8.900	137,950.00	
MEITUAN-B	46,060	72.750	3,350,865.00	
MICROPORIT SCIENTIFIC CORP	5,300	6.710	35,563.00	
MINISO GROUP HOLDING LTD	4,200	36.450	153,090.00	
MINTH GROUP LTD	4,000	11.440	45,760.00	

NETEASE INC	17,900	169.400	3,032,260.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	6,000	14.540	87,240.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	14,000	70.300	984,200.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,000	3.530	10,590.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	19,600	43.550	853,580.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	1,000	115.700	115,700.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	105,000	2.500	262,500.00	
PETROCHINA CO LTD-H	180,000	5.820	1,047,600.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	69,000	9.770	674,130.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1,600	12.020	19,232.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	64,500	33.950	2,189,775.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	3,800	18.600	70,680.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	67,000	4.050	271,350.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	11,000	5.990	65,890.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	5,750	11.700	67,275.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,400	4.690	76,916.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	3,000	13.600	40,800.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	12.040	32,508.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	6,800	69.200	470,560.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	94,000	3.100	291,400.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	10,000	21.400	214,000.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	6,000	18.740	112,440.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	21,000	5.200	109,200.00	
SUNNY OPTICAL TECH	6,000	49.550	297,300.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	59,400	284.800	16,917,120.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	12,000	7.500	90,000.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	8,000	17.580	140,640.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	18,000	5.380	96,840.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	10,000	8.230	82,300.00	
TRIP.COM GROUP LTD	5,150	327.400	1,686,110.00	

	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	49.350	394,800.00	
	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	3,000	4.580	13,740.00	
	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	28,000	4.390	122,920.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	12,000	13.820	165,840.00	
	WUXI APPTec CO LTD-H	2,840	41.950	119,138.00	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	36,500	16.600	605,900.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	143,000	12.920	1,847,560.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	44,000	3.880	170,720.00	
	XPENG INC - CLASS A SHARES	9,700	36.900	357,930.00	
	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	4.150	37,350.00	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	10,000	11.880	118,800.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	15,000	16.880	253,200.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	17,200	5.150	88,580.00	
	ZAI LAB LTD	7,800	15.640	121,992.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	12,500	7.870	98,375.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	5.840	11,680.00	
	ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	5,900	22.500	132,750.00	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	7,700	12.480	96,096.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,500	13.200	85,800.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	3,900	20.850	81,315.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	48,000	12.340	592,320.00	
	ZTE CORP-H	6,200	14.940	92,628.00	
香港・ドル	小計	7,134,857		89,852,710.75 (1,727,867,623)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	4,000	564.000	2,256,000.00	
	ACER INC	21,000	47.400	995,400.00	
	ADVANTECH CO LTD	5,408	390.000	2,109,120.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	1,075.000	1,075,000.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	1,000	4,080.000	4,080,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	30,000	136.000	4,080,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	16,000	40.150	642,400.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	6,000	477.500	2,865,000.00	
	AUO CORPORATION	51,800	18.250	945,350.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	4,000	199.500	798,000.00	

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	83,000	45.000	3,735,000.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	13,067	174.000	2,273,658.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	20,450	17.700	361,965.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	13,000	46.400	603,200.00	
CHINA AIRLINES LTD	20,000	20.250	405,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	127,083	12.450	1,582,183.35	
CHINA STEEL CORP	99,000	25.400	2,514,600.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	28,000	122.000	3,416,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	36,000	36.900	1,328,400.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	151,000	28.700	4,333,700.00	
DELTA ELECTRONICS INC	19,000	292.000	5,548,000.00	
E INK HOLDINGS INC	6,000	223.000	1,338,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	119,136	24.800	2,954,572.80	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,000	521.000	521,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	2,870.000	2,870,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	18,000	31.500	567,000.00	
EVERGREEN MARINE	5,660	149.000	843,340.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	21,000	31.350	658,350.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	17,000	80.800	1,373,600.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,718	166.500	619,047.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	86,522	27.200	2,353,398.40	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	39,000	58.100	2,265,900.00	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	12,000	74.100	889,200.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	33,000	73.800	2,435,400.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	73,621	66.100	4,866,348.10	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	4,000	366.500	1,466,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	1,000	1,525.000	1,525,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	560.000	1,120,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	115,200	103.000	11,865,600.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	3,040	657.000	1,997,280.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	70,314	21.900	1,539,876.60	
INNOLUX CORPORATION	75,558	16.550	1,250,484.90	
INVENTEC CO LTD	23,000	56.500	1,299,500.00	

LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	2,395.000	2,395,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	16,000	109.000	1,744,000.00	
MEDIATEK INC	14,000	963.000	13,482,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	94,197	38.400	3,617,164.80	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	5,000	191.000	955,000.00	
MOMO.COM INC	1,100	444.500	488,950.00	
NAN YA PLASTICS CORP	41,000	61.600	2,525,600.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	2,000	230.500	461,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	8,000	66.600	532,800.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	352.500	352,500.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	5,000	550.000	2,750,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,000	1,290.000	1,290,000.00	
PEGATRON CORP	16,000	84.800	1,356,800.00	
PHARMAESSENTIA CORP	2,000	319.500	639,000.00	
POU CHEN	7,000	30.350	212,450.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	32,000	27.750	888,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,000	268.000	1,340,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	25,000	241.500	6,037,500.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	4,000	470.000	1,880,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	8,802	37.150	326,994.30	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	150,244	8.470	1,272,566.68	
SILERGY CORP	3,000	405.500	1,216,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	110,435	19.850	2,192,134.75	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	8,000	74.700	597,600.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	91,124	17.350	1,581,001.40	
TAIWAN BUSINESS BANK	47,104	13.500	635,904.00	
TAIWAN CEMENT	71,090	32.800	2,331,752.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	89,516	25.850	2,313,988.60	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	29.500	177,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	14,000	98.000	1,372,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	218,000	678.000	147,804,000.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	35,000	44.850	1,569,750.00	

	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	45,000	74.600	3,357,000.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	11,000	192.500	2,117,500.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	93,000	49.150	4,570,950.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	8,000	75.300	602,400.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,420.000	1,420,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	24,000	36.450	874,800.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	3,795	47.900	181,780.50	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	17,000	27.700	470,900.00	
	WISTRON CORP	22,000	122.500	2,695,000.00	
	WIWYNN CORP	1,000	2,250.000	2,250,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	11,760	89.000	1,046,640.00	
	YAGEO CORPORATION	3,387	551.000	1,866,237.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	9,000	46.900	422,100.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	101,569	27.450	2,788,069.05	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	4,000	99.700	398,800.00	
台湾・ドル	小計	2,968,700		323,968,007.23 (1,550,996,835)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	10,352	166.990	1,728,680.48	
	ANGLO PLATINUM LTD	730	730.000	532,900.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	5,045	334.330	1,686,694.85	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	4,644	198.950	923,923.80	
	BID CORP LTD	2,644	443.240	1,171,926.56	
	BIDVEST GROUP LTD	1,934	234.000	452,556.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	828	2,040.000	1,689,120.00	
	CLICKS GROUP LTD	2,024	292.870	592,768.88	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	5,088	135.580	689,831.04	
	EXXARO RESOURCES LTD	1,516	182.000	275,912.00	
	FIRSTRAND LTD	50,239	64.510	3,240,917.89	
	GOLD FIELDS LTD	7,317	261.870	1,916,102.79	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	3,846	107.540	413,598.84	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	6,688	65.880	440,605.44	
	KUMBA IRON ORE LTD	436	559.890	244,112.04	
	MTN GROUP LTD	13,303	90.430	1,202,990.29	
	NASPERS LTD-N SHS	1,679	3,286.230	5,517,580.17	
	NEDBANK GROUP LTD	3,843	229.600	882,352.80	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	3,367	124.810	420,235.27	

NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	3,672	106.750	391,986.00	
OLD MUTUAL LTD	28,719	11.870	340,894.53	
OUTSURANCE GROUP LTD	6,649	41.210	274,005.29	
PEPKOR HOLDINGS LTD	14,569	19.520	284,386.88	
REINET INVESTMENTS SCA	764	480.000	366,720.00	
REMGRO LTD	3,116	150.500	468,958.00	
SANLAM LIMITED	14,251	73.080	1,041,463.08	
SASOL LTD	4,283	147.750	632,813.25	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	3,930	263.780	1,036,655.40	
SIBANYE STILLWATER LTD	24,991	20.850	521,062.35	
STANDARD BANK GROUP LTD	12,147	207.900	2,525,361.30	
VODACOM GROUP LTD	6,605	93.000	614,265.00	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	6,896	67.870	468,031.52	
南アフリカ・ランド 小計	256,115		32,989,411.74 (261,276,141)	
合計	29,070,627		8,587,933,852 (8,587,933,852)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年2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	16,579.00	552,412.28	
		ISHARES MSCI QATAR CP ETF	32,967.00	578,966.45	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	63,049.00	2,809,463.44	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	57,122.00	852,831.46	
	アメリカ・ドル	小計	169,717.00	4,793,673.63 (720,872,641)	
投資信託受益証券 合計			169,717	720,872,641 (720,872,641)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	21,300.00	649,650.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	8,462.00	620,687.70	
	メキシコ・ペソ	小計	29,762.00	1,270,337.70 (11,205,395)	
投資証券 合計			29,762	11,205,395 (11,205,395)	
合計				732,078,036 (732,078,036)	

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

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 43銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	2.29 -	- 6.85	- -	10.32
インド・ルピー	株式 131銘柄	15.71	-	-	17.74
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.74	-	-	1.97
オフショア・人民元	株式 235銘柄	3.81	-	-	4.30
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.09	-	-	0.10
タイ・バーツ	株式 37銘柄	1.44	-	-	1.63
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.11	-	-	0.12
チリ・ペソ	株式 11銘柄	0.38	-	-	0.43
トルコ・リラ	株式 17銘柄	0.64	-	-	0.72
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.25	-	-	0.28
フィリピン・ペソ	株式 14銘柄	0.55	-	-	0.63
ブラジル・レアル	株式 48銘柄	4.90	-	-	5.54
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.86	-	-	0.97
マレーシア・リングgit	株式 31銘柄	1.18	-	-	1.33
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄 投資証券 2銘柄	2.33 -	- -	- 0.11	2.75
ユーロ	株式 11銘柄	0.48	-	-	0.54
韓国・ウォン	株式 102銘柄	11.20	-	-	12.65
香港・ドル	株式 179銘柄	16.42	-	-	18.54
台湾・ドル	株式 90銘柄	14.73	-	-	16.64
南アフリカ・ランド	株式 32銘柄	2.48	-	-	2.80

(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（2024年2月21日から2024年8月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2024年2月20日現在	第2期中間計算期間 2024年8月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	17	15,617
コール・ローン	1,780	210,889
親投資信託受益証券	95,474,135	904,417,413
未収入金	3,367,956	1,005,406
流動資産合計	98,843,888	905,649,325
資産合計	98,843,888	905,649,325
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,366,060	981,337
未払受託者報酬	733	51,355
未払委託者報酬	2,917	192,763
その他未払費用	323	9,031
流動負債合計	3,370,033	1,234,486
負債合計	3,370,033	1,234,486
純資産の部		
元本等		
元本	84,295,821	737,697,455
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	11,178,034	166,717,384
(分配準備積立金)	1,940,365	1,409,959
元本等合計	95,473,855	904,414,839
純資産合計	95,473,855	904,414,839
負債純資産合計	98,843,888	905,649,325

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2024年2月21日 至 2024年8月20日
営業収益	
受取利息	19
有価証券売買等損益	8,005,386
営業収益合計	8,005,405
営業費用	
受託者報酬	51,355
委託者報酬	192,763
その他費用	9,031
営業費用合計	253,149
営業利益又は営業損失（ ）	7,752,256
経常利益又は経常損失（ ）	7,752,256
中間純利益又は中間純損失（ ）	7,752,256
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,466,732
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,178,034
剰余金増加額又は欠損金減少額	170,178,867
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	170,178,867
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,925,041
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,925,041
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（ ）	166,717,384

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2024年2月21日	至 2024年8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1期	第2期中間計算期間
	2024年2月20日現在	2024年8月20日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	84,295,821円
期中追加設定元本額	88,499,860円	756,600,017円
期中一部解約元本額	5,204,039円	103,198,383円
2. 受益権の総数	84,295,821口	737,697,455口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期	第2期中間計算期間
	2024年2月20日現在	2024年8月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期 2024年2月20日現在	第2期中間計算期間 2024年8月20日現在
1口当たり純資産額	1.1326円	1.2260円
(1万口当たり純資産額)	(11,326円)	(12,260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」受益証券及び「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における同親投資信託の状況は以下の通りであります。それらは監査意見の対象外であります。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2024年8月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	437,992,204
コール・ローン	5,914,397,723
株式	242,937,235,980
派生商品評価勘定	125,094,000
未収配当金	289,529,253
前払金	53,070,000
差入委託証拠金	560,403,834
流動資産合計	250,317,722,994
資産合計	250,317,722,994
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	93,789,600
未払解約金	1,962,800,970
流動負債合計	2,056,590,570
負債合計	2,056,590,570
純資産の部	
元本等	
元本	77,665,496,532
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	170,595,635,892
元本等合計	248,261,132,424
純資産合計	248,261,132,424
負債純資産合計	250,317,722,994

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月21日 至 2024年8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8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	71,936,737,810円
同期中追加設定元本額	15,721,553,686円
同期中一部解約元本額	9,992,794,964円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,182,322,176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)	3,024,131,055円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,069,182円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,127,747,614円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,783,211,645円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	6,801,491,179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)	2,000,253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)	3,120,236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)	8,665,628円
DCニッセイ国内株式インデックス	4,681,896,550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	25,569,015,865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)	4,941,322,014円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	442,130,784円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	255,071,152円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	510,751,247円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	680,368,825円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	34,627,133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)	140,195,130円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	13,263,018円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	15,130,386円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	5,266,639円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	11,027,342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)	30,029,449円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	373,633,095円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	245,608,076円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	447,830,452円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	214,174,024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)	13,815,259,005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)	29,979,376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)	30,745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)	68,526円
FWニッセイ国内株インデックス	92,979,006円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	164,440,139円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	15,534,211円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	105,375円
計	77,665,496,532円
2. 受益権の総数	77,665,496,532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8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8月20日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	5,098,830,000	-	5,130,240,000	31,410,000
合計	5,098,830,000	-	5,130,240,000	31,410,000

(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8月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1965円 (31,965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8月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,399,767,209
金銭信託	857,294,194
コール・ローン	11,576,413,441
株式	1,008,315,001,871
投資証券	19,544,509,701
派生商品評価勘定	550,969,159
未収入金	758,736,755
未収配当金	1,090,184,457
差入委託証拠金	13,520,756,260
流動資産合計	1,059,613,633,047
資産合計	
1,059,613,633,047	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	107,371,758
未払金	1,558,974,398
未払解約金	532,023,978
流動負債合計	2,198,370,134
負債合計	
2,198,370,134	
純資産の部	
元本等	
元本	234,467,445,054
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	822,947,817,859
元本等合計	1,057,415,262,913
純資産合計	
1,057,415,262,913	
負債純資産合計	
1,059,613,633,047	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月21日 至 2024年8月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年8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	223,761,836,770円
同期中追加設定元本額	25,662,521,254円
同期中一部解約元本額	14,956,912,970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）	749,048,763円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,675,030,800円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,611,521,574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）	2,314,829,642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）	703,292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）	1,465,744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）	4,631,364円
ニッセイ外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	491,825,198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	161,151,999,546円
DCニッセイ外国株式インデックス	43,745,758,002円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	3,415,367,483円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	447,695,007円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	179,606,741円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	511,429,352円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	633,174,649円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	9,276,938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)	89,566,597円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	9,030,352円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	10,320,892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)	3,595,296円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	20,488,191円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	377,863,511円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	246,822,250円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	446,158,561円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	151,825,130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)	125,386,795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)	275,816,215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)	126,300,438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)	123,711,824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)	123,192,791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)	110,046,136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)	31,021,770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)	10,709,616,451円
FWニッセイ先進国株インデックス	48,946,410円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	166,752,006円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド 2023-05 (適格機関投資家限定)	79,980,978円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	169,292,173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)	78,239,172円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	107,020円
計	234,467,445,054円
2. 受益権の総数	234,467,445,054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8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8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				
アメリカ・ドル	10,071,958,929	-	10,033,445,210	38,513,719
イギリス・ポンド	6,605,818,512	-	6,562,419,630	43,398,882
ユーロ	1,049,871,244	-	1,054,679,500	4,808,256
ユーロ	2,416,269,173	-	2,416,346,080	76,907
合計	10,071,958,929	-	10,033,445,210	38,513,719

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2024年8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	27,102,002,795	-	27,584,113,917	482,111,122
合計	27,102,002,795	-	27,584,113,917	482,111,122

（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8月20日現在
1口当たり純資産額	4,5099円
（1万口当たり純資産額）	（45,099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8月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	239,547,688
金銭信託	85,012,824
コール・ローン	1,147,964,844
株式	10,895,096,230
投資信託受益証券	771,769,565
投資証券	8,671,513
派生商品評価勘定	44,202,272
未収入金	747,670
未収配当金	30,743,162
差入委託証拠金	462,816,105
流動資産合計	13,686,571,873
資産合計	13,686,571,873
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,107,708
未払金	76,298,282
未払解約金	20,418,425
流動負債合計	104,824,415
負債合計	104,824,415
純資産の部	
元本等	
元本	9,244,626,534
剰余金	
剰余金又は欠損金()	4,337,120,924
元本等合計	13,581,747,458
純資産合計	13,581,747,458
負債純資産合計	13,686,571,873

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月21日 至 2024年8月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年8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	7,713,247,784円
同期中追加設定元本額	2,380,306,973円
同期中一部解約元本額	848,928,223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	2,951,224,876円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	27,516,606円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	31,377,085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）	10,933,291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）	62,288,193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）	651,826,815円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	3,497,276,478円
FWニッセイ新興国株インデックス	36,834,266円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	62,123,290円
DCニッセイ新興国株式インデックス	1,913,225,634円
計	9,244,626,534円
2. 受益権の総数	9,244,626,534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8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	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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8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 アメリカ・ドル	1,117,075,865	-	1,110,475,860	6,600,005
	1,117,075,865	-	1,110,475,860	6,600,005
合計	1,117,075,865	-	1,110,475,860	6,600,005

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2024年8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	1,857,777,562	-	1,900,472,130	42,694,568
合計	1,857,777,562	-	1,900,472,130	42,694,568

（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8月20日現在	
1口当たり純資産額		1.4692円
（1万口当たり純資産額）		（14,692円）

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年8月30日現在

資産総額	1,065,278,321円
負債総額	3,131,282円
純資産総額（ - ）	1,062,147,039円
発行済数量	873,685,561口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2157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8月30日現在

資産総額	253,636,526,089円
負債総額	600,481,879円
純資産総額（ - ）	253,036,044,210円
発行済数量	77,913,565,353口
1口当たり純資産額（ / ）	3.2477円

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

資産総額	1,053,469,238,301円
負債総額	1,187,786,240円
純資産総額（ - ）	1,052,281,452,061円
発行済数量	235,346,819,343口
1口当たり純資産額（ / ）	4.4712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8月30日現在

資産総額	13,513,360,524円
負債総額	52,013,455円
純資産総額（ - ）	13,461,347,069円
発行済数量	9,347,154,399口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4402円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限

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

(4) 受益権の譲渡

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

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

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2024年8月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間における資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

会社の意思決定機構

委託会社は最低3名で構成される取締役会により運営されます。取締役は委託会社の株主であることを要しません。取締役は株主総会の決議により選任され、その任期は就任後1年以内の最終の決算期に関する定時株主総会終結のときまでとします。ただし、任期満了前に退任した取締役の補欠として選任された取締役の任期は、退任者の残存期間とします。

取締役会は、取締役のなかから代表取締役を選任するとともに、取締役社長1名を選任します。また、取締役会は、取締役会長1名を選任することができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用）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8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	410	77,173
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	115	20,031
単位型公社債投資信託	0	0
合計	525	97,204

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

3【委託会社等の経理状況】

1.財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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

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									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	56,866,270	57,546,077	75,827,917
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	9,008,883	9,008,883	9,008,883
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	10,048,489	10,048,489	10,048,489
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	1,039,606	1,039,606	1,039,606
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	57,905,876	58,585,683	76,867,523

	評価・換算差額等			純資産 合計
	その他有価 証券評価差 額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	348,871	192,067	156,803	75,984,720
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	9,008,883
当期純利益	-	-	-	10,048,489
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)	603,603	114,109	717,713	717,713
当期変動額合計	603,603	114,109	717,713	321,892
当期末残高	254,732	306,177	560,910	76,306,613

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

5. 収益及び費用の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>投資信託委託業務 投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。 委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</p> <p>投資運用業務 投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。 運用受託報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。また、成功報酬は、契約上定められる超過収益の達成等により報酬額及び支払われることが確定した時点で収益として認識しております。</p> <p>投資助言業務 投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。 投資助言報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、契約期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</p>
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
7. ヘッジ会計の方法	<p>ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。</p> <p>ヘッジ手段・・・為替予約 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定は、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間について、原則として個々取引毎に行います。</p> <p>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
8. グループ通算制度の適用	<p>当社は、日本生命保険相互会社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。</p>

（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

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

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

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 其他有価証券	-	19,289,693	-	19,289,693
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	24,321	-	24,321
合計	-	19,265,372	-	19,265,372

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

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 其他有価証券	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 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)
現金・預金	31,522,565	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	5,100,000	18,340,000	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
其他(注)	3,029,947	15,086,454	997,574	175,716
合計	39,652,513	33,426,454	997,574	175,716

(注) 投資信託受益証券であります。

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)
現金・預金	23,594,998	-	-	-
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	-	-
其他有価証券のうち満期があるもの				
国債・地方債等	-	-	-	3,000,000
其他(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	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,778,610	6,336,999	441,610
	小計	6,778,610	6,336,999	441,610
貸借対照表計上 額が取得原価ま たは償却原価を 超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	12,511,082	13,413,000	901,917
	小計	12,511,082	13,413,000	901,917
	合計	19,289,693	19,749,999	460,306

（注1）投資信託受益証券等であります。

（注2）関係会社株式66,222千円は、市場価格がないことから、上表には記載しておりません。

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	-	-	-
	国債・地方債等	3,473,100	3,459,180	13,920
	社債	-	-	-
	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	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	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 〇 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 〇 で示しております。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度である退職一時金制度と確定拠出型年金制度を採用しております。退職一時金制度については、年俸制適用者及び年俸制非適用者を制度の対象としております。受入出向者については、退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。

2．確定給付制度

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

	前事業年度 (自 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。

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

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	
株式会社スマートプラス ¹	100	
楽天証券株式会社	19,495	
moomoo証券株式会社	3,500	
松井証券株式会社	11,945	
日本生命保険相互会社	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 ²	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（契約締結行為等はいりません）。

(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」の運用に関する投資助言を行います。

3【資本関係】

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

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

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

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2024年5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 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイ全世界株式インデックスコレクトの2023年9月15日から2024年2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、DCニッセイ全世界株式インデックスコレクトの2024年2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．X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月18日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイ全世界株式インデックスコレクトの2024年2月21日から2024年8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、DCニッセイ全世界株式インデックスコレクトの2024年8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（2024年2月21日から2024年8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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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