【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年3月19日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　大関　洋
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号
【事務連絡者氏名】	投資信託業務部　　茶木　健
【電話番号】	０３－５５３３－４６０８
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額　上限１兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０
（以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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

（７）【申込期間】

継続申込期間：2025年4月4日から2025年9月19日まで
○　継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

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

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

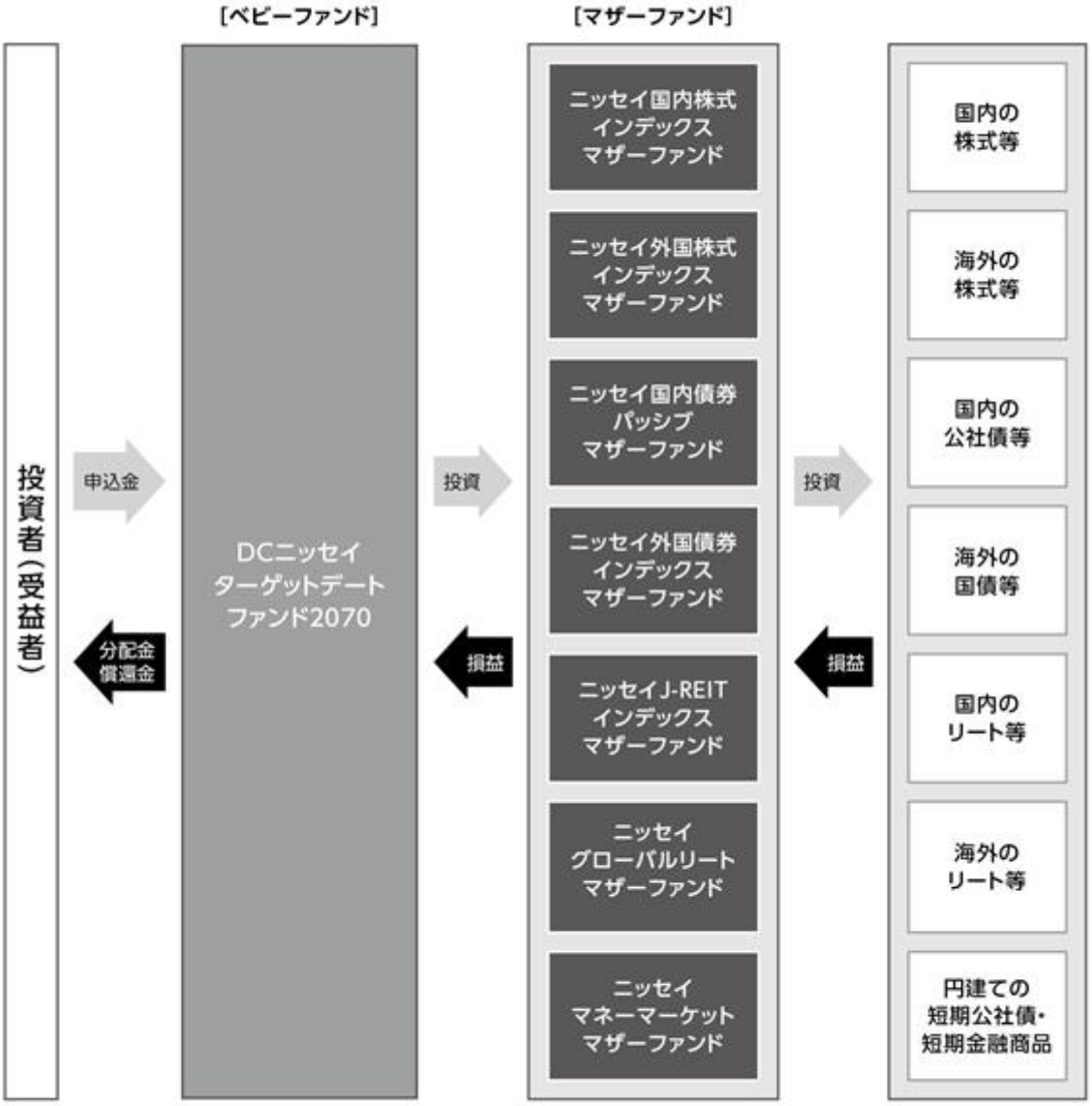
（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①　基本方針

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

②　運用の形態

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



❗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。将来の市場構造の変化等によっては、マザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

③　ファンドの特色

1日本を含む世界各国の株式(リートを含みます。以下同じ)、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資を行います。

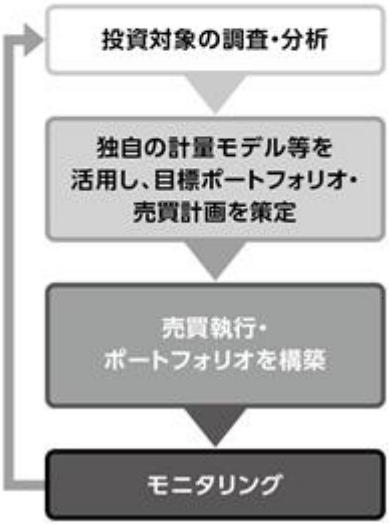
●実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ※を行いません。
※為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

2株式、公社債については、各インデックスの動きに連動する投資成果をめざします。

●マザーファンドへの投資を通じて、株式、公社債に実質的な投資を行います。

資産	インデックス	投資対象とするマザーファンド
国内株式	TOPIX(東証株価指数)(配当込み)	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド
	東証REIT指数(配当込み)	ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド
外国株式	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド
	S&Pグローバルリートインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)	ニッセイグローバルリートマザーファンド
国内債券	NOMURA-BPI総合	ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド
外国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

〈マザーファンドの運用プロセス〉



・将来の市場構造の変化等によっては、マザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

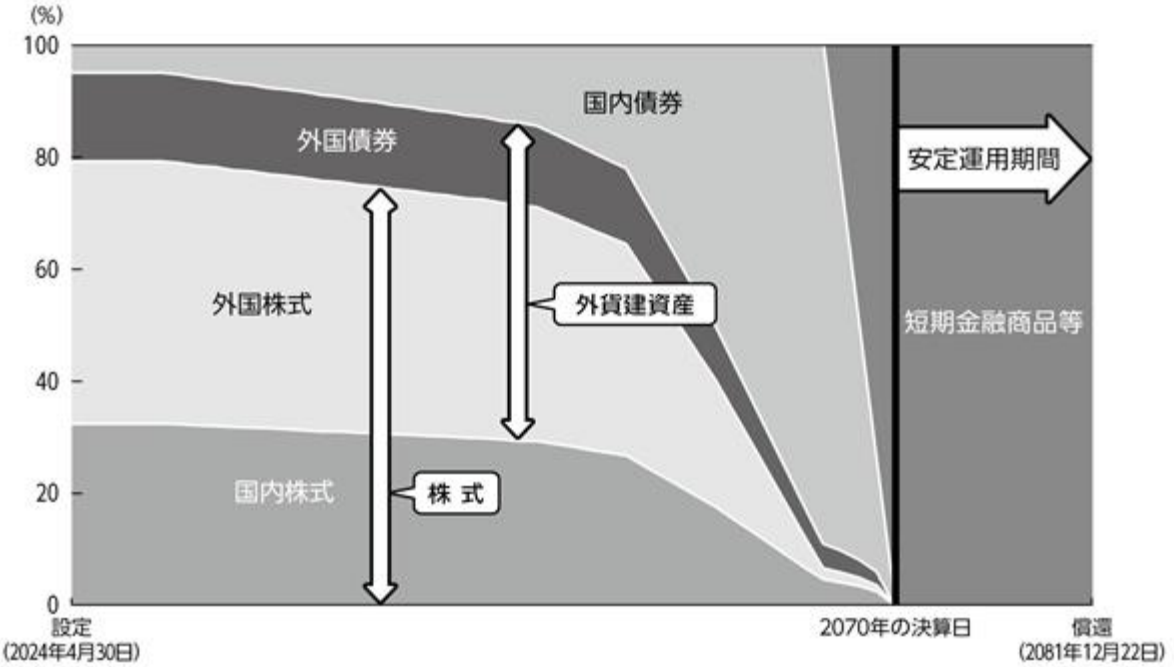
❸2070年の決算日に近づくにしたがい、リスクを低減させていく運用を行います。

●当初設定時の基本資産配分を参考にポートフォリオを構築し、2070年に近づくにしたがって株式の組入れを漸減させ、国内債券や短期金融商品等の組入れを漸増させること等により、長期的にリスクを低減させていく運用を行います。

●2070年の決算日以降は、原則として短期金融商品等に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。

・市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

〈基本資産配分のイメージ〉



・上記は2024年12月末現在で計画している基本資産配分のイメージ図であり、実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。将来の基本資産配分比率は、市況動向等により変更となる場合があります。

〈2024年12月末現在の基本資産配分〉

国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
32.6%	46.9%(0.9%)	4.7%	15.8%	0.0%

・実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。

・外国株式におけるカッコ内の数値は、外国株式の資産配分に含まれるニッセイグローバルリートマザーファンドの比率です。なお、2024年12月末現在において、ニッセイJ-REITインデックスマザーファンドの組入れは行っていません。

〈当初設定時の基本資産配分〉

国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
32.6%	46.9%	4.7%	15.8%	0.0%

〈各インデックスについて〉

●TOPIX（東証株価指数）

TOPIX（東証株価指数）とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により株式会社JPX総研が算出する株価指数です。
TOPIX（東証株価指数）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

●MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

●NOMURA−BPI総合

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

●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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

●東証REIT指数

東証REIT指数とは、東証市場に上場する不動産投資信託（Real Estate Investment Trust）全銘柄を対象とした浮動株ベースの時価総額加重方式により株式会社JPX総研が算出する株価指数です。
東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

●S&Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

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

＜ＭＳＣＩ指数にかかる免責条項等＞

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

④　信託金の上限

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

⑤　ファンドの分類

追加型投信／内外／資産複合に属します。

○　課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単　位　型 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

属性区分表

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

商品分類表

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

属性区分表

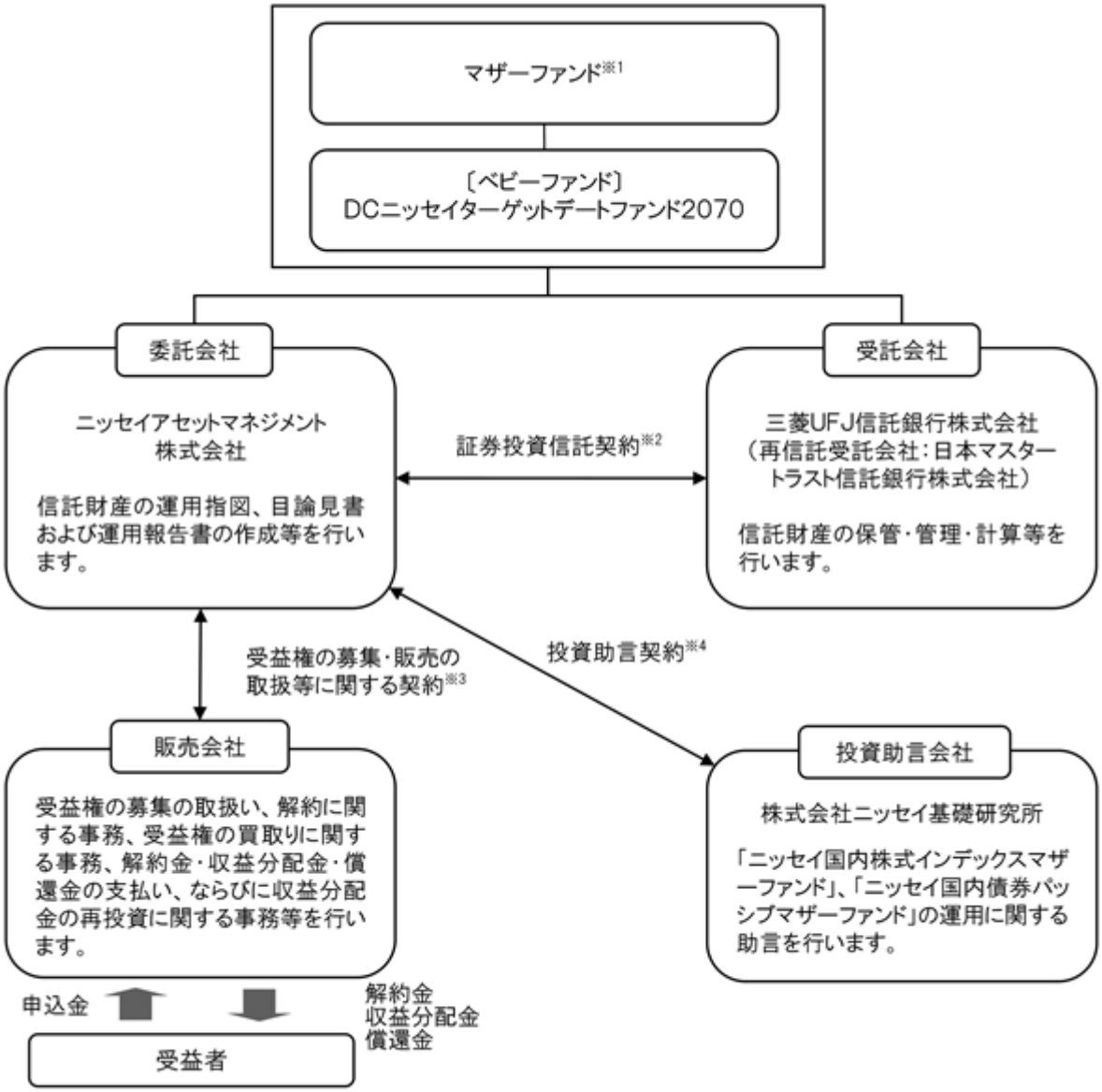
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式・債券・不動産投信・短期金融資産）資産配分変更型））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、公社債等、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券、短期金融資産に投資する旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または約款におい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

前記以外の商品分類および属性区分の定義については、
一般社団法人 投資信託協会ホームページ（https://www.toushin.or.jp/）をご参照ください。

（２）【ファンドの沿革】

2024年4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　ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド、ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド、ニッセイグローバルリートマザーファンド、ニッセイマネーマーケットマザーファンド

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

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

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

委託会社の概況（2024年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】

① 主として、複数のマザーファンド※を通じて、実質的に国内外の株式（リートを含みます。以下同じ）、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資を行います。また、将来の市場構造の変化等によっては、投資対象とするマザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

※ ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド、ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド、ニッセイグローバルリートマザーファンド、ニッセイマネーマーケットマザーファンド

② 当初設定時の資産配分は、以下の基本配分比率を基本とし、この基本配分比率に基づいてポートフォリオを構築します。

国内株式：32.6%
外国株式：46.9%
国内債券： 4.7%
外国債券：15.8%

③ 資産配分は、時間の経過により西暦2070年に近づくにしたがって、株式への配分を漸減し、公社債および短期金融商品への配分を漸増することにより、価格変動リスクを漸減させる運用をめざします。

④ 西暦2070年の決算日以降は、原則として、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資することにより、より安定的な運用を行うことを基本とします。なお、市況動向によっては、国内の公社債に投資する場合があります。

⑤ マザーファンドの組入は、原則として高位を維持します。

⑥ 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。

⑦ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

国内の証券取引所※上場株式を主要投資対象とします。

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

ｂ　投資態度

①　国内の証券取引所上場株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。
②　株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。
③　株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。
④　資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。
②　同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
③　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。
④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
⑤　同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。
⑦　外貨建資産への投資は行いません。
⑧　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
⑨　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
⑩　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b　投資態度

①　主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。

②　株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

⑤　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑦　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

ｂ　投資態度

①　国内の公社債に投資し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②　原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

③　組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

④　公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

（３）投資制限

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

②　同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

③　同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

⑤　投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限ります。

⑥　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑦　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

b　投資態度

①　主として、日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。

②　公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

③　組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

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

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

③　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑥　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑦　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

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

b　投資態度

① 国内の証券取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標とします。

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

③ 不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

④ 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。

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

（3）投資制限

① 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

③ 株式への直接投資は行いません。

④ 外貨建資産への投資は行いません。

⑤ 不動産投信指数先物取引を行うことができます。

⑥ デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑦ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑧ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイグローバルリートマザーファンド

（1）基本方針

このマザーファンドは、Ｓ＆Ｐグローバルリートインデックス（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て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

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

ｂ　投資態度

①　主として、日本を除く世界各国の証券取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している不動産投資信託証券に投資することにより、Ｓ＆Ｐグローバルリートインデックス（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て運用を行います。

②　不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　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。

④　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

①　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

②　同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、Ｓ＆Ｐグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券をＳ＆Ｐグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

③　株式への直接投資は行いません。

④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑤　不動産投信指数先物取引を行うことができます。

⑥　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑦　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑧　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイマネーマーケットマザーファンド

（1）基本方針

このマザーファンドは、安定した収益の確保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

円建ての短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。

b　投資態度

① 円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。

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

（3）投資制限

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

② 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

③ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④ 投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

⑤ 外貨建資産への投資は行いません。

⑥ デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑦ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑧ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（２）【投資対象】

ａ　主な投資対象

複数のマザーファンド※を主要投資対象とします。なお直接、株式（リートを含みます）、公社債、ならびに短期金融商品等に投資を行う場合があります。

※　ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド、ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド、ニッセイグローバルリートマザーファンド、ニッセイマネーマーケットマザーファンド

ｂ　約款に定める投資対象

①　投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、後記「（５）投資制限　ｂ　約款に定めるその他の投資制限　③　先物取引等、④　スワップ取引および⑤　金利先渡取引および為替先渡取引」に定めるものに限ります）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　有価証券

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

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます）
18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます）
21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22．外国の者に対する権利で21．の有価証券の性質を有するもの

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

③　金融商品

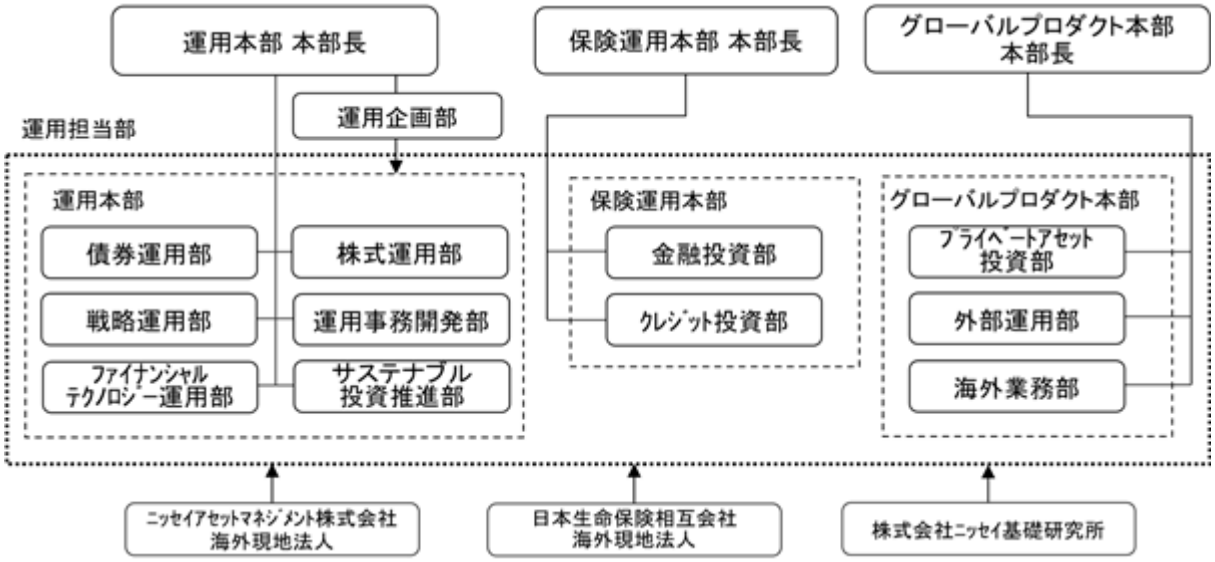
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

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

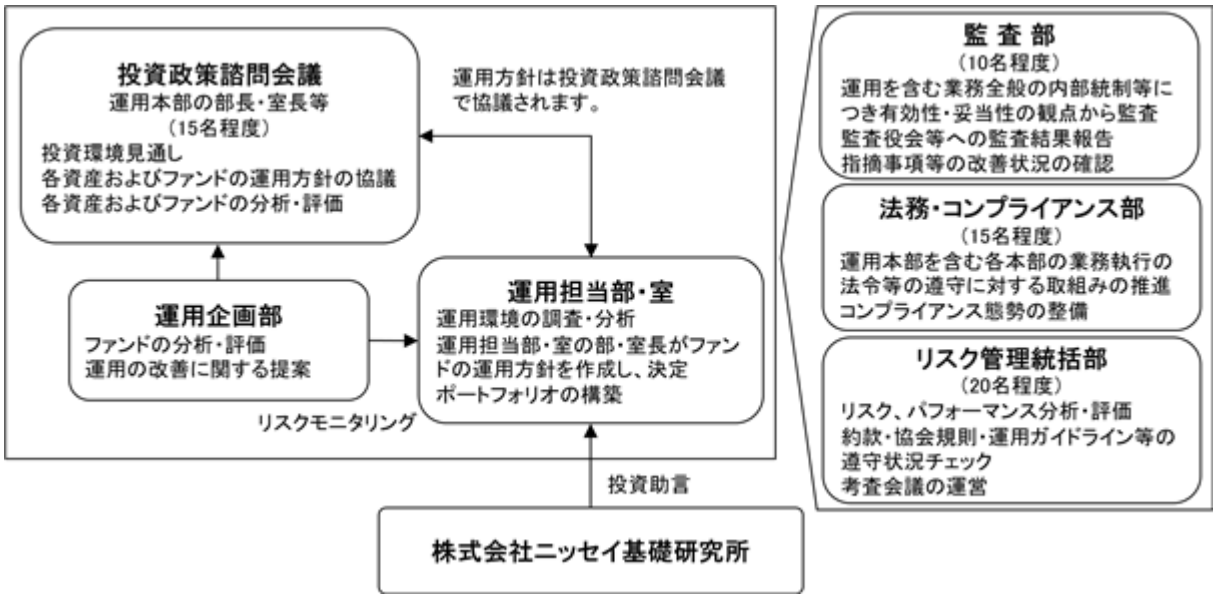
（３）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



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

○　上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

①　原則として以下の方針に基づき分配を行います。

１．分配対象額の範囲
経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

２．分配対象額についての分配方針
委託会社が基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案して決定します。

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

②　分配時期
毎決算日とし、決算日は12月20日（年１回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

③　支払方法
＜分配金受取コースの場合＞
税金を差引いた後※、原則として決算日から起算して５営業日目までにお支払いします。
＜分配金再投資コースの場合＞
税金を差引いた後※、自動的に無手数料で再投資されます。

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

○　将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

（５）【投資制限】

ａ　約款に定める主な投資制限

①　株式への実質投資割合には、制限を設けません。

②　外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③　外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

④　デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

⑤　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。

⑥　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。

⑦　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。

⑧　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。

⑨　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。

⑩　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。

⑪　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ｂ　約款に定めるその他の投資制限

①　投資する株式等の範囲

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

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

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

②　信用取引の範囲

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

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

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

③　先物取引等

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

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

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

④　スワップ取引

１．信託財産に属する資産を効率的に運用するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます）を行うことができます。

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

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

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

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

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

⑤　金利先渡取引および為替先渡取引

１．信託財産に属する資産を効率的に運用するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

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

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

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

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

ⅱ．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

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

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

⑦　有価証券の空売り

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

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

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

⑧　有価証券の借入れ

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

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

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

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　外国為替予約等

１．信託財産を効率的に運用するため、外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

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

３．前記２．の限度額を超えることとなった場合には、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引を行うものとします。

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

５．外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

⑩　資金の借入れ

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

２．一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は借入れを行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

４．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c　法令に定める投資制限

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

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

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

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

③　同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

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

3【投資リスク】

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

リートの価格は、リートが保有する不動産の価値および賃貸料収入の増減等、また不動産市況や景気動向等の影響を受け変動します。
リートが保有する不動産の賃貸料や稼働率の低下、また自然災害等によって保有する不動産に損害等が生じた場合、リートの価格が下落することがあります。

金利変動リスク

リートは、金利が上昇する場合、他の債券の利回り等との比較から売却され、価格が下落することがあります。
また、金融機関等から借入れを行うリートは、金利上昇時には金利負担の増加により収益性が悪化し、リートの価格が下落することがあります。

信用リスク

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

Ｊ－ＲＥＩＴの税制に関するリスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・短期金融資産の運用に関するリスク

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。

・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。

・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。

・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

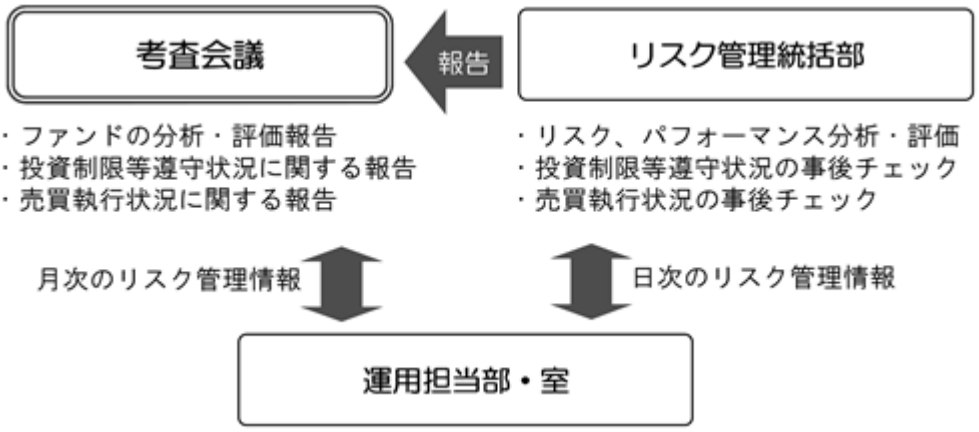
委託会社は2024年12月20日現在、ファンドを１百万円（受益権口数１百万口、ファンド全体の2.3%）保有しています。当該保有分は委託会社により換金されることがあります。

・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生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。

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

（2）投資リスク管理体制



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

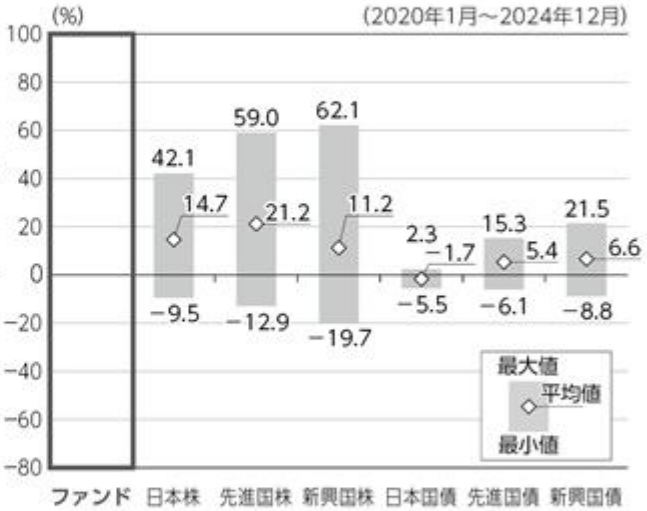
○　上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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

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

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に以下の信託報酬率（年率）をかけた額とし、その配分は次の通りです。

計算期間	信託報酬率	配分(税抜)		
		委託会社	販売会社	受託会社
設定日から 2067年決算日まで	0.242% (税抜0.22%)	0.10%	0.10%	0.02%
2067年決算日翌日から 償還日まで	0.154% (税抜0.14%)	0.06%	0.06%	0.02%

・表に記載の配分先の料率には、別途消費税がかかります。

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

○ 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。

（4）【その他の手数料等】

① 証券取引の手数料等

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

② 監査費用

ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年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。

③ 信託事務の諸費用

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

④ 借入金の利息

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

⑤ 信託財産留保額

ありません。

○ 上記の①、③および④の費用は、運用状況等により変動するため、事前に当該費用の金額、その上限額、計算方法を記載することはできません。また、「４　手数料等及び税金」に記載している費用と税金の合計額、その上限額、計算方法についても、運用状況および保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。

＜ご参考＞

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

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

（５）【課税上の取扱い】

≪確定拠出年金としてファンドを取得した場合≫

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

≪確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合≫

課税対象

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

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

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

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

個人の課税の取扱い

分　　配　　時　：　分配時の普通分配金は、上場株式等の配当所得として、以下の税率により源泉徴収※され申告不要制度が適用されます。
なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用はありません）または申告分離課税を選択することもできます。
※　外国税額控除の適用となった場合には、当該分配時の税額が異なる場合があります。

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

税率（個人）

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

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

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

＜少額投資非課税制度について＞

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

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

対象は税法上の要件を満たしたファンドを購入した場合に限られ、当ファンドは、ＮＩＳＡの対象ではありません。

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

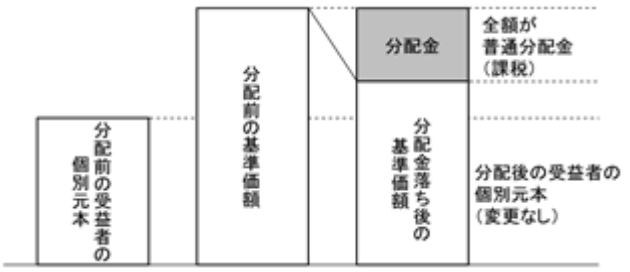
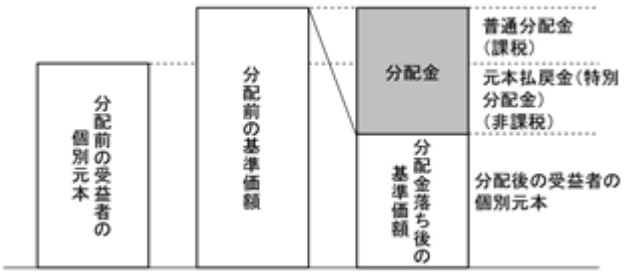
個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

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

(参考情報)ファンドの総経費率

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.25%	0.24%	0.01%

・対象期間:2024年4月30日～2024年12月20日
・対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。
・費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。
・①運用管理費用の比率、②その他費用の比率および総経費率は、表示桁数未満を四捨五入しているため、①と②の合計が総経費率の数字と一致しないことがあります。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】

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		59,305,806	100.00
	内　日本	59,305,806	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△1,152	△0.00
純資産総額		59,304,654	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　ジャージィー	1,014,320,323	0.08
	内　オランダ領キュラソー	947,297,248	0.08
	内　バミューダ	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。

ニッセイグローバルリート　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		14,515,516,539	97.85
	内　アメリカ	11,357,843,239	76.56
	内　オーストラリア	1,040,421,901	7.01
	内　イギリス	576,474,533	3.89
	内　シンガポール	456,574,116	3.08
	内　フランス	253,142,597	1.71
	内　カナダ	191,797,882	1.29
	内　香港	147,618,534	1.00
	内　ベルギー	140,756,752	0.95
	内　南アフリカ	106,810,570	0.72
	内　メキシコ	63,099,098	0.43
	内　スペイン	61,376,127	0.41
	内　韓国	39,499,746	0.27
	内　イスラエル	27,563,845	0.19
	内　ニュージーランド	19,975,185	0.13
	内　オランダ	17,039,162	0.11
	内　アイルランド	7,332,936	0.05
	内　ドイツ	4,547,748	0.03
	内　イタリア	3,642,568	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		318,854,094	2.15
純資産総額		14,834,370,633	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）		310,824,723	2.10
	内　アメリカ	271,436,880	1.83
	内　ドイツ	39,387,843	0.27

（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。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

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	5,354,512	5.0168 26,862,878	5.0906 27,257,678	－ －	45.96
2	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	5,783,263	3.2754 18,942,745	3.3714 19,497,692	－ －	32.88
3	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	5,159,198	1.8105 9,341,040	1.8149 9,363,428	－ －	15.79
4	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	3,014,366	0.9119 2,748,824	0.9098 2,742,470	－ －	4.62
5	ニッセイグローバルリート　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	213,505	2.0850 445,176	2.0821 444,538	－ －	0.75

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

27	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	204,800	6,840.28 1,400,890,808	9,198.00 1,883,750,400	－ －	0.71
28	三菱電機 日本	株式 電気機器	667,700	2,319.73 1,548,885,140	2,687.00 1,794,109,900	－ －	0.68
29	富士通 日本	株式 電気機器	604,100	2,326.81 1,405,628,835	2,799.50 1,691,177,950	－ －	0.64
30	キヤノン 日本	株式 電気機器	324,200	4,235.26 1,373,071,626	5,161.00 1,673,196,200	－ －	0.63

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

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ＧＩＣＳ分類（産業グループ）によるものです。なお、ＧＩＣＳに関する知的財産所有権はＳ＆Ｐ及びMSCI Inc.に帰属します。

ニッセイグローバルリート　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	58,031	18,176.79 1,054,817,782	16,646.86 966,034,118	－ －	6.51
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	6,045	146,089.37 883,110,290	149,109.95 901,369,700	－ －	6.08
3	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	37,179	21,800.30 810,513,450	19,772.49 735,121,777	－ －	4.96
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	19,609	29,599.68 580,420,169	28,178.18 552,546,033	－ －	3.72
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	19,299	28,637.86 552,682,237	27,208.54 525,097,648	－ －	3.54
6	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	9,858	52,792.13 520,424,832	47,153.45 464,838,788	－ －	3.13
7	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	54,893	9,031.72 495,778,221	8,329.75 457,245,449	－ －	3.08
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	119,841	3,683.38 441,420,186	3,633.66 435,462,047	－ －	2.94
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	9,025	36,263.16 327,275,066	34,986.25 315,750,927	－ －	2.13
10	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	13,323	26,127.75 348,100,095	23,424.87 312,089,625	－ －	2.10
11	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	67,694	5,086.71 344,339,893	4,577.72 309,884,800	－ －	2.09
12	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	18,506	18,393.41 340,388,579	16,564.60 306,544,665	－ －	2.07
13	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	21,819	11,776.88 256,959,892	11,322.52 247,046,159	－ －	1.67
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	26,033	10,146.61 264,146,843	9,315.22 242,503,127	－ －	1.63
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	36,492	5,378.20 196,261,581	5,077.57 185,290,976	－ －	1.25
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	4,081	47,686.22 194,607,504	44,991.13 183,608,831	－ －	1.24
17	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	7,313	25,001.88 182,838,756	24,320.17 177,853,439	－ －	1.20
18	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証券	42,534	3,957.68 168,336,211	3,696.66 157,234,017	－ －	1.06
19	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	9,851	16,511.54 162,655,212	15,557.00 153,252,036	－ －	1.03
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	7,575	20,022.93 151,673,756	19,560.53 148,171,081	－ －	1.00
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	43,831	3,381.71 148,224,046	3,176.25 139,218,406	－ －	0.94

22	HOST HOTELS AND RESORTS INC アメリカ	投資証券	47,568	2,744.20 130,536,331	2,843.28 135,249,404	－ －	0.91
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIE アメリカ	投資証券	17,718	7,941.22 140,702,557	7,568.91 134,106,000	－ －	0.90
24	UDR INC アメリカ	投資証券	18,944	7,036.24 133,294,549	6,866.59 130,080,752	－ －	0.88
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	11,866	11,196.91 132,862,615	10,534.78 125,005,794	－ －	0.84
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	6,697	19,169.60 128,378,838	18,227.08 122,066,764	－ －	0.82
27	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	13,922	8,929.38 124,314,944	8,622.39 120,040,938	－ －	0.81
28	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	10,098	11,745.70 118,608,137	11,697.41 118,120,456	－ －	0.80
29	AMERICAN HOMES 4 RENT- A アメリカ	投資証券	20,058	5,942.99 119,204,509	5,868.47 117,709,931	－ －	0.79
30	SEGRO PLC イギリス	投資証券	84,353	1,517.14 127,975,888	1,379.20 116,340,383	－ －	0.78

（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		97.85
	小計		97.85
合　計（対純資産総額比）			97.85

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2024年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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイグローバルリート　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2024年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　０７０３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
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 202503	買建	267	2,189,220,479	2,163,372,733	0.18
	ＩＣＥ－ＥＵ	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。

ニッセイグローバルリート　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	48	284,288,941	271,436,880	1.83
	ＥＵＲＥＸ取引所	THE STOXX 600 REAL ESTATE INDEX FUTURE 202503	買建	38	39,570,245	39,387,843	0.27

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

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2024年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(2024年12月20日)	47,816,376	47,816,376	1.0797	1.0797
2024年4月末日	1,018,568	－	1.0186	－
5月末日	1,033,357	－	1.0334	－
6月末日	1,073,340	－	1.0733	－
7月末日	1,036,981	－	1.0370	－
8月末日	1,014,638	－	1.0146	－
9月末日	11,540,790	－	1.0150	－
10月末日	29,939,584	－	1.0636	－
11月末日	34,688,684	－	1.0609	－
12月末日	59,304,654	－	1.0995	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	8.0

（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。）。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	53,670,866	9,382,804	44,288,062

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜参考情報＞

3.運用実績

2024年12月末現在

●基準価額・純資産の推移

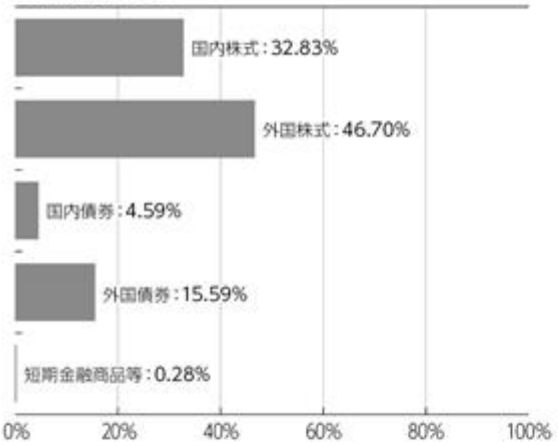
基準価額	10,995円
純資産総額	59百万円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2024年12月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

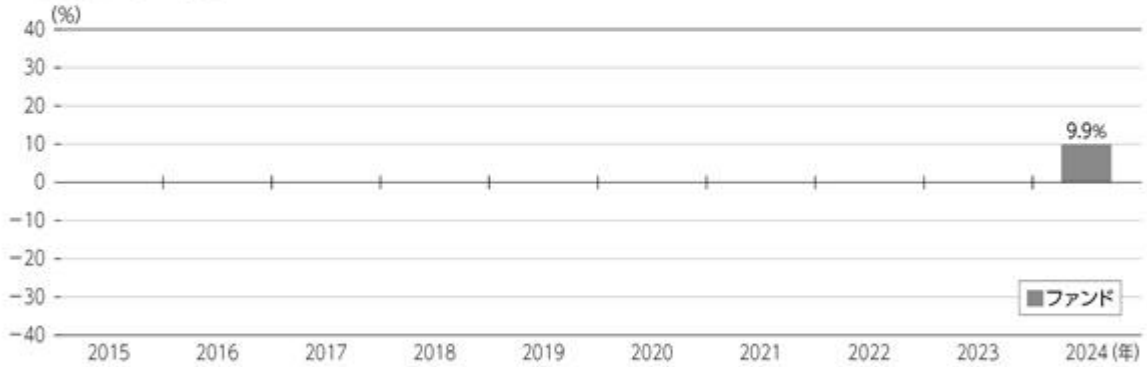
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。
・株式にはリートを含みます。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・2024年はファンド設定時から上記作成基準日までの収益率です。

! ファンドの運用実績は、あくまで過去の実績であり、将来の運用成果等を約束するものではありません。
最新の基準価額および純資産総額等については、委託会社のホームページでご確認いただけます。

◉マザーファンドの状況

1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	4.2%
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%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.6%
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%

・比率は対組入株式評価額比です。

2.ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	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%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券	98.1%
短期金融資産等	1.9%

・比率は対純資産総額比です。

3.ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	5.8%
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%

・業種はGICS分類(セクター)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。
・比率は対組入株式等評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	78.3%
2	イギリス	3.6%
3	カナダ	3.1%
4	フランス	2.7%
5	スイス	2.3%

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

4.ニッセイグローバルリートマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	6.7%
2	EQUINIX INC	アメリカ	6.2%
3	WELLTOWER INC	アメリカ	5.1%
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.8%
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.6%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	78.2%
2	オーストラリア	7.2%
3	イギリス	4.0%
4	シンガポール	3.1%
5	フランス	1.7%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。
・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

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

3.運用実績

2024年12月末現在

5.ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第343回　利付国債(10年)	2026/06/20	0.100%	0.8%
2	第342回　利付国債(10年)	2026/03/20	0.100%	0.8%
3	第148回　利付国債(5年)	2026/06/20	0.005%	0.8%
4	第344回　利付国債(10年)	2026/09/20	0.100%	0.8%
5	第345回　利付国債(10年)	2026/12/20	0.100%	0.8%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入債券種別

種別	比率
日本国債	81.7%
その他	18.3%

・比率は対組入債券評価額比です。

6.ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	2026/02/15	1.625%	3.8%
2	アメリカ国債	2026/08/15	1.500%	2.4%
3	アメリカ国債	2026/05/15	1.625%	2.0%
4	アメリカ国債	2026/11/15	2.000%	1.7%
5	アメリカ国債	2027/02/15	2.250%	1.5%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	47.2%
2	中国	11.2%
3	フランス	7.3%
4	イタリア	6.9%
5	ドイツ	5.8%

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

7.ニッセイマネーマーケットマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	種別	償還日	比率
1	第146回　共同発行市場公募地方債	地方債	2025/05/23	13.9%
2	第213回　神奈川県公募公債	地方債	2025/03/19	13.9%
3	令和2年度第10回　北海道公募公債(5年)	地方債	2025/09/25	13.8%
4	第74回　政保地方公共団体金融機構債券	特殊債	2025/07/15	10.5%
5	第148回　共同発行市場公募地方債	地方債	2025/07/25	7.9%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入比率

種別	比率
債券	63.2%
現金、その他	36.8%

・比率は対純資産総額比です。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

①　申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います（ただし、ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行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。

②　取扱コース

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

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

③　申込単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑤　販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

２【換金（解約）手続等】

①　換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います（ただし、ニューヨーク証券取引所、ニューヨークの銀行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。

②　換金方法

「解約請求」および「買取請求」の２つの方法があります。

③　換金単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　換金価額

＜解約請求の場合＞

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

＜買取請求の場合＞

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

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

○　換金手数料はありません。

⑤　信託財産留保額

ありません。

⑥　支払開始日

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

⑦　その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

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

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

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

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

⑤ 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

⑥ 基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

2024年4月30日から2081年12月22日までですが、委託会社は、信託期間終了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（4）【計算期間】

毎年12月21日から翌年12月20日までとします。

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

（５）【その他】

①　繰上償還

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

ⅰ．受益権の口数が10億口を下回っている場合

ⅱ．この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

ⅲ．やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

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

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

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

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

９．償還金については、原則として償還日から起算して５営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して５営業日目）までにお支払いします。

②　約款の変更等

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

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

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

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

５．書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

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

③　反対者の買取請求の不適用

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

④　公告

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

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

⑤　運用報告書の作成

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

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

・運用報告書（全体版）は、電磁的方法により提供します。ただし、受益者から書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行います。

⑥　信託事務処理の再信託

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

⑦　関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

（２）償還金に対する請求権

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

（３）解約請求権

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

（４）帳簿閲覧権

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

（５）書面決議における議決権

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

（６）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

第３【ファンドの経理状況】

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2024年4月30日から2024年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2024年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	153
コール・ローン	10,877
親投資信託受益証券	47,816,685
未収入金	908
流動資産合計	47,828,623
資産合計	47,828,623
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,102
未払委託者報酬	11,109
その他未払費用	36
流動負債合計	12,247
負債合計	12,247
純資産の部	
元本等	
元本	44,288,062
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,528,314
（分配準備積立金）	1,277,671
元本等合計	47,816,376
純資産合計	47,816,376
負債純資産合計	47,828,623

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2024年4月30日 至　2024年12月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,509,478
営業収益合計	1,509,478
営業費用	
受託者報酬	1,550
委託者報酬	16,210
その他費用	36
営業費用合計	17,796
営業利益又は営業損失（△）	1,491,682
経常利益又は経常損失（△）	1,491,682
当期純利益又は当期純損失（△）	1,491,682
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（△）	214,011
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,479,397
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	2,479,397
剰余金減少額又は欠損金増加額	228,754
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	228,754
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（△）	3,528,314

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第1期 自　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 2024年12月20日現在
１．　期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	52,670,866円
期中一部解約元本額	9,382,804円
２．　受益権の総数	44,288,062口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,277,671円）、収益調整金（2,250,643円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は3,528,314円（1万口当たり796.67円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2024年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2024年12月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,286,320
合計	1,286,320

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2024年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0797円 (10,797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20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	4,687,121	15,311,886	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	4,266,124	7,725,523	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	4,502,774	22,535,033	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	2,460,524	2,244,243	
親投資信託受益証券　合計		15,916,543	47,816,685	
合計			47,816,685	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	77,069,873
コール・ローン	5,470,119,329
株式	251,542,389,910
未収配当金	30,471,038
前払金	27,744,000
差入委託証拠金	289,178,147
流動資産合計	257,436,972,297
資産合計	257,436,972,297
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	81,916,200
未払解約金	480,833,761
流動負債合計	562,749,961
負債合計	562,749,961
純資産の部	
元本等	
元本	78,631,231,610
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	178,242,990,726
元本等合計	256,874,222,336
純資産合計	256,874,222,336
負債純資産合計	257,436,972,297

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年12月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	73,016,658,526円
同期中追加設定元本額	18,400,105,202円
同期中一部解約元本額	12,785,532,118円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイＴＯＰＩＸオープン	5,093,265,856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）	2,927,639,290円
ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	2,932,578円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,026,800,659円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,606,179,800円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	6,909,228,522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）	1,889,550円
ニッセイインデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	2,976,733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）	8,461,489円
ＤＣニッセイ国内株式インデックス	5,273,205,785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	25,612,705,154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）	5,232,735,522円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	477,401,541円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	248,413,108円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	553,715,416円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	703,303,706円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	28,294,875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）	126,128,251円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	13,906,825円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	15,513,826円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	4,971,054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）	11,248,830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）	28,837,736円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	398,911,128円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	268,984,861円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	473,962,151円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	207,254,981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）	13,994,230,871円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ世界株式ファンド（ＧＤＰ型バスケット）	29,913,379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）	41,274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）	92,043円
ＦＷニッセイ国内株インデックス	104,737,671円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	201,742,453円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	36,811,337円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	4,687,121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）	91,727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	78,631,231,610円
２．　受益権の総数	78,631,231,610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　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	5,919,735,786
合計	5,919,735,786

（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20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2024年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	5,593,884,000	－	5,512,080,000	△81,804,000
合計	5,593,884,000	－	5,512,080,000	△81,804,000

（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20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.2668円 (32,668円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2024年12月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,800	3,970.00	15,086,000	
ニッスイ	91,100	878.50	80,031,350	
マルハニチロ	13,500	2,909.50	39,278,250	
雪国まいたけ	7,800	1,011.00	7,885,800	
カネコ種苗	2,700	1,423.00	3,842,100	
サカタのタネ	10,200	3,380.00	34,476,000	
ホクト	8,100	1,802.00	14,596,200	
ショーボンドホールディングス	12,000	5,245.00	62,940,000	
ミライト・ワン	29,800	2,297.50	68,465,500	
タマホーム	5,700	3,435.00	19,579,500	
住石ホールディングス	9,900	787.00	7,791,300	
日鉄鉱業	3,700	4,260.00	15,762,000	
三井松島ホールディングス	4,400	3,280.00	14,432,000	
ＩＮＰＥＸ	275,400	1,941.50	534,689,100	
石油資源開発	50,000	1,082.00	54,100,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,100	3,020.00	12,382,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	11,600	2,243.00	26,018,800	
安藤・間	52,800	1,178.00	62,198,400	
東急建設	28,500	703.00	20,035,500	
コムシスホールディングス	32,300	3,240.00	104,652,000	
ビーアールホールディングス	23,500	335.00	7,872,500	
高松コンストラクショングループ	6,800	2,716.00	18,468,800	
東建コーポレーション	2,300	11,980.00	27,554,000	
ヤマウラ	6,900	1,182.00	8,155,800	
オリエンタル白石	33,700	390.00	13,143,000	
大成建設	57,900	6,563.00	379,997,700	
大林組	210,400	2,049.00	431,109,600	
清水建設	180,700	1,221.00	220,634,700	
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	893.00	8,572,800	
鹿島建設	141,300	2,808.00	396,770,400	
不動テトラ	4,000	2,014.00	8,056,000	
鉄建建設	4,200	2,195.00	9,219,000	
西松建設	10,200	5,159.00	52,621,800	
三井住友建設	51,400	416.00	21,382,400	
大豊建設	2,400	3,325.00	7,980,000	
奥村組	11,300	3,835.00	43,335,500	
東鉄工業	7,000	3,190.00	22,330,000	
淺沼組	25,500	619.00	15,784,500	

戸田建設	78,400	940.10	73,703,840	
熊谷組	10,500	3,935.00	41,317,500	
矢作建設工業	8,700	1,532.00	13,328,400	
日本ハウスホールディングス	24,100	321.00	7,736,100	
大東建託	21,800	17,630.00	384,334,000	
新日本建設	8,900	1,489.00	13,252,100	
サムティホールディングス	12,500	3,290.00	41,125,000	
東亜道路工業	11,000	1,280.00	14,080,000	
日本道路	6,400	1,761.00	11,270,400	
東亜建設工業	19,200	1,187.00	22,790,400	
日本国土開発	18,100	502.00	9,086,200	
若築建設	2,200	3,715.00	8,173,000	
東洋建設	18,300	1,296.00	23,716,800	
五洋建設	83,400	621.50	51,833,100	
世紀東急工業	9,100	1,470.00	13,377,000	
福田組	2,500	5,220.00	13,050,000	
住友林業	55,100	5,207.00	286,905,700	
大和ハウス工業	192,300	4,753.00	914,001,900	
ライト工業	12,900	2,242.00	28,921,800	
積水ハウス	193,400	3,615.00	699,141,000	
日特建設	8,000	973.00	7,784,000	
ユアテック	12,300	1,420.00	17,466,000	
日本リーテック	7,100	1,266.00	8,988,600	
四電工	8,000	1,576.00	12,608,000	
中電工	9,900	3,260.00	32,274,000	
関電工	34,900	2,367.00	82,608,300	
きんでん	44,300	3,081.00	136,488,300	
東京エネシス	7,800	1,044.00	8,143,200	
トーエネック	10,600	925.00	9,805,000	
住友電設	5,200	4,830.00	25,116,000	
日本電設工業	12,000	1,999.00	23,988,000	
エクシオグループ	67,500	1,717.50	115,931,250	
新日本空調	4,100	4,140.00	16,974,000	
九電工	13,800	5,067.00	69,924,600	
三機工業	13,300	3,190.00	42,427,000	
日揮ホールディングス	63,100	1,260.00	79,506,000	
中外炉工業	2,500	3,470.00	8,675,000	
太平電業	4,100	4,990.00	20,459,000	
高砂熱学工業	15,400	6,436.00	99,114,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	25,400	3,310.00	84,074,000	
朝日工業社	5,900	2,194.00	12,944,600	
明星工業	11,000	1,370.00	15,070,000	
大氣社	8,200	4,830.00	39,606,000	
ダイダン	8,400	3,940.00	33,096,000	
日比谷総合設備	5,200	3,840.00	19,968,000	
ニップン	21,100	2,128.00	44,900,800	
日清製粉グループ本社	66,600	1,820.00	121,212,000	
日東富士製粉	1,200	6,550.00	7,860,000	
昭和産業	5,400	2,790.00	15,066,000	
中部飼料	8,900	1,279.00	11,383,100	

フィード・ワン	9,900	752.00	7,444,800	
日本甜菜製糖	3,400	2,349.00	7,986,600	
DM三井製糖ホールディングス	6,300	3,420.00	21,546,000	
ウェルネオシュガー	3,800	2,126.00	8,078,800	
ＬＩＦＵＬＬ	26,800	200.00	5,360,000	
ＭＩＸＩ	12,500	3,105.00	38,812,500	
ジェイエイシーリクルートメント	24,100	726.00	17,496,600	
日本M&Aセンターホールディングス	98,300	653.10	64,199,730	
メンバーズ	7,300	1,041.00	7,599,300	
ＵＴグループ	8,700	2,120.00	18,444,000	
ケアネット	13,700	556.00	7,617,200	
Ｅ・Ｊホールディングス	4,700	1,678.00	7,886,600	
オープンアップグループ	20,100	1,794.00	36,059,400	
コシダカホールディングス	20,200	1,149.00	23,209,800	
パソナグループ	8,100	1,950.00	15,795,000	
リンクアンドモチベーション	16,500	588.00	9,702,000	
エス・エム・エス	25,500	1,566.50	39,945,750	
パーソルホールディングス	623,500	236.90	147,707,150	
森永製菓	26,800	2,743.00	73,512,400	
中村屋	2,500	3,195.00	7,987,500	
江崎グリコ	18,300	4,740.00	86,742,000	
名糖産業	1,300	1,938.00	2,519,400	
井村屋グループ	3,500	2,445.00	8,557,500	
不二家	4,400	2,707.00	11,910,800	
山崎製パン	42,800	2,931.00	125,446,800	
モロゾフ	2,100	4,780.00	10,038,000	
亀田製菓	4,100	4,050.00	16,605,000	
寿スピリッツ	37,800	2,130.00	80,514,000	
カルビー	29,300	3,163.00	92,675,900	
森永乳業	24,600	2,906.50	71,499,900	
六甲バター	5,800	1,361.00	7,893,800	
ヤクルト本社	91,500	3,028.00	277,062,000	
明治ホールディングス	85,600	3,163.00	270,752,800	
雪印メグミルク	17,200	2,712.00	46,646,400	
プリマハム	8,600	2,194.00	18,868,400	
日本ハム	27,500	4,940.00	135,850,000	
丸大食品	6,400	1,663.00	10,643,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	7,100	2,708.00	19,226,800	
柿安本店	2,900	2,805.00	8,134,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	9,800	3,895.00	38,171,000	
学情	4,600	2,247.00	10,336,200	
クロスキャット	7,300	1,014.00	7,402,200	
システナ	93,200	370.00	34,484,000	
デジタルアーツ	4,100	6,010.00	24,641,000	
日鉄ソリューションズ	22,200	4,098.00	90,975,600	
綜合警備保障	111,600	1,082.00	120,751,200	
キューブシステム	7,600	1,050.00	7,980,000	
いちご	54,200	361.00	19,566,200	
日本駐車場開発	76,200	215.00	16,383,000	
コア	4,400	1,823.00	8,021,200	

カカクコム	48,200	2,430.50	117,150,100	
アイロムグループ	2,700	2,783.00	7,514,100	
セントケア・ホールディング	10,800	727.00	7,851,600	
ディップ	11,700	2,414.00	28,243,800	
ＳＢＳホールディングス	5,800	2,347.00	13,612,600	
新日本科学	7,100	1,604.00	11,388,400	
エムスリー	132,000	1,365.50	180,246,000	
ワールドホールディングス	3,800	1,995.00	7,581,000	
ディー・エヌ・エー	26,700	2,694.50	71,943,150	
博報堂ＤＹホールディングス	75,700	1,244.00	94,170,800	
ファンコミュニケーションズ	19,100	414.00	7,907,400	
エスプール	24,500	311.00	7,619,500	
ＷＤＢホールディングス	4,700	1,662.00	7,811,400	
アドウェイズ	24,400	299.00	7,295,600	
バリューコマース	7,000	1,189.00	8,323,000	
インフォマート	63,100	298.00	18,803,800	
サッポロホールディングス	21,100	8,476.00	178,843,600	
アサヒグループホールディングス	480,600	1,663.00	799,237,800	
キリンホールディングス	266,600	2,058.50	548,796,100	
シマダヤ	5,700	1,350.00	7,695,000	
宝ホールディングス	43,100	1,350.00	58,185,000	
オエノンホールディングス	20,700	396.00	8,197,200	
飛島ホールディングス	6,500	1,573.00	10,224,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	45,100	2,443.00	110,179,300	
ライフドリンク　カンパニー	14,000	2,312.00	32,368,000	
サントリー食品インターナショナル	45,100	5,055.00	227,980,500	
ダイドーグループホールディングス	7,200	3,345.00	24,084,000	
伊藤園	21,400	3,558.00	76,141,200	
キーコーヒー	7,200	2,015.00	14,508,000	
日清オイリオグループ	9,000	5,100.00	45,900,000	
不二製油グループ本社	12,800	3,571.00	45,708,800	
Ｊ－オイルミルズ	7,300	2,128.00	15,534,400	
インターメスティック	3,900	2,544.00	9,921,600	
サンエー	11,700	2,786.00	32,596,200	
カワチ薬品	5,400	2,488.00	13,435,200	
エービーシー・マート	30,100	3,216.00	96,801,600	
ハードオフコーポレーション	4,400	1,800.00	7,920,000	
高千穂交易	2,700	3,815.00	10,300,500	
アスクル	16,300	1,712.00	27,905,600	
ゲオホールディングス	7,700	1,588.00	12,227,600	
アダストリア	9,500	3,575.00	33,962,500	
リガク・ホールディングス	32,900	921.00	30,300,900	
伊藤忠食品	1,600	6,980.00	11,168,000	
くら寿司	8,000	3,030.00	24,240,000	
キャンドゥ	2,400	3,415.00	8,196,000	
エレマテック	6,200	2,390.00	14,818,000	
パルグループホールディングス	15,700	3,105.00	48,748,500	
エディオン	29,900	1,778.00	53,162,200	
あらた	10,500	3,085.00	32,392,500	

サーラコーポレーション	14,400	851.00	12,254,400	
ハローズ	2,700	3,980.00	10,746,000	
ＪＰホールディングス	17,100	656.00	11,217,600	
フジオフードグループ本社	7,700	1,179.00	9,078,300	
あみやき亭	5,000	1,624.00	8,120,000	
東京エレクトロン　デバイス	6,900	2,805.00	19,354,500	
円谷フィールズホールディングス	11,100	1,730.00	19,203,000	
双日	76,600	3,039.00	232,787,400	
アルフレッサ　ホールディングス	64,100	2,154.50	138,103,450	
大黒天物産	2,100	9,610.00	20,181,000	
ハニーズホールディングス	6,100	1,616.00	9,857,600	
キッコーマン	212,100	1,736.50	368,311,650	
味の素	148,300	6,418.00	951,789,400	
ブルドックソース	4,400	1,800.00	7,920,000	
キユーピー	34,400	3,376.00	116,134,400	
ハウス食品グループ本社	21,500	2,856.00	61,404,000	
カゴメ	27,400	2,936.00	80,446,400	
アリアケジャパン	6,400	5,530.00	35,392,000	
エバラ食品工業	2,800	2,893.00	8,100,400	
ニチレイ	26,100	4,137.00	107,975,700	
横浜冷凍	17,300	829.00	14,341,700	
東洋水産	29,600	10,720.00	317,312,000	
イートアンドホールディングス	3,800	2,110.00	8,018,000	
日清食品ホールディングス	82,500	3,782.00	312,015,000	
フジッコ	6,600	1,681.00	11,094,600	
ロック・フィールド	7,800	1,507.00	11,754,600	
日本たばこ産業	388,900	4,143.00	1,611,212,700	
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,002.00	8,008,000	
わらべや日洋ホールディングス	4,300	1,954.00	8,402,200	
なとり	4,000	2,171.00	8,684,000	
ファーマフーズ	8,500	926.00	7,871,000	
北の達人コーポレーション	54,000	140.00	7,560,000	
ユーグレナ	39,800	397.00	15,800,600	
紀文食品	7,200	1,061.00	7,639,200	
ＳＲＥホールディングス	2,400	3,075.00	7,380,000	
片倉工業	6,000	1,863.00	11,178,000	
グンゼ	4,600	5,400.00	24,840,000	
ヒューリック	149,300	1,347.50	201,181,750	
アルペン	5,700	2,060.00	11,742,000	
ラクーンホールディングス	6,500	740.00	4,810,000	
クオールホールディングス	8,500	1,402.00	11,917,000	
アルコニックス	9,800	1,457.00	14,278,600	
神戸物産	53,200	3,475.00	184,870,000	
ジンズホールディングス	5,200	6,620.00	34,424,000	
ビックカメラ	41,200	1,714.00	70,616,800	
ＤＣＭホールディングス	35,600	1,409.00	50,160,400	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	97,500	2,723.50	265,541,250	
あい　ホールディングス	11,000	2,092.00	23,012,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	78,900	1,953.00	154,091,700	
ドトール・日レスホールディングス	12,200	2,309.00	28,169,800	

マツキヨココカラ＆カンパニー	121,200	2,182.00	264,458,400	
ブロンコビリー	4,000	3,705.00	14,820,000	
ＺＯＺＯ	51,100	4,867.00	248,703,700	
トレジャー・ファクトリー	6,200	1,387.00	8,599,400	
物語コーポレーション	12,300	3,555.00	43,726,500	
三越伊勢丹ホールディングス	104,400	2,431.00	253,796,400	
東洋紡	28,100	931.00	26,161,100	
富士紡ホールディングス	2,600	5,400.00	14,040,000	
日清紡ホールディングス	49,400	865.00	42,731,000	
倉敷紡績	4,600	5,420.00	24,932,000	
ダイワボウホールディングス	30,400	3,071.00	93,358,400	
日東紡績	7,300	6,210.00	45,333,000	
トヨタ紡織	27,400	1,990.50	54,539,700	
マクニカホールディングス	53,200	1,724.50	91,743,400	
Ｈａｍｅｅ	7,500	1,371.00	10,282,500	
ラクト・ジャパン	2,900	2,719.00	7,885,100	
ウエルシアホールディングス	35,700	1,905.00	68,008,500	
クリエイトＳＤホールディングス	9,700	2,773.00	26,898,100	
グリムス	3,000	2,551.00	7,653,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9,500	1,144.00	10,868,000	
八洲電機	5,600	1,670.00	9,352,000	
レスター	5,800	2,495.00	14,471,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	37,300	951.00	35,472,300	
三洋貿易	7,000	1,538.00	10,766,000	
シュッピン	7,900	1,014.00	8,010,600	
ビューティガレージ	5,600	1,310.00	7,336,000	
オイシックス・ラ・大地	11,100	1,287.00	14,285,700	
ネクステージ	15,700	1,310.00	20,567,000	
ジョイフル本田	19,100	1,831.00	34,972,100	
エターナルホスピタリティグループ	2,500	2,810.00	7,025,000	
ホットランド	5,300	2,231.00	11,824,300	
すかいらーくホールディングス	94,000	2,442.00	229,548,000	
ＳＦＰホールディングス	4,200	1,944.00	8,164,800	
綿半ホールディングス	5,300	1,511.00	8,008,300	
日本毛織	16,700	1,280.00	21,376,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	29,300	733.00	21,476,900	
野村不動産ホールディングス	40,100	3,726.00	149,412,600	
三重交通グループホールディングス	15,800	485.00	7,663,000	
ディア・ライフ	10,900	1,030.00	11,227,000	
地主	5,700	2,120.00	12,084,000	
プレサンスコーポレーション	8,500	1,922.00	16,337,000	
ＪＰＭＣ	6,800	1,130.00	7,684,000	
フージャースホールディングス	9,900	998.00	9,880,200	
オープンハウスグループ	23,500	5,387.00	126,594,500	
東急不動産ホールディングス	192,400	936.60	180,201,840	
飯田グループホールディングス	61,300	2,361.00	144,729,300	
帝国繊維	7,400	2,365.00	17,501,000	
日本コークス工業	31,400	93.00	2,920,200	

ＢＥＥＮＯＳ	4,300	4,000.00	17,200,000	
あさひ	5,700	1,584.00	9,028,800	
日本調剤	5,600	1,372.00	7,683,200	
コスモス薬品	11,700	6,406.00	74,950,200	
シップヘルスケアホールディングス	27,200	2,191.50	59,608,800	
ソフトクリエイトホールディングス	4,700	2,294.00	10,781,800	
セブン&アイ・ホールディングス	759,600	2,416.00	1,835,193,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	51,700	1,160.00	59,972,000	
明治電機工業	5,800	1,370.00	7,946,000	
ツルハホールディングス	14,500	8,018.00	116,261,000	
サンマルクホールディングス	5,500	2,561.00	14,085,500	
トリドールホールディングス	19,300	3,881.00	74,903,300	
帝人	62,500	1,283.50	80,218,750	
東レ	475,800	987.80	469,995,240	
クラレ	94,900	2,183.50	207,214,150	
旭化成	440,400	1,058.50	466,163,400	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	13,200	312.00	4,118,400	
宮地エンジニアリンググループ	8,100	1,900.00	15,390,000	
トーカロ	19,300	1,828.00	35,280,400	
ＳＵＭＣＯ	127,700	1,120.50	143,087,850	
川田テクノロジーズ	4,300	2,628.00	11,300,400	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,100	3,290.00	16,779,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	8,000	1,146.00	9,168,000	
シーアールイー	6,600	1,200.00	7,920,000	
ケイアイスター不動産	3,500	4,200.00	14,700,000	
ジェイ・エス・ビー	3,000	2,602.00	7,806,000	
ロードスターキャピタル	3,600	2,489.00	8,960,400	
霞ヶ関キャピタル	2,600	11,980.00	31,148,000	
日本フエルト	5,500	474.00	2,607,000	
イチカワ	2,400	1,570.00	3,768,000	
ＪＭホールディングス	5,000	2,430.00	12,150,000	
コメダホールディングス	18,000	2,836.00	51,048,000	
アレンザホールディングス	7,500	1,091.00	8,182,500	
バロックジャパンリミテッド	10,200	787.00	8,027,400	
クスリのアオキホールディングス	23,000	3,227.00	74,221,000	
力の源ホールディングス	7,500	953.00	7,147,500	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	36,700	3,464.00	127,128,800	
セーレン	12,600	2,796.00	35,229,600	
ソトー	5,700	655.00	3,733,500	
東海染工	1,600	701.00	1,121,600	
小松マテーレ	10,100	777.00	7,847,700	
ワコールホールディングス	13,500	5,328.00	71,928,000	
ホギメディカル	8,800	4,785.00	42,108,000	
ＴＳＩホールディングス	20,600	1,062.00	21,877,200	
マツオカコーポレーション	1,800	2,019.00	3,634,200	
ワールド	10,000	2,512.00	25,120,000	
ＴＩＳ	68,900	3,801.00	261,888,900	
グリー	21,800	449.00	9,788,200	

GMOペパボ	5,300	1,550.00	8,215,000	
コーエーテクモホールディングス	49,000	1,820.50	89,204,500	
三菱総合研究所	3,200	4,655.00	14,896,000	
ポールトゥウィンホールディングス	17,200	433.00	7,447,600	
ネクソン	143,200	2,278.00	326,209,600	
アイスタイル	21,800	466.00	10,158,800	
エムアップホールディングス	8,000	1,581.00	12,648,000	
エイチーム	12,200	1,017.00	12,407,400	
セルシス	9,300	1,380.00	12,834,000	
エニグモ	26,300	291.00	7,653,300	
コロプラ	22,100	461.00	10,188,100	
ブロードリーフ	26,200	675.00	17,685,000	
デジタルハーツホールディングス	9,900	816.00	8,078,400	
メディアドゥ	5,900	1,419.00	8,372,100	
じげん	16,300	485.00	7,905,500	
フィックスターズ	6,500	1,802.00	11,713,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,400	1,412.00	7,624,800	
オプティム	11,000	698.00	7,678,000	
ＳＨＩＦＴ	4,300	17,075.00	73,422,500	
特種東海製紙	3,200	3,480.00	11,136,000	
ティーガイア	5,500	2,659.00	14,624,500	
テクマトリックス	14,100	2,436.00	34,347,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	16,200	3,239.00	52,471,800	
GMOペイメントゲートウェイ	14,900	7,981.00	118,916,900	
システムリサーチ	5,800	1,445.00	8,381,000	
インターネットイニシアティブ	35,600	3,002.00	106,871,200	
さくらインターネット	10,200	4,255.00	43,401,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,100	2,403.00	7,449,300	
ＳＲＡホールディングス	3,700	4,165.00	15,410,500	
朝日ネット	12,800	654.00	8,371,200	
ｅＢＡＳＥ	11,900	636.00	7,568,400	
アバントグループ	8,200	1,978.00	16,219,600	
アドソル日進	3,800	2,038.00	7,744,400	
コムチュア	8,600	2,300.00	19,780,000	
アステリア	15,500	519.00	8,044,500	
アイル	3,700	2,711.00	10,030,700	
王子ホールディングス	246,500	590.50	145,558,250	
日本製紙	33,900	848.00	28,747,200	
三菱製紙	900	467.00	420,300	
北越コーポレーション	36,600	1,505.00	55,083,000	
大王製紙	32,900	829.00	27,274,100	
阿波製紙	800	446.00	356,800	
マークラインズ	3,900	2,144.00	8,361,600	
ｇｕｍｉ	21,500	438.00	9,417,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,800	2,140.00	8,132,000	
ラクス	30,800	1,885.00	58,058,000	
ダブルスタンダード	4,900	1,571.00	7,697,900	

オープンドア	11,200	616.00	6,899,200	
アカツキ	3,300	2,792.00	9,213,600	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	6,000	1,255.00	7,530,000	
カナミックネットワーク	15,800	503.00	7,947,400	
レンゴー	59,300	853.30	50,600,690	
トーモク	3,800	2,159.00	8,204,200	
ザ・パック	4,800	3,490.00	16,752,000	
チェンジホールディングス	16,200	1,249.00	20,233,800	
オークネット	3,100	2,651.00	8,218,100	
マクロミル	12,800	1,207.00	15,449,600	
オロ	3,100	2,391.00	7,412,100	
ＰＫＳＨＡ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｙ	5,200	3,790.00	19,708,000	
マネーフォワード	16,000	5,051.00	80,816,000	
レゾナック・ホールディングス	58,400	4,075.00	237,980,000	
住友化学	523,700	342.50	179,367,250	
住友精化	3,100	4,590.00	14,229,000	
日産化学	33,500	4,877.00	163,379,500	
ラサ工業	3,000	2,767.00	8,301,000	
クレハ	13,500	2,746.00	37,071,000	
多木化学	2,500	3,500.00	8,750,000	
石原産業	10,800	1,485.00	16,038,000	
日本曹達	13,800	2,831.00	39,067,800	
東ソー	86,900	2,054.50	178,536,050	
トクヤマ	21,000	2,564.50	53,854,500	
セントラル硝子	8,200	3,205.00	26,281,000	
東亞合成	31,300	1,502.00	47,012,600	
大阪ソーダ	22,700	1,997.00	45,331,900	
関東電化工業	14,000	1,004.00	14,056,000	
デンカ	23,700	2,104.50	49,876,650	
イビデン	37,700	4,363.00	164,485,100	
信越化学工業	583,800	5,054.00	2,950,525,200	
日本カーバイド工業	4,900	1,686.00	8,261,400	
プラスアルファ・コンサルティング	8,300	1,879.00	15,595,700	
電算システムホールディングス	3,200	2,372.00	7,590,400	
堺化学工業	4,500	2,523.00	11,353,500	
第一稀元素化学工業	11,100	663.00	7,359,300	
エア・ウォーター	61,400	1,865.00	114,511,000	
日本酸素ホールディングス	63,200	4,407.00	278,522,400	
日本パーカライジング	29,000	1,291.00	37,439,000	
高圧ガス工業	10,100	771.00	7,787,100	
四国化成ホールディングス	7,400	2,007.00	14,851,800	
ステラ　ケミファ	3,500	4,000.00	14,000,000	
保土谷化学工業	2,100	3,650.00	7,665,000	
日本触媒	41,700	1,861.00	77,603,700	
大日精化工業	4,500	2,900.00	13,050,000	
カネカ	16,000	3,637.00	58,192,000	
協和キリン	76,700	2,375.50	182,200,850	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	19,900	1,522.00	30,287,800	
三菱瓦斯化学	52,800	2,700.50	142,586,400	
三井化学	58,600	3,332.00	195,255,200	

東京応化工業	31,100	3,504.00	108,974,400	
大阪有機化学工業	5,400	2,840.00	15,336,000	
三菱ケミカルグループ	475,900	768.40	365,681,560	
ＫＨネオケム	11,700	2,002.00	23,423,400	
ビジョナル	7,700	8,030.00	61,831,000	
ダイセル	74,000	1,361.50	100,751,000	
住友ベークライト	20,500	3,718.00	76,219,000	
積水化学工業	129,600	2,375.00	307,800,000	
日本ゼオン	50,200	1,439.50	72,262,900	
アイカ工業	16,400	3,231.00	52,988,400	
ＵＢＥ	33,600	2,321.50	78,002,400	
積水樹脂	8,900	2,183.00	19,428,700	
旭有機材	4,300	4,455.00	19,156,500	
ニチバン	4,100	1,996.00	8,183,600	
リケンテクノス	12,200	1,058.00	12,907,600	
大倉工業	3,000	3,010.00	9,030,000	
積水化成品工業	21,800	345.00	7,521,000	
群栄化学工業	3,000	2,605.00	7,815,000	
ダイキョーニシカワ	14,400	610.00	8,784,000	
森六ホールディングス	4,100	1,932.00	7,921,200	
恵和	8,000	993.00	7,944,000	
日本化薬	45,600	1,265.00	57,684,000	
カーリット	6,400	1,240.00	7,936,000	
プレステージ・インターナショナル	31,300	687.00	21,503,100	
プロトコーポレーション	7,100	1,289.00	9,151,900	
ハイマックス	5,800	1,382.00	8,015,600	
アミューズ	5,600	1,422.00	7,963,200	
野村総合研究所	141,300	4,647.00	656,621,100	
クイック	4,600	2,269.00	10,437,400	
日本システム技術	6,000	2,060.00	12,360,000	
電通グループ	71,100	3,943.00	280,347,300	
インテージホールディングス	7,400	1,623.00	12,010,200	
イオンファンタジー	2,900	3,000.00	8,700,000	
ソースネクスト	41,400	165.00	6,831,000	
シーティーエス	9,200	915.00	8,418,000	
メディカルシステムネットワーク	19,000	412.00	7,828,000	
日本精化	4,300	2,236.00	9,614,800	
扶桑化学工業	6,000	3,480.00	20,880,000	
トリケミカル研究所	7,100	2,761.00	19,603,100	
シンプレクス・ホールディングス	12,800	2,506.00	32,076,800	
ラクスル	15,800	1,344.00	21,235,200	
メルカリ	31,800	1,825.00	58,035,000	
ＡＤＥＫＡ	22,700	2,792.00	63,378,400	
日油	76,600	2,170.00	166,222,000	
ハリマ化成グループ	9,500	860.00	8,170,000	
ウイングアーク１ｓｔ	6,800	3,620.00	24,616,000	
Ｓａｎｓａｎ	21,500	2,385.00	51,277,500	
ギフティ	5,700	1,322.00	7,535,400	
花王	158,500	6,484.00	1,027,714,000	
第一工業製薬	2,300	3,850.00	8,855,000	

石原ケミカル	3,200	2,386.00	7,635,200	
三洋化成工業	4,000	3,990.00	15,960,000	
メドレー	7,200	3,885.00	27,972,000	
ベース	3,200	2,900.00	9,280,000	
ＪＭＤＣ	7,900	3,858.00	30,478,200	
武田薬品工業	580,000	4,105.00	2,380,900,000	
アステラス製薬	571,800	1,542.50	882,001,500	
住友ファーマ	58,000	579.00	33,582,000	
塩野義製薬	216,200	2,194.50	474,450,900	
日本新薬	17,100	4,183.00	71,529,300	
中外製薬	204,000	6,650.00	1,356,600,000	
科研製薬	11,200	4,237.00	47,454,400	
エーザイ	86,500	4,316.00	373,334,000	
理研ビタミン	5,500	2,407.00	13,238,500	
ロート製薬	68,900	2,719.00	187,339,100	
小野薬品工業	133,300	1,606.00	214,079,800	
久光製薬	14,500	4,119.00	59,725,500	
持田製薬	8,200	3,485.00	28,577,000	
参天製薬	123,900	1,544.50	191,363,550	
扶桑薬品工業	3,100	2,567.00	7,957,700	
ツムラ	22,400	4,847.00	108,572,800	
テルモ	434,800	3,027.00	1,316,139,600	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	19,600	2,538.50	49,754,600	
キッセイ薬品工業	10,800	3,445.00	37,206,000	
生化学工業	12,400	786.00	9,746,400	
栄研化学	10,300	2,150.00	22,145,000	
鳥居薬品	3,500	4,400.00	15,400,000	
ＪＣＲファーマ	22,100	607.00	13,414,700	
東和薬品	8,800	2,915.00	25,652,000	
富士製薬工業	5,200	1,549.00	8,054,800	
ゼリア新薬工業	10,400	2,406.00	25,022,400	
ネクセラファーマ	30,600	1,034.00	31,640,400	
第一三共	615,200	4,382.00	2,695,806,400	
杏林製薬	14,100	1,447.00	20,402,700	
ダイト	4,800	2,018.00	9,686,400	
大塚ホールディングス	162,700	8,483.00	1,380,184,100	
ペプチドリーム	31,600	2,570.00	81,212,000	
大日本塗料	7,200	1,102.00	7,934,400	
日本ペイントホールディングス	288,100	1,016.50	292,853,650	
関西ペイント	54,500	2,216.50	120,799,250	
中国塗料	14,700	2,303.00	33,854,100	
藤倉化成	15,400	501.00	7,715,400	
太陽ホールディングス	11,300	3,970.00	44,861,000	
ＤＩＣ	23,100	3,592.00	82,975,200	
サカタインクス	14,500	1,670.00	24,215,000	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	11,700	3,025.00	35,392,500	
アルプス技研	5,800	2,626.00	15,230,800	
日本空調サービス	7,900	1,006.00	7,947,400	
オリエンタルランド	397,800	3,380.00	1,344,564,000	
フォーカスシステムズ	7,300	1,111.00	8,110,300	

ダスキン	14,600	3,650.00	53,290,000	
パーク２４	49,900	2,207.00	110,129,300	
明光ネットワークジャパン	11,100	720.00	7,992,000	
ファルコホールディングス	3,500	2,342.00	8,197,000	
クレスコ	10,700	1,187.00	12,700,900	
フジ・メディア・ホールディングス	62,600	1,848.00	115,684,800	
ラウンドワン	63,000	1,343.00	84,609,000	
リゾートトラスト	26,400	3,102.00	81,892,800	
オービック	121,000	4,700.00	568,700,000	
ジャストシステム	9,400	3,550.00	33,370,000	
ＴＤＣソフト	11,000	1,491.00	16,401,000	
ＬＩＮＥヤフー	1,042,800	426.20	444,441,360	
ビー・エム・エル	8,200	2,903.00	23,804,600	
トレンドマイクロ	34,200	8,383.00	286,698,600	
ＩＤホールディングス	5,000	1,546.00	7,730,000	
リソー教育	41,800	298.00	12,456,400	
日本オラクル	12,500	14,565.00	182,062,500	
アルファシステムズ	2,300	3,350.00	7,705,000	
フューチャー	16,200	1,881.00	30,472,200	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	4,500	1,664.00	7,488,000	
ユー・エス・エス	137,400	1,369.00	188,100,600	
オービックビジネスコンサルタント	11,000	7,027.00	77,297,000	
アイティフォー	7,600	1,440.00	10,944,000	
東京個別指導学院	20,200	349.00	7,049,800	
東計電算	1,900	4,215.00	8,008,500	
サイバーエージェント	147,700	1,107.00	163,503,900	
楽天グループ	470,800	919.80	433,041,840	
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,503.00	7,364,700	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	13,100	648.00	8,488,800	
テー・オー・ダブリュー	25,500	314.00	8,007,000	
大塚商会	73,900	3,602.00	266,187,800	
サイボウズ	9,000	2,644.00	23,796,000	
セントラルスポーツ	3,300	2,403.00	7,929,900	
パラカ	4,500	1,866.00	8,397,000	
電通総研	6,300	5,770.00	36,351,000	
ＡＣＣＥＳＳ	6,800	852.00	5,793,600	
デジタルガレージ	10,400	3,820.00	39,728,000	
イーエムシステムズ	11,200	796.00	8,915,200	
ウェザーニューズ	4,000	3,215.00	12,860,000	
ＣＩＪ	17,900	457.00	8,180,300	
スカラ	17,500	381.00	6,667,500	
フルキャストホールディングス	5,500	1,428.00	7,854,000	
エン・ジャパン	10,900	2,128.00	23,195,200	
セルソース	7,300	828.00	6,044,400	
あすか製薬ホールディングス	5,900	2,050.00	12,095,000	
サワイグループホールディングス	38,300	2,178.50	83,436,550	
富士フイルムホールディングス	393,000	3,267.00	1,283,931,000	
コニカミノルタ	146,600	671.50	98,441,900	
資生堂	136,100	2,710.50	368,899,050	

ライオン	83,000	1,764.00	146,412,000	
高砂香料工業	4,400	5,600.00	24,640,000	
マンダム	12,900	1,293.00	16,679,700	
ミルボン	10,500	3,505.00	36,802,500	
コーセー	13,300	6,892.00	91,663,600	
コタ	6,600	1,592.00	10,507,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	33,400	1,463.50	48,880,900	
ノエビアホールディングス	5,800	4,865.00	28,217,000	
新日本製薬	3,300	1,953.00	6,444,900	
エステー	5,300	1,532.00	8,119,600	
コニシ	20,500	1,224.00	25,092,000	
長谷川香料	12,500	3,060.00	38,250,000	
小林製薬	17,100	5,962.00	101,950,200	
荒川化学工業	7,200	1,081.00	7,783,200	
メック	5,400	3,225.00	17,415,000	
日本高純度化学	2,500	3,165.00	7,912,500	
タカラバイオ	20,500	992.00	20,336,000	
ＪＣＵ	7,200	3,790.00	27,288,000	
デクセリアルズ	57,100	2,437.00	139,152,700	
アース製薬	5,900	5,570.00	32,863,000	
北興化学工業	5,900	1,291.00	7,616,900	
大成ラミック	3,100	2,423.00	7,511,300	
クミアイ化学工業	25,900	728.00	18,855,200	
日本農薬	11,600	665.00	7,714,000	
ニチレキグループ	6,900	2,555.00	17,629,500	
ユシロ化学工業	3,800	2,110.00	8,018,000	
富士石油	27,100	280.00	7,588,000	
出光興産	304,600	1,008.50	307,189,100	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,105,700	807.50	892,852,750	
コスモエネルギーホールディングス	21,500	6,689.00	143,813,500	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	8,900	2,856.00	25,418,400	
テスホールディングス	29,800	253.00	7,539,400	
インフロニア・ホールディングス	66,800	1,155.50	77,187,400	
横浜ゴム	33,000	3,276.00	108,108,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	37,500	2,434.00	91,275,000	
ブリヂストン	190,800	5,247.00	1,001,127,600	
住友ゴム工業	63,900	1,756.50	112,240,350	
藤倉コンポジット	6,300	1,521.00	9,582,300	
オカモト	3,500	5,510.00	19,285,000	
アキレス	5,500	1,430.00	7,865,000	
フコク	3,700	1,720.00	6,364,000	
ニッタ	6,400	3,565.00	22,816,000	
住友理工	12,600	1,657.00	20,878,200	
三ツ星ベルト	9,100	3,970.00	36,127,000	
バンドー化学	9,700	1,820.00	17,654,000	
ＡＧＣ	63,400	4,554.00	288,723,600	
日本板硝子	33,400	347.00	11,589,800	
有沢製作所	9,800	1,426.00	13,974,800	
日本電気硝子	24,200	3,363.00	81,384,600	
住友大阪セメント	11,700	3,282.00	38,399,400	

太平洋セメント	40,200	3,541.00	142,348,200	
日本ヒューム	6,300	1,327.00	8,360,100	
日本コンクリート工業	18,900	363.00	6,860,700	
三谷セキサン	2,700	5,420.00	14,634,000	
アジアパイルホールディングス	10,000	790.00	7,900,000	
東海カーボン	60,100	879.00	52,827,900	
日本カーボン	3,700	4,405.00	16,298,500	
東洋炭素	4,600	4,215.00	19,389,000	
ノリタケ	7,200	3,775.00	27,180,000	
ＴＯＴＯ	47,300	3,801.00	179,787,300	
日本碍子	75,800	1,954.50	148,151,100	
日本特殊陶業	53,300	4,944.00	263,515,200	
ＭＡＲＵＷＡ	2,700	44,640.00	120,528,000	
品川リフラクトリーズ	8,000	1,692.00	13,536,000	
黒崎播磨	4,400	2,419.00	10,643,600	
ヨータイ	5,200	1,590.00	8,268,000	
フジミインコーポレーテッド	17,500	2,363.00	41,352,500	
ニチアス	16,500	5,754.00	94,941,000	
日本製鉄	339,600	2,982.00	1,012,687,200	
神戸製鋼所	134,900	1,471.50	198,505,350	
中山製鋼所	13,800	709.00	9,784,200	
合同製鐵	3,800	3,720.00	14,136,000	
ＪＦＥホールディングス	202,000	1,670.00	337,340,000	
東京製鐵	18,700	1,452.00	27,152,400	
共英製鋼	6,500	1,761.00	11,446,500	
大和工業	12,600	7,295.00	91,917,000	
東京鐵鋼	3,000	6,440.00	19,320,000	
大阪製鐵	3,100	2,929.00	9,079,900	
淀川製鋼所	6,200	5,480.00	33,976,000	
中部鋼鈑	4,400	2,320.00	10,208,000	
丸一鋼管	20,400	3,385.00	69,054,000	
モリ工業	1,700	4,655.00	7,913,500	
大同特殊鋼	42,200	1,115.00	47,053,000	
日本冶金工業	4,500	3,760.00	16,920,000	
山陽特殊製鋼	6,600	1,745.00	11,517,000	
愛知製鋼	3,900	4,955.00	19,324,500	
大平洋金属	6,200	1,416.00	8,779,200	
新日本電工	40,000	276.00	11,040,000	
栗本鐵工所	3,100	4,080.00	12,648,000	
日本製鋼所	19,900	6,215.00	123,678,500	
三菱製鋼	1,300	1,435.00	1,865,500	
日本精線	6,300	1,290.00	8,127,000	
エンビプロ・ホールディングス	19,100	394.00	7,525,400	
大紀アルミニウム工業所	9,500	1,021.00	9,699,500	
日本軽金属ホールディングス	19,600	1,488.00	29,164,800	
三井金属鉱業	16,800	4,524.00	76,003,200	
三菱マテリアル	47,900	2,286.50	109,523,350	
住友金属鉱山	84,800	3,455.00	292,984,000	
ＤＯＷＡホールディングス	18,100	4,317.00	78,137,700	
古河機械金属	8,800	1,529.00	13,455,200	

大阪チタニウムテクノロジーズ	11,600	1,779.00	20,636,400	
東邦チタニウム	13,900	997.00	13,858,300	
ＵＡＣＪ	9,400	5,190.00	48,786,000	
ＣＫサンエツ	2,200	3,795.00	8,349,000	
古河電気工業	22,400	6,872.00	153,932,800	
住友電気工業	231,600	2,800.50	648,595,800	
フジクラ	72,000	6,244.00	449,568,000	
ＳＷＣＣ	9,000	7,350.00	66,150,000	
平河ヒューテック	5,400	1,503.00	8,116,200	
いよぎんホールディングス	83,800	1,493.50	125,155,300	
しずおかフィナンシャルグループ	141,000	1,260.00	177,660,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	53,900	1,594.50	85,943,550	
楽天銀行	29,700	4,385.00	130,234,500	
京都フィナンシャルグループ	80,600	2,211.50	178,246,900	
リョービ	7,100	2,168.00	15,392,800	
ＡＲＥホールディングス	27,100	1,672.00	45,311,200	
東洋製罐グループホールディングス	42,700	2,439.50	104,166,650	
ホッカンホールディングス	4,700	1,611.00	7,571,700	
コロナ	8,400	966.00	8,114,400	
横河ブリッジホールディングス	11,500	2,778.00	31,947,000	
三和ホールディングス	66,200	4,507.00	298,363,400	
文化シヤッター	17,500	1,860.00	32,550,000	
三協立山	11,200	650.00	7,280,000	
アルインコ	8,200	1,038.00	8,511,600	
ＬＩＸＩＬ	97,800	1,687.00	164,988,600	
ノーリツ	9,400	1,665.00	15,651,000	
長府製作所	7,500	1,885.00	14,137,500	
リンナイ	35,600	3,148.00	112,068,800	
ユニプレス	11,700	1,060.00	12,402,000	
日東精工	13,500	615.00	8,302,500	
岡部	12,000	762.00	9,144,000	
ジーテクト	7,500	1,635.00	12,262,500	
東プレ	11,800	1,914.00	22,585,200	
高周波熱錬	9,900	958.00	9,484,200	
東京製綱	3,300	1,271.00	4,194,300	
サンコール	25,700	269.00	6,913,300	
パイオラックス	9,000	2,549.00	22,941,000	
エイチワン	7,900	998.00	7,884,200	
日本発条	59,300	1,873.50	111,098,550	
三浦工業	30,500	3,994.00	121,817,000	
タクマ	22,200	1,612.00	35,786,400	
テクノプロ・ホールディングス	38,800	2,849.50	110,560,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,800	719.00	7,046,200	
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,100	4,700.00	19,270,000	
イー・ガーディアン	4,400	1,886.00	8,298,400	
ジャパンマテリアル	20,400	1,624.00	33,129,600	
ベクトル	9,100	1,034.00	9,409,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	6,400	1,309.00	8,377,600	
キャリアリンク	3,200	2,405.00	7,696,000	

ＩＢＪ	12,700	608.00	7,721,600	
アサンテ	4,800	1,639.00	7,867,200	
バリューＨＲ	6,000	1,811.00	10,866,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	5,400	2,707.00	14,617,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	8,000	997.00	7,976,000	
シグマクシス・ホールディングス	19,500	900.00	17,550,000	
ウィルグループ	8,300	983.00	8,158,900	
メドピア	16,400	462.00	7,576,800	
リクルートホールディングス	521,300	10,865.00	5,663,924,500	
エラン	11,700	753.00	8,810,100	
ツガミ	14,000	1,420.00	19,880,000	
オークマ	11,500	3,210.00	36,915,000	
芝浦機械	8,400	3,475.00	29,190,000	
アマダ	91,200	1,477.00	134,702,400	
アイダエンジニアリング	14,700	797.00	11,715,900	
ＦＵＪＩ	28,500	2,278.00	64,923,000	
牧野フライス製作所	7,300	7,420.00	54,166,000	
オーエスジー	28,900	1,783.00	51,528,700	
旭ダイヤモンド工業	16,400	802.00	13,152,800	
ＤＭＧ森精機	41,400	2,436.50	100,871,100	
ソディック	17,300	718.00	12,421,400	
ディスコ	31,600	41,540.00	1,312,664,000	
日東工器	3,000	2,557.00	7,671,000	
日進工具	10,400	730.00	7,592,000	
日本郵政	748,300	1,497.00	1,120,205,100	
ベルシステム２４ホールディングス	7,200	1,249.00	8,992,800	
鎌倉新書	14,900	515.00	7,673,500	
ストライク	3,300	3,605.00	11,896,500	
ソラスト	18,400	460.00	8,464,000	
インソース	14,500	1,129.00	16,370,500	
豊田自動織機	55,400	11,515.00	637,931,000	
リケンＮＰＲ	8,200	2,469.00	20,245,800	
島精機製作所	10,400	992.00	10,316,800	
オプトラン	10,800	1,905.00	20,574,000	
イワキ	4,400	2,527.00	11,118,800	
フリュー	7,200	1,080.00	7,776,000	
日阪製作所	8,400	1,059.00	8,895,600	
やまびこ	10,700	2,508.00	26,835,600	
野村マイクロ・サイエンス	10,900	1,582.00	17,243,800	
平田機工	3,100	5,240.00	16,244,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	18,400	430.00	7,912,000	
タツモ	4,700	2,153.00	10,119,100	
ナブテスコ	41,200	2,731.00	112,517,200	
三井海洋開発	8,300	3,145.00	26,103,500	
レオン自動機	6,900	1,425.00	9,832,500	
ＳＭＣ	19,600	61,290.00	1,201,284,000	
ホソカワミクロン	4,600	4,175.00	19,205,000	
ユニオンツール	2,900	4,865.00	14,108,500	
オイレス工業	8,900	2,426.00	21,591,400	

日精エー・エス・ビー機械	2,200	4,930.00	10,846,000	
サトーホールディングス	8,200	2,149.00	17,621,800	
技研製作所	6,200	1,730.00	10,726,000	
日本エアーテック	6,400	1,171.00	7,494,400	
日精樹脂工業	8,700	961.00	8,360,700	
ワイエイシイホールディングス	4,300	1,785.00	7,675,500	
小松製作所	323,600	4,162.00	1,346,823,200	
住友重機械工業	38,800	3,208.00	124,470,400	
日立建機	26,100	3,395.00	88,609,500	
日工	11,300	703.00	7,943,900	
巴工業	2,600	3,795.00	9,867,000	
井関農機	8,400	910.00	7,644,000	
ＴＯＷＡ	20,100	1,411.00	28,361,100	
北川鉄工所	6,700	1,147.00	7,684,900	
ローツェ	34,300	1,512.00	51,861,600	
クボタ	343,200	1,821.00	624,967,200	
荏原実業	3,100	4,040.00	12,524,000	
三菱化工機	2,500	3,550.00	8,875,000	
月島ホールディングス	8,900	1,422.00	12,655,800	
帝国電機製作所	4,500	2,715.00	12,217,500	
新東工業	14,600	903.00	13,183,800	
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	1,411.00	15,379,900	
小森コーポレーション	16,200	1,184.00	19,180,800	
鶴見製作所	5,000	3,125.00	15,625,000	
酒井重工業	3,400	2,315.00	7,871,000	
荏原製作所	134,800	2,536.00	341,852,800	
酉島製作所	5,600	2,386.00	13,361,600	
北越工業	6,600	1,760.00	11,616,000	
ダイキン工業	85,500	17,660.00	1,509,930,000	
オルガノ	10,200	8,120.00	82,824,000	
トーヨーカネツ	2,400	4,140.00	9,936,000	
栗田工業	36,700	5,433.00	199,391,100	
椿本チエイン	29,700	1,887.00	56,043,900	
日機装	16,800	942.00	15,825,600	
レイズネクスト	9,200	1,539.00	14,158,800	
アネスト岩田	11,200	1,438.00	16,105,600	
ダイフク	110,800	3,360.00	372,288,000	
タダノ	37,800	1,128.50	42,657,300	
フジテック	21,100	6,144.00	129,638,400	
ＣＫＤ	18,200	2,468.00	44,917,600	
平和	21,800	2,320.00	50,576,000	
理想科学工業	5,200	3,100.00	16,120,000	
ＳＡＮＫＹＯ	75,800	2,062.00	156,299,600	
日本金銭機械	7,900	986.00	7,789,400	
マースグループホールディングス	4,400	3,185.00	14,014,000	
フクシマガリレイ	4,800	5,220.00	25,056,000	
ダイコク電機	2,900	2,842.00	8,241,800	
竹内製作所	12,000	4,835.00	58,020,000	
アマノ	18,600	4,284.00	79,682,400	

ジャノメ	6,700	972.00	6,512,400	
ブラザー工業	87,700	2,731.50	239,552,550	
マックス	8,100	3,370.00	27,297,000	
モリタホールディングス	10,300	2,101.00	21,640,300	
グローリー	17,200	2,598.00	44,685,600	
新晃工業	19,800	1,239.00	24,532,200	
大和冷機工業	10,100	1,464.00	14,786,400	
セガサミーホールディングス	58,600	2,610.00	152,946,000	
ＴＰＲ	8,300	2,301.00	19,098,300	
ツバキ・ナカシマ	16,200	466.00	7,549,200	
ホシザキ	42,300	6,251.00	264,417,300	
大豊工業	13,000	582.00	7,566,000	
日本精工	121,500	665.00	80,797,500	
ＮＴＮ	155,300	249.80	38,793,940	
ジェイテクト	58,400	1,128.00	65,875,200	
不二越	4,800	3,070.00	14,736,000	
ミネベアミツミ	114,200	2,500.00	285,500,000	
日本トムソン	17,900	494.00	8,842,600	
ＴＨＫ	37,900	3,640.00	137,956,000	
ユーシン精機	12,000	652.00	7,824,000	
前澤給装工業	5,900	1,282.00	7,563,800	
イーグル工業	7,300	1,951.00	14,242,300	
ＰＩＬＬＡＲ	6,100	4,105.00	25,040,500	
キッツ	22,000	1,097.00	24,134,000	
日立製作所	1,690,400	3,865.00	6,533,396,000	
三菱電機	667,700	2,599.00	1,735,352,300	
富士電機	39,900	8,502.00	339,229,800	
安川電機	71,300	3,886.00	277,071,800	
シンフォニア　テクノロジー	6,500	6,710.00	43,615,000	
明電舎	11,100	4,345.00	48,229,500	
山洋電気	2,800	8,470.00	23,716,000	
デンヨー	5,000	2,828.00	14,140,000	
ＰＨＣホールディングス	12,300	931.00	11,451,300	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	46,000	2,113.50	97,221,000	
ソシオネクスト	65,400	2,643.50	172,884,900	
ベイカレント	49,100	5,347.00	262,537,700	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,400	820.00	7,708,000	
アイモバイル	15,700	524.00	8,226,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	26,000	2,908.00	75,608,000	
ミダックホールディングス	4,900	1,535.00	7,521,500	
キュービーネットホールディングス	7,800	1,002.00	7,815,600	
オープングループ	39,100	181.00	7,077,100	
三櫻工業	10,500	707.00	7,423,500	
マキタ	81,700	4,723.00	385,869,100	
東芝テック	9,800	3,555.00	34,839,000	
芝浦メカトロニクス	4,800	7,710.00	37,008,000	
マブチモーター	28,800	2,260.00	65,088,000	
ニデック	289,800	2,750.00	796,950,000	

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	24,200	281.00	6,800,200	
トレックス・セミコンダクター	6,100	1,136.00	6,929,600	
東光高岳	4,000	2,060.00	8,240,000	
ダイヘン	6,200	7,530.00	46,686,000	
ヤーマン	12,800	717.00	9,177,600	
ＪＶＣケンウッド	51,800	1,720.00	89,096,000	
ミマキエンジニアリング	5,500	1,579.00	8,684,500	
Ｉ－ＰＥＸ	3,600	2,962.00	10,663,200	
大崎電気工業	14,100	808.00	11,392,800	
オムロン	60,200	5,128.00	308,705,600	
日東工業	8,800	2,805.00	24,684,000	
ＩＤＥＣ	9,700	2,351.00	22,804,700	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	29,300	2,511.50	73,586,950	
メルコホールディングス	3,800	2,078.00	7,896,400	
テクノメディカ	4,400	1,791.00	7,880,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	14,800	492.00	7,281,600	
日本電気	92,800	13,470.00	1,250,016,000	
富士通	604,100	2,809.50	1,697,218,950	
沖電気工業	31,800	1,063.00	33,803,400	
電気興業	4,700	1,606.00	7,548,200	
サンケン電気	6,700	5,887.00	39,442,900	
アイホン	4,000	2,662.00	10,648,000	
ルネサスエレクトロニクス	500,100	2,029.50	1,014,952,950	
セイコーエプソン	84,200	2,826.50	237,991,300	
ワコム	46,100	755.00	34,805,500	
アルバック	14,400	6,053.00	87,163,200	
ＥＩＺＯ	8,500	2,161.00	18,368,500	
日本信号	14,900	902.00	13,439,800	
京三製作所	15,300	505.00	7,726,500	
能美防災	8,900	3,280.00	29,192,000	
ホーチキ	4,200	2,527.00	10,613,400	
エレコム	15,700	1,487.00	23,345,900	
パナソニック　ホールディングス	775,500	1,588.00	1,231,494,000	
シャープ	94,800	989.90	93,842,520	
アンリツ	46,200	1,310.50	60,545,100	
富士通ゼネラル	18,600	2,322.00	43,189,200	
ソニーグループ	2,276,000	3,284.00	7,474,384,000	
ＴＤＫ	566,900	2,019.00	1,144,571,100	
帝国通信工業	2,900	2,557.00	7,415,300	
タムラ製作所	26,200	489.00	12,811,800	
アルプスアルパイン	53,300	1,578.50	84,134,050	
メイコー	6,500	9,130.00	59,345,000	
フォスター電機	6,700	1,488.00	9,969,600	
ＳＭＫ	3,300	2,442.00	8,058,600	
ヨコオ	5,800	1,752.00	10,161,600	
ホシデン	16,400	2,238.00	36,703,200	
ヒロセ電機	9,500	18,500.00	175,750,000	
日本航空電子工業	17,100	2,771.00	47,384,100	
ＴＯＡ	8,700	963.00	8,378,100	

マクセル	13,300	1,741.00	23,155,300	
古野電気	7,800	2,642.00	20,607,600	
スミダコーポレーション	8,800	876.00	7,708,800	
アイコム	3,000	2,624.00	7,872,000	
横河電機	71,800	3,465.00	248,787,000	
新電元工業	3,300	2,348.00	7,748,400	
アズビル	178,800	1,244.00	222,427,200	
日本光電工業	58,200	2,148.00	125,013,600	
チノー	3,800	2,172.00	8,253,600	
日本電子材料	4,000	2,123.00	8,492,000	
堀場製作所	12,300	9,043.00	111,228,900	
アドバンテスト	204,800	8,609.00	1,763,123,200	
エスペック	5,800	2,623.00	15,213,400	
キーエンス	65,000	64,180.00	4,171,700,000	
日置電機	3,400	7,450.00	25,330,000	
シスメックス	168,300	2,915.50	490,678,650	
日本マイクロニクス	10,700	3,845.00	41,141,500	
メガチップス	5,000	6,220.00	31,100,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	4,100	4,050.00	16,605,000	
デンソー	689,400	2,050.00	1,413,270,000	
コーセル	6,900	1,091.00	7,527,900	
イリソ電子工業	6,600	2,640.00	17,424,000	
オプテックスグループ	11,900	1,714.00	20,396,600	
千代田インテグレ	2,300	3,495.00	8,038,500	
レーザーテック	29,800	14,800.00	441,040,000	
スタンレー電気	40,700	2,531.00	103,011,700	
ウシオ電機	28,700	2,064.00	59,236,800	
日本セラミック	6,000	2,572.00	15,432,000	
古河電池	5,100	1,370.00	6,987,000	
山一電機	5,300	2,260.00	11,978,000	
図研	5,900	4,300.00	25,370,000	
日本電子	15,000	5,497.00	82,455,000	
カシオ計算機	52,000	1,287.00	66,924,000	
ファナック	314,500	4,017.00	1,263,346,500	
エンプラス	1,900	4,820.00	9,158,000	
大真空	15,300	534.00	8,170,200	
ローム	117,800	1,409.00	165,980,200	
浜松ホトニクス	104,300	1,747.00	182,212,100	
三井ハイテック	28,800	844.00	24,307,200	
新光電気工業	23,000	5,540.00	127,420,000	
京セラ	403,800	1,521.00	614,179,800	
太陽誘電	28,500	2,197.50	62,628,750	
村田製作所	580,600	2,440.00	1,416,664,000	
双葉電子工業	17,100	499.00	8,532,900	
日東電工	206,100	2,564.50	528,543,450	
東海理化電機製作所	18,300	2,179.00	39,875,700	
ニチコン	17,100	1,036.00	17,715,600	
ＫＯＡ	10,800	956.00	10,324,800	
三井Ｅ＆Ｓ	35,100	1,724.00	60,512,400	
カナデビア	53,800	925.00	49,765,000	

三菱重工業	1,147,900	2,236.50	2,567,278,350	
川崎重工業	49,000	6,524.00	319,676,000	
ＩＨＩ	52,600	8,347.00	439,052,200	
名村造船所	18,600	1,671.00	31,080,600	
プロレド・パートナーズ	15,500	408.00	6,324,000	
アンビスホールディングス	14,300	731.00	10,453,300	
カーブスホールディングス	18,200	800.00	14,560,000	
フォーラムエンジニアリング	8,200	1,026.00	8,413,200	
日本車輌製造	3,600	2,191.00	7,887,600	
三菱ロジスネクスト	10,400	1,937.00	20,144,800	
フルサト・マルカホールディングス	5,500	2,441.00	13,425,500	
ヤマエグループホールディングス	7,400	1,889.00	13,978,600	
ＦＰＧ	22,900	2,749.00	62,952,100	
じもとホールディングス	100	287.00	28,700	
全国保証	16,700	5,387.00	89,962,900	
めぶきフィナンシャルグループ	321,400	629.30	202,257,020	
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,400	1,044.00	10,857,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	8,200	4,430.00	36,326,000	
九州フィナンシャルグループ	112,700	681.90	76,850,130	
かんぽ生命保険	74,500	2,884.50	214,895,250	
ゆうちょ銀行	527,600	1,448.00	763,964,800	
富山第一銀行	20,400	1,059.00	21,603,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	340,600	859.00	292,575,400	
ジェイリース	6,300	1,208.00	7,610,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	39,500	1,978.00	78,131,000	
ＳＢＩアルヒ	5,800	807.00	4,680,600	
プレミアグループ	10,800	2,499.00	26,989,200	
日産自動車	812,400	443.00	359,893,200	
いすゞ自動車	200,700	2,078.50	417,154,950	
トヨタ自動車	3,455,000	2,771.50	9,575,532,500	
日野自動車	97,800	486.00	47,530,800	
三菱自動車工業	253,500	466.60	118,283,100	
武蔵精密工業	15,900	4,125.00	65,587,500	
日産車体	9,900	1,006.00	9,959,400	
新明和工業	18,700	1,359.00	25,413,300	
極東開発工業	8,800	2,402.00	21,137,600	
トピー工業	5,300	1,896.00	10,048,800	
ティラド	2,300	3,540.00	8,142,000	
タチエス	12,000	1,655.00	19,860,000	
ＮＯＫ	25,200	2,429.00	61,210,800	
フタバ産業	19,500	700.00	13,650,000	
カヤバ	11,000	2,811.00	30,921,000	
市光工業	19,300	380.00	7,334,000	
大同メタル工業	16,800	476.00	7,996,800	
プレス工業	25,400	526.00	13,360,400	
太平洋工業	14,900	1,303.00	19,414,700	
アイシン	137,600	1,733.00	238,460,800	

マツダ	199,600	983.40	196,286,640	
本田技研工業	1,539,900	1,229.50	1,893,307,050	
スズキ	525,200	1,737.50	912,535,000	
ＳＵＢＡＲＵ	196,000	2,599.50	509,502,000	
ヤマハ発動機	274,400	1,398.00	383,611,200	
小糸製作所	67,300	2,014.50	135,575,850	
エクセディ	10,600	4,585.00	48,601,000	
ミツバ	12,200	886.00	10,809,200	
豊田合成	18,600	2,736.00	50,889,600	
愛三工業	12,300	1,603.00	19,716,900	
ヨロズ	7,000	1,177.00	8,239,000	
エフ・シー・シー	11,400	3,155.00	35,967,000	
シマノ	28,200	21,145.00	596,289,000	
テイ・エス　テック	26,400	1,731.00	45,698,400	
三十三フィナンシャルグループ	5,800	2,190.00	12,702,000	
第四北越フィナンシャルグループ	20,100	2,826.00	56,802,600	
ひろぎんホールディングス	90,100	1,140.50	102,759,050	
おきなわフィナンシャルグループ	5,100	2,593.00	13,224,300	
ダイレクトマーケティングミックス	29,500	278.00	8,201,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	8,300	871.00	7,229,300	
十六フィナンシャルグループ	9,000	4,190.00	37,710,000	
北國フィナンシャルホールディングス	6,300	5,140.00	32,382,000	
ネットプロテクションズホールディングス	21,300	502.00	10,692,600	
プロクレアホールディングス	7,400	1,666.00	12,328,400	
ＦＰパートナー	2,800	2,075.00	5,810,000	
あいちフィナンシャルグループ	12,000	2,354.00	28,248,000	
ジャムコ	3,900	1,471.00	5,736,900	
小野建	7,500	1,442.00	10,815,000	
ノジマ	22,400	2,250.00	50,400,000	
佐鳥電機	4,800	1,704.00	8,179,200	
カッパ・クリエイト	10,800	1,583.00	17,096,400	
伯東	3,900	4,135.00	16,126,500	
コンドーテック	5,800	1,360.00	7,888,000	
ナガイレーベン	8,700	2,165.00	18,835,500	
三菱食品	6,300	4,930.00	31,059,000	
良品計画	81,900	3,446.00	282,227,400	
松田産業	5,200	3,090.00	16,068,000	
第一興商	26,600	1,846.50	49,116,900	
メディパルホールディングス	74,600	2,381.50	177,659,900	
アドヴァングループ	8,400	953.00	8,005,200	
ＳＰＫ	3,900	2,040.00	7,956,000	
萩原電気ホールディングス	3,000	3,145.00	9,435,000	
アルビス	3,000	2,601.00	7,803,000	
アズワン	21,300	2,688.50	57,265,050	
スズデン	4,400	1,824.00	8,025,600	
シモジマ	6,300	1,292.00	8,139,600	
ドウシシャ	6,400	2,139.00	13,689,600	
高速	4,100	2,388.00	9,790,800	
Ｇ－７ホールディングス	7,500	1,402.00	10,515,000	

イオン北海道	16,900	882.00	14,905,800	
コジマ	13,300	1,045.00	13,898,500	
コーナン商事	7,600	3,530.00	26,828,000	
ネットワンシステムズ	27,300	4,480.00	122,304,000	
エコス	4,000	2,024.00	8,096,000	
ワタミ	8,300	951.00	7,893,300	
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	4,166.00	578,657,400	
丸文	7,600	1,019.00	7,744,400	
西松屋チェーン	15,200	2,236.00	33,987,200	
ゼンショーホールディングス	39,100	9,259.00	362,026,900	
ハピネット	5,300	4,880.00	25,864,000	
橋本総業ホールディングス	6,800	1,280.00	8,704,000	
日本ライフライン	18,400	1,333.00	24,527,200	
サイゼリヤ	10,200	5,460.00	55,692,000	
タカショー	17,700	447.00	7,911,900	
ＶＴ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	4,990.00	29,940,000	
魚力	3,400	2,433.00	8,272,200	
ＩＤＯＭ	23,400	1,097.00	25,669,800	
フジ・コーポレーション	4,000	2,054.00	8,216,000	
ユナイテッドアローズ	7,300	2,685.00	19,600,500	
進和	4,200	2,877.00	12,083,400	
ダイトロン	3,000	2,722.00	8,166,000	
ハイデイ日高	11,100	2,720.00	30,192,000	
シークス	9,800	1,136.00	11,132,800	
コロワイド	38,800	1,671.50	64,854,200	
オーハシテクニカ	4,100	1,965.00	8,056,500	
壱番屋	27,200	998.00	27,145,600	
白銅	3,500	2,341.00	8,193,500	
スギホールディングス	36,900	2,444.00	90,183,600	
薬王堂ホールディングス	3,900	1,936.00	7,550,400	
島津製作所	93,500	4,447.00	415,794,500	
ＪＭＳ	17,900	432.00	7,732,800	
長野計器	4,300	2,490.00	10,707,000	
ブイ・テクノロジー	3,500	2,315.00	8,102,500	
スター精密	11,100	1,856.00	20,601,600	
東京計器	4,600	3,135.00	14,421,000	
愛知時計電機	400	1,985.00	794,000	
インターアクション	7,900	973.00	7,686,700	
東京精密	13,300	7,085.00	94,230,500	
マニー	26,000	1,777.00	46,202,000	
ニコン	102,500	1,637.00	167,792,500	
トプコン	36,900	2,796.00	103,172,400	
オリンパス	372,100	2,375.50	883,923,550	
理研計器	9,200	3,755.00	34,546,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	27,200	9,278.00	252,361,600	
キヤノン電子	6,200	2,423.00	15,022,600	
タムロン	8,900	4,420.00	39,338,000	
ＨＯＹＡ	127,000	19,530.00	2,480,310,000	

ノーリツ鋼機	6,200	5,000.00	31,000,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	8,100	1,966.00	15,924,600	
朝日インテック	79,200	2,527.00	200,138,400	
キヤノン	324,200	5,163.00	1,673,844,600	
リコー	171,200	1,778.00	304,393,600	
シチズン時計	59,800	905.00	54,119,000	
メニコン	24,200	1,434.00	34,702,800	
パラマウントベッドホールディングス	15,000	2,696.00	40,440,000	
トランザクション	4,300	2,115.00	9,094,500	
ニホンフラッシュ	9,500	791.00	7,514,500	
前田工繊	11,600	1,921.00	22,283,600	
アートネイチャー	9,900	801.00	7,929,900	
フルヤ金属	6,200	3,510.00	21,762,000	
バンダイナムコホールディングス	176,500	3,773.00	665,934,500	
ＳＨＯＥＩ	18,300	2,239.00	40,973,700	
フランスベッドホールディングス	9,300	1,280.00	11,904,000	
マーベラス	13,700	567.00	7,767,900	
パイロットコーポレーション	10,200	4,772.00	48,674,400	
エイベックス	12,200	1,503.00	18,336,600	
フジシールインターナショナル	14,600	2,485.00	36,281,000	
タカラトミー	27,300	4,596.00	125,470,800	
広済堂ホールディングス	24,500	502.00	12,299,000	
レック	8,300	1,231.00	10,217,300	
プロネクサス	6,700	1,302.00	8,723,400	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	85,200	3,855.00	328,446,000	
大日本印刷	134,800	2,211.50	298,110,200	
共同印刷	1,400	3,920.00	5,488,000	
ＮＩＳＳＨＡ	11,100	1,564.00	17,360,400	
ＺＡＣＲＯＳ	5,200	4,220.00	21,944,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,800	2,953.00	11,221,400	
前澤化成工業	4,600	1,741.00	8,008,600	
未来工業	2,300	3,640.00	8,372,000	
アシックス	240,000	3,085.00	740,400,000	
ツツミ	3,800	2,096.00	7,964,800	
ＪＳＰ	5,300	2,132.00	11,299,600	
ニチハ	8,200	2,912.00	23,878,400	
ローランド	4,800	3,870.00	18,576,000	
エフピコ	14,400	2,785.00	40,104,000	
ヤマハ	118,800	1,099.00	130,561,200	
クリナップ	11,600	651.00	7,551,600	
ピジョン	41,400	1,464.00	60,609,600	
天馬	5,400	2,987.00	16,129,800	
キングジム	9,400	861.00	8,093,400	
象印マホービン	19,400	1,816.00	35,230,400	
リンテック	13,000	2,988.00	38,844,000	
信越ポリマー	14,100	1,620.00	22,842,000	
イトーキ	13,000	1,646.00	21,398,000	
任天堂	410,300	9,131.00	3,746,449,300	
三菱鉛筆	9,000	2,373.00	21,357,000	
松風	6,500	2,170.00	14,105,000	

タカラスタンダード	15,000	1,667.00	25,005,000	
コクヨ	32,500	2,786.50	90,561,250	
ナカバヤシ	15,600	505.00	7,878,000	
ニフコ	24,400	3,730.00	91,012,000	
グローブライド	6,400	1,862.00	11,916,800	
オカムラ	19,600	2,031.00	39,807,600	
バルカー	5,000	3,140.00	15,700,000	
伊藤忠商事	462,300	7,483.00	3,459,390,900	
丸紅	565,100	2,236.00	1,263,563,600	
スクロール	10,200	1,075.00	10,965,000	
ヨンドシーホールディングス	6,500	1,861.00	12,096,500	
三陽商会	3,400	2,822.00	9,594,800	
長瀬産業	30,700	3,151.00	96,735,700	
蝶理	3,700	3,830.00	14,171,000	
豊田通商	206,500	2,645.00	546,192,500	
オンワードホールディングス	42,200	563.00	23,758,600	
三共生興	13,500	606.00	8,181,000	
兼松	28,800	2,567.00	73,929,600	
美津濃	6,500	9,210.00	59,865,000	
三井物産	1,010,400	3,147.00	3,179,728,800	
日本紙パルプ商事	32,900	663.00	21,812,700	
東京エレクトロン	137,600	23,300.00	3,206,080,000	
カメイ	7,300	1,803.00	13,161,900	
スターゼン	4,700	2,912.00	13,686,400	
セイコーグループ	10,100	4,715.00	47,621,500	
山善	23,200	1,387.00	32,178,400	
椿本興業	4,300	2,042.00	8,780,600	
住友商事	412,100	3,277.00	1,350,451,700	
ＢＩＰＲＯＧＹ	22,000	4,652.00	102,344,000	
内田洋行	2,800	6,580.00	18,424,000	
三菱商事	1,270,900	2,496.50	3,172,801,850	
第一実業	6,500	2,769.00	17,998,500	
キヤノンマーケティングジャパン	13,500	5,102.00	68,877,000	
西華産業	3,300	4,845.00	15,988,500	
佐藤商事	5,800	1,412.00	8,189,600	
東京産業	11,100	715.00	7,936,500	
ユアサ商事	5,900	4,255.00	25,104,500	
神鋼商事	1,600	6,010.00	9,616,000	
阪和興業	11,300	4,770.00	53,901,000	
正栄食品工業	4,600	3,865.00	17,779,000	
カナデン	5,600	1,466.00	8,209,600	
ＲＹＯＤＥＮ	5,500	2,346.00	12,903,000	
ニプロ	54,200	1,457.50	78,996,500	
岩谷産業	68,300	1,751.00	119,593,300	
極東貿易	5,000	1,529.00	7,645,000	
三愛オブリ	16,000	1,853.00	29,648,000	
稲畑産業	18,600	3,195.00	59,427,000	
ＧＳＩクレオス	3,800	2,168.00	8,238,400	
明和産業	12,700	627.00	7,962,900	
ゴールドウイン	11,500	8,458.00	97,267,000	

ユニ・チャーム	135,800	3,965.00	538,447,000	
デサント	5,600	4,330.00	24,248,000	
ワキタ	10,100	1,628.00	16,442,800	
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	4,228.00	78,640,800	
サンゲツ	17,300	2,851.00	49,322,300	
ミツウロコグループホールディングス	8,800	1,776.00	15,628,800	
シナネンホールディングス	2,000	6,340.00	12,680,000	
伊藤忠エネクス	17,000	1,596.00	27,132,000	
サンリオ	55,900	5,130.00	286,767,000	
サンワ　テクノス	3,700	2,198.00	8,132,600	
新光商事	9,200	956.00	8,795,200	
トーホー	2,900	2,832.00	8,212,800	
三信電気	4,200	1,875.00	7,875,000	
東陽テクニカ	6,300	1,417.00	8,927,100	
モスフードサービス	10,100	3,710.00	37,471,000	
加賀電子	14,000	2,877.00	40,278,000	
都築電気	3,900	2,840.00	11,076,000	
立花エレテック	4,100	2,590.00	10,619,000	
木曽路	10,400	2,096.00	21,798,400	
ＳＲＳホールディングス	11,300	1,165.00	13,164,500	
リテールパートナーズ	10,200	1,252.00	12,770,400	
上新電機	6,800	2,241.00	15,238,800	
日本瓦斯	32,900	2,080.00	68,432,000	
ロイヤルホールディングス	12,100	2,399.00	29,027,900	
チヨダ	6,600	1,341.00	8,850,600	
ライフコーポレーション	7,200	3,430.00	24,696,000	
リンガーハット	8,900	2,169.00	19,304,100	
ＭｒＭａｘＨＤ	11,600	715.00	8,294,000	
ＡＯＫＩホールディングス	14,700	1,284.00	18,874,800	
オークワ	11,000	884.00	9,724,000	
コメリ	9,300	3,270.00	30,411,000	
青山商事	14,700	2,260.00	33,222,000	
しまむら	16,100	8,561.00	137,832,100	
高島屋	95,600	1,268.00	121,220,800	
松屋	11,700	971.00	11,360,700	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	33,500	2,197.50	73,616,250	
近鉄百貨店	3,900	2,090.00	8,151,000	
丸井グループ	45,600	2,509.00	114,410,400	
クレディセゾン	40,600	3,600.00	146,160,000	
アクシアル　リテイリング	18,800	895.00	16,826,000	
イオン	254,300	3,679.00	935,569,700	
イズミ	10,500	3,187.00	33,463,500	
平和堂	11,300	2,289.00	25,865,700	
フジ	12,700	2,049.00	26,022,300	
ヤオコー	8,100	9,080.00	73,548,000	
ゼビオホールディングス	9,300	1,135.00	10,555,500	
ケーズホールディングス	46,200	1,391.50	64,287,300	
ＰＡＬＴＡＣ	10,700	4,397.00	47,047,900	
三谷産業	25,200	320.00	8,064,000	

あおぞら銀行	44,200	2,424.50	107,162,900	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,198,100	1,773.00	7,443,231,300	
りそなホールディングス	790,600	1,106.50	874,798,900	
三井住友トラストグループ	228,000	3,641.00	830,148,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,335,400	3,651.00	4,875,545,400	
千葉銀行	198,300	1,198.00	237,563,400	
群馬銀行	111,200	1,070.00	118,984,000	
武蔵野銀行	9,800	2,895.00	28,371,000	
千葉興業銀行	15,200	1,378.00	20,945,600	
七十七銀行	20,500	4,460.00	91,430,000	
秋田銀行	4,300	2,197.00	9,447,100	
山形銀行	8,400	968.00	8,131,200	
岩手銀行	4,100	2,656.00	10,889,600	
東邦銀行	55,300	281.00	15,539,300	
ふくおかフィナンシャルグループ	55,800	3,909.00	218,122,200	
スルガ銀行	43,200	1,146.00	49,507,200	
八十二銀行	149,900	996.80	149,420,320	
山梨中央銀行	7,200	1,800.00	12,960,000	
大垣共立銀行	12,300	1,831.00	22,521,300	
福井銀行	5,800	1,762.00	10,219,600	
清水銀行	5,500	1,408.00	7,744,000	
滋賀銀行	9,700	3,765.00	36,520,500	
南都銀行	9,700	3,175.00	30,797,500	
百五銀行	60,300	604.00	36,421,200	
紀陽銀行	22,900	2,129.00	48,754,100	
ほくほくフィナンシャルグループ	36,100	1,894.50	68,391,450	
山陰合同銀行	40,100	1,212.00	48,601,200	
百十四銀行	6,300	3,190.00	20,097,000	
四国銀行	9,400	1,092.00	10,264,800	
阿波銀行	9,000	2,643.00	23,787,000	
大分銀行	3,900	3,060.00	11,934,000	
宮崎銀行	4,200	2,975.00	12,495,000	
佐賀銀行	3,900	2,105.00	8,209,500	
琉球銀行	14,700	1,020.00	14,994,000	
セブン銀行	229,300	312.20	71,587,460	
みずほフィナンシャルグループ	864,100	3,766.00	3,254,200,600	
山口フィナンシャルグループ	62,800	1,597.00	100,291,600	
芙蓉総合リース	5,900	11,400.00	67,260,000	
みずほリース	48,100	1,003.00	48,244,300	
東京センチュリー	47,800	1,529.50	73,110,100	
ＳＢＩホールディングス	103,100	3,958.00	408,069,800	
日本証券金融	23,500	2,056.00	48,316,000	
アイフル	106,000	322.00	34,132,000	
名古屋銀行	4,000	6,180.00	24,720,000	
北洋銀行	87,300	449.00	39,197,700	
愛媛銀行	9,400	1,079.00	10,142,600	
京葉銀行	28,800	776.00	22,348,800	
栃木銀行	30,100	274.00	8,247,400	
北日本銀行	3,000	2,752.00	8,256,000	
リコーリース	6,100	5,040.00	30,744,000	

イオンフィナンシャルサービス	36,800	1,247.00	45,889,600	
アコム	152,300	378.20	57,599,860	
ジャックス	7,700	3,645.00	28,066,500	
オリエントコーポレーション	20,900	817.00	17,075,300	
オリックス	383,900	3,293.00	1,264,182,700	
三菱ＨＣキャピタル	320,900	1,004.50	322,344,050	
ジャフコ　グループ	19,100	2,155.50	41,170,050	
トモニホールディングス	61,200	437.00	26,744,400	
大和証券グループ本社	457,700	1,013.00	463,650,100	
野村ホールディングス	1,076,400	893.30	961,548,120	
岡三証券グループ	50,600	621.00	31,422,600	
丸三証券	21,300	968.00	20,618,400	
東洋証券	19,200	549.00	10,540,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	76,000	477.00	36,252,000	
光世証券	400	430.00	172,000	
水戸証券	17,600	550.00	9,680,000	
いちよし証券	12,900	988.00	12,745,200	
松井証券	44,100	806.00	35,544,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	313,000	4,090.00	1,280,170,000	
日本取引所グループ	380,800	1,764.50	671,921,600	
マネックスグループ	62,700	962.00	60,317,400	
極東証券	8,000	1,415.00	11,320,000	
岩井コスモホールディングス	7,300	2,272.00	16,585,600	
アイザワ証券グループ	9,300	1,691.00	15,726,300	
フィデアホールディングス	6,700	1,364.00	9,138,800	
池田泉州ホールディングス	88,800	386.00	34,276,800	
アニコム　ホールディングス	21,700	647.00	14,039,900	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	469,100	3,390.00	1,590,249,000	
スパークス・グループ	7,100	1,507.00	10,699,700	
第一生命ホールディングス	301,000	4,153.00	1,250,053,000	
東京海上ホールディングス	625,000	5,520.00	3,450,000,000	
イー・ギャランティ	10,400	1,749.00	18,189,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,100	3,730.00	11,563,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	171,900	2,783.00	478,397,700	
アドバンスクリエイト	4,600	457.00	2,102,200	
三井不動産	888,400	1,237.50	1,099,395,000	
三菱地所	370,800	2,145.50	795,551,400	
平和不動産	10,400	4,195.00	43,628,000	
東京建物	55,900	2,530.00	141,427,000	
京阪神ビルディング	10,800	1,590.00	17,172,000	
住友不動産	104,100	4,781.00	497,702,100	
テーオーシー	12,900	644.00	8,307,600	
レオパレス２１	56,000	581.00	32,536,000	
スターツコーポレーション	10,500	3,720.00	39,060,000	
フジ住宅	10,600	780.00	8,268,000	
空港施設	13,700	571.00	7,822,700	
ゴールドクレスト	4,300	3,350.00	14,405,000	
リログループ	37,200	1,955.50	72,744,600	

エスリード	3,000	4,380.00	13,140,000	
日神グループホールディングス	15,600	519.00	8,096,400	
日本エスコン	16,800	928.00	15,590,400	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	37,500	496.00	18,600,000	
イオンモール	38,700	2,005.50	77,612,850	
カチタス	17,200	2,179.00	37,478,800	
東祥	12,800	633.00	8,102,400	
トーセイ	10,600	2,468.00	26,160,800	
サンフロンティア不動産	10,700	1,859.00	19,891,300	
ＦＪネクストホールディングス	7,100	1,166.00	8,278,600	
グランディハウス	14,500	564.00	8,178,000	
東武鉄道	68,500	2,491.50	170,667,750	
相鉄ホールディングス	21,500	2,468.00	53,062,000	
東急	182,200	1,676.50	305,458,300	
京浜急行電鉄	80,400	1,290.50	103,756,200	
小田急電鉄	107,500	1,417.50	152,381,250	
京王電鉄	34,400	3,800.00	130,720,000	
京成電鉄	37,700	4,176.00	157,435,200	
富士急行	8,000	2,239.00	17,912,000	
東日本旅客鉄道	358,400	2,740.00	982,016,000	
西日本旅客鉄道	166,100	2,720.50	451,875,050	
東海旅客鉄道	250,300	2,864.00	716,859,200	
東京地下鉄	108,700	1,580.00	171,746,000	
西武ホールディングス	70,800	3,398.00	240,578,400	
鴻池運輸	11,100	3,005.00	33,355,500	
西日本鉄道	18,800	2,179.00	40,965,200	
ハマキョウレックス	22,200	1,312.00	29,126,400	
サカイ引越センター	8,200	2,426.00	19,893,200	
近鉄グループホールディングス	69,500	3,193.00	221,913,500	
阪急阪神ホールディングス	86,500	4,065.00	351,622,500	
南海電気鉄道	28,900	2,377.50	68,709,750	
京阪ホールディングス	35,800	3,281.00	117,459,800	
神戸電鉄	3,400	2,263.00	7,694,200	
名古屋鉄道	71,700	1,694.00	121,459,800	
山陽電気鉄道	4,900	1,999.00	9,795,100	
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	1,723.50	135,984,150	
山九	15,700	5,425.00	85,172,500	
日新	4,400	4,400.00	19,360,000	
丸全昭和運輸	4,000	5,880.00	23,520,000	
センコーグループホールディングス	38,200	1,515.00	57,873,000	
トナミホールディングス	1,400	5,750.00	8,050,000	
ニッコンホールディングス	36,900	2,002.00	73,873,800	
福山通運	6,900	3,675.00	25,357,500	
セイノーホールディングス	31,900	2,390.00	76,241,000	
神奈川中央交通	1,800	3,785.00	6,813,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	20,100	1,094.00	21,989,400	
日本郵船	134,500	5,055.00	679,897,500	
商船三井	123,400	5,220.00	644,148,000	
川崎汽船	147,700	2,107.00	311,203,900	

ＮＳユナイテッド海運	4,100	3,840.00	15,744,000	
明海グループ	300	663.00	198,900	
飯野海運	23,800	1,120.00	26,656,000	
九州旅客鉄道	49,700	3,865.00	192,090,500	
ＳＧホールディングス	109,000	1,462.50	159,412,500	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	23,300	7,242.00	168,738,600	
ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス	4,000	6,470.00	25,880,000	
日本航空	148,700	2,498.00	371,452,600	
ＡＮＡホールディングス	176,600	2,856.50	504,457,900	
ＴＲＥホールディングス	15,300	1,481.00	22,659,300	
人・夢・技術グループ	5,000	1,410.00	7,050,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4,200	1,920.00	8,064,000	
シルバーライフ	11,000	693.00	7,623,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,000	3,125.00	18,750,000	
ＫＰＰグループホールディングス	14,200	616.00	8,747,200	
ギフトホールディングス	3,400	3,305.00	11,237,000	
三菱倉庫	67,700	1,159.50	78,498,150	
三井倉庫ホールディングス	6,700	7,330.00	49,111,000	
住友倉庫	19,300	2,768.00	53,422,400	
澁澤倉庫	3,000	3,025.00	9,075,000	
ヤマタネ	2,800	3,725.00	10,430,000	
乾汽船	8,200	1,633.00	13,390,600	
日本トランスシティ	13,100	1,040.00	13,624,000	
中央倉庫	5,200	1,516.00	7,883,200	
安田倉庫	4,900	1,755.00	8,599,500	
大栄環境	14,600	2,845.00	41,537,000	
日本管財ホールディングス	7,000	2,600.00	18,200,000	
上組	30,000	3,413.00	102,390,000	
キユーソー流通システム	4,300	2,160.00	9,288,000	
エーアイテイー	4,600	1,661.00	7,640,600	
内外トランスライン	2,800	2,711.00	7,590,800	
日本コンセプト	4,500	1,828.00	8,226,000	
ＴＢＳホールディングス	32,800	4,110.00	134,808,000	
日本テレビホールディングス	57,700	2,811.50	162,223,550	
朝日放送グループホールディングス	13,100	626.00	8,200,600	
テレビ朝日ホールディングス	15,800	2,349.00	37,114,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	50,600	902.00	45,641,200	
テレビ東京ホールディングス	4,000	3,160.00	12,640,000	
ビジョン	9,800	1,294.00	12,681,200	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	21,900	1,702.00	37,273,800	
日本通信	58,400	123.00	7,183,200	
日本電信電話	19,389,500	155.60	3,017,006,200	
ＫＤＤＩ	479,400	4,970.00	2,382,618,000	
ソフトバンク	10,430,700	196.60	2,050,675,620	
光通信	7,500	34,450.00	258,375,000	
GMOインターネットグループ	21,200	2,687.00	56,964,400	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	34,500	3,689.00	127,270,500	
学研ホールディングス	11,900	1,028.00	12,233,200	

ゼンリン	11,100	821.00	9,113,100	
東京電力ホールディングス	546,800	444.50	243,052,600	
中部電力	239,500	1,535.00	367,632,500	
関西電力	273,800	1,663.50	455,466,300	
中国電力	112,900	852.20	96,213,380	
北陸電力	66,500	829.10	55,135,150	
東北電力	171,100	1,131.50	193,599,650	
四国電力	60,500	1,174.00	71,027,000	
九州電力	149,800	1,333.00	199,683,400	
北海道電力	68,000	790.20	53,733,600	
沖縄電力	16,600	917.00	15,222,200	
電源開発	48,900	2,459.00	120,245,100	
イーレックス	10,600	562.00	5,957,200	
レノバ	17,700	694.00	12,283,800	
東京瓦斯	122,900	4,191.00	515,073,900	
大阪瓦斯	127,700	3,217.00	410,810,900	
東邦瓦斯	25,600	3,980.00	101,888,000	
北海道瓦斯	19,400	527.00	10,223,800	
広島ガス	21,400	371.00	7,939,400	
西部ガスホールディングス	6,800	1,681.00	11,430,800	
静岡ガス	14,800	1,002.00	14,829,600	
メタウォーター	8,900	1,784.00	15,877,600	
M&A総研ホールディングス	7,200	1,837.00	13,226,400	
アイネット	4,900	1,565.00	7,668,500	
松竹	3,700	11,150.00	41,255,000	
東宝	40,800	6,616.00	269,932,800	
エイチ・アイ・エス	21,400	1,550.00	33,170,000	
東映	10,800	6,320.00	68,256,000	
ＮＴＴデータグループ	170,400	2,966.50	505,491,600	
共立メンテナンス	21,000	2,847.50	59,797,500	
イチネンホールディングス	6,500	1,863.00	12,109,500	
建設技術研究所	3,400	5,090.00	17,306,000	
スペース	7,000	1,162.00	8,134,000	
アインホールディングス	9,500	4,268.00	40,546,000	
燦ホールディングス	7,700	1,151.00	8,862,700	
ピー・シー・エー	4,300	2,105.00	9,051,500	
スバル興業	2,800	3,200.00	8,960,000	
ビジネスブレイン太田昭和	3,800	2,090.00	7,942,000	
ナガワ	1,800	6,760.00	12,168,000	
東京都競馬	4,900	4,405.00	21,584,500	
カナモト	10,400	3,285.00	34,164,000	
ＤＴＳ	11,800	4,215.00	49,737,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,800	6,247.00	204,901,600	
シーイーシー	8,200	1,927.00	15,801,400	
カプコン	129,500	3,401.00	440,429,500	
ニシオホールディングス	5,500	4,395.00	24,172,500	
アイ・エス・ビー	5,800	1,367.00	7,928,600	
日本空港ビルデング	22,600	4,905.00	110,853,000	
トランス・コスモス	8,500	3,325.00	28,262,500	

乃村工藝社	29,100	847.00	24,647,700	
ＳＣＳＫ	53,200	3,266.00	173,751,200	
藤田観光	3,000	7,750.00	23,250,000	
トーカイ	5,900	2,380.00	14,042,000	
セコム	136,100	5,288.00	719,696,800	
ＮＳＷ	2,900	3,055.00	8,859,500	
セントラル警備保障	3,600	2,893.00	10,414,800	
アイネス	5,100	1,801.00	9,185,100	
丹青社	14,100	978.00	13,789,800	
メイテックグループホールディングス	24,600	2,884.50	70,958,700	
ＴＫＣ	11,600	3,850.00	44,660,000	
富士ソフト	18,000	9,757.00	175,626,000	
応用地質	6,200	2,496.00	15,475,200	
船井総研ホールディングス	13,400	2,400.00	32,160,000	
ＮＳＤ	25,100	3,400.00	85,340,000	
コナミグループ	24,400	14,905.00	363,682,000	
学究社	4,200	2,081.00	8,740,200	
イオンディライト	7,200	4,330.00	31,176,000	
ナック	14,000	579.00	8,106,000	
福井コンピュータホールディングス	4,500	3,095.00	13,927,500	
ダイセキ	16,100	3,695.00	59,489,500	
ステップ	4,000	2,136.00	8,544,000	
泉州電業	4,700	5,000.00	23,500,000	
ＧＥＮＫＩ　ＧＬＯＢＡＬ　ＤＩＮＩＮＧ　ＣＯＮＣＥＰＴＳ	3,900	3,450.00	13,455,000	
トラスコ中山	14,400	2,339.00	33,681,600	
ヤマダホールディングス	211,500	445.50	94,223,250	
オートバックスセブン	23,900	1,419.00	33,914,100	
モリト	5,500	1,502.00	8,261,000	
アークランズ	20,500	1,655.00	33,927,500	
ニトリホールディングス	25,000	18,340.00	458,500,000	
ケーユーホールディングス	7,100	1,092.00	7,753,200	
吉野家ホールディングス	26,900	3,128.00	84,143,200	
加藤産業	8,500	4,480.00	38,080,000	
イノテック	5,900	1,336.00	7,882,400	
イエローハット	12,100	2,604.00	31,508,400	
松屋フーズホールディングス	3,200	6,680.00	21,376,000	
ＪＢＣＣホールディングス	4,300	4,555.00	19,586,500	
ＪＫホールディングス	7,600	1,031.00	7,835,600	
サガミホールディングス	11,000	1,762.00	19,382,000	
日伝	3,900	3,045.00	11,875,500	
ミロク情報サービス	5,900	1,963.00	11,581,700	
杉本商事	6,100	1,361.00	8,302,100	
因幡電機産業	19,200	3,901.00	74,899,200	
王将フードサービス	13,600	3,030.00	41,208,000	
ミニストップ	5,700	1,673.00	9,536,100	
アークス	11,600	2,547.00	29,545,200	
バローホールディングス	13,100	2,124.00	27,824,400	
東テク	6,900	2,653.00	18,305,700	
ミスミグループ本社	103,900	2,408.00	250,191,200	

ベルク	3,400	6,570.00	22,338,000	
大　庄	7,700	1,072.00	8,254,400	
ファーストリテイリング	38,700	52,770.00	2,042,199,000	
ソフトバンクグループ	321,500	8,760.00	2,816,340,000	
スズケン	22,700	4,706.00	106,826,200	
サンドラッグ	23,200	3,921.00	90,967,200	
ジェコス	8,300	987.00	8,192,100	
ベルーナ	16,500	772.00	12,738,000	
合計	122,285,900		251,542,389,910	

（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20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	3,152,337,970
金銭信託	137,432,938
コール・ローン	9,754,454,494
株式	1,141,797,603,959
投資証券	20,243,050,398
派生商品評価勘定	125,746,469
未収入金	8,188,534
未収配当金	806,928,294
差入委託証拠金	14,518,155,811
流動資産合計	1,190,543,898,867
資産合計	1,190,543,898,867
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	757,529,944
未払解約金	4,293,956,036
流動負債合計	5,051,485,980
負債合計	5,051,485,980
純資産の部	
元本等	
元本	236,877,475,601
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	948,614,937,286
元本等合計	1,185,492,412,887
純資産合計	1,185,492,412,887
負債純資産合計	1,190,543,898,867

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年12月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	226,584,636,772円
同期中追加設定元本額	30,160,283,313円
同期中一部解約元本額	19,867,444,484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）	677,908,025円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,392,005,584円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,466,249,906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）	2,346,532,211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）	632,020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）	1,327,503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）	4,283,280円
ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ（適格機関投資家限定）	491,233,547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	160,474,747,103円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	45,109,492,556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）	3,500,288,761円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	458,519,075円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	166,176,841円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	525,699,105円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	630,930,127円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	7,887,411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）	84,373,044円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	9,390,505円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	10,473,712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）	3,358,736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）	19,474,719円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	382,711,427円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	256,386,050円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	447,688,871円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	153,495,039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）	124,683,953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）	277,708,582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）	125,486,139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）	123,065,623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）	122,602,369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）	109,515,348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）	32,692,171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）	12,410,433,055円
ＦＷニッセイ先進国株インデックス	57,222,951円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	194,066,729円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンドⅡ２０２３－０５（適格機関投資家限定）	79,178,231円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	444,296,449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）	77,383,305円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	4,502,774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）	73,116,138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）	81,801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）	174,825円
計	236,877,475,601円
２．　受益権の総数	236,877,475,601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　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年12月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△6,181,326,267
投資証券	△1,775,998,367
合計	△7,957,324,634

（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20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	3,904,457,931	－	4,030,204,400	125,746,469
アメリカ・ドル	1,982,944,218	－	2,065,243,680	82,299,462
イギリス・ポンド	629,985,174	－	641,409,740	11,424,566
ユーロ	1,291,528,539	－	1,323,550,980	32,022,441
合計	3,904,457,931	－	4,030,204,400	125,746,469

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2024年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	23,909,047,187	－	23,151,517,244	△757,529,943
合計	23,909,047,187	－	23,151,517,244	△757,529,943

（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20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.0047円 (50,047円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2024年12月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	61,288	127.130	7,791,543.44	
	ABBOTT LABORATORIES	194,126	112.420	21,823,644.92	
	ABBVIE INC	197,069	171.520	33,801,274.88	
	ACCENTURE PLC	69,714	372.160	25,944,762.24	
	ADOBE INC	49,111	437.390	21,480,660.29	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	180,569	118.880	21,466,042.72	
	AECOM	14,948	107.040	1,600,033.92	
	AERCAP HOLDINGS NV	21,626	93.080	2,012,948.08	
	AES CORP	79,324	12.440	986,790.56	
	AFLAC INC	59,333	101.250	6,007,466.25	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	32,056	133.190	4,269,538.64	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,805	293.170	7,272,081.85	
	AIRBNB INC-CLASS A	49,089	129.350	6,349,662.15	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	16,898	94.580	1,598,212.84	
	ALBEMARLE CORP	13,125	88.920	1,167,075.00	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	42,025	19.410	815,705.25	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	7,916	213.580	1,690,699.28	
	ALLEGION PLC	9,719	130.630	1,269,592.97	
	ALLIANT ENERGY CORP	28,611	58.260	1,666,876.86	
	ALLSTATE CORP	29,459	189.790	5,591,023.61	
	ALLY FINANCIAL INC	30,595	34.630	1,059,504.85	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14,325	238.870	3,421,812.75	
	ALPHABET INC-CL A	653,572	188.510	123,204,857.72	
	ALPHABET INC-CL C	560,841	189.700	106,391,537.70	
	ALTRIA GROUP INC	190,400	52.990	10,089,296.00	
	AMAZON.COM INC	1,053,825	223.290	235,308,584.25	
	AMCOR PLC	161,516	9.400	1,518,250.40	
	AMEREN CORPORATION	29,770	88.570	2,636,728.90	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	59,369	91.240	5,416,827.56	
	AMERICAN EXPRESS CO	63,445	293.080	18,594,460.60	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,964	136.460	1,086,767.44	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	71,816	71.090	5,105,399.44	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,743	123.830	2,692,435.69	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,946	525.760	5,754,968.96	
AMETEK INC	25,839	182.110	4,705,540.29	
AMGEN INC	59,952	261.190	15,658,862.88	
AMPHENOL CORP-CL A	134,338	70.010	9,405,003.38	
ANALOG DEVICES INC	55,395	207.780	11,509,973.10	
ANSYS INC	9,749	334.480	3,260,845.52	
AON PLC	21,814	353.750	7,716,702.50	
APA CORP	41,132	20.480	842,383.36	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	44,475	169.630	7,544,294.25	
APPLE INC	1,696,218	249.790	423,698,294.22	
APPLIED MATERIALS INC	91,962	161.440	14,846,345.28	
APPLOVIN CORP-CLASS A	23,198	318.740	7,394,130.52	
APTIVE PLC	29,651	57.010	1,690,403.51	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	41,936	88.990	3,731,884.64	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	53,370	49.380	2,635,410.60	
ARES MANAGEMENT CORP - A	21,016	171.080	3,595,417.28	
ARISTA NETWORKS INC	119,168	109.070	12,997,653.76	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,450	279.090	6,823,750.50	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,177	249.060	791,263.62	
ASSURANT INC	5,772	208.440	1,203,115.68	
AT&T INC	801,308	22.570	18,085,521.56	
ATLASSIAN CORP-CL A	17,853	251.230	4,485,209.19	
ATMOS ENERGY CORP	17,307	137.970	2,387,846.79	
AUTODESK INC	23,978	293.630	7,040,660.14	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	45,500	291.330	13,255,515.00	
AUTOZONE INC	1,905	3,215.290	6,125,127.45	
AVANTOR INC	75,856	21.020	1,594,493.12	
AVERY DENNISON CORP	8,984	186.260	1,673,359.84	
AXON ENTERPRISE INC	8,010	615.680	4,931,596.80	
BAKER HUGHES COMPANY	110,822	39.800	4,410,715.60	
BALL CORP	33,863	55.360	1,874,655.68	
BANK OF AMERICA CORP	779,088	43.380	33,796,837.44	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	82,282	76.410	6,287,167.62	
BAXTER INTERNATIONAL INC	56,970	28.900	1,646,433.00	
BECTON DICKINSON & CO	32,252	223.830	7,218,965.16	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	17,847	47.740	852,015.78	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	147,834	449.340	66,427,729.56	

BEST BUY CO INC	22,770	85.200	1,940,004.00	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,163	325.940	705,008.22	
BIO-TECHNE CORP	17,708	71.390	1,264,174.12	
BIOGEN INC	16,251	147.390	2,395,234.89	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21,261	65.000	1,381,965.00	
BLACKROCK INC	16,523	1,016.330	16,792,820.59	
BLACKSTONE INC	80,331	168.910	13,568,709.21	
BLOCK INC	61,958	87.640	5,429,999.12	
BOEING CO	81,305	177.040	14,394,237.20	
BOOKING HOLDINGS INC	3,740	4,980.400	18,626,696.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	14,411	128.660	1,854,119.26	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	164,249	88.660	14,562,316.34	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	226,216	56.300	12,735,960.80	
BROADCOM INC	495,006	218.320	108,069,709.92	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	13,041	224.180	2,923,531.38	
BROWN & BROWN INC	27,043	102.300	2,766,498.90	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	20,361	41.360	842,130.96	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	12,986	146.290	1,899,721.94	
BUNGE GLOBAL SA	15,809	77.920	1,231,837.28	
BURLINGTON STORES INC	7,104	281.120	1,997,076.48	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,088	105.000	1,374,240.00	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	30,549	299.870	9,160,728.63	
CAMPBELL SOUP CO	21,614	41.580	898,710.12	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,600	175.660	7,483,116.00	
CARDINAL HEALTH INC	26,989	117.000	3,157,713.00	
CARLISLE COS INC	5,156	377.880	1,948,349.28	
CARLYLE GROUP INC/THE	25,826	49.030	1,266,248.78	
CARMAX INC	17,280	84.230	1,455,494.40	
CARNIVAL CORP	115,829	25.180	2,916,574.22	
CARRIER GLOBAL CORP	90,634	66.690	6,044,381.46	
CARVANA CO	12,712	222.980	2,834,521.76	
CATERPILLAR INC	54,093	360.370	19,493,494.41	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,678	193.800	2,263,196.40	
CBRE GROUP INC	34,178	125.650	4,294,465.70	
CDW CORP/DE	14,905	173.280	2,582,738.40	
CELANESE CORP-SERIES A	12,183	67.030	816,626.49	
CENCORA, INC.	19,782	226.270	4,476,073.14	
CENTENE CORP	58,686	59.710	3,504,141.06	
CENTERPOINT ENERGY INC	72,696	31.760	2,308,824.96	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,126	83.820	1,686,961.32	

CHARLES RIVER LABORATORIES	5,760	182.150	1,049,184.00	
CHARLES SCHWAB CORP	178,575	73.620	13,146,691.50	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	10,351	352.770	3,651,522.27	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,806	187.010	1,833,820.06	
CHENIERE ENERGY INC	25,226	205.940	5,195,042.44	
CHEVRON CORP	193,841	141.150	27,360,657.15	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	152,789	61.740	9,433,192.86	
CHUBB LTD	42,827	273.160	11,698,623.32	
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,324	105.850	2,892,245.40	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,428	142.230	2,478,784.44	
CINTAS CORP	40,482	182.790	7,399,704.78	
CISCO SYSTEMS INC	445,271	57.630	25,660,967.73	
CITIGROUP INC	212,830	68.420	14,561,828.60	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,012	42.450	2,123,009.40	
CLOROX CO	13,804	164.130	2,265,650.52	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	33,950	108.580	3,686,291.00	
CME GROUP INC	40,190	236.820	9,517,795.80	
CMS ENERGY CORP	33,291	65.760	2,189,216.16	
CNH INDUSTRIAL NV	98,025	11.000	1,078,275.00	
COCA-COLA CO	456,824	62.450	28,528,658.80	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	23,063	74.710	1,723,036.73	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	55,289	79.490	4,394,922.61	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	21,512	273.920	5,892,567.04	
COLGATE-PALMOLIVE CO	86,621	92.920	8,048,823.32	
COMCAST CORP	431,004	37.400	16,119,549.60	
CONAGRA BRANDS INC	53,319	26.810	1,429,482.39	
CONOCOPHILLIPS	145,419	95.180	13,840,980.42	
CONSOLIDATED EDISON INC	38,610	89.070	3,438,992.70	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18,232	227.050	4,139,575.60	
CONSTELLATION ENERGY	34,881	225.170	7,854,154.77	
COOPER COS INC/THE	22,212	91.930	2,041,949.16	
COPART INC	96,715	58.450	5,652,991.75	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	29,712	29.090	864,322.08	
CORNING INC	90,701	47.060	4,268,389.06	
CORTEVA INC	77,231	56.160	4,337,292.96	
COSTAR GROUP INC	45,742	69.840	3,194,621.28	
COSTCO WHOLESALE CORP	49,428	954.800	47,193,854.40	
COTERRA ENERGY INC	82,494	23.670	1,952,632.98	
CRH PLC	76,155	93.060	7,086,984.30	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	25,962	351.030	9,113,440.86	
CROWN HOLDINGS INC	13,451	82.240	1,106,210.24	
CSX CORP	216,268	31.580	6,829,743.44	
CUMMINS INC	15,290	349.700	5,346,913.00	
CVS HEALTH CORP	140,370	43.780	6,145,398.60	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,811	315.180	1,516,330.98	
DANAHER CORP	72,518	226.160	16,400,670.88	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,121	183.440	2,406,916.24	
DATADOG INC - CLASS A	31,310	146.930	4,600,378.30	
DAVITA INC	5,140	147.540	758,355.60	
DAYFORCE, INC.	17,635	74.000	1,304,990.00	
DECKERS OUTDOOR CORP	17,008	205.280	3,491,402.24	
DEERE & CO	28,998	426.630	12,371,416.74	
DELL TECHNOLOGIES -C	35,384	111.960	3,961,592.64	
DELTA AIR LINES INC	17,968	60.380	1,084,907.84	
DEVON ENERGY CORPORATION	69,738	30.520	2,128,403.76	
DEXCOM INC	44,725	75.820	3,391,049.50	
DIAMONDBACK ENERGY INC	21,208	153.060	3,246,096.48	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,453	217.590	1,404,108.27	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	28,014	169.270	4,741,929.78	
DOCUSIGN INC	22,639	94.150	2,131,461.85	
DOLLAR GENERAL CORP	24,561	73.890	1,814,812.29	
DOLLAR TREE INC	22,810	69.060	1,575,258.60	
DOMINION ENERGY INC	93,630	52.990	4,961,453.70	
DOMINO'S PIZZA INC	3,854	427.640	1,648,124.56	
DOORDASH INC - A	34,329	167.650	5,755,256.85	
DOVER CORP	15,328	188.940	2,896,072.32	
DOW INC	78,312	39.100	3,061,999.20	
DR HORTON INC	32,732	137.240	4,492,139.68	
DRAFTKINGS INC	48,758	39.400	1,921,065.20	
DTE ENERGY COMPANY	23,085	118.110	2,726,569.35	
DUKE ENERGY CORP	86,144	107.080	9,224,299.52	
DUPONT DE NEMOURS INC	46,558	76.850	3,577,982.30	
DYNATRACE INC	33,232	53.560	1,779,905.92	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	13,021	90.030	1,172,280.63	
EATON CORP PLC	44,410	335.640	14,905,772.40	
EBAY INC	54,535	63.950	3,487,513.25	
ECOLAB INC	28,567	235.530	6,728,385.51	
EDISON INTERNATIONAL	43,054	77.930	3,355,198.22	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	67,208	73.930	4,968,687.44	
ELECTRONIC ARTS INC	27,999	147.890	4,140,772.11	
ELEVANCE HEALTH, INC	25,874	366.480	9,482,303.52	
ELI LILLY & CO	90,128	757.540	68,275,565.12	
EMCOR GROUP INC	5,203	464.300	2,415,752.90	

EMERSON ELECTRIC CO	63,898	122.350	7,817,920.30	
ENPHASE ENERGY INC	15,123	65.800	995,093.40	
ENTEGRIS INC	16,850	97.910	1,649,783.50	
ENTERGY CORP	47,686	74.490	3,552,130.14	
EOG RESOURCES INC	63,404	118.220	7,495,620.88	
EPAM SYSTEMS INC	6,355	246.800	1,568,414.00	
EQT CORP	63,022	42.650	2,687,888.30	
EQUIFAX INC	13,802	253.660	3,501,015.32	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,297	44.980	1,587,659.06	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,835	408.380	1,157,757.30	
ESSENTIAL UTILITIES INC	29,064	36.180	1,051,535.52	
ESTEE LAUDER COS INC	26,074	74.700	1,947,727.80	
EVEREST GROUP LTD	4,823	349.360	1,684,963.28	
EVERGY INC	25,661	60.530	1,553,260.33	
EVERSOURCE ENERGY	39,908	55.900	2,230,857.20	
EXACT SCIENCES CORP	20,629	56.110	1,157,493.19	
EXELON CORP	111,607	37.190	4,150,664.33	
EXPAND ENERGY CORPORATION	22,771	94.320	2,147,760.72	
EXPEDIA GROUP INC	13,895	179.410	2,492,901.95	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	15,736	112.740	1,774,076.64	
EXXON MOBIL CORP	495,639	105.510	52,294,870.89	
F5 INC	6,497	250.410	1,626,913.77	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,245	489.730	2,078,903.85	
FAIR ISAAC CORP	2,734	2,044.890	5,590,729.26	
FASTENAL CO	63,905	74.030	4,730,887.15	
FEDEX CORP	25,893	275.880	7,143,360.84	
FERGUSON ENTERPRISES INC	22,397	174.760	3,914,099.72	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	28,974	55.190	1,599,075.06	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	60,862	80.140	4,877,480.68	
FIFTH THIRD BANCORP	75,462	42.260	3,189,024.12	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,126	2,070.940	2,331,878.44	
FIRST SOLAR INC	11,349	175.880	1,996,062.12	
FIRSTENERGY CORP	61,055	39.160	2,390,913.80	
FISERV INC	64,216	202.260	12,988,328.16	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,356	339.090	2,494,346.04	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	19,845	261.340	5,186,292.30	
FORD MOTOR CO	435,620	9.740	4,242,938.80	
FORTINET INC	72,533	94.850	6,879,755.05	
FORTIVE CORP	39,070	73.240	2,861,486.80	

FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	13,841	68.560	948,938.96	
FOX CORP - CLASS A	24,655	48.840	1,204,150.20	
FOX CORP- CLASS B	15,926	45.970	732,118.22	
FRANKLIN RESOURCES INC	32,286	19.970	644,751.42	
FREEPORT-MCMORAN INC	160,216	38.240	6,126,659.84	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,248	83.640	522,582.72	
GARMIN LTD	17,160	205.420	3,525,007.20	
GARTNER INC	8,593	481.220	4,135,123.46	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	50,930	77.430	3,943,509.90	
GE VERNOVA INC	30,658	332.800	10,202,982.40	
GEN DIGITAL INC	61,791	27.450	1,696,162.95	
GENERAL DYNAMICS CORP	26,060	260.280	6,782,896.80	
GENERAL ELECTRIC CO	120,963	164.800	19,934,702.40	
GENERAL MILLS INC	61,963	64.010	3,966,251.63	
GENERAL MOTORS CO	125,339	50.340	6,309,565.26	
GENUINE PARTS CO	15,580	114.620	1,785,779.60	
GILEAD SCIENCES INC	138,907	91.090	12,653,038.63	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,395	110.580	3,139,919.10	
GLOBAL-E ONLINE LTD	11,180	53.520	598,353.60	
GODADDY INC - CLASS A	15,716	202.940	3,189,405.04	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	35,229	553.990	19,516,513.71	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	235,727	4.920	1,159,776.84	
GRACO INC	18,872	84.750	1,599,402.00	
HALLIBURTON CO	98,483	25.770	2,537,906.91	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	32,659	107.060	3,496,472.54	
HCA HEALTHCARE INC	21,589	297.520	6,423,159.28	
HEICO CORP	4,887	237.690	1,161,591.03	
HEICO CORP-CLASS A	8,424	184.810	1,556,839.44	
HENRY SCHEIN INC	14,139	68.950	974,884.05	
HERSHEY CO/THE	16,494	168.940	2,786,496.36	
HESS CORP	30,922	127.660	3,947,502.52	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	144,863	20.890	3,026,188.07	
HF SINCLAIR CORP	18,092	33.670	609,157.64	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	27,474	245.750	6,751,735.50	
HOLOGIC INC	25,896	70.760	1,832,400.96	
HOME DEPOT INC	110,817	385.020	42,666,761.34	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	72,486	226.880	16,445,623.68	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	123,300	4.360	537,588.00	
HORMEL FOODS CORP	33,745	31.580	1,065,667.10	
HOWMET AEROSPACE INC	43,240	109.350	4,728,294.00	
HP INC	107,496	32.460	3,489,320.16	
HUBBELL INC	5,987	424.550	2,541,780.85	
HUBSPOT INC	5,442	702.450	3,822,732.90	

HUMANA INC	13,437	235.780	3,168,175.86	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	162,042	15.910	2,578,088.22	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,386	187.610	822,857.46	
HYATT HOTELS CORP - CL A	5,002	155.140	776,010.28	
IDEX CORP	8,458	210.260	1,778,379.08	
IDEXX LABORATORIES INC	9,183	409.030	3,756,122.49	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	33,130	258.110	8,551,184.30	
ILLUMINA INC	17,733	134.000	2,376,222.00	
INCYTE CORP	18,266	67.060	1,224,917.96	
INGERSOLL-RAND INC	45,005	91.260	4,107,156.30	
INSULET CORP	7,823	256.560	2,007,068.88	
INTEL CORP	477,092	19.060	9,093,373.52	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	64,049	148.290	9,497,826.21	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	102,765	223.920	23,011,138.80	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	28,537	85.940	2,452,469.78	
INTERNATIONAL PAPER CO	36,821	53.840	1,982,442.64	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	41,963	28.630	1,201,400.69	
INTUIT INC	31,271	636.950	19,918,063.45	
INTUITIVE SURGICAL INC	39,642	523.910	20,768,840.22	
IQVIA HOLDINGS INC	20,333	191.520	3,894,176.16	
JABIL CIRCUIT INC	12,644	140.440	1,775,723.36	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,140	175.990	1,432,558.60	
JACOBS SOLUTIONS INC	13,853	134.060	1,857,133.18	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,900	41.190	737,301.00	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,099	168.100	1,529,541.90	
JM SMUCKER CO	11,882	108.970	1,294,781.54	
JOHNSON & JOHNSON	268,588	143.580	38,563,865.04	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	74,520	78.710	5,865,469.20	
JPMORGAN CHASE & CO	317,407	232.960	73,943,134.72	
JUNIPER NETWORKS INC	36,788	37.000	1,361,156.00	
KELLANOVA	30,764	80.340	2,471,579.76	
KENVUE INC	213,726	21.610	4,618,618.86	
KEURIG DR PEPPER INC	128,626	32.400	4,167,482.40	
KEYCORP	105,266	16.810	1,769,521.46	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	19,357	159.850	3,094,216.45	
KIMBERLY-CLARK CORP	37,596	131.450	4,941,994.20	
KINDER MORGAN INC	223,125	26.240	5,854,800.00	
KKR & CO INC -A	69,289	143.530	9,945,050.17	
KLA CORPORATION	14,944	622.180	9,297,857.92	

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	18,066	52.280	944,490.48	
KRAFT HEINZ CO/THE	101,236	30.100	3,047,203.60	
KROGER CO	76,666	60.960	4,673,559.36	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,169	210.640	4,459,038.16	
LABCORP HOLDINGS INC	9,367	226.970	2,126,027.99	
LAM RESEARCH CORP	144,584	71.210	10,295,826.64	
LAMB WESTON HOLDING INC	15,912	62.500	994,500.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	41,079	51.280	2,106,531.12	
LEIDOS HOLDINGS INC	14,269	143.200	2,043,320.80	
LENNAR CORP-CL A	26,633	138.400	3,686,007.20	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,575	619.880	2,216,071.00	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	23,546	94.650	2,228,628.90	
LINDE PLC	53,268	419.590	22,350,720.12	
LIVE NATION INC	17,985	132.190	2,377,437.15	
LKQ CORP	29,441	36.000	1,059,876.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	23,937	479.660	11,481,621.42	
LOEWS CORP	20,739	81.660	1,693,546.74	
LOWE'S COS INC	63,287	244.520	15,474,937.24	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	8,340	327.690	2,732,934.60	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,473	373.540	4,659,164.42	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,063	72.970	2,120,727.11	
M&T BANK CORP	18,630	185.420	3,454,374.60	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	6,829	282.540	1,929,465.66	
MARATHON PETROLEUM CORP	37,312	131.650	4,912,124.80	
MARKEL GROUP INC	1,442	1,700.270	2,451,789.34	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,214	228.510	962,941.14	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	26,686	279.020	7,445,927.72	
MARSH & MCLENNAN COS INC	54,864	210.350	11,540,642.40	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,817	525.770	3,584,174.09	
MARVELL TECHNOLOGY INC	96,636	109.110	10,543,953.96	
MASCO CORP	24,321	72.690	1,767,893.49	
MASTERCARD INC-CLASS A	92,046	523.280	48,165,830.88	
MATCH GROUP INC	27,342	31.640	865,100.88	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	28,148	78.240	2,202,299.52	
MCDONALD'S CORP	80,038	290.230	23,229,428.74	
MCKESSON CORP	14,467	579.220	8,379,575.74	
MEDTRONIC PLC	143,094	79.990	11,446,089.06	
MERCADOLIBRE INC	5,090	1,666.000	8,479,940.00	
MERCK & CO INC	282,835	99.520	28,147,739.20	
META PLATFORMS INC-A	243,816	595.570	145,209,495.12	
METLIFE INC	66,398	80.110	5,319,143.78	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,382	1,206.020	2,872,739.64	

MGM MIRAGE	25,377	33.440	848,606.88	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	59,873	55.990	3,352,289.27	
MICRON TECHNOLOGY INC	123,687	87.090	10,771,900.83	
MICROSOFT CORP	787,790	437.030	344,287,863.70	
MICROSTRATEGY INC-CL A	20,415	326.460	6,664,680.90	
MODERNA INC	36,501	39.560	1,443,979.56	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,538	293.520	1,919,033.76	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	20,277	58.650	1,189,246.05	
MONDAY.COM LTD	4,177	224.690	938,530.13	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	149,043	59.270	8,833,778.61	
MONGODB INC	8,243	245.000	2,019,535.00	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,439	589.150	3,204,386.85	
MONSTER BEVERAGE CORP	81,968	50.900	4,172,171.20	
MOODY'S CORP	18,283	462.090	8,448,391.47	
MORGAN STANLEY	135,364	120.500	16,311,362.00	
MOSAIC CO/THE	35,576	23.880	849,554.88	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,614	463.810	8,633,359.34	
MSCI INC	8,775	600.580	5,270,089.50	
NASDAQ INC	48,093	77.380	3,721,436.34	
NETAPP INC	22,841	116.580	2,662,803.78	
NETFLIX INC	47,879	902.040	43,188,773.16	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,272	134.960	1,521,269.12	
NEWMONT CORP	127,560	37.020	4,722,271.20	
NEWS CORP - CLASS A	42,307	27.610	1,168,096.27	
NEXTERA ENERGY INC	229,296	69.770	15,997,981.92	
NIKE INC	132,850	77.100	10,242,735.00	
NISOURCE INC	49,977	35.870	1,792,674.99	
NORDSON CORP	6,065	208.940	1,267,221.10	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,226	230.600	5,817,115.60	
NORTHERN TRUST CORP	22,483	100.510	2,259,766.33	
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,503	467.130	7,241,916.39	
NRG ENERGY INC	23,013	89.250	2,053,910.25	
NUCOR CORP	26,487	115.780	3,066,664.86	
NUTANIX INC - A	28,108	63.900	1,796,101.20	
NVIDIA CORP	2,736,637	130.680	357,623,723.16	
NVR INC	343	8,101.210	2,778,715.03	
NXP SEMICONDUCTORS NV	28,417	207.270	5,889,991.59	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,471	1,214.390	7,858,317.69	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	70,651	45.360	3,204,729.36	
OKTA INC	18,125	81.690	1,480,631.25	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	21,514	187.740	4,039,038.36	
OMNICOM GROUP	21,820	87.890	1,917,759.80	

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	47,784	64.800	3,096,403.20	
ONEOK INC	65,144	97.660	6,361,963.04	
ORACLE CORP	185,482	168.790	31,307,506.78	
OTIS WORLDWIDE CORP	44,688	92.870	4,150,174.56	
OVINTIV INC	29,302	37.740	1,105,857.48	
OWENS CORNING	9,683	169.500	1,641,268.50	
PACCAR INC	58,502	107.510	6,289,550.02	
PACKAGING CORP OF AMERICA	10,013	227.460	2,277,556.98	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	227,054	74.210	16,849,677.34	
PALO ALTO NETWORKS INC	72,646	189.360	13,756,246.56	
PARKER HANNIFIN CORP	14,352	639.270	9,174,803.04	
PAYCHEX INC	36,147	137.810	4,981,418.07	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,767	206.990	1,193,711.33	
PAYPAL HOLDINGS INC	108,350	86.780	9,402,613.00	
PENTAIR PLC	18,447	100.980	1,862,778.06	
PEPSICO INC	153,085	151.470	23,187,784.95	
PFIZER INC	632,401	25.770	16,296,973.77	
PG&E CORP	226,337	19.420	4,395,464.54	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	173,471	122.170	21,192,952.07	
PHILLIPS 66	46,677	110.350	5,150,806.95	
PINTEREST INC- CLASS A	67,345	29.610	1,994,085.45	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	44,347	190.030	8,427,260.41	
POOL CORP	4,273	340.940	1,456,836.62	
PPG INDUSTRIES INC	26,032	119.520	3,111,344.64	
PPL CORPORATION	82,214	32.020	2,632,492.28	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,839	75.180	1,942,576.02	
PROCTER & GAMBLE CO	262,157	169.190	44,354,342.83	
PROGRESSIVE CORP	65,340	239.710	15,662,651.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39,810	115.470	4,596,860.70	
PTC INC	13,391	187.130	2,505,857.83	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	55,546	83.190	4,620,871.74	
PULTE GROUP INC	23,129	108.890	2,518,516.81	
PURE STORAGE INC - CLASS A	34,731	62.340	2,165,130.54	
QORVO INC	10,585	68.800	728,248.00	
QUALCOMM INC	124,281	150.400	18,691,862.40	
QUANTA SERVICES INC	16,433	322.590	5,301,121.47	
QUEST DIAGNOSTICS	12,421	151.520	1,882,029.92	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,820	150.860	3,291,765.20	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,096	708.250	8,566,992.00	

REGIONS FINANCIAL CORP	102,038	23.170	2,364,220.46	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	6,137	264.200	1,621,395.40	
REPUBLIC SERVICES INC	24,526	203.950	5,002,077.70	
RESMED INC	16,373	231.580	3,791,659.34	
REVVITY INC	13,759	110.540	1,520,919.86	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	83,845	13.060	1,095,015.70	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	59,571	36.940	2,200,552.74	
ROBLOX CORP -CLASS A	53,426	58.910	3,147,325.66	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,663	286.000	3,621,618.00	
ROKU INC	14,217	78.430	1,115,039.31	
ROLLINS INC	32,441	47.010	1,525,051.41	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,960	521.750	6,240,130.00	
ROSS STORES INC	37,016	147.790	5,470,594.64	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,276	230.760	6,294,209.76	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	42,519	24.280	1,032,361.32	
RPM INTERNATIONAL INC	14,355	125.400	1,800,117.00	
RTX CORPORATION	148,417	115.460	17,136,226.82	
S&P GLOBAL INC	35,726	486.560	17,382,842.56	
SALESFORCE INC	106,652	336.230	35,859,601.96	
SAMSARA INC-CL A	24,371	42.670	1,039,910.57	
SCHLUMBERGER LTD	158,432	36.910	5,847,725.12	
SEA LTD-ADR	41,293	111.640	4,609,950.52	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,471	87.540	2,054,651.34	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,285	81.470	1,000,858.95	
SEMPRA	70,633	85.900	6,067,374.70	
SERVICENOW INC	22,981	1,074.870	24,701,587.47	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26,733	342.380	9,152,844.54	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17,829	88.260	1,573,587.54	
SMITH (A.O.) CORP	13,398	68.440	916,959.12	
SMURFIT WESTROCK PLC	58,008	51.180	2,968,849.44	
SNAP INC - A	117,624	11.300	1,329,151.20	
SNAP-ON INC	5,877	337.670	1,984,486.59	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	33,665	164.210	5,528,129.65	
SOLVENTUM CORP	16,371	66.800	1,093,582.80	
SOUTHERN CO	122,094	81.780	9,984,847.32	
SOUTHWEST AIRLINES CO	16,777	32.780	549,950.06	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	17,089	454.160	7,761,140.24	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	24,607	74.270	1,827,561.89	
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,189	79.430	1,365,322.27	
STARBUCKS CORP	126,444	88.760	11,223,169.44	
STATE STREET CORP	32,803	95.420	3,130,062.26	
STEEL DYNAMICS INC	16,350	115.290	1,884,991.50	
STERIS PLC	11,006	204.340	2,248,966.04	
STRYKER CORP	38,261	357.140	13,664,533.54	

SUPER MICRO COMPUTER INC	58,799	31.240	1,836,880.76	
SYNCHRONY FINANCIAL	44,076	64.270	2,832,764.52	
SYNOPSYS INC	17,137	493.350	8,454,538.95	
SYSCO CORP	54,828	76.550	4,197,083.40	
T ROWE PRICE GROUP INC	24,846	112.970	2,806,852.62	
T-MOBILE US INC	58,718	218.000	12,800,524.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	19,559	181.380	3,547,611.42	
TARGA RESOURCES CORP	23,196	172.530	4,002,005.88	
TARGET CORP	51,398	130.430	6,703,841.14	
TE CONNECTIVITY PLC	33,899	143.890	4,877,727.11	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,222	464.950	2,427,968.90	
TELEFLEX INC	5,256	174.790	918,696.24	
TERADYNE INC	18,200	125.190	2,278,458.00	
TESLA, INC.	320,764	436.170	139,907,633.88	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	126,268	21.310	2,690,771.08	
TEXAS INSTRUMENTS INC	101,871	184.470	18,792,143.37	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,178	1,096.330	2,387,806.74	
TEXTRON INC	20,878	75.820	1,582,969.96	
THE CIGNA GROUP	31,188	274.800	8,570,462.40	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	42,618	516.690	22,020,294.42	
TJX COS INC	125,833	121.200	15,250,959.60	
TOAST INC-CLASS A	43,724	35.930	1,571,003.32	
TORO CO	11,466	81.090	929,777.94	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	12,037	264.030	3,178,129.11	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	50,087	126.230	6,322,482.01	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	12,970	130.330	1,690,380.10	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	25,173	376.900	9,487,703.70	
TRANSDIGM GROUP INC	6,261	1,260.120	7,889,611.32	
TRANSUNION	21,662	92.950	2,013,482.90	
TRAVELERS COS INC/THE	25,427	237.710	6,044,252.17	
TRIMBLE INC	27,238	70.740	1,926,816.12	
TRUIST FINANCIAL CORP	149,441	42.550	6,358,714.55	
TWILIO INC - A	17,026	106.030	1,805,266.78	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,760	593.600	2,825,536.00	
TYSON FOODS INC-CL A	31,906	58.200	1,856,929.20	
U-HAUL HOLDING CO	10,807	62.330	673,600.31	
UBER TECHNOLOGIES INC	210,943	60.210	12,700,878.03	
ULTA BEAUTY INC	5,257	425.520	2,236,958.64	
UNION PACIFIC CORP	67,966	223.150	15,166,612.90	
UNITED PARCEL SERVICE INC	81,740	122.650	10,025,411.00	
UNITED RENTALS INC	7,376	710.940	5,243,893.44	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,714	360.160	1,697,794.24	

UNITEDHEALTH GROUP INC	103,022	489.250	50,403,513.50	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,629	175.800	1,165,378.20	
US BANCORP	174,102	47.410	8,254,175.82	
VALERO ENERGY CORP	35,725	118.930	4,248,774.25	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17,163	219.670	3,770,196.21	
VERALTO CORP	27,559	101.330	2,792,553.47	
VERISIGN INC	9,800	193.440	1,895,712.00	
VERISK ANALYTICS INC	15,886	275.580	4,377,863.88	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	470,323	39.970	18,798,810.31	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,794	396.640	11,420,852.16	
VERTIV HOLDINGS CO	39,756	115.440	4,589,432.64	
VIATRIS INC	133,191	12.130	1,615,606.83	
VISA INC-CLASS A SHARES	186,365	314.880	58,682,611.20	
VISTRA CORP	38,321	137.200	5,257,641.20	
VULCAN MATERIALS CO	14,731	260.920	3,843,612.52	
WABTEC CORP	19,525	189.560	3,701,159.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	82,214	9.350	768,700.90	
WALMART INC	493,197	93.400	46,064,599.80	
WALT DISNEY CO	202,343	111.370	22,534,939.91	
WARNER BROS DISCOVERY INC	260,056	10.490	2,727,987.44	
WASTE CONNECTIONS INC	28,787	174.130	5,012,680.31	
WASTE MANAGEMENT INC	44,776	205.530	9,202,811.28	
WATERS CORP	6,623	360.630	2,388,452.49	
WATSCO INC	3,883	485.590	1,885,545.97	
WEC ENERGY GROUP INC	35,266	93.260	3,288,907.16	
WELLS FARGO & CO	379,723	68.850	26,143,928.55	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,096	327.010	2,647,472.96	
WESTERN DIGITAL CORP	38,540	59.620	2,297,754.80	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,301	113.310	487,346.31	
WEYERHAEUSER CO	81,173	27.210	2,208,717.33	
WILLIAMS COS INC	135,940	52.570	7,146,365.80	
WILLIAMS-SONOMA INC	14,094	179.590	2,531,141.46	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,330	311.000	3,523,630.00	
WIX.COM LTD	5,895	217.430	1,281,749.85	
WORKDAY INC-CLASS A	23,765	266.830	6,341,214.95	
WR BERKLEY CORP	33,957	58.030	1,970,524.71	
WW GRAINGER INC	4,902	1,081.550	5,301,758.10	
WYNN RESORTS LTD	11,142	88.310	983,950.02	
XCEL ENERGY INC	62,213	66.650	4,146,496.45	
XYLEM INC	27,109	116.430	3,156,300.87	
YUM! BRANDS INC	31,384	130.360	4,091,218.24	

	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,752	385.370	2,216,648.24	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	17,144	74.690	1,280,485.36	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,718	105.810	2,403,791.58	
	ZOETIS INC	50,548	163.520	8,265,608.96	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	27,786	84.050	2,335,413.30	
	ZSCALER INC	10,207	183.210	1,870,024.47	
アメリカ・ドル　小計		41,217,697		5,664,155,022.93 (894,653,285,873)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	108,464	35.580	3,859,149.12	
	ADMIRAL GROUP PLC	29,120	26.140	761,196.80	
	ANGLO AMERICAN PLC	141,725	23.380	3,313,530.50	
	ANTOFAGASTA PLC	43,886	15.860	696,031.96	
	ASHTEAD GROUP PLC	48,768	49.900	2,433,523.20	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	37,194	20.550	764,336.70	
	ASTRAZENECA PLC	172,963	102.440	17,718,329.72	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	99,735	7.926	790,499.61	
	AVIVA PLC	298,911	4.586	1,370,805.84	
	BAE SYSTEMS PLC	337,121	11.660	3,930,830.86	
	BARCLAYS PLC	1,620,222	2.602	4,215,817.64	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	153,876	4.300	661,666.80	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	11,385	39.180	446,064.30	
	BP PLC	1,804,508	3.790	6,839,085.32	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	222,387	28.940	6,435,879.78	
	BT GROUP PLC	727,889	1.464	1,065,629.49	
	BUNZL PLC	37,458	32.560	1,219,632.48	
	CANAL+ SADIR	80,291	1.962	157,530.94	
	CENTRICA PLC	573,884	1.259	722,519.95	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	24,175	26.920	650,791.00	
	COMPASS GROUP PLC	189,276	26.450	5,006,350.20	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	14,840	33.320	494,468.80	
	DCC PLC	11,035	51.900	572,716.50	
	DIAGEO PLC	248,247	25.255	6,269,477.98	
	ENDEAVOUR MINING PLC	20,354	14.210	289,230.34	
	ENTAIN PLC	67,834	7.136	484,063.42	
	EXPERIAN PLC	102,504	35.100	3,597,890.40	
	GLENCORE PLC	1,156,359	3.541	4,094,667.21	
	GSK PLC	462,434	13.220	6,113,377.48	
	HALEON PLC	858,090	3.806	3,265,890.54	
	HALMA PLC	42,318	27.330	1,156,550.94	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	39,673	10.945	434,220.98	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,534	19.350	358,632.90	

HSBC HOLDINGS PLC	2,031,015	7.651	15,539,295.76	
IMPERIAL BRANDS PLC	89,456	25.720	2,300,808.32	
INFORMA PLC	148,232	8.046	1,192,674.67	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	17,742	98.680	1,750,780.56	
INTERTEK GROUP PLC	17,999	46.820	842,713.18	
JD SPORTS FASHION PLC	288,971	0.971	280,590.84	
KINGFISHER PLC	203,428	2.495	507,552.86	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	659,874	2.236	1,475,478.26	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,840,965	0.543	3,714,643.99	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	53,337	114.500	6,107,086.50	
M&G PLC	252,787	1.937	489,648.41	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	228,178	3.782	862,969.19	
MELROSE INDUSTRIES PLC	143,840	5.484	788,818.56	
MONDI PLC/WI	49,286	11.455	564,571.13	
NATIONAL GRID PLC	545,092	9.216	5,023,567.87	
NATWEST GROUP PLC	787,159	4.000	3,148,636.00	
NEXT PLC	13,276	97.820	1,298,658.32	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
PEARSON PLC	66,809	12.655	845,467.89	
PERSIMMON PLC	35,719	12.070	431,128.33	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	78,979	5.010	395,684.79	
PRUDENTIAL PLC	300,677	6.298	1,893,663.74	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	77,132	48.200	3,717,762.40	
RELX PLC	207,778	36.540	7,592,208.12	
RENTOKIL INITIAL PLC	281,837	3.916	1,103,673.69	
RIO TINTO PLC	125,767	46.930	5,902,245.31	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	948,492	5.796	5,497,459.63	
SAGE GROUP PLC	112,063	13.055	1,462,982.46	
SAINSBURY (J) PLC	197,217	2.714	535,246.93	
SCHRODERS PLC	90,611	3.116	282,343.87	
SEVERN TRENT PLC	30,174	25.740	776,678.76	
SHELL PLC-NEW	691,993	24.055	16,645,891.61	
SMITH & NEPHEW PLC	97,598	9.772	953,727.65	
SMITHS GROUP PLC	38,445	17.310	665,482.95	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,250	69.550	573,787.50	
SSE PLC	123,014	15.980	1,965,763.72	
STANDARD CHARTERED PLC	234,205	9.836	2,303,640.38	
TAYLOR WIMPEY PLC	395,598	1.217	481,442.76	
TESCO PLC	763,577	3.685	2,813,781.24	
UNILEVER PLC	276,929	45.810	12,686,117.49	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	76,129	10.640	810,012.56	

	VODAFONE GROUP PLC	2,514,355	0.670	1,684,617.85	
	WHITBREAD PLC	20,016	28.970	579,863.52	
	WISE PLC - A	74,343	10.310	766,476.33	
	WPP PLC	120,276	8.414	1,012,002.26	
イギリス・ポンド　小計		30,168,838		210,458,042.61 (41,519,162,646)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	4,766	289.900	1,381,663.40	
	BANK HAPOALIM BM	140,995	42.530	5,996,517.35	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	168,107	42.500	7,144,547.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,978	950.000	2,829,100.00	
	ICL GROUP LTD	86,564	17.550	1,519,198.20	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	137,966	24.520	3,382,926.32	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,313	158.900	2,751,035.70	
	NICE LTD	7,014	645.000	4,524,030.00	
イスラエル・シュケル　小計		565,703		29,529,018.47 (1,277,068,038)	
オーストラリア・ドル	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	332,270	28.610	9,506,244.70	
	APA GROUP	145,457	7.050	1,025,471.85	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	63,159	68.350	4,316,917.65	
	ASX LTD	21,642	65.440	1,416,252.48	
	BHP GROUP LIMITED	566,004	39.680	22,459,038.72	
	BLUESCOPE STEEL LTD	48,860	19.830	968,893.80	
	BRAMBLES LTD	155,306	19.390	3,011,383.34	
	CARSALES.COM LTD	42,108	37.970	1,598,840.76	
	COCHLEAR LTD	7,302	291.110	2,125,685.22	
	COLES GROUP LTD	149,485	18.720	2,798,359.20	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	186,694	155.990	29,122,397.06	
	COMPUTERSHARE LIMITED	59,168	33.500	1,982,128.00	
	CSL LIMITED	54,022	278.790	15,060,793.38	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	170,334	4.200	715,402.80	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	188,992	17.850	3,373,507.20	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	264,326	8.480	2,241,484.48	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	47,896	51.030	2,444,132.88	
	LOTTERY CORP LTD/THE	248,040	4.950	1,227,798.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	40,383	224.010	9,046,195.83	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	307,846	3.780	1,163,657.88	
	MINERAL RESOURCES LTD	19,764	33.030	652,804.92	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	342,902	37.200	12,755,954.40	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	127,994	15.330	1,962,148.02	
	ORICA LTD	54,257	17.390	943,529.23	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	192,256	10.400	1,999,462.40	

	PRO MEDICUS LTD	6,401	250.230	1,601,722.23	
	QANTAS AIRWAYS LTD	85,081	8.900	757,220.90	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	167,959	19.320	3,244,967.88	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	20,584	34.780	715,911.52	
	REA GROUP LTD	5,887	237.430	1,397,750.41	
	REECE LTD	25,215	22.990	579,692.85	
	RIO TINTO LTD	41,379	117.400	4,857,894.60	
	SANTOS LTD	362,523	6.360	2,305,646.28	
	SEEK LTD	39,813	23.410	932,022.33	
	SGH LTD	22,679	45.300	1,027,358.70	
	SONIC HEALTHCARE LTD	50,959	27.500	1,401,372.50	
	SOUTH32 LTD	504,463	3.360	1,694,995.68	
	SUNCORP GROUP LTD	141,871	19.050	2,702,642.55	
	TELSTRA GROUP LTD	462,387	3.970	1,835,676.39	
	TRANSURBAN GROUP	346,917	13.450	4,666,033.65	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	90,607	11.560	1,047,416.92	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	26,632	34.540	919,869.28	
	WESFARMERS LIMITED	126,589	73.220	9,268,846.58	
	WESTPAC BANKING CORP	383,520	32.050	12,291,816.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	20,522	119.260	2,447,453.72	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	212,061	23.100	4,898,609.10	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	136,306	30.390	4,142,339.34	
	XERO LTD	16,179	166.270	2,690,082.33	
オーストラリア・ドル　小計		7,133,001		201,345,825.94 (19,804,375,439)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	56,016	111.340	6,236,821.44	
	AIR CANADA	19,743	21.720	428,817.96	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	84,743	79.540	6,740,458.22	
	ALTAGAS LTD	33,596	32.400	1,088,510.40	
	ARC RESOURCES LTD	66,446	24.210	1,608,657.66	
	BANK OF MONTREAL	81,524	139.130	11,342,434.12	
	BANK OF NOVA SCOTIA	138,329	76.900	10,637,500.10	
	BARRICK GOLD CORP	195,658	21.910	4,286,866.78	
	BCE INC	10,084	33.290	335,696.36	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	39,795	78.050	3,105,999.75	
	BROOKFIELD CORPORATION-A	152,607	79.880	12,190,247.16	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	15,179	39.820	604,427.78	
	CAE INC	35,735	32.860	1,174,252.10	
	CAMECO CORP	48,589	76.120	3,698,594.68	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	105,387	91.790	9,673,472.73	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	59,807	144.870	8,664,240.09	

CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	236,057	42.480	10,027,701.36	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	104,225	102.250	10,657,006.25	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,906	151.310	893,636.86	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	15,460	34.220	529,041.20	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	16,801	74.400	1,249,994.40	
CENOVUS ENERGY INC	153,592	20.660	3,173,210.72	
CGI INC	22,810	156.970	3,580,485.70	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,249	4,423.740	9,948,991.26	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	9,601	163.950	1,574,083.95	
DOLLARAMA INC	31,434	138.690	4,359,581.46	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	45,463	28.520	1,296,604.76	
EMERA INC	32,610	53.450	1,743,004.50	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,038	44.080	662,875.04	
ENBRIDGE INC	243,323	58.560	14,248,994.88	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,310	1,996.100	4,610,991.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	79,241	17.410	1,379,585.81	
FIRSTSERVICE CORP	4,570	262.190	1,198,208.30	
FORTIS INC	55,631	59.300	3,298,918.30	
FRANCO-NEVADA CORP	21,513	165.660	3,563,843.58	
GEORGE WESTON LTD	6,630	227.040	1,505,275.20	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	25,618	64.910	1,662,864.38	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,832	67.310	1,065,651.92	
GREAT-WEST LIFECO INC	31,518	46.720	1,472,520.96	
HYDRO ONE LTD	37,154	43.570	1,618,799.78	
IA FINANCIAL CORP INC	10,528	130.660	1,375,588.48	
IGM FINANCIAL INC	9,544	46.420	443,032.48	
IMPERIAL OIL LTD	20,505	90.000	1,845,450.00	
INTACT FINANCIAL CORP	19,980	259.710	5,189,005.80	
IVANHOE MINES LTD-CL A	83,062	16.850	1,399,594.70	
KEYERA CORP	25,823	42.640	1,101,092.72	
KINROSS GOLD CORP	137,026	13.060	1,789,559.56	
LOBLAW COS LTD	17,016	191.180	3,253,118.88	
LUNDIN MINING CORP	74,021	11.930	883,070.53	
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,624	59.410	1,819,371.84	
MANULIFE FINANCIAL CORP	196,483	43.330	8,513,608.39	
MEG ENERGY CORP	29,875	22.440	670,395.00	
METRO INC	23,800	91.650	2,181,270.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	38,090	131.290	5,000,836.10	
NUTRIEN LTD	55,394	63.380	3,510,871.72	
ONEX CORPORATION	7,048	111.280	784,301.44	

	OPEN TEXT CORP	29,779	39.440	1,174,483.76	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	40,439	29.450	1,190,928.55	
	PARKLAND CORP	15,837	33.040	523,254.48	
	PEMBINA PIPELINE CORP	65,043	51.900	3,375,731.70	
	POWER CORP OF CANADA	63,036	45.110	2,843,553.96	
	QUEBECOR INC -CL B	18,251	31.560	576,001.56	
	RB GLOBAL INC	20,598	130.720	2,692,570.56	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	34,446	94.290	3,247,913.34	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	40,731	43.730	1,781,166.63	
	ROYAL BANK OF CANADA	157,986	172.310	27,222,567.66	
	SAPUTO INC	28,834	25.200	726,616.80	
	SHOPIFY INC - CLASS A	135,284	154.090	20,845,911.56	
	STANTEC INC	12,821	114.880	1,472,876.48	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	64,689	84.500	5,466,220.50	
	SUNCOR ENERGY INC	141,001	49.810	7,023,259.81	
	TC ENERGY CORP	115,918	65.220	7,560,171.96	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	50,875	57.540	2,927,347.50	
	TFI INTERNATIONAL INC	8,986	204.510	1,837,726.86	
	THOMSON REUTERS CORP	17,630	234.180	4,128,593.40	
	TMX GROUP LTD	31,257	43.880	1,371,557.16	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,261	112.680	1,043,529.48	
	TORONTO-DOMINION BANK	195,213	74.200	14,484,804.60	
	TOURMALINE OIL CORP	39,476	60.710	2,396,587.96	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,149	121.850	749,255.65	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	50,638	81.880	4,146,239.44	
	WSP GLOBAL INC	14,606	247.430	3,613,962.58	
カナダ・ドル　小計		4,545,427		331,321,870.48 (36,286,371,255)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	261,700	2.560	669,952.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	222,220	43.400	9,644,348.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	676,300	0.750	507,225.00	
	KEPPEL CORP LTD	162,500	6.750	1,096,875.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	377,600	16.680	6,298,368.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	99,100	5.410	536,131.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	166,200	6.360	1,057,032.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	95,400	12.500	1,192,500.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	173,900	4.590	798,201.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	838,100	3.100	2,598,110.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	141,100	36.540	5,155,794.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	214,500	3.010	645,645.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	287,900	2.890	832,031.00	
シンガポール・ドル　小計		3,716,520		31,032,212.00	

				(3,600,357,236)	
スイス・フラン	ABB LTD	176,333	48.730	8,592,707.09	
	ADECCO GROUP AG-REG	18,899	21.560	407,462.44	
	ALCON INC	55,715	75.760	4,220,968.40	
	AVOLTA AG	10,180	36.240	368,923.20	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	3,770	61.150	230,535.50	
	BALOISE HOLDING AG	4,856	162.100	787,157.60	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,391	81.900	277,722.90	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	398	1,214.000	483,172.00	
	BKW AG	2,346	146.900	344,627.40	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	110	9,925.000	1,091,750.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	12	98,800.000	1,185,600.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	59,972	134.850	8,087,224.20	
	CLARIANT AG	24,078	9.870	237,649.86	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	783	607.500	475,672.50	
	GALDERMA GROUP AG	9,275	96.200	892,255.00	
	GEBERIT AG-REG	3,728	516.600	1,925,884.80	
	GIVAUDAN-REG	1,030	3,907.000	4,024,210.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	4,141	145.600	602,929.60	
	HOLCIM LTD	58,087	86.980	5,052,407.26	
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,986	57.440	1,320,315.84	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,394	202.300	1,091,206.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	16,957	73.020	1,238,200.14	
	LONZA GROUP AG	8,056	528.200	4,255,179.20	
	NESTLE SA	292,312	74.200	21,689,550.40	
	NOVARTIS AG	219,869	87.040	19,137,397.76	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,531	1,217.000	3,080,227.00	
	ROCHE HOLDING AG	78,367	246.700	19,333,138.90	
	ROCHE HOLDING AG-BR	3,582	261.000	934,902.00	
	SANDOZ GROUP AG	45,664	37.050	1,691,851.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,623	244.500	641,323.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,532	250.000	1,133,000.00	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	16,921	90.440	1,530,335.24	
	SIG GROUP AG	34,145	17.290	590,367.05	
	SIKA AG-BEARER	17,002	218.600	3,716,637.20	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,646	292.800	1,653,148.80	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,446	113.600	1,413,865.60	
	SWATCH GROUP AG	3,233	160.200	517,926.60	

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,201	689.400	2,206,769.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	8,627	96.150	829,486.05	
	SWISS RE AG	33,655	129.100	4,344,860.50	
	SWISSCOM AG	2,943	501.500	1,475,914.50	
	TEMENOS GROUP AG-REG	6,285	64.150	403,182.75	
	UBS GROUP AG	366,802	26.890	9,863,305.78	
	VAT GROUP AG	3,013	339.500	1,022,913.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,327	538.200	8,787,191.40	
スイス・フラン　小計		1,670,223		153,191,056.26 (26,926,391,959)	
スウェーデン・クローナ	ADDTECH AB-B SHARES	28,961	302.600	8,763,598.60	
	ALFA LAVAL AB	32,240	462.800	14,920,672.00	
	ASSA ABLOY AB	111,731	325.900	36,413,132.90	
	ATLAS COPCO AB	174,149	151.700	26,418,403.30	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	299,626	171.400	51,355,896.40	
	BEIJER REF AB	42,962	163.800	7,037,175.60	
	BIOVITRUM	21,821	305.800	6,672,861.80	
	BOLIDEN AB	30,453	304.700	9,279,029.10	
	EPIROC AB-A	73,483	196.150	14,413,690.45	
	EPIROC AB-B	43,538	175.000	7,619,150.00	
	EQT AB	41,526	297.300	12,345,679.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	67,988	295.600	20,097,252.80	
	EVOLUTION AB	18,926	911.200	17,245,371.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	73,791	74.840	5,522,518.44	
	GETINGE AB-B SHS	25,505	173.400	4,422,567.00	
	HENNES & MAURITZ AB	63,241	148.500	9,391,288.50	
	HEXAGON AB-B SHS	231,671	105.950	24,545,542.45	
	HOLMEN AB-B SHARES	8,472	396.800	3,361,689.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	14,236	347.000	4,939,892.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,903	346.800	5,861,960.40	
	INDUTRADE AB	30,438	276.000	8,400,888.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	16,476	271.000	4,464,996.00	
	INVESTOR AB	192,737	290.350	55,961,187.95	
	LIFCO AB-B SHS	25,951	316.200	8,205,706.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	8,391	496.400	4,165,292.40	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	169,260	42.090	7,124,153.40	
	SAAB AB-B	35,722	224.950	8,035,663.90	
	SAGAX AB-B	24,504	222.600	5,454,590.40	
	SANDVIK AB	118,916	200.000	23,783,200.00	
	SECURITAS AB	54,718	137.150	7,504,573.70	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	176,977	151.200	26,758,922.40	
	SKANSKA AB-B SHS	37,866	229.700	8,697,820.20	
	SKF AB	38,022	207.300	7,881,960.60	

	SVENSKA CELLULOSA AB	67,677	134.850	9,126,243.45	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	162,837	112.850	18,376,155.45	
	SWEDBANK AB - A SHARES	94,762	216.200	20,487,544.40	
	TELE2 AB	63,215	109.050	6,893,595.75	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	309,814	89.220	27,641,605.08	
	TELIA CO AB	271,652	30.260	8,220,189.52	
	TRELLEBORG AB-B SHS	23,732	381.400	9,051,384.80	
	VOLVO AB	176,898	269.900	47,744,770.20	
	VOLVO AB-A SHS	22,669	271.200	6,147,832.80	
スウェーデン・クローナ　小計		3,544,457		620,755,648.94 (8,889,220,893)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	502	11,500.000	5,773,000.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	333	11,080.000	3,689,640.00	
	CARLSBERG AS-B	10,653	691.400	7,365,484.20	
	COLOPLAST-B	14,078	790.400	11,127,251.20	
	DANSKE BANK A/S	76,984	201.000	15,473,784.00	
	DEMANT A/S	9,842	258.800	2,547,109.60	
	DSV A/S	22,794	1,496.000	34,099,824.00	
	GENMAB A/S	7,018	1,454.000	10,204,172.00	
	NOVO-NORDISK A/S	359,309	743.200	267,038,448.80	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	39,297	403.700	15,864,198.90	
	ORSTED A/S	18,739	332.100	6,223,221.90	
	PANDORA A/S	9,139	1,263.500	11,547,126.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,043	2,562.000	2,672,166.00	
	TRYGVESTA AS	37,932	150.100	5,693,593.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	112,756	96.780	10,912,525.68	
	ZEALAND PHARMA A/S	7,129	756.500	5,393,088.50	
デンマーク・クローネ　小計		727,548		415,624,634.48 (9,118,804,480)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	168,922	8.140	1,375,025.08	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	65,342	37.700	2,463,393.40	
	INFRATIL LTD	102,452	12.120	1,241,718.24	
	MERCURY NZ LTD	78,155	6.000	468,930.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	145,616	5.580	812,537.28	
ニュージーランド・ドル　小計		560,487		6,361,604.00 (564,719,587)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	35,326	215.700	7,619,818.20	
	DNB BANK ASA	99,779	225.800	22,530,098.20	
	EQUINOR ASA	93,435	255.100	23,835,268.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	22,225	200.200	4,449,445.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	9,797	1,293.000	12,667,521.00	
	MOWI ASA	51,743	196.000	10,141,628.00	
	NORSK HYDRO ASA	156,474	62.340	9,754,589.16	

	ORKLA ASA	77,627	98.150	7,619,090.05	
	SALMAR ASA	7,362	542.500	3,993,885.00	
	TELENOR ASA	70,594	125.400	8,852,487.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,362	301.500	5,536,143.00	
ノルウェー・クローネ　小計		642,724		116,999,973.71 (1,613,429,637)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	51,035	14.665	748,428.27	
	ACCIONA SA	2,757	107.900	297,480.30	
	ACCOR	21,669	46.350	1,004,358.15	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,616	47.360	929,013.76	
	ADIDAS AG	18,071	236.100	4,266,563.10	
	ADP	3,858	111.800	431,324.40	
	ADYEN NV	2,426	1,447.000	3,510,422.00	
	AEGON LTD	150,252	5.606	842,312.71	
	AENA SME SA	8,351	196.500	1,640,971.50	
	AGEAS	17,796	46.140	821,107.44	
	AIB GROUP PLC	207,851	5.230	1,087,060.73	
	AIR LIQUIDE	64,494	155.500	10,028,817.00	
	AIRBUS SE	66,287	156.520	10,375,241.24	
	AKZO NOBEL NV	19,052	56.160	1,069,960.32	
	ALLIANZ SE	43,691	296.900	12,971,857.90	
	ALSTOM RGPT	38,586	21.980	848,120.28	
	AMADEUS IT GROUP SA	50,209	66.920	3,359,986.28	
	AMPLIFON SPA	13,899	24.400	339,135.60	
	AMUNDI SA	6,840	63.550	434,682.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	100,184	48.390	4,847,903.76	
	ARCELORMITTAL	52,205	22.460	1,172,524.30	
	ARGENX SE	6,672	599.800	4,001,865.60	
	ARKEMA	6,271	70.600	442,732.60	
	ASM INTERNATIONAL NV	5,237	556.800	2,915,961.60	
	ASML HOLDING NV	44,579	690.800	30,795,173.20	
	ASR NEDERLAND NV	17,716	44.470	787,830.52	
	AXA SA	196,431	33.780	6,635,439.18	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	642,826	9.374	6,025,850.92	
	BANCO BPM SPA	143,876	7.686	1,105,830.93	
	BANCO DE SABADELL SA	606,535	1.867	1,132,400.84	
	BANCO SANTANDER SA	1,727,211	4.398	7,596,273.97	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	112,119	8.672	972,295.96	
	BASF SE	99,605	42.685	4,251,639.42	
	BAYER AG	109,581	18.870	2,067,793.47	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,337	77.280	2,499,003.36	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,264	71.200	445,996.80	

BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	8,603	127.100	1,093,441.30	
BECHTLE AG	9,156	30.360	277,976.16	
BEIERSDORF AG	11,051	122.900	1,358,167.90	
BIOMERIEUX	4,608	101.300	466,790.40	
BNP PARIBAS	113,541	57.810	6,563,805.21	
BOLLORE SE	79,043	5.750	454,497.25	
BOUYGUES	21,269	28.200	599,785.80	
BPER BANCA SPA	110,834	6.068	672,540.71	
BRENNTAG SE	14,517	57.260	831,243.42	
BUREAU VERITAS SA	35,412	29.380	1,040,404.56	
CAIXABANK	446,017	5.158	2,300,555.68	
CAPGEMINI SA	17,327	156.550	2,712,541.85	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,503	45.800	206,237.40	
CARREFOUR SA	60,495	13.550	819,707.25	
CELLNEX TELECOM SAU	59,617	29.640	1,767,047.88	
CIE DE SAINT-GOBAIN	50,550	85.400	4,316,970.00	
COMMERZBANK AG	105,660	15.570	1,645,126.20	
CONTINENTAL AG	12,267	64.200	787,541.40	
COVESTRO AG-TEND	20,007	57.500	1,150,402.50	
CREDIT AGRICOLE SA	118,757	13.070	1,552,153.99	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	6,957	82.600	574,648.20	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	23,675	21.340	505,224.50	
D'IETEREN GROUP	2,394	163.400	391,179.60	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	55,080	37.050	2,040,714.00	
DANONE	71,973	64.440	4,637,940.12	
DASSAULT AVIATION SA	2,192	192.600	422,179.20	
DASSAULT SYSTEMES SA	74,670	33.280	2,485,017.60	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	68,856	6.090	419,333.04	
DELIVERY HERO SE	20,834	27.570	574,393.38	
DEUTSCHE BANK AG	211,240	16.588	3,504,049.12	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,999	224.600	4,716,375.40	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	66,896	6.158	411,945.56	
DEUTSCHE TELEKOM AG	390,841	29.240	11,428,190.84	
DHL GROUP	113,789	33.520	3,814,207.28	
DIASORIN ITALIA SPA	2,491	99.440	247,705.04	
DR ING HC F PORSCHE AG	12,727	58.780	748,093.06	
DSM-FIRMENICH AG	20,764	98.100	2,036,948.40	
E.ON SE	250,306	11.130	2,785,905.78	
EDENRED	27,442	30.240	829,846.08	
EDP RENOVAVEIS SA	34,998	9.645	337,555.71	
EDP SA	350,597	3.119	1,093,512.04	
EIFFAGE	8,199	82.440	675,925.56	
ELIA GROUP SA/NV	3,277	73.000	239,221.00	
ELISA OYJ	16,403	41.460	680,068.38	
ENDESA SA	35,411	20.360	720,967.96	
ENEL SPA	907,046	6.801	6,168,819.84	
ENGIE	203,756	14.820	3,019,663.92	

ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	256,289	12.782	3,275,885.99	
ERSTE GROUP BANK AG	37,541	59.220	2,223,178.02	
ESSILORLUXOTTICA	33,158	231.900	7,689,340.20	
EURAZEO	4,638	69.350	321,645.30	
EUROFINS SCIENTIFIC	15,071	47.680	718,585.28	
EURONEXT NV	8,715	106.900	931,633.50	
EVONIK INDUSTRIES AG	28,719	16.390	470,704.41	
EXOR NV	10,992	88.350	971,143.20	
FERRARI NV	14,058	408.800	5,746,910.40	
FERROVIAL SE	53,018	40.100	2,126,021.80	
FINECOBANK SPA	68,163	16.775	1,143,434.32	
FORTUM OYJ	49,921	13.150	656,461.15	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	22,905	43.900	1,005,529.50	
FRESENIUS SE & CO KGAA	47,045	33.480	1,575,066.60	
GALP ENERGIA SGPS SA	51,731	16.650	861,321.15	
GEA GROUP AG	17,257	47.960	827,645.72	
GENERALI	104,952	27.080	2,842,100.16	
GETLINK SE - REGR	33,738	15.220	513,492.36	
GRIFOLS SA	33,242	9.500	315,799.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,277	64.350	596,974.95	
HANNOVER RUECK SE	6,721	246.800	1,658,742.80	
HAVAS BV	80,291	1.462	117,385.44	
HEIDELBERG MATERIALS AG	15,206	120.300	1,829,281.80	
HEINEKEN HOLDING NV	14,448	57.700	833,649.60	
HEINEKEN NV	32,123	69.160	2,221,626.68	
HENKEL AG & CO KGAA	11,613	73.700	855,878.10	
HENKEL KGAA-VORZUG	18,843	83.560	1,574,521.08	
HERMES INTERNATIONAL	3,533	2,295.000	8,108,235.00	
IBERDROLA SA	673,946	12.980	8,747,819.08	
IMCD NV	6,361	140.000	890,540.00	
INDITEX SA	121,627	49.410	6,009,590.07	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	145,676	31.880	4,644,150.88	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	40,086	9.575	383,823.45	
ING GROEP NV-CVA	368,487	14.928	5,500,773.93	
INPOST SA	25,048	16.290	408,031.92	
INTESA SANPAOLO	1,631,804	3.853	6,287,340.81	
IPSEN	4,184	107.900	451,453.60	
JDE PEET'S BV	13,670	16.520	225,828.40	
JERONIMO MARTINS	31,630	18.240	576,931.20	
KBC GROEP NV	25,603	73.740	1,887,965.22	
KERING	8,315	234.750	1,951,946.25	
KERRY GROUP PLC-A	17,067	92.050	1,571,017.35	
KESKO OYJ-B SHS	30,412	18.145	551,825.74	
KINGSPAN GROUP PLC	17,233	70.200	1,209,756.60	
KNORR-BREMSE AG	8,077	68.450	552,870.65	

KONE OYJ	37,888	46.950	1,778,841.60	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	103,606	31.440	3,257,372.64	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	89,110	24.150	2,152,006.50	
L'OREAL SA	26,792	339.350	9,091,865.20	
LA FRANCAISE DES JEUX SACA	11,391	37.080	422,378.28	
LEG IMMOBILIEN SE	8,311	79.320	659,228.52	
LEGRAND SA	29,237	93.640	2,737,752.68	
LEONARDO SPA	45,066	25.610	1,154,140.26	
LOTUS BAKERIES	45	10,660.000	479,700.00	
LOUIS HACHETTE GROUP	80,291	1.272	102,130.15	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	30,690	627.500	19,257,975.00	
MEDIOBANCA SPA	55,793	13.860	773,290.98	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	83,566	53.470	4,468,274.02	
MERCK KGAA	14,414	138.450	1,995,618.30	
METSO CORPORATION	69,323	8.906	617,390.63	
MICHELIN (C.G.D.E.)	74,513	31.880	2,375,474.44	
MONCLER SPA	26,078	50.020	1,304,421.56	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,000	323.300	1,939,800.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	14,916	502.000	7,487,832.00	
NEMETSCHEK SE	6,430	92.250	593,167.50	
NESTE OYJ	47,248	11.455	541,225.84	
NEXI SPA	57,613	5.372	309,497.03	
NN GROUP NV	30,192	41.480	1,252,364.16	
NOKIA OYJ	594,641	4.257	2,531,386.73	
NORDEA BANK ABP	351,961	10.465	3,683,271.86	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	7,599	68.500	520,531.50	
OMV AG	16,482	36.640	603,900.48	
ORANGE S.A.	212,376	9.472	2,011,625.47	
ORION OYJ-CLASS B	12,057	42.250	509,408.25	
PERNOD-RICARD	22,623	108.650	2,457,988.95	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	17,072	35.620	608,104.64	
POSTE ITALIANE SPA	50,921	13.575	691,252.57	
PROSUS	152,578	39.710	6,058,872.38	
PRYSMIAN SPA	31,291	61.100	1,911,880.10	
PUBLICIS GROUPE	25,512	103.550	2,641,767.60	
PUMA AG	11,788	45.130	531,992.44	
QIAGEN NV	24,705	42.885	1,059,473.92	
RANDSTAD NV	12,139	38.810	471,114.59	
RATIONAL AG	570	827.000	471,390.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	11,638	50.350	585,973.30	
REDEIA CORPORACION SA	45,523	16.380	745,666.74	

	RENAULT SA	21,425	46.280	991,549.00	
	REPSOL SA	131,106	11.020	1,444,788.12	
	REXEL SA	24,919	23.860	594,567.34	
	RHEINMETALL AG	4,859	620.200	3,013,551.80	
	ROYAL KPN NV	441,032	3.552	1,566,545.66	
	RWE AG	70,513	28.330	1,997,633.29	
	SAFRAN SA	40,501	211.200	8,553,811.20	
	SAMPO OYJ	55,131	38.810	2,139,634.11	
	SANOFI	127,401	91.500	11,657,191.50	
	SAP SE	116,482	237.050	27,612,058.10	
	SARTORIUS AG-VORZUG	2,925	216.000	631,800.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,260	185.000	603,100.00	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	60,993	240.650	14,677,965.45	
	SCOUT24 SE	8,340	84.050	700,977.00	
	SEB SA	2,768	86.950	240,677.60	
	SIEMENS AG	84,774	189.440	16,059,586.56	
	SIEMENS ENERGY AG	71,305	50.000	3,565,250.00	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	31,459	52.480	1,650,968.32	
	SNAM SPA	225,261	4.238	954,656.11	
	SOCIETE GENERALE	80,285	26.770	2,149,229.45	
	SODEXO	9,868	76.700	756,875.60	
	SOFINA	1,721	212.800	366,228.80	
	STELLANTIS NV	219,324	12.362	2,711,283.28	
	STMICROELECTRONICS NV	76,222	23.545	1,794,646.99	
	STORA ENSO OYJ	64,803	9.120	591,003.36	
	SYENSQO SA	8,253	70.620	582,826.86	
	SYMRISE AG	14,807	102.100	1,511,794.70	
	TALANX AG	7,184	80.900	581,185.60	
	TELECOM ITALIA SPA	1,139,036	0.251	285,898.03	
	TELEFONICA SA	450,563	3.956	1,782,427.22	
	TELEPERFORMANCE	6,098	81.360	496,133.28	
	TENARIS SA	45,289	18.005	815,428.44	
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	156,642	7.574	1,186,406.50	
	THALES SA	10,336	139.450	1,441,355.20	
	TOTALENERGIES SE	240,643	51.930	12,496,590.99	
	UCB SA	14,093	184.800	2,604,386.40	
	UNICREDIT SPA	164,277	37.595	6,175,993.81	
	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SP	43,650	11.780	514,197.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	91,867	24.230	2,225,937.41	
	UPM-KYMMENE OYJ	59,566	25.710	1,531,441.86	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	78,415	26.830	2,103,874.45	
	VINCI SA	55,822	98.480	5,497,350.56	
	VOLKSWAGEN AG	23,036	87.320	2,011,503.52	
	VONOVIA SE	82,643	28.800	2,380,118.40	
	WARTSILA OYJ	55,950	17.025	952,548.75	
	WOLTERS KLUWER NV	26,587	160.250	4,260,566.75	
	ZALANDO SE	25,026	33.300	833,365.80	

ユーロ　小計		20,602,319		564,838,044.52 (92,463,987,888)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,219,275	54.600	66,572,415.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	412,539	25.100	10,354,728.90	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	214,409	30.600	6,560,915.40	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	298,909	40.850	12,210,432.65	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	70,000	53.650	3,755,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	183,143	63.800	11,684,523.40	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	243,810	34.150	8,326,111.50	
	HANG SENG BANK LTD	84,012	92.000	7,729,104.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	162,641	23.300	3,789,535.30	
	HKT TRUST AND HKT LTD	437,000	9.520	4,160,240.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,249,437	6.100	7,621,565.70	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	134,311	298.800	40,132,126.80	
	MTR CORP	173,255	26.700	4,625,908.50	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	154,587	50.650	7,829,831.55	
	SANDS CHINA LTD	269,780	21.300	5,746,314.00	
	SINO LAND CO	436,000	7.590	3,309,240.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	150,000	20.000	3,000,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	161,523	72.300	11,678,112.90	
	SWIRE PACIFIC LTD	45,366	69.300	3,143,863.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	153,500	102.600	15,749,100.00	
	WH GROUP LTD	927,500	6.100	5,657,750.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	119,000	21.950	2,612,050.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	186,733	19.540	3,648,762.82	
香港・ドル　小計		7,486,730		249,898,132.22 (5,080,429,028)	
合計		122,581,674		1,141,797,603,959 (1,141,797,603,959)	

（２）株式以外の有価証券

2024年12月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,599.00	1,712,206.71	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	36,757.00	1,325,457.42	
		AMERICAN TOWER REIT INC	52,118.00	9,349,969.20	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	60,292.00	1,131,680.84	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,855.00	3,443,071.80	
	BOSTON PROPERTIES INC	16,726.00	1,226,517.58	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	11,893.00	1,338,200.36	
	CROWN CASTLE INC	48,513.00	4,401,584.49	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	36,524.00	6,457,808.44	
	EQUINIX INC	10,592.00	9,761,269.44	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,781.00	1,309,106.58	
	EQUITY RESIDENTIAL	38,063.00	2,644,997.87	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,160.00	1,997,711.60	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	23,653.00	3,367,004.55	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30,674.00	1,425,114.04	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	78,012.00	1,541,517.12	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	78,399.00	1,382,174.37	
	INVITATION HOMES INC	64,960.00	2,060,531.20	
	IRON MOUNTAIN INC	32,700.00	3,322,974.00	
	KIMCO REALTY CORP	75,205.00	1,730,467.05	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,043.00	1,949,015.49	
	PROLOGIS INC	103,316.00	10,476,242.40	
	PUBLIC STORAGE	17,573.00	5,084,396.09	
	REALTY INCOME CORP	97,276.00	5,035,005.76	
	REGENCY CENTERS CORP	19,224.00	1,392,202.08	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	11,991.00	2,377,095.84	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	36,366.00	6,155,309.16	
	SUN COMMUNITIES INC	13,924.00	1,669,348.36	
	UDR INC	34,983.00	1,483,978.86	
	VENTAS INC	46,218.00	2,668,165.14	
	VICI PROPERTIES INC	116,964.00	3,306,572.28	
	WELLTOWER INC	68,995.00	8,540,201.10	
	WP CAREY INC	24,490.00	1,308,745.60	
アメリカ・ドル　小計		1,359,839.00	112,375,642.82 (17,749,732,783)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	79,118.00	442,665.21	
	SEGRO PLC	143,377.00	977,831.14	
イギリス・ポンド　小計		222,495.00	1,420,496.35 (280,235,520)	
オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	191,799.00	6,904,764.00	
	GPT GROUP	213,545.00	956,681.60	
	MIRVAC GROUP	440,599.00	845,950.08	
	SCENTRE GROUP	578,996.00	1,985,956.28	
	STOCKLAND	265,529.00	1,290,470.94	
	VICINITY CENTRES	430,961.00	883,470.05	

	オーストラリア・ドル　小計		2,121,429.00	12,867,292.95 (1,265,626,935)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,366.00	395,057.88	
	カナダ・ドル　小計		9,366.00	395,057.88 (43,266,739)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	417,500.00	1,052,100.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	650,390.00	1,248,748.80	
	シンガポール・ドル　小計		1,067,890.00	2,300,848.80 (266,944,478)	
	ユーロ	COVIVIO	6,238.00	300,546.84	
		GECINA SA	5,142.00	455,324.10	
		KLEPIERRE	23,910.00	658,959.60	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,175.00	934,898.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	20,208.00	381,122.88	
	ユーロ　小計		68,673.00	2,730,851.42 (447,040,377)	
	香港・ドル	LINK REIT	287,871.00	9,355,807.50	
	香港・ドル　小計		287,871.00	9,355,807.50 (190,203,566)	
投資証券　合計			5,137,563	20,243,050,398 (20,243,050,398)	
合計				20,243,050,398 (20,243,050,398)	

（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	570銘柄	75.47	－	78.52
	投資証券	33銘柄	－	1.50	
イギリス・ポンド	株式	78銘柄	3.50	－	3.60
	投資証券	2銘柄	－	0.02	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.11	－	0.11
オーストラリア・ドル	株式	48銘柄	1.67	－	1.81
	投資証券	6銘柄	－	0.11	
カナダ・ドル	株式	82銘柄	3.06	－	3.13
	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	2.27	－	2.32
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	0.75	－	0.76
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.77	－	0.78
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
ユーロ	株式	216銘柄	7.80	－	8.00
	投資証券	5銘柄	－	0.04	
香港・ドル	株式	23銘柄	0.43	－	0.45
	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20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	8,112,688
コール・ローン	575,807,015
国債証券	51,503,494,200
地方債証券	3,120,405,432
特殊債券	4,540,079,090
社債券	4,233,437,300
未収利息	94,584,608
前払費用	4,078,628
流動資産合計	64,079,998,961
資産合計	64,079,998,961
負債の部	
流動負債	
未払解約金	60,398,907
流動負債合計	60,398,907
負債合計	60,398,907
純資産の部	
元本等	
元本	70,192,059,283
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△6,172,459,229
元本等合計	64,019,600,054
純資産合計	64,019,600,054
負債純資産合計	64,079,998,961

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2024年12月20日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	62,203,529,271円
	同期中追加設定元本額	16,546,152,488円
	同期中一部解約元本額	8,557,622,476円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイ国内債券パッシブＤＢ（適格機関投資家限定）	38,710,789,468円
	ＤＣニッセイ日本債券インデックス	5,954,898,246円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	485,069,323円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	10,862,536,397円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	900,438,315円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	4,646,530,919円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	1,194,360,359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）	456,841,283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）	45,219,505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）	191,283,205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）	104,917,189円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	295,249,180円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	345,937,738円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	1,163,695,255円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	4,686,584,506円
	ＦＷニッセイ国内債インデックス	39,277,376円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	105,970,495円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	2,460,524円
	計	70,192,059,283円
２．	受益権の総数	70,192,059,283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6,172,459,229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　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年12月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△1,238,881,200
地方債証券	△65,082,068
特殊債券	△69,066,316
社債券	△34,448,100
合計	△1,407,477,684

（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20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年12月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9121円 (9,121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20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	198,389,070	
	第４５７回　利付国債（２年）	206,000,000	205,283,120	
	第４５８回　利付国債（２年）	208,000,000	207,409,280	
	第４５９回　利付国債（２年）	210,000,000	209,296,500	
	第４６０回　利付国債（２年）	217,000,000	216,459,670	
	第４６１回　利付国債（２年）	233,000,000	232,650,500	
	第４６２回　利付国債（２年）	234,000,000	233,557,740	
	第４６３回　利付国債（２年）	235,000,000	234,475,950	
	第４６４回　利付国債（２年）	237,000,000	236,402,760	
	第４６５回　利付国債（２年）	232,000,000	231,366,640	
	第４６６回　利付国債（２年）	228,000,000	227,746,920	
	第１４７回　利付国債（５年）	486,000,000	483,302,700	
	第１４８回　利付国債（５年）	505,000,000	501,187,250	
	第１４９回　利付国債（５年）	415,000,000	411,128,050	
	第１５０回　利付国債（５年）	403,000,000	398,708,050	
	第１５１回　利付国債（５年）	269,000,000	265,785,450	
	第１５２回　利付国債（５年）	133,000,000	131,689,950	
	第１５３回　利付国債（５年）	469,000,000	462,659,120	
	第１５４回　利付国債（５年）	411,000,000	405,837,840	
	第１５５回　利付国債（５年）	186,000,000	184,495,260	
	第１５６回　利付国債（５年）	252,000,000	249,220,440	
	第１５７回　利付国債（５年）	116,000,000	114,561,600	
	第１５８回　利付国債（５年）	241,000,000	237,245,220	
	第１５９回　利付国債（５年）	120,000,000	117,927,600	
	第１６０回　利付国債（５年）	108,000,000	106,504,200	
	第１６１回　利付国債（５年）	121,000,000	119,758,540	
	第１６２回　利付国債（５年）	25,000,000	24,702,750	
	第１６３回　利付国債（５年）	282,000,000	279,679,140	
	第１６４回　利付国債（５年）	138,000,000	135,609,840	
	第１６５回　利付国債（５年）	134,000,000	132,200,380	
	第１６６回　利付国債（５年）	145,000,000	143,616,700	

第１６７回　利付国債（５年）	124,000,000	122,644,680	
第１６８回　利付国債（５年）	62,000,000	61,833,840	
第１６９回　利付国債（５年）	134,000,000	133,087,460	
第１７１回　利付国債（５年）	147,000,000	145,174,260	
第１７２回　利付国債（５年）	147,000,000	145,815,180	
第１７３回　利付国債（５年）	134,000,000	133,383,600	
第１７４回　利付国債（５年）	135,000,000	135,000,000	
第１回　利付国債（４０年）	81,000,000	87,177,060	
第２回　利付国債（４０年）	105,000,000	108,604,650	
第３回　利付国債（４０年）	97,000,000	99,585,050	
第４回　利付国債（４０年）	134,000,000	136,035,460	
第５回　利付国債（４０年）	128,000,000	123,850,240	
第６回　利付国債（４０年）	138,000,000	129,659,280	
第７回　利付国債（４０年）	143,000,000	127,331,490	
第８回　利付国債（４０年）	179,000,000	146,479,280	
第９回　利付国債（４０年）	203,000,000	119,134,610	
第１０回　利付国債（４０年）	182,000,000	125,317,920	
第１１回　利付国債（４０年）	153,000,000	100,146,150	
第１２回　利付国債（４０年）	106,000,000	60,677,580	
第１３回　利付国債（４０年）	170,000,000	94,763,100	
第１４回　利付国債（４０年）	231,000,000	136,151,400	
第１５回　利付国債（４０年）	258,000,000	167,093,700	
第１６回　利付国債（４０年）	288,000,000	203,523,840	
第１７回　利付国債（４０年）	167,000,000	153,280,950	
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	44,369,550	
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	41,981,940	
第３４２回　利付国債（１０年）	531,000,000	528,674,220	
第３４３回　利付国債（１０年）	541,000,000	537,678,260	
第３４４回　利付国債（１０年）	500,000,000	496,155,000	
第３４５回　利付国債（１０年）	499,000,000	494,623,770	
第３４６回　利付国債（１０年）	465,000,000	460,419,750	
第３４７回　利付国債（１０年）	440,000,000	435,080,800	
第３４８回　利付国債（１０年）	473,000,000	467,059,120	
第３４９回　利付国債（１０年）	299,000,000	294,819,980	
第３５０回　利付国債（１０年）	383,000,000	377,032,860	
第３５１回　利付国債（１０年）	352,000,000	345,920,960	
第３５２回　利付国債（１０年）	248,000,000	243,238,400	

第３５３回　利付国債（１０年）	318,000,000	311,255,220	
第３５４回　利付国債（１０年）	328,000,000	320,357,600	
第３５５回　利付国債（１０年）	252,000,000	245,629,440	
第３５６回　利付国債（１０年）	222,000,000	215,983,800	
第３５７回　利付国債（１０年）	284,000,000	275,712,880	
第３５８回　利付国債（１０年）	307,000,000	297,541,330	
第３５９回　利付国債（１０年）	290,000,000	280,575,000	
第３６０回　利付国債（１０年）	363,000,000	350,589,030	
第３６１回　利付国債（１０年）	373,000,000	359,508,590	
第３６２回　利付国債（１０年）	384,000,000	369,342,720	
第３６３回　利付国債（１０年）	384,000,000	368,436,480	
第３６４回　利付国債（１０年）	392,000,000	375,163,600	
第３６５回　利付国債（１０年）	398,000,000	379,803,440	
第３６６回　利付国債（１０年）	426,000,000	408,231,540	
第３６７回　利付国債（１０年）	136,000,000	129,911,280	
第３６８回　利付国債（１０年）	413,000,000	393,353,590	
第３６９回　利付国債（１０年）	475,000,000	462,037,250	
第３７０回　利付国債（１０年）	478,000,000	463,865,540	
第３７１回　利付国債（１０年）	509,000,000	488,344,780	
第３７２回　利付国債（１０年）	473,000,000	468,213,240	
第３７３回　利付国債（１０年）	474,000,000	459,874,800	
第３７４回　利付国債（１０年）	457,000,000	449,838,810	
第３７５回　利付国債（１０年）	369,000,000	371,874,510	
第４回　利付国債（３０年）	19,000,000	21,402,360	
第５回　利付国債（３０年）	13,000,000	14,191,060	
第６回　利付国債（３０年）	31,000,000	34,405,040	
第７回　利付国債（３０年）	40,000,000	44,272,000	
第８回　利付国債（３０年）	57,000,000	61,151,880	

第９回　利付国債（３０年）	57,000,000	59,412,240	
第１０回　利付国債（３０年）	69,000,000	70,246,830	
第１１回　利付国債（３０年）	83,000,000	88,446,460	
第１２回　利付国債（３０年）	92,000,000	101,110,760	
第１３回　利付国債（３０年）	89,000,000	97,062,510	
第１４回　利付国債（３０年）	103,000,000	115,929,590	
第１５回　利付国債（３０年）	138,000,000	156,483,720	
第１６回　利付国債（３０年）	116,000,000	131,621,720	
第１７回　利付国債（３０年）	107,000,000	120,498,050	
第１８回　利付国債（３０年）	116,000,000	129,583,600	
第１９回　利付国債（３０年）	99,000,000	110,588,940	
第２０回　利付国債（３０年）	105,000,000	119,409,150	
第２１回　利付国債（３０年）	41,000,000	45,779,370	
第２２回　利付国債（３０年）	54,000,000	61,438,500	
第２３回　利付国債（３０年）	57,000,000	64,875,690	
第２４回　利付国債（３０年）	27,000,000	30,723,030	
第２５回　利付国債（３０年）	34,000,000	37,940,600	
第２６回　利付国債（３０年）	91,000,000	102,543,350	
第２７回　利付国債（３０年）	123,000,000	139,898,970	
第２８回　利付国債（３０年）	155,000,000	176,106,350	
第２９回　利付国債（３０年）	174,000,000	195,403,740	
第３０回　利付国債（３０年）	189,000,000	209,317,500	
第３１回　利付国債（３０年）	187,000,000	204,033,830	
第３２回　利付国債（３０年）	217,000,000	239,123,150	
第３３回　利付国債（３０年）	243,000,000	256,836,420	
第３４回　利付国債（３０年）	217,000,000	234,687,670	
第３５回　利付国債（３０年）	244,000,000	256,209,760	
第３６回　利付国債（３０年）	244,000,000	255,289,880	
第３７回　利付国債（３０年）	256,000,000	262,978,560	
第３８回　利付国債（３０年）	173,000,000	174,435,900	
第３９回　利付国債（３０年）	164,000,000	167,552,240	
第４０回　利付国債（３０年）	139,000,000	139,487,890	
第４１回　利付国債（３０年）	126,000,000	124,215,840	
第４２回　利付国債（３０年）	138,000,000	135,640,200	
第４３回　利付国債（３０年）	141,000,000	138,266,010	
第４４回　利付国債（３０年）	150,000,000	146,640,000	
第４５回　利付国債（３０年）	162,000,000	152,500,320	
第４６回　利付国債（３０年）	194,000,000	182,123,320	
第４７回　利付国債（３０年）	181,000,000	172,482,140	
第４８回　利付国債（３０年）	185,000,000	169,471,100	
第４９回　利付国債（３０年）	186,000,000	169,875,660	
第５０回　利付国債（３０年）	187,000,000	150,740,700	
第５１回　利付国債（３０年）	197,000,000	140,841,210	
第５２回　利付国債（３０年）	196,000,000	146,241,480	
第５３回　利付国債（３０年）	184,000,000	139,847,360	
第５４回　利付国債（３０年）	189,000,000	149,822,190	
第５５回　利付国債（３０年）	176,000,000	138,925,600	
第５６回　利付国債（３０年）	180,000,000	141,478,200	
第５７回　利付国債（３０年）	182,000,000	142,442,300	
第５８回　利付国債（３０年）	226,000,000	176,126,320	

第５９回　利付国債（３０年）	171,000,000	129,470,940	
第６０回　利付国債（３０年）	155,000,000	122,711,950	
第６１回　利付国債（３０年）	150,000,000	112,633,500	
第６２回　利付国債（３０年）	148,000,000	104,988,240	
第６３回　利付国債（３０年）	160,000,000	109,793,600	
第６４回　利付国債（３０年）	169,000,000	115,274,900	
第６５回　利付国債（３０年）	160,000,000	108,484,800	
第６６回　利付国債（３０年）	150,000,000	101,020,500	
第６７回　利付国債（３０年）	188,000,000	133,111,520	
第６８回　利付国債（３０年）	190,000,000	133,666,900	
第６９回　利付国債（３０年）	187,000,000	134,499,750	
第７０回　利付国債（３０年）	180,000,000	128,662,200	
第７１回　利付国債（３０年）	183,000,000	130,089,210	
第７２回　利付国債（３０年）	186,000,000	131,496,420	
第７３回　利付国債（３０年）	187,000,000	131,689,140	
第７４回　利付国債（３０年）	183,000,000	139,535,670	
第７５回　利付国債（３０年）	189,000,000	155,206,800	
第７６回　利付国債（３０年）	180,000,000	151,027,200	
第７７回　利付国債（３０年）	174,000,000	152,867,700	
第７８回　利付国債（３０年）	180,000,000	150,208,200	
第７９回　利付国債（３０年）	183,000,000	144,617,580	
第８０回　利付国債（３０年）	170,000,000	155,560,200	
第８１回　利付国債（３０年）	184,000,000	160,203,280	
第８２回　利付国債（３０年）	183,000,000	166,857,570	
第８３回　利付国債（３０年）	175,000,000	174,375,250	
第８４回　利付国債（３０年）	114,000,000	110,952,780	
第８５回　利付国債（２０年）	118,000,000	120,396,580	
第８６回　利付国債（２０年）	126,000,000	128,870,280	
第８７回　利付国債（２０年）	106,000,000	108,284,300	
第８８回　利付国債（２０年）	165,000,000	169,367,550	
第８９回　利付国債（２０年）	112,000,000	114,798,880	
第９０回　利付国債（２０年）	180,000,000	185,157,000	
第９１回　利付国債（２０年）	119,000,000	122,615,220	
第９２回　利付国債（２０年）	157,000,000	161,841,880	
第９３回　利付国債（２０年）	61,000,000	62,976,400	
第９４回　利付国債（２０年）	100,000,000	103,461,000	
第９５回　利付国債（２０年）	112,000,000	116,829,440	
第９６回　利付国債（２０年）	42,000,000	43,604,400	
第９７回　利付国債（２０年）	80,000,000	83,565,600	
第９８回　利付国債（２０年）	48,000,000	50,009,760	
第９９回　利付国債（２０年）	207,000,000	216,379,170	
第１００回　利付国債（２０年）	148,000,000	155,645,680	
第１０１回　利付国債（２０年）	92,000,000	97,336,920	
第１０２回　利付国債（２０年）	107,000,000	113,642,560	
第１０３回　利付国債（２０年）	98,000,000	103,748,680	

第１０４回　利付国債（２０年）	35,000,000	36,813,700	
第１０５回　利付国債（２０年）	110,000,000	116,018,100	
第１０６回　利付国債（２０年）	89,000,000	94,194,930	
第１０７回　利付国債（２０年）	86,000,000	90,939,840	
第１０８回　利付国債（２０年）	135,000,000	141,702,750	
第１０９回　利付国債（２０年）	93,000,000	97,794,150	
第１１０回　利付国債（２０年）	126,000,000	133,562,520	
第１１１回　利付国債（２０年）	130,000,000	138,699,600	
第１１２回　利付国債（２０年）	156,000,000	165,759,360	
第１１３回　利付国債（２０年）	269,000,000	286,678,680	
第１１４回　利付国債（２０年）	125,000,000	133,601,250	
第１１５回　利付国債（２０年）	83,000,000	89,112,120	
第１１６回　利付国債（２０年）	51,000,000	54,920,880	
第１１７回　利付国債（２０年）	111,000,000	118,972,020	
第１１８回　利付国債（２０年）	28,000,000	29,948,240	
第１１９回　利付国債（２０年）	15,000,000	15,884,850	
第１２０回　利付国債（２０年）	34,000,000	35,636,420	
第１２１回　利付国債（２０年）	81,000,000	86,413,230	
第１２２回　利付国債（２０年）	39,000,000	41,391,090	
第１２３回　利付国債（２０年）	203,000,000	219,404,430	
第１２４回　利付国債（２０年）	102,000,000	109,656,120	
第１２５回　利付国債（２０年）	159,000,000	173,255,940	
第１２６回　利付国債（２０年）	101,000,000	108,815,380	
第１２７回　利付国債（２０年）	82,000,000	87,854,800	
第１２８回　利付国債（２０年）	219,000,000	235,022,040	

第１２９回　利付国債（２０年）	86,000,000	91,758,560	
第１３０回　利付国債（２０年）	127,000,000	135,732,520	
第１３１回　利付国債（２０年）	63,000,000	66,905,370	
第１３２回　利付国債（２０年）	88,000,000	93,553,680	
第１３３回　利付国債（２０年）	143,000,000	152,974,250	
第１３４回　利付国債（２０年）	98,000,000	104,919,780	
第１３５回　利付国債（２０年）	58,000,000	61,698,080	
第１３６回　利付国債（２０年）	60,000,000	63,392,400	
第１３７回　利付国債（２０年）	69,000,000	73,413,930	
第１３８回　利付国債（２０年）	75,000,000	78,709,500	
第１３９回　利付国債（２０年）	83,000,000	87,722,700	
第１４０回　利付国債（２０年）	225,000,000	239,589,000	
第１４１回　利付国債（２０年）	206,000,000	219,431,200	
第１４２回　利付国債（２０年）	148,000,000	158,818,800	
第１４３回　利付国債（２０年）	206,000,000	217,894,440	
第１４４回　利付国債（２０年）	153,000,000	160,594,920	
第１４５回　利付国債（２０年）	277,000,000	295,176,740	
第１４６回　利付国債（２０年）	277,000,000	295,077,020	
第１４７回　利付国債（２０年）	292,000,000	308,489,240	
第１４８回　利付国債（２０年）	260,000,000	272,027,600	
第１４９回　利付国債（２０年）	272,000,000	283,910,880	
第１５０回　利付国債（２０年）	289,000,000	298,597,690	
第１５１回　利付国債（２０年）	285,000,000	288,602,400	
第１５２回　利付国債（２０年）	265,000,000	267,806,350	
第１５３回　利付国債（２０年）	270,000,000	274,949,100	

第１５４回　利付国債（２０年）	285,000,000	286,772,700	
第１５５回　利付国債（２０年）	229,000,000	225,097,840	
第１５６回　利付国債（２０年）	164,000,000	150,410,960	
第１５７回　利付国債（２０年）	190,000,000	169,443,900	
第１５８回　利付国債（２０年）	235,000,000	216,176,500	
第１５９回　利付国債（２０年）	184,000,000	170,547,760	
第１６０回　利付国債（２０年）	172,000,000	160,763,240	
第１６１回　利付国債（２０年）	174,000,000	159,965,160	
第１６２回　利付国債（２０年）	214,000,000	195,803,580	
第１６３回　利付国債（２０年）	237,000,000	215,918,850	
第１６４回　利付国債（２０年）	297,000,000	265,809,060	
第１６５回　利付国債（２０年）	231,000,000	205,656,990	
第１６６回　利付国債（２０年）	235,000,000	214,066,200	
第１６７回　利付国債（２０年）	258,000,000	227,372,820	
第１６８回　利付国債（２０年）	240,000,000	207,321,600	
第１６９回　利付国債（２０年）	250,000,000	211,520,000	
第１７０回　利付国債（２０年）	226,000,000	190,045,660	
第１７１回　利付国債（２０年）	223,000,000	186,479,290	
第１７２回　利付国債（２０年）	200,000,000	168,940,000	
第１７３回　利付国債（２０年）	269,000,000	225,844,330	
第１７４回　利付国債（２０年）	259,000,000	216,244,280	
第１７５回　利付国債（２０年）	245,000,000	206,863,300	
第１７６回　利付国債（２０年）	240,000,000	201,554,400	
第１７７回　利付国債（２０年）	253,000,000	207,695,290	
第１７８回　利付国債（２０年）	248,000,000	206,122,720	

	第１７９回　利付国債（２０年）	266,000,000	219,859,640	
	第１８０回　利付国債（２０年）	245,000,000	212,486,050	
	第１８１回　利付国債（２０年）	253,000,000	222,265,560	
	第１８２回　利付国債（２０年）	236,000,000	213,639,000	
	第１８３回　利付国債（２０年）	243,000,000	230,415,030	
	第１８４回　利付国債（２０年）	242,000,000	217,543,480	
	第１８５回　利付国債（２０年）	243,000,000	217,589,490	
	第１８６回　利付国債（２０年）	246,000,000	235,161,240	
	第１８７回　利付国債（２０年）	189,000,000	174,144,600	
	第１８８回　利付国債（２０年）	188,000,000	181,717,040	
	第１８９回　利付国債（２０年）	187,000,000	189,423,520	
	第１９０回　利付国債（２０年）	121,000,000	120,211,080	
国債証券　合計		54,021,000,000	51,503,494,200	
地方債証券	第７６４回　東京都公募公債	100,000,000	99,160,400	
	第１４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	105,206,700	
	第３４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	91,599,200	
	第１８回　宮城県１号公募公債（５年）	100,000,000	98,493,700	
	第３０回　神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	99,137,700	
	第４４８回　大阪府公募公債	38,000,000	36,615,432	
	第４５５回　大阪府公募公債	180,000,000	173,454,300	
	第７回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	106,471,300	
	第１１回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	105,572,100	
	第１２回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	102,841,200	
	平成２９年度第５回　京都府公募公債（２０年）	100,000,000	90,730,800	
	第１５回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	105,204,500	
	第２１回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	103,919,200	
	平成２６年度第１１回　愛知県公募公債（１５年）	100,000,000	100,836,900	

	令和４年度第３回　愛知県公募公債	200,000,000	191,218,400	
	平成２０年度第１回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	105,597,500	
	平成２４年度第２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	105,180,700	
	令和４年度第１回　千葉県公募公債	300,000,000	286,888,800	
	第２２回　大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	89,677,700	
	第１回　名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	112,877,300	
	第２５回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	105,788,800	
	第２６回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	106,350,300	
	第３１回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	99,779,400	
	第９回　川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	107,085,500	
	第４回　川崎市公募公債（３０年）	100,000,000	104,818,800	
	平成３０年度第５回　広島市公募公債	200,000,000	195,652,000	
	平成２９年度第１回　仙台市公募公債	100,000,000	90,246,800	
地方債証券　合計		3,118,000,000	3,120,405,432	
特殊債券	第９回　新関西国際空港	300,000,000	304,551,000	
	第１６回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,781,000	
	第１７４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,317,500	
	第２０５回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,172,200	
	第２１２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,795,700	
	第２３３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,617,600	
	第２７８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	88,714,700	
	第２９３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	89,599,100	
	第３１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,535,000	
	第３１９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	91,058,600	
	第１７回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	212,266,200	
	第３６回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	103,451,900	

	第１回　地方公共団体金融機構債券（３０年）	100,000,000	97,339,000	
	第１１６回　政保地方公共団体金融機構債券	138,000,000	134,412,690	
	第１２０回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,645,200	
	第１３６回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	191,707,000	
	第７２回　日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,130,000	
	第９７回　都市再生債券	100,000,000	100,785,500	
	第３３回　政保中部国際空港債券	100,000,000	98,646,000	
	第５９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	212,095,400	
	第１４３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,498,100	
	第１８３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,341,300	
	第３７回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,328,000	16,749,262	
	第４２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,782,000	42,534,076	
	第４６回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,574,000	48,844,225	
	第５４回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,026,000	40,742,465	
	第５５回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,844,000	45,525,628	
	第６０回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,250,000	46,828,124	
	第６１回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,396,000	23,608,903	
	第６２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	212,968,000	214,011,543	
	第６３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	129,645,000	129,709,822	
	第７３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,048,000	93,717,945	
	第７８回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,598,000	80,630,239	
	第１０９回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,685,000	168,993,742	
	第１７５回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,624,000	158,188,826	
	い第８５４号　利付商工債券	200,000,000	198,084,600	
	い第８６２号　利付商工債券	100,000,000	98,797,500	
	第３９４回　利付信金中金債券	100,000,000	98,486,800	
	第４０２回　利付信金中金債券	200,000,000	197,070,600	
	第６６回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,094,100	

特殊債券　合計		4,567,768,000	4,540,079,090	
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	96,342,900	
	第３８回　成田国際空港	200,000,000	191,593,000	
	第８回　ビー・エヌ・ピー・パリバ	100,000,000	99,221,900	
	第６９回　西日本高速道路	100,000,000	98,734,400	
	第１３回　日本たばこ産業	100,000,000	98,113,500	
	第８回　クラレ	100,000,000	97,940,200	
	第１２回　旭化成	300,000,000	289,125,900	
	第５回　電通グループ	400,000,000	394,929,200	
	第２回　アステラス製薬	100,000,000	98,638,800	
	第１１回　ブリヂストン	100,000,000	98,790,700	
	第１９回　豊田通商	100,000,000	100,212,900	
	第２４回　りそなホールディングス	300,000,000	296,394,900	
	第２回　みずほリース	300,000,000	289,155,900	
	第１８回　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	96,282,800	
	第７８回　トヨタファイナンス	100,000,000	98,578,900	
	第５５回　日立キャピタル	100,000,000	100,236,000	
	第１７回　三井住友ファイナンス＆リース	100,000,000	98,619,500	
	第２回　三菱ＨＣキャピタル	100,000,000	98,567,500	
	第１３２回　三菱地所	100,000,000	96,851,300	
	第７回　野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	211,472,600	
	第１１回　ジャパンエクセレント投資法人	100,000,000	99,050,300	
	第１０６回　東日本旅客鉄道	100,000,000	96,708,900	
	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	208,150,800	
	第８回　東京地下鉄	100,000,000	104,417,700	
	第５１０回　関西電力	100,000,000	99,139,200	
	第５１８回　関西電力	100,000,000	98,536,600	
	第４９４回　東北電力	100,000,000	99,033,500	
	第４５１回　九州電力	100,000,000	99,124,100	
	第４７回　大阪瓦斯（トランジションボンド）	100,000,000	95,886,000	
	第８回　ファーストリテイリング	100,000,000	88,803,700	
社債券　合計		4,300,000,000	4,233,437,300	
合計			63,397,416,022	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年12月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	263,267,204
金銭信託	4,287,208
コール・ローン	304,289,351
国債証券	94,444,925,629
派生商品評価勘定	1,347,342
未収入金	9,554,318
未収利息	645,206,406
前払費用	73,879,115
流動資産合計	95,746,756,573
資産合計	95,746,756,573
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	100,654
未払金	112,788,149
未払解約金	277,097,441
流動負債合計	389,986,244
負債合計	389,986,244
純資産の部	
元本等	
元本	52,655,680,982
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	42,701,089,347
元本等合計	95,356,770,329
純資産合計	95,356,770,329
負債純資産合計	95,746,756,573

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2024年12月20日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	47,394,391,763円
	同期中追加設定元本額	12,371,268,916円
	同期中一部解約元本額	7,109,979,697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）	3,814,891,226円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,157,695,457円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,250,630,262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）	954,878,159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）	1,778,316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）	1,867,490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）	4,303,843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	16,342,410,114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）	9,848,134,570円
	ＤＣニッセイ外国債券インデックス	5,364,800,410円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	440,561,404円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	2,337,989,282円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	510,482,378円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	686,581,653円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	47,347,452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）	237,397,548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）	23,534,326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）	54,584,389円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	365,950,178円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	248,148,970円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	444,348,360円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	240,334,961円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス	88,792,853円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	183,913,697円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	4,266,124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）	57,560円
	計	52,655,680,982円
２．	受益権の総数	52,655,680,982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　2024年4月30日 至　2024年12月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年12月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年12月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△242,872,135
合計	△242,872,135

（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20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年12月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	28,463,979	－	28,564,633	△100,654
アメリカ・ドル	3,411,980	－	3,473,518	△61,538
イスラエル・シュケル	480,480	－	484,283	△3,803
オフショア・人民元	12,951,600	－	12,952,620	△1,020
マレーシア・リンギット	2,042,623	－	2,076,295	△33,672
ユーロ	9,577,296	－	9,577,917	△621
買建	34,528,226	－	35,875,568	1,347,342
アメリカ・ドル	34,528,226	－	35,875,568	1,347,342
合計	62,992,205	－	64,440,201	1,246,688

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年12月20日現在
1口当たり純資産額	1.8109円
（1万口当たり純資産額）	(18,109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20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	125,887.20	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	123,595.20	
		US TREASURY BONDS	180,000.00	188,760.60	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	102,050.00	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,137,551.00	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,065,844.00	
		US TREASURY N/B	520,000.00	389,568.40	
		US TREASURY N/B	900,000.00	796,077.00	
		US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,093,769.60	
		US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,083,218.40	
		US TREASURY N/B	900,000.00	794,178.00	
		US TREASURY N/B	180,000.00	179,942.40	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,397,628.80	
		US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,320,927.30	
		US TREASURY N/B	690,000.00	523,723.80	
		US TREASURY N/B	960,000.00	905,587.20	
		US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,607,921.80	
		US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,526,817.60	
		US TREASURY N/B	980,000.00	970,729.20	
		US TREASURY N/B	500,000.00	424,585.00	
		US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,643,003.60	
		US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,462,545.60	
		US TREASURY N/B	980,000.00	937,732.60	
		US TREASURY N/B	510,000.00	440,232.00	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,757,552.00	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,567,248.00	
		US TREASURY N/B	980,000.00	952,432.60	
		US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,629,685.40	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,473,488.00	
		US TREASURY N/B	970,000.00	879,508.70	
		US TREASURY N/B	670,000.00	521,782.60	
		US TREASURY N/B	970,000.00	945,294.10	
		US TREASURY N/B	580,000.00	557,704.80	
		US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,111,054.40	
		US TREASURY N/B	450,000.00	356,287.50	
		US TREASURY N/B	530,000.00	448,300.50	
		US TREASURY N/B	490,000.00	398,066.20	
		US TREASURY N/B	560,000.00	426,210.40	
		US TREASURY N/B	770,000.00	535,596.60	
		US TREASURY N/B	340,000.00	257,628.20	
		US TREASURY N/B	480,000.00	355,104.00	
		US TREASURY N/B	300,000.00	226,182.00	
		US TREASURY N/B	23,090,000.00	22,393,605.60	
		US TREASURY N/B	600,000.00	411,654.00	
		US TREASURY N/B	12,620,000.00	12,159,496.20	
		US TREASURY N/B	600,000.00	410,226.00	

		US TREASURY N/B	15,070,000.00	14,395,918.90	
		US TREASURY N/B	790,000.00	512,228.10	
		US TREASURY N/B	10,840,000.00	10,382,660.40	
		US TREASURY N/B	340,000.00	248,053.80	
		US TREASURY N/B	9,200,000.00	8,809,644.00	
		US TREASURY N/B	670,000.00	498,754.70	
		US TREASURY N/B	8,580,000.00	8,198,533.20	
		US TREASURY N/B	520,000.00	386,037.60	
		US TREASURY N/B	7,810,000.00	7,405,754.40	
		US TREASURY N/B	760,000.00	537,069.20	
		US TREASURY N/B	7,020,000.00	6,619,860.00	
		US TREASURY N/B	150,000.00	146,091.00	
		US TREASURY N/B	740,000.00	521,781.40	
		US TREASURY N/B	5,930,000.00	5,648,502.90	
		US TREASURY N/B	190,000.00	187,112.00	
		US TREASURY N/B	860,000.00	634,379.00	
		US TREASURY N/B	6,310,000.00	6,011,978.70	
		US TREASURY N/B	930,000.00	700,727.10	
		US TREASURY N/B	190,000.00	166,694.60	
		US TREASURY N/B	270,000.00	256,699.80	
		US TREASURY N/B	7,100,000.00	6,737,474.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	734,800.00	
		US TREASURY N/B	280,000.00	273,075.60	
		US TREASURY N/B	5,430,000.00	5,182,229.10	
		US TREASURY N/B	1,020,000.00	801,567.00	
		US TREASURY N/B	300,000.00	288,255.00	
		US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,386,495.30	
		US TREASURY N/B	9,370,000.00	8,737,150.20	
		US TREASURY N/B	1,110,000.00	812,897.40	
		US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,513,874.60	
		US TREASURY N/B	9,120,000.00	8,383,924.80	
		US TREASURY N/B	320,000.00	315,523.20	
		US TREASURY N/B	1,080,000.00	770,547.60	
		US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,140,457.40	
		US TREASURY N/B	8,720,000.00	7,711,357.60	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	623,200.00	
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,078,347.70	
		US TREASURY N/B	6,480,000.00	5,730,717.60	
		US TREASURY N/B	290,000.00	261,600.30	
		US TREASURY N/B	940,000.00	601,487.20	
		US TREASURY N/B	3,890,000.00	3,366,950.60	
		US TREASURY N/B	300,000.00	282,630.00	
		US TREASURY N/B	1,190,000.00	695,674.00	
		US TREASURY N/B	160,000.00	166,024.00	
		US TREASURY N/B	920,000.00	553,508.80	
		US TREASURY N/B	320,000.00	319,222.40	
		US TREASURY N/B	5,110,000.00	4,139,100.00	
		US TREASURY N/B	1,580,000.00	776,728.00	
		US TREASURY N/B	1,140,000.00	681,013.20	

	US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,417,307.40	
	US TREASURY N/B	5,440,000.00	4,438,060.80	
	US TREASURY N/B	1,530,000.00	804,611.70	
	US TREASURY N/B	1,260,000.00	780,607.80	
	US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,047,231.90	
	US TREASURY N/B	5,550,000.00	4,567,428.00	
	US TREASURY N/B	1,710,000.00	959,053.50	
	US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,032,446.80	
	US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,184,515.10	
	US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,041,279.00	
	US TREASURY N/B	5,710,000.00	4,804,622.40	
	US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,089,981.20	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,254,961.50	
	US TREASURY N/B	900,000.00	810,594.00	
	US TREASURY N/B	1,260,000.00	895,091.40	
	US TREASURY N/B	5,910,000.00	4,811,331.00	
	US TREASURY N/B	1,710,000.00	985,438.80	
	US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,115,299.60	
	US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,281,160.80	
	US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,484,863.80	
	US TREASURY N/B	3,290,000.00	2,681,843.50	
	US TREASURY N/B	1,620,000.00	901,627.20	
	US TREASURY N/B	300,000.00	241,932.00	
	US TREASURY N/B	1,460,000.00	981,222.20	
	US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,732,497.60	
	US TREASURY N/B	1,820,000.00	1,629,537.00	
	US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,039,013.00	
	US TREASURY N/B	1,440,000.00	880,704.00	
	US TREASURY N/B	330,000.00	265,339.80	
	US TREASURY N/B	1,170,000.00	833,800.50	
	US TREASURY N/B	290,000.00	228,169.10	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	980,158.50	
	US TREASURY N/B	2,370,000.00	2,125,107.90	
	US TREASURY N/B	1,040,000.00	847,631.20	
	US TREASURY N/B	2,290,000.00	2,028,436.20	
	US TREASURY N/B	1,310,000.00	948,256.60	
	US TREASURY N/B	910,000.00	752,661.00	
	US TREASURY N/B	350,000.00	263,606.00	
	US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,221,746.00	
	US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,168,777.40	
	US TREASURY N/B	890,000.00	802,317.20	
	US TREASURY NOTES	150,000.00	162,744.00	
	WI TREASURY SEC.	310,000.00	297,100.90	
	WI TREASURY SEC.	1,380,000.00	659,212.20	
	WI TREASURY SEC.	4,420,000.00	3,614,189.80	
	WI TREASURY SEC.	300,000.00	286,464.00	
	WI TREASURY SEC.	310,000.00	273,330.10	
アメリカ・ドル　小計		318,660,000.00 (50,332,347,000)	282,003,608.90 (44,542,470,021)	

イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	287,668.50	
	UNITED KINGDOM GILT	800,000.00	803,368.00	
	UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	398,014.20	
	UNITED KINGDOM GILT	750,000.00	752,460.00	
	UNITED KINGDOM GILT	670,000.00	646,282.00	
	UNITED KINGDOM GILT	850,000.00	837,930.00	
	UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	287,094.60	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	434,679.00	
	UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	377,423.60	
	UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	438,142.50	
	UNITED KINGDOM GILT	780,000.00	772,083.00	
	UNITED KINGDOM GILT	610,000.00	594,249.80	
	UNITED KINGDOM GILT	190,000.00	179,439.80	
	UNITED KINGDOM GILT	100,000.00	99,908.00	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	393,862.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	239,880.00	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	210,700.20	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	383,412.00	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	231,132.00	
	UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	365,986.20	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	235,935.00	
	UNITED KINGDOM GILT	420,000.00	373,333.80	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	370,418.10	
	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	380,496.40	
	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	356,683.60	
	UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	346,020.40	
	UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	193,127.70	
	UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	157,557.00	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	357,958.80	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	290,110.40	
	UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	297,992.80	
	UNITED KINGDOM GILT	530,000.00	542,062.80	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	157,235.10	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	257,067.50	
	UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	334,070.10	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	342,512.70	
	UNITED KINGDOM GILT	520,000.00	500,474.00	
	UNITED KINGDOM GILT	460,000.00	433,209.60	
	UNITED KINGDOM GILT	590,000.00	344,884.50	
	UNITED KINGDOM GILT	430,000.00	345,113.70	
	UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	165,570.00	
	UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	306,832.00	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	433,537.30	
	UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	175,126.70	
	UNITED KINGDOM GILT	550,000.00	367,510.00	
	UNITED KINGDOM GILT	680,000.00	523,028.80	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	185,552.00	
	UNITED KINGDOM GILT	650,000.00	606,833.50	

	UNITED KINGDOM GILT	640,000.00	286,374.40	
	UNITED KINGDOM GILT	580,000.00	363,544.00	
	UNITED KINGDOM GILT	660,000.00	568,015.80	
	UNITED KINGDOM GILT	760,000.00	564,467.20	
	UNITED KINGDOM GILT	580,000.00	269,746.40	
	UNITED KINGDOM GILT	850,000.00	675,427.00	
	UNITED KINGDOM GILT	250,000.00	82,990.00	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	272,800.00	
	UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	504,940.80	
	UNITED KINGDOM GILT	770,000.00	765,541.70	
	UNITED KINGDOM GILT	760,000.00	684,456.00	
	UNITED KINGDOM GILT	790,000.00	722,660.40	
	UNITED KINGDOM GILT	650,000.00	516,496.50	
イギリス・ポンド　小計		30,220,000.00 (5,961,801,600)	24,391,429.90 (4,811,941,291)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	840,000.00	849,198.00	
	ISRAEL FIXED BOND	490,000.00	485,320.50	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	517,634.00	
	ISRAEL FIXED BOND	790,000.00	739,677.00	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	344,503.50	
	ISRAEL FIXED BOND	580,000.00	560,541.00	
	ISRAEL FIXED BOND	880,000.00	751,080.00	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	597,272.00	
	ISRAEL FIXED BOND	600,000.00	533,850.00	
	ISRAEL FIXED BOND	740,000.00	533,540.00	
	ISRAEL FIXED BOND	660,000.00	634,986.00	
	ISRAEL FIXED BOND	470,000.00	324,276.50	
	ISRAEL FIXED BOND	740,000.00	604,062.00	
イスラエル・シュケル　小計		8,160,000.00 (352,902,864)	7,475,940.50 (323,318,727)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	463,520.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	196,504.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	550,000.00	533,995.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	180,000.00	178,075.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	330,000.00	324,198.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	580,000.00	586,786.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	460,000.00	461,251.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	403,913.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	360,000.00	334,342.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	214,535.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	425,830.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	503,079.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	255,217.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	449,540.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	471,780.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	590,000.00	545,283.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	264,754.60	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT	590,000.00	500,544.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	566,748.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	417,435.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	241,501.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	710,000.00	573,822.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	620,000.00	584,033.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	610,000.00	505,964.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	590,000.00	530,699.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	570,000.00	579,906.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	560,000.00	532,604.80	
オーストラリア・ドル　小計			12,990,000.00 (1,277,696,400)	11,645,867.90 (1,145,487,567)	
	オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,661,888.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,105,560.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,462,399.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,953,224.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,628,094.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	9,202,566.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	8,465,798.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	17,600,000.00	17,870,160.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	7,824,464.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	11,711,998.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,098,100.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,792,320.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	12,300,000.00	12,986,217.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	12,461,146.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	11,400,000.00	11,900,004.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,780,000.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	9,033,192.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,101,250.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	13,800,000.00	14,533,194.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	17,000,000.00	17,644,470.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	16,000,000.00	16,291,520.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,600,000.00	11,127,562.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,348,660.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,038,960.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,267,300.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	12,400,000.00	12,969,656.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,150,700.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	7,828,152.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	14,500,000.00	14,622,960.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	2,902,158.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,424,400.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,057,200.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,400,000.00	3,510,228.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,076,750.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,026,390.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,900,000.00	6,582,366.00	

		CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,241,740.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,500,000.00	6,900,595.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,629,300.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,920,000.00	11,540,146.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,229,028.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,679,025.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,615,160.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	17,400,000.00	17,826,822.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	7,820,542.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,140,000.00	4,477,658.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	4,762,228.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,276,704.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,367,650.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,802,176.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,898,588.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	6,824,304.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,757,445.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,409,263.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	9,800,000.00	10,104,976.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,785,830.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,255,280.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,589,221.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	700,000.00	883,029.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	10,641,239.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	7,095,314.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,700,000.00	6,153,036.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,900,000.00	7,337,529.00	
オフショア・人民元　小計			470,570,000.00 (10,163,794,373)	499,344,835.80 (10,785,299,174)	
カナダ・ドル		CANADIAN GOVERNMENT	450,000.00	431,127.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	630,000.00	551,149.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	240,000.00	239,599.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	253,827.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	450,000.00	452,119.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	490,000.00	486,721.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	630,000.00	651,489.30	
		CANADIAN GOVERNMENT	520,000.00	527,597.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	777,424.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	590,000.00	596,737.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	131,580.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	680,000.00	690,512.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	506,815.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	223,332.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	139,447.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	570,000.00	564,681.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	510,000.00	511,300.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	240,000.00	235,214.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	240,000.00	239,560.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	131,878.50	

	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	185,924.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	210,960.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	190,704.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	173,732.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	223,208.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	194,059.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	930,000.00	699,880.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	135,389.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	740,000.00	668,641.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	660,000.00	563,930.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	406,005.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	840,000.00	755,714.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	410,000.00	396,195.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	710,000.00	495,068.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	720,000.00	641,592.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	380,000.00	365,484.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	550,000.00	503,426.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	124,800.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	366,951.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	452,942.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	334,174.50	
カナダ・ドル　小計		**17,380,000.00** **(1,903,457,600)**	**16,430,903.70** **(1,799,512,573)**	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	100,060.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	70,000.00	70,476.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	62,433.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	65,422.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	207,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	157,280.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	220,000.00	220,415.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	197,144.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	240,000.00	237,552.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	187,100.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	158,880.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	131,215.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	132,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	212,961.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	200,260.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	129,570.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	106,990.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	204,040.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	167,760.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	117,660.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	100,160.00	
シンガポール・ドル　小計		**3,240,000.00** **(375,904,800)**	**3,167,279.80** **(367,467,802)**	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	730,000.00	727,620.20	

	SWEDISH GOVERNMENT	2,020,000.00	1,982,205.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,170,000.00	1,175,522.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,850,000.00	1,772,688.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,820,000.00	1,708,252.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,010,000.00	1,138,825.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,145,209.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,360,000.00	1,307,735.20	
スウェーデン・クローナ　小計		11,260,000.00 (161,243,200)	10,958,058.60 (156,919,399)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,630,000.00	1,659,258.50	
	KINGDOM OF DENMARK	640,000.00	646,310.40	
	KINGDOM OF DENMARK	1,290,000.00	1,245,765.90	
	KINGDOM OF DENMARK	1,200,000.00	1,125,348.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,490,000.00	888,323.10	
	KINGDOM OF DENMARK	1,200,000.00	1,054,968.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,390,000.00	3,066,656.80	
デンマーク・クローネ　小計		9,840,000.00 (215,889,600)	9,686,630.70 (212,524,678)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	300,000.00	306,441.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	97,909.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	140,000.00	139,144.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	144,625.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	190,000.00	193,300.30	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	270,000.00	260,317.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	170,000.00	138,589.10	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	220,000.00	186,907.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	330,000.00	293,145.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	340,000.00	318,498.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	130,000.00	83,506.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	98,943.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	260,000.00	248,775.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	230,000.00	196,307.30	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	190,000.00	186,642.70	
ニュージーランド・ドル　小計		3,170,000.00 (281,400,900)	2,893,054.50 (256,816,448)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,266,032.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,090,000.00	1,078,119.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,440,000.00	1,398,988.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,240,000.00	1,187,424.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,003,099.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	933,932.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,280,000.00	1,128,486.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	905,695.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,130,000.00	1,013,056.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	470,000.00	453,112.90	
ノルウェー・クローネ　小計		11,130,000.00	10,367,946.80	

		(153,482,700)	(142,973,986)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,180,000.00	1,191,516.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,160,000.00	1,121,894.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	560,000.00	523,264.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	218,435.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,240,000.00	1,191,590.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,180,000.00	1,103,500.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	890,000.00	820,731.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,280,000.00	1,131,558.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,120,000.00	1,128,601.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	944,904.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	980,000.00	898,336.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,160,000.00	886,448.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	770,000.00	745,629.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,060,000.00	1,130,235.60	
ポーランド・ズロチ　小計		14,000,000.00 (538,428,800)	13,036,647.40 (501,379,030)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT	500,000.00	522,605.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	349,587.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	353,843.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	220,000.00	223,438.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	552,689.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	633,668.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	410,508.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	211,166.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	615,770.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	364,856.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	389,674.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	414,288.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	470,000.00	474,591.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	261,453.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	590,000.00	637,276.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	530,000.00	535,729.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	602,844.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	570,000.00	604,570.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	640,000.00	646,291.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	458,544.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	352,905.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	460,000.00	459,829.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	590,000.00	574,736.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	670,983.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	810,000.00	757,811.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	390,000.00	384,391.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	560,000.00	605,651.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	230,000.00	238,093.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	340,027.20	
マレーシア・リンギット　小計		13,340,000.00	13,647,826.80	

		(467,281,524)	(478,064,266)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,100,000.00	6,805,350.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	600,000.00	518,364.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,250,000.00	6,895,040.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,720,000.00	4,831,912.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,480,000.00	8,520,339.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,970,000.00	6,927,531.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,150,000.00	8,746,393.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,940,000.00	4,615,023.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,150,000.00	2,109,257.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,220,000.00	7,825,275.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,540,000.00	8,128,030.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,910,000.00	4,229,081.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,520,000.00	8,731,077.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,650,000.00	5,863,572.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,450,000.00	6,318,121.50	
メキシコ・ペソ　小計		102,650,000.00 (797,241,490)	91,064,370.30 (707,260,538)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	241,765.00	
	BELGIUM KINGDOM	120,000.00	122,398.80	
	BELGIUM KINGDOM	380,000.00	378,217.80	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	189,732.10	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	202,328.00	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	555,126.40	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	244,312.90	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	227,868.90	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	222,857.80	
	BELGIUM KINGDOM	420,000.00	380,511.60	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	267,103.20	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	182,177.10	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	392,928.00	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	181,695.00	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	146,502.00	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	376,794.60	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	144,935.80	
	BELGIUM KINGDOM	180,000.00	150,060.60	
	BELGIUM KINGDOM	490,000.00	538,461.00	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	380,168.00	
	BELGIUM KINGDOM	280,000.00	249,482.80	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	440,103.30	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	192,520.80	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	289,924.80	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	145,083.40	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	253,708.20	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	450,792.00	
	BELGIUM KINGDOM	320,000.00	267,904.00	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	65,636.80	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	327,888.60	
	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	152,496.00	

		BELGIUM KINGDOM	180,000.00	171,869.40	
		BELGIUM KINGDOM	460,000.00	466,831.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	562,204.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	415,806.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	608,611.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	604,452.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	562,732.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	583,395.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	240,000.00	255,844.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	509,433.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	602,040.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	610,000.00	695,204.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	180,000.00	184,464.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	60,000.00	60,533.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	563,631.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	549,805.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	592,043.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	571,249.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	528,229.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	420,555.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	352,661.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	670,000.00	659,548.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	580,365.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	499,907.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	566,370.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	630,272.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	410,098.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	569,649.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	722,382.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	551,030.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	546,778.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	499,940.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	529,946.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	539,226.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	510,262.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	301,678.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	680,000.00	630,482.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	618,764.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	331,425.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	478,034.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	640,000.00	545,894.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	170,000.00	88,371.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	670,000.00	623,327.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	287,895.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	518,850.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	310,000.00	212,973.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	505,869.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	640,000.00	554,323.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	326,650.60	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	640,000.00	593,337.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	540,743.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	368,849.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	564,205.60	
		BUNDESOBLIGATION	670,000.00	678,803.80	
		BUNDESOBLIGATION	590,000.00	590,477.90	
		BUNDESOBLIGATION	90,000.00	90,096.30	
		BUNDESOBLIGATION	460,000.00	467,976.40	
		BUNDESOBLIGATION	640,000.00	623,603.20	
		BUNDESOBLIGATION	550,000.00	530,876.50	
		BUNDESOBLIGATION	510,000.00	487,330.50	
		BUNDESOBLIGATION	700,000.00	687,701.00	
		BUNDESOBLIGATION	220,000.00	216,147.80	
		BUNDESOBLIGATION	590,000.00	593,652.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	230,000.00	231,451.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	220,000.00	188,254.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	729,205.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	669,424.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	794,576.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	450,000.00	446,863.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	201,410.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	758,670.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	746,542.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	780,000.00	766,061.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	689,375.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	716,386.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	685,022.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	732,389.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	532,246.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	490,000.00	628,978.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	870,000.00	675,981.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	631,098.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	620,664.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	642,879.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	638,057.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	980,000.00	522,085.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	460,000.00	505,724.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	576,870.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	472,550.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	431,854.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	780,000.00	695,767.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	766,675.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	230,000.00	205,245.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	572,858.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	630,000.00	480,293.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	160,104.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	644,784.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	574,089.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	183,021.30	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	780,000.00	395,795.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	618,984.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	270,000.00	322,550.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	735,560.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	515,765.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	619,116.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	590,000.00	589,752.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	614,800.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	880,000.00	885,227.20	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	310,000.00	312,557.50	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	440,000.00	442,028.40	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	480,000.00	485,443.20	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	560,000.00	565,908.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	230,000.00	229,795.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	366,795.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	376,919.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	276,112.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	405,580.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	529,783.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	416,516.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	450,973.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	502,232.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	390,723.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	432,340.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	394,703.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	462,460.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	396,940.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	526,423.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	353,171.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	451,061.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	467,446.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	419,417.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	220,111.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	348,602.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	719,232.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	303,552.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	382,909.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	201,764.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	258,602.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	220,547.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	780,000.00	819,288.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	130,000.00	130,811.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	400,158.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	670,000.00	694,173.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	630,000.00	573,136.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	656,799.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	458,923.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	740,000.00	870,928.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	356,289.40	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	525,240.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	352,408.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	480,792.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	195,250.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	442,664.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	468,745.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	418,756.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	446,661.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	352,210.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	542,641.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	781,018.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	514,722.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	448,416.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	424,182.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	577,780.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	315,057.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	620,000.00	709,528.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	482,820.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	628,325.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	291,190.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	300,810.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	680,000.00	771,432.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	387,318.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	553,818.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	502,545.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	313,055.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	460,905.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	537,721.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	265,626.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	320,651.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	419,753.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	217,609.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	490,732.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	110,158.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	354,008.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	426,172.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	424,485.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	446,848.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	466,665.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	418,873.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	409,089.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	630,000.00	700,125.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	375,346.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	412,118.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	155,141.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	379,333.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	477,210.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	371,628.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	287,742.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	472,693.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	316,806.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	404,872.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	532,179.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	566,033.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	431,306.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	343,798.40	
		DEUTSCHLAND REP	380,000.00	420,337.00	
		DEUTSCHLAND REP	300,000.00	333,054.00	
		DEUTSCHLAND REP	330,000.00	360,591.00	
		DEUTSCHLAND REP	500,000.00	594,160.00	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	88,442.10	
		FINNISH GOVERNMENT	190,000.00	194,542.90	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	142,898.00	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	109,037.50	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	142,947.00	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	120,482.40	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	122,115.60	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	133,952.00	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	98,851.50	
		FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	166,299.10	
		FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	153,134.40	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	112,992.10	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	104,346.20	
		FINNISH GOVERNMENT	190,000.00	174,188.20	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	88,744.80	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	59,743.80	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	113,115.60	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	48,405.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	119,457.80	
		FINNISH GOVERNMENT	190,000.00	177,980.60	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	86,737.50	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	65,445.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	129,101.00	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	98,190.00	
		FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	533,514.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,104,840.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,420,000.00	1,436,117.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,360,000.00	1,370,064.00	
		FRANCE (GOVT OF)	990,000.00	990,534.60	
		FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	845,331.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,090,000.00	1,129,065.60	
		FRANCE (GOVT OF)	930,000.00	933,654.90	
		FRANCE (GOVT OF)	230,000.00	210,857.10	
		FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	717,222.80	
		FRANCE (GOVT OF)	470,000.00	436,615.90	
		FRANCE (GOVT OF)	690,000.00	692,684.10	
		FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	832,221.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,480,000.00	1,468,530.00	

		FRANCE (GOVT OF)	1,520,000.00	1,408,690.40	
		FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	1,085,449.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,150,000.00	1,122,400.00	
		FRANCE (GOVT OF)	430,000.00	266,466.70	
		FRANCE (GOVT OF)	1,130,000.00	922,351.20	
		FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	876,512.00	
		FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	675,171.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,050,000.00	1,018,657.50	
		FRANCE (GOVT OF)	710,000.00	540,615.30	
		FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,418,100.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,410,000.00	1,203,477.30	
		FRANCE (GOVT OF)	1,440,000.00	1,346,328.00	
		FRANCE (GOVT OF)	620,000.00	667,219.20	
		FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	1,023,345.00	
		FRANCE (GOVT OF)	770,000.00	509,370.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,360,000.00	1,243,611.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	969,067.00	
		FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	403,228.80	
		FRANCE (GOVT OF)	1,060,000.00	1,032,429.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	1,026,351.90	
		FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	536,025.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,360,000.00	1,160,800.80	
		FRANCE (GOVT OF)	690,000.00	453,606.00	
		FRANCE (GOVT OF)	310,000.00	108,834.80	
		FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	329,963.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,330,000.00	1,097,821.90	
		FRANCE (GOVT OF)	1,080,000.00	1,028,743.20	
		FRANCE (GOVT OF)	770,000.00	388,842.30	
		FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	761,700.80	
		FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	529,672.40	
		FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	981,958.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,190,000.00	1,130,333.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,190,000.00	1,112,174.00	
		FRANCE (GOVT OF)	520,000.00	555,167.60	
		FRANCE (GOVT OF)	480,000.00	417,979.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	110,152.90	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	260,000.00	228,355.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	221,183.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	260,000.00	255,889.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	169,772.60	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	182,650.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	130,000.00	118,579.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	150,886.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	238,247.50	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	161,548.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	120,000.00	95,896.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	181,788.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	159,499.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	187,052.80	

		IRELAND GOVERNMENT BOND	100,000.00	70,943.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	90,000.00	93,210.30	
		IRISH GOVERNMENT BOND	120,000.00	102,502.80	
		ITALIAN GOVT	240,000.00	261,645.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	280,551.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	283,152.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	210,000.00	227,616.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	309,169.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	480,000.00	487,824.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	361,915.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	400,172.30	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	396,646.30	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	428,476.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	467,670.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	330,000.00	302,029.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	264,700.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	282,361.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	514,665.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	345,225.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	470,000.00	236,621.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	300,972.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	340,000.00	240,730.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	329,625.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	357,099.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	263,933.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	269,786.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	269,882.90	
		OBRIGACOES DO TESOURO	230,000.00	199,709.00	
		OBRIGACOES DO TESOURO	70,000.00	73,383.80	
		OBRIGACOES DO TESOURO	390,000.00	375,710.40	
		OBRIGACOES DO TESOURO	150,000.00	151,273.50	
		OBRIGACOES DO TESOURO	110,000.00	115,810.20	
		OBRIGACOES DO TESOURO	170,000.00	191,338.40	
		OBRIGACOES DO TESOURO	150,000.00	90,051.00	
		OBRIGACOES DO TESOURO	260,000.00	234,332.80	
		OBRIGACOES DO TESOURO	160,000.00	131,310.40	
		OBRIGACOES DO TESOURO	120,000.00	88,389.60	
		OBRIGACOES DO TESOURO	170,000.00	183,297.40	
		OBRIGACOES DO TESOURO	370,000.00	370,281.20	
		OBRIGACOES DO TESOURO	200,000.00	192,982.00	
		OBRIGACOES DO TESOURO	160,000.00	150,593.60	
		OBRIGACOES DO TESOURO	260,000.00	263,091.40	
		OBRIGACOES DO TESOURO	300,000.00	296,787.00	
		OBRIGACOES DO TESOURO	240,000.00	268,464.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	123,064.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	122,811.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	168,388.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	310,000.00	314,860.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	92,895.30	

		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	100,560.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	224,434.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	118,219.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	235,434.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	410,000.00	399,901.70	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	176,483.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	350,000.00	337,186.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	49,920.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	116,559.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	230,974.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	315,169.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	350,000.00	396,560.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	360,000.00	334,191.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	195,983.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	291,690.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	240,000.00	145,255.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	101,484.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	52,378.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	370,000.00	317,744.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	66,224.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	148,278.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	260,000.00	238,422.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	267,495.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	122,082.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	129,655.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	407,580.00	
	ユーロ　小計		181,560,000.00 (29,721,372,000)	172,348,748.50 (28,213,490,129)	
国債証券　合計			102,704,244,851 (102,704,244,851)	94,444,925,629 (94,444,925,629)	
合計				94,444,925,629 (94,444,925,629)	

（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	46.71	47.16
イギリス・ポンド	国債証券	61銘柄	5.05	5.09
イスラエル・シュケル	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	1.20	1.21
オフショア・人民元	国債証券	63銘柄	11.31	11.42
カナダ・ドル	国債証券	41銘柄	1.89	1.91
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	0.22	0.23
ニュージーランド・ドル	国債証券	15銘柄	0.27	0.27

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・リンギット	国債証券	29銘柄	0.50	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.74	0.75
ユーロ	国債証券	400銘柄	29.59	29.87

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	59,331,418円
Ⅱ　負債総額	26,764円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	59,304,654円
Ⅳ　発行済数量	53,936,277口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0995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

Ⅰ　資産総額	265,581,472,439円
Ⅱ　負債総額	900,009,973円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	264,681,462,466円
Ⅳ　発行済数量	78,507,478,368口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	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

Ⅰ　資産総額	1,205,909,386,276円
Ⅱ　負債総額	2,763,666,470円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,203,145,719,806円
Ⅳ　発行済数量	236,344,766,906口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.0906円

ニッセイグローバルリート　マザーファンド

2024年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	14,901,531,925円
Ⅱ　負債総額	67,161,292円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,834,370,633円
Ⅳ　発行済数量	7,124,579,824口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0821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

Ⅰ　資産総額	64,711,426,660円
Ⅱ　負債総額	296,975,535円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	64,414,451,125円
Ⅳ　発行済数量	70,799,798,833口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9098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

Ⅰ　資産総額	95,646,031,441円
Ⅱ　負債総額	254,108,306円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	95,391,923,135円
Ⅳ　発行済数量	52,560,557,589口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8149円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

（２）受益者に対する特典

ありません。

（３）譲渡制限

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

（４）受益権の譲渡

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

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

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2024年12月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。
委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。
最近５年間における資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

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

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

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

２【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

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して記載しておりますので、表中の個々の金額の合計と合計欄の金額とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

(1)　委託会社であるニッセイアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。
　財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2)　当社の中間財務諸表は、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		13,404,658		19,047,806
純資産の部				
株主資本				
資本金		10,000,000		10,000,000
資本剰余金				
資本準備金		8,281,840		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840		8,281,840
利益剰余金				
利益準備金		139,807		139,807
その他利益剰余金				
配当準備積立金		120,000		120,000
研究開発積立金		70,000		70,000
別途積立金		350,000		350,000
繰越利益剰余金		57,905,876		60,488,508
利益剰余金合計		58,585,683		61,168,315
株主資本合計		76,867,523		79,450,155
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		△ 254,732		△ 484,519
繰延ヘッジ損益		△ 306,177		△ 329,920
評価・換算差額等合計		△ 560,910		△ 814,439
純資産合計		76,306,613		78,635,715
負債・純資産合計		89,711,272		97,683,522

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

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

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2022年4月1日　至2023年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度(自2023年4月1日　至2024年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金合計	
					配当準備積立金	研究開発積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	57,905,876	58,585,683	76,867,523
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△ 8,038,816	△ 8,038,816	△ 8,038,816
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	10,621,448	10,621,448	10,621,448
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	2,582,632	2,582,632	2,582,632
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	60,488,508	61,168,315	79,450,155

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△ 254,732	△ 306,177	△ 560,910	76,306,613
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△ 8,038,816
当期純利益	-	-	-	10,621,448
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 229,786	△ 23,743	△ 253,529	△ 253,529
当期変動額合計	△ 229,786	△ 23,743	△ 253,529	2,329,102
当期末残高	△ 484,519	△ 329,920	△ 814,439	78,635,715

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	①　満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 ②　その他有価証券 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 ③　関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
３．固定資産の減価償却の方法	①　有形固定資産 定率法(ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法)によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②　無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	①　賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。 ②　退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。 ③　役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

５．収益及び費用の計上基準	当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。 ①投資信託委託業務 投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。 委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。 ②投資運用業務 投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。 運用受託報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。また、成功報酬は、契約上定められる超過収益の達成等により報酬額及び支払われることが確定した時点で収益として認識しております。 ③投資助言業務 投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。 投資助言報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、契約期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。
６．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
７．ヘッジ会計の方法	①ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ②ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 ヘッジ手段・・・為替予約 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券 ③ヘッジ方針 ヘッジ指定は、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間について、原則として個々取引毎に行います。 ④ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。
８．グループ通算制度の適用	当社は、日本生命保険相互会社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。

（未適用の会計基準等）

- 「法人税、住民税及び事業税等に関する会計基準」（企業会計基準第27号　2022年10月28日）
- 「包括利益の表示に関する会計基準」（企業会計基準第25号　2022年10月28日）
- 「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2022年10月28日）

１．概要

その他の包括利益に対して課税される場合の法人税等の計上区分及びグループ法人税制が適用される場合の子会社株式等の売却に係る税効果の取扱いを定めるものです。

２．適用予定日

2025年3月期の期首より適用予定であります。

３．当該会計基準等の適用による影響

「法人税、住民税及び事業税等に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

（貸借対照表関係）

※１．有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

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

（損益計算書関係）

※１．各科目に含まれている関係会社に対するものは、以下のとおりであります。

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

※２．固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

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

※３．事故損失賠償金は、当社の事務処理誤り等により受託資産に生じた損失を当社が賠償したものであります。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自2022年4月1日　至2023年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首株式数（千株）	当事業年度増加株式数（千株）	当事業年度減少株式数（千株）	当事業年度末株式数（千株）
発行済株式				
普通株式	108	―	―	108
合計	108	―	―	108

２．配当に関する事項

①配当金支払額

2022年6月30日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	9,008,883千円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	83,071円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月30日

当事業年度（自2023年4月1日　至2024年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首株式数（千株）	当事業年度増加株式数（千株）	当事業年度減少株式数（千株）	当事業年度末株式数（千株）
発行済株式				
普通株式	108	―	―	108
合計	108	―	―	108

２．配当に関する事項

①配当金支払額

2023年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

株式の種類	普通株式
配当金の総額	8,038,816千円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	74,126円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023年6月26日

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

2024年6月26日開催の定時株主総会において、以下のとおり決議することを予定しております。

株式の種類	普通株式
配当金の総額	8,497,226千円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	78,353円
基準日	2024年3月31日
効力発生日	2024年6月26日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

当社は、自己勘定の資金運用にあたっては、資金運用規則に沿って、慎重な資金管理、資本金の保全、投機の回避に十分に留意しております。また、資金の管理にあたっては、投資信託委託会社としての業務により当社が受け入れる投資信託財産に属する金銭等との混同を来たさないよう、分離して行っております。

投資有価証券は主として地方債と自社設定投資信託であります。これらは金利の変動リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。自己資金運用に係るリスク管理等については、資金運用規則のほか資金運用リスク管理規程に従い、適切なリスク管理を図っております。

上記の自社設定投資信託の一部につきましてはデリバティブを用いてヘッジを行っております。デリバティブを用いたヘッジ取引につきましては、外貨建て資産の為替変動リスクを回避する目的で為替予約を使ってヘッジ会計を適用しております。ヘッジ会計の適用にあたっては、資金運用規則のほか資金運用リスク管理規程等に基づき、ヘッジ対象のリスクの種類及び選択したヘッジ手段を明確にし、また事前の有効性の確認、事後の有効性の検証を行う等、社内体制を整備して運用しております。ヘッジの有効性判定については資金運用リスク管理規程に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、以下のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品または市場価格のない株式等（注1）は次表に含まれておりません。また、短期間で決済されるため時価が簿価に近似する金融商品は、注記を省略しております。

前事業年度（2023年3月31日） **（単位：千円）**

	貸借対照表計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,445,768	23,460,731	14,962
その他有価証券	19,289,693	19,289,693	－
資産計	42,735,461	42,750,424	14,962
デリバティブ取引（※）			
ヘッジ会計が適用されているもの	△24,321	△24,321	－
デリバティブ取引計	△24,321	△24,321	－

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

当事業年度（2024年3月31日）　　（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	28,036,676	27,975,611	61,065
その他有価証券	24,465,367	24,465,367	－
資産計	52,502,043	52,440,978	61,065
デリバティブ取引（※）			
ヘッジ会計が適用されているもの	△10,936	△10,936	－
デリバティブ取引計	△10,936	△10,936	－

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

（注１）市場価格のない株式等

(単位：千円)

区分	前事業年度(2023年3月31日)
関係会社株式	66,222

(単位：千円)

区分	当事業年度(2024年3月31日)
関係会社株式	66,222

３．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の３つのレベルに分類しております。

レベル１の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル２の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル３の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券				
その他有価証券	－	19,289,693	－	19,289,693
デリバティブ取引（※）				
為替予約	－	△24,321	－	△24,321
合計	－	19,265,372	－	19,265,372

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

当事業年度（2024年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券				
その他有価証券	3,473,100	20,992,267	－	24,465,367
デリバティブ取引（※）				
為替予約	－	△10,936	－	△10,936
合計	－	24,454,430	－	24,454,430

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

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券 国債・地方債等	－	23,460,731	－	23,460,731
合計	－	23,460,731	－	23,460,731

当事業年度（2024年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券 国債・地方債等	－	27,975,611	－	27,975,611
合計	－	27,975,611	－	27,975,611

（注）時価の算定に用いた評価技法および時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

国債・地方債は相場価格を用いて評価しております。国債は、市場での取引頻度が高く、活発な市場における相場価格と認められるため、その時価をレベル１の時価に分類しております。一方、地方債は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格と認められないため、その時価をレベル２の時価に分類しております。

市場における取引価格が存在しない投資信託について、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額を時価とし、レベル２の時価に分類しております。

デリバティブ取引

為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル２の時価に分類しております。

４．金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2023年3月31日)

	１年以内（千円）	１年超５年以内（千円）	５年超10年以内（千円）	10年超（千円）
①現金・預金	31,522,565	―	―	―
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	5,100,000	18,340,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
その他（注）	3,029,947	15,086,454	997,574	175,716
合計	39,652,513	33,426,454	997,574	175,716

（注）投資信託受益証券であります。

当事業年度(2024年3月31日)

	１年以内（千円）	１年超５年以内（千円）	５年超10年以内（千円）	10年超（千円）
①現金・預金	23,594,998	―	―	―
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	4,950,000	23,050,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
国債・地方債等	―	―	―	3,000,000
その他（注）	8,363,707	9,339,165	2,160,208	928,678
合計	36,908,706	32,389,165	2,160,208	3,928,678

（注）投資信託受益証券であります。

（有価証券関係）

１．満期保有目的の債券

前事業年度（2023年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	13,455,768	13,484,645	28,876
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	13,455,768	13,484,645	28,876
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	9,990,000	9,976,086	△13,914
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	9,990,000	9,976,086	△13,914
合計		23,445,768	23,460,731	14,962

当事業年度（2024年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
時価が貸借対照表計上額を超えるもの	(1)国債・地方債等	1,094,587	1,098,374	3,786
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	1,094,587	1,098,374	3,786
時価が貸借対照表計上額を超えないもの	(1)国債・地方債等	26,942,089	26,877,237	△64,852
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	26,942,089	26,877,237	△64,852
合計		28,036,676	27,975,611	△61,065

２．その他有価証券

前事業年度（2023年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価または償却原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	6,778,610	6,336,999	441,610
	小計	6,778,610	6,336,999	441,610
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	12,511,082	13,413,000	△901,917
	小計	12,511,082	13,413,000	△901,917
合計		19,289,693	19,749,999	△460,306

（注１）投資信託受益証券等であります。

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

当事業年度（2024年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価または償却原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	①国債・地方債等	3,473,100	3,459,180	13,920
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	6,089,659	5,473,000	616,659
	小計	9,562,759	8,932,180	630,579
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	14,902,608	16,307,000	△1,404,391
	小計	14,902,608	16,307,000	△1,404,391
合計		24,465,367	25,239,180	△773,812

（注１）投資信託受益証券等であります。
（注２）関係会社株式66,222千円は、市場価格がないことから、上表には記載しておりません。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自2022年4月1日　至2023年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
(1)株式	－	－	－
(2)債券	－	－	－
(3)その他	325,215	97,919	73,703
合計	325,215	97,919	73,703

当事業年度（自2023年4月1日　至2024年3月31日）

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

（デリバティブ取引関係）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度（2023年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2024年3月31日）

該当事項はありません。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（１）通貨関連

前事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資 有価証券	1,129,663	-	△ 24,321
合計			1,129,663	-	△ 24,321

（注１）　時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

（注２）　デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については△で示しております。

当事業年度（2024年3月31日）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資 有価証券	916,030	-	△ 10,936
合計			916,030	-	△ 10,936

（注１）　時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

（注２）　デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については△で示しております。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

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

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

（２）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

（３）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

（４）退職給付費用

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

（５）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表しております。）

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

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度において75,867千円、当事業年度において81,815千円であり、退職給付費用に計上しております。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2022年4月1日　至2023年3月31日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

３．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	5,921,322

当事業年度（自2023年4月1日　至2024年3月31日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

３．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	6,138,470

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（収益認識関係）

１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

（単位：千円）

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

（注）成功報酬は、損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。

２．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の「５．収益及び費用の計上基準」に記載の通りでございます。

（関連当事者との取引）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自2022年4月1日　至2023年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	100,000	生命保険業	（被所有）直接100.00%	兼任有出向有転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	5,922,395	未収運用受託報酬	1,446,614
								投資助言報酬の受取	118,702	未収投資助言報酬	10,996
								グループ通算に伴う支払	2,065,951	その他未払金	2,065,951

当事業年度（自2023年4月1日　至2024年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	100,000	生命保険業	（被所有）直接100.00%	兼任有出向有転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	6,088,919	未収運用受託報酬	1,590,885
								投資助言報酬の受取	117,195	未収投資助言報酬	11,015
								グループ通算に伴う支払	624,787	その他未払金	624,787

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

２．親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
１株当たり純資産額	703,623円97銭	725,100円65銭
１株当たり当期純利益金額	92,657円21銭	97,940円47銭

(注) １．潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
当期純利益	10,048,489千円	10,621,448千円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	10,048,489千円	10,621,448千円
期中平均株式数	108千株	108千株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

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		31,846,639
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		52,598,319
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		10,772,456
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		2,593,064
負債合計		13,365,520
純資産の部		
株主資本		
資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840
利益剰余金		
利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		57,100,795
利益剰余金合計		57,780,602
株主資本合計		76,062,442
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		△ 703,749
純資産合計		75,358,692
負債・純資産合計		88,724,213

(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		28,118,529
営業費用		13,741,273
一般管理費	※1	6,879,283
営業利益		7,497,973
営業外収益	※2	86,867
営業外費用	※3	127,529
経常利益		7,457,311
特別利益	※4	47,164
特別損失	※5	168,558
税引前中間純利益		7,335,917
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		2,272,551
中間純利益		5,063,365

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

５．収益及び費用の計上基準	当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。 ①投資信託委託業務 投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。 当該契約については、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しております。 ②投資運用業務 投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。 当該契約については、運用期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しています。 ③投資助言業務 投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。 当該契約については、契約期間にわたり履行義務が充足されるため、履行義務を充足するにつれて一定の期間にわたり収益を認識しています。
６．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
７．ヘッジ会計の方法	①ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 ②ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 ヘッジ手段・・・為替予約 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券 ③ヘッジ方針 ヘッジ指定については、ヘッジ取引日、ヘッジ対象とリスクの種類、ヘッジ手段、ヘッジ割合、ヘッジを意図する期間を、原則として個々取引毎に行います。 ④ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。
８．グループ通算制度の適用	当社は日本生命保険相互会社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しており、当制度を前提とした会計処理を行っております。

（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
①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	－	－	－
②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	－
③デリバティブ取引(※)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	－	－	－
ヘッジ会計が適用されているもの	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△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△で示しております。

（２）時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融商品

第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			
	①国債・地方債等	－	－	－
	②社債	－	－	－
	③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			
	①国債・地方債等	3,459,180	3,405,300	△53,880
	②社債	－	－	－
	③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	5,063,365千円
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。

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

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

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

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

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

5【その他】

① 定款の変更等

該当事項はありません。

② 訴訟その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

ａ．名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

2024年3月末現在、324,279百万円

ｃ．事業の内容

銀行法に基づき監督官庁の免許を受けて銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき監督官庁の認可を受けて信託業務を営んでいます。

（参考）再信託受託会社の概況

ａ．名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

2024年3月末現在、10,000百万円

ｃ．事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

(資本金の額：2024年3月末現在)

ａ．名称	ｂ．資本金の額 (単位：百万円)	ｃ．事業の内容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,450,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。

（３）投資助言会社（参考情報）

ａ．名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

ｂ．資本金の額

2024年3月末現在、450百万円

ｃ．事業の内容

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

２【関係業務の概要】

（１）受託会社

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

（２）販売会社

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

（３）投資助言会社（参考情報）

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

３【資本関係】

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

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

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

第３【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2024年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　樋　口　誠　之

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　大　竹　新

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

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

独立監査人の監査報告書

2025年3月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　百　瀬　和　政

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０の2024年4月30日から2024年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０の2024年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

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