

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2025年3月10日提出
<b>【発行者名】</b>	ニッセイアセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	代表取締役社長 大関 洋
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	投資信託業務部 茶木 健
<b>【電話番号】</b>	03 - 5533 - 4608
<b>【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】</b>	FWニッセイ国内株インデックス FWニッセイ先進国株インデックス FWニッセイ新興国株インデックス FWニッセイ国内債インデックス FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり） FWニッセイ外国債インデックス FWニッセイ新興国債インデックス FWニッセイ国内リートインデックス FWニッセイ先進国リートインデックス
<b>【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】</b>	継続募集額 各ファンドにつき、1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

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

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

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

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

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

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

取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

「外国債インデックス(ヘッジあり)」

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

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

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

なお、委託会社へは後記「(8) 申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

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

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2025年3月11日から2025年9月10日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に各々の販売会社より、委託会社の指定する口座を經由して、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。

(10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 1 2 ) 【その他】

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### 基本方針

###### 「国内株インデックス」

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

###### 「先進国株インデックス」

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

###### 「新興国株インデックス」

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

###### 「国内債インデックス」

ファンドは、N O M U R A - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

###### 「外国債インデックス ( ヘッジあり ) 」

ファンドは、F T S E 世界国債インデックス ( 除く日本 ) ( 円ヘッジベース ) の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

###### 「外国債インデックス」

ファンドは、F T S E 世界国債インデックス ( 除く日本、円換算ベース ) の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

###### 「新興国債インデックス」

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

###### 「国内リートインデックス」

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

###### 「先進国リートインデックス」

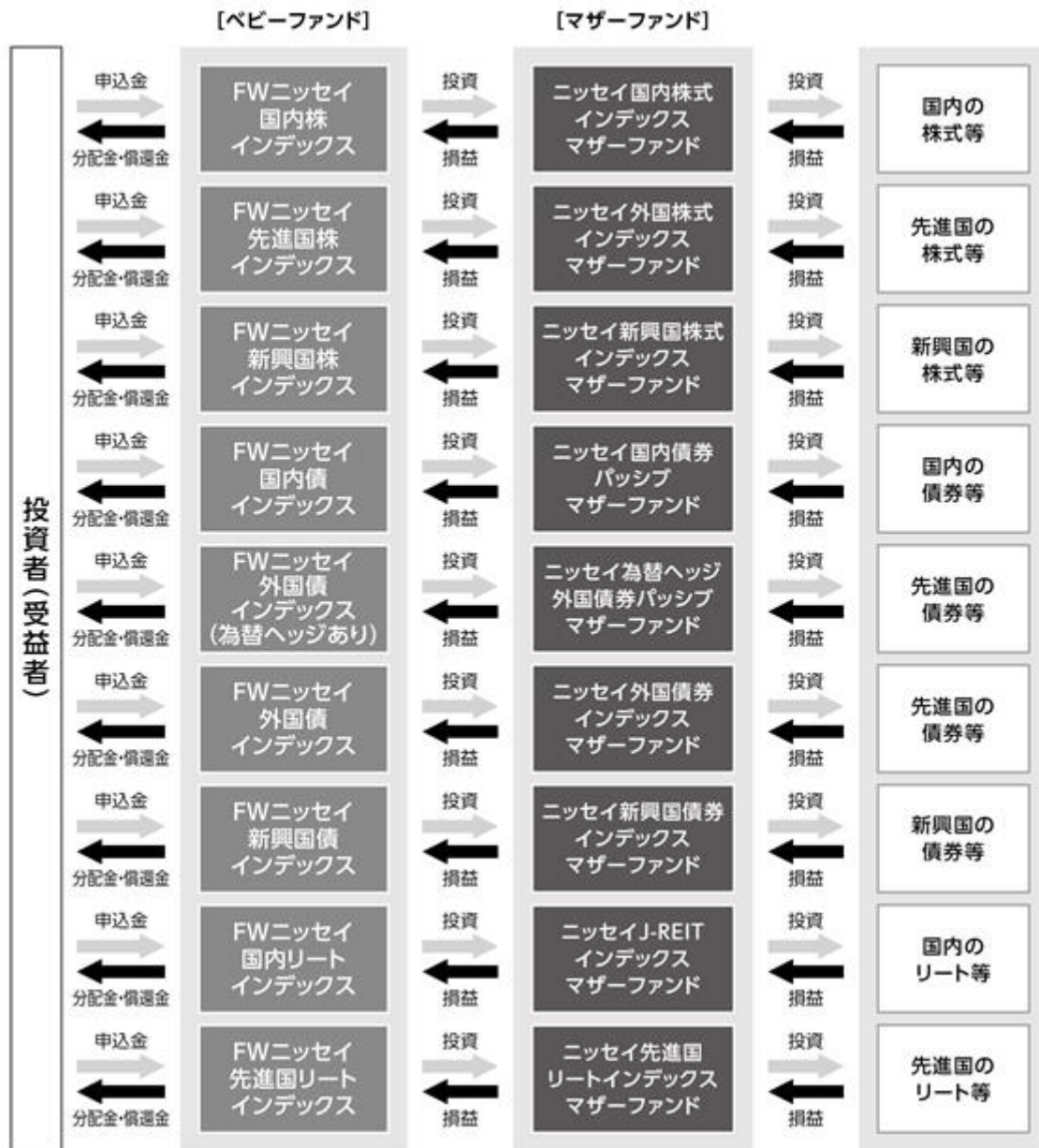
ファンドは、S & P 先進国R E I T インデックス ( 除く日本、配当込み、円換算ベース ) の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

## 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



## ファンドの特色

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

### 〈FWニッセイ国内株インデックス〉

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

#### ●TOPIX（東証株価指数）

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

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

### 〈FWニッセイ先進国株インデックス〉

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

・原則として、対円での為替ヘッジ\*は行いません。

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

#### ●MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

### 〈FWニッセイ新興国株インデックス〉

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

・原則として、対円での為替ヘッジ\*は行いません。

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

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

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

#### ●MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

### 〈FWニッセイ国内債インデックス〉

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

#### ●NOMURA-BPI総合

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

**〈FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)〉**

日本を除く世界主要国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本)(円ヘッジベース)の動きに連動する投資成果をめざします。

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

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

**●FTSE世界国債インデックス(除く日本)(円ヘッジベース)**

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

**〈FWニッセイ外国債インデックス〉**

日本を除く世界主要国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の動きに連動する投資成果をめざします。

・原則として、対円での為替ヘッジ\*は行いません。

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

**●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)**

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

**〈FWニッセイ新興国債インデックス〉**

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

・原則として、対円での為替ヘッジ\*は行いません。

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

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

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

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

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

**〈FWニッセイ国内リートインデックス〉**

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

**●東証REIT指数**

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

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



### 〈FWニッセイ先進国リートインデックス〉

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

・原則として、対円での為替ヘッジ<sup>®</sup>は行いません。

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

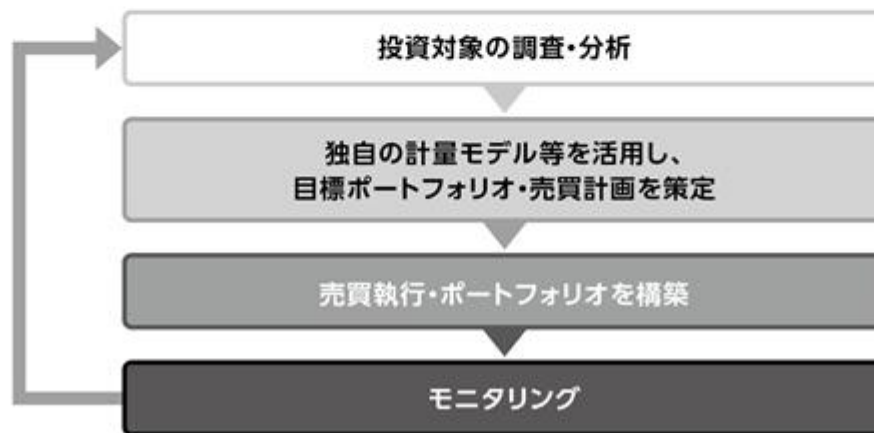
### ●S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

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

### 【各ファンドにおける基準価額と指数の連動性に関する留意点】

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

### 〈運用プロセスのイメージ〉



### <MSCI指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

## 信託金の上限

各ファンドにつき、次の額を限度とします。ただし、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

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

## ファンドの分類

「国内株インデックス」

追加型投信 / 国内 / 株式 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

## 「先進国株インデックス」

追加型投信 / 海外 / 株式 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

## 「新興国株インデックス」

追加型投信 / 海外 / 株式 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

## 「国内債インデックス」

追加型投信 / 国内 / 債券 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

追加型投信 / 海外 / 債券 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

#### 商品分類表

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

#### 属性区分表

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



## 「外国債インデックス」

追加型投信 / 海外 / 債券 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

## 「新興国債インデックス」

追加型投信 / 海外 / 債券 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

## 「国内リートインデックス」

追加型投信 / 国内 / 不動産投信 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 ( ) 資産複合	インデックス型 特殊型

## 属性区分表

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

## 「先進国リートインデックス」

追加型投信 / 海外 / 不動産投信 / インデックス型に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

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

## 属性区分表

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

商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
海外	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
株式	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
債券	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
不動産投信（リート）	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 （投資信託証券 （株式（一般）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
その他資産 （投資信託証券 （債券（一般）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、公社債等に主として投資する旨の記載があるものをいう。
その他資産 （投資信託証券 （債券（公債）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む）に主として投資する旨の記載があるものをいう。
その他資産 （投資信託証券 （不動産投信））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
年1回 日本	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本除く）	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
エマージング	目論見書または約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。
為替ヘッジあり （フルヘッジ）	目論見書または約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
TOPIX	目論見書または約款において、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。
その他の指数 （MSCI コクサイ・ インデックス）	目論見書または約款において、MSCIコクサイ・インデックスの動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。
その他の指数 （MSCI エマージング・ マーケット・ インデックス）	目論見書または約款において、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。
その他の指数 （NOMURA - BPI総合）	目論見書または約款において、NOMURA - BPI総合の動きに連動することを目標に運用を行う旨の記載があるものをいう。

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

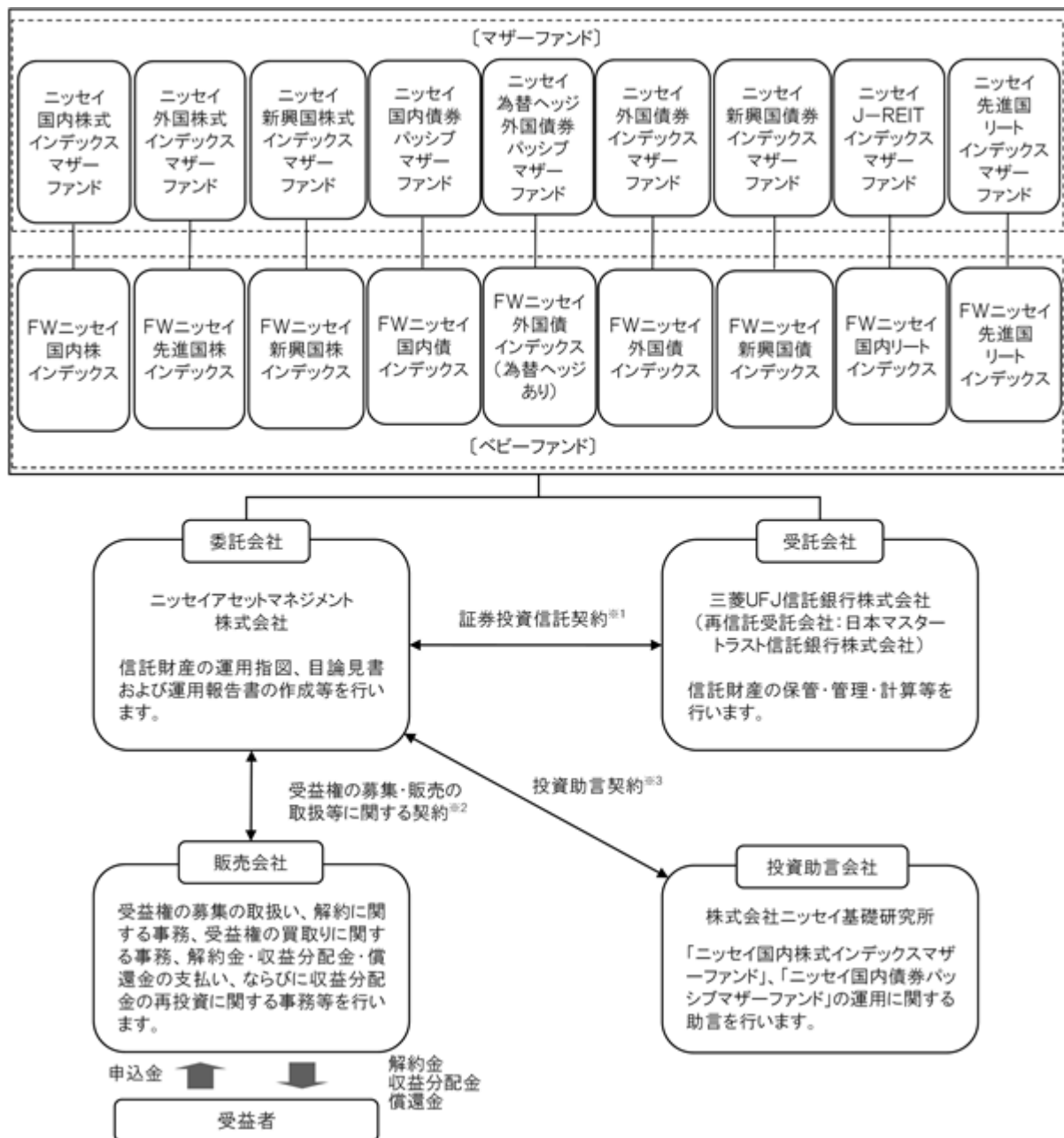
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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

## ( 2 ) 【ファンドの沿革】

2021年11月30日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



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

## 委託会社の概況（2024年12月末現在）

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

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## 「国内株インデックス」

主としてニッセイ国内株式インデックスマザーファンドに投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

株式以外の資産（上記マザーファンドを通じて投資する場合は、当該マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、このファンドの信託財産に属するとみなした部分を含みます）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。



## (参考) マザーファンドの概要

### ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

#### (1) 基本方針

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

#### (2) 運用方法

##### a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

##### b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

#### 「先進国株インデックス」

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

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

## （参考）マザーファンドの概要

### ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

#### （１）基本方針

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

#### （２）運用方法

##### a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

##### b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### （３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

#### 「新興国株インデックス」

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

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (参考) マザーファンドの概要

### ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

#### (1) 基本方針

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

#### (2) 運用方法

##### a 投資対象

新興国の株式等(DR(預託証券)を含みます)を主要投資対象とします。

##### b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

#### 「国内債インデックス」

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (参考) マザーファンドの概要

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。なお、ここでいう新株予約権とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます)の新株予約権をいいます。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限りません。

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

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

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

## 「外国債インデックス(ヘッジあり)」

主として、ニッセイが替ヘッジ外国債券パッシブマザーファンドを通じて、実質的に日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本)(円ヘッジベース)に連動する投資成果をめざします。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (参考) マザーファンドの概要

### ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブマザーファンド

#### (1) 基本方針

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

#### (2) 運用方法

##### a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

##### b 投資態度

主として、日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス(除く日本)(円ヘッジベース)に連動する投資成果をめざします。

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

#### 「外国債インデックス」

主として、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドを通じて、実質的に日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に連動する投資成果をめざします。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (参考) マザーファンドの概要

### ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

#### (1) 基本方針

マザーファンドは、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

#### (2) 運用方法

##### a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

##### b 投資態度

主として、日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)に連動する投資成果を目指します。

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

#### 「新興国債インデックス」

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

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (参考) マザーファンドの概要

### ニッセイ新興国債券インデックスマザーファンド

#### (1) 基本方針

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

#### (2) 運用方法

##### a 投資対象

新興国の米ドル建て公社債を主要投資対象とします。

##### b 投資態度

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

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

#### 「国内リートインデックス」

主として、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンドへの投資を行い、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （参考）マザーファンドの概要

### ニッセイJ - REITインデックスマザーファンド

#### （1）基本方針

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

#### （2）運用方法

##### a 投資対象

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

##### b 投資態度

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

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### （3）投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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

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

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



## 「先進国リートインデックス」

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

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

上記マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （参考）マザーファンドの概要

## ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

## （1）基本方針

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

## （2）運用方法

## a 投資対象

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

## b 投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （3）投資制限

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

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## (2) 【投資対象】

## a 主な投資対象

## 「国内株インデックス」

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

## 「先進国株インデックス」

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

## 「新興国株インデックス」

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

## 「国内債インデックス」

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

## 「外国債インデックス（ヘッジあり）」

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

## 「外国債インデックス」

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

## 「新興国債インデックス」

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

## 「国内リートインデックス」

ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます）を主要投資対象とします。

## 「先進国リートインデックス」

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます）を主要投資対象とします。

## b 約款に定める投資対象

## 投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

## イ．有価証券

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

## ハ．約束手形

## 二．金銭債権

### 「国内リートインデックス」

#### イ．有価証券

ロ．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」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

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

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

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

#### 1．株券または新株引受権証券

#### 2．国債証券

#### 3．地方債証券

#### 4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

#### 10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

#### 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書

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

#### 20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）

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

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

1. 国債証券
  2. 地方債証券
  3. 特別の法律により法人の発行する債券
  4. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます)の新株引受権証券を除きます)
  5. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます)
  6. 転換社債の転換および新株予約権の行使により取得した株券(なお、ここでいう新株予約権とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます)の新株予約権をいいます)
  7. コマーシャル・ペーパー
  8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.から7.までの証券または証書の性質を有するもの
  9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます)
  10. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます)
  11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます)
  12. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  13. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります)
  14. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます)
  15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  16. 金銭を信託する信託の受益権および金銭債権を信託する信託の受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  17. 外国の者に対する権利で15.および16.の有価証券の性質を有するもの
- ただし、9.および10.の証券については、株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券に投資するものを除きます。
- なお、6.の証券および8.の証券または証書のうち6.の証券の性質を有するものを以下「株式」といい、1.から5.までの証券および8.の証券または証書のうち1.から5.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、9.および10.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

## 「国内リートインデックス」

- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、1．の証券の性質を有するもの
- 3．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます）
- 4．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）

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

## 金融商品

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

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

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

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

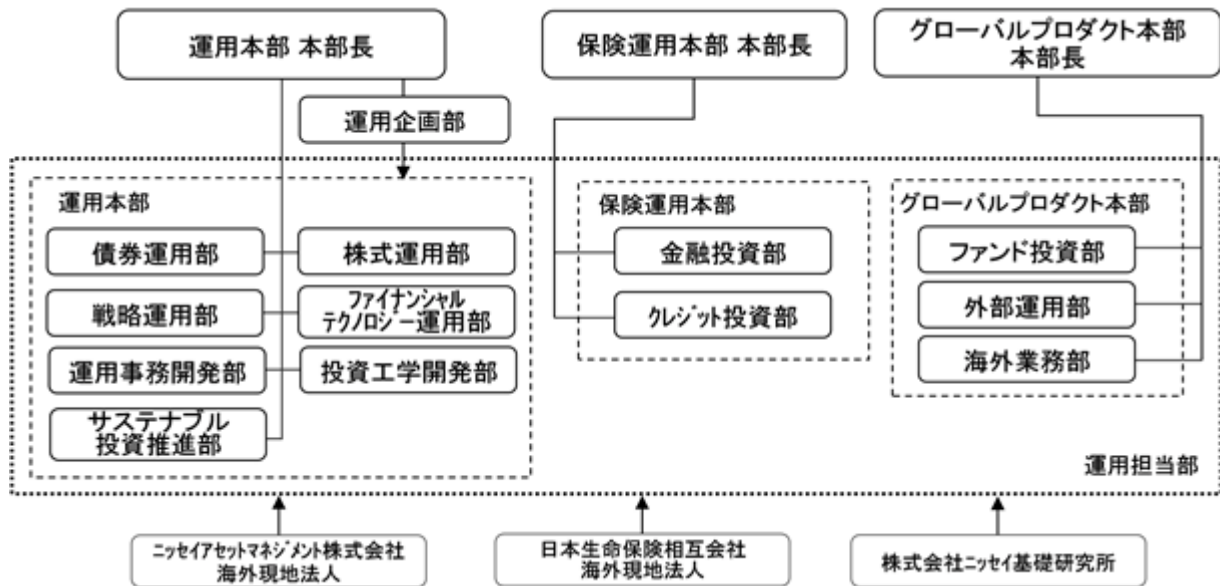
- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6．外国の者に対する権利で5．の権利の性質を有するもの
- 7．金銭を信託する信託の受益権および金銭債権を信託する信託の受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号または第2号で定めるもの

## 「国内リートインデックス」

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形

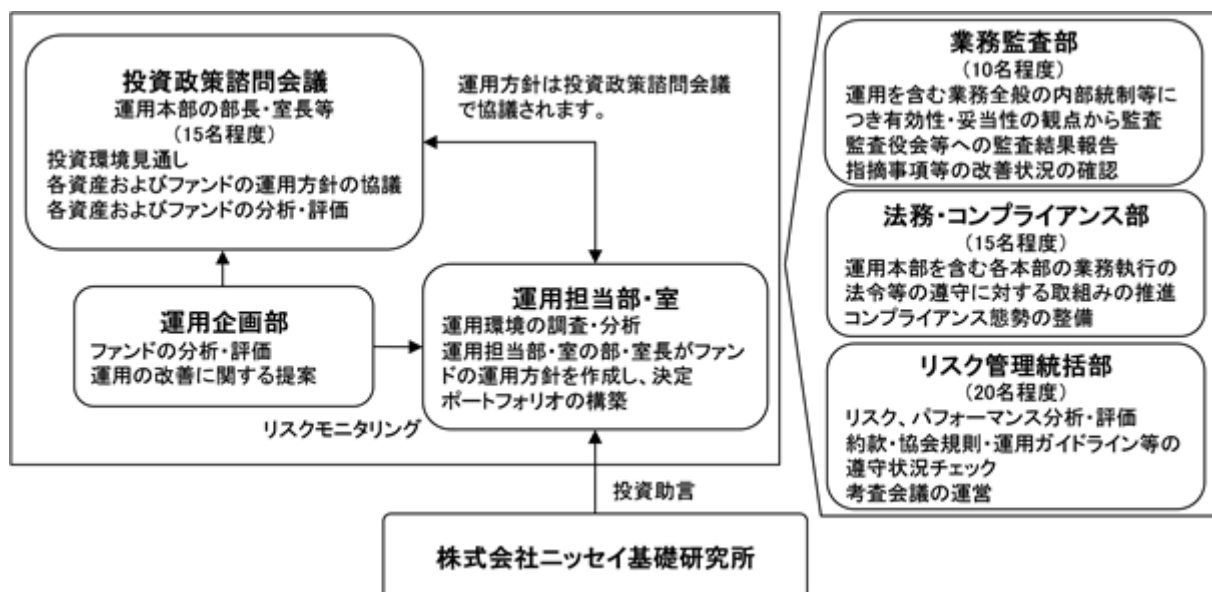
前記 にかかわらず、このファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記 に掲げる金融商品により運用することができます。

(3) 【運用体制】  
委託会社の組織体制

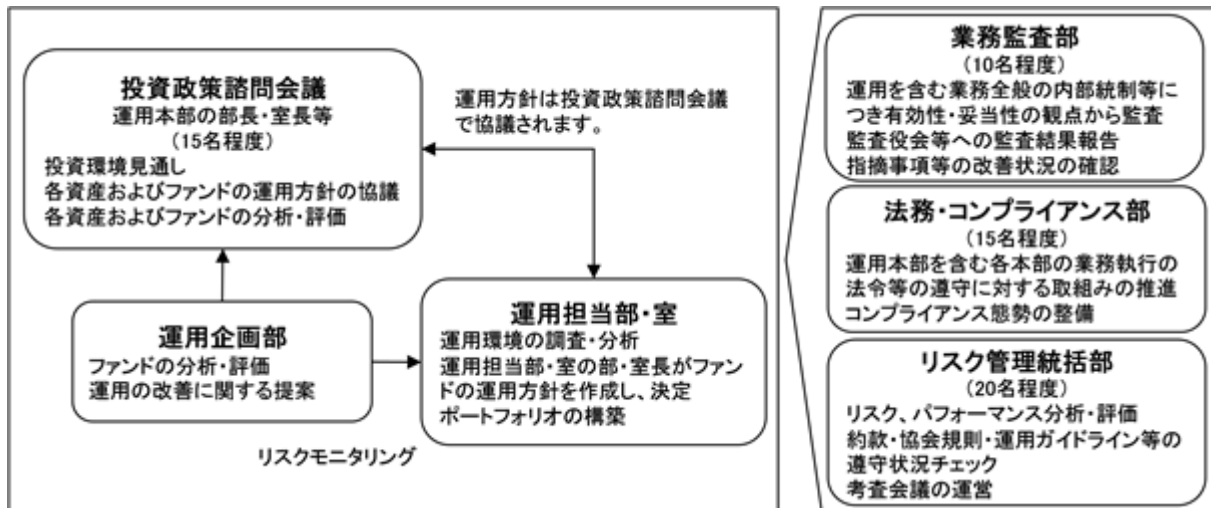


社内規程として、投資信託財産及び投資法人資産に係る運用業務規程およびポートフォリオ・マネジャー／アナリスト服務規程を定めています。また、各投資対象の適切な利用、リスク管理の推進を目的として、各投資対象の取扱いに関して規程を設けています。

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



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



#### < 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- 1．分配対象額の範囲  
経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。
- 2．分配対象額についての分配方針  
委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。  
信託財産の十分な成長に資することに配慮し、分配を抑制する方針です。
- 3．留保益の運用方針  
留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。  
分配時期  
毎決算日とし、決算日は12月10日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。  
支払方法  
< 分配金受取コースの場合 >  
税金を差引いた後、原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。  
< 分配金再投資コースの場合 >  
税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

## (5) 【投資制限】

## a 約款に定める主な投資制限

## 「国内株インデックス」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

## 「先進国株インデックス」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## 「新興国株インデックス」

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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



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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

#### 「国内債インデックス」

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

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限りま

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

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

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

#### 「外国債インデックス(ヘッジあり)」

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

#### 「外国債インデックス」

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

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

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

投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

#### 「新興国債インデックス」

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

#### 「国内リートインデックス」

投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

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

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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

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

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

#### 「先進国リートインデックス」

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

##### 「国内株インデックス」

投資する株式等の範囲

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

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

信用取引の範囲

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

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

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

先物取引等

1. 国内の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます)ならびに外国の金融商品取引所における国内の有価証券

にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ)。

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

#### スワップ取引

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

1. 金利先渡取引を行うことができます。
2. 金利先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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の50%を超えないものとします。
  - ・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。
3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとします。

#### 有価証券の空売り

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

#### 有価証券の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとしします。
  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します。
  4. 前記1.の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。
- 資金の借入れ
1. 信託財産を効率的に運用するため、ならびに信託財産を安定的に運用するため、一部解約にともなう支払資金の手当て(一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます)を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとしします。
  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します。
  3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
  4. 借入金の利息は信託財産中より支払われます。

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

##### 投資する株式等の範囲

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

##### 信用取引の範囲

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

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

#### 金利先渡取引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、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、
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、

#### 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、
  - ・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、
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとし、
3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとし、

#### 有価証券の空売り

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

#### 有価証券の借入れ

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

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

#### 資金の借入れ

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

### 「国内債インデックス」

#### 投資する株式等の範囲

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

#### 信用取引の範囲

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

#### 先物取引等

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



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

#### スワップ取引

1. 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます)を行うことができます。
2. スワップ取引にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。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

1. 金利先渡取引を行うことができます。
2. 金利先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、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の50%を超えないものとします。
  - ・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。
3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとします。

#### 有価証券の空売り

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

#### 有価証券の借入れ

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



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

#### 「外国債インデックス(ヘッジあり)/新興国債インデックス」

##### 投資する株式等の範囲

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

##### 信用取引の範囲

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

##### 先物取引等

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

##### スワップ取引

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

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

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

#### 「外国債インデックス」

##### 投資する株式等の範囲

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

##### 信用取引の範囲

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

##### 先物取引等

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

##### スワップ取引

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

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

#### 4. 前記1. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

##### 外国為替予約等

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

##### 資金の借入れ

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

#### 「国内リートインデックス」

##### 先物取引等

国内の金融商品取引所における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号口に掲げるものをいいます）のうち不動産投信指数を対象とする先物取引ならびに外国の金融商品取引所における国内の有価証券にかかるこの取引と類似の取引を行うことができます。

##### 公社債の借入れ

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

##### 資金の借入れ

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

券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

## c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

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

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

「国内リートインデックス」

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。

### 3【投資リスク】

#### （１）投資リスクおよび留意事項

##### 「国内株インデックス」

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動することを目標に運用しますので、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

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

##### ・流動性リスク

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

##### ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

##### ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

##### ・短期金融資産の運用に関する留意点

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

##### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

##### ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2024年12月10日現在、ファンドを1百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の0.4%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。



- ・流動性に関する留意点

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

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

「先進国株インデックス」

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

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

- ・株式投資リスク

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

- ・為替変動リスク

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

- ・カントリーリスク

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

- ・流動性リスク

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

- ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

- ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

- ・短期金融資産の運用に関する留意点  
 コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。
- ・ファミリーファンド方式に関する留意点  
 ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。
- ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点  
 委託会社は2024年12月10日現在、ファンドを1百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の0.6%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。
- ・流動性に関する留意点  
 ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。  
 これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付けを取消する可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

#### 「新興国株インデックス」

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

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

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

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

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

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

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる収益分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり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12月10日現在、ファンドを1百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の2.0%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

・流動性に関する留意点

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

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

## 「国内債インデックス」

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、NOMURA - B P I 総合の動きに連動することを目標に運用しますので、NOMURA - B P I 総合の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

## ・債券投資リスク

## 金利変動リスク

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

## 信用リスク

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

## ・流動性リスク

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

## ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

## ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

## ・短期金融資産の運用に関する留意点

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

## ・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

## ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2024年12月10日現在、ファンドを0.9百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の2.6%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

- ・流動性に関する留意点

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

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

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

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

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

- ・債券投資リスク

- 金利変動リスク

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

- 信用リスク

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

- ・為替変動リスク

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

- ・カントリーリスク

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

- ・流動性リスク

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

- ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

- ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

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

- ・短期金融資産の運用に関する留意点  
コマーシャル・ペーパー、コール・ローン等の短期金融資産で運用する場合、発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。
- ・ファミリーファンド方式に関する留意点  
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。
- ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点  
委託会社は2024年12月10日現在、ファンドを0.8百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の9.0%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。
- ・流動性に関する留意点  
ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。  
これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付けを取消しする可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

#### 「外国債インデックス」

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

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

- ・債券投資リスク
  - 金利変動リスク  
金利は、景気や経済の状況等の影響を受け変動し、それにともない債券価格も変動します。一般に金利が上昇した場合には、債券の価格が下落します。
  - 信用リスク  
債券の発行体が財政難・経営不振、資金繰り悪化等に陥り、債券の利息や償還金をあらかじめ定められた条件で支払うことができなくなる場合（債務不履行）、またはそれが予想される場合、債券の価格が下落することがあります。
- ・為替変動リスク  
原則として対円での為替ヘッジを行わないため、外貨建資産については、為替変動の影響を直接的に受けます。一般に円高局面ではファンドの資産価値が減少します。
- ・カントリーリスク  
外国の資産に投資するため、各国の政治・経済情勢、外国為替規制、資本規制等による影響を受け、ファンドの資産価値が減少する可能性があります。

- ・流動性リスク  
市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。
- ・基準価額と指数の連動性に関する留意点  
ファンドはF T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざしますが、当該指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングのずれ、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから、基準価額と当該指数の動きは完全に一致するものではありません。
- ・収益分配金に関する留意点  
収益分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財産から支払われますので、収益分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。  
収益分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超過し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12月10日現在、ファンドを1百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の0.7%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。
- ・流動性に関する留意点  
ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。  
これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付けを取消する可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

## 「新興国債インデックス」

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

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

## ・債券投資リスク

## 金利変動リスク

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

## 信用リスク

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

## ・為替変動リスク

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

## ・カントリーリスク

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

## ・流動性リスク

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

## ・新興国の債券投資に関する留意点

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

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

## ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

## ・収益分配金に関する留意点

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

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



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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2024年12月10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61.2%）保有しています。また、2024年11月末現在、ファンドの投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に15.3%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する可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性などがあります。

### 「国内リートインデックス」

ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動することを目標に運用しますので、東証REIT指数（配当込み）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

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

金利変動リスク

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

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

信用リスク

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

## J - R E I Tの税制に関するリスク

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

## リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

### ・流動性リスク

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

### ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

### ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

### ・短期金融資産の運用に関する留意点

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

### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

### ・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社は2024年12月10日現在、ファンドを0.9百万円（受益権口数1百万口、ファンド全体の13.0%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

### ・流動性に関する留意点

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

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

## 「先進国リートインデックス」

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

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

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

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

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

## ・不動産投資信託（リート）投資リスク

## 保有不動産に関するリスク

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

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

## 金利変動リスク

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

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

## 信用リスク

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

## リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

## ・為替変動リスク

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

## ・カントリーリスク

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

## ・流動性リスク

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

## ・基準価額と指数の連動性に関する留意点

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

## ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にもない、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12月10日現在、ファンドを1百万円(受益権口数1百万口、ファンド全体の2.7%)保有しています。また、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2024年11月末現在、ファンドの投資対象であるマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に18.2%保有しています。

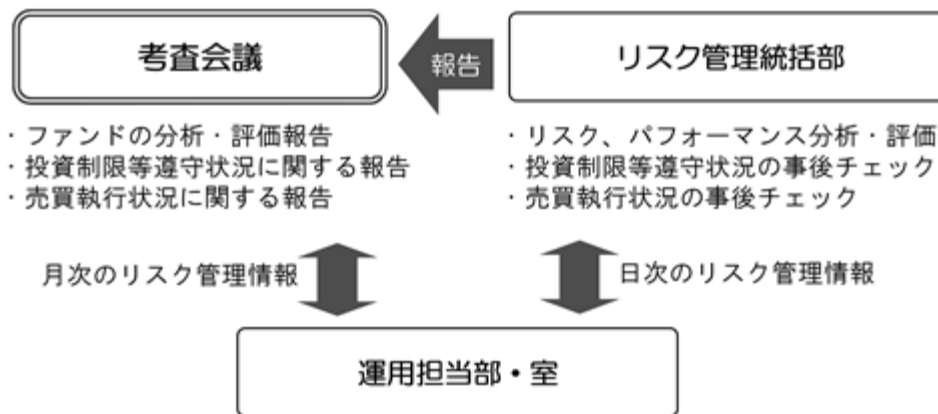
当該保有分は委託会社または日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

・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。

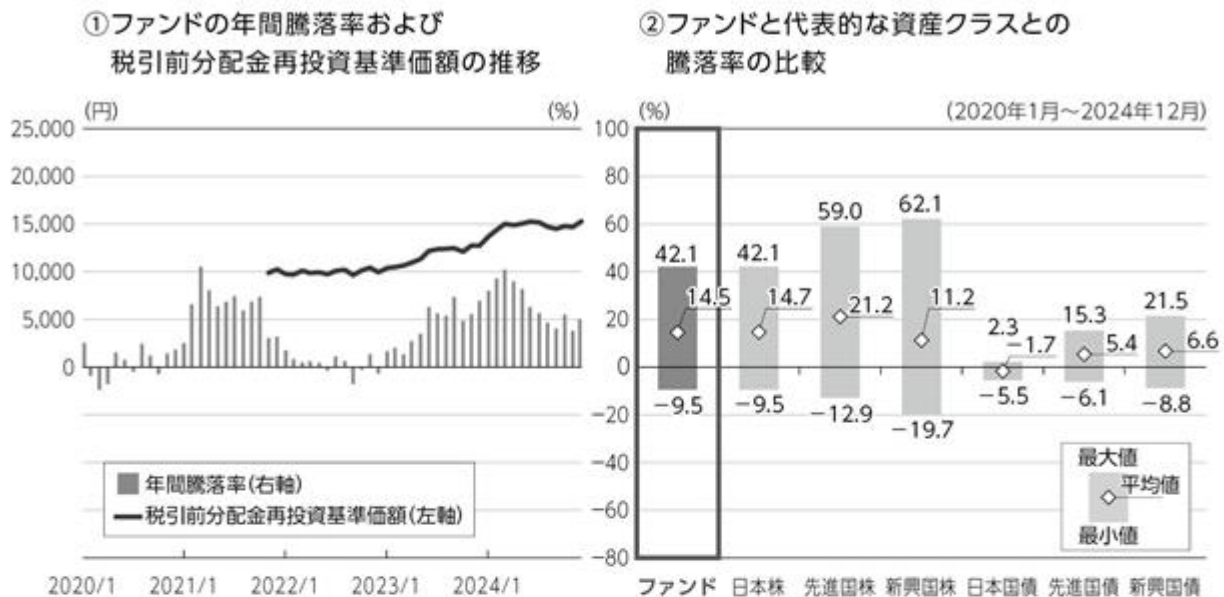
上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

< 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。

## ●FWニッセイ国内株インデックス



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

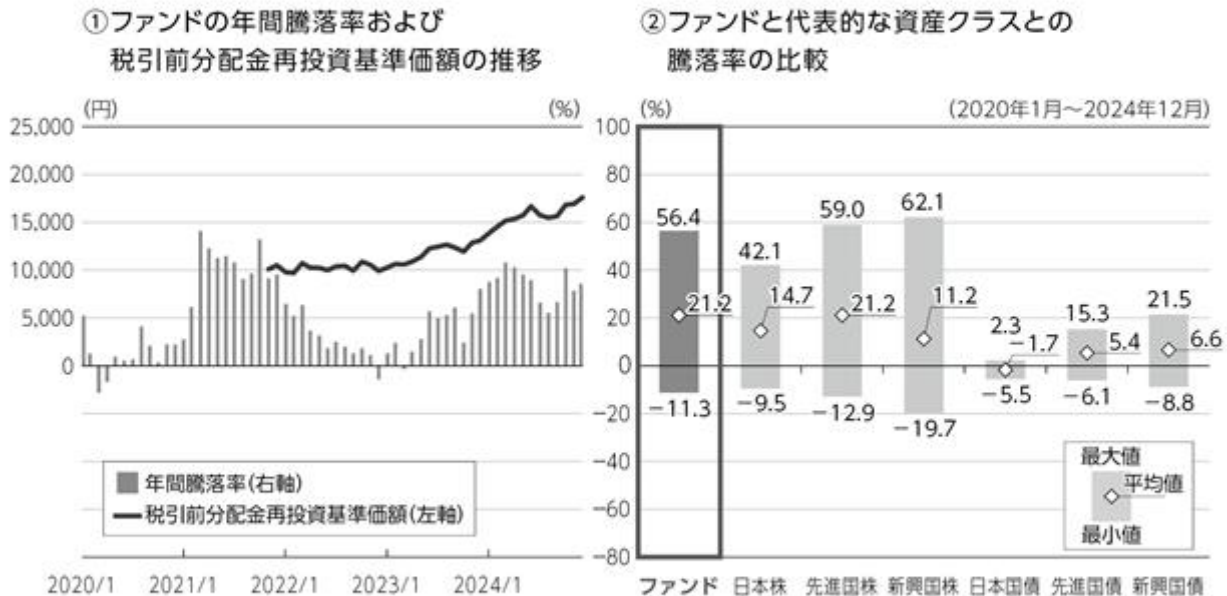
**!** 前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

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



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

## ●FWニッセイ先進国株インデックス



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

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間ににおけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

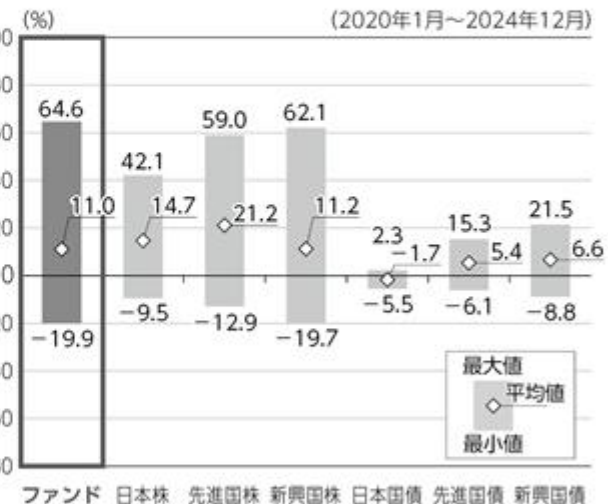
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

## ●FWニッセイ新興国株インデックス

①ファンドの年間騰落率および  
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)

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

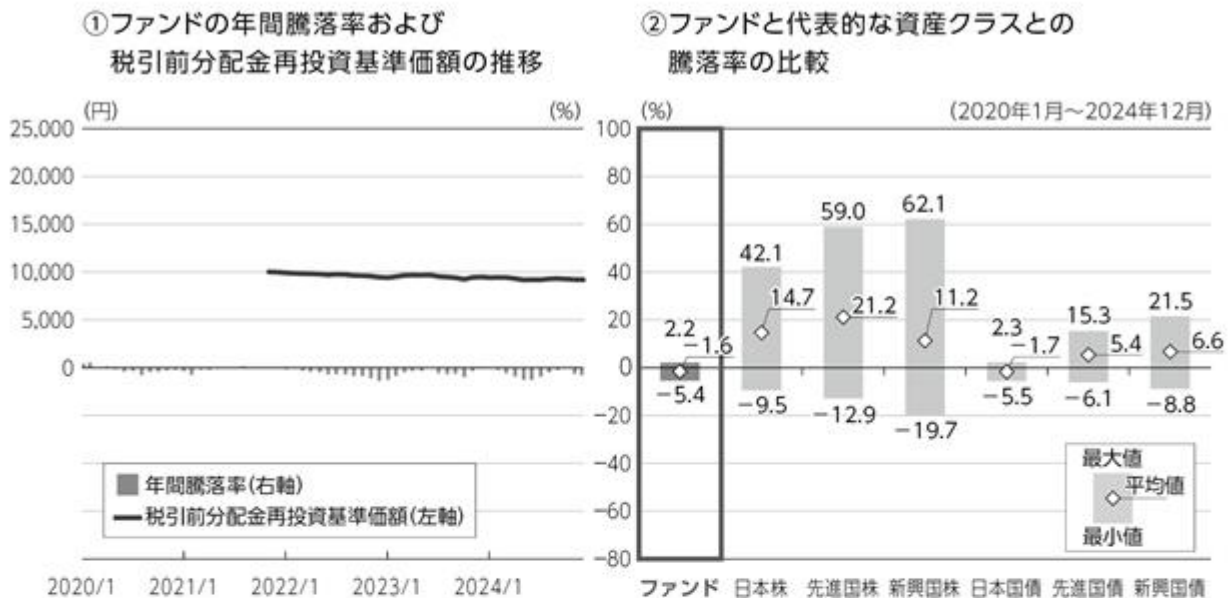
❗前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

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



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

## ●FWニッセイ国内債インデックス



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

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

### <代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

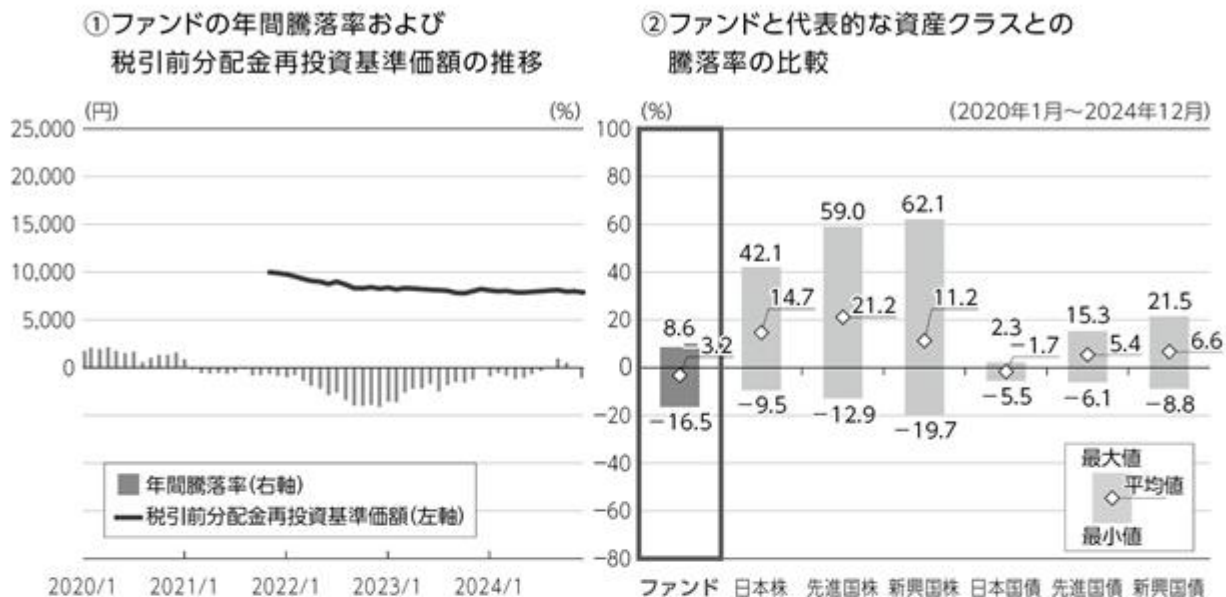
- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

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

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

## ●FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

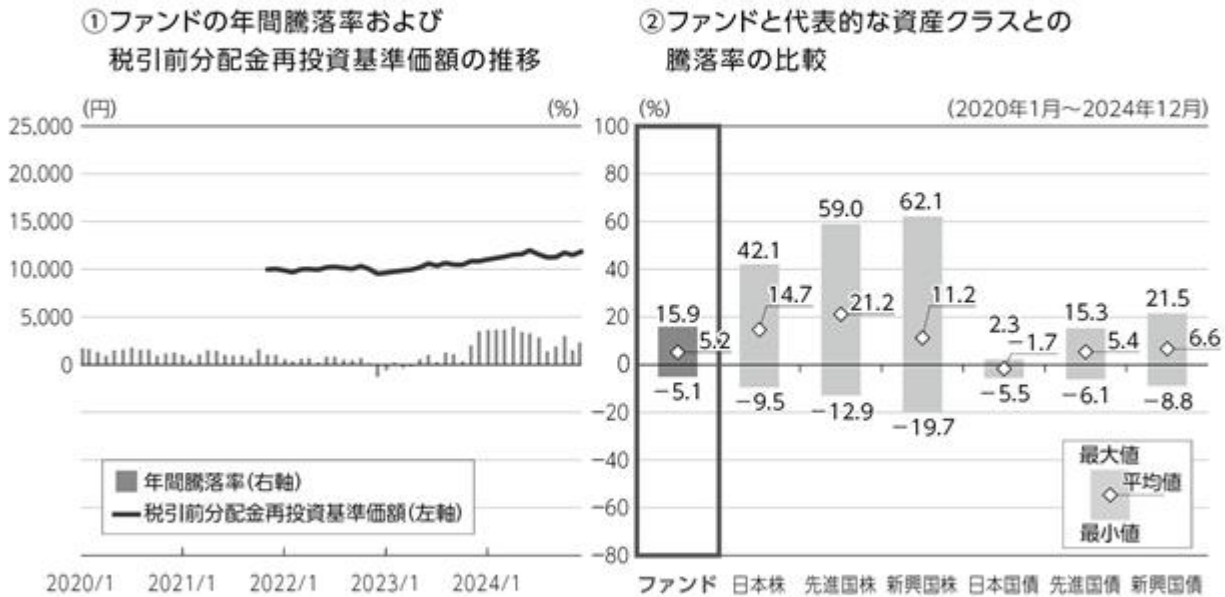
❗前記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆、保証するものではありません。

- ・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる商標または商標は、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財産権は同社に帰属します。



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

## ●FWニッセイ外国債インデックス



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

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間におけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)

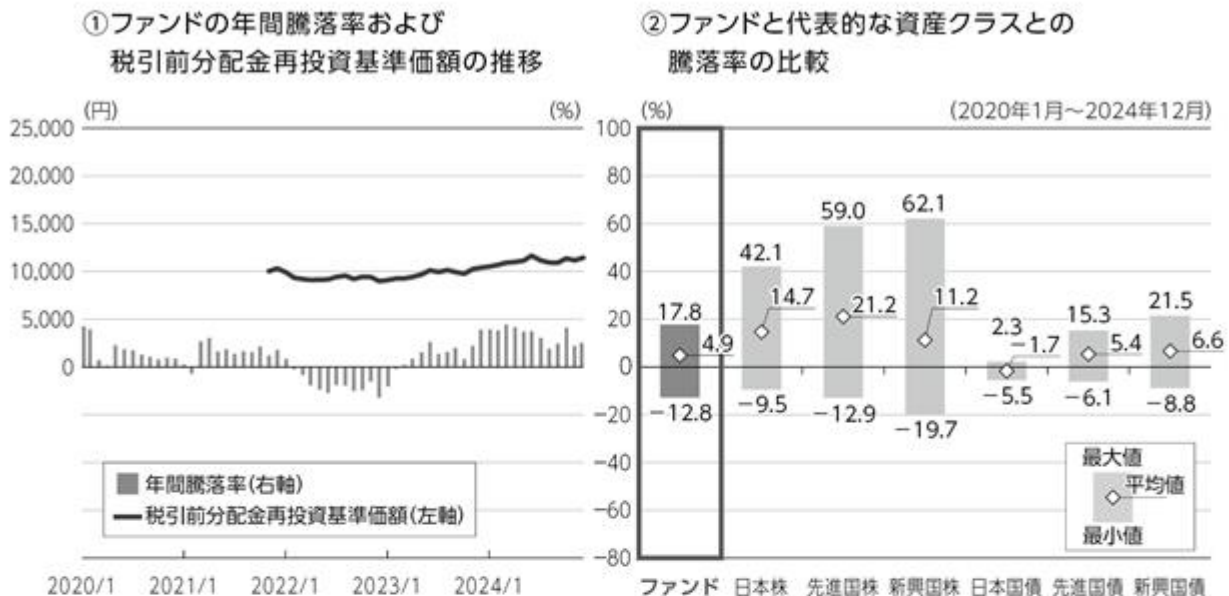
- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

- ・TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる商標または商標は、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。

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

## ●FWニッセイ新興国債インデックス



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

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間に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エマーシング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

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

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

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



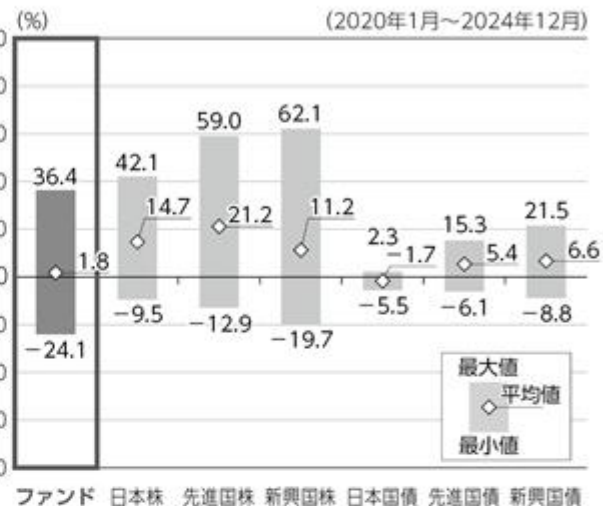
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

## ●FWニッセイ国内リートインデックス

### ①ファンドの年間騰落率および 税引前分配金再投資基準価額の推移



### ②ファンドと代表的な資産クラスとの 騰落率の比較



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

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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間ににおけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数) (配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)

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

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

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

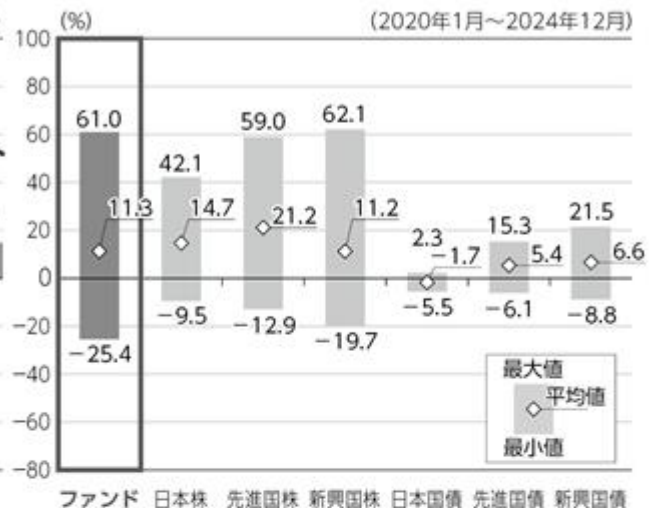
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

## ●FWニッセイ先進国リートインデックス

### ①ファンドの年間騰落率および 税引前分配金再投資基準価額の推移



### ②ファンドと代表的な資産クラスとの 騰落率の比較



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

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

## [FWニッセイ国内株インデックス]

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

## [FWニッセイ先進国株インデックス]

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

## [FWニッセイ新興国株インデックス]

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

## [FWニッセイ国内債インデックス]

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

## [FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)]

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



## [FWニッセイ外国債インデックス]

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

## [FWニッセイ新興国債インデックス]

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

## [FWニッセイ国内リートインデックス]

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

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

## [FWニッセイ先進国リートインデックス]

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

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

・上記すべての表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

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



## (4) 【その他の手数料等】

## 証券取引の手数料等

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

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

ありません。

## 「外国債インデックス（ヘッジあり）」

購入時：取得申込受付日の翌営業日の基準価額に0.03%をかけた額とします。

換金時：換金請求受付日の翌営業日の基準価額に0.03%をかけた額とします。

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

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

## &lt;ご参考&gt;

「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・收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收受
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收受
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收受
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收受
証券取引の手数料	有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
監査費用	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
借入金の利息	受託会社等から一時的に資金を借入れた場合に発生する利息

## （５）【課税上の取扱い】

## 課税対象

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

## 個人の課税の取扱い

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

## 税率（個人）

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

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

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

## &lt; 少額投資非課税制度について &gt;

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」は少額上場株式等に関する非課税制度であり、NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

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

対象は税法上の要件を満たしたファンドを購入した場合に限られ、いずれのファンドもNISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象となります。ただし、販売会社により取扱いが異なる場合があります。

詳しくは、販売会社にお問合せください。

## 法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

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

## 税率（法人）

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

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

## 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

普通分配金	元本払戻金（特別分配金）
<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>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

## 国内株インデックス

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
0.29%	0.29%	0.01%

## 先進国株インデックス

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
0.34%	0.32%	0.02%

## 新興国株インデックス

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
0.48%	0.33%	0.15%

## 国内債インデックス

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
0.21%	0.20%	0.01%

## 外国債インデックス(ヘッジあり)

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
0.27%	0.24%	0.03%

## 外国債インデックス

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
0.33%	0.29%	0.04%

## 新興国債インデックス

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
0.32%	0.30%	0.03%

## 国内リートインデックス

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
0.29%	0.29%	0.01%

## 先進国リートインデックス

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
0.44%	0.32%	0.13%

・対象期間:2023年12月12日~2024年12月10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口当たり)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。なお、前記「ファンドの費用」に記載の監査費用は、「②その他費用の比率」に含まれます。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## F Wニッセイ国内株インデックス

2024年12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	355,599,267	100.00
内 日本	355,599,267	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,439	0.00
純資産総額	355,590,828	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ先進国株インデックス

2024年12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	291,469,862	100.00
内 日本	291,469,862	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,686	0.00
純資産総額	291,462,176	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ新興国株インデックス

2024年12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	68,497,699	100.00
内 日本	68,497,699	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,866	0.00
純資産総額	68,495,833	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ国内債インデックス

2024年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	36,092,005	100.00
内 日本	36,092,005	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	588	0.00
純資産総額	36,091,417	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

2024年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	8,876,590	100.00
内 日本	8,876,590	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	174	0.00
純資産総額	8,876,416	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ外国債インデックス

2024年12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	160,785,196	100.00
内 日本	160,785,196	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,795	0.00
純資産総額	160,781,401	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ新興国債インデックス

2024年12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	1,882,178	100.00
内 日本	1,882,178	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	45	0.00
純資産総額	1,882,133	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ国内リートインデックス

2024年12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	7,313,763	100.00
内 日本	7,313,763	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	171	0.00
純資産総額	7,313,592	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ先進国リートインデックス

2024年12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	48,927,666	100.00
内 日本	48,927,666	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,293	0.00
純資産総額	48,926,373	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12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	259,225,506,880	97.94
内 日本	259,225,506,880	97.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,455,955,586	2.06
純資産総額	264,681,462,466	100.00

## その他資産の投資状況

2024年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	5,099,295,000	1.93
内 日本	5,099,295,000	1.93

（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12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,161,027,858,925	96.50
内 アメリカ	889,900,939,122	73.96
内 イギリス	41,273,471,863	3.43
内 カナダ	37,729,492,909	3.14
内 スイス	30,514,976,488	2.54
内 フランス	28,860,156,696	2.40
内 ドイツ	26,218,144,289	2.18
内 オーストラリア	19,777,127,468	1.64
内 オランダ	17,468,221,015	1.45
内 アイルランド	14,214,427,906	1.18
内 スウェーデン	8,964,636,602	0.75
内 デンマーク	8,414,884,306	0.70
内 スペイン	7,804,463,568	0.65
内 イタリア	6,838,178,736	0.57
内 香港	4,863,865,658	0.40
内 シンガポール	3,613,711,496	0.30
内 ベルギー	2,809,606,512	0.23
内 フィンランド	2,800,800,928	0.23
内 イスラエル	1,948,996,506	0.16
内 ノルウェー	1,648,376,889	0.14
内 ジャージー	1,014,320,323	0.08
内 オランダ領キュラソー	947,297,248	0.08
内 パミュータ	839,092,035	0.07
内 ケイマン諸島	613,712,796	0.05
内 ニュージーランド	592,957,763	0.05
内 オーストリア	553,882,336	0.05
内 ポルトガル	475,259,009	0.04
内 ルクセンブルグ	326,858,458	0.03
投資証券	20,696,647,342	1.72
内 アメリカ	18,139,438,687	1.51
内 オーストラリア	1,301,859,170	0.11
内 フランス	393,927,989	0.03
内 イギリス	289,388,885	0.02
内 シンガポール	272,019,578	0.02
内 香港	193,018,081	0.02
内 ベルギー	63,454,671	0.01
内 カナダ	43,540,281	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	21,421,213,539	1.78
純資産総額	1,203,145,719,806	100.00

## その他資産の投資状況

2024年12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）	21,227,721,190	1.76
内 アメリカ	16,921,977,765	1.41
内 ドイツ	2,163,372,733	0.18
内 イギリス	2,142,370,692	0.18

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	13,519,732,233	85.28
内 台湾	2,864,559,096	18.07
内 インド	2,843,381,796	17.94
内 香港	1,556,934,325	9.82
内 中国	1,426,848,165	9.00
内 韓国	1,315,883,492	8.30
内 ケイマン諸島	813,259,553	5.13
内 ブラジル	518,367,732	3.27
内 南アフリカ	421,151,446	2.66
内 アメリカ	333,499,194	2.10
内 メキシコ	249,589,720	1.57
内 マレーシア	221,467,514	1.40
内 タイ	213,226,970	1.35
内 インドネシア	212,712,731	1.34
内 ポーランド	121,577,558	0.77
内 トルコ	93,993,970	0.59
内 フィリピン	75,421,206	0.48
内 ギリシャ	61,448,832	0.39
内 チリ	58,389,943	0.37
内 ハンガリー	37,687,644	0.24
内 バミューダ	35,445,893	0.22
内 チェコ	18,149,282	0.11
内 コロンビア	13,082,606	0.08
内 オランダ	9,321,417	0.06
内 ペルー	4,330,427	0.03
内 ロシア	1,667	0.00
内 カザフスタン	30	0.00
内 イギリス	20	0.00
内 イギリス領バージン諸島	4	0.00
投資信託受益証券	1,031,426,357	6.51
内 アメリカ	1,031,426,357	6.51
投資証券	7,001,089	0.04
内 メキシコ	7,001,089	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,294,356,897	8.16
純資産総額	15,852,516,576	100.00

## その他資産の投資状況

2024年12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）	1,263,771,201	7.97
内 アメリカ	1,263,771,201	7.97

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2024年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	52,229,605,720	81.08
内 日本	52,229,605,720	81.08
地方債証券	3,110,546,348	4.83
内 日本	3,110,546,348	4.83
特殊債券	4,529,317,851	7.03
内 日本	4,529,317,851	7.03
社債券	4,034,713,100	6.26
内 日本	4,034,713,100	6.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	510,268,106	0.79
純資産総額	64,414,451,125	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド

2024年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	122,867,671,054	103.26
内 アメリカ	58,063,917,031	48.80
内 中国	13,441,810,124	11.30
内 フランス	9,020,871,213	7.58
内 イタリア	8,551,275,294	7.19
内 ドイツ	7,210,209,930	6.06
内 イギリス	6,322,945,111	5.31
内 スペイン	5,408,456,082	4.55
内 カナダ	2,368,134,294	1.99
内 ベルギー	1,936,982,058	1.63
内 オランダ	1,638,024,075	1.38
内 オーストラリア	1,504,111,878	1.26
内 オーストリア	1,364,016,534	1.15
内 シンガポール	1,099,863,016	0.92
内 メキシコ	924,720,818	0.78
内 ポルトガル	726,830,454	0.61
内 ポーランド	660,062,897	0.55
内 フィンランド	612,302,715	0.51
内 アイルランド	582,754,727	0.49
内 イスラエル	419,378,311	0.35
内 ニュージーランド	339,924,785	0.29
内 デンマーク	277,924,907	0.23
内 スウェーデン	204,453,336	0.17
内 ノルウェー	188,701,464	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,877,245,965	3.26
純資産総額	118,990,425,089	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	94,217,545,834	98.77
内 アメリカ	44,494,044,735	46.64
内 中国	10,510,901,626	11.02
内 フランス	6,894,273,601	7.23
内 イタリア	6,523,361,856	6.84
内 ドイツ	5,498,488,943	5.76
内 イギリス	4,834,347,540	5.07
内 スペイン	4,125,929,666	4.33
内 カナダ	1,808,082,121	1.90
内 ベルギー	1,473,021,373	1.54
内 オランダ	1,247,446,986	1.31
内 オーストラリア	1,148,977,428	1.20
内 オーストリア	1,039,935,417	1.09
内 メキシコ	710,282,062	0.74
内 ポルトガル	554,403,490	0.58
内 ポーランド	501,869,480	0.53
内 マレーシア	482,904,782	0.51
内 フィンランド	467,608,943	0.49
内 アイルランド	444,015,246	0.47
内 シンガポール	365,329,433	0.38
内 イスラエル	319,559,781	0.33
内 ニュージーランド	259,240,830	0.27
内 デンマーク	212,475,177	0.22
内 スウェーデン	156,878,583	0.16
内 ノルウェー	144,166,735	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,174,377,301	1.23
純資産総額	95,391,923,135	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	5,258,305,767	93.41
内 トルコ	613,602,990	10.90
内 サウジアラビア	478,804,209	8.51
内 メキシコ	474,943,670	8.44
内 アラブ首長国連邦	411,626,746	7.31
内 コロンビア	365,411,614	6.49
内 ポーランド	358,427,034	6.37
内 チリ	326,874,852	5.81
内 ブラジル	321,590,060	5.71
内 ドミニカ共和国	277,436,250	4.93
内 ハンガリー	255,469,871	4.54
内 ルーマニア	234,641,235	4.17
内 カタール	203,356,839	3.61
内 ベルギー	196,914,103	3.50
内 インドネシア	157,384,669	2.80
内 パナマ	135,612,458	2.41
内 南アフリカ	119,424,001	2.12
内 中国	117,983,297	2.10
内 オマーン	96,584,075	1.72
内 フィリピン	63,578,868	1.13
内 ウルグアイ	48,638,926	0.86
特殊債券	182,139,205	3.24
内 ケイマン諸島	182,139,205	3.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	188,910,639	3.36
純資産総額	5,629,355,611	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	30,329,154,000	98.11
内 日本	30,329,154,000	98.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	584,531,455	1.89
純資産総額	30,913,685,455	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	15,973,998,186	93.88
内 アメリカ	12,751,958,166	74.94
内 オーストラリア	1,172,025,362	6.89
内 イギリス	655,749,193	3.85
内 シンガポール	473,078,771	2.78
内 フランス	275,156,584	1.62
内 カナダ	192,560,449	1.13
内 ベルギー	150,101,503	0.88
内 香港	141,896,972	0.83
内 スペイン	67,451,087	0.40
内 韓国	24,816,745	0.15
内 イスラエル	22,595,360	0.13
内 オランダ	19,896,970	0.12
内 ニュージーランド	14,307,802	0.08
内 アイルランド	6,490,248	0.04
内 ドイツ	5,429,126	0.03
内 イタリア	483,848	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,042,044,656	6.12
純資産総額	17,016,042,842	100.00

## その他資産の投資状況

2024年12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）	1,120,779,620	6.59
内 アメリカ	983,958,690	5.78
内 ドイツ	136,820,930	0.80

（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】

## F Wニッセイ国内株インデックス

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	105,475,253	3.3142 349,571,220	3.3714 355,599,267	- -	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ先進国株インデックス

2024年12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	57,256,485	4.9818  285,244,600	5.0906  291,469,862	-  -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ新興国株インデックス

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	43,928,493	1.5387  67,593,108	1.5593  68,497,699	-  -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。



## F Wニッセイ国内債インデックス

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内債券パッシ ブ マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	39,670,263	0.9109 36,135,952	0.9098 36,092,005	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ為替ヘッジ外国債 券パッシブ マザーファン ド 日本	親投資 信託受 益証券	9,217,643	0.9811 9,043,454	0.9630 8,876,590	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ外国債インデックス

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国債券インデッ クス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	88,591,766	1.7773 157,457,510	1.8149 160,785,196	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ新興国債インデックス

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ新興国債イン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,318,237	1.4115 1,860,767	1.4278 1,882,178	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ国内リートインデックス

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイJ-REITイン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,104,705	1.7465 7,169,155	1.7818 7,313,763	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## F Wニッセイ先進国リートインデックス

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ先進国リートイン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	26,450,247	1.8740 49,570,131	1.8498 48,927,666	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年12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12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	3,455,000	3,379.52 11,676,263,644	3,146.00 10,869,430,000	- -	4.11
2	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	4,198,100	1,506.09 6,322,741,148	1,846.00 7,749,692,600	- -	2.93
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	2,276,000	2,664.10 6,063,492,693	3,369.00 7,667,844,000	- -	2.90
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	1,690,400	2,636.51 4,456,772,308	3,937.00 6,655,104,800	- -	2.51
5	リクルートホールディン グス 日本	株式 サービス 業	521,300	6,343.85 3,307,052,136	11,145.00 5,809,888,500	- -	2.20
6	三井住友フィナンシャル グループ 日本	株式 銀行業	1,335,400	2,734.95 3,652,260,632	3,764.00 5,026,445,600	- -	1.90
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	65,000	68,909.57 4,479,122,626	64,630.00 4,200,950,000	- -	1.59
8	任天堂 日本	株式 その他製 品	410,300	8,254.88 3,386,980,342	9,264.00 3,801,019,200	- -	1.44
9	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	462,300	6,651.68 3,075,071,858	7,832.00 3,620,733,600	- -	1.37
10	東京海上ホールディング ス 日本	株式 保険業	625,000	4,479.62 2,799,766,551	5,728.00 3,580,000,000	- -	1.35

11	みずほフィナンシャルグループ	株式	864,100	2,773.98	3,873.00	-	1.26
	日本	銀行業		2,396,996,448	3,346,659,300	-	
12	三井物産	株式	1,010,400	3,206.14	3,311.00	-	1.26
	日本	卸売業		3,239,486,168	3,345,434,400	-	
13	東京エレクトロン	株式	137,600	34,295.68	24,185.00	-	1.26
	日本	電気機器		4,719,086,094	3,327,856,000	-	
14	三菱商事	株式	1,270,900	3,124.30	2,604.00	-	1.25
	日本	卸売業		3,970,678,090	3,309,423,600	-	
15	信越化学工業	株式	583,800	6,122.43	5,296.00	-	1.17
	日本	化学		3,574,277,029	3,091,804,800	-	
16	日本電信電話	株式	19,389,500	179.12	158.00	-	1.16
	日本	情報・通信業		3,473,055,562	3,063,541,000	-	
17	ソフトバンクグループ	株式	321,500	8,554.91	9,185.00	-	1.12
	日本	情報・通信業		2,750,406,219	2,952,977,500	-	
18	第一三共	株式	615,200	4,973.39	4,352.00	-	1.01
	日本	医薬品		3,059,634,710	2,677,350,400	-	
19	三菱重工業	株式	1,147,900	1,197.81	2,223.00	-	0.96
	日本	機械		1,374,975,250	2,551,781,700	-	
20	HOYA	株式	127,000	18,538.16	19,815.00	-	0.95
	日本	精密機器		2,354,346,641	2,516,505,000	-	
21	武田薬品工業	株式	580,000	4,440.57	4,181.00	-	0.92
	日本	医薬品		2,575,536,200	2,424,980,000	-	
22	KDDI	株式	479,400	4,614.16	5,042.00	-	0.91
	日本	情報・通信業		2,212,028,936	2,417,134,800	-	
23	本田技研工業	株式	1,539,900	1,734.16	1,535.00	-	0.89
	日本	輸送用機器		2,670,440,666	2,363,746,500	-	
24	ファーストリテイリング	株式	38,700	41,647.59	53,820.00	-	0.79
	日本	小売業		1,611,761,833	2,082,834,000	-	
25	ソフトバンク	株式	10,430,700	196.38	198.90	-	0.78
	日本	情報・通信業		2,048,382,535	2,074,666,230	-	
26	セブン&アイ・ホールディングス	株式	759,600	2,126.28	2,487.00	-	0.71
	日本	小売業		1,615,127,082	1,889,125,200	-	
27	アドバンテスト	株式	204,800	6,840.28	9,198.00	-	0.71
	日本	電気機器		1,400,890,808	1,883,750,400	-	
28	三菱電機	株式	667,700	2,319.73	2,687.00	-	0.68
	日本	電気機器		1,548,885,140	1,794,109,900	-	
29	富士通	株式	604,100	2,326.81	2,799.50	-	0.64
	日本	電気機器		1,405,628,835	1,691,177,950	-	
30	キヤノン	株式	324,200	4,235.26	5,161.00	-	0.63
	日本	電気機器		1,373,071,626	1,673,196,200	-	

(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12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	17.21
		銀行業	8.42
		輸送用機器	7.75
		情報・通信業	7.38
		卸売業	6.66
		機械	5.42
		化学	5.04
		サービス業	5.03
		小売業	4.50
		医薬品	4.24
		保険業	3.21
		食料品	3.00
		その他製品	2.60
		精密機器	2.35
		陸運業	2.20
		建設業	2.10
		不動産業	1.77
		電気・ガス業	1.20
		その他金融業	1.17
		証券、商品先物取引業	0.87
		非鉄金属	0.81
		鉄鋼	0.80
		海運業	0.67
		ガラス・土石製品	0.64
		ゴム製品	0.56
		石油・石炭製品	0.53
		金属製品	0.48
	繊維製品	0.40	
空運業	0.33		
鉱業	0.24		
倉庫・運輸関連業	0.14		
パルプ・紙	0.13		
水産・農林業	0.08		
	小計		97.94
合 計（対純資産総額比）			97.94

（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12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	1,696,218	36,144.78 61,309,430,098	40,429.22 68,576,781,206	- -	5.70
2	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,736,637	23,246.40 63,616,965,802	21,672.24 59,309,058,782	- -	4.93

3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	787,790	66,087.18 52,062,824,044	68,101.23 53,649,472,235	- -	4.46
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	1,053,825	32,357.39 34,099,033,435	35,392.77 37,297,791,114	- -	3.10
5	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	243,816	88,756.09 21,640,155,154	94,877.94 23,132,761,233	- -	1.92
6	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部 品	320,764	54,719.83 17,552,152,667	68,279.97 21,901,759,119	- -	1.82
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	653,572	28,167.14 18,409,258,661	30,490.77 19,927,917,974	- -	1.66
8	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	495,006	26,154.18 12,946,476,133	38,240.01 18,929,036,865	- -	1.57
9	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	560,841	28,403.61 15,929,913,145	30,693.24 17,214,031,452	- -	1.43
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	317,407	38,451.97 12,204,926,409	38,148.27 12,108,528,126	- -	1.01
11	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	90,128	115,457.65 10,405,967,978	123,881.83 11,165,221,628	- -	0.93
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	147,834	74,174.90 10,965,573,331	72,210.75 10,675,204,281	- -	0.89
13	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サー ビス	186,365	49,342.12 9,195,644,849	50,405.63 9,393,846,874	- -	0.78
14	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネル ギー	495,639	18,764.89 9,300,612,999	16,843.00 8,348,050,849	- -	0.69
15	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ サービス	103,022	91,317.67 9,407,729,604	80,670.21 8,310,807,219	- -	0.69

16	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 金融サー ビス	92,046	82,169.28 7,563,354,268	84,183.39 7,748,744,868	- -	0.64
17	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	49,428	147,163.30 7,273,987,815	148,641.74 7,347,064,221	- -	0.61
18	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	493,197	13,701.39 6,757,487,784	14,498.77 7,150,754,207	- -	0.59
19	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用 品・パー ソナル用 品	262,157	27,013.72 7,081,838,361	26,816.25 7,030,069,066	- -	0.58
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	110,817	64,378.37 7,134,218,755	62,142.59 6,886,455,927	- -	0.57
21	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	47,879	137,822.46 6,598,801,915	143,556.25 6,873,330,124	- -	0.57
22	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	268,588	24,204.83 6,501,128,869	22,944.00 6,162,485,489	- -	0.51
23	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	106,652	51,160.15 5,456,333,107	53,536.02 5,709,723,711	- -	0.47
24	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	197,069	26,360.46 5,194,830,258	28,157.62 5,548,994,370	- -	0.46
25	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	779,088	7,341.13 5,719,389,249	7,013.70 5,464,290,440	- -	0.45
26	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	359,309	16,033.02 5,760,809,701	14,059.74 5,051,794,353	- -	0.42

27	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	44,579	103,058.15 4,594,229,395	112,953.70 5,035,363,348	- -	0.42
28	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	185,482	29,878.53 5,541,930,148	26,726.09 4,957,209,144	- -	0.41
29	SAP SE ドイツ	株式 ソフト ウェア・ サービス	116,482	36,270.19 4,224,825,086	39,498.33 4,600,845,639	- -	0.38
30	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲 料・タバ コ	456,824	9,902.66 4,523,775,841	9,878.34 4,512,663,248	- -	0.38

（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12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	10.11
		半導体・半導体製造装置	9.26
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.24
		金融サービス	7.14
		メディア・娯楽	6.95
		資本財	6.78
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.59
		銀行	5.58
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.16
		エネルギー	3.74
		ヘルスケア機器・サービス	3.68
		素材	3.10
		保険	2.93
		食品・飲料・タバコ	2.71
		公益事業	2.49
		自動車・自動車部品	2.32
		消費者サービス	1.96
		生活必需品流通・小売り	1.82
		商業・専門サービス	1.50
		家庭用品・パーソナル用品	1.44
		運輸	1.43
		耐久消費財・アパレル	1.16
電気通信サービス	1.10		
不動産管理・開発	0.27		
エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.03		
その他	0.02		
	小計		96.50
投資証券	外国		1.72
	小計		1.72
合計（対純資産総額比）			98.22

（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12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	295,000	5,009.56 1,477,822,571	5,252.92 1,549,613,760	- -	9.78
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア ア・娯楽	77,800	8,269.56 643,371,847	8,506.61 661,814,413	- -	4.17
3	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	91,849	6,562.73 602,780,700	6,439.50 591,462,351	- -	3.73
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	57,359	6,067.92 348,050,340	5,778.11 331,427,185	- -	2.09
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	195,200	1,730.29 337,752,715	1,678.29 327,602,793	- -	2.07
6	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	68,075	3,261.50 222,026,897	3,344.74 227,693,515	- -	1.44
7	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	81,422	2,461.63 200,431,269	2,594.94 211,285,440	- -	1.33
8	MEITUAN-B 香港	株式 消費者 サービス	59,460	3,497.67 207,971,755	3,152.78 187,464,655	- -	1.18
9	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネル ギー	74,094	2,315.62 171,573,951	2,271.15 168,278,810	- -	1.06
10	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	1,162,000	122.55 142,408,311	131.85 153,219,693	- -	0.97
11	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	62,942	2,329.60 146,629,900	2,432.04 153,077,650	- -	0.97
12	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフト ウェア・ サービス	40,031	3,401.70 136,173,499	3,565.15 142,716,719	- -	0.90

13	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	149,200	981.84  146,491,203	898.78  134,098,095	-  -	0.85
14	PDD HOLDINGS INC(ADR)  アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	8,341	18,485.89  154,190,849	15,414.64  128,573,520	-  -	0.81
15	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	180,400	576.75  104,046,421	695.97  125,554,250	-  -	0.79
16	SK HYNIX INC  韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	6,610	18,391.02  121,564,677	18,776.20  124,110,682	-  -	0.78
17	MEDIATEK INC  台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	18,000	6,192.67  111,468,096	6,891.45  124,046,208	-  -	0.78
18	ISHARES MSCI QATAR CP ETF  アメリカ	投資信 託受益 証券 -	43,167	2,900.55  125,208,195	2,806.11  121,131,488	-  -	0.76
19	ISHARES MSCI KUWAIT ETF  アメリカ	投資信 託受益 証券 -	21,079	5,202.37  109,660,815	5,102.09  107,547,078	-  -	0.68
20	BHARTI AIRTEL LTD  インド	株式 電気通信 サービス	30,801	2,842.25  87,544,385	2,975.72  91,655,182	-  -	0.58
21	IND & COMM BK OF CHINA - H  中国	株式 銀行	839,000	96.48  80,951,040	105.16  88,229,911	-  -	0.56
22	TATA CONSULTANCY SVCS LTD  インド	株式 ソフト ウェア・ サービス	11,098	7,545.30  83,737,823	7,746.62  85,971,999	-  -	0.54
23	TRIP.COM GROUP LTD  香港	株式 消費者 サービス	7,450	10,303.31  76,759,710	11,392.42  84,873,529	-  -	0.54

24	JD.COM INC - CL A 香港	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	29,457	2,796.13 82,365,778	2,769.64 81,585,344	- -	0.51
25	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	79,000	940.53 74,302,423	944.61 74,624,427	- -	0.47
26	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	2,013	34,795.69 70,043,727	35,972.93 72,413,522	- -	0.46
27	BANK OF CHINA LTD - H 中国	株式 銀行	871,000	76.01 66,211,155	80.29 69,938,861	- -	0.44
28	BYD CO LTD 香港	株式 自動車・ 自動車部 品	12,500	5,474.06 68,425,850	5,575.96 69,699,600	- -	0.44
29	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	702,300	97.59 68,543,418	96.04 67,448,892	- -	0.43
30	NETEASE INC 香港	株式 メディ ア・娯楽	22,800	2,753.33 62,776,106	2,891.92 65,935,821	- -	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	銀行	13.52
		半導体・半導体製造装置	12.72
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.17
		メディア・娯楽	6.06
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.66
		素材	4.64
		資本財	4.10
		エネルギー	3.52
		自動車・自動車部品	3.39
		消費者サービス	2.78
		保険	2.76
		金融サービス	2.68
		食品・飲料・タバコ	2.54
		ソフトウェア・サービス	2.38
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.24
		公益事業	2.20
		電気通信サービス	1.95
		運輸	1.59
		耐久消費財・アパレル	1.11
		生活必需品流通・小売り	1.03
不動産管理・開発	0.96		
ヘルスケア機器・サービス	0.68		
家庭用品・パーソナル用品	0.56		
商業・専門サービス	0.04		
	小計		85.28
投資信託受益証券	外国		6.51
	小計		6.51
投資証券	外国		0.04
	小計		0.04
合計（対純資産総額比）			91.84

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

## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	第343回 利付国債（10年） 日本	国債証券	541,000,000	99.74 539,601,600	99.37 537,607,930	0.1 2026/6/20	0.83
2	第342回 利付国債（10年） 日本	国債証券	527,000,000	99.78 525,840,600	99.55 524,639,040	0.1 2026/3/20	0.81
3	第148回 利付国債（5年） 日本	国債証券	505,000,000	99.53 502,660,120	99.23 501,141,800	0.005 2026/6/20	0.78
4	第344回 利付国債（10年） 日本	国債証券	500,000,000	99.61 498,088,180	99.21 496,075,000	0.1 2026/9/20	0.77

5	第345回 利付国債(10年) 日本	国債証券	496,000,000	99.55 493,768,000	99.09 491,496,320	0.1 2026/12/20	0.76
6	第371回 利付国債(10年) 日本	国債証券	509,000,000	95.71 487,210,650	95.54 486,334,230	0.4 2033/6/20	0.76
7	第147回 利付国債(5年) 日本	国債証券	482,000,000	99.57 479,927,400	99.43 479,295,980	0.005 2026/3/20	0.74
8	第348回 利付国債(10年) 日本	国債証券	473,000,000	99.35 469,941,340	98.69 466,827,350	0.1 2027/9/20	0.72
9	第372回 利付国債(10年) 日本	国債証券	473,000,000	100.42 475,018,120	98.55 466,169,880	0.8 2033/9/20	0.72
10	第153回 利付国債(5年) 日本	国債証券	469,000,000	99.14 464,993,160	98.60 462,476,210	0.005 2027/6/20	0.72
11	第370回 利付国債(10年) 日本	国債証券	478,000,000	98.25 469,639,440	96.61 461,810,140	0.5 2033/3/20	0.72
12	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	465,000,000	99.56 462,990,120	98.97 460,247,700	0.1 2027/3/20	0.71
13	第369回 利付国債(10年) 日本	国債証券	475,000,000	98.53 468,055,020	96.85 460,042,250	0.5 2032/12/20	0.71
14	第373回 利付国債(10年) 日本	国債証券	474,000,000	97.88 463,951,200	96.59 457,850,820	0.6 2033/12/20	0.71
15	第374回 利付国債(10年) 日本	国債証券	457,000,000	98.23 448,912,330	98.02 447,974,250	0.8 2034/3/20	0.70
16	第347回 利付国債(10年) 日本	国債証券	440,000,000	99.36 437,208,450	98.83 434,891,600	0.1 2027/6/20	0.68
17	第149回 利付国債(5年) 日本	国債証券	415,000,000	99.48 412,842,000	99.05 411,074,100	0.005 2026/9/20	0.64
18	第366回 利付国債(10年) 日本	国債証券	426,000,000	97.01 413,262,600	95.46 406,659,600	0.2 2032/3/20	0.63
19	第154回 利付国債(5年) 日本	国債証券	411,000,000	99.13 407,442,010	98.69 405,636,450	0.1 2027/9/20	0.63
20	第150回 利付国債(5年) 日本	国債証券	403,000,000	99.44 400,753,600	98.90 398,599,240	0.005 2026/12/20	0.62
21	第5回 電通グループ 日本	社債券	400,000,000	99.37 397,514,000	98.70 394,817,200	0.32 2027/7/8	0.61

22	第368回 利付国債（10年） 日本	国債証券	413,000,000	96.48 398,466,530	94.85 391,747,020	0.2 2032/9/20	0.61
23	第365回 利付国債（10年） 日本	国債証券	398,000,000	96.50 384,070,000	95.07 378,398,500	0.1 2031/12/20	0.59
24	第364回 利付国債（10年） 日本	国債証券	392,000,000	96.78 379,385,440	95.36 373,822,960	0.1 2031/9/20	0.58
25	第350回 利付国債（10年） 日本	国債証券	380,000,000	99.18 376,884,000	98.36 373,798,400	0.1 2028/3/20	0.58
26	第375回 利付国債（10年） 日本	国債証券	369,000,000	101.29 373,775,730	100.38 370,424,340	1.1 2034/6/20	0.58
27	第362回 利付国債（10年） 日本	国債証券	384,000,000	97.41 374,085,120	95.89 368,229,120	0.1 2031/3/20	0.57
28	第363回 利付国債（10年） 日本	国債証券	384,000,000	97.12 372,956,160	95.61 367,169,280	0.1 2031/6/20	0.57
29	第376回 利付国債（10年） 日本	国債証券	369,000,000	98.54 363,619,980	98.33 362,845,080	0.9 2034/9/20	0.56
30	第361回 利付国債（10年） 日本	国債証券	373,000,000	97.63 364,174,820	96.15 358,669,340	0.1 2030/12/20	0.56

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率（%）
公社債券	国内	国債証券	81.08
		特殊債券	7.03
		社債券	6.26
		地方債証券	4.83
	小計		99.21
合計（対純資産総額比）			99.21

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	5,870,059,800	95.84 5,625,989,010	97.06 5,698,067,047	1.625 2026/2/15	4.79
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	3,500,523,400	94.66 3,313,740,248	96.43 3,375,659,730	1.625 2026/5/15	2.84
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	2,486,589,600	93.72 2,330,484,540	95.57 2,376,632,607	1.5 2026/8/15	2.00
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	2,285,701,000	94.58 2,161,935,036	95.82 2,190,341,554	2 2026/11/15	1.84
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	2,125,939,200	94.61 2,011,393,861	94.82 2,015,985,624	2.25 2027/8/15	1.69
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	2,029,449,400	94.76 1,923,252,925	95.79 1,944,050,169	2.25 2027/2/15	1.63
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	2,023,122,200	95.12 1,924,442,973	95.58 1,933,740,661	2.375 2027/5/15	1.63
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,853,869,600	93.66 1,736,378,929	93.21 1,728,066,008	2.625 2029/2/15	1.45
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,858,615,000	91.96 1,709,276,975	91.88 1,707,806,978	2.375 2029/5/15	1.44
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,787,434,000	95.84 1,713,130,368	95.40 1,705,319,282	3.125 2028/11/15	1.43
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,763,707,000	95.00 1,675,643,483	95.23 1,679,648,724	2.75 2028/2/15	1.41
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,730,489,200	95.11 1,645,938,859	95.26 1,648,550,536	2.875 2028/5/15	1.39
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,847,542,400	89.65 1,656,471,619	88.44 1,634,132,777	1.625 2029/8/15	1.37
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,728,907,400	89.36 1,545,101,493	88.39 1,528,319,563	1.75 2029/11/15	1.28
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,607,108,800	95.00 1,526,753,360	94.84 1,524,294,483	2.875 2028/8/15	1.28
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,380,911,400	98.23 1,356,524,504	94.84 1,309,753,035	3.875 2033/8/15	1.10
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,387,238,600	93.48 1,296,901,622	94.30 1,308,276,978	2.25 2027/11/15	1.10
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,347,693,600	96.95 1,306,713,279	88.85 1,197,493,148	4.125 2053/8/15	1.01
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,271,767,200	83.82 1,066,117,714	84.04 1,068,920,331	1.625 2031/5/15	0.90
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,195,840,800	82.58 987,608,938	82.23 983,387,723	1.125 2031/2/15	0.83
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,146,805,000	82.04 940,861,758	81.32 932,673,570	1.25 2031/8/15	0.78
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	960,152,600	98.13 942,239,336	95.43 916,302,430	4 2034/2/15	0.77
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,115,169,000	83.40 930,089,307	81.42 908,070,965	1.375 2031/11/15	0.76

24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	949,080,000	99.13 940,848,975	94.25 894,507,900	3.875 2034/8/15	0.75
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,243,294,800	78.86 980,581,991	71.54 889,577,429	3 2052/8/15	0.75
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,080,369,400	80.80 873,002,202	80.93 874,418,581	0.625 2030/8/15	0.73
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,012,352,000	81.53 825,380,709	81.52 825,340,215	0.875 2030/11/15	0.69
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	969,643,400	85.19 826,113,857	83.81 812,755,097	1.875 2032/2/15	0.68
29	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券	818,003,200	96.95 793,061,261	98.53 806,003,093	2 2028/2/1	0.68
30	WI TREASURY SEC. アメリカ	国債証券	982,297,800	81.49 800,568,308	81.75 803,057,920	0.625 2030/5/15	0.67

（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12月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	外国	国債証券	103.26
	小計		103.26
合計（対純資産総額比）			103.26

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	3,642,885,400	96.79 3,525,960,800	97.06 3,536,148,857	1.625 2026/2/15	3.71
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,383,772,600	95.37 2,273,427,766	95.57 2,278,362,175	1.5 2026/8/15	2.39
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,975,668,200	96.17 1,900,124,991	96.43 1,905,196,115	1.625 2026/5/15	2.00
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,714,671,200	95.78 1,642,391,159	95.82 1,643,135,117	2 2026/11/15	1.72
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,455,256,000	95.79 1,394,111,119	95.79 1,394,018,827	2.25 2027/2/15	1.46
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,482,146,600	93.71 1,389,038,150	93.21 1,381,568,131	2.625 2029/2/15	1.45
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,442,601,600	92.40 1,332,986,074	91.88 1,325,548,906	2.375 2029/5/15	1.39
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,357,184,400	95.62 1,297,807,582	95.58 1,297,223,993	2.375 2027/5/15	1.36
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,379,329,600	88.92 1,226,568,846	88.44 1,220,003,237	1.625 2029/8/15	1.28
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,235,385,800	94.93 1,172,757,197	94.82 1,171,491,646	2.25 2027/8/15	1.23
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,157,877,600	94.47 1,093,869,832	94.30 1,091,971,207	2.25 2027/11/15	1.14



12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,123,078,000	95.24 1,069,686,871	94.84 1,065,205,790	2.875 2028/8/15	1.12
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,048,733,400	89.31 936,686,119	88.39 927,059,350	1.75 2029/11/15	0.97
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	950,661,800	95.56 908,547,482	95.26 905,647,963	2.875 2028/5/15	0.95
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	938,007,400	95.50 895,797,067	95.23 893,301,967	2.75 2028/2/15	0.94
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	858,917,400	95.88 823,615,894	95.40 819,458,734	3.125 2028/11/15	0.86
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	934,843,800	82.20 768,469,648	81.32 760,289,765	1.25 2031/8/15	0.80
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	903,207,800	84.92 767,085,985	84.04 759,146,155	1.625 2031/5/15	0.80
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	877,899,000	83.00 728,656,170	82.23 721,931,463	1.125 2031/2/15	0.76
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	844,681,200	82.24 694,682,712	81.52 688,643,241	0.875 2030/11/15	0.72
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	808,299,800	81.50 658,820,917	80.93 654,213,609	0.625 2030/8/15	0.69
22	WI TREASURY SEC. アメリカ	国債証 券	699,155,600	82.24 575,027,514	81.75 571,580,677	0.625 2030/5/15	0.60
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	615,320,200	87.06 535,710,072	86.52 532,393,496	1.5 2030/2/15	0.56
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	438,158,600	99.94 437,897,829	98.13 430,008,850	4.375 2034/5/15	0.45
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	525,157,600	82.51 433,324,699	81.42 427,630,582	1.375 2031/11/15	0.45
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	441,322,200	97.06 428,349,272	95.43 421,167,015	4 2034/2/15	0.44
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	419,177,000	100.88 422,893,681	99.21 415,882,268	4.5 2033/11/15	0.44
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	439,740,400	96.05 422,408,183	94.25 414,455,327	3.875 2034/8/15	0.43
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	408,104,400	97.25 396,910,096	97.49 397,869,141	2.25 2026/3/31	0.42
30	CHINA GOVERNMENT BOND 中国	国債証 券	381,254,720	101.31 386,287,282	101.60 387,377,670	2.3 2026/5/15	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12月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	外国	国債証券	98.77
	小計		98.77
合計（対純資産総額比）			98.77

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	STATE OF QATAR カタール	国債証 券	94,908,000	86.43 82,029,933	84.70 80,396,566	4.4 2050/4/16	1.43
2	REPUBLIC OF POLAND ポーランド	国債証 券	79,090,000	94.91 75,066,849	92.19 72,917,816	5.5 2054/3/18	1.30
3	REPUBLIC OF TURKIYE トルコ	国債証 券	63,272,000	111.95 70,837,116	110.50 69,921,254	9.875 2028/1/15	1.24
4	REPUBLIC OF POLAND ポーランド	国債証 券	68,017,400	98.14 66,756,357	96.76 65,820,437	5.125 2034/9/18	1.17
5	OMAN GOV INTERNTL BOND オマーン	国債証 券	63,272,000	103.68 65,601,675	102.92 65,122,073	6.25 2031/1/25	1.16
6	HUNGARY ハンガリー	国債証 券	63,272,000	102.50 64,853,800	101.60 64,284,984	6.125 2028/5/22	1.14
7	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証 券	63,272,000	102.64 64,945,544	101.10 63,971,788	8.75 2053/11/14	1.14
8	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証 券	63,272,000	101.79 64,408,365	100.58 63,644,039	8 2035/11/14	1.13
9	DOMINICAN REPUBLIC ドミニカ共和国	国債証 券	71,181,000	89.84 63,953,281	89.24 63,529,042	4.875 2032/9/23	1.13
10	STATE OF QATAR カタール	国債証 券	63,272,000	100.27 63,445,365	99.32 62,846,179	4.75 2034/5/29	1.12
11	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証 券	63,272,000	99.80 63,147,354	99.30 62,832,259	4.75 2028/1/18	1.12
12	HAZINE MUSTESARLIGI VARL トルコ	国債証 券	63,272,000	100.00 63,272,000	99.21 62,773,416	6.5 2030/4/26	1.12
13	REPUBLIC OF COLOMBIA コロンビア	国債証 券	63,272,000	99.44 62,918,309	98.59 62,383,661	7.5 2034/2/2	1.11
14	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 南アフリカ	国債証 券	63,272,000	100.97 63,892,065	97.74 61,846,481	7.1 2036/11/19	1.10
15	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証 券	63,272,000	99.05 62,676,294	97.62 61,766,759	6.35 2035/2/9	1.10
16	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証 券	63,272,000	100.69 63,713,005	97.49 61,687,669	6.25 2031/3/18	1.10
17	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証 券	63,272,000	98.49 62,322,287	97.05 61,410,537	5 2034/1/16	1.09
18	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証 券	63,272,000	98.19 62,127,409	96.88 61,301,709	4.875 2033/7/18	1.09
19	CHINA GOVT INTL BOND 中国	国債証 券	63,272,000	96.51 61,065,705	96.79 61,245,397	0.55 2025/10/21	1.09
20	DOMINICAN REPUBLIC ドミニカ共和国	国債証 券	71,181,000	86.09 61,280,434	84.58 60,208,448	5.875 2060/1/30	1.07
21	STATE OF QATAR カタール	国債証 券	63,272,000	95.70 60,551,304	95.00 60,114,094	3.75 2030/4/16	1.07
22	UNITED MEXICAN STATES メキシコ	国債証 券	63,272,000	96.31 60,938,528	93.90 59,412,408	6 2036/5/7	1.06
23	REPUBLIC OF TURKIYE トルコ	国債証 券	63,272,000	96.61 61,132,773	93.71 59,295,354	6.5 2035/1/3	1.05

24	HUNGARY ハンガリー	国債証券	63,272,000	95.50 60,424,760	93.61 59,233,348	5.5 2036/3/26	1.05
25	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	63,272,000	97.92 61,959,106	93.43 59,117,560	6 2033/10/20	1.05
26	SAUDI INTERNATIONAL BOND サウジアラビア	国債証券	63,272,000	96.36 60,972,062	93.16 58,944,827	5.75 2054/1/16	1.05
27	FED REPUBLIC OF BRAZIL ブラジル	国債証券	63,272,000	97.63 61,773,719	92.82 58,730,335	7.125 2054/5/13	1.04
28	REPUBLIC OF POLAND ポーランド	国債証券	63,272,000	94.76 59,960,976	92.30 58,406,383	5.5 2053/4/4	1.04
29	ABU DHABI GOVT INT'L アラブ首長国連邦	国債証券	63,272,000	92.30 58,402,586	91.78 58,074,205	3.125 2030/4/16	1.03
30	REPUBLIC OF PERU ペルー	国債証券	68,017,400	85.89 58,425,586	85.26 57,992,995	2.783 2031/1/23	1.03

(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12月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	外国	国債証券	93.41
		特殊債券	3.24
	小計	96.64	
合計 (対純資産総額比)			96.64

(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。

#### ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	18,454	129,632.14 2,392,231,514	122,400.00 2,258,769,600	- -	7.31
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	16,250	113,155.90 1,838,783,432	107,900.00 1,753,375,000	- -	5.67
3	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	16,405	91,754.86 1,505,238,507	90,200.00 1,479,731,000	- -	4.79
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	10,127	142,062.07 1,438,662,663	137,700.00 1,394,487,900	- -	4.51
5	KDX不動産投資法人 日本	投資証券	8,851	147,124.14 1,302,195,835	149,500.00 1,323,224,500	- -	4.28
6	GLP投資法人 日本	投資証券	10,627	129,522.62 1,376,436,923	123,400.00 1,311,371,800	- -	4.24
7	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	5,511	247,301.71 1,362,879,769	222,900.00 1,228,401,900	- -	3.97
8	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	17,431	63,923.64 1,114,253,015	66,200.00 1,153,932,200	- -	3.73
9	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,745	232,190.80 1,101,745,377	231,800.00 1,099,891,000	- -	3.56

10	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,304	160,406.72 1,011,204,006	164,100.00 1,034,486,400	- -	3.35
11	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,077	139,014.09 983,802,772	140,800.00 996,441,600	- -	3.22
12	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,109	302,330.01 939,944,018	292,400.00 909,071,600	- -	2.94
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	11,623	68,520.25 796,410,941	70,600.00 820,583,800	- -	2.65
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	9,507	73,213.49 696,040,665	77,300.00 734,891,100	- -	2.38
15	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	6,896	100,194.84 690,943,655	101,500.00 699,944,000	- -	2.26
16	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,164	334,808.18 724,524,913	315,500.00 682,742,000	- -	2.21
17	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	5,793	114,982.33 666,092,680	114,900.00 665,615,700	- -	2.15
18	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,092	590,804.93 645,158,986	587,000.00 641,004,000	- -	2.07
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	4,050	144,450.11 585,022,977	142,100.00 575,505,000	- -	1.86
20	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,126	273,388.73 581,224,455	263,200.00 559,563,200	- -	1.81
21	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,538	327,437.35 503,598,654	328,500.00 505,233,000	- -	1.63
22	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,881	126,197.69 489,773,252	126,700.00 491,722,700	- -	1.59
23	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,720	127,429.42 474,037,454	123,900.00 460,908,000	- -	1.49
24	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	5,870	80,664.82 473,502,549	77,700.00 456,099,000	- -	1.48
25	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,602	293,108.36 469,559,593	277,900.00 445,195,800	- -	1.44
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	4,673	91,859.75 429,260,631	89,100.00 416,364,300	- -	1.35
27	NTT都市開発リート投資法人 日本	投資証券	3,216	109,908.26 353,464,988	119,600.00 384,633,600	- -	1.24
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,796	132,327.76 369,988,422	137,300.00 383,890,800	- -	1.24

29	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	1,092	353,825.49	346,500.00	-	1.22
				386,377,444	378,378,000	-	
30	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	6,098	61,490.80	61,600.00	-	1.22
				374,970,924	375,636,800	-	

（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12月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
投資証券	国内		98.11
	小計		98.11
合計(対純資産総額比)			98.11

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	65,210	18,216.28 1,187,883,931	16,646.86 1,085,541,949	- -	6.38
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	6,794	146,266.42 993,734,115	149,109.95 1,013,053,060	- -	5.95
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	41,682	21,841.64 910,403,283	19,772.50 824,157,345	- -	4.84
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	21,957	29,654.73 651,128,940	28,178.18 618,708,412	- -	3.64
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	21,568	28,674.62 618,454,307	27,208.54 586,833,829	- -	3.45
6	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	11,094	52,977.90 587,736,871	47,153.45 523,120,463	- -	3.07
7	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	61,665	9,047.48 557,912,984	8,329.75 513,654,576	- -	3.02
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	134,610	3,686.50 496,240,632	3,633.66 489,127,645	- -	2.87
9	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	14,925	26,209.96 391,183,768	23,424.87 349,616,277	- -	2.05
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	9,990	36,312.14 362,758,374	34,986.25 349,512,661	- -	2.05
11	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	20,670	18,463.57 381,642,099	16,564.60 342,390,480	- -	2.01
12	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	74,149	5,097.33 377,962,557	4,577.72 339,434,042	- -	1.99
13	VENTAS INC アメリカ	投資証券	29,386	10,163.08 298,652,550	9,315.22 273,737,060	- -	1.61
14	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	24,016	11,796.88 283,314,011	11,322.52 271,921,745	- -	1.60
15	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	4,559	47,773.83 217,800,936	44,991.13 205,114,595	- -	1.21

16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	40,031	5,383.50 215,506,899	5,077.57 203,260,524	- -	1.19
17	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	8,301	25,037.12 207,833,167	24,320.17 201,881,772	- -	1.19
18	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証券	47,896	3,964.37 189,877,916	3,696.66 177,055,543	- -	1.04
19	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	10,923	16,563.01 180,917,830	15,557.00 169,929,143	- -	1.00
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	8,363	20,029.22 167,504,435	19,560.53 163,584,785	- -	0.96
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	49,063	3,389.46 166,297,337	3,176.25 155,836,569	- -	0.92
22	UDR INC アメリカ	投資証券	21,297	7,045.91 150,056,860	6,866.59 146,237,848	- -	0.86
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIE アメリカ	投資証券	19,239	7,952.96 153,007,186	7,568.91 145,618,317	- -	0.86
24	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	13,396	11,209.56 150,163,360	10,534.78 141,124,020	- -	0.83
25	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証券	48,880	2,745.96 134,222,526	2,843.28 138,979,795	- -	0.82
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	7,498	19,207.12 144,015,007	18,227.08 136,666,656	- -	0.80
27	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	11,488	11,748.47 134,966,504	11,697.41 134,379,857	- -	0.79
28	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	15,567	8,935.75 139,102,837	8,622.39 134,224,773	- -	0.79
29	SEGRO PLC イギリス	投資証券	95,639	1,521.12 145,478,941	1,379.20 131,906,131	- -	0.78
30	AMERICAN HOMES 4 RENT- A アメリカ	投資証券	22,364	5,947.95 133,020,115	5,868.47 131,242,641	- -	0.77

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

2024年12月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
投資証券	外国		93.88
	小計		93.88
合計（対純資産総額比）			93.88

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

F Wニッセイ国内株インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ先進国株インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ新興国株インデックス  
該当事項はありません。

F Wニッセイ国内債インデックス  
該当事項はありません。

F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）  
該当事項はありません。

F Wニッセイ外国債インデックス  
該当事項はありません。

F Wニッセイ新興国債インデックス  
該当事項はありません。

F Wニッセイ国内リートインデックス  
該当事項はありません。

F Wニッセイ先進国リートインデックス  
該当事項はありません。

（参考）  
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

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

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

F Wニッセイ国内株インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ先進国株インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ新興国株インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ国内債インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

F Wニッセイ外国債インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ新興国債インデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ国内リートインデックス

該当事項はありません。

F Wニッセイ先進国リートインデックス

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2024年12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 703月	買建	183	5,018,143,650	5,099,295,000	1.93

（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12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 202503	買建	355	17,278,388,150	16,921,977,765	1.41
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 202503	買建	267	2,189,220,479	2,163,372,733	0.18
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE 202503	買建	132	2,175,898,795	2,142,370,692	0.18

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

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

## ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2024年12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	N Y S E L I F F E U S	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202503	買建	147	1,289,015,384	1,263,771,201	7.97

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

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

## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

該当事項はありません。

## ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド

該当事項はありません。

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

## ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

## ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

## ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2024年12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	シカゴオプション取引所	DOW JONES U.S. REAL ESTATE INDEX FUTURES 202503	買建	174	1,021,078,758	983,958,690	5.78
	EUREX取引所	THE STOXX 600 REAL ESTATE INDEX FUTURE 202503	買建	132	137,261,101	136,820,930	0.80

(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】

## FWニッセイ国内株インデックス

直近日（2024年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2022年12月12日)	52,583,023	52,583,023	1.0277	1.0277
第2計算期間末 (2023年12月11日)	156,316,990	156,316,990	1.2661	1.2661
第3計算期間末 (2024年12月10日)	343,043,555	343,043,555	1.5020	1.5020
2023年12月末日	155,254,267	-	1.2719	-
2024年1月末日	208,035,660	-	1.3708	-
2月末日	216,746,488	-	1.4380	-
3月末日	242,033,316	-	1.5014	-
4月末日	250,320,602	-	1.4877	-
5月末日	260,782,435	-	1.5042	-
6月末日	274,795,295	-	1.5256	-
7月末日	297,160,359	-	1.5168	-
8月末日	309,453,477	-	1.4729	-
9月末日	310,933,496	-	1.4498	-
10月末日	323,089,648	-	1.4768	-
11月末日	329,090,076	-	1.4689	-
12月末日	355,590,828	-	1.5276	-

## F Wニッセイ先進国株インデックス

直近日（2024年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2022年12月12日）	62,822,639	62,822,639	1.0404	1.0404
第2計算期間末 （2023年12月11日）	208,179,029	208,179,029	1.2882	1.2882
第3計算期間末 （2024年12月10日）	274,724,535	274,724,535	1.7212	1.7212
2023年12月末日	209,230,087	-	1.3101	-
2024年1月末日	161,205,562	-	1.3897	-
2月末日	164,855,952	-	1.4565	-
3月末日	173,681,101	-	1.5167	-
4月末日	186,803,797	-	1.5365	-
5月末日	195,513,149	-	1.5723	-
6月末日	201,442,516	-	1.6675	-
7月末日	215,698,277	-	1.5745	-
8月末日	221,918,347	-	1.5471	-
9月末日	234,274,209	-	1.5648	-
10月末日	258,691,706	-	1.6828	-
11月末日	260,247,928	-	1.6923	-
12月末日	291,462,176	-	1.7595	-

## F Wニッセイ新興国株インデックス

直近日（2024年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2022年12月12日）	7,064,013	7,064,013	0.9851	0.9851
第2計算期間末 （2023年12月11日）	13,075,008	13,075,008	1.0657	1.0657
第3計算期間末 （2024年12月10日）	65,155,022	65,155,022	1.2954	1.2954
2023年12月末日	13,408,070	-	1.0936	-
2024年1月末日	34,448,816	-	1.0920	-
2月末日	36,653,601	-	1.1573	-
3月末日	39,950,485	-	1.1905	-
4月末日	45,073,172	-	1.2480	-
5月末日	46,582,958	-	1.2578	-
6月末日	48,448,928	-	1.3245	-
7月末日	52,580,299	-	1.2475	-
8月末日	53,738,615	-	1.2138	-
9月末日	60,673,220	-	1.2861	-
10月末日	63,002,893	-	1.3274	-
11月末日	60,632,669	-	1.2472	-
12月末日	68,495,833	-	1.3128	-

## F Wニッセイ国内債インデックス

直近日（2024年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2022年12月12日)	27,363,939	27,363,939	0.9601	0.9601
第2計算期間末 (2023年12月11日)	39,749,321	39,749,321	0.9374	0.9374
第3計算期間末 (2024年12月10日)	35,281,701	35,281,701	0.9208	0.9208
2023年12月末日	39,465,271	-	0.9485	-
2024年1月末日	43,290,561	-	0.9415	-
2月末日	44,013,001	-	0.9445	-
3月末日	46,472,410	-	0.9433	-
4月末日	46,585,999	-	0.9324	-
5月末日	46,245,119	-	0.9175	-
6月末日	35,405,449	-	0.9198	-
7月末日	35,573,296	-	0.9187	-
8月末日	35,618,482	-	0.9294	-
9月末日	34,726,000	-	0.9318	-
10月末日	36,972,050	-	0.9272	-
11月末日	35,310,415	-	0.9207	-
12月末日	36,091,417	-	0.9196	-

## F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

直近日（2024年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2022年12月12日)	9,243,339	9,243,339	0.8478	0.8478
第2計算期間末 (2023年12月11日)	31,485,565	31,485,565	0.8055	0.8055
第3計算期間末 (2024年12月10日)	8,921,409	8,921,409	0.8027	0.8027
2023年12月末日	31,293,798	-	0.8231	-
2024年1月末日	7,858,122	-	0.8084	-
2月末日	7,599,995	-	0.7994	-
3月末日	8,205,847	-	0.8046	-
4月末日	8,157,755	-	0.7887	-
5月末日	8,184,247	-	0.7863	-
6月末日	8,582,346	-	0.7938	-
7月末日	8,864,161	-	0.8001	-
8月末日	8,852,273	-	0.8070	-
9月末日	8,585,096	-	0.8126	-
10月末日	9,018,032	-	0.7948	-
11月末日	8,892,973	-	0.8000	-
12月末日	8,876,416	-	0.7876	-

## F Wニッセイ外国債インデックス

直近日（2024年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2022年12月12日)	21,934,050	21,934,050	1.0030	1.0030
第2計算期間末 (2023年12月11日)	61,064,272	61,064,272	1.0712	1.0712
第3計算期間末 (2024年12月10日)	155,420,192	155,420,192	1.1609	1.1609
2023年12月末日	60,421,927	-	1.0853	-
2024年1月末日	114,476,144	-	1.1041	-
2月末日	111,029,763	-	1.1182	-
3月末日	123,274,754	-	1.1325	-
4月末日	131,108,514	-	1.1532	-
5月末日	132,609,072	-	1.1589	-
6月末日	136,857,705	-	1.1989	-
7月末日	139,095,941	-	1.1552	-
8月末日	142,133,263	-	1.1253	-
9月末日	145,576,598	-	1.1277	-
10月末日	156,113,283	-	1.1744	-
11月末日	154,950,622	-	1.1499	-
12月末日	160,781,401	-	1.1855	-

## F Wニッセイ新興国債インデックス

直近日（2024年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2022年12月12日)	12,573,266	12,573,266	0.9479	0.9479
第2計算期間末 (2023年12月11日)	49,107,539	49,107,539	1.0284	1.0284
第3計算期間末 (2024年12月10日)	1,848,170	1,848,170	1.1317	1.1317
2023年12月末日	48,400,173	-	1.0394	-
2024年1月末日	1,820,366	-	1.0531	-
2月末日	1,674,721	-	1.0695	-
3月末日	1,838,202	-	1.0922	-
4月末日	1,859,623	-	1.0994	-
5月末日	1,883,896	-	1.1139	-
6月末日	1,834,520	-	1.1646	-
7月末日	1,771,059	-	1.1153	-
8月末日	1,739,331	-	1.0935	-
9月末日	1,744,039	-	1.0915	-
10月末日	1,858,147	-	1.1367	-
11月末日	1,822,598	-	1.1165	-
12月末日	1,882,133	-	1.1446	-

## F Wニッセイ国内リートインデックス

直近日（2024年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2022年12月12日）	2,746,990	2,746,990	0.9911	0.9911
第2計算期間末 （2023年12月11日）	9,755,640	9,755,640	0.9696	0.9696
第3計算期間末 （2024年12月10日）	6,973,184	6,973,184	0.9072	0.9072
2023年12月末日	9,526,284	-	0.9667	-
2024年1月末日	6,295,319	-	0.9655	-
2月末日	6,028,832	-	0.9192	-
3月末日	6,574,310	-	0.9717	-
4月末日	6,678,837	-	0.9813	-
5月末日	6,459,418	-	0.9477	-
6月末日	6,768,308	-	0.9422	-
7月末日	7,107,627	-	0.9448	-
8月末日	7,230,827	-	0.9709	-
9月末日	6,815,548	-	0.9551	-
10月末日	7,213,693	-	0.9339	-
11月末日	7,130,072	-	0.9255	-
12月末日	7,313,592	-	0.9255	-

## F Wニッセイ先進国リートインデックス

直近日（2024年12月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2022年12月12日）	4,875,541	4,875,541	0.9855	0.9855
第2計算期間末 （2023年12月11日）	16,318,793	16,318,793	1.0683	1.0683
第3計算期間末 （2024年12月10日）	48,301,877	48,301,877	1.3146	1.3146
2023年12月末日	16,730,361	-	1.1297	-
2024年1月末日	30,211,382	-	1.1191	-
2月末日	30,462,086	-	1.1385	-
3月末日	34,545,781	-	1.1821	-
4月末日	36,019,905	-	1.1602	-
5月末日	37,486,948	-	1.1788	-
6月末日	39,286,027	-	1.2351	-
7月末日	43,859,823	-	1.2538	-
8月末日	45,275,156	-	1.2477	-
9月末日	44,049,615	-	1.2796	-
10月末日	47,953,372	-	1.3485	-
11月末日	48,548,029	-	1.3456	-
12月末日	48,926,373	-	1.2969	-

## 【分配の推移】

## F Wニッセイ国内株インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## F Wニッセイ先進国株インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## F Wニッセイ新興国株インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## F Wニッセイ国内債インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## F Wニッセイ外国債インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## F Wニッセイ新興国債インデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## F Wニッセイ国内リートインデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## F Wニッセイ先進国リートインデックス

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## F Wニッセイ国内株インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	2.8
第2計算期間	23.2
第3計算期間	18.6

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

## F Wニッセイ先進国株インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	4.0
第2計算期間	23.8
第3計算期間	33.6

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

## F Wニッセイ新興国株インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	1.5
第2計算期間	8.2
第3計算期間	21.6

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

## F Wニッセイ国内債インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	4.0
第2計算期間	2.4
第3計算期間	1.8

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



## F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

	収益率（％）
第1計算期間	15.2
第2計算期間	5.0
第3計算期間	0.3

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

## F Wニッセイ外国債インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	0.3
第2計算期間	6.8
第3計算期間	8.4

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

## F Wニッセイ新興国債インデックス

	収益率（％）
第1計算期間	5.2
第2計算期間	8.5
第3計算期間	10.0

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

## F Wニッセイ国内リートインデックス

	収益率（％）
第1計算期間	0.9
第2計算期間	2.2
第3計算期間	6.4

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

## F Wニッセイ先進国リートインデックス

	収益率（％）
第1計算期間	1.5
第2計算期間	8.4
第3計算期間	23.1

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

## （４）【設定及び解約の実績】

## F Wニッセイ国内株インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	51,780,776	616,588	51,164,188
第2計算期間	106,543,174	34,239,629	123,467,733
第3計算期間	167,145,839	62,221,917	228,391,655

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## F Wニッセイ先進国株インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	61,354,529	973,328	60,381,201
第2計算期間	142,889,264	41,662,099	161,608,366
第3計算期間	96,316,903	98,311,168	159,614,101

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## F Wニッセイ新興国株インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	7,343,377	172,577	7,170,800
第2計算期間	9,203,729	4,105,474	12,269,055
第3計算期間	50,399,465	12,370,957	50,297,563

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## F Wニッセイ国内債インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	29,556,858	1,054,389	28,502,469
第2計算期間	40,682,519	26,783,101	42,401,887
第3計算期間	27,478,506	31,562,814	38,317,579

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	11,592,565	689,960	10,902,605
第2計算期間	42,017,468	13,830,598	39,089,475
第3計算期間	6,232,505	34,207,444	11,114,536

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## F Wニッセイ外国債インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	22,471,963	602,774	21,869,189
第2計算期間	49,101,514	13,963,459	57,007,244
第3計算期間	120,449,511	43,582,434	133,874,321

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## F Wニッセイ新興国債インデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	13,564,095	299,277	13,264,818
第2計算期間	45,163,345	10,676,853	47,751,310
第3計算期間	2,685,190	48,803,416	1,633,084

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## F Wニッセイ国内リートインデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	2,840,503	68,822	2,771,681
第2計算期間	9,220,199	1,930,015	10,061,865
第3計算期間	3,612,115	5,987,874	7,686,106

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## F Wニッセイ先進国リートインデックス

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	5,033,936	86,474	4,947,462
第2計算期間	13,970,820	3,642,742	15,275,540
第3計算期間	33,756,513	12,290,054	36,741,999

(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。

&lt; 参考情報 &gt;

# 3.運用実績

2024年12月末現在

## FWニッセイ国内株インデックス

### ●基準価額・純資産の推移



基準価額	15,276円
純資産総額	355百万円

### ●分配の推移 1万円当たり(税引前)

2022年12月	0円
2023年12月	0円
2024年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

### ●組入上位業種(マザーファンド)

順位	業種	比率
1	電気機器	17.6%
2	銀行業	8.6%
3	輸送用機器	7.9%
4	情報・通信業	7.5%
5	卸売業	6.8%
6	機械	5.5%
7	化学	5.1%
8	サービス業	5.1%
9	小売業	4.6%
10	医薬品	4.3%

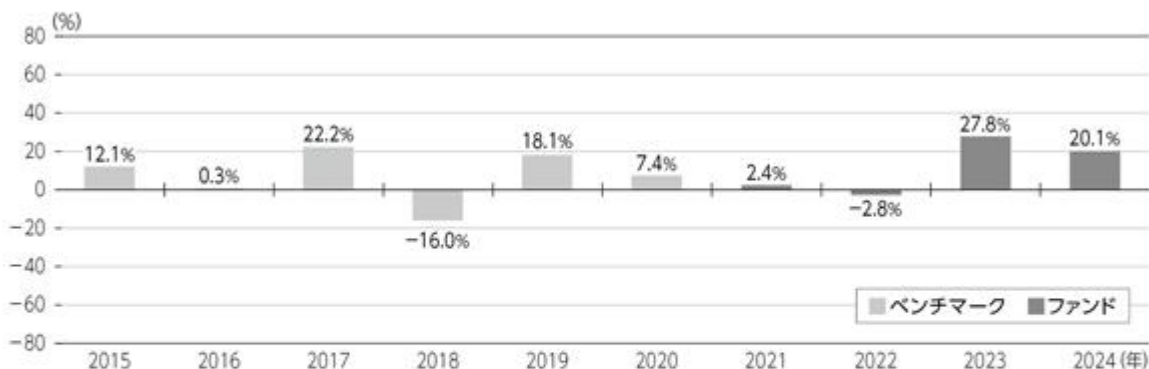
・比率は対組入株式評価額比です。

### ●組入上位銘柄(マザーファンド)

順位	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	4.2%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3.0%
3	ソニーグループ	3.0%
4	日立製作所	2.6%
5	リクルートホールディングス	2.2%
6	三井住友フィナンシャルグループ	1.9%
7	キーエンス	1.6%
8	任天堂	1.5%
9	伊藤忠商事	1.4%
10	東京海上ホールディングス	1.4%

・比率は対組入株式評価額比です。

### ●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021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。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 3.運用実績

2024年12月末現在

## FWニッセイ先進国株インデックス

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	17,595円
純資産総額	291百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

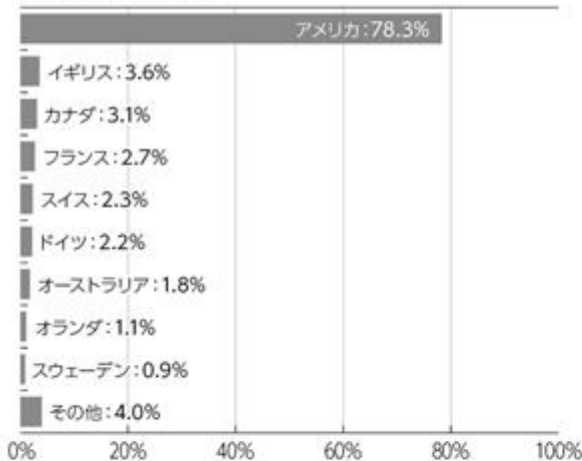
2022年12月	0円
2023年12月	0円
2024年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

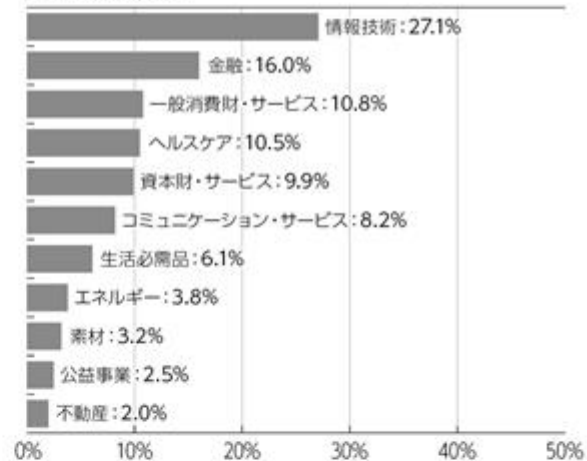
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●主要な資産の状況(マザーファンド)

## 国・地域別組入比率



## 業種別組入比率



・上記グラフはすべて対組入株式等評価額比です。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

2024年12月末現在

## 3.運用実績

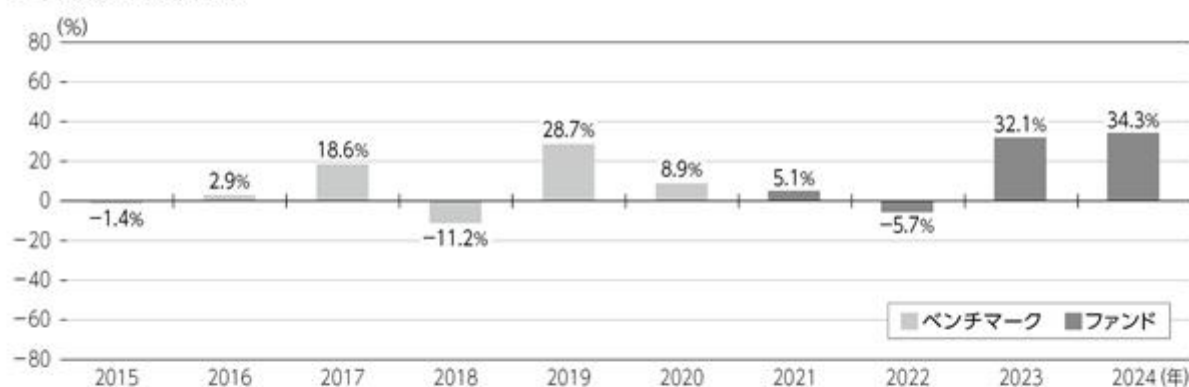
## ●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	5.8%
2	エヌビディア	情報技術	5.0%
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	3.2%
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	2.0%
6	テスラ	一般消費財・サービス	1.9%
7	アルファベット(A)	コミュニケーション・サービス	1.7%
8	ブロードコム	情報技術	1.6%
9	アルファベット(C)	コミュニケーション・サービス	1.5%
10	JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	金融	1.0%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 3.運用実績

2024年12月末現在

## FWニッセイ新興国株インデックス

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	13,128円
純資産総額	68百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

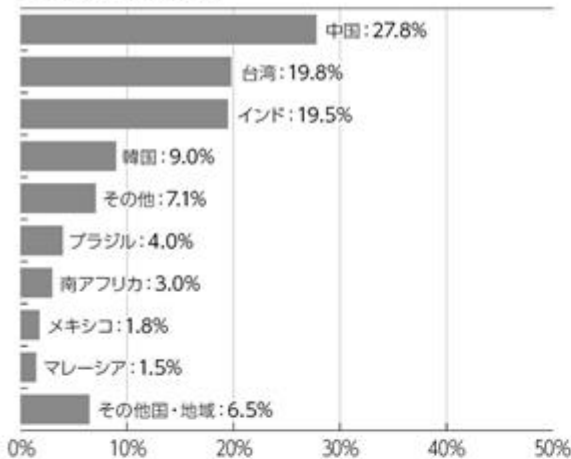
2022年12月	0円
2023年12月	0円
2024年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

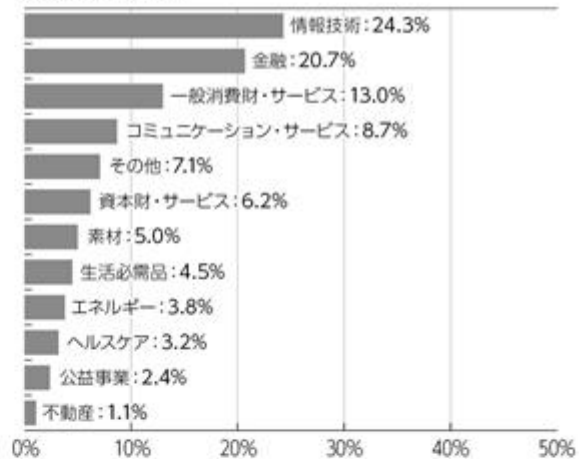
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●主要な資産の状況(マザーファンド)

## 国・地域別組入比率



## 業種別組入比率



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

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。



2024年12月末現在

## 3.運用実績

## ●組入上位銘柄(マザーファンド)

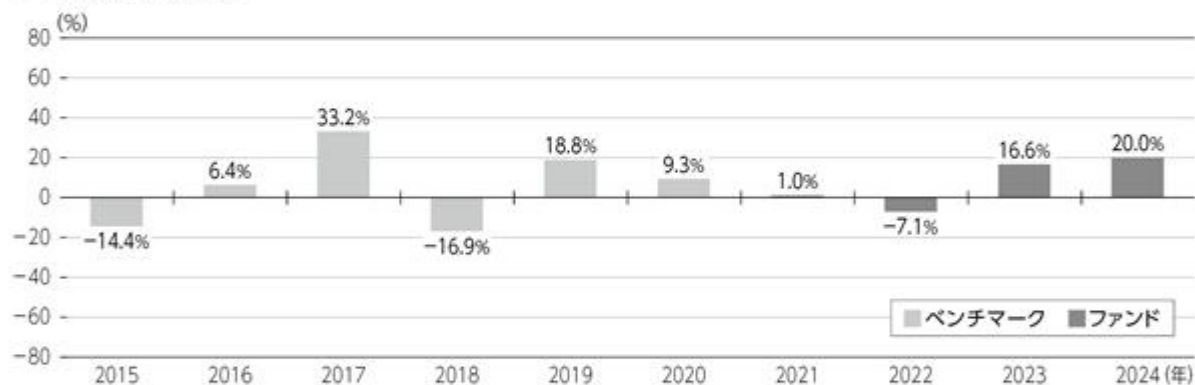
	銘柄	業種	比率
1	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	10.6%
2	騰訊控股[テンセント・ホールディングス]	コミュニケーション・サービス	4.5%
3	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	4.1%
4	サムスン電子	情報技術	2.3%
5	アリババ・グループ・ホールディング	一般消費財・サービス	2.3%
6	HDFC銀行	金融	1.6%
7	iシェアーズMSCI UAEキャップETF	その他	1.5%
8	Meituan	一般消費財・サービス	1.3%
9	リライアンス・インダストリーズ	エネルギー	1.2%
10	チャイナ・コンストラクション・バンク(中国建設銀行)	金融	1.1%

・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。

## ●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。



## 3.運用実績

2024年12月末現在

## FWニッセイ国内債インデックス

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	9,196円
純資産総額	36百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023年12月	0円
2024年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

## ●資産別投資比率(マザーファンド)

債券	99.2%
債券先物	-
現金、その他	0.8%

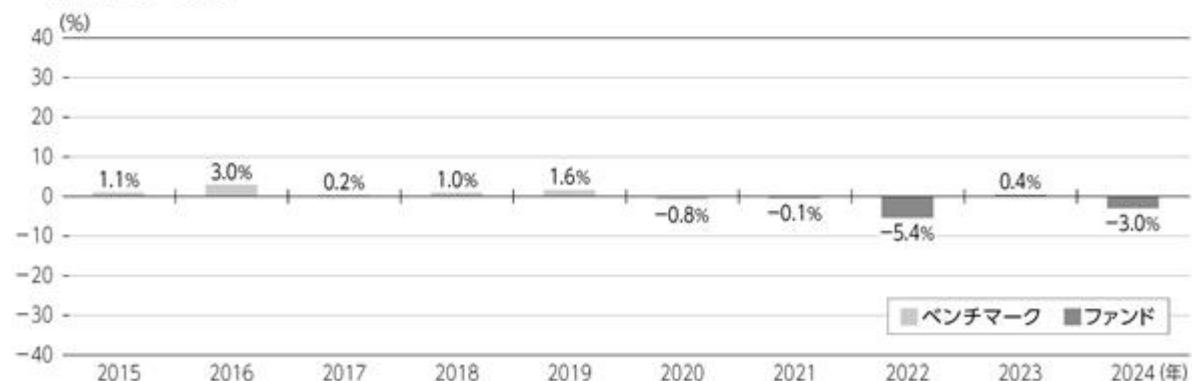
・比率は対純資産総額比です。

## ●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	種別	償還日	クーポン	比率
1	第343回 利付国債(10年)	国債	2026/06/20	0.100%	0.8%
2	第342回 利付国債(10年)	国債	2026/03/20	0.100%	0.8%
3	第148回 利付国債(5年)	国債	2026/06/20	0.005%	0.8%
4	第344回 利付国債(10年)	国債	2026/09/20	0.100%	0.8%
5	第345回 利付国債(10年)	国債	2026/12/20	0.100%	0.8%
6	第371回 利付国債(10年)	国債	2033/06/20	0.400%	0.8%
7	第147回 利付国債(5年)	国債	2026/03/20	0.005%	0.8%
8	第348回 利付国債(10年)	国債	2027/09/20	0.100%	0.7%
9	第372回 利付国債(10年)	国債	2033/09/20	0.800%	0.7%
10	第153回 利付国債(5年)	国債	2027/06/20	0.005%	0.7%

・比率は対組入債券評価額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

2024年12月末現在

## 3.運用実績

## FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	7,876円
純資産総額	887万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

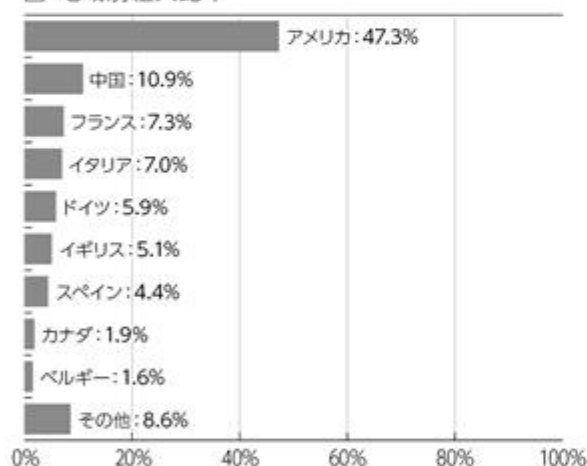
2022年12月	0円
2023年12月	0円
2024年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

## ●主要な資産の状況(マザーファンド)

## 国・地域別組入比率



・比率は対組入債券評価額比です。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

## 3.運用実績

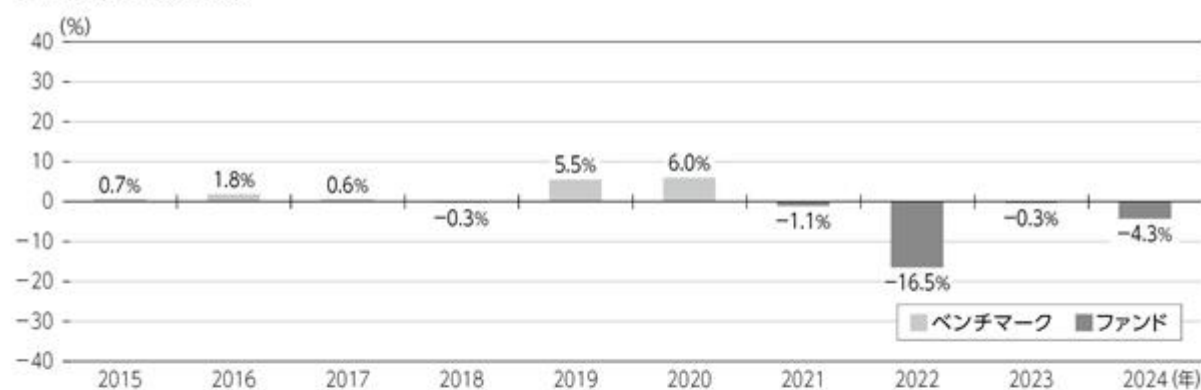
2024年12月末現在

## ●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	アメリカドル	2026/02/15	1.625%	4.6%
2	アメリカ国債	アメリカドル	2026/05/15	1.625%	2.7%
3	アメリカ国債	アメリカドル	2026/08/15	1.500%	1.9%
4	アメリカ国債	アメリカドル	2026/11/15	2.000%	1.8%
5	アメリカ国債	アメリカドル	2027/08/15	2.250%	1.6%
6	アメリカ国債	アメリカドル	2027/02/15	2.250%	1.6%
7	アメリカ国債	アメリカドル	2027/05/15	2.375%	1.6%
8	アメリカ国債	アメリカドル	2029/02/15	2.625%	1.4%
9	アメリカ国債	アメリカドル	2029/05/15	2.375%	1.4%
10	アメリカ国債	アメリカドル	2028/11/15	3.125%	1.4%

・比率は対組入債券評価額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

2024年12月末現在

## 3.運用実績

## FWニッセイ外国債インデックス

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	11,855円
純資産総額	160百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

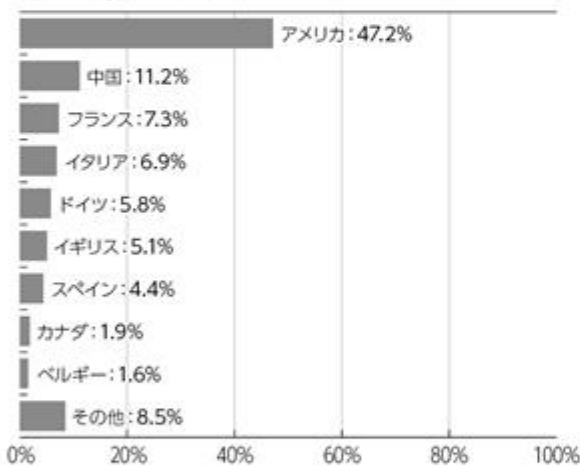
2022年12月	0円
2023年12月	0円
2024年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

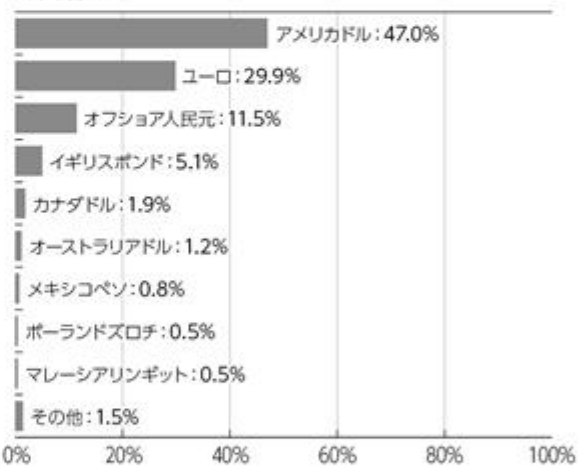
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●主要な資産の状況(マザーファンド)

## 国・地域別組入比率



## 通貨別比率



・国・地域別組入比率は対組入債券評価額比、通貨別比率は対純資産総額比です。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

## 3.運用実績

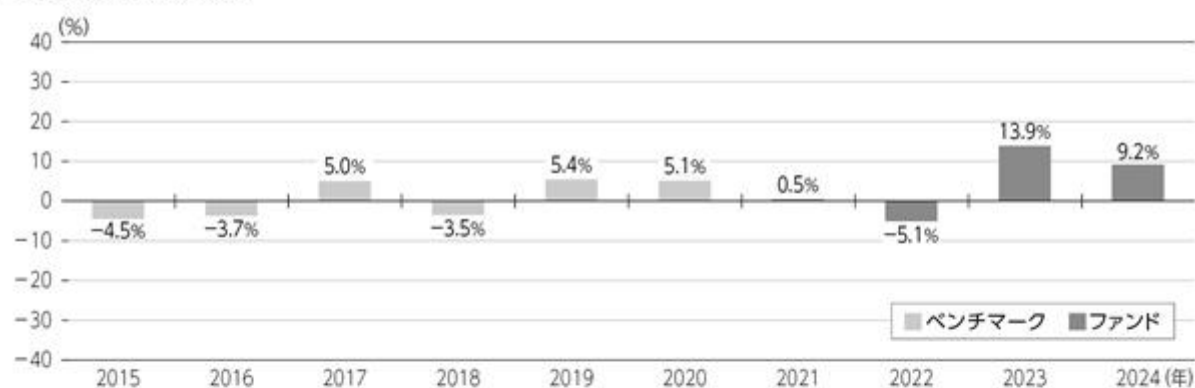
2024年12月末現在

## ●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	アメリカドル	2026/02/15	1.625%	3.8%
2	アメリカ国債	アメリカドル	2026/08/15	1.500%	2.4%
3	アメリカ国債	アメリカドル	2026/05/15	1.625%	2.0%
4	アメリカ国債	アメリカドル	2026/11/15	2.000%	1.7%
5	アメリカ国債	アメリカドル	2027/02/15	2.250%	1.5%
6	アメリカ国債	アメリカドル	2029/02/15	2.625%	1.5%
7	アメリカ国債	アメリカドル	2029/05/15	2.375%	1.4%
8	アメリカ国債	アメリカドル	2027/05/15	2.375%	1.4%
9	アメリカ国債	アメリカドル	2029/08/15	1.625%	1.3%
10	アメリカ国債	アメリカドル	2027/08/15	2.250%	1.2%

・比率は対組入債券評価額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

2024年12月末現在

## 3.運用実績

## FWニッセイ新興国債インデックス

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	11,446円
純資産総額	188万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

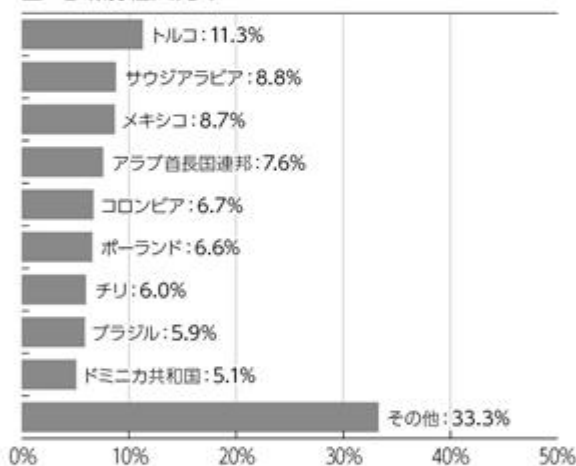
2022年12月	0円
2023年12月	0円
2024年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

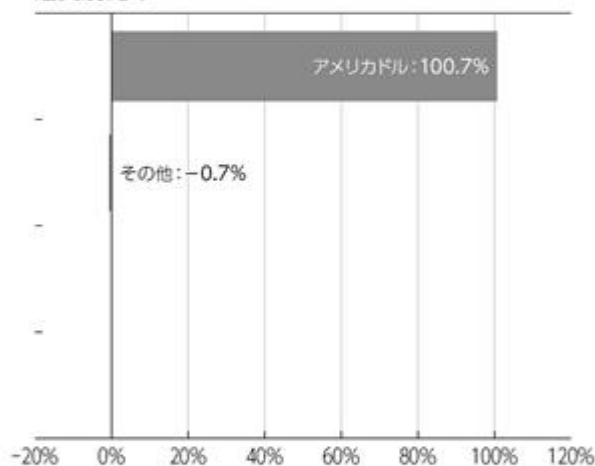
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●主要な資産の状況(マザーファンド)

## 国・地域別組入比率



## 通貨別比率



・国・地域別組入比率は対組入債券評価額比、通貨別比率は対純資産総額比です。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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



## 3.運用実績

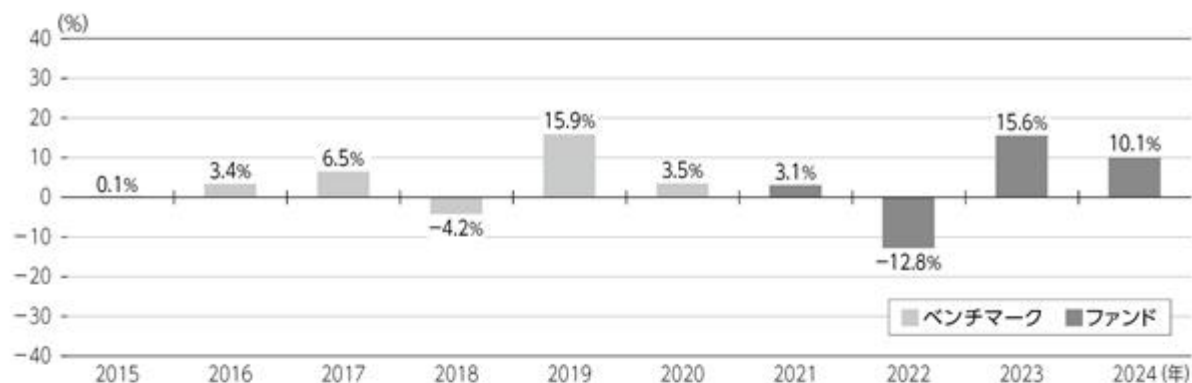
2024年12月末現在

## ●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	カタール国債	アメリカドル	2050/04/16	4.400%	1.5%
2	ポーランド国債	アメリカドル	2054/03/18	5.500%	1.3%
3	トルコ国債	アメリカドル	2028/01/15	9.875%	1.3%
4	ポーランド国債	アメリカドル	2034/09/18	5.125%	1.2%
5	オマーン国債	アメリカドル	2031/01/25	6.250%	1.2%
6	ハンガリー国債	アメリカドル	2028/05/22	6.125%	1.2%
7	コロンビア国債	アメリカドル	2053/11/14	8.750%	1.2%
8	コロンビア国債	アメリカドル	2035/11/14	8.000%	1.2%
9	ドミニカ共和国国債	アメリカドル	2032/09/23	4.875%	1.2%
10	カタール国債	アメリカドル	2034/05/29	4.750%	1.2%

・比率は対組入債券評価額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

2024年12月末現在

## 3.運用実績

## FWニッセイ国内リートインデックス

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	9,255円
純資産総額	731万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023年12月	0円
2024年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

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

## ●資産別投資比率(マザーファンド)

不動産投資信託証券	98.1%
短期金融資産等	1.9%

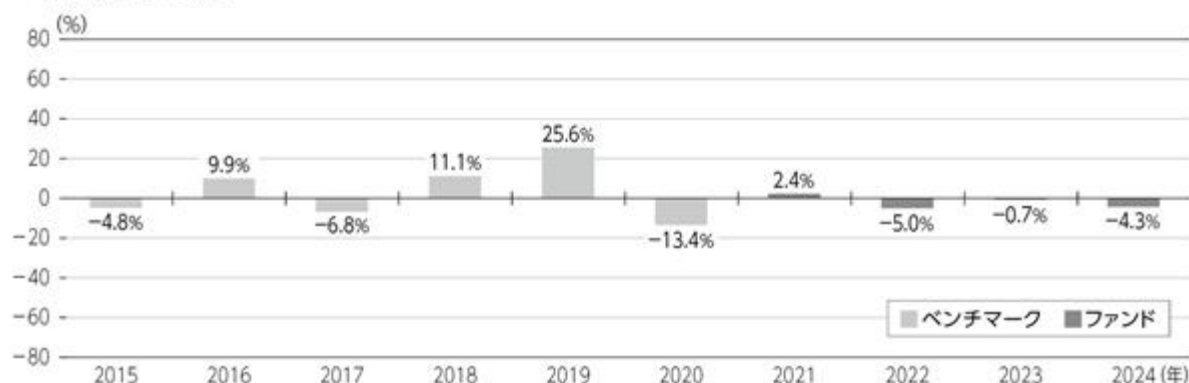
・比率は対純資産総額比です。

## ●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.4%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.8%
3	日本都市ファンド投資法人	4.9%
4	野村不動産マスターファンド投資法人	4.6%
5	KDX不動産投資法人	4.4%
6	GLP投資法人	4.3%
7	日本プロロジスリート投資法人	4.1%
8	インヴェンシブル投資法人	3.8%
9	大和ハウスリート投資法人	3.6%
10	オリックス不動産投資法人	3.4%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021年はファンド設定時から年末まで、2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。



## 3.運用実績

2024年12月末現在

## FWニッセイ先進国リートインデックス

## ●基準価額・純資産の推移



基準価額	12,969円
純資産総額	48百万円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2022年12月	0円
2023年12月	0円
2024年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

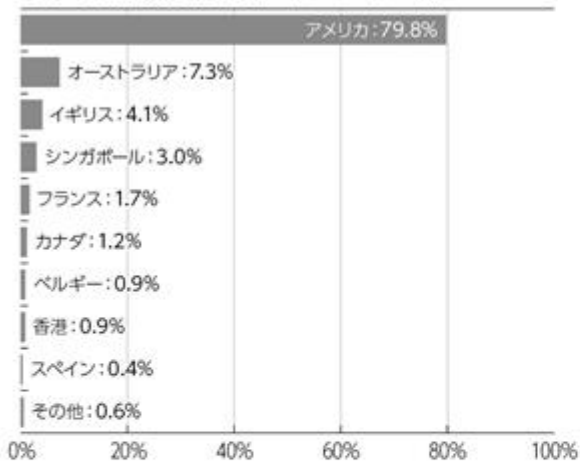
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●資産別投資比率(マザーファンド)

不動産投資信託証券等	100.5%
現金、その他	-0.5%

・比率は対純資産総額比です。

## ●国・地域別投資比率(マザーファンド)



・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

2024年12月末現在

## 3.運用実績

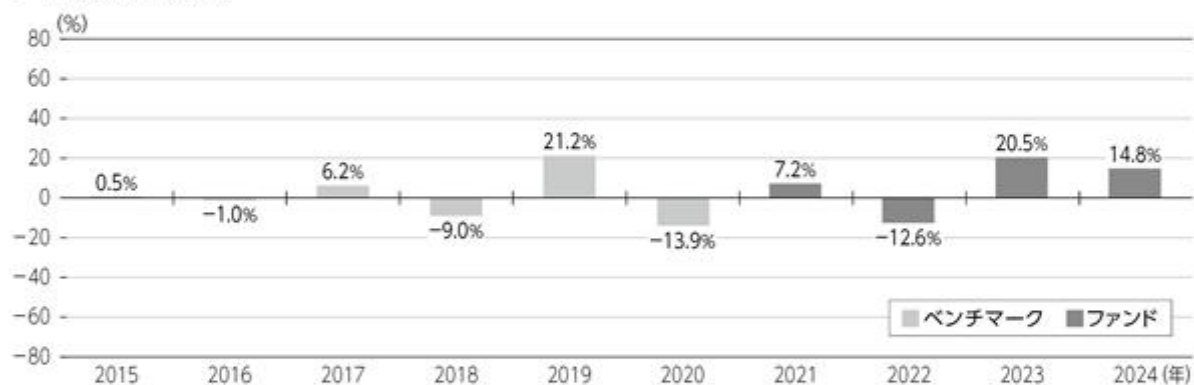
## ●組入上位銘柄(マザーファンド)

	銘柄	国・地域	比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	6.8%
2	EQUINIX INC	アメリカ	6.3%
3	WELLTOWER INC	アメリカ	5.2%
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.9%
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.7%
6	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.3%
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.2%
8	GOODMAN GROUP	オーストラリア	3.1%
9	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	2.2%
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.2%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2021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。

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

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

最新の運用実績については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

「国内株インデックス／国内リートインデックス」

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付を行います。

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、その他やむを得ない事情があるときは、申込みの受付を中止することおよび既に受付けた申込みの受付を取消すことがあります。

「国内債インデックス」

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付を行います。

原則として午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。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、その他やむを得ない事情があるときは、申込みの受付を中止することおよび既に受付けた申込みの受付を取消すことがあります。

「先進国株インデックス」

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

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

「新興国株インデックス」

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付を行います（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、申込みの受付を中止することおよび既に受付けた申込みの受付を取消すことがあります。

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

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

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

### 「外国債インデックス」

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

原則として午後3時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、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、申込みの受付けを中止することおよび既に受付けた申込みの受付けを取消すことがあります。

### 「新興国債インデックス」

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

原則として午後3時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。

### 「先進国リートインデックス」

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

原則として午後3時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、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときには、申込みの受付けを中止することおよび既に受付けた申込みの受付けを取消すことがあります。

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

### 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）

「国内株インデックス／国内債インデックス／国内リートインデックス」

取得申込受付日の基準価額とします。

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

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

## 「外国債インデックス（ヘッジあり）」

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

## 販売価額

申込価額と同額とします。

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

## 申込手数料

ありません。

## 信託財産留保額

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

## その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

## 2【換金（解約）手続等】

### 換金受付

「国内株インデックス／国内リートインデックス」

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

原則として午後3時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、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することおよび既に受付けた換金の受付けを取消すことがあります。

「国内債インデックス」

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

原則として午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。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、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することおよび既に受付けた換金の受付けを取消すことがあります。

「先進国株インデックス」

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

原則として午後3時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、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することおよび既に受付けた換金の受付けを取消すことがあります。

「新興国株インデックス」

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

原則として午後3時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。

「外国債インデックス（ヘッジあり）」

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

原則として午後3時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、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することおよび既に受付けた換金の受付けを取消すことがあります。

「外国債インデックス」

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

原則として午後3時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、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することおよび既に受付けた換金の受付けを取消すことがあります。

#### 「新興国債インデックス」

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

原則として午後3時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。

#### 「先進国リートインデックス」

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

原則として午後3時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、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときには、換金の受付けを中止することおよび既に受付けた換金の受付けを取消すことがあります。

#### 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

#### 換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

#### 換金価額

##### 「国内株インデックス/国内債インデックス/国内リートインデックス」

###### <解約請求の場合>

解約価額：解約請求受付日の基準価額とします。

###### <買取請求の場合>

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

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

換金手数料はありません。

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

###### <解約請求の場合>

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

###### <買取請求の場合>

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

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

換金手数料はありません。

## 「外国債インデックス(ヘッジあり)」

## &lt; 解約請求の場合 &gt;

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

## &lt; 買取請求の場合 &gt;

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

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

換金手数料はありません。

## 信託財産留保額

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

## 支払開始日

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

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

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

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

「新興国株インデックス」

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

## その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>



### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限です。

#### (4)【計算期間】

毎年12月11日から翌年12月10日までとします。

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

## (5) 【その他】

## 繰上償還

1. 委託会社は、信託期間中において、下記の理由により、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、ファンドを終了させることができます。この場合、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
  - ・ 受益権の口数が30億口または純資産総額が30億円を下回っている場合
  - ・ この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき
  - ・ やむを得ない事情が発生したとき
2. 委託会社は、前記1.により解約するときには、書面による決議（以下「書面決議」といいます）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までにこの信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
3. 前記2.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 前記2.から4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記2.から4.までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。
6. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「 約款の変更等 2. 」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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発送します。

3. 前記2.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該3.において同じ)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。
4. 前記2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前記2.から5.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前記1.から6.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、前記1.から7.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求の不適用

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

#### 公告

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

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

#### 運用報告書の作成

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

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

#### 信託事務処理の再信託

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

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

### 第3【ファンドの経理状況】

#### FWニッセイ国内株インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2023年12月12日から2024年12月10日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### FWニッセイ先進国株インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2023年12月12日から2024年12月10日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### FWニッセイ新興国株インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2023年12月12日から2024年12月10日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### FWニッセイ国内債インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2023年12月12日から2024年12月10日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2023年12月12日から2024年12月10日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## F Wニッセイ外国債インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2023年12月12日から2024年12月10日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## F Wニッセイ新興国債インデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2023年12月12日から2024年12月10日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## F Wニッセイ国内リートインデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2023年12月12日から2024年12月10日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## F Wニッセイ先進国リートインデックス

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2023年12月12日から2024年12月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1 【財務諸表】

## 【FWニッセイ国内株インデックス】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,729	4,577
コール・ローン	188,510	417,082
親投資信託受益証券	156,320,749	343,046,239
未収入金	28,682	2,554,266
流動資産合計	156,539,670	346,022,164
資産合計	156,539,670	346,022,164
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	24,889	2,540,812
未払受託者報酬	14,624	32,984
未払委託者報酬	175,916	396,272
その他未払費用	7,251	8,541
流動負債合計	222,680	2,978,609
負債合計	222,680	2,978,609
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	123,467,733	228,391,655
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	32,849,257	114,651,900
（分配準備積立金）	19,845,413	40,560,553
元本等合計	156,316,990	343,043,555
純資産合計	156,316,990	343,043,555
負債純資産合計	156,539,670	346,022,164



## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	第3期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
営業収益		
受取利息	-	127
有価証券売買等損益	24,003,082	35,357,410
営業収益合計	24,003,082	35,357,537
営業費用		
受託者報酬	24,333	56,556
委託者報酬	293,081	679,593
その他費用	12,033	20,255
営業費用合計	329,447	756,404
営業利益又は営業損失（ ）	23,673,635	34,601,133
経常利益又は経常損失（ ）	23,673,635	34,601,133
当期純利益又は当期純損失（ ）	23,673,635	34,601,133
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	4,455,364	7,346,026
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,418,835	32,849,257
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,892,481	73,999,584
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	13,892,481	73,999,584
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,680,330	19,452,048
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,680,330	19,452,048
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（ ）	32,849,257	114,651,900

## ( 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3期	
	自 2023年12月12日	至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2023年12月12日から2024年12月10日までとなっております。	

( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 期首元本額	51,164,188円	123,467,733円
期中追加設定元本額	106,543,174円	167,145,839円
期中一部解約元本額	34,239,629円	62,221,917円
2. 受益権の総数	123,467,733口	228,391,655口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10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(19,218,271円)、収益調整金(13,003,844円)及び分配準備積立金(627,142円)より分配対象収益は32,849,257円(1万口当たり2,660.55円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(125円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(27,254,982円)、収益調整金(74,091,347円)及び分配準備積立金(13,305,446円)より分配対象収益は114,651,900円(1万口当たり5,019.97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2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	19,493,429	27,902,072
合計	19,493,429	27,902,072

## (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2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1口当たり純資産額	1.2661円	1.5020円
(1万口当たり純資産額)	(12,661円)	(15,020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12月10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	103,501,762	343,046,239	
親投資信託受益証券	合計	103,501,762	343,046,239	
合計			343,046,239	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【FWニッセイ先進国株インデックス】  
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	2,518	3,902
コール・ローン	274,627	355,595
親投資信託受益証券	208,184,564	274,726,927
未収入金	5,613	615,487
流動資産合計	208,467,322	275,701,911
資産合計	208,467,322	275,701,911
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	603,747
未払受託者報酬	19,190	25,294
未払委託者報酬	259,574	341,920
その他未払費用	9,529	6,415
流動負債合計	288,293	977,376
負債合計	288,293	977,376
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	161,608,366	159,614,101
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	46,570,663	115,110,434
（分配準備積立金）	27,199,603	58,308,289
元本等合計	208,179,029	274,724,535
純資産合計	208,179,029	274,724,535
負債純資産合計	208,467,322	275,701,911

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	第3期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
営業収益		
受取利息	-	87
有価証券売買等損益	33,437,562	58,010,064
営業収益合計	33,437,562	58,010,151
営業費用		
受託者報酬	31,642	45,285
委託者報酬	428,270	612,314
その他費用	15,682	16,345
営業費用合計	475,594	673,944
営業利益又は営業損失（ ）	32,961,968	57,336,207
経常利益又は経常損失（ ）	32,961,968	57,336,207
当期純利益又は当期純損失（ ）	32,961,968	57,336,207
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（ ）	5,268,834	11,837,341
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,441,438	46,570,663
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,781,869	53,450,632
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	18,781,869	53,450,632
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,345,778	30,409,727
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,345,778	30,409,727
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（ ）	46,570,663	115,110,434

## （ 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3期	
	自 2023年12月12日	至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2023年12月12日から2024年12月10日までとなっております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 期首元本額	60,381,201円	161,608,366円
期中追加設定元本額	142,889,264円	96,316,903円
期中一部解約元本額	41,662,099円	98,311,168円
2. 受益権の総数	161,608,366口	159,614,101口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10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（27,199,603円）、収益調整金（19,371,060円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は46,570,663円（1万口当たり2,881.70円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（86円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（45,498,780円）、収益調整金（56,802,145円）及び分配準備積立金（12,809,423円）より分配対象収益は115,110,434円（1万口当たり7,211.80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2期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	第3期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	28,093,153	46,048,893
合計	28,093,153	46,048,893

## (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2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1口当たり純資産額	1,2882円	1,7212円
(1万口当たり純資産額)	(12,882円)	(17,212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12月10日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ外国株式インデック ス マザーファンド	55,179,346	274,726,927	
親投資信託受益証券	合計	55,179,346	274,726,927	
合計			274,726,927	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【FWニッセイ新興国株インデックス】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	171	968
コール・ローン	18,659	88,224
親投資信託受益証券	13,075,365	65,155,601
未収入金	90,057	883,243
流動資産合計	13,184,252	66,128,036
資産合計	13,184,252	66,128,036
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	89,185	879,281
未払受託者報酬	1,257	6,107
未払委託者報酬	18,238	86,160
その他未払費用	564	1,466
流動負債合計	109,244	973,014
負債合計	109,244	973,014
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	12,269,055	50,297,563
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	805,953	14,857,459
（分配準備積立金）	847,209	6,911,070
元本等合計	13,075,008	65,155,022
純資産合計	13,075,008	65,155,022
負債純資産合計	13,184,252	66,128,036

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	第3期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	884,668	7,901,548
営業収益合計	884,668	7,901,548
営業費用		
受託者報酬	2,178	9,839
委託者報酬	31,799	138,834
その他費用	929	3,269
営業費用合計	34,906	151,942
営業利益又は営業損失（ ）	849,762	7,749,606
経常利益又は経常損失（ ）	849,762	7,749,606
当期純利益又は当期純損失（ ）	849,762	7,749,606
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（ ）	111,716	1,417,114
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	106,787	805,953
剰余金増加額又は欠損金減少額	174,694	9,027,339
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	70,562	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	104,132	9,027,339
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	1,308,325
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	1,308,325
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（ ）	805,953	14,857,459

## ( 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3期	
	自 2023年12月12日	至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2023年12月12日から2024年12月10日までとなっております。	

( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 期首元本額	7,170,800円	12,269,055円
期中追加設定元本額	9,203,729円	50,399,465円
期中一部解約元本額	4,105,474円	12,370,957円
2. 受益権の総数	12,269,055口	50,297,563口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10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(738,046円)、収益調整金(188,881円)及び分配準備積立金(109,163円)より分配対象収益は1,036,090円(1万口当たり844.47円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	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(6,332,492円)、収益調整金(7,946,389円)及び分配準備積立金(578,578円)より分配対象収益は14,857,459円(1万口当たり2,953.91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2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	767,414	6,462,218
合計	767,414	6,462,218

## (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2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0657円 (10,657円)	1.2954円 (12,954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12月10日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	42,352,835	65,155,601	
親投資信託受益証券	合計	42,352,835	65,155,601	
合計			65,155,601	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【FWニッセイ国内債インデックス】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	355	386
コール・ローン	38,671	35,149
親投資信託受益証券	39,749,999	35,281,893
未収入金	687	26,807
流動資産合計	39,789,712	35,344,235
資産合計	39,789,712	35,344,235
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	25,853
未払受託者報酬	4,229	3,921
未払委託者報酬	34,103	31,720
その他未払費用	2,059	1,040
流動負債合計	40,391	62,534
負債合計	40,391	62,534
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	42,401,887	38,317,579
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,652,566	3,035,878
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	39,749,321	35,281,701
純資産合計	39,749,321	35,281,701
負債純資産合計	39,789,712	35,344,235

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2022年12月13日 至 2023年12月11日	自	2023年12月12日 至 2024年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		664,843		735,305
営業収益合計		664,843		735,305
営業費用				
受託者報酬		7,216		8,708
委託者報酬		58,278		70,281
その他費用		3,491		3,357
営業費用合計		68,985		82,346
営業利益又は営業損失（ ）		733,828		817,651
経常利益又は経常損失（ ）		733,828		817,651
当期純利益又は当期純損失（ ）		733,828		817,651
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（ ）		5,675		233,163
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,138,530		2,652,566
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,125,743		1,942,744
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,125,743		1,942,744
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,911,626		1,741,568
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,911,626		1,741,568
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,652,566		3,035,878

## （ 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3期	
	自 2023年12月12日	至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2023年12月12日から2024年12月10日までとなっております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 期首元本額	28,502,469円	42,401,887円
期中追加設定元本額	40,682,519円	27,478,506円
期中一部解約元本額	26,783,101円	31,562,814円
2. 受益権の総数	42,401,887口	38,317,579口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,652,566円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,035,878円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は0円（1万口当たり0円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は0円（1万口当たり0円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	第3期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	670,205	527,060
合計	670,205	527,060

## （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2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
1口当たり純資産額	0.9374円	0.9208円
（1万口当たり純資産額）	(9,374円)	(9,208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12月10日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券パッシブ マ ザーファンド	38,733,004	35,281,893	
親投資信託受益証券	合計	38,733,004	35,281,893	
合計			35,281,893	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【FWニッセイ外国債インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	297	113
コール・ローン	32,438	10,258
親投資信託受益証券	31,486,219	8,921,468
未収入金	433	232
流動資産合計	31,519,387	8,932,071
資産合計	31,519,387	8,932,071
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	2,922	915
未払委託者報酬	29,509	9,563
その他未払費用	1,391	184
流動負債合計	33,822	10,662
負債合計	33,822	10,662
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	39,089,475	11,114,536
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,603,910	2,193,127
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	31,485,565	8,921,409
純資産合計	31,485,565	8,921,409
負債純資産合計	31,519,387	8,932,071



## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2022年12月13日 至 2023年12月11日	自	2023年12月12日 至 2024年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		717,322		156,332
営業収益合計		717,322		156,332
営業費用				
受託者報酬		4,752		2,280
委託者報酬		48,379		23,689
その他費用		2,228		814
営業費用合計		55,359		26,783
営業利益又は営業損失（ ）		772,681		129,549
経常利益又は経常損失（ ）		772,681		129,549
当期純利益又は当期純損失（ ）		772,681		129,549
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（ ）		171,377		140,758
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,659,266		7,603,910
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,226,673		6,647,449
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,226,673		6,647,449
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,570,013		1,225,457
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,570,013		1,225,457
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,603,910		2,193,127

## （ 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3期	
	自 2023年12月12日	至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2023年12月12日から2024年12月10日までとなっております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 期首元本額	10,902,605円	39,089,475円
期中追加設定元本額	42,017,468円	6,232,505円
期中一部解約元本額	13,830,598円	34,207,444円
2. 受益権の総数	39,089,475口	11,114,536口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,603,910円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,193,127円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（3,604円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は3,604円（1万口当たり0.92円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（1,034円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,034円（1万口当たり0.93円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	第3期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	552,910	7,673
合計	552,910	7,673

## (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2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1口当たり純資産額	0.8055円	0.8027円
(1万口当たり純資産額)	(8,055円)	(8,027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12月10日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ為替ヘッジ外国債券 パッシブ マザーファンド	9,091,479	8,921,468	
親投資信託受益証券	合計	9,091,479	8,921,468	
合計			8,921,468	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【FWニッセイ外国債インデックス】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	674	2,204
コール・ローン	73,517	200,796
親投資信託受益証券	61,065,748	155,421,409
未収入金	1,494	1,505,400
流動資産合計	61,141,433	157,129,809
資産合計	61,141,433	157,129,809
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	1,499,346
未払受託者報酬	5,680	15,819
未払委託者報酬	68,702	190,339
その他未払費用	2,779	4,113
流動負債合計	77,161	1,709,617
負債合計	77,161	1,709,617
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	57,007,244	133,874,321
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,057,028	21,545,871
（分配準備積立金）	2,951,311	7,921,636
元本等合計	61,064,272	155,420,192
純資産合計	61,064,272	155,420,192
負債純資産合計	61,141,433	157,129,809

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	第3期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
営業収益		
受取利息	-	22
有価証券売買等損益	3,663,036	8,463,197
営業収益合計	3,663,036	8,463,219
営業費用		
受託者報酬	9,204	27,516
委託者報酬	111,598	331,197
その他費用	4,472	9,895
営業費用合計	125,274	368,608
営業利益又は営業損失（ ）	3,537,762	8,094,611
経常利益又は経常損失（ ）	3,537,762	8,094,611
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,537,762	8,094,611
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（ ）	449,192	2,062,694
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	64,861	4,057,028
剰余金増加額又は欠損金減少額	903,597	15,555,264
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,147	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	888,450	15,555,264
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	4,098,338
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	4,098,338
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（ ）	4,057,028	21,545,871

## （ 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3期	
	自 2023年12月12日	至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2023年12月12日から2024年12月10日までとなっております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 期首元本額	21,869,189円	57,007,244円
期中追加設定元本額	49,101,514円	120,449,511円
期中一部解約元本額	13,963,459円	43,582,434円
2. 受益権の総数	57,007,244口	133,874,321口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10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（2,951,311円）、収益調整金（1,105,717円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は4,057,028円（1万口当たり711.67円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（22円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（6,031,895円）、収益調整金（13,624,235円）及び分配準備積立金（1,889,719円）より分配対象収益は21,545,871円（1万口当たり1,609.41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2期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	第3期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,199,996	6,348,150
合計	3,199,996	6,348,150

## (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2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0712円 (10,712円)	1.1609円 (11,609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12月10日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	87,462,808	155,421,409	
親投資信託受益証券	合計	87,462,808	155,421,409	
合計			155,421,409	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【FWニッセイ新興国債インデックス】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	550	27
コール・ローン	60,009	2,464
親投資信託受益証券	49,108,766	1,848,184
未収入金	1,236	70
流動資産合計	49,170,561	1,850,745
資産合計	49,170,561	1,850,745
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	4,464	183
未払委託者報酬	56,394	2,392
その他未払費用	2,164	-
流動負債合計	63,022	2,575
負債合計	63,022	2,575
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	47,751,310	1,633,084
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,356,229	215,086
（分配準備積立金）	3,190,655	208,976
元本等合計	49,107,539	1,848,170
純資産合計	49,107,539	1,848,170
負債純資産合計	49,170,561	1,850,745

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2022年12月13日 至 2023年12月11日	自	2023年12月12日 至 2024年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,630,312		1,628,213
営業収益合計		3,630,312		1,628,213
営業費用				
受託者報酬		7,204		1,441
委託者報酬		91,086		18,282
その他費用		3,468		534
営業費用合計		101,758		20,257
営業利益又は営業損失（ ）		3,528,554		1,607,956
経常利益又は経常損失（ ）		3,528,554		1,607,956
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,528,554		1,607,956
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（ ）		426,737		1,465,994
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		691,552		1,356,229
剰余金増加額又は欠損金減少額		613,112		112,449
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		613,112		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		112,449
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,667,148		1,395,554
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,395,554
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,667,148		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,356,229		215,086

## （ 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3期	
	自 2023年12月12日	至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2023年12月12日から2024年12月10日までとなっております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 期首元本額	13,264,818円	47,751,310円
期中追加設定元本額	45,163,345円	2,685,190円
期中一部解約元本額	10,676,853円	48,803,416円
2. 受益権の総数	47,751,310口	1,633,084口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10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（3,101,817円）、収益調整金（346,255円）及び分配準備積立金（88,838円）より分配対象収益は3,536,910円（1万口当たり740.69円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	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（141,962円）、収益調整金（53,804円）及び分配準備積立金（67,014円）より分配対象収益は262,780円（1万口当たり1,609.10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2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,191,125	147,810
合計	3,191,125	147,810

## (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2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0284円 (10,284円)	1.1317円 (11,317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12月10日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド	1,309,376	1,848,184	
親投資信託受益証券	合計	1,309,376	1,848,184	
合計			1,848,184	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【FWニッセイ国内リートインデックス】  
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	114	105
コール・ローン	12,397	9,585
親投資信託受益証券	9,755,874	6,973,238
未収入金	234	1,652
流動資産合計	9,768,619	6,984,580
資産合計	9,768,619	6,984,580
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	1,382
未払受託者報酬	937	725
未払委託者報酬	11,674	9,119
その他未払費用	368	170
流動負債合計	12,979	11,396
負債合計	12,979	11,396
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,061,865	7,686,106
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	306,225	712,922
（分配準備積立金）	-	-
元本等合計	9,755,640	6,973,184
純資産合計	9,755,640	6,973,184
負債純資産合計	9,768,619	6,984,580

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	第3期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	8,963	376,602
営業収益合計	8,963	376,602
営業費用		
受託者報酬	1,545	1,471
委託者報酬	19,460	18,309
その他費用	598	415
営業費用合計	21,603	20,195
営業利益又は営業損失（ ）	12,640	396,797
経常利益又は経常損失（ ）	12,640	396,797
当期純利益又は当期純損失（ ）	12,640	396,797
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（ ）	7,778	17,536
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	24,691	306,225
剰余金増加額又は欠損金減少額	59,251	189,524
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	59,251	189,524
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	320,367	181,888
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	320,367	181,888
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	306,225	712,922

## （ 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3期	
	自 2023年12月12日	至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2023年12月12日から2024年12月10日までとなっております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 期首元本額	2,771,681円	10,061,865円
期中追加設定元本額	9,220,199円	3,612,115円
期中一部解約元本額	1,930,015円	5,987,874円
2. 受益権の総数	10,061,865口	7,686,106口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は306,225円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は712,922円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は0円（1万口当たり0円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は0円（1万口当たり0円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,003	397,390
合計	1,003	397,390

## (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2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1口当たり純資産額	0.9696円	0.9072円
(1万口当たり純資産額)	(9,696円)	(9,072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12月10日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	3,992,922	6,973,238	
親投資信託受益証券	合計	3,992,922	6,973,238	
合計			6,973,238	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【FWニッセイ先進国リートインデックス】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	184	752
コール・ローン	20,110	68,530
親投資信託受益証券	16,319,225	48,302,296
未収入金	435	293,857
流動資産合計	16,339,954	48,665,435
資産合計	16,339,954	48,665,435
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	291,781
未払受託者報酬	1,376	4,829
未払委託者報酬	19,178	65,743
その他未払費用	607	1,205
流動負債合計	21,161	363,558
負債合計	21,161	363,558
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	15,275,540	36,741,999
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,043,253	11,559,878
（分配準備積立金）	984,964	6,403,310
元本等合計	16,318,793	48,301,877
純資産合計	16,318,793	48,301,877
負債純資産合計	16,339,954	48,665,435



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2022年12月13日 至 2023年12月11日	自	2023年12月12日 至 2024年12月10日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,204,893		7,046,035
営業収益合計		1,204,893		7,046,035
営業費用				
受託者報酬		2,238		8,027
委託者報酬		31,284		109,423
その他費用		951		2,757
営業費用合計		34,473		120,207
営業利益又は営業損失（ ）		1,170,420		6,925,828
経常利益又は経常損失（ ）		1,170,420		6,925,828
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,170,420		6,925,828
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		128,879		1,144,620
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		71,921		1,043,253
剰余金増加額又は欠損金減少額		73,633		6,110,071
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		66,278		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,355		6,110,071
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,374,654
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,374,654
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,043,253		11,559,878

## （ 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3期	
	自 2023年12月12日	至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年12月10日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間末日が休業日のため、2023年12月12日から2024年12月10日までとなっております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	第2期	第3期
	2023年12月11日現在	2024年12月10日現在
1. 期首元本額	4,947,462円	15,275,540円
期中追加設定元本額	13,970,820円	33,756,513円
期中一部解約元本額	3,642,742円	12,290,054円
2. 受益権の総数	15,275,540口	36,741,999口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期	第3期
	自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	自 2023年12月12日 至 2024年12月10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（984,964円）、収益調整金（58,289円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,043,253円（1万口当たり682.96円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	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（5,781,208円）、収益調整金（5,156,568円）及び分配準備積立金（622,102円）より分配対象収益は11,559,878円（1万口当たり3,146.23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2期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日	第3期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,071,510	5,881,104
合計	1,071,510	5,881,104

## (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2期 2023年12月11日現在	第3期 2024年12月10日現在
1口当たり純資産額	1.0683円	1.3146円
(1万口当たり純資産額)	(10,683円)	(13,146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12月10日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	25,765,347	48,302,296	
親投資信託受益証券	合計	25,765,347	48,302,296	
合計			48,302,296	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「FWニッセイ国内株インデックス」、「FWニッセイ先進国株インデックス」、「FWニッセイ新興国株インデックス」、「FWニッセイ国内債インデックス」、「FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）」、「FWニッセイ外国債インデックス」、「FWニッセイ新興国債インデックス」、「FWニッセイ国内リートインデックス」、「FWニッセイ先進国リートインデックス」は、「ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ」-REITインデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド  
貸借対照表

（単位：円）

2024年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	72,413,327
コール・ローン	6,598,367,447
株式	255,212,734,142
派生商品評価勘定	99,645,150
未収配当金	159,478,963
差入委託証拠金	371,212,860
流動資産合計	262,513,851,889
資産合計	262,513,851,889
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,662,100
前受金	90,650,000
未払解約金	592,717,450
流動負債合計	685,029,550
負債合計	685,029,550
純資産の部	
元本等	
元本	78,996,556,126
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	182,832,266,213
元本等合計	261,828,822,339
純資産合計	261,828,822,339
負債純資産合計	262,513,851,889

## 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12月12日 至 2024年12月10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12月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	72,044,115,492円
同期中追加設定元本額	27,010,776,880円
同期中一部解約元本額	20,058,336,246円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,108,111,069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）	2,951,761,175円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	2,933,996円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,070,600,101円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,713,105,172円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	6,950,981,816円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	1,935,016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）	3,021,880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）	8,535,584円
DCニッセイ国内株式インデックス	5,235,759,236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	25,719,965,422円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）	5,285,195,941円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	477,989,939円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	255,115,675円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	554,071,940円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	711,382,497円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	29,303,966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）	128,765,324円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	13,887,806円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	15,413,779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）	5,064,469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)	11,585,810円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	28,794,638円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	398,866,319円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	268,850,864円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	473,688,265円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	211,232,924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)	13,994,334,154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)	30,017,691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)	41,284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)	92,063円
FWニッセイ国内株インデックス	103,501,762円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	194,563,782円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	34,057,678円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	3,920,022円
ニッセイインデックスバランス(外国株式重視型)SA(適格機関投資 家限定)	92,560円
ニッセイ全世界株式インデックスコレクトSA(適格機関投資家限定)	14,507円
計	78,996,556,126円
2. 受益権の総数	78,996,556,126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12月12日 至 2024年12月10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12月10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12月10日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	9,581,138,807	
合計	9,581,138,807	

(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(2024年2月21日から2024年12月10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12月10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	6,726,970,000	-		6,825,090,000	98,120,000
合計	6,726,970,000	-		6,825,090,000	98,120,000

## (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12月10日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3144円 (33,144円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2024年12月10日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,800	4,060.00	15,428,000	
ニッセイ	91,100	913.10	83,183,410	
マルハニチロ	13,500	2,957.00	39,919,500	
雪国まいたけ	7,800	1,033.00	8,057,400	
カネコ種苗	2,700	1,417.00	3,825,900	
サカタのタネ	10,200	3,490.00	35,598,000	
ホクト	8,100	1,746.00	14,142,600	
ショーボンドホールディングス	12,000	5,273.00	63,276,000	
ミライト・ワン	29,800	2,185.00	65,113,000	
タマホーム	5,700	3,620.00	20,634,000	
住石ホールディングス	9,900	824.00	8,157,600	
日鉄鉱業	3,700	4,105.00	15,188,500	
三井松島ホールディングス	4,400	3,485.00	15,334,000	
I N P E X	275,400	1,982.00	545,842,800	
石油資源開発	50,000	1,096.00	54,800,000	
K & O エナジーグループ	4,100	3,150.00	12,915,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	11,600	2,282.00	26,471,200	
安藤・間	52,800	1,189.00	62,779,200	
東急建設	28,500	697.00	19,864,500	
コムシスホールディングス	32,300	3,280.00	105,944,000	
ビーアールホールディングス	23,500	336.00	7,896,000	
高松コンストラクショングループ	6,800	2,638.00	17,938,400	
東建コーポレーション	2,300	11,000.00	25,300,000	
ヤマウラ	6,900	1,174.00	8,100,600	
オリエンタル白石	33,700	383.00	12,907,100	
大成建設	57,900	6,584.00	381,213,600	
大林組	210,400	2,070.00	435,528,000	
清水建設	180,700	1,183.50	213,858,450	
長谷工コーポレーション	58,500	2,026.50	118,550,250	
松井建設	9,600	897.00	8,611,200	
鹿島建設	141,300	2,708.00	382,640,400	
不動テトラ	4,000	2,034.00	8,136,000	
鉄建建設	4,200	2,262.00	9,500,400	
西松建設	10,200	5,056.00	51,571,200	
三井住友建設	51,400	412.00	21,176,800	
大豊建設	2,400	3,395.00	8,148,000	
奥村組	11,300	3,830.00	43,279,000	
東鉄工業	7,000	3,220.00	22,540,000	
浅沼組	25,500	640.00	16,320,000	

戸田建設	78,400	917.50	71,932,000
熊谷組	10,500	4,015.00	42,157,500
矢作建設工業	8,700	1,533.00	13,337,100
日本ハウスホールディングス	24,100	337.00	8,121,700
大東建託	21,800	17,555.00	382,699,000
新日本建設	8,900	1,478.00	13,154,200
サムティホールディングス	12,500	3,285.00	41,062,500
東亜道路工業	11,000	1,284.00	14,124,000
日本道路	6,400	1,763.00	11,283,200
東亜建設工業	19,200	1,179.00	22,636,800
日本国土開発	18,100	510.00	9,231,000
若築建設	2,200	3,825.00	8,415,000
東洋建設	18,300	1,288.00	23,570,400
五洋建設	83,400	634.90	52,950,660
世紀東急工業	9,100	1,505.00	13,695,500
福田組	2,500	5,250.00	13,125,000
住友林業	55,100	5,901.00	325,145,100
大和ハウス工業	192,300	4,726.00	908,809,800
ライト工業	12,900	2,191.00	28,263,900
積水ハウス	193,400	3,628.00	701,655,200
日特建設	8,000	981.00	7,848,000
ユアテック	12,300	1,400.00	17,220,000
日本リーテック	7,100	1,127.00	8,001,700
四電工	8,000	1,468.00	11,744,000
中電工	9,900	3,360.00	33,264,000
関電工	34,900	2,217.00	77,373,300
きんでん	44,300	3,050.00	135,115,000
東京エネシス	7,800	1,040.00	8,112,000
トーエネック	10,600	952.00	10,091,200
住友電設	5,200	4,795.00	24,934,000
日本電設工業	12,000	1,974.00	23,688,000
エクシオグループ	67,500	1,731.50	116,876,250
新日本空調	4,100	3,875.00	15,887,500
九電工	13,800	5,217.00	71,994,600
三機工業	13,300	2,915.00	38,769,500
日揮ホールディングス	63,100	1,298.50	81,935,350
中外炉工業	2,500	3,360.00	8,400,000
太平電業	4,100	5,020.00	20,582,000
高砂熱学工業	15,400	6,060.00	93,324,000
NEC ネットエスアイ	25,400	3,250.00	82,550,000
朝日工業社	5,900	2,022.00	11,929,800
明星工業	11,000	1,392.00	15,312,000
大気社	8,200	4,680.00	38,376,000
ダイダン	8,400	3,625.00	30,450,000
日比谷総合設備	5,200	3,905.00	20,306,000
ニッポン	21,100	2,131.00	44,964,100
日清製粉グループ本社	66,600	1,824.00	121,478,400
日東富士製粉	1,200	6,690.00	8,028,000
昭和産業	5,400	2,810.00	15,174,000
中部飼料	8,900	1,306.00	11,623,400

フィード・ワン	9,900	798.00	7,900,200
日本甜菜製糖	3,400	2,387.00	8,115,800
D M三井製糖ホールディングス	6,300	3,330.00	20,979,000
ウェルネオシュガー	3,800	2,161.00	8,211,800
L I F U L L	26,800	198.00	5,306,400
M I X I	12,500	2,807.00	35,087,500
ジェイエイシーリクルートメント	24,100	728.00	17,544,800
日本M&Aセンターホールディングス	98,300	648.80	63,777,040
メンバーズ	7,300	1,030.00	7,519,000
UTグループ	8,700	2,208.00	19,209,600
ケアネット	13,700	591.00	8,096,700
E・Jホールディングス	4,700	1,662.00	7,811,400
オープンアップグループ	20,100	1,838.00	36,943,800
コシダカホールディングス	20,200	1,166.00	23,553,200
パソナグループ	8,100	2,012.00	16,297,200
リンクアンドモチベーション	16,500	579.00	9,553,500
エス・エム・エス	25,500	1,693.50	43,184,250
パーソルホールディングス	623,500	239.10	149,078,850
森永製菓	26,800	2,772.50	74,303,000
中村屋	2,500	3,180.00	7,950,000
江崎グリコ	18,300	4,598.00	84,143,400
名糖産業	1,300	1,961.00	2,549,300
井村屋グループ	3,500	2,445.00	8,557,500
不二家	4,400	2,639.00	11,611,600
山崎製パン	42,800	2,820.00	120,696,000
モロゾフ	2,100	4,550.00	9,555,000
亀田製菓	4,100	4,135.00	16,953,500
寿スピリッツ	37,800	2,141.50	80,948,700
カルビー	29,300	3,252.00	95,283,600
森永乳業	24,600	2,968.50	73,025,100
六甲バター	5,800	1,384.00	8,027,200
ヤクルト本社	91,500	3,240.00	296,460,000
明治ホールディングス	85,600	3,166.00	271,009,600
雪印メグミルク	17,200	2,718.00	46,749,600
プリマハム	8,600	2,208.00	18,988,800
日本ハム	27,500	5,081.00	139,727,500
丸大食品	6,400	1,707.00	10,924,800
S F o o d s	7,100	2,725.00	19,347,500
柿安本店	2,900	2,792.00	8,096,800
伊藤ハム米久ホールディングス	9,800	3,855.00	37,779,000
学情	4,600	2,041.00	9,388,600
クロスキャット	7,300	1,084.00	7,913,200
システナ	93,200	356.00	33,179,200
デジタルアーツ	4,100	6,210.00	25,461,000
日鉄ソリューションズ	22,200	4,119.00	91,441,800
総合警備保障	111,600	1,132.50	126,387,000
キューブシステム	7,600	1,066.00	8,101,600
いちご	54,200	370.00	20,054,000
日本駐車場開発	76,200	206.00	15,697,200
コア	4,400	1,797.00	7,906,800

カカクコム	48,200	2,486.00	119,825,200
アイロムグループ	2,700	2,599.00	7,017,300
セントケア・ホールディング	10,800	746.00	8,056,800
ディップ	11,700	2,517.00	29,448,900
SBSホールディングス	5,800	2,380.00	13,804,000
新日本科学	7,100	1,579.00	11,210,900
エムスリー	132,000	1,450.00	191,400,000
ワールドホールディングス	3,800	1,973.00	7,497,400
ディー・エヌ・エー	26,700	2,449.00	65,388,300
博報堂DYホールディングス	75,700	1,217.50	92,164,750
ファンコミュニケーションズ	19,100	420.00	8,022,000
エスプール	24,500	310.00	7,595,000
WDBホールディングス	4,700	1,699.00	7,985,300
アドウェイズ	24,400	309.00	7,539,600
バリューコマース	7,000	1,168.00	8,176,000
インフォマート	63,100	275.00	17,352,500
サッポロホールディングス	21,100	9,142.00	192,896,200
アサヒグループホールディングス	480,600	1,623.50	780,254,100
麒麟ホールディングス	266,600	2,101.00	560,126,600
シマダヤ	5,700	1,401.00	7,985,700
宝ホールディングス	43,100	1,284.50	55,361,950
オエノンホールディングス	20,700	418.00	8,652,600
飛島ホールディングス	6,500	1,543.00	10,029,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	45,100	2,454.50	110,697,950
ライフドリンク カンパニー	14,000	2,335.00	32,690,000
サントリー食品インターナショナル	45,100	4,955.00	223,470,500
ダイドーグループホールディングス	7,200	3,465.00	24,948,000
伊藤園	21,400	3,671.00	78,559,400
キーコーヒー	7,200	2,040.00	14,688,000
日清オイリオグループ	9,000	4,975.00	44,775,000
不二製油グループ本社	12,800	3,511.00	44,940,800
J-オイルミルズ	7,300	2,127.00	15,527,100
インターメスティック	3,900	2,667.00	10,401,300
サンエー	11,700	2,764.00	32,338,800
カワチ薬品	5,400	2,582.00	13,942,800
エービーシー・マート	30,100	3,238.00	97,463,800
ハードオフコーポレーション	4,400	1,803.00	7,933,200
高千穂交易	2,700	3,765.00	10,165,500
アスクル	16,300	1,883.00	30,692,900
ゲオホールディングス	7,700	1,677.00	12,912,900
アダストリア	9,500	3,675.00	34,912,500
リガク・ホールディングス	32,900	967.00	31,814,300
伊藤忠食品	1,600	6,890.00	11,024,000
くら寿司	8,000	3,850.00	30,800,000
キャンドウ	2,400	3,460.00	8,304,000
エレマテック	6,200	2,386.00	14,793,200
パルグループホールディングス	15,700	3,255.00	51,103,500
エディオン	29,900	1,782.00	53,281,800
あらた	10,500	3,045.00	31,972,500

サーラコーポレーション	14,400	844.00	12,153,600
ハローズ	2,700	4,040.00	10,908,000
J Pホールディングス	17,100	677.00	11,576,700
フジオフードグループ本社	7,700	1,171.00	9,016,700
あみやき亭	5,000	1,652.00	8,260,000
東京エレクトロン デバイス	6,900	2,974.00	20,520,600
円谷フィールズホールディングス	11,100	1,975.00	21,922,500
双日	76,600	3,150.00	241,290,000
アルフレッサ ホールディングス	64,100	2,202.00	141,148,200
大黒天物産	2,100	9,800.00	20,580,000
ハニーズホールディングス	6,100	1,654.00	10,089,400
キッコーマン	212,100	1,686.00	357,600,600
味の素	148,300	6,520.00	966,916,000
ブルドックソース	4,400	1,892.00	8,324,800
キュービー	34,400	3,414.00	117,441,600
ハウス食品グループ本社	21,500	2,906.00	62,479,000
カゴメ	27,400	2,995.50	82,076,700
アリアケジャパン	6,400	5,690.00	36,416,000
エバラ食品工業	2,800	2,859.00	8,005,200
ニチレイ	26,100	4,239.00	110,637,900
横浜冷凍	17,300	820.00	14,186,000
東洋水産	29,600	10,550.00	312,280,000
イートアンドホールディングス	3,800	2,164.00	8,223,200
日清食品ホールディングス	82,500	4,016.00	331,320,000
フジッコ	6,600	1,712.00	11,299,200
ロック・フィールド	7,800	1,522.00	11,871,600
日本たばこ産業	388,900	4,195.00	1,631,435,500
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,166.00	8,664,000
わらべや日洋ホールディングス	4,300	1,978.00	8,505,400
なとり	4,000	2,139.00	8,556,000
ファーマフーズ	8,500	954.00	8,109,000
北の達人コーポレーション	54,000	145.00	7,830,000
ユーグレナ	39,800	415.00	16,517,000
紀文食品	7,200	1,080.00	7,776,000
S R Eホールディングス	2,400	3,225.00	7,740,000
片倉工業	6,000	1,943.00	11,658,000
グンゼ	4,600	5,170.00	23,782,000
ヒューリック	149,300	1,379.00	205,884,700
アルペン	5,700	1,998.00	11,388,600
ラクーンホールディングス	6,500	727.00	4,725,500
クオールホールディングス	8,500	1,469.00	12,486,500
アルコニックス	9,800	1,476.00	14,464,800
神戸物産	53,200	3,637.00	193,488,400
ジーンズホールディングス	5,200	6,280.00	32,656,000
ビックカメラ	41,200	1,770.50	72,944,600
D C Mホールディングス	35,600	1,420.00	50,552,000
Monotaro	97,500	2,674.00	260,715,000
あい ホールディングス	11,000	2,134.00	23,474,000
J . フロント リテイリング	78,900	1,893.50	149,397,150
ドトール・日レスホールディングス	12,200	2,286.00	27,889,200

マツキヨココカラ &カンパニー	121,200	2,254.00	273,184,800
ブロンコビリー	4,000	3,930.00	15,720,000
Z O Z O	51,100	4,737.00	242,060,700
トレジャー・ファクトリー	6,200	1,419.00	8,797,800
物語コーポレーション	12,300	3,680.00	45,264,000
三越伊勢丹ホールディングス	104,400	2,272.50	237,249,000
東洋紡	28,100	949.00	26,666,900
富士紡ホールディングス	2,600	5,420.00	14,092,000
日清紡ホールディングス	49,400	878.00	43,373,200
倉敷紡績	4,600	5,550.00	25,530,000
ダイワボウホールディングス	30,400	3,115.00	94,696,000
日東紡績	7,300	5,930.00	43,289,000
トヨタ紡織	27,400	1,998.50	54,758,900
マクニカホールディングス	53,200	1,748.00	92,993,600
H a m e e	7,500	1,060.00	7,950,000
ラクト・ジャパン	2,900	2,770.00	8,033,000
ウエルシアホールディングス	35,700	1,940.00	69,258,000
クリエイトSDホールディングス	9,700	2,887.00	28,003,900
グリムス	3,000	2,615.00	7,845,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	9,500	1,196.00	11,362,000
八洲電機	5,600	1,566.00	8,769,600
レスター	5,800	2,450.00	14,210,000
T O K A Iホールディングス	37,300	941.00	35,099,300
三洋貿易	7,000	1,571.00	10,997,000
シュッピン	7,900	996.00	7,868,400
ビューティガレージ	5,600	1,297.00	7,263,200
オイシックス・ラ・大地	11,100	1,511.00	16,772,100
ネクステージ	15,700	1,404.00	22,042,800
ジョイフル本田	19,100	1,836.00	35,067,600
エターナルホスピタリティグループ	2,500	3,070.00	7,675,000
ホットランド	5,300	2,233.00	11,834,900
すかいらーくホールディングス	94,000	2,442.00	229,548,000
S F Pホールディングス	4,200	1,976.00	8,299,200
綿半ホールディングス	5,300	1,520.00	8,056,000
日本毛織	16,700	1,273.00	21,259,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	29,374	783.00	22,999,842
野村不動産ホールディングス	40,100	3,716.00	149,011,600
三重交通グループホールディングス	15,800	493.00	7,789,400
ディア・ライフ	10,900	1,059.00	11,543,100
地主	5,700	2,115.00	12,055,500
プレサンスコーポレーション	8,500	1,920.00	16,320,000
J P M C	6,800	1,143.00	7,772,400
フージャースホールディングス	9,900	1,008.00	9,979,200
オープンハウスグループ	23,500	5,796.00	136,206,000
東急不動産ホールディングス	192,400	965.50	185,762,200
飯田グループホールディングス	61,300	2,317.50	142,062,750
帝国繊維	7,400	2,424.00	17,937,600
日本コークス工業	31,400	97.00	3,045,800

BEENOS	4,300	3,370.00	14,491,000
あさひ	5,700	1,531.00	8,726,700
日本調剤	5,600	1,422.00	7,963,200
コスモス薬品	11,700	7,053.00	82,520,100
シップヘルスケアホールディングス	27,200	2,205.50	59,989,600
ソフトクリエイトホールディングス	4,700	2,240.00	10,528,000
セブン&アイ・ホールディングス	759,600	2,545.50	1,933,561,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	51,700	1,185.00	61,264,500
明治電機工業	5,800	1,369.00	7,940,200
ツルハホールディングス	14,500	8,420.00	122,090,000
サンマルクホールディングス	5,500	2,601.00	14,305,500
トリドールホールディングス	19,300	3,890.00	75,077,000
帝人	62,500	1,306.50	81,656,250
東レ	475,800	964.70	459,004,260
クラレ	94,900	2,231.50	211,769,350
旭化成	440,400	1,070.50	471,448,200
TOKYO BASE	13,200	325.00	4,290,000
宮地エンジニアリンググループ	8,100	1,935.00	15,673,500
トーカロ	19,300	1,846.00	35,627,800
SUMCO	127,700	1,234.00	157,581,800
川田テクノロジーズ	4,300	2,678.00	11,515,400
RS Technologies	5,100	3,280.00	16,728,000
And Doホールディングス	8,000	983.00	7,864,000
シーアールイー	6,600	1,205.00	7,953,000
ケイアイスター不動産	3,500	4,170.00	14,595,000
ジェイ・エス・ビー	3,000	2,742.00	8,226,000
ロードスターキャピタル	3,600	2,417.00	8,701,200
霞ヶ関キャピタル	2,600	11,820.00	30,732,000
日本フェルト	5,500	486.00	2,673,000
イチカワ	2,400	1,545.00	3,708,000
JMホールディングス	5,000	2,697.00	13,485,000
コメダホールディングス	18,000	2,877.00	51,786,000
アレンザホールディングス	7,500	1,075.00	8,062,500
パロックジャパンリミテッド	10,200	788.00	8,037,600
クスリのアオキホールディングス	23,000	3,289.00	75,647,000
力の源ホールディングス	7,500	981.00	7,357,500
FOOD & LIFE COMPANIES	36,700	3,575.00	131,202,500
セーレン	12,600	2,829.00	35,645,400
ソトー	5,700	669.00	3,813,300
東海染工	1,600	697.00	1,115,200
小松マテーレ	10,100	790.00	7,979,000
ワコールホールディングス	13,500	5,196.00	70,146,000
ホギメディカル	8,800	4,805.00	42,284,000
TSIホールディングス	20,600	976.00	20,105,600
マツオカコーポレーション	1,800	1,818.00	3,272,400
ワールド	10,000	2,470.00	24,700,000
TIS	68,900	3,904.00	268,985,600
グリー	21,800	458.00	9,984,400



GMOペパボ	5,300	1,589.00	8,421,700
コーエーテクモホールディングス	49,000	1,764.00	86,436,000
三菱総合研究所	3,200	4,390.00	14,048,000
ポルトゥウィンホールディングス	17,200	496.00	8,531,200
ネクソン	143,200	2,194.50	314,252,400
アイスタイル	21,800	448.00	9,766,400
エムアップホールディングス	8,000	1,609.00	12,872,000
エイチーム	12,200	955.00	11,651,000
セルシス	9,300	1,411.00	13,122,300
エニグモ	26,300	296.00	7,784,800
コロプラ	22,100	475.00	10,497,500
ブロードリーフ	26,200	679.00	17,789,800
デジタルハーツホールディングス	9,900	797.00	7,890,300
メディアドゥ	5,900	1,355.00	7,994,500
じげん	16,300	504.00	8,215,200
フィックスターズ	6,500	1,732.00	11,258,000
CARTA HOLDINGS	5,400	1,466.00	7,916,400
オブティム	11,000	727.00	7,997,000
SHIFT	4,300	17,705.00	76,131,500
特種東海製紙	3,200	3,575.00	11,440,000
ティーガイア	5,500	2,658.00	14,619,000
テクマトリックス	14,100	2,488.00	35,080,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	16,200	3,056.00	49,507,200
GMOペイメントゲートウェイ	14,900	8,539.00	127,231,100
システムリサーチ	5,800	1,419.00	8,230,200
インターネットイニシアティブ	35,600	3,100.00	110,360,000
さくらインターネット	10,200	4,740.00	48,348,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,100	2,529.00	7,839,900
SRAホールディングス	3,700	4,360.00	16,132,000
朝日ネット	12,800	647.00	8,281,600
eBASE	11,900	655.00	7,794,500
アバントグループ	8,200	1,971.00	16,162,200
アドソル日進	3,800	2,154.00	8,185,200
コムチュア	8,600	2,173.00	18,687,800
アステリア	15,500	485.00	7,517,500
アイル	3,700	2,889.00	10,689,300
王子ホールディングス	246,500	551.50	135,944,750
日本製紙	33,900	876.00	29,696,400
三菱製紙	900	476.00	428,400
北越コーポレーション	36,600	1,545.00	56,547,000
大王製紙	32,900	837.00	27,537,300
阿波製紙	800	464.00	371,200
マークライNZ	3,900	2,214.00	8,634,600
gumi	21,500	383.00	8,234,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,800	2,212.00	8,405,600
ラクス	30,800	1,998.00	61,538,400
ダブルスタンダード	4,900	1,634.00	8,006,600

オープンドア	11,200	672.00	7,526,400
アカツキ	3,300	2,555.00	8,431,500
Ubicomホールディングス	6,000	1,285.00	7,710,000
カナミックネットワーク	15,800	491.00	7,757,800
レンゴー	59,300	863.80	51,223,340
トーモク	3,800	2,198.00	8,352,400
ザ・パック	4,800	3,530.00	16,944,000
チェンジホールディングス	16,200	1,287.00	20,849,400
オークネット	3,100	2,619.00	8,118,900
マクロミル	12,800	1,180.00	15,104,000
オロ	3,100	2,528.00	7,836,800
PKSHA Technology	5,200	3,965.00	20,618,000
マネーフォワード	16,000	5,008.00	80,128,000
レゾナック・ホールディングス	58,400	4,057.00	236,928,800
住友化学	523,700	360.80	188,950,960
住友精化	3,100	4,730.00	14,663,000
日産化学	33,500	5,088.00	170,448,000
ラサ工業	3,000	2,703.00	8,109,000
クレハ	13,500	2,805.00	37,867,500
多木化学	2,500	3,510.00	8,775,000
石原産業	10,800	1,513.00	16,340,400
日本曹達	13,800	2,722.00	37,563,600
東ソー	86,900	2,074.00	180,230,600
トクヤマ	21,000	2,658.00	55,818,000
セントラル硝子	8,200	3,260.00	26,732,000
東亜合成	31,300	1,506.50	47,153,450
大阪ソーダ	22,700	1,794.00	40,723,800
関東電化工業	14,000	1,044.00	14,616,000
デンカ	23,700	2,179.00	51,642,300
イビデン	37,700	4,119.00	155,286,300
信越化学工業	583,800	5,524.00	3,224,911,200
日本カーバイド工業	4,900	1,643.00	8,050,700
プラスアルファ・コンサルティング	8,300	1,832.00	15,205,600
電算システムホールディングス	3,200	2,446.00	7,827,200
堺化学工業	4,500	2,618.00	11,781,000
第一稀元素化学工業	11,100	700.00	7,770,000
エア・ウォーター	61,400	1,860.50	114,234,700
日本酸素ホールディングス	63,200	4,380.00	276,816,000
日本パーカライジング	29,000	1,264.00	36,656,000
高压ガス工業	10,100	836.00	8,443,600
四国化成ホールディングス	7,400	2,158.00	15,969,200
ステラ ケミファ	3,500	3,950.00	13,825,000
保土谷化学工業	2,100	3,760.00	7,896,000
日本触媒	41,700	1,852.00	77,228,400
大日精化工業	4,500	3,015.00	13,567,500
カネカ	16,000	3,627.00	58,032,000
協和キリン	76,700	2,483.00	190,446,100
APPIER GROUP	19,900	1,334.00	26,546,600
三菱瓦斯化学	52,800	2,677.50	141,372,000
三井化学	58,600	3,461.00	202,814,600

東京応化工業	31,100	3,561.00	110,747,100
大阪有機化学工業	5,400	2,750.00	14,850,000
三菱ケミカルグループ	475,900	793.20	377,483,880
KHネオケム	11,700	2,097.00	24,534,900
ビジョナル	7,700	8,501.00	65,457,700
ダイセル	74,000	1,381.50	102,231,000
住友ベークライト	20,500	3,730.00	76,465,000
積水化学工業	129,600	2,389.00	309,614,400
日本ゼオン	50,200	1,401.00	70,330,200
アイカ工業	16,400	3,276.00	53,726,400
UBE	33,600	2,380.00	79,968,000
積水樹脂	8,900	2,115.00	18,823,500
旭有機材	4,300	4,455.00	19,156,500
ニチバン	4,100	1,985.00	8,138,500
リケンテクノス	12,200	1,057.00	12,895,400
大倉工業	3,000	3,030.00	9,090,000
積水化成成品工業	21,800	361.00	7,869,800
群栄化学工業	3,000	2,701.00	8,103,000
ダイキョーニシカワ	14,400	611.00	8,798,400
森六ホールディングス	4,100	2,001.00	8,204,100
恵和	8,000	1,017.00	8,136,000
日本化薬	45,600	1,302.00	59,371,200
カーリット	6,400	1,280.00	8,192,000
プレステージ・インターナショナル	31,300	692.00	21,659,600
プロトコーポレーション	7,100	1,300.00	9,230,000
ハイマックス	5,800	1,365.00	7,917,000
アミューズ	5,600	1,394.00	7,806,400
野村総合研究所	141,300	4,642.00	655,914,600
クイック	4,600	2,090.00	9,614,000
日本システム技術	6,000	1,970.00	11,820,000
電通グループ	71,100	4,023.00	286,035,300
インテージホールディングス	7,400	1,636.00	12,106,400
イオンファンタジー	2,900	3,070.00	8,903,000
ソースネクスト	41,400	186.00	7,700,400
シーティーエス	9,200	911.00	8,381,200
メディカルシステムネットワーク	19,000	430.00	8,170,000
日本精化	4,300	2,485.00	10,685,500
扶桑化学工業	6,000	3,435.00	20,610,000
トリケミカル研究所	7,100	2,771.00	19,674,100
シンプレクス・ホールディングス	12,800	2,552.00	32,665,600
ラクスル	15,800	1,132.00	17,885,600
メルカリ	31,800	1,882.50	59,863,500
ADEKA	22,700	2,776.50	63,026,550
日油	76,600	2,223.50	170,320,100
ハリマ化成グループ	9,500	867.00	8,236,500
ウイングアーク1st	6,800	3,490.00	23,732,000
Sansan	21,500	2,289.00	49,213,500
ギフトィ	5,700	1,315.00	7,495,500
花王	158,500	6,571.00	1,041,503,500
第一工業製薬	2,300	3,955.00	9,096,500

石原ケミカル	3,200	2,460.00	7,872,000
三洋化成工業	4,000	4,110.00	16,440,000
メドレー	7,200	4,005.00	28,836,000
ベース	3,200	3,160.00	10,112,000
J M D C	7,900	4,060.00	32,074,000
武田薬品工業	580,000	4,114.00	2,386,120,000
アステラス製薬	571,800	1,580.50	903,729,900
住友ファーマ	58,000	612.00	35,496,000
塩野義製薬	216,200	2,182.50	471,856,500
日本新薬	17,100	4,224.00	72,230,400
中外製薬	204,000	6,737.00	1,374,348,000
科研製薬	11,200	4,336.00	48,563,200
エーザイ	86,500	4,418.00	382,157,000
理研ビタミン	5,500	2,491.00	13,700,500
ロート製薬	68,900	2,807.50	193,436,750
小野薬品工業	133,300	1,720.50	229,342,650
久光製薬	14,500	4,216.00	61,132,000
持田製薬	8,200	3,530.00	28,946,000
参天製薬	123,900	1,708.00	211,621,200
扶桑薬品工業	3,100	2,482.00	7,694,200
ツムラ	22,400	4,804.00	107,609,600
テルモ	434,800	3,026.00	1,315,704,800
H . U . グループホールディングス	19,600	2,550.00	49,980,000
キッセイ薬品工業	10,800	3,570.00	38,556,000
生化学工業	12,400	808.00	10,019,200
栄研化学	10,300	2,199.00	22,649,700
鳥居薬品	3,500	4,575.00	16,012,500
J C R ファーマ	22,100	686.00	15,160,600
東和薬品	8,800	2,832.00	24,921,600
富士製薬工業	5,200	1,525.00	7,930,000
ゼリア新薬工業	10,400	2,424.00	25,209,600
ネクセラファーマ	30,600	1,120.00	34,272,000
第一三共	615,200	4,502.00	2,769,630,400
杏林製薬	14,100	1,480.00	20,868,000
ダイト	4,800	2,112.00	10,137,600
大塚ホールディングス	162,700	8,798.00	1,431,434,600
ペプチドリーム	31,600	2,809.50	88,780,200
大日本塗料	7,200	1,133.00	8,157,600
日本ペイントホールディングス	288,100	1,095.00	315,469,500
関西ペイント	54,500	2,155.00	117,447,500
中国塗料	14,700	2,336.00	34,339,200
藤倉化成	15,400	524.00	8,069,600
太陽ホールディングス	11,300	4,035.00	45,595,500
D I C	23,100	3,438.00	79,417,800
サカタインクス	14,500	1,667.00	24,171,500
a r t i e n c e	11,700	3,150.00	36,855,000
アルプス技研	5,800	2,630.00	15,254,000
日本空調サービス	7,900	1,019.00	8,050,100
オリエンタルランド	397,800	3,404.00	1,354,111,200
フォーカスシステムズ	7,300	1,110.00	8,103,000

ダスキン	14,600	3,706.00	54,107,600
パーク24	49,900	1,798.00	89,720,200
明光ネットワークジャパン	11,100	723.00	8,025,300
ファルコホールディングス	3,500	2,302.00	8,057,000
クレスコ	10,700	1,215.00	13,000,500
フジ・メディア・ホールディングス	62,600	1,734.00	108,548,400
ラウンドワン	63,000	1,247.00	78,561,000
リゾートトラスト	26,400	3,056.00	80,678,400
オービック	121,000	4,956.00	599,676,000
ジャストシステム	9,400	3,595.00	33,793,000
TDCソフト	11,000	1,381.00	15,191,000
LINEヤフー	1,042,800	433.60	452,158,080
ビー・エム・エル	8,200	2,915.00	23,903,000
トレンドマイクロ	34,200	8,478.00	289,947,600
IDホールディングス	5,000	1,620.00	8,100,000
リソー教育	41,800	300.00	12,540,000
日本オラクル	12,500	14,710.00	183,875,000
アルファシステムズ	2,300	3,440.00	7,912,000
フューチャー	16,200	1,897.00	30,731,400
CAC Holdings	4,500	1,714.00	7,713,000
ユー・エス・エス	137,400	1,371.50	188,444,100
オービックビジネスコンサルタント	11,000	7,253.00	79,783,000
アイティフォー	7,600	1,443.00	10,966,800
東京個別指導学院	20,200	385.00	7,777,000
東計電算	1,900	4,410.00	8,379,000
サイバーエージェント	147,700	1,084.50	160,180,650
楽天グループ	470,800	930.40	438,032,320
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,563.00	7,658,700
SBIグローバルアセットマネジメント	13,100	672.00	8,803,200
テー・オー・ダブリュー	25,500	316.00	8,058,000
大塚商会	73,900	3,674.00	271,508,600
サイボウズ	9,000	2,063.00	18,567,000
セントラルスポーツ	3,300	2,407.00	7,943,100
パラカ	4,500	1,790.00	8,055,000
電通総研	6,300	5,760.00	36,288,000
ACCESS	6,800	895.00	6,086,000
デジタルガレージ	10,400	3,755.00	39,052,000
イーエムシステムズ	11,200	794.00	8,892,800
ウェザーニューズ	4,000	3,130.00	12,520,000
CIJ	17,900	457.00	8,180,300
スカラ	17,500	428.00	7,490,000
フルキャストホールディングス	5,500	1,462.00	8,041,000
エン・ジャパン	10,900	2,219.00	24,187,100
セルソース	7,300	1,024.00	7,475,200
あすか製薬ホールディングス	5,900	2,070.00	12,213,000
サワイグループホールディングス	38,300	2,021.00	77,404,300
富士フイルムホールディングス	393,000	3,391.00	1,332,663,000
コニカミノルタ	146,600	660.10	96,770,660
資生堂	136,100	2,813.50	382,917,350

ライオン	83,000	1,834.50	152,263,500
高砂香料工業	4,400	5,720.00	25,168,000
マンダム	12,900	1,291.00	16,653,900
ミルボン	10,500	3,585.00	37,642,500
コーセー	13,300	7,071.00	94,044,300
コタ	6,600	1,602.00	10,573,200
ポーラ・オルビスホールディングス	33,400	1,443.50	48,212,900
ノエビアホールディングス	5,800	4,990.00	28,942,000
新日本製薬	3,300	1,923.00	6,345,900
エステー	5,300	1,522.00	8,066,600
コニシ	20,500	1,332.00	27,306,000
長谷川香料	12,500	3,290.00	41,125,000
小林製薬	17,100	6,014.00	102,839,400
荒川化学工業	7,200	1,135.00	8,172,000
メック	5,400	3,415.00	18,441,000
日本高純度化学	2,500	3,220.00	8,050,000
タカラバイオ	20,500	1,031.00	21,135,500
JCU	7,200	3,920.00	28,224,000
デクセリアルズ	57,100	2,517.00	143,720,700
アース製薬	5,900	5,490.00	32,391,000
北興化学工業	5,900	1,327.00	7,829,300
大成ラミック	3,100	2,519.00	7,808,900
クミアイ化学工業	25,900	805.00	20,849,500
日本農薬	11,600	699.00	8,108,400
ニチレキグループ	6,900	2,488.00	17,167,200
ユシロ化学工業	3,800	2,150.00	8,170,000
富士石油	27,100	285.00	7,723,500
出光興産	304,600	1,015.50	309,321,300
E N E O Sホールディングス	1,105,700	805.50	890,641,350
コスモエネルギーホールディングス	21,500	6,821.00	146,651,500
A N Y C O L O R	8,900	2,270.00	20,203,000
テスホールディングス	29,800	283.00	8,433,400
インフロニア・ホールディングス	66,800	1,189.50	79,458,600
横浜ゴム	33,000	3,142.00	103,686,000
T O Y O T I R E	37,500	2,406.00	90,225,000
ブリヂストン	190,800	5,327.00	1,016,391,600
住友ゴム工業	63,900	1,719.00	109,844,100
藤倉コンポジット	6,300	1,518.00	9,563,400
オカモト	3,500	5,760.00	20,160,000
アキレス	5,500	1,463.00	8,046,500
フコク	3,700	1,727.00	6,389,900
ニッタ	6,400	3,570.00	22,848,000
住友理工	12,600	1,576.00	19,857,600
三ツ星ベルト	9,100	4,100.00	37,310,000
バンドー化学	9,700	1,876.00	18,197,200
A G C	63,400	4,681.00	296,775,400
日本板硝子	33,400	343.00	11,456,200
有沢製作所	9,800	1,438.00	14,092,400
日本電気硝子	24,200	3,415.00	82,643,000
住友大阪セメント	11,700	3,350.00	39,195,000

太平洋セメント	40,200	3,685.00	148,137,000
日本ヒューム	6,300	1,284.00	8,089,200
日本コンクリート工業	18,900	374.00	7,068,600
三谷セキサン	2,700	6,090.00	16,443,000
アジアパイルホールディングス	10,000	797.00	7,970,000
東海カーボン	60,100	922.00	55,412,200
日本カーボン	3,700	4,510.00	16,687,000
東洋炭素	4,600	4,400.00	20,240,000
ノリタケ	7,200	3,755.00	27,036,000
TOTO	47,300	4,214.00	199,322,200
日本碍子	75,800	1,988.00	150,690,400
日本特殊陶業	53,300	4,670.00	248,911,000
MARUWA	2,700	46,230.00	124,821,000
品川リフラクトリーズ	8,000	1,669.00	13,352,000
黒崎播磨	4,400	2,397.00	10,546,800
ヨータイ	5,200	1,556.00	8,091,200
フジインコーポレーテッド	17,500	2,454.00	42,945,000
ニチアス	16,500	5,867.00	96,805,500
日本製鉄	339,600	3,067.00	1,041,553,200
神戸製鋼所	134,900	1,526.50	205,924,850
中山製鋼所	13,800	731.00	10,087,800
合同製鐵	3,800	3,885.00	14,763,000
JFEホールディングス	202,000	1,743.00	352,086,000
東京製鐵	18,700	1,461.00	27,320,700
共英製鋼	6,500	1,805.00	11,732,500
大和工業	12,600	7,558.00	95,230,800
東京鐵鋼	3,000	6,330.00	18,990,000
大阪製鐵	3,100	3,140.00	9,734,000
淀川製鋼所	6,200	5,220.00	32,364,000
中部鋼鈹	4,400	2,241.00	9,860,400
丸一鋼管	20,400	3,590.00	73,236,000
モリ工業	1,700	4,725.00	8,032,500
大同特殊鋼	42,200	1,151.50	48,593,300
日本冶金工業	4,500	3,880.00	17,460,000
山陽特殊製鋼	6,600	1,805.00	11,913,000
愛知製鋼	3,900	4,990.00	19,461,000
大平洋金属	6,200	1,439.00	8,921,800
新日本電工	40,000	290.00	11,600,000
栗本鐵工所	3,100	4,030.00	12,493,000
日本製鋼所	19,900	6,041.00	120,215,900
三菱製鋼	1,300	1,380.00	1,794,000
日本精線	6,300	1,262.00	7,950,600
エンビプロ・ホールディングス	19,100	406.00	7,754,600
大紀アルミニウム工業所	9,500	1,065.00	10,117,500
日本輕金属ホールディングス	19,600	1,515.00	29,694,000
三井金属鈹業	16,800	4,753.00	79,850,400
三菱マテリアル	47,900	2,432.50	116,516,750
住友金属鈹山	84,800	3,764.00	319,187,200
DOWAホールディングス	18,100	4,533.00	82,047,300
古河機械金属	8,800	1,570.00	13,816,000

大阪チタニウムテクノロジーズ	11,600	1,801.00	20,891,600
東邦チタニウム	13,900	1,015.00	14,108,500
U A C J	9,400	5,250.00	49,350,000
C Kサンエツ	2,200	3,745.00	8,239,000
古河電気工業	22,400	6,415.00	143,696,000
住友電気工業	231,600	2,924.50	677,314,200
フジクラ	72,000	5,851.00	421,272,000
S W C C	9,000	7,780.00	70,020,000
平河ヒューテック	5,400	1,499.00	8,094,600
いよぎんホールディングス	83,800	1,544.50	129,429,100
しずおかフィナンシャルグループ	141,000	1,346.00	189,786,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	53,900	1,653.00	89,096,700
楽天銀行	29,700	4,195.00	124,591,500
京都フィナンシャルグループ	80,600	2,328.00	187,636,800
リョービ	7,100	2,136.00	15,165,600
A R E ホールディングス	27,100	1,708.00	46,286,800
東洋製罐グループホールディングス	42,700	2,482.00	105,981,400
ホッカンホールディングス	4,700	1,656.00	7,783,200
コロナ	8,400	981.00	8,240,400
横河ブリッジホールディングス	11,500	2,830.00	32,545,000
三和ホールディングス	66,200	4,502.00	298,032,400
文化シャッター	17,500	1,856.00	32,480,000
三協立山	11,200	669.00	7,492,800
アルインコ	8,200	1,016.00	8,331,200
L I X I L	97,800	1,723.00	168,509,400
ノーリツ	9,400	1,699.00	15,970,600
長府製作所	7,500	1,888.00	14,160,000
リンナイ	35,600	3,256.00	115,913,600
ユニプレス	11,700	1,017.00	11,898,900
日東精工	13,500	630.00	8,505,000
岡部	12,000	781.00	9,372,000
ジーテクト	7,500	1,601.00	12,007,500
東プレ	11,800	1,953.00	23,045,400
高周波熱錬	9,900	972.00	9,622,800
東京製綱	3,300	1,235.00	4,075,500
サンコール	25,700	286.00	7,350,200
パイオラックス	9,000	2,484.00	22,356,000
エイチワン	7,900	1,008.00	7,963,200
日本発条	59,300	1,793.00	106,324,900
三浦工業	30,500	3,840.00	117,120,000
タクマ	22,200	1,619.00	35,941,800
テクノプロ・ホールディングス	38,800	2,942.00	114,149,600
アイ・アールジャパンホールディングス	9,800	764.00	7,487,200
K e e P e r 技研	4,100	4,775.00	19,577,500
イー・ガーディアン	4,400	1,860.00	8,184,000
ジャパンマテリアル	20,400	1,660.00	33,864,000
ベクトル	9,100	1,015.00	9,236,500
チャーム・ケア・コーポレーション	6,400	1,293.00	8,275,200
キャリアリンク	3,200	2,452.00	7,846,400



I B J	12,700	621.00	7,886,700
アサンテ	4,800	1,656.00	7,948,800
バリューHR	6,000	1,924.00	11,544,000
M & Aキャピタルパートナーズ	5,400	2,695.00	14,553,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	8,000	1,000.00	8,000,000
シグマクシス・ホールディングス	19,500	901.00	17,569,500
ウィルグループ	8,300	969.00	8,042,700
メドピア	16,400	503.00	8,249,200
リクルートホールディングス	521,300	11,350.00	5,916,755,000
エラン	11,700	747.00	8,739,900
ツガミ	14,000	1,410.00	19,740,000
オークマ	11,500	3,250.00	37,375,000
芝浦機械	8,400	3,560.00	29,904,000
アマダ	91,200	1,489.00	135,796,800
アイダエンジニアリング	14,700	795.00	11,686,500
F U J I	28,500	2,216.50	63,170,250
牧野フライス製作所	7,300	7,170.00	52,341,000
オーエスジー	28,900	1,744.00	50,401,600
旭ダイヤモンド工業	16,400	814.00	13,349,600
D M G 森精機	41,400	2,577.50	106,708,500
ソディック	17,300	733.00	12,680,900
ディスコ	31,600	41,940.00	1,325,304,000
日東工器	3,000	2,586.00	7,758,000
日進工具	10,400	738.00	7,675,200
日本郵政	748,300	1,534.00	1,147,892,200
ベルシステム24ホールディングス	7,200	1,260.00	9,072,000
鎌倉新書	14,900	531.00	7,911,900
ストライク	3,300	3,850.00	12,705,000
ソラスト	18,400	480.00	8,832,000
インソース	14,500	1,179.00	17,095,500
豊田自動織機	55,400	11,170.00	618,818,000
リケンNPR	8,200	2,599.00	21,311,800
島精機製作所	10,400	1,041.00	10,826,400
オプトラン	10,800	1,849.00	19,969,200
イワキ	4,400	2,561.00	11,268,400
フリー	7,200	1,108.00	7,977,600
日阪製作所	8,400	1,059.00	8,895,600
やまびこ	10,700	2,564.00	27,434,800
野村マイクロ・サイエンス	10,900	1,649.00	17,974,100
平田機工	3,100	5,460.00	16,926,000
P E G A S U S	18,400	434.00	7,985,600
タツモ	4,700	2,453.00	11,529,100
ナブテスコ	41,200	2,509.50	103,391,400
三井海洋開発	8,300	3,145.00	26,103,500
レオン自動機	6,900	1,451.00	10,011,900
S M C	19,600	63,180.00	1,238,328,000
ホソカワミクロン	4,600	4,205.00	19,343,000
ユニオンツール	2,900	4,930.00	14,297,000
オイレス工業	8,900	2,442.00	21,733,800

日精エー・エス・ビー機械	2,200	5,040.00	11,088,000	
サトーホールディングス	8,200	2,291.00	18,786,200	
技研製作所	6,200	1,738.00	10,775,600	
日本エアーテック	6,400	1,213.00	7,763,200	
日精樹脂工業	8,700	923.00	8,030,100	
ワイエイシーホールディングス	4,300	1,883.00	8,096,900	
小松製作所	323,600	4,216.00	1,364,297,600	
住友重機械工業	38,800	3,279.00	127,225,200	
日立建機	26,100	3,584.00	93,542,400	
日工	11,300	710.00	8,023,000	
巴工業	2,600	3,930.00	10,218,000	
井関農機	8,400	950.00	7,980,000	
T O W A	20,100	1,534.00	30,833,400	
北川鉄工所	6,700	1,210.00	8,107,000	
ローツェ	34,300	1,585.50	54,382,650	
クボタ	343,200	1,865.00	640,068,000	
荏原実業	3,100	4,280.00	13,268,000	
三菱化工機	2,500	3,375.00	8,437,500	
月島ホールディングス	8,900	1,430.00	12,727,000	
帝国電機製作所	4,500	2,730.00	12,285,000	
新東工業	14,600	920.00	13,432,000	
澁谷工業	6,200	3,755.00	23,281,000	
アイチコーポレーション	10,900	1,392.00	15,172,800	
小森コーポレーション	16,200	1,140.00	18,468,000	
鶴見製作所	5,000	3,360.00	16,800,000	
酒井重工業	3,400	2,332.00	7,928,800	
荏原製作所	134,800	2,456.00	331,068,800	
西島製作所	5,600	2,341.00	13,109,600	
北越工業	6,600	1,783.00	11,767,800	
ダイキン工業	85,500	18,460.00	1,578,330,000	
オルガノ	10,200	8,320.00	84,864,000	
トーヨーカネツ	2,400	4,080.00	9,792,000	
栗田工業	36,700	5,655.00	207,538,500	
椿本チエイン	29,700	1,855.00	55,093,500	
日機装	16,800	947.00	15,909,600	
レイズネクスト	9,200	1,610.00	14,812,000	
アネスト岩田	11,200	1,446.00	16,195,200	
ダイフク	110,800	3,430.00	380,044,000	
タダノ	37,800	1,161.50	43,904,700	
フジテック	21,100	6,062.00	127,908,200	
C K D	18,200	2,493.00	45,372,600	
平和	21,800	2,101.00	45,801,800	
理想科学工業	5,200	3,320.00	17,264,000	
S A N K Y O	75,800	2,046.50	155,124,700	
日本金銭機械	7,900	1,020.00	8,058,000	
マースグループホールディングス	4,400	3,165.00	13,926,000	
フクシマガリレイ	4,800	5,260.00	25,248,000	
ダイコク電機	2,900	3,015.00	8,743,500	
竹内製作所	12,000	5,010.00	60,120,000	
アマノ	18,600	4,335.00	80,631,000	

ジャノメ	6,700	1,007.00	6,746,900
ブラザー工業	87,700	2,718.00	238,368,600
マックス	8,100	3,350.00	27,135,000
モリタホールディングス	10,300	2,107.00	21,702,100
グローリー	17,200	2,570.00	44,204,000
新晃工業	19,800	1,237.00	24,492,600
大和冷機工業	10,100	1,494.00	15,089,400
セガサミーホールディングス	58,600	2,596.00	152,125,600
T P R	8,300	2,321.00	19,264,300
ツバキ・ナカシマ	16,200	507.00	8,213,400
ホシザキ	42,300	6,386.00	270,127,800
大豊工業	13,000	610.00	7,930,000
日本精工	121,500	677.60	82,328,400
NTN	155,300	245.00	38,048,500
ジェイテクト	58,400	1,105.00	64,532,000
不二越	4,800	3,115.00	14,952,000
ミネベアミツミ	114,200	2,569.50	293,436,900
日本トムソン	17,900	503.00	9,003,700
T H K	37,900	3,579.00	135,644,100
ユーシン精機	12,000	680.00	8,160,000
前澤給装工業	5,900	1,341.00	7,911,900
イーグル工業	7,300	1,932.00	14,103,600
P I L L A R	6,100	4,380.00	26,718,000
キット	22,000	1,131.00	24,882,000
日立製作所	1,690,400	3,973.00	6,715,959,200
三菱電機	667,700	2,612.00	1,744,032,400
富士電機	39,900	8,839.00	352,676,100
安川電機	71,300	4,125.00	294,112,500
シンフォニア テクノロジー	6,500	5,440.00	35,360,000
明電舎	11,100	3,940.00	43,734,000
山洋電気	2,800	8,470.00	23,716,000
デンヨー	5,000	2,816.00	14,080,000
PHCホールディングス	12,300	933.00	11,475,900
KOKUSAI ELECTRIC	46,000	2,309.00	106,214,000
ソシオネクスト	65,400	2,520.00	164,808,000
ベイカレント	49,100	5,580.00	273,978,000
Orchestra Holdings	9,400	816.00	7,670,400
アイモバイル	15,700	499.00	7,834,300
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	26,000	2,878.00	74,828,000
ミダックホールディングス	4,900	1,606.00	7,869,400
キュービーネットホールディングス	7,800	1,023.00	7,979,400
オープングループ	39,100	195.00	7,624,500
三櫻工業	10,500	728.00	7,644,000
マキタ	81,700	4,920.00	401,964,000
東芝テック	9,800	3,615.00	35,427,000
芝浦メカトロニクス	4,800	8,150.00	39,120,000
マブチモーター	28,800	2,222.00	63,993,600
ニデック	289,800	2,836.50	822,017,700

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	24,200	300.00	7,260,000	
トレックス・セミコンダクター	6,100	1,253.00	7,643,300	
東光高岳	4,000	2,069.00	8,276,000	
ダイヘン	6,200	7,320.00	45,384,000	
ヤーマン	12,800	763.00	9,766,400	
JVCケンウッド	51,800	1,601.50	82,957,700	
ミマキエンジニアリング	5,500	1,438.00	7,909,000	
I - P E X	3,600	2,944.00	10,598,400	
大崎電気工業	14,100	822.00	11,590,200	
オムロン	60,200	5,164.00	310,872,800	
日東工業	8,800	2,887.00	25,405,600	
I D E C	9,700	2,420.00	23,474,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	29,300	2,536.50	74,319,450	
メルコホールディングス	3,800	2,100.00	7,980,000	
テクノメディカ	4,400	1,814.00	7,981,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	14,800	512.00	7,577,600	
日本電気	92,800	12,765.00	1,184,592,000	
富士通	604,100	2,800.00	1,691,480,000	
沖電気工業	31,800	968.00	30,782,400	
電気興業	4,700	1,666.00	7,830,200	
サンケン電気	6,700	6,163.00	41,292,100	
アイホン	4,000	2,771.00	11,084,000	
ルネサスエレクトロニクス	500,100	2,045.00	1,022,704,500	
セイコーエプソン	84,200	2,802.50	235,970,500	
ワコム	46,100	733.00	33,791,300	
アルバック	14,400	6,385.00	91,944,000	
E I Z O	8,500	2,267.00	19,269,500	
日本信号	14,900	920.00	13,708,000	
京三製作所	15,300	536.00	8,200,800	
能美防災	8,900	3,135.00	27,901,500	
ホーチキ	4,200	2,479.00	10,411,800	
エレコム	15,700	1,453.00	22,812,100	
パナソニック ホールディングス	775,500	1,507.00	1,168,678,500	
シャープ	94,800	951.80	90,230,640	
アンリツ	46,200	1,194.50	55,185,900	
富士通ゼネラル	18,600	2,121.00	39,450,600	
ソニーグループ	2,276,000	3,338.00	7,597,288,000	
T D K	566,900	2,012.50	1,140,886,250	
帝国通信工業	2,900	2,696.00	7,818,400	
タムラ製作所	26,200	499.00	13,073,800	
アルプスアルパイン	53,300	1,603.50	85,466,550	
メイコー	6,500	8,940.00	58,110,000	
フォスター電機	6,700	1,458.00	9,768,600	
S M K	3,300	2,432.00	8,025,600	
ヨコオ	5,800	1,728.00	10,022,400	
ホシデン	16,400	2,234.00	36,637,600	
ヒロセ電機	9,500	18,490.00	175,655,000	
日本航空電子工業	17,100	2,653.00	45,366,300	
T O A	8,700	920.00	8,004,000	

マクセル	13,300	1,708.00	22,716,400
古野電気	7,800	2,637.00	20,568,600
スミダコーポレーション	8,800	972.00	8,553,600
アイコム	3,000	2,761.00	8,283,000
横河電機	71,800	3,529.00	253,382,200
新電元工業	3,300	2,350.00	7,755,000
アズビル	178,800	1,213.00	216,884,400
日本光電工業	58,200	2,106.50	122,598,300
チノー	3,800	2,144.00	8,147,200
日本電子材料	4,000	2,101.00	8,404,000
堀場製作所	12,300	9,135.00	112,360,500
アドバンテスト	204,800	8,478.00	1,736,294,400
エスベック	5,800	2,697.00	15,642,600
キーエンス	65,000	65,600.00	4,264,000,000
日置電機	3,400	7,450.00	25,330,000
シスメックス	168,300	3,092.00	520,383,600
日本マイクロニクス	10,700	3,610.00	38,627,000
メガチップス	5,000	6,140.00	30,700,000
OBARA GROUP	4,100	4,175.00	17,117,500
デンソー	689,400	2,163.00	1,491,172,200
コーセル	6,900	1,202.00	8,293,800
イリソ電子工業	6,600	2,745.00	18,117,000
オプテックスグループ	11,900	1,751.00	20,836,900
千代田インテグレ	2,300	3,685.00	8,475,500
レーザーテック	29,800	15,825.00	471,585,000
スタンレー電気	40,700	2,567.50	104,497,250
ウシオ電機	28,700	2,017.00	57,887,900
日本セラミック	6,000	2,648.00	15,888,000
古河電池	5,100	1,372.00	6,997,200
山一電機	5,300	2,324.00	12,317,200
図研	5,900	4,300.00	25,370,000
日本電子	15,000	5,473.00	82,095,000
カシオ計算機	52,000	1,255.50	65,286,000
ファナック	314,500	4,130.00	1,298,885,000
エンプラス	1,900	5,130.00	9,747,000
大真空	15,300	544.00	8,323,200
ローム	117,800	1,460.00	171,988,000
浜松ホトニクス	104,300	1,858.50	193,841,550
三井ハイテック	28,800	780.00	22,464,000
新光電気工業	23,000	5,481.00	126,063,000
京セラ	403,800	1,552.00	626,697,600
太陽誘電	28,500	2,227.00	63,469,500
村田製作所	580,600	2,529.00	1,468,337,400
双葉電子工業	17,100	473.00	8,088,300
日東電工	206,100	2,473.00	509,685,300
東海理化電機製作所	18,300	2,195.00	40,168,500
ニチコン	17,100	1,041.00	17,801,100
日本ケミコン	8,000	1,006.00	8,048,000
KOA	10,800	1,000.00	10,800,000
三井E&S	35,100	1,532.00	53,773,200

カナデビア	53,800	944.00	50,787,200
三菱重工業	1,147,900	2,256.50	2,590,236,350
川崎重工業	49,000	6,097.00	298,753,000
I H I	52,600	8,225.00	432,635,000
名村造船所	18,600	1,515.00	28,179,000
プロレド・パートナーズ	15,500	532.00	8,246,000
アンピスホールディングス	14,300	819.00	11,711,700
カーブスホールディングス	18,200	816.00	14,851,200
フォーラムエンジニアリング	8,200	954.00	7,822,800
日本車輛製造	3,600	2,285.00	8,226,000
三菱ロジスネクスト	10,400	1,875.00	19,500,000
フルサト・マルカホールディングス	5,500	2,267.00	12,468,500
ヤマエグループホールディングス	7,400	1,968.00	14,563,200
F P G	22,900	2,780.00	63,662,000
じもとホールディングス	100	302.00	30,200
全国保証	16,700	5,388.00	89,979,600
めぶきフィナンシャルグループ	321,400	674.10	216,655,740
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,400	1,038.00	10,795,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	8,200	4,375.00	35,875,000
九州フィナンシャルグループ	112,700	729.70	82,237,190
かんぽ生命保険	74,500	3,070.00	228,715,000
ゆうちょ銀行	527,600	1,514.50	799,050,200
富山第一銀行	20,400	1,118.00	22,807,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	340,600	905.30	308,345,180
ジェイリース	6,300	1,297.00	8,171,100
西日本フィナンシャルホールディングス	39,500	2,077.00	82,041,500
S B I アルヒ	5,800	826.00	4,790,800
プレミアグループ	10,800	2,536.00	27,388,800
日産自動車	812,400	366.00	297,338,400
いすゞ自動車	200,700	2,101.00	421,670,700
トヨタ自動車	3,455,000	2,679.50	9,257,672,500
日野自動車	97,800	436.30	42,670,140
三菱自動車工業	253,500	417.50	105,836,250
武蔵精密工業	15,900	3,930.00	62,487,000
日産車体	9,900	1,038.00	10,276,200
新明和工業	18,700	1,319.00	24,665,300
極東開発工業	8,800	2,312.00	20,345,600
トピー工業	5,300	1,923.00	10,191,900
ティラド	2,300	3,515.00	8,084,500
タチエス	12,000	1,732.00	20,784,000
N O K	25,200	2,320.00	58,464,000
フタバ産業	19,500	688.00	13,416,000
カヤバ	11,000	2,660.00	29,260,000
市光工業	19,300	402.00	7,758,600
大同メタル工業	16,800	478.00	8,030,400
プレス工業	25,400	545.00	13,843,000
太平洋工業	14,900	1,355.00	20,189,500

アイシン	137,600	1,713.00	235,708,800
マツダ	199,600	983.50	196,306,600
本田技研工業	1,539,900	1,314.50	2,024,198,550
スズキ	525,200	1,696.50	891,001,800
S U B A R U	196,000	2,487.00	487,452,000
ヤマハ発動機	274,400	1,354.50	371,674,800
小糸製作所	67,300	1,987.00	133,725,100
エクセディ	10,600	4,575.00	48,495,000
ミツバ	12,200	889.00	10,845,800
豊田合成	18,600	2,601.00	48,378,600
愛三工業	12,300	1,541.00	18,954,300
ヨロズ	7,000	1,178.00	8,246,000
エフ・シー・シー	11,400	3,110.00	35,454,000
シマノ	28,200	21,285.00	600,237,000
テイ・エス テック	26,400	1,687.00	44,536,800
三十三フィナンシャルグループ	5,800	2,170.00	12,586,000
第四北越フィナンシャルグループ	20,100	2,886.00	58,008,600
ひろぎんホールディングス	90,100	1,162.50	104,741,250
おきなわフィナンシャルグループ	5,100	2,645.00	13,489,500
ダイレクトマーケティングミックス	29,500	267.00	7,876,500
L I T A L I C O	8,300	916.00	7,602,800
十六フィナンシャルグループ	9,000	4,475.00	40,275,000
北國フィナンシャルホールディングス	6,300	5,340.00	33,642,000
ネットプロテクションズホールディングス	21,300	488.00	10,394,400
プロクレアホールディングス	7,400	1,763.00	13,046,200
F P パートナー	2,800	2,329.00	6,521,200
あいちフィナンシャルグループ	12,000	2,459.00	29,508,000
ジャムコ	3,900	1,475.00	5,752,500
小野建	7,500	1,492.00	11,190,000
ノジマ	22,400	2,335.00	52,304,000
佐鳥電機	4,800	1,780.00	8,544,000
カッパ・クリエイト	10,800	1,632.00	17,625,600
伯東	3,900	4,260.00	16,614,000
コンドーテック	5,800	1,330.00	7,714,000
ナガイレーベン	8,700	2,200.00	19,140,000
三菱食品	6,300	4,930.00	31,059,000
良品計画	81,900	3,295.00	269,860,500
松田産業	5,200	3,045.00	15,834,000
第一興商	26,600	1,915.00	50,939,000
メディバルホールディングス	74,600	2,376.50	177,286,900
アドヴァングループ	8,400	983.00	8,257,200
S P K	3,900	2,054.00	8,010,600
萩原電気ホールディングス	3,000	3,140.00	9,420,000
アルビス	3,000	2,604.00	7,812,000
アズワン	21,300	2,801.50	59,671,950
スズデン	4,400	1,830.00	8,052,000
シモジマ	6,300	1,282.00	8,076,600
ドウシシャ	6,400	2,087.00	13,356,800
高速	4,100	2,353.00	9,647,300

G - 7ホールディングス	7,500	1,395.00	10,462,500
イオン北海道	16,900	875.00	14,787,500
コジマ	13,300	1,089.00	14,483,700
コーナン商事	7,600	3,620.00	27,512,000
ネットワンシステムズ	27,300	4,478.00	122,249,400
エコス	4,000	2,011.00	8,044,000
ワタミ	8,300	994.00	8,250,200
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	138,900	3,988.00	553,933,200
丸文	7,600	1,047.00	7,957,200
西松屋チェーン	15,200	2,341.00	35,583,200
ゼンショーホールディングス	39,100	9,560.00	373,796,000
ハピネット	5,300	4,385.00	23,240,500
橋本総業ホールディングス	6,800	1,305.00	8,874,000
日本ライフライン	18,400	1,321.00	24,306,400
サイゼリヤ	10,200	5,810.00	59,262,000
タカショー	17,700	453.00	8,018,100
V Tホールディングス	26,800	483.00	12,944,400
アルゴグラフィックス	6,000	5,010.00	30,060,000
魚力	3,400	2,416.00	8,214,400
I D O M	23,400	1,113.00	26,044,200
フジ・コーポレーション	4,000	2,037.00	8,148,000
ユナイテッドアローズ	7,300	2,679.00	19,556,700
進和	4,200	2,870.00	12,054,000
ダイトロン	3,000	2,788.00	8,364,000
ハイデイ日高	11,100	2,815.00	31,246,500
シークス	9,800	1,159.00	11,358,200
コロワイド	38,800	1,750.00	67,900,000
オーハシテクニカ	4,100	2,014.00	8,257,400
壱番屋	27,200	1,024.00	27,852,800
白銅	3,500	2,354.00	8,239,000
スギホールディングス	36,900	2,523.00	93,098,700
薬王堂ホールディングス	3,900	2,062.00	8,041,800
島津製作所	93,500	4,412.00	412,522,000
J M S	17,900	433.00	7,750,700
長野計器	4,300	2,450.00	10,535,000
ブイ・テクノロジー	3,500	2,239.00	7,836,500
スター精密	11,100	1,885.00	20,923,500
東京計器	4,600	3,285.00	15,111,000
愛知時計電機	400	1,994.00	797,600
インターアクション	7,900	996.00	7,868,400
東京精密	13,300	7,387.00	98,247,100
マニー	26,000	1,799.50	46,787,000
ニコン	102,500	1,656.50	169,791,250
トプコン	36,900	2,156.50	79,574,850
オリンパス	372,100	2,371.50	882,435,150
理研計器	9,200	3,825.00	35,190,000
S C R E E Nホールディングス	27,200	9,685.00	263,432,000
キヤノン電子	6,200	2,545.00	15,779,000
タムロン	8,900	4,150.00	36,935,000



HOYA	127,000	20,385.00	2,588,895,000	
ノーリツ鋼機	6,200	4,650.00	28,830,000	
A & D ホロンホールディングス	8,100	2,038.00	16,507,800	
朝日インテック	79,200	2,618.50	207,385,200	
キヤノン	324,200	5,019.00	1,627,159,800	
リコー	171,200	1,771.50	303,280,800	
シチズン時計	59,800	904.00	54,059,200	
メニコン	24,200	1,524.00	36,880,800	
パラマウントベッドホールディングス	15,000	2,599.00	38,985,000	
トランザクション	4,300	2,250.00	9,675,000	
ニホンフラッシュ	9,500	821.00	7,799,500	
前田工織	11,600	1,777.00	20,613,200	
アートネイチャー	9,900	815.00	8,068,500	
フルヤ金属	6,200	3,585.00	22,227,000	
バンダイナムコホールディングス	176,500	3,299.00	582,273,500	
SHOEI	18,300	2,342.00	42,858,600	
フランスベッドホールディングス	9,300	1,254.00	11,662,200	
マーベラス	13,700	577.00	7,904,900	
パイロットコーポレーション	10,200	4,793.00	48,888,600	
エイベックス	12,200	1,516.00	18,495,200	
フジシールインターナショナル	14,600	2,523.00	36,835,800	
タカラトミー	27,300	4,350.00	118,755,000	
広済堂ホールディングス	24,500	550.00	13,475,000	
レック	8,300	1,281.00	10,632,300	
プロネクサス	6,700	1,285.00	8,609,500	
TOPPANホールディングス	85,200	4,066.00	346,423,200	
大日本印刷	134,800	2,239.00	301,817,200	
共同印刷	1,400	3,985.00	5,579,000	
NISSHA	11,100	1,587.00	17,615,700	
ZACROS	5,200	4,125.00	21,450,000	
TAKARA & COMPANY	3,800	2,951.00	11,213,800	
前澤化成工業	4,600	1,762.00	8,105,200	
未来工業	2,300	3,870.00	8,901,000	
アシックス	240,000	3,037.00	728,880,000	
ツツミ	3,800	2,100.00	7,980,000	
JSP	5,300	2,123.00	11,251,900	
ニチハ	8,200	2,889.00	23,689,800	
ローランド	4,800	4,095.00	19,656,000	
エフピコ	14,400	2,829.00	40,737,600	
ヤマハ	118,800	1,105.50	131,333,400	
クリナップ	11,600	673.00	7,806,800	
ピジョン	41,400	1,519.50	62,907,300	
天馬	5,400	3,000.00	16,200,000	
キングジム	9,400	860.00	8,084,000	
象印マホービン	19,400	1,599.00	31,020,600	
リンテック	13,000	3,060.00	39,780,000	
信越ポリマー	14,100	1,613.00	22,743,300	
イトーキ	13,000	1,615.00	20,995,000	
任天堂	410,300	9,037.00	3,707,881,100	
三菱鉛筆	9,000	2,388.00	21,492,000	

松風	6,500	2,103.00	13,669,500
タカスタンダード	15,000	1,657.00	24,855,000
コクヨ	32,500	2,861.00	92,982,500
ナカバヤシ	15,600	507.00	7,909,200
ニフコ	24,400	3,652.00	89,108,800
グロープライド	6,400	1,905.00	12,192,000
オカムラ	19,600	2,014.00	39,474,400
バルカー	5,000	3,330.00	16,650,000
伊藤忠商事	462,300	7,705.00	3,562,021,500
丸紅	565,100	2,297.50	1,298,317,250
スクロール	10,200	1,068.00	10,893,600
ヨンドシーホールディングス	6,500	1,855.00	12,057,500
三陽商会	3,400	2,821.00	9,591,400
長瀬産業	30,700	3,119.00	95,753,300
蝶理	3,700	3,960.00	14,652,000
豊田通商	206,500	2,606.50	538,242,250
オンワードホールディングス	42,200	557.00	23,505,400
三共生興	13,500	593.00	8,005,500
兼松	28,800	2,538.50	73,108,800
美津濃	6,500	8,680.00	56,420,000
三井物産	1,010,400	3,232.00	3,265,612,800
日本紙パルプ商事	32,900	692.00	22,766,800
東京エレクトロン	137,600	24,600.00	3,384,960,000
カメイ	7,300	1,918.00	14,001,400
スターゼン	4,700	2,917.00	13,709,900
セイコーグループ	10,100	4,365.00	44,086,500
山善	23,200	1,325.00	30,740,000
椿本興業	4,300	1,982.00	8,522,600
住友商事	412,100	3,357.00	1,383,419,700
B I P R O G Y	22,000	4,617.00	101,574,000
内田洋行	2,800	6,690.00	18,732,000
三菱商事	1,270,900	2,592.50	3,294,808,250
第一実業	6,500	2,726.00	17,719,000
キャノンマーケティングジャパン	13,500	4,903.00	66,190,500
西華産業	3,300	4,445.00	14,668,500
佐藤商事	5,800	1,384.00	8,027,200
東京産業	11,100	705.00	7,825,500
ユアサ商事	5,900	4,495.00	26,520,500
神鋼商事	1,600	6,100.00	9,760,000
阪和興業	11,300	4,840.00	54,692,000
正栄食品工業	4,600	4,350.00	20,010,000
カナデン	5,600	1,444.00	8,086,400
R Y O D E N	5,500	2,414.00	13,277,000
ニプロ	54,200	1,393.00	75,500,600
岩谷産業	68,300	1,847.50	126,184,250
極東貿易	5,000	1,594.00	7,970,000
三愛オブリ	16,000	1,870.00	29,920,000
稲畑産業	18,600	3,250.00	60,450,000
G S I クレオス	3,800	2,113.00	8,029,400
明和産業	12,700	634.00	8,051,800

ゴールドウイン	11,500	8,835.00	101,602,500
ユニ・チャーム	135,800	3,850.00	522,830,000
デサント	5,600	4,330.00	24,248,000
ワキタ	10,100	1,592.00	16,079,200
ヤマトインターナショナル	10,200	333.00	3,396,600
東邦ホールディングス	18,600	4,288.00	79,756,800
サンゲツ	17,300	2,801.00	48,457,300
ミツウロコグループホールディングス	8,800	1,758.00	15,470,400
シナネンホールディングス	2,000	6,230.00	12,460,000
伊藤忠エネクス	17,000	1,606.00	27,302,000
サンリオ	55,900	4,681.00	261,667,900
サンワテクノス	3,700	2,170.00	8,029,000
新光商事	9,200	990.00	9,108,000
トーヨー	2,900	2,795.00	8,105,500
三信電気	4,200	1,875.00	7,875,000
東陽テクニカ	6,300	1,412.00	8,895,600
モスフードサービス	10,100	3,735.00	37,723,500
加賀電子	14,000	2,793.00	39,102,000
都築電気	3,900	2,662.00	10,381,800
立花エレテック	4,100	2,666.00	10,930,600
木曽路	10,400	2,096.00	21,798,400
S R Sホールディングス	11,300	1,161.00	13,119,300
リテールパートナーズ	10,200	1,288.00	13,137,600
上新電機	6,800	2,289.00	15,565,200
日本瓦斯	32,900	2,042.50	67,198,250
ロイヤルホールディングス	12,100	2,435.00	29,463,500
チヨダ	6,600	1,399.00	9,233,400
ライフコーポレーション	7,200	3,460.00	24,912,000
リンガーハット	8,900	2,219.00	19,749,100
MrMaxHD	11,600	672.00	7,795,200
AOKIホールディングス	14,700	1,280.00	18,816,000
オークワ	11,000	925.00	10,175,000
コメリ	9,300	3,255.00	30,271,500
青山商事	14,700	2,240.00	32,928,000
しまむら	16,100	8,538.00	137,461,800
高島屋	95,600	1,227.00	117,301,200
松屋	11,700	905.00	10,588,500
エイチ・ツー・オーリテイリング	33,500	2,175.50	72,879,250
近鉄百貨店	3,900	2,126.00	8,291,400
丸井グループ	45,600	2,525.00	115,140,000
クレディセゾン	40,600	3,579.00	145,307,400
アクシアルリテイリング	18,800	914.00	17,183,200
イオン	254,300	3,696.00	939,892,800
イズミ	10,500	3,166.00	33,243,000
平和堂	11,300	2,284.00	25,809,200
フジ	12,700	2,050.00	26,035,000
ヤオコー	8,100	9,223.00	74,706,300
ゼビオホールディングス	9,300	1,130.00	10,509,000
ケーズホールディングス	46,200	1,413.50	65,303,700
PALTAC	10,700	4,322.00	46,245,400

三谷産業	25,200	319.00	8,038,800
あおぞら銀行	44,200	2,463.50	108,886,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,198,100	1,806.00	7,581,768,600
りそなホールディングス	790,600	1,205.50	953,068,300
三井住友トラストグループ	228,000	3,791.00	864,348,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,335,400	3,791.00	5,062,501,400
千葉銀行	198,300	1,262.00	250,254,600
群馬銀行	111,200	1,122.50	124,822,000
武蔵野銀行	9,800	3,045.00	29,841,000
千葉興業銀行	15,200	1,381.00	20,991,200
七十七銀行	20,500	4,630.00	94,915,000
秋田銀行	4,300	2,286.00	9,829,800
山形銀行	8,400	989.00	8,307,600
岩手銀行	4,100	2,789.00	11,434,900
東邦銀行	55,300	288.00	15,926,400
ふくおかフィナンシャルグループ	55,800	4,235.00	236,313,000
スルガ銀行	43,200	1,065.00	46,008,000
八十二銀行	149,900	1,033.00	154,846,700
山梨中央銀行	7,200	1,900.00	13,680,000
大垣共立銀行	12,300	1,928.00	23,714,400
福井銀行	5,800	1,901.00	11,025,800
清水銀行	5,500	1,466.00	8,063,000
滋賀銀行	9,700	3,885.00	37,684,500
南都銀行	9,700	3,250.00	31,525,000
百五銀行	60,300	631.00	38,049,300
紀陽銀行	22,900	2,112.00	48,364,800
ほくほくフィナンシャルグループ	36,100	1,905.50	68,788,550
山陰合同銀行	40,100	1,261.00	50,566,100
百十四銀行	6,300	3,335.00	21,010,500
四国銀行	9,400	1,137.00	10,687,800
阿波銀行	9,000	2,834.00	25,506,000
大分銀行	3,900	3,285.00	12,811,500
宮崎銀行	4,200	3,120.00	13,104,000
佐賀銀行	3,900	2,197.00	8,568,300
琉球銀行	14,700	1,052.00	15,464,400
セブン銀行	229,300	327.10	75,004,030
みずほフィナンシャルグループ	864,100	3,812.00	3,293,949,200
山口フィナンシャルグループ	62,800	1,619.50	101,704,600
芙蓉総合リース	5,900	11,165.00	65,873,500
みずほリース	48,100	1,001.00	48,148,100
東京センチュリー	47,800	1,515.50	72,440,900
SBIホールディングス	103,100	3,970.00	409,307,000
日本証券金融	23,500	2,050.00	48,175,000
アイフル	106,000	334.00	35,404,000
名古屋銀行	4,000	6,560.00	26,240,000
北洋銀行	87,300	463.00	40,419,900
愛媛銀行	9,400	1,073.00	10,086,200
京葉銀行	28,800	827.00	23,817,600
栃木銀行	30,100	292.00	8,789,200
北日本銀行	3,000	2,908.00	8,724,000

リコーリース	6,100	5,180.00	31,598,000	
イオンフィナンシャルサービス	36,800	1,290.00	47,472,000	
アコム	152,300	395.00	60,158,500	
ジャックス	7,700	3,730.00	28,721,000	
オリエントコーポレーション	20,900	829.00	17,326,100	
オリックス	383,900	3,377.00	1,296,430,300	
三菱HCキャピタル	320,900	1,013.50	325,232,150	
ジャフコ グループ	19,100	2,201.00	42,039,100	
トモニホールディングス	61,200	454.00	27,784,800	
大和証券グループ本社	457,700	1,042.00	476,923,400	
野村ホールディングス	1,076,400	923.00	993,517,200	
岡三証券グループ	50,600	646.00	32,687,600	
丸三証券	21,300	993.00	21,150,900	
東洋証券	19,200	613.00	11,769,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	76,000	490.00	37,240,000	
光世証券	400	426.00	170,400	
水戸証券	17,600	579.00	10,190,400	
いちよし証券	12,900	1,021.00	13,170,900	
松井証券	44,100	828.00	36,514,800	
S O M P Oホールディングス	313,000	4,112.00	1,287,056,000	
日本取引所グループ	380,800	1,886.50	718,379,200	
マネックスグループ	62,700	1,121.00	70,286,700	
極東証券	8,000	1,482.00	11,856,000	
岩井コスモホールディングス	7,300	2,306.00	16,833,800	
アイザワ証券グループ	9,300	1,801.00	16,749,300	
フィデアホールディングス	6,700	1,406.00	9,420,200	
池田泉州ホールディングス	88,800	404.00	35,875,200	
アニコム ホールディングス	21,700	656.00	14,235,200	
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	469,100	3,394.00	1,592,125,400	
スパークス・グループ	7,100	1,503.00	10,671,300	
第一生命ホールディングス	301,000	4,267.00	1,284,367,000	
東京海上ホールディングス	625,000	5,623.00	3,514,375,000	
イー・ギャランティ	10,400	1,772.00	18,428,800	
N E Cキャピタルソリューション	3,100	3,740.00	11,594,000	
T & Dホールディングス	171,900	2,739.00	470,834,100	
アドバンスクリエイト	4,600	540.00	2,484,000	
三井不動産	888,400	1,220.00	1,083,848,000	
三菱地所	370,800	2,124.00	787,579,200	
平和不動産	10,400	4,170.00	43,368,000	
東京建物	55,900	2,581.50	144,305,850	
京阪神ビルディング	10,800	1,577.00	17,031,600	
住友不動産	104,100	4,616.00	480,525,600	
テーオーシー	12,900	669.00	8,630,100	
レオパレス21	56,000	560.00	31,360,000	
スターツコーポレーション	10,500	3,640.00	38,220,000	
フジ住宅	10,600	781.00	8,278,600	
空港施設	13,700	573.00	7,850,100	
ゴールドクレスト	4,300	3,200.00	13,760,000	

リログループ	37,200	1,880.50	69,954,600
エスリード	3,000	4,410.00	13,230,000
日神グループホールディングス	15,600	523.00	8,158,800
日本エスコン	16,800	970.00	16,296,000
MIRARTHホールディングス	37,500	497.00	18,637,500
イオンモール	38,700	2,002.00	77,477,400
カチタス	17,200	2,218.00	38,149,600
東祥	12,800	646.00	8,268,800
トーセイ	10,600	2,586.00	27,411,600
サンフロンティア不動産	10,700	1,865.00	19,955,500
FJネクストホールディングス	7,100	1,183.00	8,399,300
グランディハウス	14,500	562.00	8,149,000
東武鉄道	68,500	2,520.00	172,620,000
相鉄ホールディングス	21,500	2,454.50	52,771,750
東急	182,200	1,693.50	308,555,700
京浜急行電鉄	80,400	1,279.50	102,871,800
小田急電鉄	107,500	1,492.00	160,390,000
京王電鉄	34,400	4,013.00	138,047,200
京成電鉄	37,700	4,255.00	160,413,500
富士急行	8,000	2,338.00	18,704,000
東日本旅客鉄道	358,400	2,793.00	1,001,011,200
西日本旅客鉄道	166,100	2,793.50	464,000,350
東海旅客鉄道	250,300	2,989.50	748,271,850
東京地下鉄	108,700	1,623.00	176,420,100
西武ホールディングス	70,800	3,033.00	214,736,400
鴻池運輸	11,100	3,005.00	33,355,500
西日本鉄道	18,800	2,224.00	41,811,200
ハマキョウレックス	22,200	1,288.00	28,593,600
サカイ引越センター	8,200	2,469.00	20,245,800
近鉄グループホールディングス	69,500	3,213.00	223,303,500
阪急阪神ホールディングス	86,500	4,134.00	357,591,000
南海電気鉄道	28,900	2,458.00	71,036,200
京阪ホールディングス	35,800	3,397.00	121,612,600
神戸電鉄	3,400	2,315.00	7,871,000
名古屋鉄道	71,700	1,729.50	124,005,150
山陽電気鉄道	4,900	2,027.00	9,932,300
トランコム	100	10,250.00	1,025,000
ヤマトホールディングス	78,900	1,805.00	142,414,500
山九	15,700	5,194.00	81,545,800
日新	4,400	4,290.00	18,876,000
丸全昭和運輸	4,000	5,960.00	23,840,000
センコーグループホールディングス	38,200	1,486.00	56,765,200
トナミホールディングス	1,400	5,840.00	8,176,000
ニッコンホールディングス	36,900	2,025.50	74,740,950
福山通運	6,900	3,705.00	25,564,500
セイノーホールディングス	31,900	2,444.00	77,963,600
神奈川中央交通	1,800	3,800.00	6,840,000
AZ-COM丸和ホールディングス	20,100	1,097.00	22,049,700
日本郵船	134,500	4,928.00	662,816,000
商船三井	123,400	5,168.00	637,731,200

川崎汽船	147,700	2,087.50	308,323,750
NSユニテッド海運	4,100	4,025.00	16,502,500
明海グループ	300	672.00	201,600
飯野海運	23,800	1,136.00	27,036,800
九州旅客鉄道	49,700	3,922.00	194,923,400
SGホールディングス	109,000	1,494.00	162,846,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	23,300	7,737.00	180,272,100
ID&Eホールディングス	4,000	6,480.00	25,920,000
日本航空	148,700	2,571.50	382,382,050
ANAホールディングス	176,600	2,959.50	522,647,700
TREホールディングス	15,300	1,553.00	23,760,900
人・夢・技術グループ	5,000	1,399.00	6,995,000
西本Wismettacホールディングス	4,200	1,927.00	8,093,400
シルバーライフ	11,000	774.00	8,514,000
Genky DrugStores	6,000	3,090.00	18,540,000
KPPグループホールディングス	14,200	666.00	9,457,200
ギフトホールディングス	3,400	3,370.00	11,458,000
三菱倉庫	67,700	1,172.50	79,378,250
三井倉庫ホールディングス	6,700	7,370.00	49,379,000
住友倉庫	19,300	2,766.00	53,383,800
澁澤倉庫	3,000	3,115.00	9,345,000
ヤマタネ	2,800	3,805.00	10,654,000
乾汽船	8,200	1,548.00	12,693,600
日本トランスシティ	13,100	1,053.00	13,794,300
中央倉庫	5,200	1,552.00	8,070,400
安田倉庫	4,900	1,748.00	8,565,200
大栄環境	14,600	3,020.00	44,092,000
日本管財ホールディングス	7,000	2,588.00	18,116,000
上組	30,000	3,466.00	103,980,000
キューソー流通システム	4,300	2,292.00	9,855,600
エーアイティー	4,600	1,765.00	8,119,000
内外トランスライン	2,800	2,820.00	7,896,000
日本コンセプト	4,500	1,881.00	8,464,500
TBSホールディングス	32,800	3,872.00	127,001,600
日本テレビホールディングス	57,700	2,579.50	148,837,150
朝日放送グループホールディングス	13,100	624.00	8,174,400
テレビ朝日ホールディングス	15,800	2,229.00	35,218,200
スカパーJSATホールディングス	50,600	890.00	45,034,000
テレビ東京ホールディングス	4,000	3,020.00	12,080,000
ビジョン	9,800	1,356.00	13,288,800
U-NEXT HOLDINGS	21,900	1,679.00	36,770,100
日本通信	58,400	138.00	8,059,200
日本電信電話	19,389,500	155.00	3,005,372,500
KDDI	479,400	4,948.00	2,372,071,200
ソフトバンク	10,430,700	198.10	2,066,321,670
光通信	7,500	33,940.00	254,550,000
GMOインターネットグループ	21,200	2,734.50	57,971,400
KADOKAWA	34,500	4,404.00	151,938,000

学研ホールディングス	11,900	1,014.00	12,066,600
ゼンリン	11,100	815.00	9,046,500
東京電力ホールディングス	546,800	506.50	276,954,200
中部電力	239,500	1,577.50	377,811,250
関西電力	273,800	1,794.00	491,197,200
中国電力	112,900	894.00	100,932,600
北陸電力	66,500	865.50	57,555,750
東北電力	171,100	1,201.50	205,576,650
四国電力	60,500	1,216.50	73,598,250
九州電力	149,800	1,428.50	213,989,300
北海道電力	68,000	814.60	55,392,800
沖縄電力	16,600	954.00	15,836,400
電源開発	48,900	2,459.00	120,245,100
イーレックス	10,600	629.00	6,667,400
レノバ	17,700	753.00	13,328,100
東京瓦斯	122,900	4,445.00	546,290,500
大阪瓦斯	127,700	3,163.00	403,915,100
東邦瓦斯	25,600	3,852.00	98,611,200
北海道瓦斯	19,400	537.00	10,417,800
広島ガス	21,400	375.00	8,025,000
西部ガスホールディングス	6,800	1,703.00	11,580,400
静岡ガス	14,800	1,004.00	14,859,200
メタウォーター	8,900	1,800.00	16,020,000
M & A 総研ホールディングス	7,200	1,931.00	13,903,200
アイネット	4,900	1,644.00	8,055,600
松竹	3,700	11,120.00	41,144,000
東宝	40,800	6,492.00	264,873,600
エイチ・アイ・エス	21,400	1,715.00	36,701,000
東映	10,800	5,990.00	64,692,000
NTTデータグループ	170,400	2,989.00	509,325,600
共立メンテナンス	21,000	2,762.50	58,012,500
イチネンホールディングス	6,500	1,860.00	12,090,000
建設技術研究所	3,400	5,050.00	17,170,000
スペース	7,000	1,142.00	7,994,000
アインホールディングス	9,500	4,590.00	43,605,000
燦ホールディングス	7,700	1,194.00	9,193,800
ピー・シー・エー	4,300	2,210.00	9,503,000
スバル興業	2,800	3,230.00	9,044,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,800	2,143.00	8,143,400
ナガワ	1,800	6,320.00	11,376,000
東京都競馬	4,900	4,320.00	21,168,000
カナモト	10,400	3,255.00	33,852,000
D T S	11,800	4,220.00	49,796,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,800	6,198.00	203,294,400
シーイーシー	8,200	1,967.00	16,129,400
カブコン	129,500	3,535.00	457,782,500
ニシオホールディングス	5,500	3,925.00	21,587,500
アイ・エス・ピー	5,800	1,408.00	8,166,400
日本空港ビルデング	22,600	5,085.00	114,921,000



トランス・コスモス	8,500	3,410.00	28,985,000
乃村工藝社	29,100	809.00	23,541,900
S C S K	53,200	3,115.00	165,718,000
藤田観光	3,000	8,440.00	25,320,000
トーカイ	5,900	2,256.00	13,310,400
セコム	136,100	5,337.00	726,365,700
N S W	2,900	3,075.00	8,917,500
セントラル警備保障	3,600	2,828.00	10,180,800
アイネス	5,100	1,782.00	9,088,200
丹青社	14,100	808.00	11,392,800
メイテックグループホールディングス	24,600	2,889.00	71,069,400
T K C	11,600	4,060.00	47,096,000
富士ソフト	18,000	9,530.00	171,540,000
応用地質	6,200	2,361.00	14,638,200
船井総研ホールディングス	13,400	2,490.00	33,366,000
N S D	25,100	3,512.00	88,151,200
コナミグループ	24,400	15,170.00	370,148,000
学究社	4,200	1,989.00	8,353,800
イオンディライト	7,200	4,365.00	31,428,000
ナック	14,000	575.00	8,050,000
福井コンピュータホールディングス	4,500	3,085.00	13,882,500
ダイセキ	16,100	3,870.00	62,307,000
ステップ	4,000	2,089.00	8,356,000
泉州電業	4,700	5,380.00	25,286,000
GENKI GLOBAL DINI NG CONCEPTS	3,900	3,605.00	14,059,500
トラスコ中山	14,400	2,200.00	31,680,000
ヤマダホールディングス	211,500	445.20	94,159,800
オートバックスセブン	23,900	1,435.00	34,296,500
モリト	5,500	1,487.00	8,178,500
アークランズ	20,500	1,686.00	34,563,000
ニトリホールディングス	25,000	19,850.00	496,250,000
ケーユーホールディングス	7,100	1,119.00	7,944,900
吉野家ホールディングス	26,900	3,270.00	87,963,000
加藤産業	8,500	4,565.00	38,802,500
イノテック	5,900	1,389.00	8,195,100
イエローハット	12,100	2,579.00	31,205,900
松屋フーズホールディングス	3,200	6,680.00	21,376,000
J B C Cホールディングス	4,300	4,625.00	19,887,500
J Kホールディングス	7,600	1,088.00	8,268,800
サガミホールディングス	11,000	1,782.00	19,602,000
日伝	3,900	3,065.00	11,953,500
ミロク情報サービス	5,900	1,955.00	11,534,500
杉本商事	6,100	1,368.00	8,344,800
因幡電機産業	19,200	3,840.00	73,728,000
王将フードサービス	13,600	3,060.00	41,616,000
ミニストップ	5,700	1,724.00	9,826,800
アークス	11,600	2,597.00	30,125,200
パローホールディングス	13,100	2,142.00	28,060,200
東テク	6,900	2,551.00	17,601,900

ミスミグループ本社	103,900	2,509.00	260,685,100	
ベルク	3,400	6,500.00	22,100,000	
大 庄	7,700	1,043.00	8,031,100	
ファーストリテイリング	38,700	53,800.00	2,082,060,000	
ソフトバンクグループ	321,500	9,269.00	2,979,983,500	
スズケン	22,700	4,723.00	107,212,100	
サンドラッグ	23,200	3,946.00	91,547,200	
ジェコス	8,300	997.00	8,275,100	
ペルーナ	16,500	780.00	12,870,000	
合計	122,293,974		255,212,734,142	

( 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12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,929,020,128
金銭信託	98,523,072
コール・ローン	8,977,510,931
株式	1,135,396,874,618
投資証券	21,198,349,480
派生商品評価勘定	1,115,468,126
未収配当金	1,290,996,048
差入委託証拠金	15,121,842,173
流動資産合計	1,185,128,584,576
資産合計	1,185,128,584,576
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	321,933,216
未払解約金	1,926,817,968
流動負債合計	2,248,751,184
負債合計	2,248,751,184
純資産の部	
元本等	
元本	237,581,474,108
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	945,298,359,284
元本等合計	1,182,879,833,392
純資産合計	1,182,879,833,392
負債純資産合計	1,185,128,584,576

## 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12月12日 至 2024年12月10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12月10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	221,016,811,238円
同期中追加設定元本額	49,291,603,675円
同期中一部解約元本額	32,726,940,805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）	700,915,134円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,481,293,892円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,528,795,577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）	2,357,343,596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）	655,150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）	1,364,083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）	4,373,339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）	491,288,020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	161,267,832,216円
DCニッセイ外国株式インデックス	44,912,993,382円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	3,576,745,435円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	464,347,031円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	172,694,549円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	532,103,346円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	645,714,340円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	8,269,923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)	87,191,025円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	9,377,318円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	10,408,486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)	3,420,208円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	19,446,036円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	387,108,595円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	259,200,377円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	452,660,808円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	158,208,401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)	124,691,201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)	278,661,134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)	125,493,429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)	123,072,778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)	122,609,497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)	109,521,718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)	32,695,997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)	12,241,681,843円
FWニッセイ先進国株インデックス	55,179,346円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	189,194,119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)	79,182,841円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	411,176,517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)	77,387,799円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	3,800,129円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-08(適 格機関投資家限定)	73,120,543円
ニッセイインデックスバランス(外国株式重視型)SA(適格機関投資 家限定)	81,713円
ニッセイ全世界株式インデックスコレクトSA(適格機関投資家限定)	173,237円
計	237,581,474,108円

2. 受益権の総数

237,581,474,108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12月12日 至 2024年12月10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12月10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12月10日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	29,139,480,387	
投資証券	12,503,328	
合計	29,151,983,715	

（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（2024年11月21日から2024年12月10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12月10日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	13,400,165,751	-	13,242,370,407	157,795,344
アメリカ・ドル	10,143,006,740	-	9,984,462,400	158,544,340
イギリス・ポンド	938,949,265	-	944,983,393	6,034,128
ユーロ	2,318,209,746	-	2,312,924,614	5,285,132
買建	17,481,563,873	-	17,167,724,404	313,839,469
アメリカ・ドル	12,173,473,006	-	11,973,938,240	199,534,766
イギリス・ポンド	1,576,988,023	-	1,550,722,188	26,265,835
ユーロ	3,731,102,844	-	3,643,063,976	88,038,868
合計	30,881,729,624	-	30,410,094,811	156,044,125

## （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12月10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	22,652,538,084	-	23,602,117,118	949,579,034
合計	22,652,538,084	-	23,602,117,118	949,579,034

## （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12月10日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.9788円 (49,788円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2024年12月10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	61,288	131.490	8,058,759.12	
	ABBOTT LABORATORIES	194,126	114.900	22,305,077.40	
	ABBVIE INC	197,069	176.570	34,796,473.33	
	ACCENTURE PLC	69,714	359.500	25,062,183.00	
	ADOBE INC	49,111	547.930	26,909,390.23	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	180,569	130.870	23,631,065.03	
	AECOM	14,948	112.510	1,681,799.48	
	AERCAP HOLDINGS NV	21,626	95.270	2,060,309.02	
	AES CORP	79,324	13.600	1,078,806.40	
	AFLAC INC	59,333	105.000	6,229,965.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	32,056	144.000	4,616,064.00	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,805	316.620	7,853,759.10	
	AIRBNB INC-CLASS A	49,089	137.270	6,738,447.03	
	AKAMA I TECHNOLOGIES INC	16,898	99.120	1,674,929.76	
	ALBEMARLE CORP	13,125	109.660	1,439,287.50	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	42,025	18.940	795,953.50	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	7,916	237.570	1,880,604.12	
	ALLEGION PLC	9,719	141.430	1,374,558.17	



ALLIANT ENERGY CORP	28,611	60.910	1,742,696.01	
ALLSTATE CORP	29,459	199.040	5,863,519.36	
ALLY FINANCIAL INC	30,595	38.370	1,173,930.15	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14,325	255.890	3,665,624.25	
ALPHABET INC-CL A	653,572	175.370	114,616,921.64	
ALPHABET INC-CL C	560,841	177.100	99,324,941.10	
ALTRIA GROUP INC	190,400	55.860	10,635,744.00	
AMAZON.COM INC	1,053,825	226.090	238,259,294.25	
AMCOR PLC	161,516	10.200	1,647,463.20	
AMEREN CORPORATION	29,770	91.170	2,714,130.90	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	59,369	95.580	5,674,489.02	
AMERICAN EXPRESS CO	63,445	296.720	18,825,400.40	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,964	142.000	1,130,888.00	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	71,816	74.080	5,320,129.28	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,743	130.720	2,842,244.96	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,946	553.830	6,062,223.18	
AMETEK INC	25,839	189.890	4,906,567.71	
AMGEN INC	59,952	277.630	16,644,473.76	
AMPHENOL CORP-CL A	134,338	73.670	9,896,680.46	
ANALOG DEVICES INC	55,395	219.040	12,133,720.80	
ANSYS INC	9,749	342.510	3,339,129.99	
AON PLC	21,814	367.900	8,025,370.60	
APA CORP	41,132	22.250	915,187.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	44,475	172.470	7,670,603.25	
APPLE INC	1,696,218	246.750	418,541,791.50	
APPLIED MATERIALS INC	91,962	171.860	15,804,589.32	
APPLOVIN CORP-CLASS A	23,198	342.540	7,946,242.92	
APTIV PLC	29,651	57.400	1,701,967.40	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	41,936	95.900	4,021,662.40	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	53,370	51.980	2,774,172.60	
ARES MANAGEMENT CORP - A	21,016	175.290	3,683,894.64	
ARISTA NETWORKS INC	119,168	105.920	12,622,274.56	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,450	291.850	7,135,732.50	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,177	252.900	803,463.30	
ASSURANT INC	5,772	218.630	1,261,932.36	
AT&T INC	801,308	23.370	18,726,567.96	
ATLISSIAN CORP-CL A	17,853	273.140	4,876,368.42	
ATMOS ENERGY CORP	17,307	141.050	2,441,152.35	
AUTODESK INC	23,978	308.550	7,398,411.90	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	45,500	297.560	13,538,980.00	
AUTOZONE INC	1,905	3,324.010	6,332,239.05	

AVANTOR INC	75,856	22.090	1,675,659.04	
AVERY DENNISON CORP	8,984	204.040	1,833,095.36	
AXON ENTERPRISE INC	8,010	642.590	5,147,145.90	
BAKER HUGHES COMPANY	110,822	41.430	4,591,355.46	
BALL CORP	33,863	57.670	1,952,879.21	
BANK OF AMERICA CORP	779,088	45.910	35,767,930.08	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	82,282	80.610	6,632,752.02	
BAXTER INTERNATIONAL INC	56,970	31.850	1,814,494.50	
BECTON DICKINSON & CO	32,252	223.010	7,192,518.52	
BENTLEY SYSTEMS INC- CLASS B	17,847	48.620	867,721.14	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	147,834	463.870	68,575,757.58	
BEST BUY CO INC	22,770	87.320	1,988,276.40	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,163	345.600	747,532.80	
BIO-TECHNE CORP	17,708	77.400	1,370,599.20	
BIOGEN INC	16,251	156.460	2,542,631.46	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21,261	66.810	1,420,447.41	
BLACKROCK INC	16,523	1,046.380	17,289,336.74	
BLACKSTONE INC	80,331	185.350	14,889,350.85	
BLOCK INC	61,958	95.420	5,912,032.36	
BOEING CO	81,305	157.040	12,768,137.20	
BOOKING HOLDINGS INC	3,740	5,149.600	19,259,504.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	14,411	140.800	2,029,068.80	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	164,249	88.720	14,572,171.28	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	226,216	58.710	13,281,141.36	
BROADCOM INC	495,006	178.940	88,576,373.64	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	13,041	233.570	3,045,986.37	
BROWN & BROWN INC	27,043	105.680	2,857,904.24	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	20,361	45.220	920,724.42	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	12,986	176.890	2,297,093.54	
BUNGE GLOBAL SA	15,809	85.500	1,351,669.50	
BURLINGTON STORES INC	7,104	291.340	2,069,679.36	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,088	108.140	1,415,336.32	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	30,549	309.750	9,462,552.75	
CAMPBELL SOUP CO	21,614	43.110	931,779.54	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,600	184.720	7,869,072.00	
CARDINAL HEALTH INC	26,989	121.580	3,281,322.62	
CARLISLE COS INC	5,156	430.940	2,221,926.64	
CARLYLE GROUP INC/THE	25,826	52.740	1,362,063.24	
CARMAX INC	17,280	87.200	1,506,816.00	

CARNIVAL CORP	115,829	25.390	2,940,898.31	
CARRIER GLOBAL CORP	90,634	73.200	6,634,408.80	
CARVANA CO	12,712	244.030	3,102,109.36	
CATALENT INC	20,245	62.370	1,262,680.65	
CATERPILLAR INC	54,093	399.260	21,597,171.18	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,678	201.600	2,354,284.80	
CBRE GROUP INC	34,178	137.290	4,692,297.62	
CDW CORP/DE	14,905	182.460	2,719,566.30	
CELANESE CORP-SERIES A	12,183	72.420	882,292.86	
CENCORA, INC.	19,782	240.510	4,757,768.82	
CENTENE CORP	58,686	58.490	3,432,544.14	
CENTERPOINT ENERGY INC	72,696	31.360	2,279,746.56	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,126	88.220	1,775,515.72	
CHARLES RIVER LABORATORIES	5,760	201.750	1,162,080.00	
CHARLES SCHWAB CORP	178,575	81.510	14,555,648.25	
CHARTER COMMUNICATIONS- CL A	10,351	365.960	3,788,051.96	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,806	187.890	1,842,449.34	
CHENIERE ENERGY INC	25,226	214.290	5,405,679.54	
CHEVRON CORP	193,841	157.080	30,448,544.28	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	152,789	64.580	9,867,113.62	
CHUBB LTD	42,827	277.320	11,876,783.64	
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,324	105.890	2,893,338.36	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,428	153.650	2,677,812.20	
CINTAS CORP	40,482	208.300	8,432,400.60	
CISCO SYSTEMS INC	445,271	58.950	26,248,725.45	
CITIGROUP INC	212,830	71.860	15,293,963.80	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,012	45.970	2,299,051.64	
CLOROX CO	13,804	167.400	2,310,789.60	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	33,950	113.870	3,865,886.50	
CME GROUP INC	40,190	236.720	9,513,776.80	
CMS ENERGY CORP	33,291	67.650	2,252,136.15	
CNH INDUSTRIAL NV	98,025	12.060	1,182,181.50	
COCA-COLA CO	456,824	62.600	28,597,182.40	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	23,063	78.720	1,815,519.36	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	55,289	80.640	4,458,504.96	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	21,512	310.520	6,679,906.24	
COLGATE-PALMOLIVE CO	86,621	92.940	8,050,555.74	
COMCAST CORP	431,004	39.050	16,830,706.20	
CONAGRA BRANDS INC	53,319	27.740	1,479,069.06	
CONOCOPHILLIPS	145,419	103.160	15,001,424.04	

CONSOLIDATED EDISON INC	38,610	94.780	3,659,455.80	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18,232	244.310	4,454,259.92	
CONSTELLATION ENERGY	34,881	239.850	8,366,207.85	
COOPER COS INC/THE	22,212	99.260	2,204,763.12	
COPART INC	96,715	61.770	5,974,085.55	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	29,712	31.270	929,094.24	
CORNING INC	90,701	48.510	4,399,905.51	
CORTEVA INC	77,231	59.740	4,613,779.94	
COSTAR GROUP INC	45,742	78.650	3,597,608.30	
COSTCO WHOLESALE CORP	49,428	987.860	48,827,944.08	
COTERRA ENERGY INC	82,494	24.860	2,050,800.84	
CRH PLC	76,155	100.090	7,622,353.95	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	25,962	353.600	9,180,163.20	
CROWN HOLDINGS INC	13,451	88.220	1,186,647.22	
CSX CORP	216,268	33.970	7,346,623.96	
CUMMINS INC	15,290	383.420	5,862,491.80	
CVS HEALTH CORP	140,370	56.070	7,870,545.90	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,811	320.000	1,539,520.00	
DANAHER CORP	72,518	235.910	17,107,721.38	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,121	168.640	2,212,725.44	
DATADOG INC - CLASS A	31,310	161.190	5,046,858.90	
DAVITA INC	5,140	158.060	812,428.40	
DAYFORCE, INC.	17,635	79.230	1,397,221.05	
DECKERS OUTDOOR CORP	17,008	201.550	3,427,962.40	
DEERE & CO	28,998	449.410	13,031,991.18	
DELL TECHNOLOGIES -C	35,384	123.810	4,380,893.04	
DELTA AIR LINES INC	17,968	62.260	1,118,687.68	
DEVON ENERGY CORPORATION	69,738	35.510	2,476,396.38	
DEXCOM INC	44,725	78.410	3,506,887.25	
DIAMONDBACK ENERGY INC	21,208	167.120	3,544,280.96	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,453	214.190	1,382,168.07	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	28,014	176.760	4,951,754.64	
DOCUSIGN INC	22,639	102.260	2,315,064.14	
DOLLAR GENERAL CORP	24,561	80.800	1,984,528.80	
DOLLAR TREE INC	22,810	71.600	1,633,196.00	
DOMINION ENERGY INC	93,630	55.590	5,204,891.70	
DOMINO'S PIZZA INC	3,854	457.740	1,764,129.96	
DOORDASH INC - A	34,329	175.640	6,029,545.56	
DOVER CORP	15,328	201.740	3,092,270.72	
DOW INC	78,312	42.730	3,346,271.76	
DR HORTON INC	32,732	160.960	5,268,542.72	
DRAFTKINGS INC	48,758	42.480	2,071,239.84	
DTE ENERGY COMPANY	23,085	121.800	2,811,753.00	
DUKE ENERGY CORP	86,144	111.860	9,636,067.84	

DUPONT DE NEMOURS INC	46,558	83.540	3,889,455.32	
DYNATRACE INC	33,232	57.420	1,908,181.44	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	13,021	100.080	1,303,141.68	
EATON CORP PLC	44,410	364.060	16,167,904.60	
EBAY INC	54,535	65.140	3,552,409.90	
ECOLAB INC	28,567	249.400	7,124,609.80	
EDISON INTERNATIONAL	43,054	83.020	3,574,343.08	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	67,208	70.900	4,765,047.20	
ELECTRONIC ARTS INC	27,999	165.610	4,636,914.39	
ELEVANCE HEALTH, INC	25,874	395.660	10,237,306.84	
ELI LILLY & CO	90,128	803.580	72,425,058.24	
EMCOR GROUP INC	5,203	478.590	2,490,103.77	
EMERSON ELECTRIC CO	63,898	130.430	8,334,216.14	
ENPHASE ENERGY INC	15,123	76.390	1,155,245.97	
ENTEGRIS INC	16,850	110.510	1,862,093.50	
ENERGY CORP	23,843	149.560	3,565,959.08	
EOG RESOURCES INC	63,404	127.850	8,106,201.40	
EPAM SYSTEMS INC	6,355	247.200	1,570,956.00	
EQT CORP	63,022	43.270	2,726,961.94	
EQUIFAX INC	13,802	264.860	3,655,597.72	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,297	46.760	1,650,487.72	
ERIE INDEMNITY COMPANY- CL A	2,835	409.710	1,161,527.85	
ESSENTIAL UTILITIES INC	29,064	38.830	1,128,555.12	
ESTEE LAUDER COS INC	26,074	81.680	2,129,724.32	
EVEREST GROUP LTD	4,823	368.170	1,775,683.91	
EVERGY INC	25,661	62.470	1,603,042.67	
EVERSOURCE ENERGY	39,908	60.250	2,404,457.00	
EXACT SCIENCES CORP	20,629	61.800	1,274,872.20	
EXELON CORP	111,607	37.440	4,178,566.08	
EXPAND ENERGY CORPORATION	22,771	97.130	2,211,747.23	
EXPEDIA GROUP INC	13,895	189.520	2,633,380.40	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	15,736	120.640	1,898,391.04	
EXXON MOBIL CORP	495,639	112.900	55,957,643.10	
F5 INC	6,497	257.920	1,675,706.24	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,245	477.760	2,028,091.20	
FAIR ISAAC CORP	2,734	2,227.110	6,088,918.74	
FASTENAL CO	63,905	80.320	5,132,849.60	
FEDEX CORP	25,893	279.530	7,237,870.29	
FERGUSON ENTERPRISES INC	22,397	217.740	4,876,722.78	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	28,974	61.310	1,776,395.94	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	60,862	83.780	5,099,018.36	
FIFTH THIRD BANCORP	75,462	46.530	3,511,246.86	

FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,126	2,152.410	2,423,613.66	
FIRST SOLAR INC	11,349	200.000	2,269,800.00	
FIRSTENERGY CORP	61,055	40.810	2,491,654.55	
FISERV INC	64,216	202.890	13,028,784.24	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,356	361.720	2,660,812.32	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	19,845	271.520	5,388,314.40	
FORD MOTOR CO	435,620	10.600	4,617,572.00	
FORTINET INC	72,533	97.040	7,038,602.32	
FORTIVE CORP	39,070	78.450	3,065,041.50	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	13,841	78.830	1,091,086.03	
FOX CORP - CLASS A	24,655	46.230	1,139,800.65	
FOX CORP- CLASS B	15,926	43.750	696,762.50	
FRANKLIN RESOURCES INC	32,286	22.300	719,977.80	
FREEMONT-MCMORAN INC	160,216	43.730	7,006,245.68	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,248	98.080	612,803.84	
GARMIN LTD	17,160	219.330	3,763,702.80	
GARTNER INC	8,593	514.440	4,420,582.92	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	50,930	81.900	4,171,167.00	
GE VERNOVA INC	30,658	335.250	10,278,094.50	
GEN DIGITAL INC	61,791	30.480	1,883,389.68	
GENERAL DYNAMICS CORP	26,060	269.570	7,024,994.20	
GENERAL ELECTRIC CO	120,963	171.320	20,723,381.16	
GENERAL MILLS INC	61,963	65.890	4,082,742.07	
GENERAL MOTORS CO	125,339	52.710	6,606,618.69	
GENUINE PARTS CO	15,580	125.920	1,961,833.60	
GILEAD SCIENCES INC	138,907	90.590	12,583,585.13	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,395	116.790	3,316,252.05	
GLOBAL-E ONLINE LTD	11,180	53.920	602,825.60	
GODADDY INC - CLASS A	15,716	203.390	3,196,477.24	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	35,229	594.120	20,930,253.48	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	235,727	5.330	1,256,424.91	
GRACO INC	18,872	90.390	1,705,840.08	
HALLIBURTON CO	98,483	29.080	2,863,885.64	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	32,659	116.210	3,795,302.39	
HCA HEALTHCARE INC	21,589	318.500	6,876,096.50	
HEICO CORP	4,887	255.480	1,248,530.76	
HEICO CORP-CLASS A	8,424	197.960	1,667,615.04	
HENRY SCHEIN INC	14,139	74.980	1,060,142.22	
HERSHEY CO/THE	16,494	193.650	3,194,063.10	
HESS CORP	30,922	142.450	4,404,838.90	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	144,863	23.110	3,347,783.93	
HF SINCLAIR CORP	18,092	39.300	711,015.60	

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	27,474	250.000	6,868,500.00	
HOLOGIC INC	25,896	75.790	1,962,657.84	
HOME DEPOT INC	110,817	429.180	47,560,440.06	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	72,486	225.090	16,315,873.74	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	123,300	4.700	579,510.00	
HORMEL FOODS CORP	33,745	33.180	1,119,659.10	
HOWMET AEROSPACE INC	43,240	113.750	4,918,550.00	
HP INC	107,496	36.450	3,918,229.20	
HUBBELL INC	5,987	452.220	2,707,441.14	
HUBSPOT INC	5,442	737.380	4,012,821.96	
HUMANA INC	13,437	286.240	3,846,206.88	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	162,042	17.280	2,800,085.76	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,386	193.250	847,594.50	
HYATT HOTELS CORP - CL A	5,002	158.530	792,967.06	
IDEX CORP	8,458	229.650	1,942,379.70	
IDEX LABORATORIES INC	9,183	450.680	4,138,594.44	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	33,130	274.070	9,079,939.10	
ILLUMINA INC	17,733	147.530	2,616,149.49	
INCYTE CORP	18,266	72.110	1,317,161.26	
INGERSOLL-RAND INC	45,005	102.540	4,614,812.70	
INSULET CORP	7,823	265.120	2,074,033.76	
INTEL CORP	477,092	20.810	9,928,284.52	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	64,049	156.070	9,996,127.43	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	102,765	230.000	23,635,950.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	28,537	89.130	2,543,502.81	
INTERNATIONAL PAPER CO	36,821	55.780	2,053,875.38	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	41,963	30.300	1,271,478.90	
INTUIT INC	31,271	646.580	20,219,203.18	
INTUITIVE SURGICAL INC	39,642	538.860	21,361,488.12	
IQVIA HOLDINGS INC	20,333	206.440	4,197,544.52	
JABIL CIRCUIT INC	12,644	134.270	1,697,709.88	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,140	174.800	1,422,872.00	
JACOBS SOLUTIONS INC	13,853	136.150	1,886,085.95	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,900	44.480	796,192.00	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,099	182.380	1,659,475.62	
JM SMUCKER CO	11,882	117.830	1,400,056.06	
JOHNSON & JOHNSON	268,588	149.600	40,180,764.80	

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	74,520	83.920	6,253,718.40	
JPMORGAN CHASE & CO	317,407	243.810	77,387,000.67	
JUNIPER NETWORKS INC	36,788	37.130	1,365,938.44	
KELLANOVA	30,764	80.580	2,478,963.12	
KENVUE INC	213,726	22.810	4,875,090.06	
KEURIG DR PEPPER INC	128,626	33.600	4,321,833.60	
KEYCORP	105,266	18.540	1,951,631.64	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	19,357	172.530	3,339,663.21	
KIMBERLY-CLARK CORP	37,596	132.950	4,998,388.20	
KINDER MORGAN INC	223,125	27.100	6,046,687.50	
KKR & CO INC -A	69,289	152.350	10,556,179.15	
KLA CORPORATION	14,944	652.370	9,749,017.28	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	18,066	55.990	1,011,515.34	
KRAFT HEINZ CO/THE	101,236	31.720	3,211,205.92	
KROGER CO	76,666	57.770	4,428,994.82	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,169	229.760	4,863,789.44	
LABCORP HOLDINGS INC	9,367	236.000	2,210,612.00	
LAM RESEARCH CORP	144,584	77.450	11,198,030.80	
LAMB WESTON HOLDING INC	15,912	78.010	1,241,295.12	
LAS VEGAS SANDS CORP	41,079	55.170	2,266,328.43	
LEIDOS HOLDINGS INC	14,269	160.310	2,287,463.39	
LENNAR CORP-CL A	26,633	166.010	4,421,344.33	
LENOX INTERNATIONAL INC	3,575	638.790	2,283,674.25	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	23,546	91.140	2,145,982.44	
LINDE PLC	53,268	442.580	23,575,351.44	
LIVE NATION INC	17,985	133.990	2,409,810.15	
LKQ CORP	29,441	39.410	1,160,269.81	
LOCKHEED MARTIN CORP	23,937	510.010	12,208,109.37	
LOEWS CORP	20,739	85.000	1,762,815.00	
LOWE'S COS INC	63,287	274.150	17,350,131.05	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	8,340	320.500	2,672,970.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,473	404.790	5,048,945.67	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,063	77.310	2,246,860.53	
M&T BANK CORP	18,630	206.730	3,851,379.90	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	6,829	299.700	2,046,651.30	
MARATHON PETROLEUM CORP	37,312	152.980	5,707,989.76	
MARKEL GROUP INC	1,442	1,756.390	2,532,714.38	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,214	240.970	1,015,447.58	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	26,686	286.970	7,658,081.42	
MARSH & MCLENNAN COS INC	54,864	218.170	11,969,678.88	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,817	574.700	3,917,729.90	
MARVELL TECHNOLOGY INC	96,636	107.030	10,342,951.08	
MASCO CORP	24,321	81.240	1,975,838.04	



MASTERCARD INC-CLASS A	92,046	522.820	48,123,489.72	
MATCH GROUP INC	27,342	33.390	912,949.38	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	28,148	79.970	2,250,995.56	
MCDONALD'S CORP	80,038	301.370	24,121,052.06	
MCKESSON CORP	14,467	591.900	8,563,017.30	
MEDTRONIC PLC	143,094	83.960	12,014,172.24	
MERCADOLIBRE INC	5,090	1,844.300	9,387,487.00	
MERCK & CO INC	282,835	103.790	29,355,444.65	
META PLATFORMS INC-A	243,816	613.570	149,598,183.12	
METLIFE INC	66,398	82.280	5,463,227.44	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,382	1,281.690	3,052,985.58	
MGM MIRAGE	25,377	36.600	928,798.20	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	59,873	61.870	3,704,342.51	
MICRON TECHNOLOGY INC	123,687	102.820	12,717,497.34	
MICROSOFT CORP	787,790	446.020	351,370,095.80	
MICROSTRATEGY INC-CL A	20,415	365.340	7,458,416.10	
MODERNA INC	36,501	45.650	1,666,270.65	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,538	306.540	2,004,158.52	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	20,277	61.570	1,248,454.89	
MONDAY.COM LTD	4,177	290.190	1,212,123.63	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	149,043	61.440	9,157,201.92	
MONGODB INC	8,243	350.130	2,886,121.59	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,439	609.670	3,315,995.13	
MONSTER BEVERAGE CORP	81,968	53.210	4,361,517.28	
MOODY'S CORP	18,283	490.520	8,968,177.16	
MORGAN STANLEY	135,364	128.580	17,405,103.12	
MOSAIC CO/THE	35,576	26.010	925,331.76	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,614	478.910	8,914,430.74	
MSCI INC	8,775	618.500	5,427,337.50	
NASDAQ INC	48,093	79.700	3,833,012.10	
NETAPP INC	22,841	127.600	2,914,511.60	
NETFLIX INC	47,879	913.690	43,746,563.51	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,272	129.120	1,455,440.64	
NEWMONT CORP	127,560	41.730	5,323,078.80	
NEWS CORP - CLASS A	42,307	29.380	1,242,979.66	
NEXTERA ENERGY INC	229,296	74.700	17,128,411.20	
NIKE INC	132,850	77.640	10,314,474.00	
NISOURCE INC	49,977	36.610	1,829,657.97	
NORDSON CORP	6,065	255.430	1,549,182.95	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,226	256.840	6,479,045.84	
NORTHERN TRUST CORP	22,483	108.600	2,441,653.80	
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,503	479.170	7,428,572.51	
NRG ENERGY INC	23,013	96.070	2,210,858.91	

NUCOR CORP	26,487	144.580	3,829,490.46	
NUTANIX INC - A	28,108	65.320	1,836,014.56	
NVIDIA CORP	2,736,637	138.810	379,872,581.97	
NVR INC	343	9,120.010	3,128,163.43	
NXP SEMICONDUCTORS NV	28,417	223.610	6,354,325.37	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,471	1,254.900	8,120,457.90	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	70,651	48.720	3,442,116.72	
OKTA INC	18,125	83.200	1,508,000.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	21,514	203.930	4,387,350.02	
OMNICOM GROUP	21,820	92.820	2,025,332.40	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	47,784	67.680	3,234,021.12	
ONEOK INC	65,144	105.120	6,847,937.28	
ORACLE CORP	185,482	190.450	35,325,046.90	
OTIS WORLDWIDE CORP	44,688	100.870	4,507,678.56	
OVINTIV INC	29,302	41.350	1,211,637.70	
OWENS CORNING	9,683	199.050	1,927,401.15	
PACCAR INC	58,502	114.830	6,717,784.66	
PACKAGING CORP OF AMERICA	10,013	239.630	2,399,415.19	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	227,054	72.460	16,452,332.84	
PALO ALTO NETWORKS INC	36,323	388.940	14,127,467.62	
PARKER HANNIFIN CORP	14,352	686.000	9,845,472.00	
PAYCHEX INC	36,147	140.950	5,094,919.65	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,767	234.940	1,354,898.98	
PAYPAL HOLDINGS INC	108,350	90.000	9,751,500.00	
PENTAIR PLC	18,447	108.240	1,996,703.28	
PEPSICO INC	153,085	159.470	24,412,464.95	
PFIZER INC	632,401	26.100	16,505,666.10	
PG&E CORP	226,337	20.210	4,574,270.77	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	173,471	128.710	22,327,452.41	
PHILLIPS 66	46,677	130.080	6,071,744.16	
PINTEREST INC- CLASS A	67,345	33.060	2,226,425.70	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	44,347	204.500	9,068,961.50	
POOL CORP	4,273	380.320	1,625,107.36	
PPG INDUSTRIES INC	26,032	126.860	3,302,419.52	
PPL CORPORATION	82,214	33.150	2,725,394.10	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,839	82.530	2,132,492.67	
PROCTER & GAMBLE CO	262,157	170.790	44,773,794.03	
PROGRESSIVE CORP	65,340	247.860	16,195,172.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39,810	122.560	4,879,113.60	
PTC INC	13,391	199.590	2,672,709.69	

PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	55,546	87.900	4,882,493.40	
PULTE GROUP INC	23,129	128.470	2,971,382.63	
PURE STORAGE INC - CLASS A	34,731	63.810	2,216,185.11	
QORVO INC	10,585	69.510	735,763.35	
QUALCOMM INC	124,281	160.740	19,976,927.94	
QUANTA SERVICES INC	16,433	321.980	5,291,097.34	
QUEST DIAGNOSTICS	12,421	158.200	1,965,002.20	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,820	161.530	3,524,584.60	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,096	788.000	9,531,648.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	102,038	25.730	2,625,437.74	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	6,137	308.260	1,891,791.62	
REPUBLIC SERVICES INC	24,526	212.340	5,207,850.84	
RESMED INC	16,373	244.760	4,007,455.48	
REVVITY INC	13,759	120.290	1,655,070.11	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	83,845	14.450	1,211,560.25	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	59,571	39.540	2,355,437.34	
ROBLOX CORP -CLASS A	53,426	56.930	3,041,542.18	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,663	298.720	3,782,691.36	
ROKU INC	14,217	84.120	1,195,934.04	
ROLLINS INC	32,441	48.680	1,579,227.88	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,960	548.420	6,559,103.20	
ROSS STORES INC	37,016	156.240	5,783,379.84	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,276	247.140	6,740,990.64	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	42,519	26.010	1,105,919.19	
RPM INTERNATIONAL INC	14,355	134.830	1,935,484.65	
RTX CORPORATION	148,417	116.580	17,302,453.86	
S&P GLOBAL INC	35,726	513.350	18,339,942.10	
SALESFORCE INC	106,652	351.570	37,495,643.64	
SAMSARA INC-CL A	24,371	50.130	1,221,718.23	
SCHLUMBERGER LTD	158,432	41.170	6,522,645.44	
SEA LTD-ADR	41,293	114.150	4,713,595.95	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,471	98.970	2,322,924.87	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,285	84.390	1,036,731.15	
SEMPRA	70,633	88.780	6,270,797.74	
SERVICENOW INC	22,981	1,120.480	25,749,750.88	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26,733	376.450	10,063,637.85	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17,829	89.670	1,598,726.43	
SMITH (A.O.) CORP	13,398	73.890	989,978.22	
SMURFIT WESTROCK PLC	58,008	54.340	3,152,154.72	
SNAP INC - A	117,624	12.500	1,470,300.00	
SNAP-ON INC	5,877	354.600	2,083,984.20	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	33,665	180.760	6,085,285.40	

SOLVENTUM CORP	16,371	70.630	1,156,283.73	
SOUTHERN CO	122,094	84.310	10,293,745.14	
SOUTHWEST AIRLINES CO	16,777	33.900	568,740.30	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	17,089	482.520	8,245,784.28	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	24,607	75.460	1,856,844.22	
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,189	85.800	1,474,816.20	
STARBUCKS CORP	126,444	99.310	12,557,153.64	
STATE STREET CORP	32,803	99.430	3,261,602.29	
STEEL DYNAMICS INC	16,350	138.250	2,260,387.50	
STERIS PLC	11,006	215.630	2,373,223.78	
STRYKER CORP	38,261	381.110	14,581,649.71	
SUPER MICRO COMPUTER INC	58,799	44.160	2,596,563.84	
SYNCHRONY FINANCIAL	44,076	67.930	2,994,082.68	
SYNOPSIS INC	17,137	508.490	8,713,993.13	
SYSCO CORP	54,828	81.070	4,444,905.96	
T ROWE PRICE GROUP INC	24,846	123.590	3,070,717.14	
T-MOBILE US INC	58,718	228.860	13,438,201.48	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	19,559	187.900	3,675,136.10	
TARGA RESOURCES CORP	23,196	186.930	4,336,028.28	
TARGET CORP	51,398	135.290	6,953,635.42	
TE CONNECTIVITY PLC	33,899	151.500	5,135,698.50	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,222	470.740	2,458,204.28	
TELEFLEX INC	5,256	187.040	983,082.24	
TERADYNE INC	18,200	119.560	2,175,992.00	
TESLA, INC.	320,764	389.790	125,030,599.56	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	126,268	17.600	2,222,316.80	
TEXAS INSTRUMENTS INC	101,871	193.450	19,706,944.95	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,178	1,327.040	2,890,293.12	
TEXTRON INC	20,878	82.430	1,720,973.54	
THE CIGNA GROUP	31,188	319.150	9,953,650.20	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	42,618	537.230	22,895,668.14	
TJX COS INC	125,833	125.900	15,842,374.70	
TOAST INC-CLASS A	43,724	38.300	1,674,629.20	
TORO CO	11,466	87.680	1,005,338.88	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	12,037	283.730	3,415,258.01	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	50,087	134.770	6,750,224.99	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	12,970	127.310	1,651,210.70	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	25,173	401.640	10,110,483.72	
TRANSDIGM GROUP INC	6,261	1,258.490	7,879,405.89	
TRANSUNION	21,662	98.190	2,126,991.78	
TRAVELERS COS INC/THE	25,427	251.920	6,405,569.84	

TRIMBLE INC	27,238	74.610	2,032,227.18	
TRUIST FINANCIAL CORP	149,441	46.800	6,993,838.80	
TWILIO INC - A	17,026	110.200	1,876,265.20	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,760	621.770	2,959,625.20	
TYSON FOODS INC-CL A	31,906	62.640	1,998,591.84	
U-HAUL HOLDING CO	10,807	67.360	727,959.52	
UBER TECHNOLOGIES INC	210,943	65.740	13,867,392.82	
ULTA BEAUTY INC	5,257	418.010	2,197,478.57	
UNION PACIFIC CORP	67,966	233.540	15,872,779.64	
UNITED PARCEL SERVICE INC	81,740	128.530	10,506,042.20	
UNITED RENTALS INC	7,376	835.890	6,165,524.64	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,714	367.000	1,730,038.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	103,022	560.620	57,756,193.64	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,629	192.850	1,278,402.65	
US BANCORP	174,102	51.310	8,933,173.62	
VALERO ENERGY CORP	35,725	134.550	4,806,798.75	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17,163	245.990	4,221,926.37	
VERALTO CORP	27,559	106.750	2,941,923.25	
VERISIGN INC	9,800	200.460	1,964,508.00	
VERISK ANALYTICS INC	15,886	284.910	4,526,080.26	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	470,323	42.360	19,922,882.28	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,794	473.980	13,647,780.12	
VERTIV HOLDINGS CO	39,756	126.170	5,016,014.52	
VIATRIS INC	133,191	12.800	1,704,844.80	
VISA INC-CLASS A SHARES	186,365	308.300	57,456,329.50	
VISTRA CORP	38,321	148.310	5,683,387.51	
VULCAN MATERIALS CO	14,731	281.230	4,142,799.13	
WABTEC CORP	19,525	202.690	3,957,522.25	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	82,214	8.850	727,593.90	
WALMART INC	493,197	93.830	46,276,674.51	
WALT DISNEY CO	202,343	114.610	23,190,531.23	
WARNER BROS DISCOVERY INC	260,056	10.560	2,746,191.36	
WASTE CONNECTIONS INC	28,787	186.270	5,362,154.49	
WASTE MANAGEMENT INC	44,776	217.470	9,737,436.72	
WATERS CORP	6,623	392.010	2,596,282.23	
WATSCO INC	3,883	522.370	2,028,362.71	
WEC ENERGY GROUP INC	35,266	97.110	3,424,681.26	
WELLS FARGO & CO	379,723	72.620	27,575,484.26	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,096	322.160	2,608,207.36	
WESTERN DIGITAL CORP	38,540	70.740	2,726,319.60	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,301	125.850	541,280.85	

WEYERHAEUSER CO	81,173	31.740	2,576,431.02	
WILLIAMS COS INC	135,940	54.670	7,431,839.80	
WILLIAMS-SONOMA INC	14,094	190.160	2,680,115.04	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,330	312.220	3,537,452.60	
WIX.COM LTD	5,895	214.740	1,265,892.30	
WORKDAY INC-CLASS A	23,765	279.910	6,652,061.15	
WR BERKLEY CORP	33,957	62.040	2,106,692.28	
WW GRAINGER INC	4,902	1,162.050	5,696,369.10	
WYNN RESORTS LTD	11,142	95.940	1,068,963.48	
XCEL ENERGY INC	62,213	69.110	4,299,540.43	
XYLEM INC	27,109	129.350	3,506,549.15	
YUM! BRANDS INC	31,384	139.080	4,364,886.72	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP- CL A	5,752	411.230	2,365,394.96	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	17,144	82.040	1,406,493.76	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,718	109.470	2,486,939.46	
ZOETIS INC	50,548	178.150	9,005,126.20	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	27,786	85.580	2,377,925.88	
ZSCALER INC	10,207	206.130	2,103,968.91	
アメリカ・ドル 小計	41,177,776		5,847,319,462.39 (886,102,791,328)	
イギリス・ポ ンド				
3I GROUP PLC	108,464	36.860	3,997,983.04	
ADMIRAL GROUP PLC	29,120	26.920	783,910.40	
ANGLO AMERICAN PLC	141,725	25.310	3,587,059.75	
ANTOFAGASTA PLC	43,886	18.155	796,750.33	
ASHTREAD GROUP PLC	48,768	62.720	3,058,728.96	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	37,194	22.160	824,219.04	
ASTRAZENECA PLC	172,963	107.020	18,510,500.26	
AUTO TRADER GROUP PLC-WI	99,735	8.268	824,608.98	
AVIVA PLC	298,911	4.833	1,444,636.86	
BAE SYSTEMS PLC	337,121	11.990	4,042,080.79	
BARCLAYS PLC	1,620,222	2.675	4,334,093.85	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	153,876	4.418	679,824.16	
BERKELEY GROUP HOLDINGS- UNIT	11,385	42.080	479,080.80	
BP PLC	1,804,508	3.938	7,106,152.50	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	222,387	29.830	6,633,804.21	
BT GROUP PLC	727,889	1.555	1,131,867.39	
BUNZL PLC	37,458	35.920	1,345,491.36	
CENTRICA PLC	573,884	1.314	754,083.57	
COCA-COLA HBC AG-CDI	24,175	27.620	667,713.50	
COMPASS GROUP PLC	189,276	27.000	5,110,452.00	
CRODA INTERNATIONAL PLC	14,840	34.640	514,057.60	
DCC PLC	11,035	55.800	615,753.00	

DIAGEO PLC	248,247	24.330	6,039,849.51	
ENDEAVOUR MINING PLC	20,354	15.350	312,433.90	
ENTAIN PLC	67,834	8.120	550,812.08	
EXPERIAN PLC	102,504	36.880	3,780,347.52	
GLENCORE PLC	1,156,359	3.948	4,565,305.33	
GSK PLC	462,434	13.830	6,395,462.22	
HALEON PLC	858,090	3.732	3,202,391.88	
HALMA PLC	42,318	27.880	1,179,825.84	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	39,673	10.950	434,419.35	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,534	19.580	362,895.72	
HSBC HOLDINGS PLC	2,031,015	7.501	15,234,643.51	
IMPERIAL BRANDS PLC	89,456	25.690	2,298,124.64	
INFORMA PLC	148,232	8.434	1,250,188.68	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	17,742	99.000	1,756,458.00	
INTERTEK GROUP PLC	17,999	48.080	865,391.92	
JD SPORTS FASHION PLC	288,971	1.044	301,685.72	
KINGFISHER PLC	203,428	2.591	527,081.94	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	659,874	2.360	1,557,302.64	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,840,965	0.532	3,639,393.38	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	53,337	112.050	5,976,410.85	
M&G PLC	252,787	2.014	509,113.01	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	228,178	3.907	891,491.44	
MELROSE INDUSTRIES PLC	143,840	5.646	812,120.64	
MONDI PLC/WI	49,286	12.115	597,099.89	
NATIONAL GRID PLC	545,092	9.648	5,259,047.61	
NATWEST GROUP PLC	787,159	4.152	3,268,284.16	
NEXT PLC	13,276	97.960	1,300,516.96	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
PEARSON PLC	66,809	12.480	833,776.32	
PERSIMMON PLC	35,719	13.040	465,775.76	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	78,979	5.200	410,690.80	
PRUDENTIAL PLC	300,677	6.814	2,048,813.07	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	77,132	47.380	3,654,514.16	
RELX PLC	207,778	36.770	7,639,997.06	
RENTOKIL INITIAL PLC	281,837	4.127	1,163,141.29	
RIO TINTO PLC	125,767	51.130	6,430,466.71	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	948,492	5.824	5,524,017.40	
SAGE GROUP PLC	112,063	13.030	1,460,180.89	
SAINSBURY (J) PLC	197,217	2.696	531,697.03	
SCHRODERS PLC	90,611	3.168	287,055.64	
SEVERN TRENT PLC	30,174	26.400	796,593.60	
SHELL PLC-NEW	691,993	25.365	17,552,402.44	

	SMITH & NEPHEW PLC	97,598	9.916	967,781.76	
	SMITHS GROUP PLC	38,445	17.520	673,556.40	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,250	74.350	613,387.50	
	SSE PLC	123,014	16.990	2,090,007.86	
	STANDARD CHARTERED PLC	234,205	9.892	2,316,755.86	
	TAYLOR WIMPEY PLC	395,598	1.281	506,761.03	
	TESCO PLC	763,577	3.648	2,785,528.89	
	UNILEVER PLC	276,929	46.060	12,755,349.74	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	76,129	10.945	833,231.90	
	VODAFONE GROUP PLC	2,514,355	0.708	1,780,163.34	
	WHITBREAD PLC	20,016	29.110	582,665.76	
	WISE PLC - A	74,343	9.360	695,850.48	
	WPP PLC	120,276	8.916	1,072,380.81	
イギリス・ポンド 小計		30,088,547		216,583,498.94 (41,846,097,830)	
イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	4,766	291.600	1,389,765.60	
	BANK HAPOLIM BM	140,995	44.500	6,274,277.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	168,107	43.890	7,378,216.23	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,978	874.900	2,605,452.20	
	ICL GROUP LTD	86,564	18.380	1,591,046.32	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	137,966	25.590	3,530,549.94	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,313	163.200	2,825,481.60	
	NICE LTD	7,014	682.700	4,788,457.80	
イスラエル・シュケル 小計		565,703		30,383,247.19 (1,289,768,843)	
オーストラリ ア・ドル	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	332,270	30.030	9,978,068.10	
	APA GROUP	145,457	7.280	1,058,926.96	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	63,159	69.000	4,357,971.00	
	ASX LTD	21,642	69.580	1,505,850.36	
	BHP GROUP LIMITED	566,004	40.590	22,974,102.36	
	BLUESCOPE STEEL LTD	48,860	21.530	1,051,955.80	
	BRAMBLES LTD	155,306	19.450	3,020,701.70	
	CARSALES.COM LTD	42,108	40.220	1,693,583.76	
	COCHLEAR LTD	7,302	301.570	2,202,064.14	
	COLES GROUP LTD	149,485	19.010	2,841,709.85	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	186,694	159.380	29,755,289.72	
	COMPUTERSHARE LIMITED	59,168	33.400	1,976,211.20	
	CSL LIMITED	54,022	281.280	15,195,308.16	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	170,334	4.290	730,732.86	
	FORTECUE METALS GROUP LTD	188,992	19.250	3,638,096.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	264,326	8.650	2,286,419.90	



JAMES HARDIE INDUSTRIES- CDI	47,896	55.120	2,640,027.52	
LOTTERY CORP LTD/THE	248,040	5.140	1,274,925.60	
MACQUARIE GROUP LTD	40,383	231.170	9,335,338.11	
MEDIBANK PRIVATE LTD	307,846	3.870	1,191,364.02	
MINERAL RESOURCES LTD	19,764	34.190	675,731.16	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	342,902	38.730	13,280,594.46	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	127,994	16.510	2,113,180.94	
ORICA LTD	54,257	18.500	1,003,754.50	
ORIGIN ENERGY LIMITED	192,256	10.660	2,049,448.96	
PRO MEDICUS LTD	6,401	268.370	1,717,836.37	
QANTAS AIRWAYS LTD	85,081	9.030	768,281.43	
QBE INSURANCE GROUP LTD	167,959	19.650	3,300,394.35	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	20,584	39.450	812,038.80	
REA GROUP LTD	5,887	250.780	1,476,341.86	
REECE LTD	25,215	25.170	634,661.55	
RIO TINTO LTD	41,379	119.490	4,944,376.71	
SANTOS LTD	362,523	6.540	2,370,900.42	
SEEK LTD	39,813	25.770	1,025,981.01	
SGH LTD	22,679	48.630	1,102,879.77	
SONIC HEALTHCARE LTD	50,959	28.600	1,457,427.40	
SOUTH32 LTD	504,463	3.600	1,816,066.80	
SUNCORP GROUP LTD	141,871	19.790	2,807,627.09	
TELSTRA GROUP LTD	462,387	4.010	1,854,171.87	
TRANSURBAN GROUP	346,917	12.930	4,485,636.81	
TREASURY WINE ESTATES LTD	90,607	11.490	1,041,074.43	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	26,632	35.610	948,365.52	
WESFARMERS LIMITED	126,589	74.590	9,442,273.51	
WESTPAC BANKING CORP	383,520	32.870	12,606,302.40	
WISETECH GLOBAL LTD	20,522	131.320	2,694,949.04	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	212,061	23.790	5,044,931.19	
WOOLWORTHS GROUP LTD	136,306	30.240	4,121,893.44	
XERO LTD	16,179	178.810	2,892,966.99	
オーストラリア・ドル 小計	7,133,001		207,198,735.90 (20,187,372,839)	
カナダ・ドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	56,016	119.850	6,713,517.60	
AIR CANADA	19,743	25.540	504,236.22	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	84,743	81.520	6,908,249.36	
ALTAGAS LTD	33,596	34.050	1,143,943.80	
ARC RESOURCES LTD	66,446	24.610	1,635,236.06	
BANK OF MONTREAL	81,524	142.890	11,648,964.36	
BANK OF NOVA SCOTIA	138,329	79.170	10,951,506.93	

BARRICK GOLD CORP	195,658	24.230	4,740,793.34	
BCE INC	10,084	38.130	384,502.92	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	39,795	81.380	3,238,517.10	
BROOKFIELD CORPORATION-A	152,607	83.830	12,793,044.81	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	15,179	42.180	640,250.22	
CAE INC	35,735	32.980	1,178,540.30	
CAMECO CORP	48,589	81.570	3,963,404.73	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	105,387	93.860	9,891,623.82	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	59,807	150.860	9,022,484.02	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	236,057	45.900	10,835,016.30	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	104,225	107.100	11,162,497.50	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,906	157.280	928,895.68	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	15,460	36.090	557,951.40	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	16,801	75.080	1,261,419.08	
CENOVUS ENERGY INC	153,592	21.530	3,306,835.76	
CGI INC	22,810	161.370	3,680,849.70	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,249	4,702.430	10,575,765.07	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	9,601	170.160	1,633,706.16	
DOLLARAMA INC	31,434	140.130	4,404,846.42	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	45,463	30.180	1,372,073.34	
EMERA INC	32,610	55.530	1,810,833.30	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,038	43.640	656,258.32	
ENBRIDGE INC	243,323	60.050	14,611,546.15	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,310	2,011.000	4,645,410.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	79,241	20.490	1,623,648.09	
FIRSTSERVICE CORP	4,570	272.070	1,243,359.90	
FORTIS INC	55,631	62.210	3,460,804.51	
FRANCO-NEVADA CORP	21,513	173.100	3,723,900.30	
GEORGE WESTON LTD	6,630	234.610	1,555,464.30	
GFL ENVIRONMENTAL INC- SUB VT	25,618	64.930	1,663,376.74	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,832	67.820	1,073,726.24	
GREAT-WEST LIFECO INC	31,518	47.940	1,510,972.92	
HYDRO ONE LTD	37,154	45.940	1,706,854.76	
IA FINANCIAL CORP INC	10,528	136.650	1,438,651.20	
IGM FINANCIAL INC	9,544	47.640	454,676.16	
IMPERIAL OIL LTD	20,505	102.480	2,101,352.40	
INTACT FINANCIAL CORP	19,980	272.070	5,435,958.60	

IVANHOE MINES LTD-CL A	83,062	20.020	1,662,901.24		
KEYERA CORP	25,823	44.570	1,150,931.11		
KINROSS GOLD CORP	137,026	14.070	1,927,955.82		
LOBLAW COS LTD	17,016	192.630	3,277,792.08		
LUNDIN MINING CORP	74,021	13.780	1,020,009.38		
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,624	64.940	1,988,722.56		
MANULIFE FINANCIAL CORP	196,483	45.280	8,896,750.24		
MEG ENERGY CORP	29,875	23.680	707,440.00		
METRO INC	23,800	93.350	2,221,730.00		
NATIONAL BANK OF CANADA	38,090	135.320	5,154,338.80		
NUTRIEN LTD	55,394	69.160	3,831,049.04		
ONEX CORPORATION	7,048	116.350	820,034.80		
OPEN TEXT CORP	29,779	43.280	1,288,835.12		
PAN AMERICAN SILVER CORP	40,439	33.030	1,335,700.17		
PARKLAND CORP	15,837	36.530	578,525.61		
PEMBINA PIPELINE CORP	65,043	55.670	3,620,943.81		
POWER CORP OF CANADA	63,036	47.000	2,962,692.00		
QUEBECOR INC -CL B	18,251	32.940	601,187.94		
RB GLOBAL INC	20,598	138.040	2,843,347.92		
RESTAURANT BRANDS INTERN	34,446	99.360	3,422,554.56		
ROGERS COMMUNICATIONS INC	40,731	49.030	1,997,040.93		
ROYAL BANK OF CANADA	157,986	178.630	28,221,039.18		
SAPUTO INC	28,834	26.810	773,039.54		
SHOPIFY INC - CLASS A	135,284	163.420	22,108,111.28		
STANTEC INC	12,821	121.030	1,551,725.63		
SUN LIFE FINANCIAL INC	64,689	87.450	5,657,053.05		
SUNCOR ENERGY INC	141,001	54.150	7,635,204.15		
TC ENERGY CORP	115,918	67.100	7,778,097.80		
TECK RESOURCES LTD-CL B	50,875	66.330	3,374,538.75		
TFI INTERNATIONAL INC	8,986	215.280	1,934,506.08		
THOMSON REUTERS CORP	17,630	239.740	4,226,616.20		
TMX GROUP LTD	31,257	44.000	1,375,308.00		
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,261	111.560	1,033,157.16		
TORONTO-DOMINION BANK	195,213	74.620	14,566,794.06		
TOURMALINE OIL CORP	39,476	62.350	2,461,328.60		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,149	132.400	814,127.60		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	50,638	88.170	4,464,752.46		
WSP GLOBAL INC	14,606	253.040	3,695,902.24		
カナダ・ドル 小計	4,545,427		346,777,250.80 (37,073,955,883)		
シンガポール・ ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	261,700	2.710	709,207.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	222,220	43.650	9,699,903.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	676,300	0.775	524,132.50	
	KEPPEL CORP LTD	162,500	6.860	1,114,750.00	

	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	377,600	16.540	6,245,504.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	99,100	5.620	556,942.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	166,200	6.390	1,062,018.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	95,400	12.570	1,199,178.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	173,900	4.550	791,245.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	838,100	3.070	2,572,967.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	141,100	36.800	5,192,480.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	214,500	3.070	658,515.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	287,900	2.680	771,572.00	
	シンガポール・ドル 小計	3,716,520		31,098,413.50 (3,514,431,710)	
スイス・フラン	ABB LTD	176,333	51.940	9,158,736.02	
	ADECCO GROUP AG-REG	18,899	24.360	460,379.64	
	ALCON INC	55,715	76.400	4,256,626.00	
	AVOLTA AG	10,180	36.480	371,366.40	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	3,770	66.150	249,385.50	
	BALOISE HOLDING AG	4,856	164.100	796,869.60	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,391	88.700	300,781.70	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	398	1,304.000	518,992.00	
	BKW AG	2,346	150.700	353,542.20	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	110	9,910.000	1,090,100.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	12	98,200.000	1,178,400.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	59,972	134.000	8,036,248.00	
	CLARIANT AG	24,078	11.020	265,339.56	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	783	632.000	494,856.00	
	GALDERMA GROUP AG	9,275	88.910	824,640.25	
	GEBERIT AG-REG	3,728	545.600	2,033,996.80	
	GIVAUDAN-REG	1,030	3,902.000	4,019,060.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	4,141	150.700	624,048.70	
	HOLCIM LTD	58,087	88.720	5,153,478.64	
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,986	59.240	1,361,690.64	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,394	211.100	1,138,673.40	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	16,957	74.960	1,271,096.72	
	LONZA GROUP AG	8,056	518.800	4,179,452.80	
	NESTLE SA	292,312	75.600	22,098,787.20	
	NOVARTIS AG	219,869	89.380	19,651,891.22	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,531	1,298.000	3,285,238.00	
	ROCHE HOLDING AG	78,367	257.200	20,155,992.40	

	ROCHE HOLDING AG-BR	3,582	272.400	975,736.80	
	SANDOZ GROUP AG	45,664	37.930	1,732,035.52	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,623	252.000	660,996.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,532	261.000	1,182,852.00	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	16,921	88.500	1,497,508.50	
	SIG GROUP AG	34,145	17.860	609,829.70	
	SIKA AG-BEARER	17,002	235.500	4,003,971.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,646	296.900	1,676,297.40	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,446	117.800	1,466,138.80	
	SWATCH GROUP AG	3,233	167.350	541,042.55	
	SWISS LIFE HOLDING AG- REG	3,201	689.000	2,205,489.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	8,627	96.650	833,799.55	
	SWISS RE AG	33,655	130.950	4,407,122.25	
	SWISSCOM AG	2,943	508.000	1,495,044.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	6,285	58.650	368,615.25	
	UBS GROUP AG	366,802	28.750	10,545,557.50	
	VAT GROUP AG	3,013	348.400	1,049,729.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,327	553.800	9,041,892.60	
スイス・フラン	小計	1,670,223		157,623,327.01 (27,174,261,577)	
スウェーデン・ クローナ	ADDTech AB-B SHARES	28,961	310.000	8,977,910.00	
	ALFA LAVAL AB	32,240	489.100	15,768,584.00	
	ASSA ABLOY AB	111,731	344.600	38,502,502.60	
	ATLAS COPCO AB	174,149	161.500	28,125,063.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	299,626	181.200	54,292,231.20	
	BEIJER REF AB	42,962	173.500	7,453,907.00	
	BIOVITRUM	21,821	315.400	6,882,343.40	
	BOLIDEN AB	30,453	336.000	10,232,208.00	
	EPIROC AB-A	73,483	210.900	15,497,564.70	
	EPIROC AB-B	43,538	188.200	8,193,851.60	
	EQT AB	41,526	326.900	13,574,849.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	67,988	304.000	20,668,352.00	
	EVOLUTION AB	18,926	978.200	18,513,413.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	73,791	80.060	5,907,707.46	
	GETINGE AB-B SHS	25,505	173.900	4,435,319.50	
	HENNES & MAURITZ AB	63,241	163.450	10,336,741.45	
	HEXAGON AB-B SHS	231,671	109.000	25,252,139.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	8,472	425.000	3,600,600.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	14,236	371.400	5,287,250.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,903	371.300	6,276,083.90	
	INDUTRADE AB	30,438	286.400	8,717,443.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	16,476	284.300	4,684,126.80	

	INVESTOR AB	192,737	305.100	58,804,058.70	
	LIFCO AB-B SHS	25,951	338.800	8,792,198.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	8,391	530.500	4,451,425.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	169,260	47.400	8,022,924.00	
	SAAB AB-B	35,722	230.850	8,246,423.70	
	SAGAX AB-B	24,504	234.000	5,733,936.00	
	SANDVIK AB	118,916	215.800	25,662,072.80	
	SECURITAS AB	54,718	139.850	7,652,312.30	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	176,977	156.750	27,741,144.75	
	SKANSKA AB-B SHS	37,866	232.800	8,815,204.80	
	SKF AB	38,022	223.900	8,513,125.80	
	SVENSKA CELLULOSA AB	67,677	145.600	9,853,771.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	162,837	116.700	19,003,077.90	
	SWEDBANK AB - A SHARES	94,762	220.800	20,923,449.60	
	TELE2 AB	63,215	115.000	7,269,725.00	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	309,814	91.920	28,478,102.88	
	TELIA CO AB	271,652	31.480	8,551,604.96	
	TRELLEBORG AB-B SHS	23,732	405.400	9,620,952.80	
	VOLVO AB	176,898	287.900	50,928,934.20	
	VOLVO AB-A SHS	22,669	288.800	6,546,807.20	
スウェーデン・クローナ 小計		3,544,457		654,791,445.20 (9,095,053,174)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	502	12,075.000	6,061,650.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	333	11,670.000	3,886,110.00	
	CARLSBERG AS-B	10,653	727.200	7,746,861.60	
	COLOPLAST-B	14,078	842.800	11,864,938.40	
	DANSKE BANK A/S	76,984	203.400	15,658,545.60	
	DEMANT A/S	9,842	275.200	2,708,518.40	
	DSV A/S	22,794	1,524.500	34,749,453.00	
	GENMAB A/S	7,018	1,561.500	10,958,607.00	
	NOVO-NORDISK A/S	359,309	782.300	281,087,430.70	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	39,297	414.600	16,292,536.20	
	ORSTED A/S	18,739	363.500	6,811,626.50	
	PANDORA A/S	9,139	1,257.000	11,487,723.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,043	2,572.000	2,682,596.00	
	TRYGVESTA AS	37,932	156.100	5,921,185.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	112,756	102.400	11,546,214.40	
	ZEALAND PHARMA A/S	7,129	770.000	5,489,330.00	
デンマーク・クローネ 小計		727,548		434,953,326.00 (9,325,399,309)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	168,922	8.340	1,408,809.48	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	65,342	37.000	2,417,654.00	
	INFRATIL LTD	102,452	12.420	1,272,453.84	
	MERCURY NZ LTD	78,155	6.350	496,284.25	

	MERIDIAN ENERGY LTD	145,616	5.750	837,292.00	
ニュージーランド・ドル 小計		560,487		6,432,493.57 (570,176,230)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	35,326	227.100	8,022,534.60	
	DNB BANK ASA	99,779	228.100	22,759,589.90	
	EQUINOR ASA	93,435	266.800	24,928,458.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	22,225	202.200	4,493,895.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	9,797	1,267.000	12,412,799.00	
	MOWI ASA	51,743	203.700	10,540,049.10	
	NORSK HYDRO ASA	156,474	67.560	10,571,383.44	
	ORKLA ASA	77,627	100.600	7,809,276.20	
	SALMAR ASA	7,362	583.500	4,295,727.00	
	TELENOR ASA	70,594	127.600	9,007,794.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,362	328.500	6,031,917.00	
ノルウェー・クローネ 小計		642,724		120,873,423.64 (1,647,504,764)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	51,035	14.985	764,759.47	
	ACCIONA SA	2,757	118.000	325,326.00	
	ACCOR	21,669	45.650	989,189.85	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,616	47.440	930,583.04	
	ADIDAS AG	18,071	238.600	4,311,740.60	
	ADP	3,858	114.300	440,969.40	
	ADYEN NV	2,426	1,504.800	3,650,644.80	
	AEGON LTD	150,252	6.130	921,044.76	
	AENA SME SA	8,351	201.200	1,680,221.20	
	AGEAS	17,796	47.400	843,530.40	
	AIB GROUP PLC	207,851	5.325	1,106,806.57	
	AIR LIQUIDE	64,494	161.660	10,426,100.04	
	AIRBUS SE	66,287	156.960	10,404,407.52	
	AKZO NOBEL NV	19,052	60.640	1,155,313.28	
	ALLIANZ SE	43,691	298.600	13,046,132.60	
	ALSTOM RGPT	38,586	21.480	828,827.28	
	AMADEUS IT GROUP SA	50,209	69.700	3,499,567.30	
	AMPLIFON SPA	13,899	24.640	342,471.36	
	AMUNDI SA	6,840	64.800	443,232.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	100,184	50.500	5,059,292.00	
	ARCELORMITTAL	52,205	24.620	1,285,287.10	
	ARGENX SE	6,672	585.200	3,904,454.40	
	ARKEMA	6,271	78.200	490,392.20	
	ASM INTERNATIONAL NV	5,237	522.200	2,734,761.40	
	ASML HOLDING NV	44,579	675.000	30,090,825.00	
	ASR NEDERLAND NV	17,716	45.850	812,278.60	
	AXA SA	196,431	34.070	6,692,404.17	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	642,826	9.582	6,159,558.73	

BANCO BPM SPA	143,876	7.678	1,104,679.92	
BANCO DE SABADELL SA	606,535	1.910	1,158,481.85	
BANCO SANTANDER SA	1,727,211	4.651	8,033,258.36	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	112,119	8.452	947,629.78	
BASF SE	99,605	45.135	4,495,671.67	
BAYER AG	109,581	20.230	2,216,823.63	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,337	79.200	2,561,090.40	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,264	73.600	461,030.40	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	8,603	126.050	1,084,408.15	
BECHTLE AG	9,156	32.480	297,386.88	
BEIERSDORF AG	11,051	124.650	1,377,507.15	
BIOMERIEUX	4,608	98.200	452,505.60	
BNP PARIBAS	113,541	60.060	6,819,272.46	
BOLLORE SE	79,043	5.970	471,886.71	
BOUYGUES	21,269	28.880	614,248.72	
BPER BANCA SPA	110,834	5.834	646,605.55	
BRENTAG SE	14,517	62.180	902,667.06	
BUREAU VERITAS SA	35,412	29.540	1,046,070.48	
CAIXABANK	446,017	5.374	2,396,895.35	
CAPGEMINI SA	17,327	160.050	2,773,186.35	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,503	60.100	270,630.30	
CARREFOUR SA	60,495	14.415	872,035.42	
CELLNEX TELECOM SAU	59,617	33.540	1,999,554.18	
CIE DE SAINT-GOBAIN	50,550	89.880	4,543,434.00	
COMMERZBANK AG	105,660	14.865	1,570,635.90	
CONTINENTAL AG	12,267	66.160	811,584.72	
COVESTRO AG	20,007	57.920	1,158,805.44	
CREDIT AGRICOLE SA	118,757	13.120	1,558,091.84	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	6,957	83.000	577,431.00	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	23,675	22.420	530,793.50	
D'IETEREN GROUP	2,394	199.500	477,603.00	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	55,080	36.790	2,026,393.20	
DANONE	71,973	64.300	4,627,863.90	
DASSAULT AVIATION SA	2,192	190.100	416,699.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	74,670	35.220	2,629,877.40	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	68,856	6.166	424,566.09	
DELIVERY HERO SE	20,834	35.580	741,273.72	
DEUTSCHE BANK AG	211,240	16.848	3,558,971.52	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,999	220.500	4,630,279.50	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	66,896	6.642	444,323.23	
DEUTSCHE TELEKOM AG	390,841	29.950	11,705,687.95	
DHL GROUP	113,789	35.880	4,082,749.32	
DIASORIN ITALIA SPA	2,491	103.700	258,316.70	
DR ING HC F PORSCHE AG	12,727	61.100	777,619.70	



DSM-FIRMENICH AG	20,764	103.800	2,155,303.20	
E.ON SE	250,306	12.000	3,003,672.00	
EDENRED	27,442	31.660	868,813.72	
EDP RENOVAVEIS SA	34,998	10.260	359,079.48	
EDP SA	350,597	3.220	1,128,922.34	
EIFFAGE	8,199	87.360	716,264.64	
ELIA GROUP SA/NV	3,277	82.400	270,024.80	
ELISA OYJ	16,403	42.380	695,159.14	
ENDESA SA	35,411	21.140	748,588.54	
ENEL SPA	907,046	6.923	6,279,479.45	
ENGIE	203,756	15.285	3,114,410.46	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	256,289	13.494	3,458,363.76	
ERSTE GROUP BANK AG	37,541	54.640	2,051,240.24	
ESSILORLUXOTTICA	33,158	229.900	7,623,024.20	
EURAZEO	4,638	71.100	329,761.80	
EUROFINS SCIENTIFIC	15,071	47.800	720,393.80	
EURONEXT NV	8,715	106.700	929,890.50	
EVONIK INDUSTRIES AG	28,719	17.915	514,500.88	
EXOR NV	10,992	95.200	1,046,438.40	
FERRARI NV	14,058	427.500	6,009,795.00	
FERROVIAL SE	53,018	40.700	2,157,832.60	
FINECOBANK SPA	68,163	16.595	1,131,164.98	
FORTUM OYJ	49,921	14.175	707,630.17	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	22,905	45.620	1,044,926.10	
FRESENIUS SE & CO KGAA	47,045	33.740	1,587,298.30	
GALP ENERGIA SGPS SA	51,731	16.715	864,683.66	
GEA GROUP AG	17,257	47.680	822,813.76	
GENERALI	104,952	27.660	2,902,972.32	
GETLINK SE - REGR	33,738	15.880	535,759.44	
GRIFOLS SA	33,242	8.804	292,662.56	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,277	66.500	616,920.50	
HANNOVER RUECK SE	6,721	253.800	1,705,789.80	
HEIDELBERG MATERIALS AG	15,206	122.200	1,858,173.20	
HEINEKEN HOLDING NV	14,448	59.200	855,321.60	
HEINEKEN NV	32,123	69.720	2,239,615.56	
HENKEL AG & CO KGAA	11,613	73.950	858,781.35	
HENKEL KGAA-VORZUG	18,843	83.460	1,572,636.78	
HERMES INTERNATIONAL	3,533	2,278.000	8,048,174.00	
IBERDROLA SA	673,946	13.275	8,946,633.15	
IMCD NV	6,361	146.950	934,748.95	
INDITEX SA	121,627	55.240	6,718,675.48	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	145,676	33.410	4,867,035.16	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	40,086	9.895	396,650.97	
ING GROEP NV-CVA	368,487	15.156	5,584,788.97	
INPOST SA	25,048	16.400	410,787.20	

INTESA SANPAOLO	1,631,804	3.839	6,264,495.55	
IPSEN	4,184	109.200	456,892.80	
JDE PEET'S BV	13,670	18.900	258,363.00	
JERONIMO MARTINS	31,630	18.670	590,532.10	
KBC GROEP NV	25,603	71.140	1,821,397.42	
KERING	8,315	246.500	2,049,647.50	
KERRY GROUP PLC-A	17,067	87.800	1,498,482.60	
KESKO OYJ-B SHS	30,412	19.040	579,044.48	
KINGSPAN GROUP PLC	17,233	71.250	1,227,851.25	
KNORR-BREMSE AG	8,077	72.950	589,217.15	
KONE OYJ	37,888	49.380	1,870,909.44	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	103,606	32.140	3,329,896.84	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	89,110	24.980	2,225,967.80	
L'OREAL SA	26,792	349.700	9,369,162.40	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	11,391	37.440	426,479.04	
LEG IMMOBILIEN SE	8,311	84.720	704,107.92	
LEGRAND SA	29,237	96.960	2,834,819.52	
LEONARDO SPA	45,066	25.150	1,133,409.90	
LOTUS BAKERIES	45	10,820.000	486,900.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	30,690	652.600	20,028,294.00	
MEDIOBANCA SPA	55,793	14.185	791,423.70	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	83,566	55.520	4,639,584.32	
MERCK KGAA	14,414	141.700	2,042,463.80	
METSO CORPORATION	69,323	9.172	635,830.55	
MICHELIN (C.G.D.E.)	74,513	32.380	2,412,730.94	
MONCLER SPA	26,078	51.760	1,349,797.28	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,000	318.700	1,912,200.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	14,916	503.600	7,511,697.60	
NEMETSCHKE SE	6,430	99.900	642,357.00	
NESTE OYJ	47,248	13.240	625,563.52	
NEXI SPA	57,613	5.778	332,887.91	
NN GROUP NV	30,192	42.780	1,291,613.76	
NOKIA OYJ	594,641	4.206	2,501,060.04	
NORDEA BANK ABP	351,961	10.925	3,845,173.92	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS- A	7,599	72.950	554,347.05	
OMV AG	16,482	38.400	632,908.80	
ORANGE S.A.	212,376	9.750	2,070,666.00	
ORION OYJ-CLASS B	12,057	44.310	534,245.67	
PERNOD-RICARD	22,623	111.800	2,529,251.40	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	17,072	35.480	605,714.56	
POSTE ITALIANE SPA	50,921	13.660	695,580.86	
PROSUS	152,578	41.240	6,292,316.72	

PRYSMIAN SPA	31,291	61.800	1,933,783.80	
PUBLICIS GROUPE	25,512	104.800	2,673,657.60	
PUMA AG	11,788	46.290	545,666.52	
QIAGEN NV	24,705	41.650	1,028,963.25	
RANDSTAD NV	12,139	43.590	529,139.01	
RATIONAL AG	570	875.500	499,035.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	11,638	51.150	595,283.70	
REDEIA CORPORACION SA	45,523	16.930	770,704.39	
RENAULT SA	21,425	43.760	937,558.00	
REPSOL SA	131,106	11.355	1,488,708.63	
REXEL SA	24,919	25.680	639,919.92	
RHEINMETALL AG	4,859	613.000	2,978,567.00	
ROYAL KPN NV	441,032	3.678	1,622,115.69	
RWE AG	70,513	30.940	2,181,672.22	
SAFRAN SA	40,501	210.400	8,521,410.40	
SAMPO OYJ	55,131	40.430	2,228,946.33	
SANOFI	127,401	91.820	11,697,959.82	
SAP SE	116,482	240.500	28,013,921.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,925	214.800	628,290.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,260	184.350	600,981.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	60,993	248.300	15,144,561.90	
SCOUT24 SE	8,340	87.650	731,001.00	
SEB SA	2,768	95.150	263,375.20	
SIEMENS AG	84,774	194.140	16,458,024.36	
SIEMENS ENERGY AG	71,305	51.640	3,682,190.20	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	31,459	52.360	1,647,193.24	
SNAM SPA	225,261	4.393	989,571.57	
SOCIETE GENERALE	80,285	26.745	2,147,222.32	
SODEXO	9,868	79.150	781,052.20	
SOFINA	1,721	215.800	371,391.80	
STELLANTIS NV	219,324	13.146	2,883,233.30	
STMICROELECTRONICS NV	76,222	25.310	1,929,178.82	
STORA ENSO OYJ	64,803	9.846	638,050.33	
SYENQO SA	8,253	76.340	630,034.02	
SYMRISE AG	14,807	101.900	1,508,833.30	
TALANX AG	7,184	83.950	603,096.80	
TELECOM ITALIA SPA	1,139,036	0.242	275,646.71	
TELEFONICA SA	450,563	4.321	1,946,882.72	
TELEPERFORMANCE	6,098	89.720	547,112.56	
TENARIS SA	45,289	18.455	835,808.49	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	156,642	7.790	1,220,241.18	
THALES SA	10,336	139.800	1,444,972.80	
TOTALENERGIES SE	240,643	54.960	13,225,739.28	
UCB SA	14,093	182.000	2,564,926.00	
UNICREDIT SPA	164,277	38.720	6,360,805.44	
UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SP	43,650	11.710	511,141.50	

	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	91,867	23.510	2,159,793.17	
	UPM-KYMMENE OYJ	59,566	26.800	1,596,368.80	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	78,415	28.330	2,221,496.95	
	VINCI SA	55,822	101.150	5,646,395.30	
	VIVENDI SA	80,291	8.860	711,378.26	
	VOLKSWAGEN AG	23,036	84.340	1,942,856.24	
	VONOVIA SE	82,643	30.570	2,526,396.51	
	WARTSILA OYJ	55,950	17.345	970,452.75	
	WOLTERS KLUWER NV	26,587	161.350	4,289,812.45	
	ZALANDO SE	25,026	34.700	868,402.20	
	ユーロ 小計	20,522,028		578,168,460.24 (92,454,918,477)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,219,275	58.200	70,961,805.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	412,539	25.000	10,313,475.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	214,409	32.850	7,043,335.65	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	298,909	43.150	12,897,923.35	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	70,000	54.150	3,790,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	183,143	65.350	11,968,395.05	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	243,810	36.250	8,838,112.50	
	HANG SENG BANK LTD	84,012	96.700	8,123,960.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	162,641	25.550	4,155,477.55	
	HKT TRUST AND HKT LTD	437,000	9.700	4,238,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,249,437	5.950	7,434,150.15	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	134,311	311.600	41,851,307.60	
	MTR CORP	173,255	27.800	4,816,489.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	154,587	51.650	7,984,418.55	
	SANDS CHINA LTD	269,780	20.600	5,557,468.00	
	SINO LAND CO	436,000	8.000	3,488,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	150,000	21.200	3,180,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	161,523	77.900	12,582,641.70	
	SWIRE PACIFIC LTD	45,366	69.100	3,134,790.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	153,500	113.500	17,422,250.00	
	WH GROUP LTD	927,500	6.250	5,796,875.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	119,000	22.700	2,701,300.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	186,733	21.600	4,033,432.80	
	香港・ドル 小計	7,486,730		262,315,007.90 (5,115,142,654)	
	合計	122,381,171		1,135,396,874,618 (1,135,396,874,618)	

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

2024年12月10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	17,599.00	1,878,693.25	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	36,757.00	1,385,371.33	
		AMERICAN TOWER REIT INC	52,118.00	10,894,746.72	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	60,292.00	1,199,207.88	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,855.00	3,598,926.45	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,726.00	1,388,425.26	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,893.00	1,460,103.61	
		CROWN CASTLE INC	48,513.00	4,948,326.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	36,524.00	6,872,721.08	
		EQUINIX INC	10,592.00	10,263,436.16	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,781.00	1,386,845.91	
		EQUITY RESIDENTIAL	38,063.00	2,803,720.58	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,160.00	2,155,160.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	23,653.00	3,891,155.03	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30,674.00	1,536,460.66	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	78,012.00	1,692,860.40	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	78,399.00	1,484,877.06	
		INVITATION HOMES INC	64,960.00	2,187,852.80	
		IRON MOUNTAIN INC	32,700.00	3,738,918.00	
		KIMCO REALTY CORP	75,205.00	1,883,133.20	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,043.00	2,075,793.45	
		PROLOGIS INC	103,316.00	11,924,732.72	
		PUBLIC STORAGE	17,573.00	5,896,971.61	
		REALTY INCOME CORP	97,276.00	5,494,148.48	
		REGENCY CENTERS CORP	19,224.00	1,440,262.08	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	11,991.00	2,677,110.66	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	36,366.00	6,622,612.26	
		SUN COMMUNITIES INC	13,924.00	1,734,094.96	
		UDR INC	34,983.00	1,570,386.87	
	VENTAS INC	46,218.00	2,822,071.08		
	VICI PROPERTIES INC	116,964.00	3,714,776.64		
	WELLTOWER INC	68,995.00	8,931,402.75		
	WP CAREY INC	24,490.00	1,383,929.90		
アメリカ・ドル	小計		1,359,839.00	122,939,234.84 (18,630,211,647)	
イギリス・ボン ド	LAND SECURITIES GROUP PLC		79,118.00	463,235.89	
	SEGRO PLC		143,377.00	1,060,989.80	
イギリス・ボン ド	小計		222,495.00	1,524,225.69	

				(294,495,646)	
オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	191,799.00	7,250,002.20		
	GPT GROUP	213,545.00	980,171.55		
	MIRVAC GROUP	440,599.00	925,257.90		
	SCENTRE GROUP	578,996.00	2,090,175.56		
	STOCKLAND	265,529.00	1,330,300.29		
	VICINITY CENTRES	430,961.00	900,708.49		
オーストラリア・ドル 小計		2,121,429.00	13,476,615.99	(1,313,026,696)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,366.00	413,977.20		
カナダ・ドル 小計		9,366.00	413,977.20	(44,258,302)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	417,500.00	1,077,150.00		
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	650,390.00	1,261,756.60		
シンガポール・ドル 小計		1,067,890.00	2,338,906.60	(264,319,835)	
ユーロ	COVIVIO	6,238.00	311,151.44		
	GECINA SA	5,142.00	472,549.80		
	KLEPIERRE	23,910.00	671,392.80		
	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	13,175.00	1,009,205.00		
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	20,208.00	402,139.20		
ユーロ 小計		68,673.00	2,866,438.24	(458,372,139)	
香港・ドル	LINK REIT	287,871.00	9,931,549.50		
香港・ドル 小計		287,871.00	9,931,549.50	(193,665,215)	
投資証券 合計		5,137,563	21,198,349,480	(21,198,349,480)	
合計			21,198,349,480	(21,198,349,480)	

(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 571銘柄	74.91	-	78.22
	投資証券 33銘柄	-	1.57	
イギリス・ポンド	株式 77銘柄	3.54	-	3.64
	投資証券 2銘柄	-	0.02	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.11	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式 48銘柄	1.71	-	1.86

	投資証券	6銘柄	-	0.11	
カナダ・ドル	株式	82銘柄	3.13	-	3.21
	投資証券	1銘柄	-	0.00	
シンガポール・ドル	株式	13銘柄	0.30	-	0.33
	投資証券	2銘柄	-	0.02	
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.30	-	2.35
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	0.77	-	0.79
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.79	-	0.81
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.05	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.14	-	0.14
	投資証券	5銘柄	-	0.04	
ユーロ	株式	215銘柄	7.82	-	8.03
	投資証券	5銘柄	-	0.04	
香港・ドル	株式	23銘柄	0.43	-	0.46
	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12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	161,250,899
金銭信託	5,043,899
コール・ローン	459,604,578
株式	13,363,978,300
投資信託受益証券	1,003,016,419
投資証券	7,140,792
派生商品評価勘定	25,908,439
未収入金	191,290
未収配当金	9,933,902
差入委託証拠金	493,283,535
流動資産合計	15,529,352,053
資産合計	15,529,352,053
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,602,089
未払解約金	42,165,596
流動負債合計	71,767,685
負債合計	71,767,685
純資産の部	
元本等	
元本	10,047,952,974
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	5,409,631,394
元本等合計	15,457,584,368
純資産合計	15,457,584,368
負債純資産合計	15,529,352,053



## 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12月12日 至 2024年12月10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12月10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	7,242,099,133円
同期中追加設定元本額	4,520,498,007円
同期中一部解約元本額	1,714,644,166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	2,995,806,479円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	29,323,891円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	32,804,613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）	10,868,833円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	61,613,545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）	672,788,705円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	4,070,686,766円
FWニッセイ新興国株インデックス	42,352,835円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	154,344,271円
ニッセイ全世界株式インデックスコレクトSA（適格機関投資家限定）	65,577円
DCニッセイ新興国株式インデックス	1,977,297,459円
計	10,047,952,974円
2. 受益権の総数	10,047,952,974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12月12日 至 2024年12月10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12月10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12月10日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	308,070,113
投資信託受益証券	8,511,476
投資証券	12,971
合計	316,594,560

(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(2024年11月21日から2024年12月10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12月10日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	684,106,302	-	673,097,920	11,008,382
アメリカ・ドル	684,106,302	-	673,097,920	11,008,382
買建	1,090,893,530	-	1,074,958,720	15,934,810
アメリカ・ドル	1,090,893,530	-	1,074,958,720	15,934,810
合計	1,774,999,832	-	1,748,056,640	4,926,428

## （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12月10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	1,073,666,203	-	1,074,898,981	1,232,778
合計	1,073,666,203	-	1,074,898,981	1,232,778

## （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12月10日現在	
1口当たり純資産額	1.5384円
（1万口当たり純資産額）	（15,384円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2024年12月10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	29.000	15,486.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,233	12.970	28,962.01	
	CREDICORP LTD	695	190.880	132,661.60	
	H WORLD GROUP LIMITED (ADR)	2,293	36.600	83,923.80	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	9,900	2.181	21,591.90	
	INTER & CO INC - CL A	3,300	4.300	14,190.00	
	KANZHUN LTD	3,300	15.340	50,622.00	
	KE HOLDINGS INC	8,099	21.020	170,240.98	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	567	41.630	23,604.21	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,892	0.000	0.18	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	2,982	0.000	0.29	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	468	0.000	0.04	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	729	0.000	0.07	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	34,000	11.930	405,620.00	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	300	0.000	0.03	
	PDD HOLDINGS INC(ADR)	8,341	110.330	920,262.53	
	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)	1,800	38.940	70,092.00	
	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	5,184	1.650	8,553.60	
SOUTHERN COPPER CORP	1,137	105.540	119,998.98		
STONECO LTD-A	3,000	9.180	27,540.00		
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	5,163	0.000	0.51		
TAL EDUCATION GROUP- ADR	4,524	10.740	48,587.76		
TATNEFT-SPONSORED ADR	1,225	0.000	0.12		

	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	568	0.000	0.05	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	8,573	13.160	112,820.68	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	4,325	14.620	63,231.50	
	VK COMPANY LTD-GDR	380	0.000	0.03	
	VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	6,620	0.000	0.66	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	422	0.000	0.04	
	XP INC - CLASS A	4,500	13.430	60,435.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	4,626	51.000	235,926.00	
アメリカ・ドル	小計	221,943		2,614,361.56 (396,180,351)	
インド・ル ピー	ABB INDIA LTD	517	7,569.750	3,913,560.75	
	ADANI ENTERPRISES LTD	1,562	2,495.850	3,898,517.70	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	2,770	1,216.950	3,370,951.50	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	6,816	1,266.850	8,634,849.60	
	ADANI POWER LTD	9,132	535.900	4,893,838.80	
	ALKEM LABORATORIES LTD	517	5,484.600	2,835,538.20	
	AMBUJA CEMENTS LTD	8,774	571.300	5,012,586.20	
	APL APOLLO TUBES LTD	1,926	1,616.600	3,113,571.60	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,192	7,193.850	8,575,069.20	
	ASHOK LEYLAND LTD	19,677	228.660	4,499,342.82	
	ASIAN PAINTS LTD	4,520	2,391.850	10,811,162.00	
	ASTRAL LTD	1,023	1,850.550	1,893,112.65	
	AU SMALL FINANCE BANK LTD	4,770	581.200	2,772,324.00	
	AUROBINDO PHARMA LTD	2,097	1,239.500	2,599,231.50	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	1,837	3,829.050	7,033,964.85	
	AXIS BANK LTD	27,876	1,163.250	32,426,757.00	
	BAJAJ AUTO LTD	811	9,077.450	7,361,811.95	
	BAJAJ FINANCE LTD	3,284	6,868.350	22,555,661.40	
	BAJAJ FINSERV LTD	4,831	1,637.050	7,908,588.55	
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	215	11,122.000	2,391,230.00	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,012	2,857.800	2,892,093.60	
	BANK OF BARODA	9,496	262.930	2,496,783.28	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	40,951	314.600	12,883,184.60	
	BHARAT FORGE LTD	3,156	1,363.450	4,303,048.20	
	BHARAT HEAVY ELECTROCALCS	12,085	249.550	3,015,811.75	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,172	303.450	4,907,393.40	
	BHARTI AIRTEL LTD	30,801	1,602.550	49,360,142.55	
	BOSCH LTD	100	35,895.150	3,589,515.00	

BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,379	4,793.000	6,609,547.00	
BSE LTD	797	5,467.100	4,357,278.70	
CADILA HEALTHCARE LTD	3,563	982.450	3,500,469.35	
CANARA BANK	25,567	108.990	2,786,547.33	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LIMITED	7,587	793.500	6,020,284.50	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	5,390	1,282.250	6,911,327.50	
CIPLA LIMITED	6,070	1,469.000	8,916,830.00	
COAL INDIA LTD	23,487	414.000	9,723,618.00	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,470	2,804.250	4,122,247.50	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,009	858.100	3,440,122.90	
CUMMINS INDIA LTD	1,728	3,509.150	6,063,811.20	
DABUR INDIA LTD	7,985	506.850	4,047,197.25	
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,272	5,959.650	7,580,674.80	
DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	417	17,345.900	7,233,240.30	
DLF LTD	7,713	862.700	6,654,005.10	
DR. REDDY'S LABORATORIES	5,925	1,255.150	7,436,763.75	
EICHER MOTORS LTD	1,576	4,842.100	7,631,149.60	
GAIL INDIA LTD	26,237	208.670	5,474,874.79	
GMR INFRASTRUCTURE LTD	26,931	86.200	2,321,452.20	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	4,616	1,127.850	5,206,155.60	
GODREJ PROPERTIES LTD	1,395	2,842.950	3,965,915.25	
GRASIM INDUSTRIES LTD	2,865	2,681.400	7,682,211.00	
HAVELLS INDIA LTD	2,949	1,704.700	5,027,160.30	
HCL TECHNOLOGIES LTD	11,047	1,909.900	21,098,665.30	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,289	4,469.150	5,760,734.35	
HDFC BANK LTD	68,075	1,870.000	127,300,250.00	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	12,103	641.800	7,767,705.40	
HERO MOTOCORP LTD	1,289	4,595.950	5,924,179.55	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	14,614	670.900	9,804,532.60	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	2,125	4,618.950	9,815,268.75	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	9,526	399.700	3,807,542.20	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	10,417	2,400.750	25,008,612.75	
ICICI BANK LTD	62,942	1,322.300	83,228,206.60	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	2,980	1,962.200	5,847,356.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,346	676.200	1,586,365.20	
IDFC BANK LTD	56,848	65.220	3,707,626.56	
INDIAN HOTELS CO LTD	10,329	837.200	8,647,438.80	

INDIAN OIL CORPORATION LTD	37,833	142.330	5,384,770.89	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,327	833.700	3,607,419.90	
INDUS TOWERS LTD	14,838	362.150	5,373,581.70	
INDUSIND BANK LTD	3,140	982.600	3,085,364.00	
INFO EDGE INDIA LTD	914	8,418.850	7,694,828.90	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	40,031	1,923.650	77,005,633.15	
INTERGLOBE AVIATION LTD	2,280	4,489.450	10,235,946.00	
ITC LTD	34,818	464.950	16,188,629.10	
JINDAL STAINLESS LTD	4,346	747.050	3,246,679.30	
JINDAL STEEL & POWER LTD	5,534	967.200	5,352,484.80	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	31,385	336.850	10,572,037.25	
JSW ENERGY LTD	4,815	675.200	3,251,088.00	
JSW STEEL LTD	7,756	1,011.900	7,848,296.40	
JUBILANT FOODWORKS LTD	2,065	694.700	1,434,555.50	
KALYAN JEWELLERS INDIA LTD	4,819	775.450	3,736,893.55	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,637	1,786.250	24,359,091.25	
LARSEN & TOUBRO LTD	8,250	3,947.300	32,565,225.00	
LTIMINDTREE LIMITED	943	6,389.050	6,024,874.15	
LUPIN LTD	2,422	2,104.700	5,097,583.40	
MACROTECH DEVELOPERS LTD	2,725	1,376.500	3,750,962.50	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	10,750	3,051.250	32,800,937.50	
MANKIND PHARMA LTD	1,387	2,639.350	3,660,778.45	
MARICO LTD	4,615	607.750	2,804,766.25	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,495	11,279.800	16,863,301.00	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	9,488	1,116.950	10,597,621.60	
MPHASIS LTD	1,316	3,104.600	4,085,653.60	
MRF LTD	24	132,151.400	3,171,633.60	
MUTHOOT FINANCE LTD	1,734	1,991.300	3,452,914.20	
NESTLE INDIA LTD	4,509	2,228.850	10,049,884.65	
NHPC LTD	38,515	86.770	3,341,946.55	
NMDC LTD	11,681	241.530	2,821,311.93	
NTPC LTD	52,250	369.850	19,324,662.50	
OBEROI REALTY LTD	1,611	2,139.900	3,447,378.90	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	41,708	258.900	10,798,201.20	
OIL INDIA LTD	6,297	467.850	2,946,051.45	
ORACLE FINANCIAL SERVICES	277	12,585.000	3,486,045.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	55	46,121.000	2,536,655.00	
PB FINTECH LTD	3,475	2,131.150	7,405,746.25	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	1,116	6,234.250	6,957,423.00	
PETRONET LNG LTD	6,694	335.100	2,243,159.40	
PHOENIX MILLS LTD	2,512	1,797.150	4,514,440.80	
PI INDUSTRIES LTD	717	4,060.600	2,911,450.20	



PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,082	3,160.750	6,580,681.50	
POLYCAB INDIA LTD	517	7,438.400	3,845,652.80	
POWER FINANCE CORPORATION	15,725	515.350	8,103,878.75	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	55,562	329.100	18,285,454.20	
PRESTIGE ESTATES PROJECTS	1,809	1,742.100	3,151,458.90	
PUNJAB NATIONAL BANK	25,385	108.770	2,761,126.45	
RAIL VIKAS NIGAM LTD	6,549	470.550	3,081,631.95	
REC LTD	14,200	563.700	8,004,540.00	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	74,094	1,295.150	95,962,844.10	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	39,725	166.810	6,626,527.25	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	2,791	719.650	2,008,543.15	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	4,948	1,469.300	7,270,096.40	
SHREE CEMENT LTD	75	26,711.250	2,003,343.75	
SHRIRAM FINANCE LIMITED	3,278	3,106.900	10,184,418.20	
SIEMENS LTD	1,037	7,842.050	8,132,205.85	
SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	350	10,962.900	3,837,015.00	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	3,909	659.650	2,578,571.85	
SRF LTD	1,334	2,302.350	3,071,334.90	
STATE BANK OF INDIA	21,173	858.050	18,167,492.65	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	11,764	1,806.650	21,253,430.60	
SUNDARAM FINANCE LTD	868	4,369.500	3,792,726.00	
SUPREME INDUSTRIES LTD	839	5,012.650	4,205,613.35	
SUZLON ENERGY LTD	116,921	67.360	7,875,798.56	
TATA COMMUNICATIONS LTD	1,415	1,785.350	2,526,270.25	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	11,098	4,452.150	49,409,960.70	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	6,156	933.950	5,749,396.20	
TATA ELXSI LTD	496	7,356.000	3,648,576.00	
TATA MOTORS LTD	25,109	798.750	20,055,813.75	
TATA POWER CO LTD	20,526	440.750	9,046,834.50	
TATA STEEL LTD	94,976	149.880	14,235,002.88	
TECH MAHINDRA LTD	6,408	1,777.850	11,392,462.80	
THERMAX LTD	559	4,641.650	2,594,682.35	
TITAN CO LTD	4,248	3,468.200	14,732,913.60	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	1,426	3,335.700	4,756,708.20	
TORRENT POWER LTD	2,238	1,645.950	3,683,636.10	
TRENT LTD	2,141	6,949.700	14,879,307.70	

	TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	1,349	3,710.150	5,004,992.35	
	TVS MOTOR CO LTD	2,887	2,488.850	7,185,309.95	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,399	11,814.800	16,528,905.20	
	UNION BANK OF INDIA	17,927	129.260	2,317,244.02	
	UNITED SPIRITS LTD	3,724	1,506.250	5,609,275.00	
	UPL LTD	4,658	555.400	2,587,053.20	
	VARUN BEVERAGES LTD	13,990	641.600	8,975,984.00	
	VEDANTA LTD	18,194	497.050	9,043,327.70	
	VODAFONE IDEA LTD	301,243	8.090	2,437,055.87	
	VOLTAS LTD	2,560	1,764.350	4,516,736.00	
	WIPRO LTD	31,370	303.750	9,528,637.50	
	YES BANK LTD	186,706	21.840	4,077,659.04	
	ZOMATO LTD	79,069	295.300	23,349,075.70	
インド・ルピー	小計	2,330,689		1,586,662,125.12 (2,840,125,204)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	220,000	2,680.000	589,600,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	75,300	9,325.000	702,172,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	289,000	5,225.000	1,510,025,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	702,300	10,350.000	7,268,805,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	435,300	6,375.000	2,775,037,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	185,200	5,000.000	926,000,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	890,800	4,390.000	3,910,612,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	272,946	935.000	255,204,510.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	89,600	8,250.000	739,200,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	45,500	4,910.000	223,405,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	11,203,400	78.000	873,865,200.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	7,125.000	42,750,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	9,600	11,775.000	113,040,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	10,400	8,200.000	85,280,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	176,100	1,485.000	261,508,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	113,600	1,920.000	218,112,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	221,600	2,940.000	651,504,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	647,100	2,740.000	1,773,054,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	49,100	1,895.000	93,044,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	10,600	28,500.000	302,100,000.00	

インドネシア・ルピア 小計		15,653,446		23,314,319,710.00 (223,817,469)	
オフショア・ 人民元	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,500	13.090	58,905.00	
	ADVANCED MICRO- FABRICATION-A	528	214.040	113,013.12	
	AECC AVIATION POWER CO-A	3,100	40.270	124,837.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	71,800	5.010	359,718.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	4,637	14.620	67,792.94	
	AIR CHINA LTD-A	10,100	8.690	87,769.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	14,800	7.640	113,072.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	25.500	25,500.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	190.000	57,000.00	
	ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	140	86.300	12,082.00	
	BANK OF BEIJING CO LTD - A	8,600	5.870	50,482.00	
	BANK OF CHINA LTD-A	32,100	5.150	165,315.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	22,200	7.400	164,280.00	
	BANK OF JIANGSU CO LTD-A	7,800	9.160	71,448.00	
	BANK OF NANJING CO LTD - A	8,800	10.570	93,016.00	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	4,300	24.820	106,726.00	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD- A	4,500	8.650	38,925.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO- A	33,200	6.950	230,740.00	
	BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	218	312.600	68,146.80	
	BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,000	40.190	80,380.00	
	BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	560	76.600	42,896.00	
	BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	51,100	6.360	324,996.00	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	45,400	4.290	194,766.00	
	BYD CO LTD -A	1,300	280.490	364,637.00	
	CAITONG SECURITIES CO LTD-A	7,500	8.490	63,675.00	
	CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	366	539.000	197,274.00	
	CGN POWER CO LTD-A	17,400	4.080	70,992.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	107.150	10,715.00		

CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	12,300	7.050	86,715.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK- A	9,600	8.250	79,200.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD- A	3,200	35.600	113,920.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6,800	4.320	29,376.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	37,000	3.740	138,380.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	6,900	15.800	109,020.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	16,200	8.640	139,968.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	2,400	37.000	88,800.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO- A	4,100	44.070	180,687.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	17,500	37.700	659,750.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	10,500	19.580	205,590.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	11.120	21,128.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	21,200	4.070	86,284.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	9.990	105,894.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	11,500	22.880	263,120.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,000	35.350	141,400.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	25,900	6.470	167,573.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD- A	39,200	6.610	259,112.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	10,871	6.410	69,683.11	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	1,473	49.450	72,839.85	
CHINA SHENHUA ENERGY CO- A	4,800	42.500	204,000.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4,700	7.140	33,558.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	22,900	6.100	139,690.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	57,100	4.620	263,802.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	2,800	69.290	194,012.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	8,100	8.420	68,202.00	

CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	22,600	28.410	642,066.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	24,600	2.970	73,062.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	5,850	14.070	82,309.50	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	3,200	29.970	95,904.00	
CITI PACIFIC SPECIAL STEE-A	13,400	12.080	161,872.00	
CITIC SECURITIES CO-A	12,500	31.120	389,000.00	
CMOC GROUP LTD-A	11,300	7.390	83,507.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	1,820	39.370	71,653.40	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	3,480	268.050	932,814.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	5,070	14.150	71,740.50	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	6,600	27.600	182,160.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	24,500	6.940	170,030.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,200	15.390	64,638.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	13,113	27.540	361,132.02	
EVE ENERGY CO LTD-A	900	49.900	44,910.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	7,800	20.890	162,942.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	6.880	40,592.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	2,554	46.270	118,173.58	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	11,600	8.900	103,240.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	11,900	22.130	263,347.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	2,800	56.340	157,752.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	2,800	39.530	110,684.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	13,200	4.730	62,436.00	
GEM CO LTD-A	13,300	6.900	91,770.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	16.720	61,864.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	196	83.320	16,330.72	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	200	68.670	13,734.00	
GOERTEK INC -A	1,000	25.920	25,920.00	
GOLDWIND SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A	3,900	10.940	42,666.00	

GONGNIU GROUP CO LTD-A	1,015	73.250	74,348.75	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,800	22.530	40,554.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,500	26.960	94,360.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,200	42.350	135,520.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,000	45.730	45,730.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	5,400	7.130	38,502.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	8,700	9.720	84,564.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,300	28.780	37,414.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,000	22.760	22,760.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,200	11.480	128,576.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,600	18.980	125,268.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,500	29.400	161,700.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	12,600	11.540	145,404.00	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,646	16.460	27,093.16	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	3,900	27.790	108,381.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	25.710	20,568.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	7,900	14.850	117,315.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2,800	17.960	50,288.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	700	330.310	231,217.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	400	59.340	23,736.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,300	37.720	49,036.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	7,700	7.190	55,363.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,500	18.430	156,655.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	7.820	48,484.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	17.240	24,136.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	121.380	60,690.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	1,183	31.270	36,992.41	

HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	1,886	128.990	243,275.14	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	52.680	63,216.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	140	208.540	29,195.60	
IND & COMM BK OF CHINA-A	54,400	6.320	343,808.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD - A	14,000	18.540	259,560.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	21,900	6.480	141,912.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	2.030	65,772.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	5.780	12,138.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	2,800	28.820	80,696.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,372	15.960	21,897.12	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	2,900	9.460	27,434.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,000	57.190	57,190.00	
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS CO LTD-A	6,484	49.380	320,179.92	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,300	47.450	61,685.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY - A	900	85.030	76,527.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,200	15.880	34,936.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	9,300	21.350	198,555.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	6,076	8.670	52,678.92	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	41.490	91,278.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	900	1,518.800	1,366,920.00	
LB GROUP CO LTD-A	2,900	18.240	52,896.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	2,400	21.700	52,080.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	13,900	8.770	121,903.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,480	17.630	114,242.40	
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	6,689	39.880	266,757.32	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	900	137.880	124,092.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,300	30.650	39,845.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	480	101.880	48,902.40	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	3.410	69,905.00	

MIDEA GROUP CO LTD-A	3,300	73.130	241,329.00	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	974	68.820	67,030.68	
MUYUAN FOODS CO LTD-A	5,790	39.550	228,994.50	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,110	24.920	77,501.20	
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,776	21.600	124,761.60	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	600	397.800	238,680.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	52.330	47,097.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	9.460	17,028.00	
NINESTAR CORP-A	1,700	27.290	46,393.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,015	53.580	54,383.70	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	4,400	16.580	72,952.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	4,500	10.930	49,185.00	
PETROCHINA CO LTD-A	29,700	8.430	250,371.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	675	29.600	19,980.00	
PICC HOLDING CO-A	14,900	7.520	112,048.00	
PING AN BANK CO LTD-A	23,300	11.670	271,911.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	9,900	54.830	542,817.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	9.870	26,649.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	12,200	5.550	67,710.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	5.530	55,300.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	11,400	17.600	200,640.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	17,500	9.600	168,000.00	
S F HOLDING CO LTD-A	7,300	40.830	298,059.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,000	18.070	144,560.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	5,100	12.830	65,433.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	16.860	50,580.00	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	4,600	17.850	82,110.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	13,700	7.920	108,504.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	12,900	16.150	208,335.00	
SERES GROUP CO L-A	1,400	144.750	202,650.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	4,700	24.580	115,526.00	



SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,360	24.860	158,109.60	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,900	22.550	42,845.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	30,200	4.020	121,404.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,872	27.740	51,929.28	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	8.920	56,196.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	26.310	94,716.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	5,100	10.360	52,836.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	5,500	21.570	118,635.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	18,900	9.660	182,574.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	1,160	18.630	21,610.80	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	14,800	8.070	119,436.00	
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,296	141.000	182,736.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,280	200.480	256,614.40	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD- A	140	99.040	13,865.60	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11,000	5.450	59,950.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,500	62.520	93,780.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDIC-A	1,300	259.850	337,805.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	470	96.530	45,369.10	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,800	16.940	30,492.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	700	78.770	55,139.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	117.570	18,811.20	
TBEA CO LTD-A	2,860	12.930	36,979.80	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4,400	4.750	20,900.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	1,875	9.980	18,712.50	
TIANQI LITHIUM CORP-A	1,300	37.300	48,490.00	
TONGWEI CO LTD-A	3,900	25.740	100,386.00	

TRINA SOLAR CO LTD-A	1,092	23.680	25,858.56	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	600	73.480	44,088.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	419	65.180	27,310.42	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	980	24.860	24,362.80	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	4,400	73.170	321,948.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-A	3,400	13.570	46,138.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1,800	16.990	30,582.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	9,700	9.110	88,367.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	405	98.540	39,908.70	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	36.580	7,316.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	5,200	7.910	41,132.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,100	145.760	597,616.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-A	1,872	58.980	110,410.56	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2,600	8.070	20,982.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	4,700	20.850	97,995.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	6,760	15.010	101,467.60	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	1,300	34.450	44,785.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,690	12.660	21,395.40	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	2,500	14.570	36,425.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	700	57.450	40,215.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	300	36.860	11,058.00	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	900	223.190	200,871.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	1,100	22.300	24,530.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	3,000	16.830	50,490.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	650	32.430	21,079.50	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	800	34.180	27,344.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,008	21.480	21,651.84	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2,000	12.740	25,480.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	1,000	125.100	125,100.00	

	ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	12,400	7.000	86,800.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	21,100	15.880	335,068.00	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9,400	6.990	65,706.00	
	ZTE CORP-A	9,200	31.060	285,752.00	
オフショア・人民元 小計		1,748,416		28,209,259.02 (588,036,109)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	2,517	37,880.000	95,343,960.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,540	35,900.000	162,986,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,691	16,820.000	112,542,620.00	
コロンビア・ペソ 小計		13,748		370,872,580.00 (12,847,768)	
タイ・パーツ	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	14,700	295.000	4,336,500.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	59,400	60.500	3,593,700.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	129,100	25.250	3,259,775.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	71,300	7.350	524,055.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	7,700	202.000	1,555,400.00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	31,900	59.750	1,906,025.00	
	CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN	15,700	34.000	533,800.00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	26,800	23.900	640,520.00	
	CP ALL PCL-FOREIGN	68,800	62.750	4,317,200.00	
	CP AXTRA PCL-FOREIGN	19,613	35.500	696,261.50	
	DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN	38,400	152.500	5,856,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	42,400	64.250	2,724,200.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	44,400	9.650	428,460.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6,300	101.500	639,450.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	4,900	156.500	766,850.00	
	KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	32,300	21.500	694,450.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN	15,500	47.750	740,125.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	53,400	27.250	1,455,150.00	
PTT EXPLORATION & PROD-FOR	15,800	126.500	1,998,700.00		

	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	14,300	24.900	356,070.00	
	PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN	32,900	13.900	457,310.00	
	PTT PCL/FOREIGN	134,300	32.000	4,297,600.00	
	SCB X PCL-FOREIGN	6,800	118.500	805,800.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	12,700	179.000	2,273,300.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	9,300	38.000	353,400.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	428,400	1.830	783,972.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-FOREIGN	122,498	11.800	1,445,476.40	
タイ・パーツ 小計		1,459,611		47,439,549.90 (213,003,579)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	2,199	937.000	2,060,463.00	
	KOMERCNI BANKA AS	654	849.000	555,246.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	124.600	140,050.40	
チェコ・コルナ 小計		3,977		2,755,759.40 (17,558,321)	
チリ・ペソ	BANCO DE CHILE	554,983	113.120	62,779,676.96	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,450	28,150.000	40,817,500.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,088,852	47.490	51,709,581.48	
	CENCOSUD SA	9,218	2,115.000	19,496,070.00	
	EMPRESAS CMPC SA	10,124	1,545.100	15,642,592.40	
	EMPRESAS COPEC SA	7,046	6,036.000	42,529,656.00	
	ENEL CHILE SA	90,486	54.890	4,966,776.54	
	ENERSIS SA	205,266	88.300	18,124,987.80	
	FALABELLA SA	7,564	3,463.000	26,194,132.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	1,914,707	14.080	26,959,074.56	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,584	39,024.000	61,814,016.00	
チリ・ペソ 小計		3,891,280		371,034,063.74 (57,983,348)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	49,905	66.350	3,311,196.75	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	11,662	71.250	830,917.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,758	526.000	2,502,708.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	16,544	61.700	1,020,764.80	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	16,270	27.000	439,290.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	593	991.500	587,959.50	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	15,178	100.800	1,529,942.40	
	KOC HOLDING AS	9,876	200.700	1,982,113.20	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	2,013	224.700	452,321.10	

	SASA POLYESTER SANAYI	66,344	4.460	295,894.24	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	17,645	154.500	2,726,152.50	
	TURK HAVA YOLLARI AO	6,115	300.500	1,837,557.50	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	10,503	43.200	453,729.60	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,833	93.800	1,109,935.40	
	TURKIYE IS BANKASI-C	81,449	14.280	1,163,091.72	
	YAPI VE KREDI BANKASI	39,247	32.420	1,272,387.74	
トルコ・リラ 小計		359,935		21,515,961.95 (93,686,953)	
ハンガリー・ フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	4,259	2,656.000	11,311,904.00	
	OTP BANK RT	2,868	21,930.000	62,895,240.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,879	10,700.000	20,105,300.00	
ハンガリー・フォリント 小計		9,006		94,312,444.00 (36,592,945)	
フィリピン・ ペソ	AYALA CORPORATION	3,625	640.000	2,320,000.00	
	AYALA LAND INC	55,300	28.150	1,556,695.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	25,735	130.000	3,345,550.00	
	BDO UNIBANK INC	32,808	153.000	5,019,624.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	13,250	395.000	5,233,750.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	18,558	21.200	393,429.60	
	JOLLIBEE FOODS CORP	7,320	260.000	1,903,200.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,370	482.000	660,340.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	15,127	76.000	1,149,652.00	
	PLDT INC	585	1,355.000	792,675.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,195	880.000	2,811,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	105,700	26.200	2,769,340.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	7,280	76.500	556,920.00	
フィリピン・ペソ 小計		289,853		28,512,775.60 (74,466,816)	
ブラジル・レ アル	AMBEV SA	61,000	14.210	866,810.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	44,903	11.110	498,872.33	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	48,479	12.240	593,382.96	
	BANCO BTG PACTUAL SA- UNIT	12,900	30.370	391,773.00	
	BANCO DO BRASIL SA	23,900	24.670	589,613.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	7,900	35.660	281,714.00	
	BM&FBOVESPA SA	68,500	10.000	685,000.00	
	BRF SA	7,600	28.690	218,044.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	9,100	15.760	143,416.00	

CCR SA	6,800	10.660	72,488.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,600	40.010	104,026.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	15,200	35.950	546,440.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	23,917	11.630	278,154.71	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	13,900	9.570	133,023.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,300	91.070	482,671.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	5,100	11.650	59,415.00	
COSAN SA	10,400	9.360	97,344.00	
CPFL ENERGIA SA	3,000	31.940	95,820.00	
EMBRAER SA	8,500	56.440	479,740.00	
ENERGISA SA-UNITS	2,300	38.460	88,458.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,575	37.960	173,667.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	14,100	29.580	417,078.00	
GERDAU SA-PREF	12,024	21.150	254,307.60	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	43,506	2.410	104,849.46	
HYPERA S.A	2,900	18.950	54,955.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	61,150	32.860	2,009,389.00	
ITAU SA	75,895	9.300	705,823.50	
JBS SA	7,100	39.930	283,503.00	
KLABIN SA - UNIT	10,700	23.380	250,166.00	
LOCALIZA RENT A CAR	9,995	33.450	334,332.75	
NATURA &CO HOLDING SA	7,300	14.130	103,149.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	50,500	43.220	2,182,610.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	49,700	40.040	1,989,988.00	
PRIO S.A.	10,000	39.900	399,000.00	
RAIA DROGASIL SA	16,236	24.200	392,911.20	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	10,500	27.120	284,760.00	
RUMO SA	13,500	19.130	258,255.00	
SUZANO S.A.	7,622	66.650	508,006.30	
TELEFONICA BRASIL S.A.	5,700	51.070	291,099.00	
TIM SA	10,500	15.600	163,800.00	
TOTVS SA	4,400	27.710	121,924.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	5,200	17.560	91,312.00	
VALE SA	40,454	59.830	2,420,362.82	
VIBRA ENERGIA SA	12,300	20.290	249,567.00	
WEG SA	19,720	55.750	1,099,390.00	
ブラジル・リアル 小計	886,876		21,850,410.63 (544,059,929)	

ポーランド・ズロチ	ALIOR BANK SA	1,454	88.500	128,679.00	
	ALLEGRO.EU SA	6,936	29.845	207,004.92	
	BANK PEKAO SA	2,397	146.950	352,239.15	
	BUDIMEX	97	473.800	45,958.60	
	CD PROJEKT SA	427	194.300	82,966.10	
	DINO POLSKA SA	513	405.500	208,021.50	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,585	133.400	211,439.00	
	LPP SA	9	16,860.000	151,740.00	
	MBANK SA	114	561.200	63,976.80	
	ORLEN SA	8,185	53.080	434,459.80	
	PGE SA	8,858	6.204	54,955.03	
	PKO BANK POLSKI SA	10,872	61.280	666,236.16	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	8,080	46.000	371,680.00	
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	693	476.500	330,214.50	
ポーランド・ズロチ 小計	50,220		3,309,570.56 (124,260,143)		
マレーシア・リンギット	AMBANK HOLDINGS BHD	35,600	5.530	196,868.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	20,500	2.360	48,380.00	
	CELCOMDIGI BERHAD	51,800	3.650	189,070.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	93,200	8.180	762,376.00	
	GAMUDA BHD	18,800	9.220	173,336.00	
	GENTING BHD	33,300	3.650	121,545.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	11,300	2.150	24,295.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	10,000	20.600	206,000.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	17,200	7.420	127,624.00	
	INARI AMERTRON BHD	47,200	2.970	140,184.00	
	IOI CORPORATION BHD	19,700	3.910	77,027.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	3,400	21.440	72,896.00	
	MALAYAN BANKING BHD	68,800	10.100	694,880.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	4,900	10.600	51,940.00	
	MAXIS BHD	53,100	3.500	185,850.00	
	MISC BHD	21,000	7.420	155,820.00	
	MR DIY GROUP M BHD	16,300	1.860	30,318.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	96.200	57,720.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	49,600	4.810	238,576.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,300	20.000	66,000.00	
	PETRONAS GAS BHD	11,300	17.700	200,010.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,680	12.860	73,044.80	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	54,800	4.930	270,164.00	
	PUBLIC BANK BHD	187,800	4.540	852,612.00	
QL RESOURCES BHD	4,500	4.900	22,050.00		
RHB BANK BHD	17,000	6.570	111,690.00		

	SIME DARBY BERHAD	4,800	2.370	11,376.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	19,000	5.060	96,140.00	
	SUNWAY BHD	34,300	4.820	165,326.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	12,500	6.600	82,500.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	33,500	13.820	462,970.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	42,800	2.160	92,448.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	30,900	3.640	112,476.00	
マレーシア・リンギット 小計		1,038,480		6,173,511.80 (211,243,375)	
メキシコ・ペ ソ	ALFA S.A.B. -A	17,900	15.800	282,820.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	228,600	15.280	3,493,008.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	6,700	183.080	1,226,636.00	
	CEMEX SAB-CPO	161,100	11.870	1,912,257.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	6,475	167.000	1,081,325.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	20,900	183.560	3,836,404.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,665	351.350	936,347.75	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	1,580	537.990	850,024.20	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	3,800	185.180	703,684.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL- B SH	4,425	398.200	1,762,035.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	16,400	58.600	961,040.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV- SER A1	5,300	120.800	640,240.00	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	3,700	136.730	505,901.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	32,100	142.530	4,575,213.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	27,600	47.940	1,323,144.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	35,600	108.470	3,861,532.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,960	335.930	994,352.80	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	10,000	27.520	275,200.00	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	12,000	14.380	172,560.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,765	189.470	334,414.55	
WALMART DE MEXICO-SER V	75,500	57.230	4,320,865.00		
メキシコ・ペソ 小計		677,070		34,049,003.30	



				(255,003,200)	
ユーロ	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	25,965	1.648	42,790.32	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	29,366	2.250	66,073.50	
	FF GROUP	129	0.000	0.01	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,778	14.940	26,563.32	
	JUMBO SA	1,127	26.140	29,459.78	
	MYTILINEOS S.A.	1,452	32.860	47,712.72	
	NATIONAL BANK OF GREECE	8,342	7.746	64,617.13	
	OPAP SA	2,062	15.940	32,868.28	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	12,984	3.919	50,884.29	
	PUBLIC POWER CORP	1,420	11.930	16,940.60	
ユーロ 小計	84,625		377,909.95 (60,431,580)		
韓国・ウォン	ALTEOGEN INC	459	285,000.000	130,815,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP	353	99,500.000	35,123,500.00	
	CELLTRION INC	1,837	175,100.000	321,658,700.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	61	250,500.000	15,280,500.00	
	COWAY CO LTD	312	72,300.000	22,557,600.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	1,321	29,850.000	39,431,850.00	
	DAUM COMMUNICATIONS CORP	4,215	42,300.000	178,294,500.00	
	DB INSURANCE CO LTD	363	101,000.000	36,663,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	272	42,500.000	11,560,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	5,255	17,380.000	91,331,900.00	
	ECOPRO BM CO LTD	636	128,800.000	81,916,800.00	
	ECOPRO CO LTD	1,045	70,100.000	73,254,500.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	170	72,400.000	12,308,000.00	
	ENCHEM CO LTD	141	145,400.000	20,501,400.00	
	GS HOLDINGS CORP	407	39,700.000	16,157,900.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	3,543	57,200.000	202,659,600.00	
	HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	531	37,200.000	19,753,200.00	
	HANMI PHARM CO LTD	60	245,000.000	14,700,000.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	367	70,100.000	25,726,700.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	381	279,000.000	106,299,000.00	
	HD HYUNDAI	361	76,600.000	27,652,600.00	
	HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	269	345,500.000	92,939,500.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	316	208,000.000	65,728,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	566	187,900.000	106,351,400.00		

HLB INC	1,238	72,100.000	89,259,800.00	
HMM CO LTD	3,612	17,800.000	64,293,600.00	
HYBE CO LTD	300	185,300.000	55,590,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	476	112,400.000	53,502,400.00	
HYUNDAI MOBIS	767	243,000.000	186,381,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,663	201,000.000	334,263,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	423	153,600.000	64,972,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	149,600.000	25,432,000.00	
HYUNDAI ROTEM COMPANY	916	44,450.000	40,716,200.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5,116	14,130.000	72,289,080.00	
KAKAOBANK CORP	1,670	22,700.000	37,909,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	4,539	82,800.000	375,829,200.00	
KIA CORPORATION	2,840	92,000.000	261,280,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	932	51,900.000	48,370,800.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,254	20,900.000	68,008,600.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	481	73,300.000	35,257,300.00	
KOREA ZINC CO LTD	65	1,535,000.000	99,775,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,631	23,250.000	61,170,750.00	
KRAFTON INC	369	301,000.000	111,069,000.00	
KT&G CORP	1,142	119,200.000	136,126,400.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	101	87,800.000	8,867,800.00	
L&F CO LTD	197	94,900.000	18,695,300.00	
LG CHEM LTD	599	246,500.000	147,653,500.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	56	166,500.000	9,324,000.00	
LG CORP	1,400	73,800.000	103,320,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,203	8,890.000	37,364,670.00	
LG ELECTRONICS INC	1,310	83,200.000	108,992,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	580	387,500.000	224,750,000.00	
LG H AND H CO LTD	100	331,000.000	33,100,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	244	152,700.000	37,258,800.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	1,340	13,460.000	18,036,400.00	
LG UPLUS CORP	815	10,760.000	8,769,400.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	113	56,400.000	6,373,200.00	
LS ELECTRIC CO LTD	229	143,600.000	32,884,400.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	1,199	98,400.000	117,981,600.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	1,312	8,110.000	10,640,320.00	
NAVER CORP	1,790	201,500.000	360,685,000.00	
NCSOFT CORPORATION	137	190,000.000	26,030,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	53,400.000	3,097,200.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	234	101,000.000	23,634,000.00	

	POSCO DX CO LTD	586	19,660.000	11,520,760.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	431	155,100.000	66,848,100.00	
	POSCO HOLDINGS INC	793	253,500.000	201,025,500.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	426	37,400.000	15,932,400.00	
	S-OIL CORPORATION	988	53,600.000	52,956,800.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	228	953,000.000	217,284,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	1,181	116,100.000	137,114,100.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	807	105,600.000	85,219,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	57,359	53,400.000	3,062,970,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	10,222	44,800.000	457,945,600.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,205	16,310.000	19,653,550.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	334	365,000.000	121,910,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	8,752	9,990.000	87,432,480.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	892	98,000.000	87,416,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	633	239,500.000	151,603,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	623	132,400.000	82,485,200.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	5,222	50,700.000	264,755,400.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	470	96,900.000	45,543,000.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	115	44,700.000	5,140,500.00	
	SK HYNIX INC	6,610	168,900.000	1,116,429,000.00	
	SK INC	528	127,600.000	67,372,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	728	109,100.000	79,424,800.00	
	SK SQUARE CO LTD	1,151	78,800.000	90,698,800.00	
	SK TELECOM CO LTD	720	57,200.000	41,184,000.00	
	SKC CO LTD	129	90,400.000	11,661,600.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	6,866	15,310.000	105,118,460.00	
	YUHAN CORP	684	109,300.000	74,761,200.00	
韓国・ウォン	小計	180,545		12,069,026,020.00 (1,281,730,563)	
香港・ドル	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	10,000	38.500	385,000.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	339,000	4.190	1,420,410.00	
	AKESO INC	8,000	66.350	530,800.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	195,200	86.900	16,962,880.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	52,000	3.820	198,640.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	4.860	116,640.00	

ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	23,000	21.750	500,250.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,000	113.270	226,540.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	16,600	83.750	1,390,250.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	41,000	3.880	159,080.00	
BAIDU INC-CLASS A	28,050	87.100	2,443,155.00	
BANK OF CHINA LTD - H	871,000	3.830	3,335,930.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	110,000	5.960	655,600.00	
BEIGENE LTD	8,600	123.200	1,059,520.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	4,500	25.700	115,650.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	2.290	36,640.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	3,040	158.500	481,840.00	
BOC AVIATION LTD	1,900	61.800	117,420.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	58,000	4.020	233,160.00	
BYD CO LTD	12,500	273.800	3,422,500.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	6,500	42.950	279,175.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	6,000	13.320	79,920.00	
CGN POWER CO LTD-H	137,000	2.770	379,490.00	
CHINA CITIC BANK	117,000	5.300	620,100.00	
CHINA COAL ENERGY CO - H	20,000	9.890	197,800.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	4.320	34,560.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,162,000	6.260	7,274,120.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	30,150	11.640	350,946.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	67,000	2.850	190,950.00	
CHINA FEIHE LTD	32,000	5.710	182,720.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	51,500	7.790	401,185.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	26,800	6.660	178,488.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	38,000	12.480	474,240.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	13,200	15.200	200,640.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	87,000	16.220	1,411,140.00	
CHINA LITERATURE LTD	3,600	29.600	106,560.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	6.810	217,920.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	38,000	17.280	656,640.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	47,500	38.400	1,824,000.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	10,000	13.160	131,600.00	

CHINA MINSHENG BANKING-H	107,400	3.160	339,384.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	42,000	3.850	161,700.00	
CHINA OILFIELD SERVICES- H	12,000	6.810	81,720.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	56,500	14.200	802,300.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	32,800	26.750	877,400.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	274,000	4.390	1,202,860.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	106,880	5.150	550,432.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	33,000	3.160	104,280.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	28,000	3.960	110,880.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	20,000	27.350	547,000.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	8,200	29.400	241,080.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,500	24.650	1,096,925.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	10,000	31.000	310,000.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	18,000	5.450	98,100.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	26,000	19.000	494,000.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	52,000	2.340	121,680.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	41,500	34.600	1,435,900.00	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	14,000	6.300	88,200.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	26,000	12.060	313,560.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	30,000	13.120	393,600.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	548,000	1.070	586,360.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	13,800	6.990	96,462.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	29,800	7.230	215,454.00	
CITIC LTD	72,000	9.220	663,840.00	
CITIC SECURITIES CO LTD- H	16,500	24.500	404,250.00	
CMOC GROUP LIMITED-H	54,000	5.920	319,680.00	
CRRG CORP LTD H	79,000	4.900	387,100.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	8,900	57.650	513,085.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	5.530	38,710.00	
FOSUN INTERNATIONAL	17,000	4.430	75,310.00	

FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	8,000	54.000	432,000.00	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	282,000	1.340	377,880.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	81,000	15.420	1,249,020.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	11.580	115,800.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	4,000	51.150	204,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	29,000	13.660	396,140.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	30,000	5.220	156,600.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	16,000	16.900	270,400.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	25,400	28.650	727,710.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	5,000	20.550	102,750.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	10,000	7.290	72,900.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	20,000	19.100	382,000.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	4,500	22.850	102,825.00	
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	6,000	23.450	140,700.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	21.400	64,200.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	50,000	4.290	214,500.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	15,800	14.380	227,204.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	839,000	4.820	4,043,980.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	12,500	39.100	488,750.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	20,750	31.350	650,512.50	
JD LOGISTICS INC	22,100	14.760	326,196.00	
JD.COM INC - CL A	29,457	152.200	4,483,355.40	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	8.150	16,300.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	9,000	13.100	117,900.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	44,000	10.540	463,760.00	
KINGSOFT CORP LTD	8,000	34.700	277,600.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	33,500	48.450	1,623,075.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	36,000	8.070	290,520.00	
LEGEND GROUP LTD	86,000	9.440	811,840.00	
LI AUTO INC-CLASS A	14,200	91.900	1,304,980.00	
LI NING CO LTD	30,000	17.440	523,200.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	15,500	11.940	185,070.00	
MEITUAN-B	59,460	171.700	10,209,282.00	

MIDEA GROUP CO LTD	3,700	77.400	286,380.00	
MINISO GROUP HOLDING LTD	4,200	47.050	197,610.00	
MMG LTD	56,000	2.860	160,160.00	
NETEASE INC	22,800	150.900	3,440,520.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	18,800	27.200	511,360.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	18,100	50.750	918,575.00	
NIO INC-CLASS A	17,210	38.150	656,561.50	
NONGFU SPRING CO LTD-H	27,800	36.900	1,025,820.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	1,000	104.100	104,100.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	105,000	3.950	414,750.00	
PETROCHINA CO LTD-H	244,000	5.880	1,434,720.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	85,000	12.540	1,065,900.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	79,000	48.550	3,835,450.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	6,400	94.250	603,200.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	106,000	4.550	482,300.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	5,750	13.560	77,970.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,400	4.850	79,540.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	13.240	35,748.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	9,400	61.950	582,330.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	138,000	3.330	459,540.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	18,000	21.150	380,700.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	6,000	22.800	136,800.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	21,000	11.580	243,180.00	
SUNNY OPTICAL TECH	9,300	67.200	624,960.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	77,800	418.800	32,582,640.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	12,000	10.300	123,600.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	16,000	19.480	311,680.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	10,000	11.160	111,600.00	
TRIP.COM GROUP LTD	7,450	577.500	4,302,375.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD- H	8,000	52.200	417,600.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	66,000	4.510	297,660.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	24,000	11.580	277,920.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-H	2,840	59.850	169,974.00	

	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	36,500	19.000	693,500.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	180,400	30.950	5,583,380.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	44,000	3.420	150,480.00	
	XPENG INC - CLASS A SHARES	15,700	52.450	823,465.00	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	10,000	11.780	117,800.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	41,500	9.510	394,665.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	12,500	11.080	138,500.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	5.400	10,800.00	
	ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	5,900	29.750	175,525.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,500	17.180	111,670.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	3,900	30.850	120,315.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	68,000	15.680	1,066,240.00	
	ZTE CORP-H	6,200	19.820	122,884.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC	5,650	149.900	846,935.00	
香港・ドル	小計	9,131,987		159,418,283.40 (3,108,656,525)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	6,000	720.000	4,320,000.00	
	ACER INC	38,000	39.500	1,501,000.00	
	ADVANTECH CO LTD	5,408	355.500	1,922,544.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	825.000	1,650,000.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	1,000	2,675.000	2,675,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	41,000	160.000	6,560,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	16,000	42.500	680,000.00	
	ASIA VITAL COMPONENTS	4,000	708.000	2,832,000.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	8,000	608.000	4,864,000.00	
	AUO CORPORATION	51,800	15.550	805,490.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	196.000	1,764,000.00	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	115,000	69.200	7,958,000.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	17,408	121.000	2,106,368.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	73,736	18.000	1,327,248.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	13,000	52.000	676,000.00	
	CHINA AIRLINES LTD	20,000	26.950	539,000.00	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	208,083	18.000	3,745,494.00	
	CHINA STEEL CORP	134,000	21.000	2,814,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	45,000	124.500	5,602,500.00	



COMPAL ELECTRONICS	52,000	39.100	2,033,200.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	203,000	39.050	7,927,150.00	
DELTA ELECTRONICS INC	24,000	405.000	9,720,000.00	
E INK HOLDINGS INC	10,000	268.000	2,680,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	164,364	27.550	4,528,228.20	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,000	527.000	1,581,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	3,165.000	3,165,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	32,000	47.500	1,520,000.00	
EVERGREEN MARINE	10,660	235.500	2,510,430.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	21,000	33.050	694,050.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	17,000	90.000	1,530,000.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,718	136.000	505,648.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	150,047	28.100	4,216,320.70	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	39,000	33.150	1,292,850.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	45,000	40.200	1,809,000.00	
FORTUNE ELECTRIC CO LTD	1,100	573.000	630,300.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	98,302	91.500	8,994,633.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	7,000	277.500	1,942,500.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	1,000	1,225.000	1,225,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	420.000	1,680,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	149,200	195.000	29,094,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,040	610.000	2,464,400.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	105,357	27.550	2,902,585.35	
INNOLUX CORPORATION	66,491	15.650	1,040,584.15	
INTERNATIONAL GAMES SYSTEM C	3,000	1,035.000	3,105,000.00	
INVENTEC CO LTD	23,000	50.300	1,156,900.00	
JENTECH PRECISION INDUSTRIAL	1,000	1,525.000	1,525,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	2,440.000	2,440,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	23,000	105.000	2,415,000.00	
MEDIATEK INC	18,000	1,325.000	23,850,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	152,802	39.950	6,104,439.90	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	9,000	173.000	1,557,000.00	
NAN YA PLASTICS CORP	77,000	36.900	2,841,300.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	8,000	32.500	260,000.00	

NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	394.000	394,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	8,000	487.500	3,900,000.00	
PEGATRON CORP	24,000	97.300	2,335,200.00	
PHARMAESSENTIA CORP	2,000	582.000	1,164,000.00	
POU CHEN	26,000	43.900	1,141,400.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,000	270.000	1,350,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	33,000	296.000	9,768,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	519.000	3,114,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	8,802	46.000	404,892.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	150,244	12.000	1,802,928.00	
SILERGY CORP	3,000	411.500	1,234,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	140,195	24.100	3,378,699.50	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	21,000	75.700	1,589,700.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	158,768	17.650	2,802,255.20	
TAIWAN BUSINESS BANK	52,520	15.100	793,052.00	
TAIWAN CEMENT	71,090	33.550	2,385,069.50	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	129,909	25.300	3,286,697.70	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	28.250	169,500.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	23,000	114.500	2,633,500.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	295,000	1,075.000	317,125,000.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	60,000	40.150	2,409,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	58,000	84.600	4,906,800.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	15,000	148.500	2,227,500.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	137,000	44.050	6,034,850.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	8,000	92.800	742,400.00	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,930.000	1,930,000.00	
WALSIN LIHWA CORP	24,000	25.900	621,600.00	
WAN HAI LINES LIMITED	3,795	86.100	326,749.50	
WISTRON CORP	29,000	118.500	3,436,500.00	
WIWYNN CORP	1,000	2,485.000	2,485,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	23,760	70.600	1,677,456.00	
YAGEO CORPORATION	6,046	535.000	3,234,610.00	

	YANG MING MARINE TRANSPORT	20,000	83.000	1,660,000.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	135,600	34.950	4,739,220.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	11,000	115.500	1,270,500.00	
台湾・ドル 小計		4,034,245		593,758,742.70 (2,773,031,456)	
南アフリカ・ ランド	ABSA GROUP LTD	10,352	196.170	2,030,751.84	
	ANGLO PLATINUM LTD	730	594.450	433,948.50	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	6,350	464.740	2,951,099.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	4,644	169.000	784,836.00	
	BID CORP LTD	3,754	447.680	1,680,590.72	
	BIDVEST GROUP LTD	4,492	283.900	1,275,278.80	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,032	3,316.630	3,422,762.16	
	CLICKS GROUP LTD	2,024	394.000	797,456.00	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	7,097	196.510	1,394,631.47	
	EXXARO RESOURCES LTD	1,516	175.840	266,573.44	
	FIRSTRAND LTD	58,574	80.100	4,691,777.40	
	GOLD FIELDS LTD	10,244	261.430	2,678,088.92	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	7,258	167.580	1,216,295.64	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,898	103.720	1,234,060.56	
	KUMBA IRON ORE LTD	436	361.750	157,723.00	
	MTN GROUP LTD	19,216	84.580	1,625,289.28	
	NASPERS LTD-N SHS	2,013	4,430.230	8,918,052.99	
	NEDBANK GROUP LTD	5,871	308.150	1,809,148.65	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	7,914	143.570	1,136,212.98	
	OLD MUTUAL LTD	74,869	13.100	980,783.90	
	OUTSURANCE GROUP LTD	6,649	68.410	454,858.09	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	14,569	28.640	417,256.16	
	REINET INVESTMENTS SCA	1,873	480.130	899,283.49	
	REMGRO LTD	6,411	159.930	1,025,311.23	
	SANLAM LIMITED	23,353	90.870	2,122,087.11	
	SASOL LTD	7,508	93.410	701,322.28	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	5,730	303.310	1,737,966.30	
SIBANYE STILLWATER LTD	24,991	18.680	466,831.88		
STANDARD BANK GROUP LTD	17,624	233.430	4,113,970.32		
VODACOM GROUP LTD	6,605	106.260	701,847.30		
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	13,949	64.610	901,244.89		
南アフリカ・ランド 小計		369,546		53,027,340.30 (451,262,666)	
合計		42,435,498		13,363,978,300 (13,363,978,300)	

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

2024年12月10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	21,079.00	694,763.84	
		ISHARES MSCI QATAR CP ETF	43,167.00	780,459.36	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	91,849.00	3,888,886.66	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	81,422.00	1,254,713.02	
	アメリカ・ドル	小計	237,517.00	6,618,822.88 (1,003,016,419)	
投資信託受益証券 合計			237,517	1,003,016,419 (1,003,016,419)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	43,300.00	953,466.00	
	メキシコ・ペソ	小計	43,300.00	953,466.00 (7,140,792)	
投資証券 合計			43,300	7,140,792 (7,140,792)	
合計				1,010,157,211 (1,010,157,211)	

(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 39銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	2.56 -	- 6.49	- -	9.73
インド・ルピー	株式 156銘柄	18.37	-	-	19.76
インドネシア・ルピア	株式 20銘柄	1.45	-	-	1.56
オフショア・人民元	株式 229銘柄	3.80	-	-	4.09
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.08	-	-	0.09
タイ・バーツ	株式 27銘柄	1.38	-	-	1.48
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	-	-	0.40
トルコ・リラ	株式 16銘柄	0.61	-	-	0.65
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.24	-	-	0.25
フィリピン・ペソ	株式 13銘柄	0.48	-	-	0.52
ブラジル・レアル	株式 45銘柄	3.52	-	-	3.78
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.80	-	-	0.86
マレーシア・リングgit	株式 33銘柄	1.37	-	-	1.47
メキシコ・ペソ	株式 21銘柄 投資証券 1銘柄	1.65 -	- -	- 0.05	1.82
ユーロ	株式 10銘柄	0.39	-	-	0.42
韓国・ウォン	株式 91銘柄	8.29	-	-	8.92
香港・ドル	株式 150銘柄	20.11	-	-	21.63
台湾・ドル	株式 88銘柄	17.94	-	-	19.29
南アフリカ・ランド	株式 31銘柄	2.92	-	-	3.14

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド  
貸借対照表

（単位：円）

2024年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	6,552,414
コール・ローン	597,061,834
国債証券	51,131,406,690
地方債証券	3,118,507,788
特殊債券	4,536,587,597
社債券	4,230,067,400
未収利息	167,855,958
前払費用	12,661,033
流動資産合計	63,800,700,714
資産合計	63,800,700,714
負債の部	
流動負債	
未払解約金	346,609,225
流動負債合計	346,609,225
負債合計	346,609,225
純資産の部	
元本等	
元本	69,658,693,582
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,204,602,093
元本等合計	63,454,091,489
純資産合計	63,454,091,489
負債純資産合計	63,800,700,714

## 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12月12日 至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2024年12月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	56,949,608,279円
同期中追加設定元本額	23,868,466,824円
同期中一部解約元本額	11,159,381,521円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブD B（適格機関投資家限定）	38,641,715,030円
DCニッセイ日本債券インデックス	5,920,197,185円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	468,483,907円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	10,757,009,136円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	869,337,081円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	4,532,632,550円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	1,191,874,415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）	449,592,506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）	45,917,728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）	190,052,792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）	104,227,369円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	284,807,568円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	333,547,497円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	1,121,805,581円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	4,608,093,609円
FWニッセイ国内債インデックス	38,733,004円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	98,667,621円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	1,999,003円
計	69,658,693,582円
2. 受益権の総数	69,658,693,582口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は6,204,602,093円であります。

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年12月10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	2024年12月10日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		1,293,308,110
地方債証券		66,979,712
特殊債券		72,557,809
社債券		37,818,000
合計		1,470,663,631

（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（2024年3月12日から2024年12月10日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2024年12月10日現在	
1口当たり純資産額	0.9109円
（1万口当たり純資産額）	（9,109円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2024年12月10日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第456回 利付国債（2年）	199,000,000	198,265,690	
	第457回 利付国債（2年）	206,000,000	205,132,740	
	第458回 利付国債（2年）	208,000,000	207,280,320	
	第459回 利付国債（2年）	210,000,000	209,183,100	
	第460回 利付国債（2年）	217,000,000	216,357,680	
	第461回 利付国債（2年）	233,000,000	232,557,300	
	第462回 利付国債（2年）	234,000,000	233,475,840	
	第463回 利付国債（2年）	235,000,000	234,407,800	
	第464回 利付国債（2年）	237,000,000	236,350,620	
	第465回 利付国債（2年）	232,000,000	231,315,600	
	第466回 利付国債（2年）	162,000,000	161,787,780	
	第147回 利付国債（5年）	486,000,000	483,020,820	
	第148回 利付国債（5年）	505,000,000	500,914,550	
	第149回 利付国債（5年）	415,000,000	410,949,600	
	第150回 利付国債（5年）	403,000,000	398,482,370	
	第151回 利付国債（5年）	269,000,000	265,591,770	
	第152回 利付国債（5年）	133,000,000	131,598,180	

第153回 利付国債(5年)	469,000,000	462,293,300	
第154回 利付国債(5年)	411,000,000	405,443,280	
第155回 利付国債(5年)	186,000,000	184,286,940	
第156回 利付国債(5年)	252,000,000	248,930,640	
第157回 利付国債(5年)	116,000,000	114,418,920	
第158回 利付国債(5年)	241,000,000	236,943,970	
第159回 利付国債(5年)	120,000,000	117,766,800	
第160回 利付国債(5年)	108,000,000	106,361,640	
第161回 利付国債(5年)	121,000,000	119,581,880	
第162回 利付国債(5年)	25,000,000	24,673,000	
第163回 利付国債(5年)	282,000,000	279,349,200	
第164回 利付国債(5年)	138,000,000	135,458,040	
第165回 利付国債(5年)	134,000,000	132,055,660	
第166回 利付国債(5年)	145,000,000	143,464,450	
第167回 利付国債(5年)	124,000,000	122,533,080	
第168回 利付国債(5年)	62,000,000	61,781,140	
第169回 利付国債(5年)	134,000,000	132,970,880	
第171回 利付国債(5年)	147,000,000	145,034,610	
第172回 利付国債(5年)	147,000,000	145,678,470	
第173回 利付国債(5年)	134,000,000	133,226,820	
第174回 利付国債(5年)	135,000,000	134,843,400	
第1回 利付国債(40年)	81,000,000	86,904,090	
第2回 利付国債(40年)	105,000,000	108,253,950	
第3回 利付国債(40年)	97,000,000	99,256,220	
第4回 利付国債(40年)	134,000,000	135,922,900	
第5回 利付国債(40年)	128,000,000	123,741,440	
第6回 利付国債(40年)	138,000,000	129,430,200	
第7回 利付国債(40年)	143,000,000	127,099,830	
第8回 利付国債(40年)	179,000,000	146,078,320	
第9回 利付国債(40年)	203,000,000	118,702,220	
第10回 利付国債(40年)	182,000,000	124,964,840	
第11回 利付国債(40年)	153,000,000	99,947,250	
第12回 利付国債(40年)	106,000,000	60,554,620	
第13回 利付国債(40年)	170,000,000	94,729,100	
第14回 利付国債(40年)	231,000,000	136,343,130	
第15回 利付国債(40年)	220,000,000	142,700,800	
第16回 利付国債(40年)	288,000,000	203,857,920	
第17回 利付国債(40年)	167,000,000	153,274,270	
第1回 クライメート・トラン ジション利付国債(5年)	45,000,000	44,321,400	
第2回 クライメート・トラン ジション利付国債(10年)	42,000,000	41,928,600	
第342回 利付国債(10 年)	531,000,000	528,382,170	
第343回 利付国債(10 年)	541,000,000	537,402,350	
第344回 利付国債(10 年)	500,000,000	495,955,000	
第345回 利付国債(10 年)	499,000,000	494,354,310	

第346回 利付国債(10年)	465,000,000	460,098,900	
第347回 利付国債(10年)	440,000,000	434,746,400	
第348回 利付国債(10年)	473,000,000	466,605,040	
第349回 利付国債(10年)	299,000,000	294,470,150	
第350回 利付国債(10年)	383,000,000	376,554,110	
第351回 利付国債(10年)	352,000,000	345,449,280	
第352回 利付国債(10年)	248,000,000	242,928,400	
第353回 利付国債(10年)	318,000,000	310,895,880	
第354回 利付国債(10年)	328,000,000	319,970,560	
第355回 利付国債(10年)	252,000,000	245,314,440	
第356回 利付国債(10年)	222,000,000	215,644,140	
第357回 利付国債(10年)	284,000,000	275,391,960	
第358回 利付国債(10年)	307,000,000	297,255,820	
第359回 利付国債(10年)	290,000,000	280,372,000	
第360回 利付国債(10年)	363,000,000	350,324,040	
第361回 利付国債(10年)	373,000,000	359,333,280	
第362回 利付国債(10年)	384,000,000	369,158,400	
第363回 利付国債(10年)	384,000,000	368,244,480	
第364回 利付国債(10年)	392,000,000	374,963,680	
第365回 利付国債(10年)	398,000,000	379,719,860	
第366回 利付国債(10年)	426,000,000	408,154,860	
第367回 利付国債(10年)	136,000,000	129,886,800	
第368回 利付国債(10年)	413,000,000	393,130,570	
第369回 利付国債(10年)	475,000,000	461,814,000	
第370回 利付国債(10年)	478,000,000	463,459,240	

第371回 利付国債(10年)	509,000,000	487,886,680	
第372回 利付国債(10年)	473,000,000	467,820,650	
第373回 利付国債(10年)	474,000,000	459,253,860	
第374回 利付国債(10年)	457,000,000	449,244,710	
第375回 利付国債(10年)	369,000,000	371,560,860	
第4回 利付国債(30年)	19,000,000	21,402,930	
第5回 利付国債(30年)	13,000,000	14,192,490	
第6回 利付国債(30年)	31,000,000	34,409,380	
第7回 利付国債(30年)	40,000,000	44,305,600	
第8回 利付国債(30年)	57,000,000	61,145,040	
第9回 利付国債(30年)	57,000,000	59,399,700	
第10回 利付国債(30年)	69,000,000	70,197,150	
第11回 利付国債(30年)	83,000,000	88,395,830	
第12回 利付国債(30年)	92,000,000	101,060,160	
第13回 利付国債(30年)	89,000,000	96,969,060	
第14回 利付国債(30年)	103,000,000	115,823,500	
第15回 利付国債(30年)	138,000,000	156,474,060	
第16回 利付国債(30年)	116,000,000	131,552,120	
第17回 利付国債(30年)	107,000,000	120,373,930	
第18回 利付国債(30年)	116,000,000	129,443,240	
第19回 利付国債(30年)	99,000,000	110,464,200	
第20回 利付国債(30年)	105,000,000	119,275,800	
第21回 利付国債(30年)	41,000,000	45,747,390	
第22回 利付国債(30年)	54,000,000	61,396,380	
第23回 利付国債(30年)	57,000,000	64,796,460	
第24回 利付国債(30年)	27,000,000	30,684,690	
第25回 利付国債(30年)	34,000,000	37,890,280	
第26回 利付国債(30年)	91,000,000	102,405,940	
第27回 利付国債(30年)	123,000,000	139,705,860	
第28回 利付国債(30年)	155,000,000	175,852,150	
第29回 利付国債(30年)	174,000,000	194,993,100	
第30回 利付国債(30年)	189,000,000	209,107,710	
第31回 利付国債(30年)	187,000,000	203,940,330	
第32回 利付国債(30年)	217,000,000	239,014,650	
第33回 利付国債(30年)	243,000,000	256,860,720	
第34回 利付国債(30年)	217,000,000	234,718,050	
第35回 利付国債(30年)	244,000,000	255,892,560	
第36回 利付国債(30年)	244,000,000	254,962,920	
第37回 利付国債(30年)	256,000,000	262,630,400	
第38回 利付国債(30年)	173,000,000	174,076,060	
第39回 利付国債(30年)	164,000,000	167,322,640	
第40回 利付国債(30年)	139,000,000	139,194,600	
第41回 利付国債(30年)	126,000,000	123,949,980	
第42回 利付国債(30年)	137,000,000	134,366,860	
第43回 利付国債(30年)	141,000,000	137,965,680	

第44回	利付国債(30年)	150,000,000	146,212,500	
第45回	利付国債(30年)	162,000,000	152,158,500	
第46回	利付国債(30年)	194,000,000	181,712,040	
第47回	利付国債(30年)	181,000,000	172,091,180	
第48回	利付国債(30年)	185,000,000	169,080,750	
第49回	利付国債(30年)	186,000,000	169,481,340	
第50回	利付国債(30年)	187,000,000	150,370,440	
第51回	利付国債(30年)	197,000,000	140,478,730	
第52回	利付国債(30年)	196,000,000	145,869,080	
第53回	利付国債(30年)	184,000,000	139,494,080	
第54回	利付国債(30年)	189,000,000	149,336,460	
第55回	利付国債(30年)	176,000,000	138,473,280	
第56回	利付国債(30年)	180,000,000	141,013,800	
第57回	利付国債(30年)	182,000,000	141,972,740	
第58回	利付国債(30年)	226,000,000	175,545,500	
第59回	利付国債(30年)	171,000,000	129,038,310	
第60回	利付国債(30年)	155,000,000	122,304,300	
第61回	利付国債(30年)	150,000,000	112,167,000	
第62回	利付国債(30年)	148,000,000	104,550,160	
第63回	利付国債(30年)	160,000,000	109,332,800	
第64回	利付国債(30年)	169,000,000	114,789,870	
第65回	利付国債(30年)	160,000,000	108,025,600	
第66回	利付国債(30年)	150,000,000	100,593,000	
第67回	利付国債(30年)	188,000,000	132,652,800	
第68回	利付国債(30年)	190,000,000	133,307,800	
第69回	利付国債(30年)	187,000,000	134,245,430	
第70回	利付国債(30年)	180,000,000	128,419,200	
第71回	利付国債(30年)	183,000,000	129,843,990	
第72回	利付国債(30年)	186,000,000	131,351,340	
第73回	利付国債(30年)	187,000,000	131,440,430	
第74回	利付国債(30年)	183,000,000	139,277,640	
第75回	利付国債(30年)	189,000,000	154,925,190	
第76回	利付国債(30年)	180,000,000	150,753,600	
第77回	利付国債(30年)	174,000,000	152,592,780	
第78回	利付国債(30年)	180,000,000	149,934,600	
第79回	利付国債(30年)	182,000,000	143,559,780	
第80回	利付国債(30年)	170,000,000	155,281,400	
第81回	利付国債(30年)	184,000,000	159,910,720	
第82回	利付国債(30年)	183,000,000	166,555,620	
第83回	利付国債(30年)	175,000,000	174,063,750	
第84回	利付国債(30年)	114,000,000	110,851,320	
第85回	利付国債(20年)	118,000,000	120,407,200	
第86回	利付国債(20年)	126,000,000	128,889,180	
第87回	利付国債(20年)	106,000,000	108,295,960	
第88回	利付国債(20年)	165,000,000	169,398,900	
第89回	利付国債(20年)	112,000,000	114,816,800	
第90回	利付国債(20年)	180,000,000	185,220,000	
第91回	利付国債(20年)	119,000,000	122,660,440	
第92回	利付国債(20年)	157,000,000	161,856,010	
第93回	利付国債(20年)	61,000,000	62,969,690	

第94回 利付国債(20年)	100,000,000	103,453,000	
第95回 利付国債(20年)	112,000,000	116,819,360	
第96回 利付国債(20年)	42,000,000	43,598,100	
第97回 利付国債(20年)	80,000,000	83,539,200	
第98回 利付国債(20年)	48,000,000	49,992,480	
第99回 利付国債(20年)	207,000,000	216,254,970	
第100回 利付国債(20年)	148,000,000	155,546,520	
第101回 利付国債(20年)	92,000,000	97,296,440	
第102回 利付国債(20年)	107,000,000	113,566,590	
第103回 利付国債(20年)	98,000,000	103,676,160	
第104回 利付国債(20年)	35,000,000	36,785,700	
第105回 利付国債(20年)	110,000,000	115,941,100	
第106回 利付国債(20年)	89,000,000	94,135,300	
第107回 利付国債(20年)	86,000,000	90,889,960	
第108回 利付国債(20年)	135,000,000	141,617,700	
第109回 利付国債(20年)	93,000,000	97,749,510	
第110回 利付国債(20年)	126,000,000	133,508,340	
第111回 利付国債(20年)	99,000,000	105,579,540	
第112回 利付国債(20年)	156,000,000	165,684,480	
第113回 利付国債(20年)	269,000,000	286,334,360	
第114回 利付国債(20年)	125,000,000	133,526,250	
第115回 利付国債(20年)	83,000,000	89,063,980	
第116回 利付国債(20年)	51,000,000	54,916,800	
第117回 利付国債(20年)	111,000,000	118,959,810	
第118回 利付国債(20年)	28,000,000	29,943,480	
第119回 利付国債(20年)	15,000,000	15,877,350	
第120回 利付国債(20年)	34,000,000	35,626,900	
第121回 利付国債(20年)	81,000,000	86,395,410	

第122回 利付国債(20年)	39,000,000	41,381,340	
第123回 利付国債(20年)	203,000,000	219,428,790	
第124回 利付国債(20年)	102,000,000	109,665,300	
第125回 利付国債(20年)	159,000,000	173,275,020	
第126回 利付国債(20年)	101,000,000	108,822,450	
第127回 利付国債(20年)	82,000,000	87,858,080	
第128回 利付国債(20年)	149,000,000	159,903,820	
第129回 利付国債(20年)	86,000,000	91,757,700	
第130回 利付国債(20年)	127,000,000	135,684,260	
第131回 利付国債(20年)	63,000,000	66,901,590	
第132回 利付国債(20年)	88,000,000	93,578,320	
第133回 利付国債(20年)	143,000,000	153,018,580	
第134回 利付国債(20年)	98,000,000	104,950,160	
第135回 利付国債(20年)	58,000,000	61,713,740	
第136回 利付国債(20年)	60,000,000	63,406,800	
第137回 利付国債(20年)	69,000,000	73,432,560	
第138回 利付国債(20年)	75,000,000	78,725,250	
第139回 利付国債(20年)	83,000,000	87,742,620	
第140回 利付国債(20年)	225,000,000	239,559,750	
第141回 利付国債(20年)	206,000,000	219,400,300	
第142回 利付国債(20年)	148,000,000	158,799,560	
第143回 利付国債(20年)	206,000,000	217,770,840	
第144回 利付国債(20年)	153,000,000	160,498,530	
第145回 利付国債(20年)	277,000,000	295,007,770	
第146回 利付国債(20年)	277,000,000	294,902,510	

第147回 利付国債(20年)	292,000,000	308,159,280	
第148回 利付国債(20年)	260,000,000	271,720,800	
第149回 利付国債(20年)	272,000,000	283,701,440	
第150回 利付国債(20年)	289,000,000	298,230,660	
第151回 利付国債(20年)	285,000,000	288,223,350	
第152回 利付国債(20年)	265,000,000	267,443,300	
第153回 利付国債(20年)	270,000,000	274,573,800	
第154回 利付国債(20年)	285,000,000	286,365,150	
第155回 利付国債(20年)	203,000,000	199,337,880	
第156回 利付国債(20年)	133,000,000	121,830,660	
第157回 利付国債(20年)	136,000,000	121,067,200	
第158回 利付国債(20年)	218,000,000	200,189,400	
第159回 利付国債(20年)	184,000,000	170,251,520	
第160回 利付国債(20年)	172,000,000	160,482,880	
第161回 利付国債(20年)	174,000,000	159,678,060	
第162回 利付国債(20年)	214,000,000	195,551,060	
第163回 利付国債(20年)	237,000,000	215,518,320	
第164回 利付国債(20年)	297,000,000	265,301,190	
第165回 利付国債(20年)	231,000,000	205,259,670	
第166回 利付国債(20年)	235,000,000	213,657,300	
第167回 利付国債(20年)	258,000,000	226,921,320	
第168回 利付国債(20年)	240,000,000	207,019,200	
第169回 利付国債(20年)	250,000,000	211,200,000	
第170回 利付国債(20年)	226,000,000	189,867,120	
第171回 利付国債(20年)	223,000,000	186,303,120	



第172回 利付国債(20年)	200,000,000	168,784,000	
第173回 利付国債(20年)	269,000,000	225,771,700	
第174回 利付国債(20年)	259,000,000	216,174,350	
第175回 利付国債(20年)	245,000,000	206,802,050	
第176回 利付国債(20年)	240,000,000	201,494,400	
第177回 利付国債(20年)	253,000,000	207,492,890	
第178回 利付国債(20年)	248,000,000	205,795,360	
第179回 利付国債(20年)	266,000,000	219,649,500	
第180回 利付国債(20年)	245,000,000	212,160,200	
第181回 利付国債(20年)	253,000,000	221,926,540	
第182回 利付国債(20年)	236,000,000	213,320,400	
第183回 利付国債(20年)	243,000,000	230,084,550	
第184回 利付国債(20年)	242,000,000	217,214,360	
第185回 利付国債(20年)	243,000,000	217,256,580	
第186回 利付国債(20年)	246,000,000	234,654,480	
第187回 利付国債(20年)	189,000,000	173,759,040	
第188回 利付国債(20年)	188,000,000	181,322,240	
第189回 利付国債(20年)	187,000,000	189,017,730	
第190回 利付国債(20年)	121,000,000	119,949,720	
国債証券 合計	53,686,000,000	51,131,406,690	
地方債証券			
第764回 東京都公募公債	100,000,000	99,112,000	
第14回 東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,152,700	
第34回 東京都公募公債(20年)	100,000,000	91,498,400	
第18回 宮城県1号公募公債(5年)	100,000,000	98,438,100	
第30回 神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	98,957,200	
第448回 大阪府公募公債	38,000,000	36,562,308	
第455回 大阪府公募公債	180,000,000	173,350,980	

第7回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	106,509,800	
第11回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	105,537,800	
第12回 大阪府公募公債（20年）	100,000,000	102,756,800	
平成29年度第5回 京都府公募公債（20年）	100,000,000	90,714,000	
第15回 兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	105,214,600	
第21回 兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	103,876,300	
平成26年度第11回 愛知県公募公債（15年）	100,000,000	100,710,200	
令和4年度第3回 愛知県公募公債	200,000,000	191,189,600	
平成20年度第1回 福岡県公募公債（20年）	100,000,000	105,496,100	
平成24年度第2回 福岡県公募公債（20年）	100,000,000	105,183,000	
令和4年度第1回 千葉県公募公債	300,000,000	286,865,400	
第22回 大阪市公募公債（20年）	100,000,000	89,508,500	
第1回 名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	112,712,000	
第25回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	105,793,400	
第26回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	106,293,100	
第31回 横浜市公募公債（20年）	100,000,000	99,617,400	
第9回 川崎市公募公債（20年）	100,000,000	107,075,000	
第4回 川崎市公募公債（30年）	100,000,000	104,675,200	
平成30年度第5回 広島市公募公債	200,000,000	195,469,800	
平成29年度第1回 仙台市公募公債	100,000,000	90,238,100	
地方債証券 合計	3,118,000,000	3,118,507,788	
特殊債券			
第9回 新関西国際空港	300,000,000	304,356,000	
第16回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,657,300	
第174回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,319,700	
第205回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,124,900	
第212回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,763,200	

第233回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,507,900	
第278回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	88,553,700	
第293回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	89,538,500	
第316回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,441,800	
第319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	91,008,200	
第17回 地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	212,340,000	
第36回 地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	103,401,600	
第1回 地方公共団体金融機構債券(30年)	100,000,000	97,268,500	
第116回 政保地方公共団体金融機構債券	138,000,000	134,292,768	
第120回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,480,200	
第136回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	191,627,400	
第72回 日本政策金融公庫債券	100,000,000	97,982,000	
第97回 都市再生債券	100,000,000	100,655,800	
第33回 政保中部国際空港債券	100,000,000	98,540,700	
第59回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	212,078,400	
第143回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,403,300	
第183回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,225,100	
第37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,328,000	16,742,731	
第42回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,782,000	42,504,828	
第46回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,574,000	48,829,953	
第54回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,026,000	40,710,444	
第55回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,844,000	45,489,753	
第60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,250,000	46,795,750	
第61回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,396,000	23,590,186	
第62回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	212,968,000	213,862,465	
第63回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	129,645,000	129,606,106	

	第73回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,048,000	93,652,812	
	第78回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,598,000	80,565,760	
	第109回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,685,000	168,796,089	
	第175回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,624,000	157,945,752	
	い第854号 利付商工債券	200,000,000	198,033,400	
	い第862号 利付商工債券	100,000,000	98,740,900	
	第394回 利付信金中金債券	100,000,000	98,424,300	
	第402回 利付信金中金債券	200,000,000	196,753,200	
	第66回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,976,200	
特殊債券 合計		4,567,768,000	4,536,587,597	
社債券	第36回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2021)	100,000,000	96,139,000	
	第38回 成田国際空港	200,000,000	191,523,800	
	第8回 ビー・エヌ・ピー・パリバ	100,000,000	99,062,600	
	第69回 西日本高速道路	100,000,000	98,667,000	
	第13回 日本たばこ産業	100,000,000	97,981,700	
	第8回 クラレ	100,000,000	97,799,800	
	第12回 旭化成	300,000,000	288,661,200	
	第5回 電通グループ	400,000,000	394,666,800	
	第2回 アステラス製薬	100,000,000	98,551,900	
	第11回 プリヂストーン	100,000,000	98,728,700	
	第19回 豊田通商	100,000,000	100,204,400	
	第24回 リそなホールディングス	300,000,000	296,241,600	
	第2回 みずほリース	300,000,000	288,739,500	
	第18回 NTTファイナンス	100,000,000	96,240,000	
	第78回 トヨタファイナンス	100,000,000	98,517,800	
	第55回 日立キャピタル	100,000,000	100,242,800	
	第17回 三井住友ファイナンス&リース	100,000,000	98,520,200	
	第2回 三菱HCキャピタル	100,000,000	98,511,300	
	第132回 三菱地所	100,000,000	96,796,800	
	第7回 野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	211,367,000	
	第11回 ジャパンエクセレント投資法人	100,000,000	98,998,300	
	第106回 東日本旅客鉄道	100,000,000	96,590,800	
	第3回 東日本旅客鉄道(サステナビリティボンド)	100,000,000	94,783,700	
	第32回 東海旅客鉄道	200,000,000	208,138,400	
	第8回 東京地下鉄	100,000,000	104,355,300	
	第510回 関西電力	100,000,000	99,076,000	
	第518回 関西電力	100,000,000	98,353,900	
	第494回 東北電力	100,000,000	98,968,000	

	第451回 九州電力	100,000,000	99,069,100	
	第47回 大阪瓦斯(トランジションボンド)	100,000,000	95,879,300	
	第8回 ファーストリテイリング	100,000,000	88,690,700	
社債券 合計		4,300,000,000	4,230,067,400	
合計			63,016,569,475	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年12月10日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	421,468,956
金銭信託	2,935,547
コール・ローン	267,489,678
国債証券	121,158,335,263
派生商品評価勘定	14,813,273
未収利息	694,249,996
前払費用	104,229,954
流動資産合計	122,663,522,667
<b>資産合計</b>	
122,663,522,667	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,040,313,451
未払金	145,874,691
未払解約金	1,295,335
流動負債合計	1,187,483,477
<b>負債合計</b>	
1,187,483,477	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	123,788,253,695
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,312,214,505
元本等合計	121,476,039,190
<b>純資産合計</b>	
121,476,039,190	
<b>負債純資産合計</b>	
122,663,522,667	

## 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12月12日 至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2024年12月10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	111,074,787,262円
同期中追加設定元本額	21,507,798,358円
同期中一部解約元本額	8,794,331,925円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブD B（適格機関投資家限定）	103,634,020,702円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02（適格機関投資家限定）	2,994,908,108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）	3,013,731,455円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01（適格機関投資家限定）	2,956,240,456円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05（適格機関投資家限定）	2,945,340,782円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08（適格機関投資家限定）	2,630,925,914円
FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）	9,091,479円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド 2023-05（適格機関投資家限定）	1,898,298,129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）	1,852,778,590円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-08（適格機関投資家限定）	1,852,918,080円
計	123,788,253,695円
2. 受益権の総数	123,788,253,695口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,312,214,505円であります。

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年12月10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12月10日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		1,435,136,574
合計		1,435,136,574

(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（2024年3月12日から2024年12月10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12月10日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	120,963,827,732	-	121,991,146,729	1,027,318,997
イギリス・ポンド	56,719,504,507	-	57,148,639,589	429,135,082
イスラエル・シケル	6,364,177,470	-	6,438,011,763	73,834,293
イスラエル・シケル	400,848,519	-	411,430,302	10,581,783
オーストラリア・ドル	1,498,924,416	-	1,493,565,926	5,358,490
オフショア・人民元	13,530,208,350	-	13,643,989,919	113,781,569
カナダ・ドル	2,379,694,147	-	2,372,356,290	7,337,857
シンガポール・ドル	1,075,294,230	-	1,085,755,128	10,460,898
スウェーデン・クローナ	200,499,961	-	202,808,827	2,308,866
デンマーク・クローネ	273,018,626	-	275,655,084	2,636,458
ニュージーランド・ドル	338,753,037	-	338,475,662	277,375
ノルウェー・クローネ	187,489,493	-	188,510,326	1,020,833
ポーランド・ズロチ	640,784,905	-	652,948,114	12,163,209
メキシコ・ペソ	934,184,853	-	948,673,225	14,488,372
ユーロ	36,420,445,218	-	36,790,326,574	369,881,356
買建				
アメリカ・ドル	170,513,327	-	172,332,146	1,818,819
アメリカ・ドル	71,599,527	-	72,431,785	832,258
オフショア・人民元	24,711,600	-	25,012,800	301,200
メキシコ・ペソ	46,933,754	-	47,319,949	386,195
ユーロ	27,268,446	-	27,567,612	299,166
合計	121,134,341,059	-	122,163,478,875	1,025,500,178

(注) 為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年12月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9813円 (9,813円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2024年12月10日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	360,000.00	385,282.80	
		US TREASURY N/B	4,620,000.00	4,407,387.60	
		US TREASURY N/B	2,950,000.00	2,321,502.50	
		US TREASURY N/B	290,000.00	299,854.20	
		US TREASURY N/B	8,730,000.00	8,534,884.50	
		US TREASURY N/B	8,520,000.00	8,112,914.40	
		US TREASURY N/B	3,270,000.00	2,606,909.40	
		US TREASURY N/B	5,740,000.00	5,113,479.00	
		US TREASURY N/B	6,070,000.00	5,978,950.00	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,504,560.00	
		US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,846,220.00	
		US TREASURY N/B	5,540,000.00	5,405,821.20	
		US TREASURY N/B	4,770,000.00	3,903,004.80	
		US TREASURY N/B	2,860,000.00	2,227,310.80	
		US TREASURY N/B	37,110,000.00	35,995,215.60	
		US TREASURY N/B	22,830,000.00	22,018,393.50	
		US TREASURY N/B	15,720,000.00	15,045,612.00	
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	1,781,078.00	
		US TREASURY N/B	14,450,000.00	13,880,381.00	
		US TREASURY N/B	12,830,000.00	12,333,222.40	
		US TREASURY N/B	12,790,000.00	12,278,400.00	
		US TREASURY N/B	13,440,000.00	12,815,712.00	
		US TREASURY N/B	3,650,000.00	2,724,360.00	
		US TREASURY N/B	8,770,000.00	8,325,974.90	
		US TREASURY N/B	11,250,000.00	10,801,687.50	
		US TREASURY N/B	380,000.00	389,230.20	
		US TREASURY N/B	10,940,000.00	10,514,324.60	
		US TREASURY N/B	980,000.00	972,650.00	
		US TREASURY N/B	10,160,000.00	9,738,055.20	
		US TREASURY N/B	4,810,000.00	3,734,099.20	
		US TREASURY N/B	11,300,000.00	10,904,839.00	
		US TREASURY N/B	390,000.00	391,400.10	
US TREASURY N/B	11,720,000.00	11,061,570.40			
US TREASURY N/B	11,750,000.00	10,943,950.00			

US TREASURY N/B	11,680,000.00	10,480,931.20	
US TREASURY N/B	5,780,000.00	3,826,764.60	
US TREASURY N/B	10,930,000.00	9,818,200.40	
US TREASURY N/B	5,330,000.00	4,689,547.20	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,697,880.80	
US TREASURY N/B	190,000.00	204,493.20	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	869,306.10	
US TREASURY N/B	6,830,000.00	5,632,018.00	
US TREASURY N/B	7,510,000.00	3,948,607.80	
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,264,571.40	
US TREASURY N/B	6,400,000.00	5,326,464.00	
US TREASURY N/B	7,560,000.00	6,354,784.80	
US TREASURY N/B	2,690,000.00	1,896,234.80	
US TREASURY N/B	8,040,000.00	6,912,470.40	
US TREASURY N/B	520,000.00	472,466.80	
US TREASURY N/B	7,250,000.00	6,039,540.00	
US TREASURY N/B	8,690,000.00	5,341,569.20	
US TREASURY N/B	7,050,000.00	5,883,930.00	
US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,702,289.10	
US TREASURY N/B	6,130,000.00	5,271,800.00	
US TREASURY N/B	2,630,000.00	1,970,317.10	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	1,913,350.40	
US TREASURY N/B	5,310,000.00	4,821,904.80	
US TREASURY N/B	7,860,000.00	6,044,182.80	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	1,641,049.20	
US TREASURY N/B	950,000.00	948,955.00	
WI TREASURY SEC.	540,000.00	541,539.00	
WI TREASURY SEC.	6,210,000.00	5,165,167.50	
WI TREASURY SEC.	1,840,000.00	1,840,644.00	
アメリカ・ドル 小計	418,330,000.00 (63,393,728,200)	375,819,216.40 (56,951,644,052)	
イギリス・ボンド	UNITED KINGDOM GILT	1,300,000.00	1,057,914.00
	UNITED KINGDOM GILT	1,030,000.00	1,057,892.40
	UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	349,915.50
	UNITED KINGDOM GILT	1,210,000.00	1,243,867.90
	UNITED KINGDOM GILT	570,000.00	477,848.10
	UNITED KINGDOM GILT	520,000.00	313,367.60
	UNITED KINGDOM GILT	2,830,000.00	2,716,092.50
	UNITED KINGDOM GILT	960,000.00	713,788.80
	UNITED KINGDOM GILT	780,000.00	722,779.20
	UNITED KINGDOM GILT	2,190,000.00	2,204,892.00
	UNITED KINGDOM GILT	1,770,000.00	1,649,905.50
	UNITED KINGDOM GILT	990,000.00	902,493.90
	UNITED KINGDOM GILT	2,340,000.00	2,149,219.80
	UNITED KINGDOM GILT	990,000.00	434,887.20
	UNITED KINGDOM GILT	910,000.00	519,974.00
	UNITED KINGDOM GILT	900,000.00	918,297.00
	UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	581,898.00

	UNITED KINGDOM GILT	890,000.00	448,933.80	
	UNITED KINGDOM GILT	780,000.00	678,342.60	
	UNITED KINGDOM GILT	1,400,000.00	1,212,540.00	
	UNITED KINGDOM GILT	500,000.00	479,890.00	
	UNITED KINGDOM GILT	800,000.00	792,808.00	
	UNITED KINGDOM GILT	1,060,000.00	1,036,764.80	
	UNITED KINGDOM GILT	830,000.00	506,964.00	
	UNITED KINGDOM GILT	430,000.00	350,058.70	
	UNITED KINGDOM GILT	1,050,000.00	314,275.50	
	UNITED KINGDOM GILT	1,180,000.00	813,598.20	
	UNITED KINGDOM GILT	2,470,000.00	1,934,034.70	
	UNITED KINGDOM GILT	1,070,000.00	523,112.30	
	UNITED KINGDOM GILT	1,000,000.00	472,790.00	
	UNITED KINGDOM GILT	1,710,000.00	1,301,857.20	
	UNITED KINGDOM GILT	2,100,000.00	1,034,271.00	
	UNITED KINGDOM GILT	640,000.00	588,710.40	
	UNITED KINGDOM GILT	1,490,000.00	1,503,112.00	
	UNITED KINGDOM GILT	840,000.00	785,072.40	
イギリス・ボンド 小計		40,580,000.00 (7,840,461,800)	32,792,169.00 (6,335,774,972)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND	2,400,000.00	2,249,520.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,890,000.00	1,826,779.50	
	ISRAEL FIXED BOND	1,260,000.00	1,080,261.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,570,000.00	1,405,464.00	
	ISRAEL FIXED BOND	2,070,000.00	1,505,925.00	
	ISRAEL FIXED BOND	830,000.00	797,132.00	
	ISRAEL FIXED BOND	200,000.00	138,710.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,020,000.00	837,165.00	
イスラエル・シュケル 小計		11,240,000.00 (477,138,000)	9,840,956.50 (417,748,603)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,180,000.00	1,153,426.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	760,000.00	779,972.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	930,000.00	933,896.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	970,000.00	849,244.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,310,000.00	1,242,783.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,260,000.00	1,198,020.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	480,000.00	371,145.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,460,000.00	1,361,026.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	370,000.00	295,463.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,470,000.00	1,261,362.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,850,000.00	1,517,647.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	980,000.00	544,929.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	850,000.00	714,926.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,553,647.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,633,760.00	
オーストラリア・ドル 小計		17,170,000.00 (1,672,873,100)	15,411,253.70 (1,501,518,448)	

オフショア・人 民元	CHINA GOVERNMENT BOND	18,100,000.00	18,738,025.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,900,000.00	3,949,881.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,800,000.00	7,316,460.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,800,000.00	16,701,706.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,200,000.00	15,749,936.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,500,000.00	10,317,640.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,800,000.00	10,364,480.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,800,000.00	18,037,808.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,300,000.00	14,994,122.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,500,000.00	14,935,725.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,500,000.00	16,720,110.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,849,050.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,300,000.00	21,267,701.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	8,869,650.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,329,940.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	13,763,790.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,800,000.00	14,624,412.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,300,000.00	13,893,712.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,500,000.00	19,068,875.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,000,000.00	12,171,120.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,900,000.00	13,337,955.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,800,000.00	11,115,468.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,000,000.00	16,128,480.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	22,500,000.00	22,944,825.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,000,000.00	17,477,700.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	30,500,000.00	30,821,775.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,500,000.00	15,812,790.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	19,300,000.00	19,397,658.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,500,000.00	11,663,300.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,028,700.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,657,564.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	2,518,200.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	16,516,000.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,900,000.00	5,117,697.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,900,000.00	5,279,946.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,100,000.00	13,392,130.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,900,000.00	15,659,453.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,360,100.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	7,786,772.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	7,757,548.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,253,240.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,772,800.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,503,292.00	
CHINA GOVERNMENT BOND	8,200,000.00	10,137,988.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	6,195,118.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,953,136.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	6,261,711.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	8,369,497.00		

	CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	7,992,084.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,411,120.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,800,000.00	13,156,608.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,300,000.00	11,151,909.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	6,514,007.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,900,000.00	12,564,972.00	
オフショア・人民元 小計		603,800,000.00 (12,586,512,900)	635,675,686.00 (13,250,977,513)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT	1,460,000.00	1,433,720.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	840,000.00	771,262.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	670,000.00	707,118.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	950,000.00	967,784.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	920,000.00	917,470.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	680,000.00	814,674.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	213,557.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,039,277.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,620,000.00	1,552,219.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,660,000.00	1,616,657.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	222,736.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,310,000.00	1,034,087.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,930,000.00	1,889,373.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,180,000.00	1,082,638.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,730,000.00	3,609,632.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,070,000.00	1,895,747.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	860,000.00	631,119.60	
CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,496,448.00		
カナダ・ドル 小計		22,970,000.00 (2,455,722,700)	21,895,523.10 (2,340,850,375)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,060,000.00	1,115,650.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	730,000.00	736,570.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	310,000.00	313,072.10	
	SINGAPORE GOVERNMENT	650,000.00	655,739.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,030,000.00	1,020,833.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,320,000.00	1,261,920.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,099,010.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	940,000.00	803,700.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	740,000.00	752,950.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,380,000.00	1,396,146.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	108,750.00	
SINGAPORE GOVERNMENT	340,000.00	341,870.00		
シンガポール・ドル 小計		9,700,000.00 (1,096,197,000)	9,606,210.60 (1,085,597,860)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	2,500,000.00	2,462,325.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,310,000.00	2,230,050.90	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,897,680.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,890,000.00	2,185,218.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,550,000.00	2,278,119.00	

	SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,429,720.00	
スウェーデン・クローナ 小計		14,750,000.00 (204,877,500)	14,483,112.90 (201,170,438)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	280,000.00	289,928.80	
	KINGDOM OF DENMARK	2,130,000.00	2,061,733.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,810,000.00	1,709,762.20	
	KINGDOM OF DENMARK	1,950,000.00	1,228,461.00	
	KINGDOM OF DENMARK	3,910,000.00	3,479,118.00	
	KINGDOM OF DENMARK	3,140,000.00	4,128,126.60	
デンマーク・クローネ 小計		13,220,000.00 (283,436,800)	12,897,130.10 (276,514,469)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	430,000.00	414,640.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	830,000.00	686,136.10	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	790,000.00	673,522.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	450,000.00	398,866.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	710,000.00	671,070.70	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	440,000.00	298,469.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	490,000.00	467,837.30	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	210,000.00	208,441.80	
ニュージーランド・ドル 小計		4,350,000.00 (385,584,000)	3,818,984.80 (338,514,813)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	300,000.00	303,915.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	890,000.00	865,631.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,850,000.00	2,738,394.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,870,000.00	3,589,966.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,613,030.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,750,000.00	2,519,797.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,150,000.00	1,161,258.50	
ノルウェー・クローネ 小計		14,810,000.00 (201,860,300)	13,791,993.60 (187,984,873)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	2,900,000.00	2,979,025.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,950,000.00	1,903,941.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	650,000.00	619,060.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,750,000.00	2,644,427.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,320,000.00	2,176,438.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,820,000.00	2,615,239.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,310,000.00	2,061,213.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,180,000.00	1,734,582.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	460,000.00	494,348.20	
ポーランド・ズロチ 小計		18,340,000.00 (688,588,138)	17,228,275.30 (646,847,656)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,800,000.00	5,551,760.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,400,000.00	3,790,600.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,450,000.00	13,089,243.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,600,000.00	10,769,976.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	27,500,000.00	26,319,425.00	

	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	6,779,855.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,670,000.00	11,167,489.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,300,000.00	10,824,835.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,050,000.00	10,625,810.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,870,000.00	10,009,965.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,700,000.00	6,044,115.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,900,000.00	9,400,814.00	
メキシコ・ペソ	小計	138,740,000.00 (1,039,065,482)	124,373,889.40 (931,473,370)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	690,000.00	833,147.40	
	BELGIUM KINGDOM	340,000.00	374,472.60	
	BELGIUM KINGDOM	620,000.00	640,627.40	
	BELGIUM KINGDOM	640,000.00	586,764.80	
	BELGIUM KINGDOM	890,000.00	875,849.00	
	BELGIUM KINGDOM	320,000.00	243,113.60	
	BELGIUM KINGDOM	430,000.00	335,060.30	
	BELGIUM KINGDOM	550,000.00	532,961.00	
	BELGIUM KINGDOM	580,000.00	466,853.60	
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	599,872.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,570,000.00	1,499,664.00	
	BELGIUM KINGDOM	790,000.00	745,112.20	
	BELGIUM KINGDOM	360,000.00	269,524.80	
	BELGIUM KINGDOM	690,000.00	612,237.00	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	136,606.00	
	BELGIUM KINGDOM	730,000.00	847,697.90	
	BELGIUM KINGDOM	670,000.00	568,836.70	
	BELGIUM KINGDOM	660,000.00	563,567.40	
	BELGIUM KINGDOM	710,000.00	475,515.40	
	BELGIUM KINGDOM	830,000.00	857,780.10	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,620,000.00	1,690,777.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	210,000.00	234,248.70	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	719,952.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,010,000.00	1,964,815.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	690,000.00	656,376.30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	670,000.00	675,427.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,930,000.00	1,901,629.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,830,000.00	1,803,025.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,800,000.00	1,761,876.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,850,000.00	1,811,686.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	464,334.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,080,000.00	1,319,544.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,099,557.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,260,000.00	3,165,329.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,590,000.00	2,499,945.70	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	868,043.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,410,000.00	1,297,890.90	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	724,213.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,310,000.00	2,251,441.50	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,310,000.00	1,130,346.60	



BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,890,000.00	1,473,141.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	880,000.00	771,012.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,050,000.00	749,836.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	896,148.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,550,000.00	1,548,047.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,120,000.00	1,129,441.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	540,000.00	558,252.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	635,430.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,720,000.00	1,769,656.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,170,000.00	3,112,527.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	980,000.00	1,203,577.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,240,000.00	2,168,700.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,880,000.00	2,780,956.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,590,000.00	2,499,505.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,150,000.00	1,421,446.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	984,720.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	403,345.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000.00	2,300,352.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,050,000.00	2,877,522.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000.00	1,965,285.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,220,000.00	2,034,896.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,610,000.00	899,168.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	745,001.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,050,000.00	2,767,875.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,160,000.00	927,478.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,230,000.00	1,455,852.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,680,000.00	1,493,671.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,210,000.00	1,064,134.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,090,000.00	581,645.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	940,000.00	817,001.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	910,000.00	932,859.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	920,000.00	900,689.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,156,701.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,440,000.00	2,487,214.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	529,591.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	763,875.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	660,000.00	765,514.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,790,000.00	1,929,029.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,570,000.00	2,376,222.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	960,000.00	957,225.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,220,000.00	1,454,618.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,360,000.00	1,175,121.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,530,000.00	2,484,713.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	451,346.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,018,583.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,840,000.00	2,825,203.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,350,000.00	1,287,927.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,960,000.00	4,912,284.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,340,000.00	1,508,907.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	980,000.00	995,141.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,150,000.00	1,173,069.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	308,055.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,290,000.00	1,318,896.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	525,833.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	830,000.00	976,453.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,080,000.00	1,951,414.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	824,348.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	930,000.00	746,241.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,030,000.00	860,606.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	740,000.00	857,593.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,821,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	434,780.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,080,000.00	1,858,688.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	680,000.00	463,372.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,660,000.00	1,443,320.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	910,000.00	644,716.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,360,000.00	2,276,928.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,550,000.00	4,419,642.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	252,045.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,860,000.00	1,807,957.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	770,000.00	779,317.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	640,000.00	711,398.40	
DEUTSCHLAND REP	420,000.00	503,617.80	
FINNISH GOVERNMENT	260,000.00	261,783.60	
FINNISH GOVERNMENT	550,000.00	562,056.00	
FINNISH GOVERNMENT	240,000.00	235,248.00	
FINNISH GOVERNMENT	210,000.00	201,434.10	
FINNISH GOVERNMENT	470,000.00	416,448.20	
FINNISH GOVERNMENT	370,000.00	286,864.70	
FINNISH GOVERNMENT	410,000.00	378,589.90	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	343,090.00	
FINNISH GOVERNMENT	310,000.00	272,149.00	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	71,436.40	
FINNISH GOVERNMENT	260,000.00	224,367.00	
FINNISH GOVERNMENT	220,000.00	212,106.40	
FINNISH GOVERNMENT	50,000.00	33,926.00	
FINNISH GOVERNMENT	310,000.00	289,856.20	
FRANCE (GOVT OF)	3,130,000.00	3,174,727.70	
FRANCE (GOVT OF)	1,330,000.00	1,352,929.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,230,000.00	1,433,343.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,190,000.00	1,194,022.20	
FRANCE (GOVT OF)	4,510,000.00	4,514,194.30	
FRANCE (GOVT OF)	3,740,000.00	3,506,250.00	
FRANCE (GOVT OF)	550,000.00	361,185.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,520,000.00	1,269,823.20	
FRANCE (GOVT OF)	2,410,000.00	2,323,625.60	
FRANCE (GOVT OF)	950,000.00	804,203.50	
FRANCE (GOVT OF)	2,870,000.00	2,789,066.00	

FRANCE (GOVT OF)	960,000.00	761,865.60	
FRANCE (GOVT OF)	3,760,000.00	3,567,788.80	
FRANCE (GOVT OF)	3,240,000.00	2,820,420.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,510,000.00	3,297,188.70	
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,653,240.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,220,000.00	1,426,594.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,330,000.00	921,929.40	
FRANCE (GOVT OF)	4,810,000.00	4,424,141.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,140,000.00	622,964.40	
FRANCE (GOVT OF)	2,900,000.00	2,826,427.00	
FRANCE (GOVT OF)	890,000.00	905,806.40	
FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	874,676.40	
FRANCE (GOVT OF)	960,000.00	651,648.00	
FRANCE (GOVT OF)	420,000.00	159,280.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,690,000.00	902,662.80	
FRANCE (GOVT OF)	3,110,000.00	2,556,109.00	
FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	1,142,090.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,530,000.00	1,451,648.70	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,225,840.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,150,000.00	1,035,437.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	380,000.00	343,102.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	420,000.00	413,582.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	460,000.00	419,239.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	350,000.00	337,323.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	340,000.00	313,983.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	450,000.00	430,776.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	240,000.00	191,061.60	
IRELAND GOVERNMENT BOND	840,000.00	750,027.60	
IRELAND GOVERNMENT BOND	270,000.00	231,916.50	
IRELAND GOVERNMENT BOND	230,000.00	167,594.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	730,000.00	743,205.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	650,000.00	683,845.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	920,000.00	898,260.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	960,000.00	930,163.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,090,000.00	1,041,778.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	870,000.00	1,013,871.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	870,000.00	801,330.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	940,000.00	711,984.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	860,000.00	765,365.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	587,625.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	130,000.00	124,736.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,230,000.00	652,096.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	304,472.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,010,000.00	891,335.10	
OBRIGACOES DO TESOURO	410,000.00	361,062.40	
OBRIGACOES DO TESOURO	250,000.00	275,930.00	
OBRIGACOES DO TESOURO	500,000.00	483,080.00	
OBRIGACOES DO TESOURO	400,000.00	412,772.00	
OBRIGACOES DO TESOURO	460,000.00	419,198.00	

	OBRIGACOES DO TESOURO	200,000.00	168,442.00	
	OBRIGACOES DO TESOURO	400,000.00	306,184.00	
	OBRIGACOES DO TESOURO	500,000.00	502,350.00	
	OBRIGACOES DO TESOURO	250,000.00	239,282.50	
	OBRIGACOES DO TESOURO	330,000.00	334,253.70	
	OBRIGACOES DO TESOURO	370,000.00	368,538.50	
	OBRIGACOES DO TESOURO	550,000.00	632,049.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	430,000.00	427,088.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	171,754.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	380,000.00	400,736.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,520,000.00	1,484,052.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	490,000.00	389,275.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	78,948.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	410,000.00	338,045.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	890,000.00	852,255.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	720,000.00	833,299.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	770,000.00	718,309.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	520,000.00	463,325.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	530,000.00	334,080.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	130,914.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	690,000.00	598,243.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	812,331.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	413,524.00	
	ユーロ 小計	242,490,000.00 (38,776,575,900)	229,452,303.30 (36,691,717,821)	
国債証券 合計		131,102,621,820 (131,102,621,820)	121,158,335,263 (121,158,335,263)	
合計			121,158,335,263 (121,158,335,263)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 63銘柄	46.88	47.01
イギリス・ポンド	国債証券 35銘柄	5.22	5.23
イスラエル・シュケル	国債証券 8銘柄	0.34	0.34
オーストラリア・ドル	国債証券 15銘柄	1.24	1.24
オフショア・人民元	国債証券 54銘柄	10.91	10.94
カナダ・ドル	国債証券 18銘柄	1.93	1.93
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.89	0.90
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.17	0.17
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.23	0.23
ニュージーランド・ドル	国債証券 8銘柄	0.28	0.28
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.15	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券 9銘柄	0.53	0.53
メキシコ・ペソ	国債証券 12銘柄	0.77	0.77

ユーロ	国債証券	210銘柄	30.20	30.28
-----	------	-------	-------	-------

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年12月10日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	141,622,317
金銭信託	2,479,698
コール・ローン	225,952,304
国債証券	91,449,718,640
派生商品評価勘定	15,560
未収利息	575,608,888
前払費用	63,333,747
流動資産合計	92,458,731,154
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	877,477
未払金	101,280,776
未払解約金	142,865,244
流動負債合計	245,023,497
負債合計	245,023,497
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	51,893,236,881
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	40,320,470,776
元本等合計	92,213,707,657
純資産合計	92,213,707,657
負債純資産合計	92,458,731,154

## 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12月12日 至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価して おります。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の 仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に 換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令 第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2024年12月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,638,546,039円
同期中追加設定元本額	18,761,227,388円
同期中一部解約元本額	10,506,536,546円
元本の内訳	
ファンド名	
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	3,739,510,433円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,964,566,775円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,138,689,689円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	952,251,570円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	1,747,004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)	1,818,945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)	4,165,953円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	16,425,135,964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)	9,552,349,015円
DCニッセイ外国債券インデックス	5,358,485,469円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	423,501,122円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	2,304,341,718円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	490,575,987円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	666,615,961円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	47,020,826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)	232,523,906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)	23,674,185円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	53,697,350円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	351,389,105円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	238,154,172円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	426,399,555円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	235,170,581円
FWニッセイ外国債インデックス	87,462,808円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	170,478,624円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	3,453,343円
ニッセイインデックスバランス(外国株式重視型)SA(適格機関投資家限定)	56,821円
計	51,893,236,881円
2. 受益権の総数	51,893,236,881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12月12日 至 2024年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年12月10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12月10日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		1,133,816,056
合計		1,133,816,056

（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（2024年11月21日から2024年12月10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12月10日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	124,257,817	-	123,395,900	861,917
アメリカ・ドル	75,973,217	-	75,095,740	877,477
イギリス・ポンド	4,011,461	-	4,011,650	189
オフショア・人民元	14,577,500	-	14,589,750	12,250
カナダ・ドル	2,103,015	-	2,103,027	12
ノルウェー・クローネ	635,800	-	635,991	191
ユーロ	26,956,824	-	26,959,742	2,918
合計	124,257,817	-	123,395,900	861,917

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	2024年12月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7770円 (17,770円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

該当事項はありません。

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

2024年12月10日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	126,834.00	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	125,100.00	
		US TREASURY BONDS	180,000.00	192,641.40	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	102,214.00	
		US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,117,835.60	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,131,091.00	
		US TREASURY N/B	520,000.00	409,214.00	
		US TREASURY N/B	890,000.00	825,501.70	
		US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,151,294.00	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,122,996.60	
		US TREASURY N/B	900,000.00	832,815.00	
		US TREASURY N/B	180,000.00	186,116.40	
		US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,424,572.00	
		US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,371,196.80	
		US TREASURY N/B	690,000.00	550,081.80	
		US TREASURY N/B	960,000.00	949,459.20	
		US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,680,050.40	
		US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,615,037.40	
		US TREASURY N/B	980,000.00	1,017,583.00	
		US TREASURY N/B	500,000.00	445,425.00	
		US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,718,600.00	
		US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,569,170.40	
		US TREASURY N/B	980,000.00	982,979.20	
		US TREASURY N/B	510,000.00	461,646.90	
		US TREASURY N/B	2,740,000.00	2,777,236.60	
		US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,638,744.40	
		US TREASURY N/B	980,000.00	998,061.40	
		US TREASURY N/B	2,740,000.00	2,669,773.80	
		US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,492,943.40	
		US TREASURY N/B	750,000.00	713,670.00	
		US TREASURY N/B	670,000.00	548,220.80	
		US TREASURY N/B	970,000.00	974,083.70	
		US TREASURY N/B	530,000.00	539,767.90	
		US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,158,984.80	
		US TREASURY N/B	450,000.00	374,130.00	
		US TREASURY N/B	530,000.00	470,147.10	
		US TREASURY N/B	490,000.00	417,950.40	
		US TREASURY N/B	560,000.00	447,820.80	
		US TREASURY N/B	740,000.00	542,020.40	
		US TREASURY N/B	340,000.00	271,014.00	
US TREASURY N/B	480,000.00	373,814.40			
US TREASURY N/B	300,000.00	238,170.00			
US TREASURY N/B	23,090,000.00	22,396,376.40			
US TREASURY N/B	600,000.00	434,178.00			
US TREASURY N/B	12,620,000.00	12,171,359.00			
US TREASURY N/B	600,000.00	432,702.00			

US TREASURY N/B	15,180,000.00	14,528,778.00	
US TREASURY N/B	750,000.00	513,772.50	
US TREASURY N/B	10,840,000.00	10,412,687.20	
US TREASURY N/B	340,000.00	261,494.00	
US TREASURY N/B	7,980,000.00	7,671,014.40	
US TREASURY N/B	670,000.00	525,682.00	
US TREASURY N/B	8,580,000.00	8,236,800.00	
US TREASURY N/B	520,000.00	407,102.80	
US TREASURY N/B	7,810,000.00	7,447,225.50	
US TREASURY N/B	730,000.00	544,872.00	
US TREASURY N/B	6,340,000.00	6,019,005.80	
US TREASURY N/B	150,000.00	151,980.00	
US TREASURY N/B	740,000.00	550,981.80	
US TREASURY N/B	5,930,000.00	5,693,689.50	
US TREASURY N/B	190,000.00	194,615.10	
US TREASURY N/B	860,000.00	669,518.60	
US TREASURY N/B	6,310,000.00	6,064,477.90	
US TREASURY N/B	890,000.00	707,923.80	
US TREASURY N/B	190,000.00	174,161.60	
US TREASURY N/B	270,000.00	267,975.00	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	6,805,137.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	776,320.00	
US TREASURY N/B	280,000.00	285,194.00	
US TREASURY N/B	5,430,000.00	5,240,112.90	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	846,396.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	301,077.00	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,386,509.40	
US TREASURY N/B	9,370,000.00	8,843,593.40	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	836,611.20	
US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,515,990.20	
US TREASURY N/B	9,120,000.00	8,494,368.00	
US TREASURY N/B	320,000.00	329,686.40	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	777,763.30	
US TREASURY N/B	2,290,000.00	2,211,636.20	
US TREASURY N/B	8,720,000.00	7,824,804.80	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	662,070.00	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,080,912.80	
US TREASURY N/B	5,630,000.00	5,057,316.40	
US TREASURY N/B	290,000.00	274,116.70	
US TREASURY N/B	940,000.00	638,683.00	
US TREASURY N/B	3,890,000.00	3,422,577.60	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,142.00	
US TREASURY N/B	1,190,000.00	740,394.20	
US TREASURY N/B	160,000.00	172,204.80	
US TREASURY N/B	920,000.00	583,767.60	
US TREASURY N/B	320,000.00	334,198.40	
US TREASURY N/B	5,110,000.00	4,213,706.00	
US TREASURY N/B	1,540,000.00	809,701.20	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	692,054.00	

US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,425,318.00	
US TREASURY N/B	5,440,000.00	4,527,494.40	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	859,125.60	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	821,104.20	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,054,415.70	
US TREASURY N/B	5,550,000.00	4,665,219.00	
US TREASURY N/B	1,660,000.00	993,012.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,057,380.00	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,193,318.30	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,049,639.50	
US TREASURY N/B	5,710,000.00	4,909,229.60	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,159,108.00	
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,265,817.40	
US TREASURY N/B	900,000.00	817,731.00	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	941,056.20	
US TREASURY N/B	5,910,000.00	4,923,266.40	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,051,102.80	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,174,020.40	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,283,445.60	
US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,499,994.00	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,303,496.00	
US TREASURY N/B	1,580,000.00	938,678.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	254,073.00	
US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,032,774.80	
US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,751,606.60	
US TREASURY N/B	1,820,000.00	1,648,010.00	
US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,055,400.00	
US TREASURY N/B	1,440,000.00	938,692.80	
US TREASURY N/B	330,000.00	278,447.40	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	846,562.10	
US TREASURY N/B	290,000.00	239,168.80	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,004,102.20	
US TREASURY N/B	2,290,000.00	2,104,097.80	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	889,928.00	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,052,260.80	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,007,363.80	
US TREASURY N/B	910,000.00	790,134.80	
US TREASURY N/B	350,000.00	276,689.00	
US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,277,492.00	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,209,000.00	
US TREASURY N/B	890,000.00	841,673.00	
US TREASURY NOTES	150,000.00	165,585.00	
WI TREASURY SEC.	310,000.00	310,883.50	
WI TREASURY SEC.	1,380,000.00	704,931.60	
WI TREASURY SEC.	4,420,000.00	3,676,335.00	
WI TREASURY SEC.	300,000.00	300,105.00	
WI TREASURY SEC.	280,000.00	258,759.20	
アメリカ・ドル 小計	314,200,000.00 (47,613,868,000)	283,514,475.40 (42,963,783,603)	

イギリス・ボンド	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	285,159.60	
	UNITED KINGDOM GILT	800,000.00	809,640.00	
	UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	415,027.80	
	UNITED KINGDOM GILT	750,000.00	770,310.00	
	UNITED KINGDOM GILT	650,000.00	651,859.00	
	UNITED KINGDOM GILT	850,000.00	841,049.50	
	UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	303,260.10	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	455,459.90	
	UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	390,636.20	
	UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	445,657.50	
	UNITED KINGDOM GILT	750,000.00	750,157.50	
	UNITED KINGDOM GILT	580,000.00	578,909.60	
	UNITED KINGDOM GILT	190,000.00	186,029.00	
	UNITED KINGDOM GILT	100,000.00	100,606.00	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	410,610.20	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	251,499.00	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	222,973.10	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	383,900.00	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	243,223.20	
	UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	379,200.30	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	249,900.00	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	370,656.00	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	372,516.00	
	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	382,181.50	
	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	373,760.10	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	330,649.20	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	193,283.20	
	UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	165,706.00	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	367,318.80	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	300,647.30	
	UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	300,846.00	
	UNITED KINGDOM GILT	530,000.00	550,028.70	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	166,458.60	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	269,597.70	
	UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	337,779.00	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	335,923.00	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	485,594.90	
	UNITED KINGDOM GILT	460,000.00	449,916.80	
	UNITED KINGDOM GILT	590,000.00	360,372.00	
	UNITED KINGDOM GILT	430,000.00	350,058.70	
	UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	179,586.00	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	307,001.60	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	436,232.30	
	UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	186,068.30	
UNITED KINGDOM GILT	550,000.00	379,219.50		
UNITED KINGDOM GILT	660,000.00	516,786.60		
UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	195,556.00		
UNITED KINGDOM GILT	630,000.00	588,879.90		

	UNITED KINGDOM GILT	620,000.00	293,129.80	
	UNITED KINGDOM GILT	560,000.00	365,260.00	
	UNITED KINGDOM GILT	660,000.00	573,282.60	
	UNITED KINGDOM GILT	760,000.00	578,603.20	
	UNITED KINGDOM GILT	550,000.00	270,880.50	
	UNITED KINGDOM GILT	830,000.00	672,432.80	
	UNITED KINGDOM GILT	250,000.00	89,915.00	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	285,156.60	
	UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	514,488.00	
	UNITED KINGDOM GILT	740,000.00	738,298.00	
	UNITED KINGDOM GILT	740,000.00	689,754.00	
	UNITED KINGDOM GILT	770,000.00	719,649.70	
	UNITED KINGDOM GILT	650,000.00	541,677.50	
イギリス・ボンド 小計		29,800,000.00 (5,757,658,000)	24,710,218.90 (4,774,261,394)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND	800,000.00	809,960.00	
	ISRAEL FIXED BOND	490,000.00	488,407.50	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	517,660.00	
	ISRAEL FIXED BOND	790,000.00	740,467.00	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	344,371.50	
	ISRAEL FIXED BOND	580,000.00	560,599.00	
	ISRAEL FIXED BOND	880,000.00	754,468.00	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	600,184.00	
	ISRAEL FIXED BOND	600,000.00	537,120.00	
	ISRAEL FIXED BOND	740,000.00	538,350.00	
	ISRAEL FIXED BOND	660,000.00	633,864.00	
	ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	277,420.00	
	ISRAEL FIXED BOND	690,000.00	566,317.50	
イスラエル・シュケル 小計		8,000,000.00 (339,600,000)	7,369,188.50 (312,822,052)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	480,000.00	452,769.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	202,380.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	518,064.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	160,000.00	160,939.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	330,000.00	330,366.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	580,000.00	595,242.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	460,000.00	461,927.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	411,489.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	360,000.00	341,528.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	230,000.00	202,107.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	427,864.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	505,086.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	239,698.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	423,315.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	475,510.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	590,000.00	550,003.90	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	271,507.00		

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	590,000.00	506,261.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	574,245.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	396,195.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	250,222.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	710,000.00	580,673.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	620,000.00	584,746.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	610,000.00	513,064.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	590,000.00	539,206.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	540,000.00	551,394.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	560,000.00	541,542.40	
	オーストラリア・ドル 小計	12,790,000.00 (1,246,129,700)	11,607,353.70 (1,130,904,471)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,555,100.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,089,530.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,411,395.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,879,388.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,569,036.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	8,982,416.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	8,355,040.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,600,000.00	17,835,136.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	7,759,196.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	11,639,565.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,080,040.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,697,856.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,300,000.00	12,886,341.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	12,180,986.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,400,000.00	11,817,924.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,744,250.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,901,816.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,090,270.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,800,000.00	14,416,032.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,000,000.00	17,522,750.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,000,000.00	16,228,160.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,600,000.00	10,959,870.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,262,890.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,032,120.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,197,700.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,400,000.00	12,748,440.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,105,500.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	7,753,368.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,500,000.00	14,573,370.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,600,000.00	2,171,712.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,344,840.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,028,700.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,400,000.00	3,454,366.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,036,400.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,900,000.00	6,474,272.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,500,000.00	6,844,695.00	



	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,587,936.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,920,000.00	11,472,879.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,226,412.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,653,409.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,542,780.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,400,000.00	17,788,020.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	7,777,178.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,140,000.00	4,438,162.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	4,659,298.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,266,336.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,316,550.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,778,560.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,866,562.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	6,676,236.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,725,090.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,358,546.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,800,000.00	10,059,798.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,720,922.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,206,360.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,542,104.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	700,000.00	866,278.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	10,586,958.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	6,954,954.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,700,000.00	6,086,859.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,900,000.00	7,285,572.00	
	オフショア・人民元 小計	464,070,000.00 (9,673,771,185)	488,074,231.20 (10,174,151,386)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT	450,000.00	441,900.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	550,902.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	240,000.00	240,079.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	242,742.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	450,000.00	456,502.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	490,000.00	499,172.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	627,582.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	520,000.00	528,637.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	777,855.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	590,000.00	598,195.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	135,007.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	680,000.00	699,380.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	488,030.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	233,052.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	143,766.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	570,000.00	579,843.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	470,000.00	472,928.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	210,000.00	208,794.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	220,521.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	139,276.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	186,285.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	213,567.60	

	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	191,632.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	175,300.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	228,423.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	200,462.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	930,000.00	734,123.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	137,053.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	740,000.00	678,942.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	640,000.00	556,281.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	406,446.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	840,000.00	769,288.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	410,000.00	397,171.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	710,000.00	521,040.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	636,097.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	380,000.00	367,049.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	550,000.00	514,404.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	126,488.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	369,115.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	463,579.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	336,758.40	
カナダ・ドル 小計		17,130,000.00 (1,831,368,300)	16,493,680.50 (1,763,339,382)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	100,780.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	50,760.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	63,479.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	67,299.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	210,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	141,260.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	220,000.00	222,180.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	201,766.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	240,000.00	237,864.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	191,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	159,856.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	134,346.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	136,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	213,675.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	202,340.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	131,180.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	110,110.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	204,399.30	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	152,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	119,412.00	
SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	100,550.00		
シンガポール・ドル 小計		3,180,000.00 (359,371,800)	3,152,008.30 (356,208,458)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	730,000.00	743,081.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,020,000.00	1,989,558.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,070,000.00	1,092,512.80	

	SWEDISH GOVERNMENT	1,790,000.00	1,728,048.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,820,000.00	1,726,888.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,010,000.00	1,167,762.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,161,394.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,360,000.00	1,332,691.20	
スウェーデン・クローナ 小計		11,100,000.00 (154,179,000)	10,941,937.10 (151,983,506)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,480,000.00	1,532,480.80	
	KINGDOM OF DENMARK	640,000.00	647,084.80	
	KINGDOM OF DENMARK	1,290,000.00	1,248,655.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,200,000.00	1,133,544.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,490,000.00	938,670.20	
	KINGDOM OF DENMARK	1,200,000.00	1,067,760.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,390,000.00	3,142,109.10	
デンマーク・クローネ 小計		9,690,000.00 (207,753,600)	9,710,304.40 (208,188,926)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	300,000.00	307,152.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	100,452.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	120,708.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	146,506.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	190,000.00	193,093.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	241,070.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	170,000.00	140,533.90	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	220,000.00	187,563.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	330,000.00	292,502.10	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	340,000.00	321,357.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	130,000.00	85,147.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	101,751.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	260,000.00	248,240.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	230,000.00	197,533.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	190,000.00	188,590.20	
ニュージーランド・ドル 小計		3,130,000.00 (277,443,200)	2,872,200.70 (254,591,870)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,294,788.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,090,000.00	1,104,224.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,360,000.00	1,322,763.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,240,000.00	1,191,441.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,009,809.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	946,192.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,280,000.00	1,147,110.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	923,270.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,070,000.00	980,430.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	470,000.00	474,601.30	
ノルウェー・クローネ 小計		10,990,000.00 (149,793,700)	10,394,632.10 (141,678,836)	

ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,180,000.00	1,212,155.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,160,000.00	1,132,600.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	560,000.00	533,344.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	218,402.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,240,000.00	1,192,396.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,180,000.00	1,106,981.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	890,000.00	825,377.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,220,000.00	1,088,606.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,120,000.00	1,139,779.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,170,000.00	930,945.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	930,000.00	852,717.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,100,000.00	853,028.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	770,000.00	747,685.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,030,000.00	1,106,910.10	
ポーランド・ズロチ 小計		13,770,000.00 (517,004,289)	12,940,929.00 (485,876,238)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA GOVERNMENT	500,000.00	523,045.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	350,203.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	354,805.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	220,000.00	224,039.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	553,613.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	635,388.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	411,127.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	211,692.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	616,039.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	365,004.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	390,548.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	362,922.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	470,000.00	474,770.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	261,919.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	590,000.00	637,471.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	530,000.00	535,994.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	603,388.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	570,000.00	605,847.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	640,000.00	648,524.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	459,437.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	352,999.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	460,000.00	461,656.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	540,000.00	526,732.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	640,000.00	632,454.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	638,037.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	390,000.00	385,503.30	
MALAYSIA GOVERNMENT	560,000.00	606,032.00		
MALAYSIA GOVERNMENT	230,000.00	238,733.10		
MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	340,391.00		
マレーシア・リングgit 小計		13,070,000.00 (447,225,339)	13,408,320.50 (458,801,888)	

メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,100,000.00	6,827,502.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	600,000.00	522,672.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,250,000.00	6,939,700.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,720,000.00	4,927,780.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,280,000.00	8,406,102.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,970,000.00	7,103,432.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,150,000.00	8,757,190.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,940,000.00	4,737,922.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,950,000.00	1,954,426.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,220,000.00	7,866,046.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,340,000.00	7,989,303.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,910,000.00	4,329,687.10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,220,000.00	8,490,513.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,450,000.00	5,847,877.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,250,000.00	6,252,835.00	
メキシコ・ペソ	小計	101,350,000.00 (759,040,555)	90,952,991.30 (681,174,238)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	253,237.50	
	BELGIUM KINGDOM	120,000.00	126,682.80	
	BELGIUM KINGDOM	380,000.00	386,520.80	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	198,861.60	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	204,036.00	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	567,506.20	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	253,319.70	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	231,228.90	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	227,319.40	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	366,728.00	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	267,714.20	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	187,404.00	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	393,640.00	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	189,932.50	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	155,842.00	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	377,917.80	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	152,934.80	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	137,113.60	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	519,138.50	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	382,080.00	
	BELGIUM KINGDOM	280,000.00	254,111.20	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	443,294.60	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	187,170.00	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	292,809.00	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	136,606.00	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	235,597.50	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	464,492.00	
	BELGIUM KINGDOM	320,000.00	271,683.20	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	71,729.60	
BELGIUM KINGDOM	390,000.00	333,017.10		
BELGIUM KINGDOM	240,000.00	160,737.60		
BELGIUM KINGDOM	190,000.00	186,865.00		

BELGIUM KINGDOM	440,000.00	454,726.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	571,917.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	427,931.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	619,851.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	577,186.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	543,769.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	594,903.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	220,000.00	245,403.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	527,108.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	593,280.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	610,000.00	699,602.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	180,000.00	186,690.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,000.00	30,455.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	577,467.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	553,035.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	593,112.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	576,736.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	528,457.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	437,584.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	372,997.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	640,445.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	581,303.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	508,986.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	567,988.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	632,593.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	409,707.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	586,464.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	733,038.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	553,447.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	550,181.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	493,414.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	533,884.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	543,972.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	511,227.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	317,995.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	680,000.00	636,956.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	614,029.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	343,048.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	458,085.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	640,000.00	552,230.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	170,000.00	95,094.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	640,000.00	596,979.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	296,187.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	525,690.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	310,000.00	221,380.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	487,106.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	620,000.00	544,936.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	343,523.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	620,000.00	578,745.20	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	529,332.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	361,207.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	564,547.20	
BUNDES OblIGATION	670,000.00	681,691.50	
BUNDES OblIGATION	590,000.00	593,587.20	
BUNDES OblIGATION	90,000.00	90,569.70	
BUNDES OblIGATION	460,000.00	471,026.20	
BUNDES OblIGATION	640,000.00	623,404.80	
BUNDES OblIGATION	550,000.00	531,003.00	
BUNDES OblIGATION	510,000.00	487,743.60	
BUNDES OblIGATION	680,000.00	669,330.80	
BUNDES OblIGATION	220,000.00	216,539.40	
BUNDES OblIGATION	570,000.00	575,352.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	230,000.00	234,602.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	220,000.00	196,099.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	739,784.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	654,668.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	806,744.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	450,000.00	465,210.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	206,518.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	718,766.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	771,652.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	746,221.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	700,039.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	716,445.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	685,583.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	733,445.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	543,857.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	490,000.00	643,350.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	685,686.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	613,427.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	622,677.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	627,019.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	614,135.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	980,000.00	547,320.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	450,000.00	507,955.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	580,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	473,380.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	439,752.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	683,338.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	757,516.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	230,000.00	206,841.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	577,908.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	466,662.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	280,000.00	156,648.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	650,793.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	576,234.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	184,718.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	405,551.20	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	608,405.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	270,000.00	324,990.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	738,086.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	527,731.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	626,566.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	590,000.00	593,646.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	622,839.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	880,000.00	897,028.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	310,000.00	312,743.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	440,000.00	442,217.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	430,000.00	435,336.30	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	560,000.00	566,518.40	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	200,000.00	200,030.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	383,108.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	377,163.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	280,365.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	389,269.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	540,749.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	418,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	451,743.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	512,887.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	395,370.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	435,588.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	395,440.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	447,673.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	408,861.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	545,138.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	353,181.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	454,938.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	477,778.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	384,000.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	226,033.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	318,769.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	732,512.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	263,408.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	391,670.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	203,618.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	270,527.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	223,916.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	780,000.00	840,582.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	90,000.00	90,837.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	416,209.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	670,000.00	701,134.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	630,000.00	582,498.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	660,666.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	478,612.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	740,000.00	882,309.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	371,545.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	505,557.90	



BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	362,224.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	481,229.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	205,157.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	422,941.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	469,793.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	436,410.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	447,655.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	362,527.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	544,709.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	788,235.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	517,879.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	438,625.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	421,008.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	552,096.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	305,939.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	705,870.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	487,853.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	647,702.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	304,915.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	292,439.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	660,000.00	764,880.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	391,601.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	554,229.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	508,415.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	324,109.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	431,235.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	545,096.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	265,757.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	307,164.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	426,040.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	226,713.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	492,012.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	115,424.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	355,676.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	406,336.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	424,512.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	447,110.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	466,248.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	420,453.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	409,352.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	630,000.00	703,376.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	359,353.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	419,424.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	163,088.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	380,019.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	486,010.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	374,477.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	296,028.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	444,158.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	324,444.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	404,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	542,523.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	561,084.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	433,465.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	333,468.00	
DEUTSCHLAND REP	380,000.00	421,822.80	
DEUTSCHLAND REP	300,000.00	333,939.00	
DEUTSCHLAND REP	330,000.00	362,079.30	
DEUTSCHLAND REP	480,000.00	575,563.20	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	90,617.40	
FINNISH GOVERNMENT	190,000.00	197,772.90	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	143,805.20	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	113,681.70	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	145,698.00	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	121,518.00	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	122,630.40	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	137,995.20	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	99,877.80	
FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	166,634.00	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	134,289.40	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	115,187.80	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	108,543.40	
FINNISH GOVERNMENT	190,000.00	175,444.10	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	90,888.00	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	61,756.20	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	114,127.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	51,026.00	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	120,813.00	
FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	159,934.30	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	86,770.80	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	67,852.00	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	130,902.80	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	98,372.00	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	558,162.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,080,000.00	1,086,544.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,420,000.00	1,440,291.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,330,000.00	1,347,662.40	
FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	986,722.80	
FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	850,683.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,090,000.00	1,149,285.10	
FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	835,594.20	
FRANCE (GOVT OF)	230,000.00	219,493.60	
FRANCE (GOVT OF)	720,000.00	722,433.60	
FRANCE (GOVT OF)	440,000.00	427,631.60	
FRANCE (GOVT OF)	690,000.00	698,376.60	
FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	848,996.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,480,000.00	1,481,376.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,480,000.00	1,387,500.00	

FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	1,092,511.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,170,000.00	1,142,598.60	
FRANCE (GOVT OF)	410,000.00	269,247.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,110,000.00	927,305.10	
FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	877,385.60	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	677,224.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,030,000.00	1,000,954.00	
FRANCE (GOVT OF)	710,000.00	563,463.10	
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,423,320.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,380,000.00	1,201,290.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,400,000.00	1,315,118.00	
FRANCE (GOVT OF)	620,000.00	683,339.20	
FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	1,029,019.20	
FRANCE (GOVT OF)	750,000.00	519,885.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,340,000.00	1,232,505.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	976,261.00	
FRANCE (GOVT OF)	760,000.00	415,309.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,060,000.00	1,033,107.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	1,027,937.60	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	560,690.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	1,120,405.00	
FRANCE (GOVT OF)	690,000.00	468,372.00	
FRANCE (GOVT OF)	310,000.00	117,564.40	
FRANCE (GOVT OF)	530,000.00	325,446.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,330,000.00	1,111,800.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,080,000.00	1,030,071.60	
FRANCE (GOVT OF)	770,000.00	411,272.40	
FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	772,586.00	
FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	543,870.80	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	971,992.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,170,000.00	1,114,717.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,160,000.00	1,100,596.40	
FRANCE (GOVT OF)	520,000.00	579,488.00	
FRANCE (GOVT OF)	480,000.00	432,182.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	111,868.90	
IRELAND GOVERNMENT BOND	260,000.00	234,754.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	222,626.80	
IRELAND GOVERNMENT BOND	260,000.00	256,027.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	154,936.30	
IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	183,118.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	130,000.00	120,052.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	152,182.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	230,000.00	220,174.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	167,178.90	
IRELAND GOVERNMENT BOND	120,000.00	97,561.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	181,974.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	160,720.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	171,790.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	100,000.00	72,867.00	

IRELAND GOVERNMENT BOND	90,000.00	95,634.00	
IRISH GOVERNMENT BOND	120,000.00	103,674.00	
ITALIAN GOVT	240,000.00	262,392.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	285,065.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	285,381.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	210,000.00	234,658.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	294,419.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	480,000.00	504,993.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	367,322.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	380,784.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	397,257.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	430,092.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	477,801.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	330,000.00	303,953.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	272,674.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	284,787.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	430,000.00	505,357.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	345,423.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	238,572.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	304,472.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	232,675.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	331,023.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	340,418.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	263,817.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	273,578.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	281,182.40	
OBRIGACOES DO TESOURO	210,000.00	184,934.40	
OBRIGACOES DO TESOURO	70,000.00	77,260.40	
OBRIGACOES DO TESOURO	370,000.00	357,479.20	
OBRIGACOES DO TESOURO	150,000.00	154,789.50	
OBRIGACOES DO TESOURO	110,000.00	119,248.80	
OBRIGACOES DO TESOURO	170,000.00	198,772.50	
OBRIGACOES DO TESOURO	150,000.00	95,773.50	
OBRIGACOES DO TESOURO	260,000.00	236,938.00	
OBRIGACOES DO TESOURO	160,000.00	134,753.60	
OBRIGACOES DO TESOURO	120,000.00	91,855.20	
OBRIGACOES DO TESOURO	170,000.00	184,924.30	
OBRIGACOES DO TESOURO	370,000.00	371,739.00	
OBRIGACOES DO TESOURO	200,000.00	196,982.00	
OBRIGACOES DO TESOURO	160,000.00	153,140.80	
OBRIGACOES DO TESOURO	260,000.00	263,351.40	
OBRIGACOES DO TESOURO	300,000.00	298,815.00	
OBRIGACOES DO TESOURO	240,000.00	275,803.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	127,245.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	123,510.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	169,985.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	310,000.00	320,350.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	95,170.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	101,224.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	208,578.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	122,682.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	242,551.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	410,000.00	400,303.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	182,721.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	350,000.00	337,333.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	52,632.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	107,185.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	231,709.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	310,000.00	296,852.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	350,000.00	405,076.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	340,000.00	317,175.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	196,249.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	310,000.00	276,213.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	240,000.00	151,281.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	104,731.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	56,085.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	370,000.00	320,797.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	69,720.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	151,730.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	260,000.00	239,358.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	270,777.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	126,409.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	129,771.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	413,524.00	
	ユーロ 小計	179,020,000.00 (28,627,088,200)	172,546,760.00 (27,591,952,392)	
国債証券 合計		97,961,294,868 (97,961,294,868)	91,449,718,640 (91,449,718,640)	
合計			91,449,718,640 (91,449,718,640)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 142銘柄	46.59	46.98
イギリス・ポンド	国債証券 61銘柄	5.18	5.22
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	0.34	0.34
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.23	1.24
オフショア・人民元	国債証券 61銘柄	11.03	11.13
カナダ・ドル	国債証券 41銘柄	1.91	1.93
シンガポール・ドル	国債証券 21銘柄	0.39	0.39
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.16	0.17
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.23	0.23
ニュージーランド・ドル	国債証券 15銘柄	0.28	0.28
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	0.15	0.15

ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	0.53	0.53
マレーシア・リングgit	国債証券	29銘柄	0.50	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.74	0.74
ユーロ	国債証券	400銘柄	29.92	30.17

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	58,477,330
金銭信託	466,316
コール・ローン	42,491,125
国債証券	5,125,580,593
特殊債券	178,303,783
派生商品評価勘定	297,707
未収利息	50,942,135
前払費用	14,949,032
流動資産合計	5,471,508,021
資産合計	5,471,508,021
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	332,588
未払金	19,545,023
未払解約金	3,651,371
流動負債合計	23,528,982
負債合計	23,528,982
純資産の部	
元本等	
元本	3,859,692,423
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,588,286,616
元本等合計	5,447,979,039
純資産合計	5,447,979,039
負債純資産合計	5,471,508,021

## 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12月12日 至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2024年12月10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	2,448,211,176円
同期中追加設定元本額	1,853,655,317円
同期中一部解約元本額	442,174,070円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	584,876,224円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	68,301,034円
ニッセイ新興国債券インデックス（ラップ専用）	3,205,205,789円
FWニッセイ新興国債インデックス	1,309,376円
計	3,859,692,423円
2. 受益権の総数	3,859,692,423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12月12日 至 2024年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年12月10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12月10日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	83,556,565
特殊債券	2,036,698
合計	85,593,263

(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(2024年11月21日から2024年12月10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12月10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	48,661,814	-	48,626,933	34,881
	48,661,814	-	48,626,933	34,881
合計	48,661,814	-	48,626,933	34,881

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2024年12月10日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4115円 (14,115円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2024年12月10日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	202,180.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	205,600.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	204,620.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	400,000.00	321,276.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	117,500.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	181,252.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	168,330.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	200,000.00	169,164.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	400,000.00	372,916.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	185,466.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	172,218.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	400,000.00	386,992.00	
		CHINA GOVT INTL BOND	200,000.00	189,842.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	150,000.00	139,882.50	

DOMINICAN REPUBLIC	450,000.00	402,777.00	
DOMINICAN REPUBLIC	450,000.00	412,119.00	
DOMINICAN REPUBLIC	300,000.00	265,833.00	
DOMINICAN REPUBLIC	300,000.00	296,634.00	
DOMINICAN REPUBLIC	300,000.00	294,696.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	400,000.00	394,224.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	400,000.00	403,176.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	197,154.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	400,000.00	398,448.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	199,396.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	400,000.00	360,788.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	175,232.00	
HAZINE MUSTESARL	200,000.00	198,256.00	
HAZINE MUSTESARLIGI VARL	200,000.00	206,240.00	
HAZINE MUSTESARLIGI VARL	200,000.00	215,358.00	
HAZINE MUSTESARLIGI VARL	400,000.00	400,580.00	
HUNGARY	400,000.00	391,216.00	
HUNGARY	400,000.00	324,572.00	
HUNGARY	200,000.00	126,550.00	
HUNGARY	200,000.00	199,080.00	
HUNGARY	400,000.00	410,900.00	
HUNGARY	200,000.00	209,070.00	
OMAN GOV INTERNTL BOND	400,000.00	418,500.00	
OMAN SOVEREIGN SUKUK	200,000.00	200,574.00	
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN	200,000.00	198,022.00	
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN	200,000.00	196,510.00	
REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	196,228.00	
REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	200,436.00	
REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	172,132.00	
REPUBLIC OF CHILE	400,000.00	255,496.00	
REPUBLIC OF CHILE	400,000.00	301,628.00	
REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	191,698.00	
REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	176,820.00	
REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	146,266.00	
REPUBLIC OF CHILE	200,000.00	178,212.00	
REPUBLIC OF CHILE	400,000.00	333,080.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	404,124.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	414,444.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	422,800.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	168,622.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	324,044.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	120,516.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	314,748.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	210,116.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	189,660.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	170,184.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	276,324.00	
REPUBLIC OF PANAMA	400,000.00	256,104.00	
REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	145,964.00	

REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	126,910.00	
REPUBLIC OF PANAMA	400,000.00	378,680.00	
REPUBLIC OF PERU	200,000.00	202,662.00	
REPUBLIC OF PERU	430,000.00	375,609.30	
REPUBLIC OF PERU	320,000.00	185,961.60	
REPUBLIC OF PERU	260,000.00	188,011.20	
REPUBLIC OF PERU	360,000.00	300,470.40	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	400,000.00	293,372.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000.00	134,376.00	
REPUBLIC OF POLAND	200,000.00	205,190.00	
REPUBLIC OF POLAND	250,000.00	261,865.00	
REPUBLIC OF POLAND	310,000.00	307,830.00	
REPUBLIC OF POLAND	400,000.00	392,400.00	
REPUBLIC OF POLAND	430,000.00	430,774.00	
REPUBLIC OF POLAND	210,000.00	209,643.00	
REPUBLIC OF POLAND	450,000.00	441,531.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	408,668.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	387,520.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	200,000.00	194,178.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	200,000.00	199,430.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	200,000.00	192,274.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	200,000.00	195,500.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	400,000.00	448,064.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	200,000.00	231,008.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	200,000.00	224,440.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	200,000.00	225,404.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	200,000.00	209,268.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	200,000.00	203,552.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	400,000.00	386,820.00	
REPUBLIC OF TURKIYE	200,000.00	215,904.00	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY	300,000.00	314,193.00	
ROMANIA	180,000.00	184,860.00	
ROMANIA	320,000.00	318,768.00	
ROMANIA	230,000.00	229,434.20	
ROMANIA	300,000.00	282,186.00	
ROMANIA	290,000.00	199,282.20	
ROMANIA	250,000.00	262,162.50	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	199,420.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	400,000.00	400,996.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	400,000.00	395,972.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	142,516.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	183,838.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	162,750.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	164,030.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	131,200.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	207,516.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	400,000.00	400,684.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	400,000.00	398,972.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	200,000.00	180,024.00	

		STATE OF QATAR	400,000.00	407,004.00	
		STATE OF QATAR	400,000.00	386,152.00	
		STATE OF QATAR	600,000.00	536,250.00	
		UAE INT'L GOVT BOND	200,000.00	192,124.00	
		UAE INT'L GOVT BOND	200,000.00	202,030.00	
		UAE INT'L GOVT BOND	200,000.00	136,508.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	189,002.00	
		UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	392,904.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	190,514.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	187,532.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	160,922.00	
		UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	334,972.00	
		UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	239,428.00	
		UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	247,156.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	156,340.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	145,380.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	185,832.00	
		UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	331,268.00	
		UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	203,058.00	
	アメリカ・ドル	小計	37,040,000.00 (5,613,041,600)	33,823,284.90 (5,125,580,593)	
国債証券	合計		5,613,041,600 (5,613,041,600)	5,125,580,593 (5,125,580,593)	
特殊債券	アメリカ・ドル	KSA SUKUK LTD	200,000.00	197,126.00	
		KSA SUKUK LTD	200,000.00	195,022.00	
		KSA SUKUK LTD	200,000.00	203,876.00	
		KSA SUKUK LTD	200,000.00	205,258.00	
		KSA SUKUK LTD	200,000.00	204,232.00	
		KSA SUKUK LTD	200,000.00	171,098.00	
	アメリカ・ドル	小計	1,200,000.00 (181,848,000)	1,176,612.00 (178,303,783)	
特殊債券	合計		181,848,000 (181,848,000)	178,303,783 (178,303,783)	
合計				5,303,884,376 (5,303,884,376)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 131銘柄	94.08	100.00
	特殊債券 6銘柄	3.27	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,130,268
コール・ローン	285,232,836
投資証券	29,583,394,500
未収配当金	239,456,513
流動資産合計	30,111,214,117
資産合計	30,111,214,117
負債の部	
流動負債	
未払解約金	123,337,174
流動負債合計	123,337,174
負債合計	123,337,174
純資産の部	
元本等	
元本	17,171,691,708
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,816,185,235
元本等合計	29,987,876,943
純資産合計	29,987,876,943
負債純資産合計	30,111,214,117

## 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12月12日 至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2024年12月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,635,955,175円
同期中追加設定元本額	6,680,521,051円
同期中一部解約元本額	6,144,784,518円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイJ-REITインデックスファンド（適格機関投資家限定）	54,792,391円
DCニッセイJ-REITインデックスファンド	855,938,427円
<購入・換金手数料なし>ニッセイJリートインデックスファンド	9,044,082,896円
ニッセイJ-REITインデックスファンド2013-02（適格機関投資家限定）	1,575,888,063円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドA	3,283,510,820円
DCニッセイJ-REITインデックスファンドB	2,010,815,233円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）	230,537,965円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	28,326,701円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート/債券）	9,377,895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）	20,885,529円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	53,180,813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）	112,095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）	249,958円
FWニッセイ国内リートインデックス	3,992,922円
計	17,171,691,708円
2. 受益権の総数	17,171,691,708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12月12日 至 2024年12月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年12月10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	2024年12月10日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	916,751,661
合計	916,751,661

(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(2024年11月13日から2024年12月10日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年12月10日現在
1口当たり純資産額	1.7464円
(1万口当たり純資産額)	(17,464円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年12月10日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	C R E ロジスティクスファンド 投資法人	1,348	189,259,200	
	G L P 投資法人	10,521	1,314,072,900	
	K D X 不動産投資法人	8,763	1,262,748,300	

NTT都市開発リート投資法人	3,184	353,742,400	
Oneリート投資法人	546	121,102,800	
SOSILA物流リート投資法人	1,563	161,145,300	
いちごオフィスリート投資法人	2,285	176,859,000	
いちごホテルリート投資法人	518	73,970,400	
アクティブア・プロパティーズ投資法人	1,522	477,147,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	3,078	882,154,800	
イオンリート投資法人	3,842	476,792,200	
インヴィンシブル投資法人	17,257	1,126,882,100	
エスコンジャパンリート投資法人	693	76,299,300	
オリックス不動産投資法人	6,241	1,008,545,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,268	216,594,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,586	436,784,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人	853	76,087,600	
サンケイリアルエステート投資法人	1,003	73,519,900	
ザイマックス・リート投資法人	536	58,745,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,507	814,695,600	
ジャパンエクセレント投資法人	2,690	309,350,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	3,217	1,756,482,000	
スターアジア不動産投資法人	5,772	285,425,400	
スターツプロシード投資法人	543	89,377,800	
タカラレーベン不動産投資法人	2,046	171,045,600	
トーセイ・リート投資法人	681	82,877,700	
ヒューリックリート投資法人	2,768	361,500,800	
フロンティア不動産投資法人	1,162	451,437,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	772	79,670,400	
マリモ地方創生リート投資法人	569	61,053,700	
ユナイテッド・アーバン投資法人	7,006	952,115,400	
ラサールロジポート投資法人	4,010	560,197,000	
阪急阪神リート投資法人	1,493	171,695,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	6,827	670,411,400	
三菱地所物流リート投資法人	1,082	367,880,000	
産業ファンド投資法人	5,735	646,334,500	
森トラストリート投資法人	6,037	362,823,700	
森ヒルズリート投資法人	3,683	455,955,400	
星野リゾート・リート投資法人	1,325	302,895,000	
積水ハウス・リート投資法人	9,412	679,546,400	
大和ハウスリート投資法人	4,697	1,059,173,500	

大和証券オフィス投資法人	1,298	374,862,400	
大和証券リビング投資法人	4,626	408,013,200	
投資法人みらい	4,313	168,207,000	
東海道リート投資法人	535	55,051,500	
東急リアル・エステート投資法人	2,100	326,130,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,082	611,330,000	
日本ビルファンド投資法人	18,270	2,239,902,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,142	686,511,000	
日本プロロジスリート投資法人	5,456	1,237,966,400	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	506	32,282,800	
日本リート投資法人	1,017	311,202,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,104	548,723,200	
日本都市ファンド投資法人	16,241	1,425,959,800	
福岡リート投資法人	1,767	248,263,500	
平和不動産リート投資法人	2,297	265,992,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	10,026	1,388,601,000	
投資証券 合計	224,421	29,583,394,500	
合計		29,583,394,500	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2024年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
預金	70,002,757
金銭信託	3,661,303
コール・ローン	333,621,196
投資証券	16,226,366,735
派生商品評価勘定	10,962,870
未収入金	766,983
未収配当金	50,779,188
差入委託証拠金	363,104,219
流動資産合計	17,059,265,251
資産合計	17,059,265,251
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,926,573
未払解約金	33,789,330
流動負債合計	51,715,903
負債合計	51,715,903
純資産の部	
元本等	
元本	9,072,222,862
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,935,326,486
元本等合計	17,007,549,348
純資産合計	17,007,549,348
負債純資産合計	17,059,265,251

## 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12月12日 至 2024年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。  為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2024年12月10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	6,367,125,666円
同期中追加設定元本額	4,060,402,843円
同期中一部解約元本額	1,355,305,647円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ先進国リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,630,793,171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）	221,526,597円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	27,219,402円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート/債券）	9,004,166円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	51,109,451円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	53,033,829円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	4,311,023,782円
FWニッセイ先進国リートインデックス	25,765,347円
DCニッセイ先進国リートインデックス	2,742,747,117円
計	9,072,222,862円
2. 受益権の総数	9,072,222,862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12月12日 至 2024年12月10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12月10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12月10日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	39,504,675
合計	39,504,675

(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(2024年11月21日から2024年12月10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12月10日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	501,216,595	-	495,210,577	6,006,018	
アメリカ・ドル	444,457,801	-	438,489,920	5,967,881	
ユーロ	56,758,794	-	56,720,657	38,137	
買建	787,778,758	-	779,693,820	8,084,938	
アメリカ・ドル	684,919,364	-	678,395,520	6,523,844	
ユーロ	102,859,394	-	101,298,300	1,561,094	
合計	1,288,995,353	-	1,274,904,397	2,078,920	

(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12月10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	753,025,525	-	748,140,743	4,884,782	
合計	753,025,525	-	748,140,743	4,884,782	

(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12月10日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8747円 (18,747円)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2024年12月10日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	7,232.00	183,114.24	
		AGREE REALTY CORP	7,169.00	533,803.74	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	5,420.00	106,665.60	
		ALEXANDER'S INC	189.00	40,816.44	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,106.00	1,185,565.50	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,112.00	19,560.08	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	3,045.00	85,260.00	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	9,519.00	268,435.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	22,364.00	842,899.16	
		AMERICOLD REALTY TRUST	18,739.00	438,679.99	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	10,141.00	88,023.88	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	16,084.00	260,078.28	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	4,896.00	53,317.44	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,092.00	2,290,783.08	
		BOSTON PROPERTIES INC	10,361.00	860,066.61	
		BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	2,552.00	8,727.84	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	13,422.00	77,176.50	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,546.00	637,330.68	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	13,387.00	230,256.40	
		BRT APARTMENTS CORP	1,000.00	18,470.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,625.00	936,121.25	
		CARETRUST REIT INC	10,996.00	317,124.64	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,443.00	45,093.75	
		CENTERSPACE	1,185.00	83,032.95	
		CHATHAM LODGING TRUST	3,110.00	30,135.90	
		CITY OFFICE REIT INC	1,913.00	11,248.44	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,000.00	36,880.00			
COPT DEFENSE PROPERTIES	7,915.00	261,590.75			
COUSINS PROPERTIES INC	11,187.00	346,685.13			

CTO REALTY GROWTH INC	1,441.00	29,410.81	
CUBESMART	16,201.00	770,843.58	
CURBLINE PROPERTIES CORP	6,411.00	156,043.74	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	15,070.00	145,124.10	
DIGITAL REALTY TRUST INC	21,957.00	4,131,648.69	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	13,543.00	34,670.08	
DOUGLAS EMMETT INC	12,301.00	244,666.89	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,300.00	20.30	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	7,832.00	92,182.64	
EASTGROUP PROPERTIES	3,415.00	594,107.55	
ELME COMMUNITIES	6,230.00	104,601.70	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	9,688.00	109,474.40	
EPR PROPERTIES	5,215.00	235,822.30	
EQUINIX INC	6,772.00	6,561,932.56	
EQUITY COMMONWEALTH	8,058.00	12,087.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,396.00	939,193.56	
EQUITY RESIDENTIAL	24,223.00	1,784,266.18	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	12,550.00	411,012.50	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,559.00	1,372,259.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	15,137.00	2,490,187.87	
FARMLAND PARTNERS INC	2,825.00	34,408.50	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,332.00	608,967.72	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	9,518.00	502,360.04	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6,412.00	187,486.88	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	3,892.00	7,278.04	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	19,500.00	976,755.00	
GETTY REALTY CORP	3,525.00	113,892.75	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,133.00	52,571.74	
GLADSTONE LAND CORP	2,740.00	31,236.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,343.00	37,132.65	
GLOBAL NET LEASE INC	13,953.00	100,880.19	
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	26,063.00	472,000.93	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	50,393.00	1,093,528.10	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	7,679.00	243,654.67	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	50,843.00	962,966.42	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	9,447.00	33,253.44	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	16,166.00	345,629.08	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2,316.00	8,360.76	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,072.00	222,449.92	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	4,807.00	148,872.79	
INVITATION HOMES INC	40,480.00	1,363,366.40	
IRON MOUNTAIN INC	20,957.00	2,396,223.38	
JBG SMITH PROPERTIES	6,357.00	105,526.20	
KILROY REALTY CORP	7,791.00	324,027.69	
KIMCO REALTY CORP	47,896.00	1,199,315.84	
KITE REALTY GROUP TRUST	16,063.00	431,452.18	
LAMAR ADVERTISING CO-A	6,265.00	824,474.00	
LINEAGE INC	4,224.00	268,519.68	
LTC PROPERTIES INC	3,035.00	113,569.70	
LXP INDUSTRIAL TRUST	20,935.00	194,904.85	
MACERICH CO/THE	15,900.00	347,097.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	44,282.00	185,098.76	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,301.00	1,321,104.15	
MODIV INDUSTRIAL INC	808.00	12,903.76	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	5,063.00	220,544.28	
NATL HEALTH INVESTORS INC	3,065.00	227,882.75	
NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I	775.00	25,241.75	
NETSTREIT CORP	5,435.00	85,818.65	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	3,700.00	21,053.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	1,649.00	76,513.60	
NNN REIT INC	13,151.00	561,679.21	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,958.00	2,799.94	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	18,391.00	721,662.84	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,064.00	30,919.84	
ORION OFFICE REIT INC	2,625.00	10,736.25	
OUTFRONT MEDIA INC	9,923.00	188,537.00	
PARAMOUNT GROUP INC	12,191.00	60,833.09	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	15,173.00	239,885.13	
PEAKSTONE REALTY TRUST	2,150.00	27,455.50	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	8,169.00	120,492.75	

PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	8,701.00	341,079.20	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	9,559.00	90,332.55	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,618.00	50,239.42	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,387.00	19,126.73	
PROLOGIS INC	66,062.00	7,624,876.04	
PUBLIC STORAGE	11,226.00	3,767,108.82	
REALTY INCOME CORP	62,122.00	3,508,650.56	
REGENCY CENTERS CORP	11,488.00	860,680.96	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	9,505.00	165,767.20	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	15,649.00	652,876.28	
RLJ LODGING TRUST	11,240.00	118,357.20	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	4,375.00	516,250.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	17,255.00	306,966.45	
SAFEHOLD INC	3,463.00	73,277.08	
SAUL CENTERS INC	953.00	38,358.25	
SERVICE PROPERTIES TRUST	10,575.00	29,715.75	
SIMON PROPERTY GROUP INC	21,839.00	3,977,100.29	
SITE CENTERS CORP	3,206.00	49,468.58	
SL GREEN REALTY CORP	4,586.00	350,553.84	
STAG INDUSTRIAL INC	13,234.00	484,761.42	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	7,397.00	50,447.54	
SUN COMMUNITIES INC	8,363.00	1,041,528.02	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	15,066.00	182,750.58	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	7,786.00	280,607.44	
TERRENO REALTY CORP	6,997.00	442,350.34	
UDR INC	21,297.00	956,022.33	
UMH PROPERTIES INC	4,642.00	91,586.66	
UNITI GROUP INC	18,430.00	104,129.50	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	986.00	40,968.30	
URBAN EDGE PROPERTIES	7,898.00	178,731.74	
VENTAS INC	29,386.00	1,794,309.16	
VERIS RESIDENTIAL INC	5,363.00	94,120.65	
VICI PROPERTIES INC	74,686.00	2,372,027.36	
VORNADO REALTY TRUST	11,761.00	534,184.62	
WELLTOWER INC	41,304.00	5,346,802.80	
WHITESTONE REIT	3,579.00	51,430.23	
WP CAREY INC	15,567.00	879,691.17	

	XENIA HOTELS & RESORTS INC	7,775.00	126,032.75	
アメリカ・ドル	小計	1,631,110.00	86,003,092.12 (13,032,908,583)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	21,742.00	13,240.87	
	AEW UK REIT PLC	11,978.00	12,049.86	
	ASSURA PLC	218,401.00	87,141.99	
	BIG YELLOW GROUP PLC	14,640.00	148,156.80	
	BRITISH LAND CO PLC	65,890.00	241,420.96	
	CARE REIT PLC	27,096.00	22,164.52	
	CLS HOLDINGS PLC	9,187.00	7,560.90	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	27,532.00	21,585.08	
	DERWENT LONDON PLC	8,381.00	171,642.88	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	40,871.00	35,476.02	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	29,168.00	87,212.32	
	HAMMERSON PLC	32,887.00	95,766.94	
	HELICAL PLC	5,769.00	11,307.24	
	HOME REIT PLC	24,530.00	2.45	
	INTU PROPERTIES PLC	19,587.00	19.58	
	INVISTA FOUNDATION PROPERTY	32,593.00	16,100.94	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	52,744.00	308,816.12	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	23,195.00	8,930.07	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	149,386.00	277,111.03	
	NEWRIVER REIT PLC	15,040.00	12,167.36	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	44,095.00	29,896.41	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	102,134.00	95,188.88	
	PRS REIT PLC/THE	42,398.00	45,196.26	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	16,283.00	116,097.79	
	SEGRO PLC	95,639.00	707,728.60	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	143,006.00	191,342.02	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	101,964.00	71,680.69	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	45,224.00	39,344.88	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	12,542.00	7,575.36	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	175,978.00	240,033.99	
	UNITE GROUP PLC	28,264.00	236,004.40	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	34,690.00	37,673.34	
	WAREHOUSE REIT PLC	19,079.00	15,415.83	
	WORKSPACE GROUP PLC	9,481.00	50,154.49	

イギリス・ボンド 小計		1,701,394.00	3,461,206.87 (668,739,779)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	65,374.00	129,702.01	
	REIT 1 LTD	15,106.00	304,234.84	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	11,772.00	115,530.40	
イスラエル・シュケル 小計		92,252.00	549,467.25 (23,324,885)	
オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	28,466.00	33,020.56	
	ABACUS STORAGE KING	32,480.00	38,164.00	
	ARENA REIT	28,753.00	112,136.70	
	BWP TRUST	38,080.00	126,044.80	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	60,469.00	112,169.99	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	37,029.00	106,273.23	
	CENTURIA OFFICE REIT	19,401.00	21,729.12	
	CHARTER HALL GROUP	33,786.00	498,681.36	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	49,464.00	187,963.20	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	37,158.00	120,020.34	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	21,280.00	54,476.80	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	116,782.00	43,209.34	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	12,026.00	31,267.60	
	DEXUS/AU	78,423.00	537,981.78	
	GOODMAN GROUP	124,471.00	4,705,003.80	
	GPT GROUP	141,081.00	647,561.79	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	22,755.00	55,977.30	
	HEALTHCO REIT	24,033.00	25,234.65	
	HOMEEO DAILY NEEDS REIT	142,199.00	167,794.82	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	11,928.00	45,087.84	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	26,244.00	125,183.88	
	MIRVAC GROUP	292,742.00	614,758.20	
	NATIONAL STORAGE REIT	94,223.00	222,366.28	
REGION RE LTD	91,566.00	195,035.58		
RURAL FUNDS TRUST	27,371.00	48,446.67		
SCENTRE GROUP	370,863.00	1,338,815.43		
STOCKLAND	171,706.00	860,247.06		
VICINITY CENTRES	279,426.00	584,000.34		
WAYPOINT REIT LTD	55,185.00	132,995.85		
オーストラリア・ドル 小計		2,469,390.00	11,791,648.31 (1,148,860,295)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	4,612.00	84,676.32	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,592.00	41,716.32	

	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,798.00	123,396.74	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6,165.00	272,493.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	13,358.00	183,672.50	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3,942.00	56,094.66	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	3,382.00	50,425.62	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	9,756.00	120,974.40	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	525.00	9,922.50	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	8,464.00	149,643.52	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	9,065.00	86,842.70	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	4,650.00	49,057.50	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,532.00	81,258.76	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,412.00	19,768.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,578.00	29,839.98	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	3,282.00	25,796.52	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	7,442.00	35,944.86	
	PRIMARIS REIT	3,864.00	62,828.64	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,918.00	201,109.56	
	SLATE GROCERY REIT	1,903.00	27,955.07	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,268.00	135,334.92	
	カナダ・ドル 小計	111,508.00	1,848,752.09 (197,650,086)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	49,600.00	62,000.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	258,300.00	666,414.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	193,642.00	172,341.38	
	CAPITALAND CHINA TRUST	94,600.00	68,585.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	390,928.00	758,400.32	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	52,300.00	45,762.50	
	EC WORLD REIT	17,800.00	1.78	
	ESR-REIT	497,133.00	131,740.24	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	73,800.00	45,387.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	82,000.00	173,840.00	

	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	221,811.00	199,629.90	
	KEPPEL DC REIT	103,100.00	225,789.00	
	KEPPEL REIT	176,300.00	150,736.50	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	143,000.00	79,365.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	156,700.00	354,142.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	251,400.00	321,792.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	172,100.00	209,962.00	
	QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	186,900.00	52,332.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	27,000.00	101,250.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	49,000.00	34,055.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	101,500.00	50,750.00	
	SUNTEC REIT	164,800.00	197,760.00	
	シンガポール・ドル 小計	3,463,714.00	4,102,035.62 (463,571,045)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	76,957.00	157,761.85	
	ニュージーランド・ドル 小計	76,957.00	157,761.85 (13,984,010)	
ユーロ	AEDIFICA	3,374.00	190,293.60	
	ALTAREA	398.00	36,974.20	
	CARE PROPERTY INVEST	3,166.00	37,738.72	
	CARMILA	4,211.00	65,860.04	
	COFINIMMO	2,836.00	156,830.80	
	COVIVIO	3,631.00	181,114.28	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	3,108.00	71,173.20	
	GECINA SA	3,773.00	346,738.70	
	HAMBORNER REIT AG	5,242.00	33,601.22	
	ICADE	2,264.00	50,985.28	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,183.00	3,063.97	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	24,065.00	127,544.50	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	42,776.00	37,899.53	
	KLEPIERRE	15,498.00	435,183.84	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4,123.00	34,097.21	
	MERCIALYS	6,919.00	69,535.95	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	28,164.00	288,962.64	
	MONTEA NV	1,322.00	85,136.80	
	NSI NV	1,241.00	24,571.80	



	RETAIL ESTATES	915.00	53,527.50	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	2,318.00	87,852.20	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,228.00	553,664.80	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,561.00	249,963.90	
	WERELDHAVE NV	1,962.00	27,271.80	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,350.00	68,855.00	
	ユーロ 小計	184,628.00	3,318,441.48 (530,651,977)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	165,000.00	293,700.00	
	FORTUNE REIT	125,000.00	505,000.00	
	LINK REIT	184,800.00	6,375,600.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	63,000.00	115,290.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	237,000.00	232,260.00	
	香港・ドル 小計	774,800.00	7,521,850.00 (146,676,075)	
投資証券 合計		10,505,753	16,226,366,735 (16,226,366,735)	
合計			16,226,366,735 (16,226,366,735)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資証券 137銘柄	76.63	80.32
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	3.93	4.12
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	0.14	0.14
オーストラリア・ドル	投資証券 29銘柄	6.76	7.08
カナダ・ドル	投資証券 21銘柄	1.16	1.22
シンガポール・ドル	投資証券 22銘柄	2.73	2.86
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	0.08	0.09
ユーロ	投資証券 25銘柄	3.12	3.27
香港・ドル	投資証券 5銘柄	0.86	0.90

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## F Wニッセイ国内株インデックス

2024年12月30日現在

資産総額	356,862,377円
負債総額	1,271,549円
純資産総額（ - ）	355,590,828円
発行済数量	232,779,265口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5276円

## F Wニッセイ先進国株インデックス

2024年12月30日現在

資産総額	291,647,737円
負債総額	185,561円
純資産総額（ - ）	291,462,176円
発行済数量	165,648,658口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7595円

## F Wニッセイ新興国株インデックス

2024年12月30日現在

資産総額	68,542,566円
負債総額	46,733円
純資産総額（ - ）	68,495,833円
発行済数量	52,177,323口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3128円

## F Wニッセイ国内債インデックス

2024年12月30日現在

資産総額	36,095,306円
負債総額	3,889円
純資産総額（ - ）	36,091,417円
発行済数量	39,248,637口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9196円

## F Wニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）

2024年12月30日現在

資産総額	8,877,581円
負債総額	1,165円
純資産総額（ - ）	8,876,416円
発行済数量	11,270,141口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7876円

## F Wニッセイ外国債インデックス

2024年12月30日現在

資産総額	160,806,355円
負債総額	24,954円
純資産総額（ - ）	160,781,401円
発行済数量	135,621,470口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1855円

## F Wニッセイ新興国債インデックス

2024年12月30日現在

資産総額	1,882,433円
負債総額	300円
純資産総額（ - ）	1,882,133円
発行済数量	1,644,380口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1446円

## F Wニッセイ国内リートインデックス

2024年12月30日現在

資産総額	7,314,699円
負債総額	1,107円
純資産総額（ - ）	7,313,592円
発行済数量	7,902,392口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9255円

## F Wニッセイ先進国リートインデックス

2024年12月30日現在

資産総額	48,948,933円
負債総額	22,560円
純資産総額（ - ）	48,926,373円
発行済数量	37,724,615口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2969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12月30日現在

資産総額	265,581,472,439円
負債総額	900,009,973円
純資産総額（ - ）	264,681,462,466円
発行済数量	78,507,478,368口
1口当たり純資産額（ / ）	3.3714円

## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

資産総額	1,205,909,386,276円
負債総額	2,763,666,470円
純資産総額（ - ）	1,203,145,719,806円
発行済数量	236,344,766,906口
1口当たり純資産額（ / ）	5.0906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12月30日現在

資産総額	15,924,844,418円
負債総額	72,327,842円
純資産総額（ - ）	15,852,516,576円
発行済数量	10,166,131,819口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5593円

## ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

2024年12月30日現在

資産総額	64,711,426,660円
負債総額	296,975,535円
純資産総額（ - ）	64,414,451,125円
発行済数量	70,799,798,833口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9098円

## ニッセイ為替ヘッジ外国債券パッシブ マザーファンド

2024年12月30日現在

資産総額	124,887,799,431円
負債総額	5,897,374,342円
純資産総額（ - ）	118,990,425,089円
発行済数量	123,566,003,601口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9630円

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

資産総額	95,646,031,441円
負債総額	254,108,306円
純資産総額（ - ）	95,391,923,135円
発行済数量	52,560,557,589口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8149円

## ニッセイ新興国債券インデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

資産総額	5,630,443,223円
負債総額	1,087,612円
純資産総額（ - ）	5,629,355,611円
発行済数量	3,942,727,017口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4278円

## ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

資産総額	31,033,463,883円
負債総額	119,778,428円
純資産総額（ - ）	30,913,685,455円
発行済数量	17,349,234,428口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7818円

## ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

2024年12月30日現在

資産総額	17,058,413,810円
負債総額	42,370,968円
純資産総額（ - ）	17,016,042,842円
発行済数量	9,199,044,718口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8498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12月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間における資本金の増減はありません。

##### （2）委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年12月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	401	78,630
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	113	18,333
単位型公社債投資信託	0	0
合計	514	96,963

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### 1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 当社の中間財務諸表は、財務諸表等規則第282条及び第306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」に基づき作成しております。

中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### 2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第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。

また、第30期事業年度に係る中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (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		利益準備金	利益剰余金				利益剰余金 合計	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金					
					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><b>投資信託委託業務</b>  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><b>投資運用業務</b>  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><b>投資助言業務</b>  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><b>ヘッジ会計の方法</b>  繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p><b>ヘッジ手段とヘッジ対象</b>  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><b>ヘッジ方針</b>  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><b>ヘッジ有効性評価の方法</b>  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 示しております。

当事業年度(2024年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	28,036,676	27,975,611	61,065
その他有価証券	24,465,367	24,465,367	-
資産計	52,502,043	52,440,978	61,065
デリバティブ取引( )			
ヘッジ会計が適用されて いるもの	10,936	10,936	-
デリバティブ取引計	10,936	10,936	-

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

(注1) 市場価格のない株式等

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2023年3月31日)
関係会社株式	66,222

(単位:千円)

区分	当事業年度 (2024年3月31日)
関係会社株式	66,222

## 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

## (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 その他有価証券	-	19,289,693	-	19,289,693
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	24,321	-	24,321
合計	-	19,265,372	-	19,265,372

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

当事業年度（2024年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 その他有価証券	3,473,100	20,992,267	-	24,465,367
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	10,936	-	10,936
合計	-	24,454,430	-	24,454,430

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

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第30期中間会計期間末

(2024年9月30日現在)

## 資産の部

## 流動資産

現金・預金		8,797,070
有価証券		7,177,496
前払費用		845,824
未収委託者報酬		8,184,349
未収運用受託報酬		6,377,456
未収投資助言報酬		294,298
その他		170,143
流動資産合計		<u>31,846,639</u>

## 固定資産

有形固定資産	1	215,964
無形固定資産		4,063,289
投資その他の資産		
投資有価証券		50,639,238
関係会社株式		66,222
長期前払費用		19,335
差入保証金		359,166
繰延税金資産		1,504,365
その他		9,991
投資その他の資産合計		<u>52,598,319</u>

固定資産合計 56,877,573資産合計 88,724,213

## 負債の部

## 流動負債

預り金		60,635
未払収益分配金		6,131
未払手数料		2,799,139
未払運用委託報酬		2,648,819
未払投資助言報酬		950,011
その他未払金		539,205
未払費用		327,139
未払法人税等		2,177,878
未払消費税等	2	468,742
前受投資助言報酬		42,288
賞与引当金		739,274
その他		13,188
流動負債合計		<u>10,772,456</u>

## 固定負債

長期未払金		19,450
退職給付引当金		2,573,614
固定負債合計		<u>2,593,064</u>

## 負債合計

		<u>13,365,520</u>
--	--	-------------------

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		<u>8,281,840</u>

## 利益剰余金

利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		57,100,795
利益剰余金合計		<u>57,780,602</u>

## 株主資本合計

		<u>76,062,442</u>
--	--	-------------------

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		433,813
繰延ヘッジ損益		269,935
評価・換算差額等合計		<u>703,749</u>

## 純資産合計

		<u>75,358,692</u>
--	--	-------------------

## 負債・純資産合計

		<u>88,724,213</u>
--	--	-------------------

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第30期中間会計期間	
(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	15,951,960
運用受託報酬	11,538,636
投資助言報酬	618,305
その他営業収益	9,627
営業収益計	<u>28,118,529</u>
営業費用	13,741,273
一般管理費	1 6,879,283
営業利益	<u>7,497,973</u>
営業外収益	2 86,867
営業外費用	3 127,529
経常利益	<u>7,457,311</u>
特別利益	4 47,164
特別損失	5 168,558
税引前中間純利益	<u>7,335,917</u>
法人税、住民税及び事業税	2,035,467
法人税等調整額	237,084
法人税等合計	<u>2,272,551</u>
中間純利益	<u>5,063,365</u>

## (3)中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備 金	資本剰余 金合計	利益準備 金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	60,488,508	61,168,315	79,450,155
会計方針の変更による 累積的影響額	-	-	-	-	-	-	-	46,146	46,146	46,146
遡及処理後当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	60,534,655	61,214,462	79,496,302
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	8,497,226	8,497,226	8,497,226
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	5,063,365	5,063,365	5,063,365
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	3,433,860	3,433,860	3,433,860
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	57,100,795	57,780,602	76,062,442

	評価・換算差額等			純資産 合計
	其他有価証 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	484,519	329,920	814,439	78,635,715
会計方針の変更による累 積的影響額	46,146	-	46,146	-
遡及処理後当期首残高	530,666	329,920	860,586	78,635,715
当中間期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	8,497,226
中間純利益	-	-	-	5,063,365
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	96,852	59,985	156,837	156,837
当中間期変動額合計	96,852	59,985	156,837	3,277,023
当中間期末残高	433,813	269,935	703,749	75,358,692

## 注記事項

## （重要な会計方針）

項目	第30期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	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。 その他有価証券 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	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。 無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
4．引当金の計上基準	賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。 退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。 年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。

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。 当該契約については、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。</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。 当該契約については、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しています。</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。 当該契約については、契約期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しています。</p>
6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物が替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
7. ヘッジ会計の方法	<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 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。</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	当社は日本生命保険相互会社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。

(会計方針の変更)

(法人税、住民税及び事業税等に関する会計基準の適用)

「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、以下「2022年改正会計基準」という)等を、当中間会計期間の期首から適用し、資産または負債の評価替えにより生じた評価差額等に対して課される当中間会計期間の所得に対する法人税、住民税及び事業税等の計上区分を見直しております。

2022年改正会計基準等の適用については、2022年改正会計基準第20-3項ただし書きに定める経過的な取扱い及び「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、以下「2022年改正適用指針」という。)第65-2項(2)ただし書きに従っており、2022年改正会計基準が定める新たな会計方針を当中間会計期間の期首より適用しております。この結果、当中間会計期間の期首の利益剰余金が46,146千円増加するとともに、その他有価証券評価差額金の当期首残高が同額減少しております。





## （中間貸借対照表関係）

第30期中間会計期間末 (2024年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	832,741千円
2.消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債の「未払消費税等」として表示しております。	

## （中間損益計算書関係）

第30期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1.減価償却の実施額	
有形固定資産	16,159千円
無形固定資産	401,891千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
有価証券利息	49,709千円
受取配当金	32,394千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	60,547千円
金融派生商品費用	63,737千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	47,164千円
5.特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	29,235千円
投資有価証券償還損	138,874千円

## （追加情報）

## （役員退職慰労金制度の廃止）

当社は、2024年6月26日開催の定時株主総会において、役員退職慰労金制度の廃止に伴い退職慰労金の打ち切り支給を決議いたしました。これに伴い、「役員退職慰労引当金」を取り崩し打ち切り支給額の未払金19,450千円を固定負債の「長期未払金」として表示しております。

(中間株主資本等変動計算書関係)

第30期中間会計期間  
(自 2024年4月1日  
至 2024年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項  
配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2024年6月26日 定時株主総会	普通株式	8,497,226	78,353	2024年3月31日	2024年6月26日

## （金融商品関係）

第30期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

## 1．金融商品の時価等に関する事項

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

なお、市場価格のない株式等（注1）は次表に含まれておりません。また、短期間で決済されるため時価が簿価に近似する金融商品は、注記を省略しております。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券			
満期保有目的の債券	7,177,496	7,170,723	6,773
その他有価証券	-	-	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,736,340	23,610,939	125,401
その他有価証券	26,902,898	26,902,898	-
デリバティブ取引 ( )			
ヘッジ会計が適用され ていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用され ているもの	18,913	18,913	-

( )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 ー で示しております。

## （注1）市場価格のない株式等

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

## 2．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

( 1 ) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融商品  
第30期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券				
その他有価証券	3,405,300	23,497,598	-	26,902,898
デリバティブ取引（ ）				
為替予約	-	18,913	-	18,913
合計	3,405,300	23,516,511	-	26,921,811

( )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 ) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融商品  
第30期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券 国債・地方債等	-	30,781,662	-	30,781,662
合計	-	30,781,662	-	30,781,662

( 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。

(有価証券関係)

第30期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

## 1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	995,797	998,300	2,502
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	995,797	998,300	2,502
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	29,918,038	29,783,362	134,676
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	29,918,038	29,783,362	134,676
合計		30,913,836	30,781,662	132,174

## 2. その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注）	7,320,000	7,939,819	619,819
小計		7,320,000	7,939,819	619,819
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	3,459,180	3,405,300	53,880
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注）	16,759,000	15,557,778	1,201,221
小計		20,218,180	18,963,078	1,255,101
合計		27,538,180	26,902,898	635,281

(注) 投資信託受益証券等であります。

## （デリバティブ取引関係）

## 1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第30期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

該当事項はありません。

## 2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## （1）通貨関連

第30期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資有価証券	773,596	-	18,913
合計			773,596	-	18,913

（注1）時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

## （収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

区分	第30期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）
営業収益	
投資信託委託業務	15,951,960千円
投資運用業務	11,538,636千円
投資助言業務	618,305千円
その他	9,627千円
計	28,118,529千円

## （セグメント情報等）

## [セグメント情報]

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

## 1．サービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## （1）営業収益

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

## （2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	3,300,663

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	第30期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
1株当たり純資産額	694,883円19銭
1株当たり中間純利益金額	46,689円34銭

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

2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	5,063,365千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	<u>5,063,365千円</u>
期中平均株式数	108千株

(重要な後発事象)

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

該当事項はありません。



#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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
株式会社スマートプラス	100	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

#### (3) 投資助言会社（参考情報）

##### a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

##### b. 資本金の額

2024年3月末現在、450百万円

##### c. 事業の内容

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

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

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

### (2) 販売会社

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

### (3) 投資助言会社(参考情報)

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

## 3【資本関係】

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

2025年3月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ国内株インデックスの2023年12月12日から2024年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ国内株インデックスの2024年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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



# 独立監査人の監査報告書

2025年3月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ先進国株インデックスの2023年12月12日から2024年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ先進国株インデックスの2024年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2025年3月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ新興国株インデックスの2023年12月12日から2024年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ新興国株インデックスの2024年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2025年3月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ国内債インデックスの2023年12月12日から2024年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、F Wニッセイ国内債インデックスの2024年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2025年3月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）の2023年12月12日から2024年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ外国債インデックス（為替ヘッジあり）の2024年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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



# 独立監査人の監査報告書

2025年3月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ外国債インデックスの2023年12月12日から2024年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ外国債インデックスの2024年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2025年3月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているFWニッセイ新興国債インデックスの2023年12月12日から2024年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、FWニッセイ新興国債インデックスの2024年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2025年3月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ国内リートインデックスの2023年12月12日から2024年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、F Wニッセイ国内リートインデックスの2024年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2025年3月6日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているF Wニッセイ先進国リートインデックスの2023年12月12日から2024年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、F Wニッセイ先進国リートインデックスの2024年12月10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29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 大竹新

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木健嗣

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

## 利害関係

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

以上

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