

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年5月20日提出
【計算期間】	第2期（自 2024年2月21日 至 2025年2月20日）
【ファンド名】	D C ニッセイ全世界株式インデックスコレクト
【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
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

基本方針

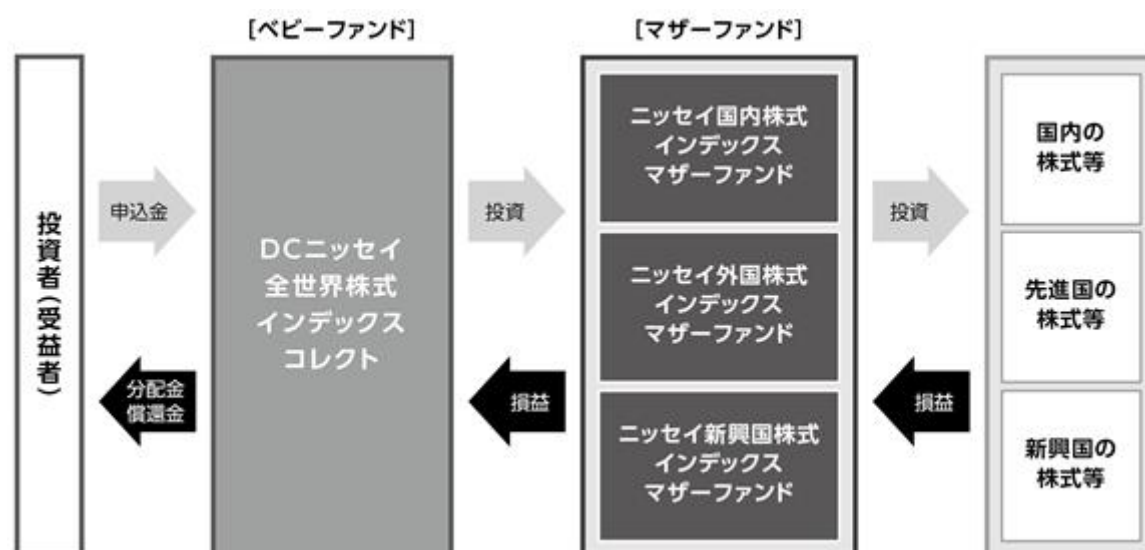
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



ファンドの特色

1 全世界の株式に分散投資を行います。

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

【投資対象とするマザーファンド】

ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	「TOPIX（東証株価指数）（配当込み）」の動きに連動する投資成果をめざします。
ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド	「MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）」の動きに連動する投資成果をめざします。
ニッセイ新興国株式 インデックスマザーファンド*	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）」の動きに連動する投資成果をめざします。

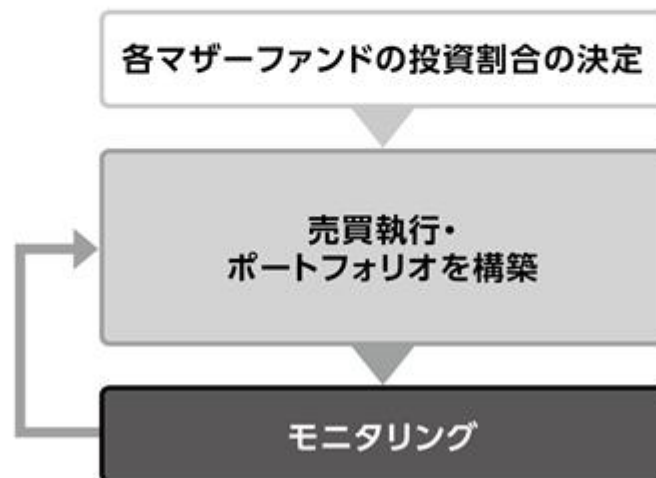
※投資対象には、DR（預託証券）もしくは株式等と同等の投資効果が得られる証券および証書等を含みます。DR（預託証券）とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し海外で発行される証券をいい、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。

- 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ*を行いません。

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

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

＜当ファンドの運用プロセス＞



＜各指数について＞

●TOPIX(東証株価指数)

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

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

●MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

●MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス

MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックスはMSCI Inc.が公表している指数であり、先進国(含む日本)および新興国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

<MSCI指数にかかる免責条項等>

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

MSCI Inc. は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc. の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、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。

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。

ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 株式に属します。

- 課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

商品分類表

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

属性区分表

その他資産 （投資信託証券 （株式（一般）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本含む）	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

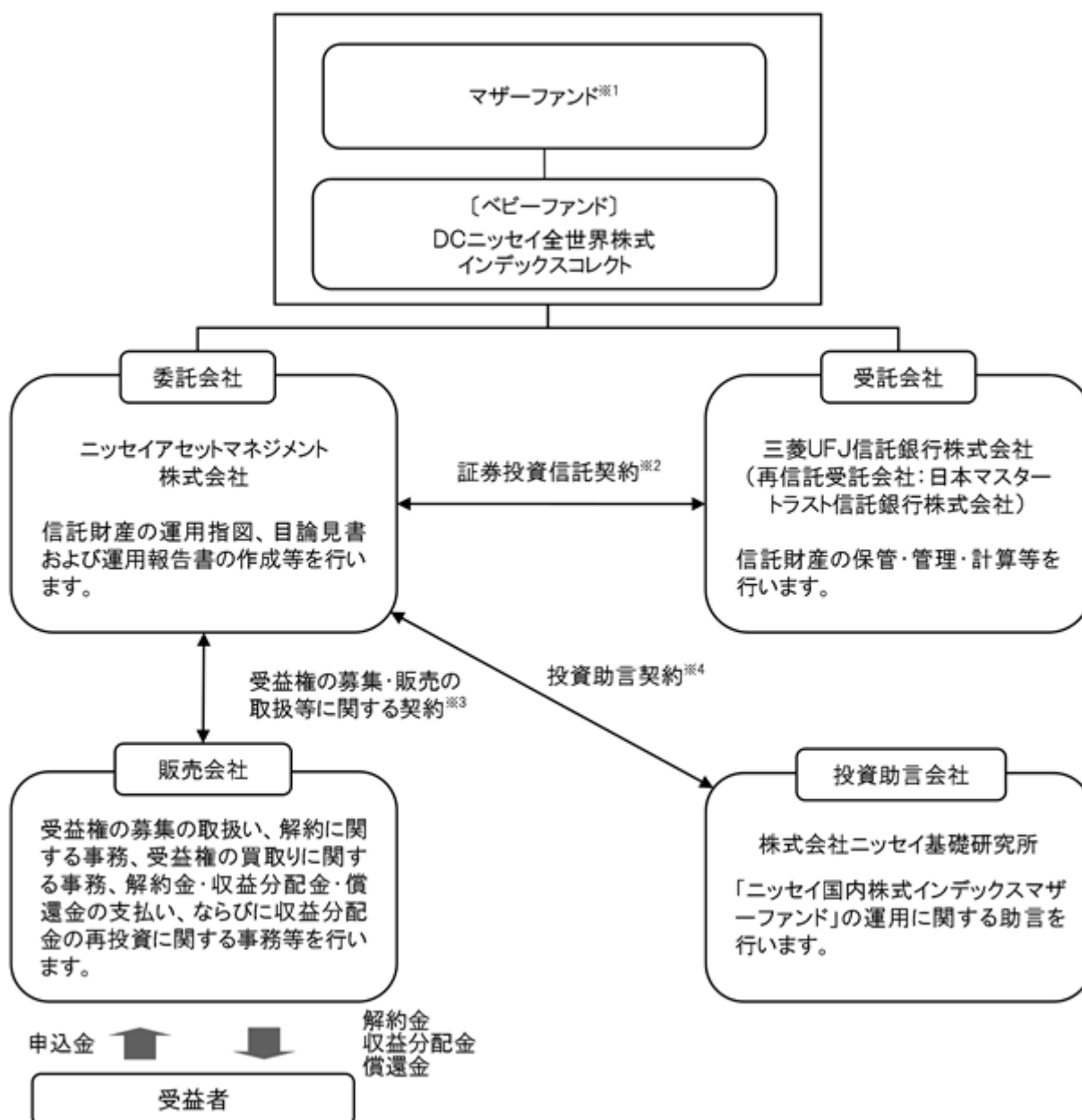
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

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

（２）【ファンドの沿革】

2023年9月15日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



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

委託会社の概況（2025年2月末現在）

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

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

複数のマザーファンドを主要投資対象とします。なお直接、株式等（ＤＲ（預託証券）を含みます）に投資を行う場合があります。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

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

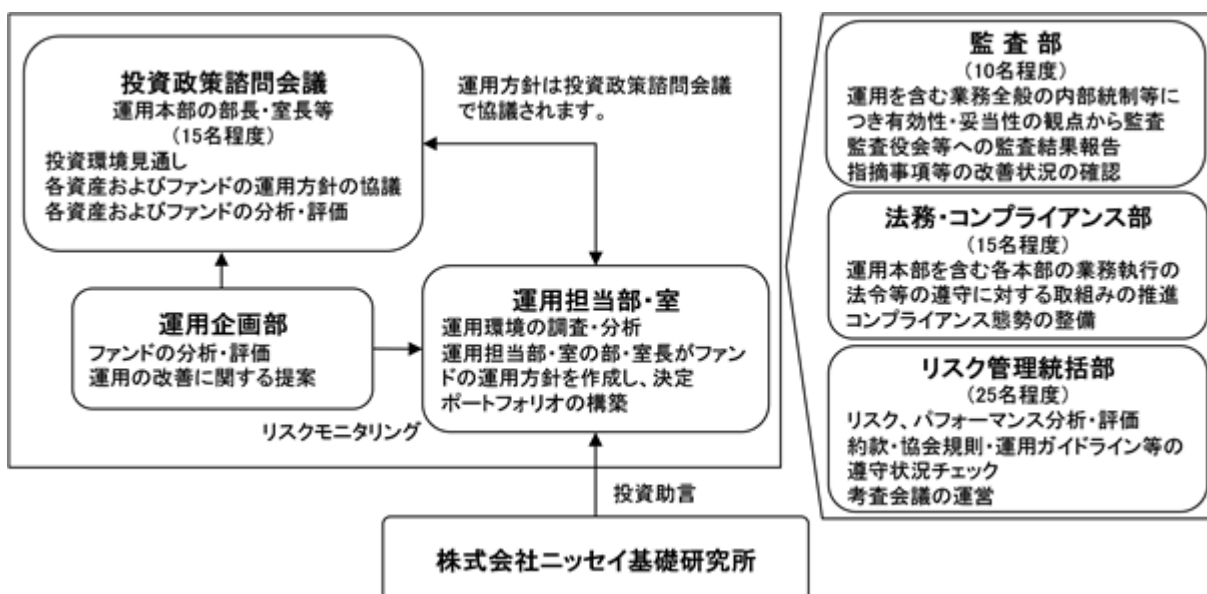
有価証券

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
- 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

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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

- 上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

2. 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

3. 留保益の運用方針

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

分配時期

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

支払方法

< 分配金受取コースの場合 >

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

< 分配金再投資コースの場合 >

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

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

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

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

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

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

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

信用取引の範囲

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

先物取引等

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

スワップ取引

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

３．において同じ）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部を解約するものとします。

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

１．金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

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

有価証券の貸付けおよび範囲

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

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

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

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

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

有価証券の空売り

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

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

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

有価証券の借入れ

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

外国為替予約等

１．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

２．前記１．の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財

産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該取引については、この限りではありません。

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

資金の借入れ

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

c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

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

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

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

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

（１）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

・流動性リスク

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

・新興国の株式投資に関する留意点

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

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

・ストックコネクトを通じた取引に関する留意点

ファンドは中国A株への投資に際し、ストックコネクト（上海・香港相互株式取引制度および深セン・香港相互株式取引制度）を通じて行う場合があります。ストックコネクトを通じた投資は、取引や決済に関する特有の制限等で意図した取引等ができない場合、取引等に特有の費用が課される場合、ストックコネクトにおける取引停止や中国本土市場と香港市場の休業日の違いにより、中国本土市場の急変あるいは株価の大幅な変動時に対応できない場合等には、ファンドの資産価値が減少する要因となることがあります。また、ストックコネクトでは、投資者が不利益を被る大きな制度変更が行われる可能性があります。

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

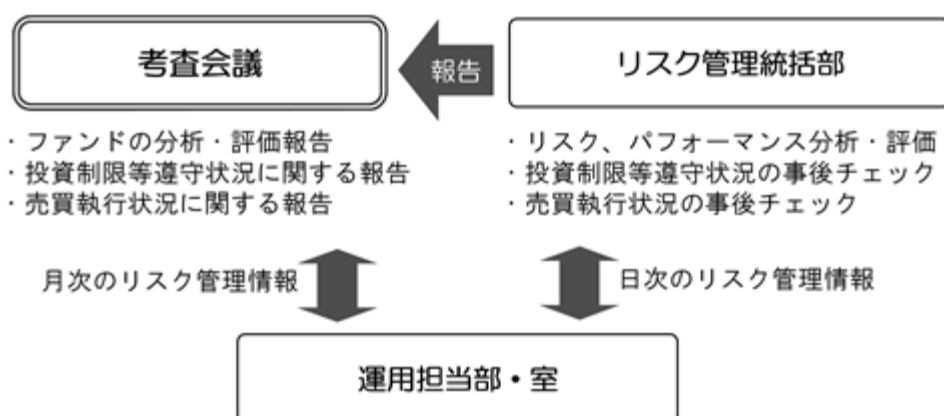
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・流動性に関する留意点

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

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

(2) 投資リスク管理体制



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

< 流動性リスクに関する管理体制 >

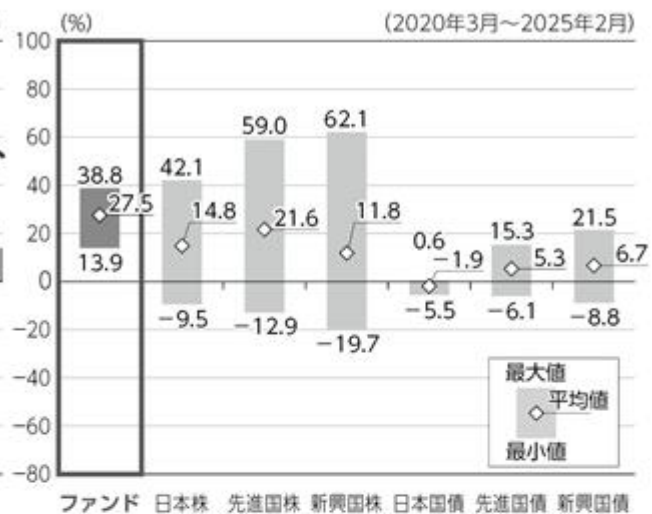
委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行っています。そして取締役会等においては、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢などを監督しています。

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

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



グラフは次に記載の基準で作成していますが、ファンドについては設定日以降の年間騰落率のデータが5年分に満たないため、実在するデータのみの記載となっています。したがって、グラフ②においては、代表的な資産クラスとの比較対象期間が異なりますのでご注意ください。

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.1045%（税抜0.095%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.0375%	0.0375%	0.0200%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

（４）【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

<ご参考>

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

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

（５）【課税上の取扱い】

確定拠出年金としてファンドを取得した場合

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

確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合

課税対象

分 配 時： 分配時の「普通分配金」に対して課税されます。

「元本払戻金（特別分配金）」は非課税です。

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

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

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

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

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

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

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

税率（個人）

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

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

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

< 少額投資非課税制度について >

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

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

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

詳しくは、販売会社にお問合せください。

法人の課税の取扱い（分配時・解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

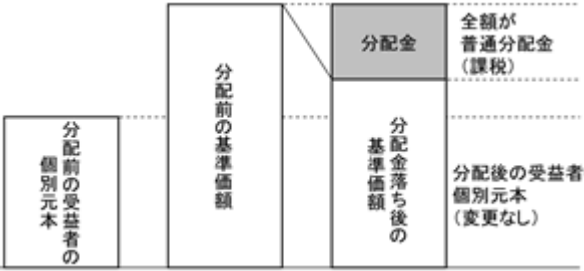
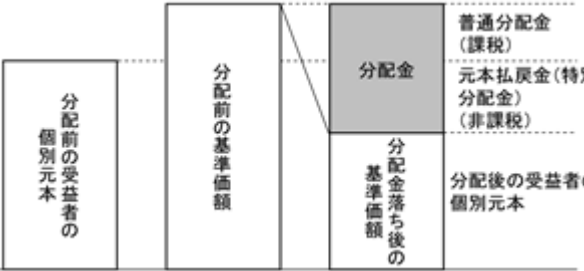
個別元本

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

同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合に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）
 分配前の受益者の個別元本 分配前の基準価額 分配金 全額が普通分配金（課税） 分配後の受益者の個別元本（変更なし） 分配金落ち後の基準価額	 分配前の受益者の個別元本 分配前の基準価額 分配金 普通分配金（課税） 元本払戻金（特別分配金）（非課税） 分配後の受益者の個別元本 分配金落ち後の基準価額
収益分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本と同額以上の場合、収益分配金の全額が普通分配金となります。	収益分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本を下回っている場合、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、収益分配金から元本払戻金（特別分配金）を差引いた額が普通分配金となります。

- 投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めします。

(参考情報) ファンドの総経費率

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.13%	0.10%	0.03%

・対象期間:2024年2月21日～2025年2月20日

・対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

・費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。

・①運用管理費用の比率、②その他費用の比率および総経費率は、表示桁数未満を四捨五入しているため、①と②の合計が総経費率の数字と一致しないことがあります。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】

2025年2月28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	3,152,584,238	100.00
内 日本	3,152,584,238	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	801	0.00
純資産総額	3,152,585,039	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2025年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	281,022,476,890	98.17
内 日本	281,022,476,890	98.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,232,530,828	1.83
純資産総額	286,255,007,718	100.00

その他資産の投資状況

2025年2月28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）	4,897,080,000	1.71
内 日本	4,897,080,000	1.71

（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

2025年2月28日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		1,099,128,555,490	95.25
	内 アメリカ	824,719,793,364	71.47
	内 イギリス	42,252,964,249	3.66
	内 カナダ	36,160,429,900	3.13
	内 スイス	31,918,328,521	2.77
	内 フランス	30,031,074,373	2.60
	内 ドイツ	27,896,877,950	2.42
	内 オーストラリア	18,690,951,749	1.62
	内 オランダ	17,281,854,089	1.50
	内 アイルランド	13,555,855,414	1.17
	内 スウェーデン	9,568,986,383	0.83
	内 スペイン	8,641,517,531	0.75
	内 デンマーク	8,057,918,065	0.70
	内 イタリア	7,402,071,139	0.64
	内 香港	4,898,524,981	0.42
	内 シンガポール	3,637,123,546	0.32
	内 フィンランド	2,939,691,848	0.25
	内 ベルギー	2,819,597,069	0.24
	内 イスラエル	1,893,388,871	0.16
	内 ノルウェー	1,683,689,401	0.15
	内 オランダ領キュラソー	970,079,088	0.08
	内 ジャージー	837,530,800	0.07
	内 パミューダ	804,550,592	0.07
	内 オーストリア	598,070,639	0.05
	内 ケイマン諸島	568,531,050	0.05
	内 ニュージーランド	508,493,908	0.04
	内 ポルトガル	440,167,038	0.04
	内 ルクセンブルグ	350,493,932	0.03
投資証券		20,521,734,193	1.78
	内 アメリカ	18,123,905,771	1.57
	内 オーストラリア	1,151,833,512	0.10
	内 フランス	407,205,354	0.04
	内 イギリス	276,079,992	0.02
	内 シンガポール	260,951,584	0.02
	内 香港	198,386,299	0.02
	内 ベルギー	65,277,013	0.01
	内 カナダ	38,094,668	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		34,329,488,933	2.97
純資産総額		1,153,979,778,616	100.00

その他資産の投資状況

2025年2月28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）	31,859,895,188	2.76
内 アメリカ	25,285,577,203	2.19
内 イギリス	3,313,886,477	0.29
内 ドイツ	3,260,431,508	0.28

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2025年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	13,264,468,148	81.78
内 台湾	2,640,679,724	16.28
内 インド	2,422,980,727	14.94
内 香港	1,871,317,997	11.54
内 中国	1,386,892,168	8.55
内 韓国	1,371,465,059	8.46
内 ケイマン諸島	906,768,499	5.59
内 ブラジル	533,806,781	3.29
内 南アフリカ	424,686,360	2.62
内 アメリカ	362,212,895	2.23
内 メキシコ	248,820,364	1.53
内 マレーシア	201,696,622	1.24
内 タイ	176,394,953	1.09
内 インドネシア	175,488,922	1.08
内 ポーランド	139,589,034	0.86
内 トルコ	84,573,490	0.52
内 フィリピン	68,470,138	0.42
内 ギリシャ	64,436,787	0.40
内 チリ	63,317,586	0.39
内 ハンガリー	39,560,433	0.24
内 バミューダ	32,807,020	0.20
内 チェコ	19,091,715	0.12
内 コロンビア	16,342,026	0.10
内 オランダ	8,785,952	0.05
内 ペルー	4,281,269	0.03
内 ロシア	1,576	0.00
内 カザフスタン	28	0.00
内 イギリス	19	0.00
内 イギリス領バージン諸島	4	0.00
投資信託受益証券	1,005,600,947	6.20
内 アメリカ	1,005,600,947	6.20
投資証券	7,140,758	0.04
内 メキシコ	7,140,758	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,941,860,546	11.97
純資産総額	16,219,070,399	100.00

その他資産の投資状況

2025年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	1,922,301,612	11.85
内 アメリカ	1,922,301,612	11.85

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2025年2月28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	555,450,436	5.0680 2,815,059,865	4.8338 2,684,936,317	- -	85.17
2	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	208,721,299	1.5676 327,211,946	1.5318 319,719,285	- -	10.14
3	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	45,537,521	3.3111 150,781,040	3.2485 147,928,636	- -	4.69

（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

2025年2月28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

2025年2月28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	3,902,900	2,710.50 10,578,810,450	2,689.00 10,494,898,100	- -	3.67
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	2,532,700	3,732.00 9,452,036,400	3,739.00 9,469,765,300	- -	3.31
3	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	4,638,500	1,972.50 9,149,441,250	1,903.00 8,827,065,500	- -	3.08
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	1,909,500	4,317.00 8,243,311,500	3,750.00 7,160,625,000	- -	2.50

5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,508,500	3,917.00 5,908,794,500	3,792.00 5,720,232,000	- -	2.00
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	588,900	9,875.00 5,815,387,500	8,800.00 5,182,320,000	- -	1.81
7	任天堂 日本	株式 その他製品	463,500	11,490.00 5,325,615,000	11,160.00 5,172,660,000	- -	1.81
8	キーエンス 日本	株式 電気機器	73,500	62,780.00 4,614,330,000	59,410.00 4,366,635,000	- -	1.53
9	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	976,000	4,360.00 4,255,360,000	4,177.00 4,076,752,000	- -	1.42
10	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	706,000	5,073.00 3,581,538,000	5,297.00 3,739,682,000	- -	1.31
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,435,700	2,369.00 3,401,173,300	2,496.50 3,584,225,050	- -	1.25
12	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	522,200	6,104.00 3,187,508,800	6,669.00 3,482,551,800	- -	1.22
13	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	155,400	25,200.00 3,916,080,000	22,125.00 3,438,225,000	- -	1.20
14	三井物産 日本	株式 卸売業	1,141,300	2,720.50 3,104,906,650	2,795.00 3,189,933,500	- -	1.11
15	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	21,902,800	146.00 3,197,808,800	145.40 3,184,667,120	- -	1.11
16	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	363,200	9,451.00 3,432,603,200	8,273.00 3,004,753,600	- -	1.05
17	信越化学工業 日本	株式 化学	654,000	4,628.00 3,026,712,000	4,492.00 2,937,768,000	- -	1.03
18	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	655,200	4,161.00 2,726,287,200	4,334.00 2,839,636,800	- -	0.99
19	K D D I 日本	株式 情報・通信業	541,600	4,871.00 2,638,133,600	4,894.00 2,650,590,400	- -	0.93
20	三菱重工業 日本	株式 機械	1,296,700	2,162.50 2,804,113,750	1,987.00 2,576,542,900	- -	0.90
21	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	11,787,000	210.60 2,482,342,200	213.70 2,518,881,900	- -	0.88
22	H O Y A 日本	株式 精密機器	143,400	18,200.00 2,609,880,000	17,495.00 2,508,783,000	- -	0.88
23	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,739,600	1,366.50 2,377,163,400	1,393.00 2,423,262,800	- -	0.85
24	第一三共 日本	株式 医薬品	695,000	3,417.00 2,374,815,000	3,447.00 2,395,665,000	- -	0.84

25	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	43,700	47,530.00 2,077,061,000	45,470.00 1,987,039,000	- -	0.69
26	富士通 日本	株式 電気機器	682,300	2,975.00 2,029,842,500	2,879.00 1,964,341,700	- -	0.69
27	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	231,400	9,580.00 2,216,812,000	8,116.00 1,878,042,400	- -	0.66
28	キヤノン 日本	株式 電気機器	366,200	5,112.00 1,872,014,400	5,063.00 1,854,070,600	- -	0.65
29	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	858,100	2,400.00 2,059,440,000	2,144.00 1,839,766,400	- -	0.64
30	三菱電機 日本	株式 電気機器	754,200	2,364.00 1,782,928,800	2,307.00 1,739,939,400	- -	0.61

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2025年2月28日現在

2020年12月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
株式	国内	電気機器	17.58
		銀行業	9.01
		情報・通信業	7.58
		輸送用機器	7.18
		卸売業	6.37
		機械	5.28
		化学	4.86
		サービス業	4.73
		小売業	4.35
		医薬品	4.12
		保険業	3.26
		その他製品	3.10
		食料品	2.94
		陸運業	2.35
		精密機器	2.18
		建設業	2.14
		不動産業	1.82
		電気・ガス業	1.24
		その他金融業	1.13
		証券、商品先物取引業	0.93
		鉄鋼	0.88
		非鉄金属	0.79
		海運業	0.70
		ガラス・土石製品	0.62
		ゴム製品	0.61
		石油・石炭製品	0.54
		金属製品	0.50
		繊維製品	0.41
		空運業	0.35
		鉱業	0.25
		倉庫・運輸関連業	0.14
		パルプ・紙	0.14
	水産・農林業	0.08	
	小計		98.17
合 計（対純資産総額比）			98.17

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2025年2月28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	34,200.21 58,011,015,317	35,516.69 60,244,050,574	- -	5.22
2	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製造装置	2,736,637	21,995.75 60,194,406,825	17,982.85 49,212,534,043	- -	4.26
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・ サービス	787,790	62,531.73 49,261,871,757	58,749.96 46,282,635,006	- -	4.01
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	30,616.58 32,264,523,545	31,242.11 32,923,722,682	- -	2.85
5	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	243,816	83,981.06 20,475,926,299	98,518.78 24,020,455,059	- -	2.08
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	653,572	26,651.76 17,418,850,321	25,219.39 16,482,690,428	- -	1.43
7	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製造装置	495,006	24,747.09 12,249,962,592	29,604.72 14,654,516,998	- -	1.27
8	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	560,841	26,875.51 15,072,892,277	25,475.33 14,287,609,945	- -	1.24
9	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部品	320,764	51,775.93 16,607,856,175	42,199.45 13,536,066,464	- -	1.17
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	317,407	36,383.28 11,548,307,850	38,772.01 12,306,508,488	- -	1.07
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	109,246.09 9,846,132,426	135,475.29 12,210,117,586	- -	1.06

12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	147,834	70,184.33 10,375,631,309	75,195.70 11,116,481,808	- -	0.96
13	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サー ビス	186,365	46,687.54 8,700,924,040	53,243.60 9,922,744,594	- -	0.86
14	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネル ギー	495,639	17,755.35 8,800,244,959	16,486.15 8,171,179,147	- -	0.71
15	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 金融サー ビス	92,046	77,748.62 7,156,449,825	84,536.60 7,781,256,748	- -	0.67
16	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	49,428	139,245.99 6,882,651,133	152,919.33 7,558,496,924	- -	0.65
17	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ サービス	103,022	86,404.83 8,901,598,747	70,129.37 7,224,868,491	- -	0.63
18	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	493,197	12,964.26 6,393,938,530	14,486.55 7,144,727,587	- -	0.62
19	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	47,879	130,407.69 6,243,789,876	144,142.68 6,901,407,706	- -	0.60
20	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用 品・パー ソナル用 品	262,157	25,560.40 6,700,839,218	25,738.74 6,747,593,457	- -	0.58
21	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	268,588	22,902.63 6,151,371,588	24,505.46 6,581,874,934	- -	0.57
22	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	60,914.85 6,750,401,575	58,411.71 6,473,010,566	- -	0.56

23	ABBVIE INC アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	197,069	24,942.28 4,915,351,149	30,685.34 6,047,129,938	- -	0.52
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	779,088	6,946.18 5,411,689,145	6,603.44 5,144,661,174	- -	0.45
25	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	44,579	97,234.10 4,334,599,163	108,779.95 4,849,301,836	- -	0.42
26	SAP SE ドイツ	株式 ソフト ウェア・ サービス	116,482	34,220.48 3,986,070,721	41,623.00 4,848,330,286	- -	0.42
27	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲 料・タバ コ	456,824	9,369.90 4,280,399,103	10,607.11 4,845,583,743	- -	0.42
28	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	15,126.58 5,435,119,419	13,387.94 4,810,410,207	- -	0.42
29	SALESFORCE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	106,652	48,407.76 5,162,785,283	44,137.68 4,707,372,167	- -	0.41
30	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	185,482	28,271.08 5,243,777,249	24,659.62 4,573,917,343	- -	0.40

（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

2025年2月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
株式	外国	ソフトウェア・サービス	9.53
		半導体・半導体製造装置	8.16
		金融サービス	7.32
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.96
		資本財	6.90
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.72
		メディア・娯楽	6.70
		銀行	5.99
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.93
		エネルギー	3.86
		ヘルスケア機器・サービス	3.82
		素材	3.21
		保険	3.11
		食品・飲料・タバコ	2.87
		公益事業	2.52
		消費者サービス	2.00
		生活必需品流通・小売り	1.87
		自動車・自動車部品	1.70
		商業・専門サービス	1.55
		運輸	1.43
		家庭用品・パーソナル用品	1.38
		電気通信サービス	1.23
		耐久消費財・アパレル	1.20
		不動産管理・開発	0.28
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.03
	小計		95.25
投資証券	外国		1.78
	小計		1.78
合 計（対純資産総額比）			97.03

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2025年2月28日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	295,000	4,737.11 1,397,448,796	4,739.38 1,398,118,280	- -	8.62
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア・娯楽	77,800	7,811.04 607,699,119	9,536.45 741,935,810	- -	4.57
3	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	91,849	6,209.66 570,351,418	6,161.91 565,965,629	- -	3.49

4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	195,200	1,634.35 319,025,504	2,612.22 509,906,320	- -	3.14
5	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	57,359	5,819.79 333,817,798	5,810.15 333,264,967	- -	2.05
6	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	81,422	2,329.20 189,648,174	2,607.25 212,287,623	- -	1.31
7	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	68,075	3,016.01 205,315,195	2,925.20 199,133,262	- -	1.23
8	MEITUAN-B 香港	株式 消費者 サービス	59,460	3,303.74 196,440,445	3,326.40 197,787,744	- -	1.22
9	XIAOMI CORP-CLASS B 香港	株式 テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	180,400	544.77 98,277,410	1,022.17 184,400,370	- -	1.14
10	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネル ギー	74,094	2,141.33 158,659,783	2,076.21 153,834,851	- -	0.95
11	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	1,162,000	115.75 134,512,267	128.97 149,868,950	- -	0.92
12	PDD HOLDINGS INC(ADR) アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	8,341	17,491.36 145,895,463	17,762.83 148,159,811	- -	0.91
13	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	6,610	17,638.97 116,593,631	20,557.43 135,884,678	- -	0.84
14	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	62,942	2,154.25 135,593,241	2,102.61 132,342,730	- -	0.82
15	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	18,000	5,855.87 105,405,723	6,904.00 124,272,117	- -	0.77

16	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフト ウェア・ サービス	40,031	3,145.65 125,923,881	3,034.59 121,477,912	- -	0.75
17	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	149,200	928.44 138,524,041	792.93 118,305,961	- -	0.73
18	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	43,167	2,744.50 118,472,060	2,673.10 115,389,975	- -	0.71
19	ISHARES MSCI KUWAIT ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	21,079	4,922.48 103,761,122	5,311.33 111,957,720	- -	0.69
20	BYD CO LTD 香港	株式 自動車・ 自動車部 品	12,500	5,170.55 64,631,875	7,673.05 95,913,125	- -	0.59
21	JD.COM INC - CL A 香港	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	29,457	2,641.09 77,798,882	3,218.59 94,810,300	- -	0.58
22	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	839,000	91.13 76,462,587	107.60 90,282,692	- -	0.56
23	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 電気通信 サービス	30,801	2,628.32 80,955,023	2,838.68 87,434,429	- -	0.54
24	NASPERS LTD-N SHS 南アフリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	2,013	33,316.77 67,066,662	37,348.33 75,182,196	- -	0.46
25	BANK OF CHINA LTD - H 中国	株式 銀行	871,000	71.80 62,539,977	85.27 74,276,702	- -	0.46
26	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	79,000	888.38 70,182,612	926.88 73,224,112	- -	0.45
27	TATA CONSULTANCY SVCS LTD インド	株式 ソフト ウェア・ サービス	11,098	6,977.38 77,434,976	6,213.58 68,958,377	- -	0.43

28	NETEASE INC 香港	株式 メディア・娯楽	22,800	2,600.67 59,295,390	3,012.62 68,687,850	- -	0.42
29	TRIP.COM GROUP LTD 香港	株式 消費者サービス	7,450	9,732.03 72,503,652	8,739.50 65,109,275	- -	0.40
30	VALE SA ブラジル	株式 素材	40,454	1,479.05 59,833,635	1,443.66 58,402,109	- -	0.36

（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

2025年2月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率（％）
株式	外国	銀行	12.72
		半導体・半導体製造装置	11.53
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.05
		メディア・娯楽	6.49
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.84
		素材	4.39
		資本財	3.84
		自動車・自動車部品	3.34
		エネルギー	3.19
		保険	2.61
		金融サービス	2.56
		消費者サービス	2.55
		食品・飲料・タバコ	2.31
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.18
		ソフトウェア・サービス	1.97
		公益事業	1.94
		電気通信サービス	1.83
		運輸	1.41
		耐久消費財・アパレル	1.01
		生活必需品流通・小売り	0.96
		不動産管理・開発	0.89
		ヘルスケア機器・サービス	0.62
		家庭用品・パーソナル用品	0.50
		商業・専門サービス	0.03
	小計		81.78
投資信託受益証券	外国		6.20
	小計		6.20
投資証券	外国		0.04
	小計		0.04
合 計（対純資産総額比）			88.03

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2025年2月28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	5,007,795,000	4,897,080,000	1.71

（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

2025年2月28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	575	26,380,433,458	25,285,577,203	2.19
	ICE - EU	FTSE 100 INDEX FUTURE 202503	買建	201	3,263,196,931	3,313,886,477	0.29
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 202503	買建	383	3,187,918,951	3,260,431,508	0.28

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2025年2月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	NYSE LIFFE US	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202503	買建	231	1,907,716,195	1,922,301,612	11.85

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2025年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	１口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	１口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2024年2月20日)	95,473,855	95,473,855	1.1326	1.1326
第2計算期間末 (2025年2月20日)	3,188,970,700	3,188,970,700	1.3652	1.3652
2024年2月末日	121,688,424	-	1.1470	-
3月末日	262,074,609	-	1.1934	-
4月末日	373,537,132	-	1.2119	-
5月末日	511,362,814	-	1.2376	-
6月末日	654,350,981	-	1.3088	-
7月末日	794,714,216	-	1.2391	-
8月末日	1,062,147,039	-	1.2157	-
9月末日	1,255,075,154	-	1.2340	-
10月末日	1,944,529,448	-	1.3181	-
11月末日	2,238,169,393	-	1.3160	-
12月末日	2,713,345,153	-	1.3702	-
2025年1月末日	3,023,834,023	-	1.3712	-
2月末日	3,152,585,039	-	1.3062	-

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	13.3
第2計算期間	20.5

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	89,499,860	5,204,039	84,295,821
第2計算期間	2,636,085,774	384,435,384	2,335,946,211

（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

2025年2月末現在

●基準価額・純資産の推移



基準価額	13,062円
純資産総額	31億円

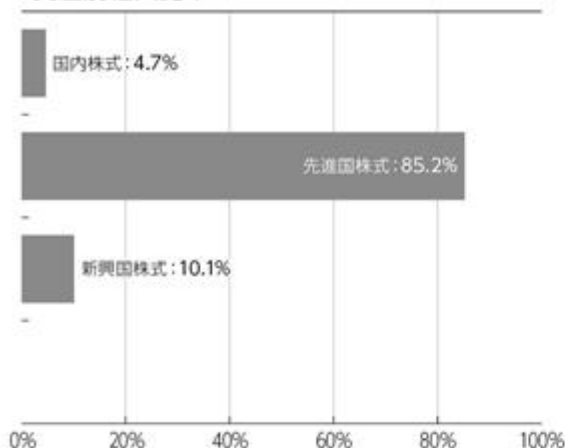
●分配の推移 1万口当り(税引前)

2024年 2 月	0円
2025年 2 月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

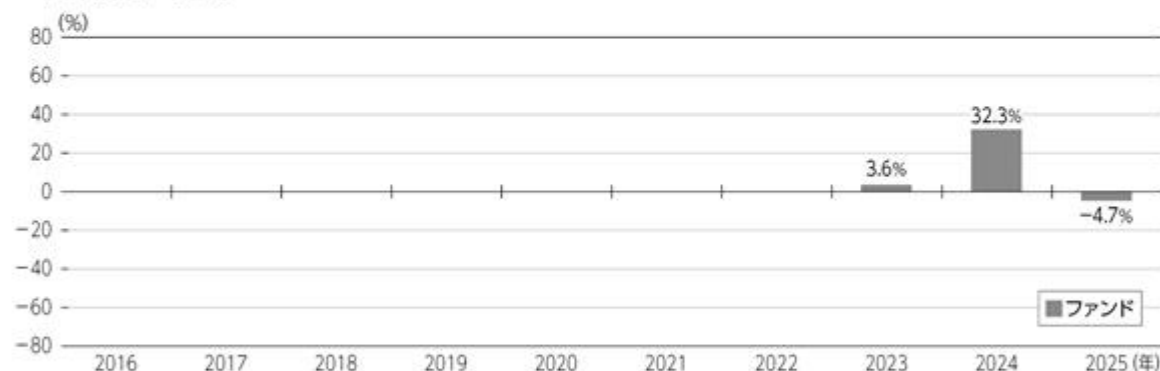
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

●資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2023年はファンド設定時から年末まで、2025年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

3.運用実績

2025年2月末現在

●マザーファンドの状況

1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.7%
2	ソニーグループ	3.4%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3.1%
4	日立製作所	2.5%
5	三井住友フィナンシャルグループ	2.0%

・比率は対組入株式評価額比です。

2. ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	アップル	情報技術	5.4%
2	エヌビディア	情報技術	4.4%
3	マイクロソフト	情報技術	4.1%
4	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.9%
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	2.1%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

3. ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	台湾セミコンダクター（TSMC）	情報技術	9.8%
2	騰訊控股【テンセント・ホールディングス】	コミュニケーション・サービス	5.2%
3	iシェアーズMSCIサウジアラビアETF	その他	4.0%
4	アリババ・グループ・ホールディング	一般消費財・サービス	3.6%
5	サムスン電子	情報技術	2.3%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.9%
2	銀行業	9.2%
3	情報・通信業	7.7%
4	輸送用機器	7.3%
5	卸売業	6.5%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	76.7%
2	イギリス	3.9%
3	カナダ	3.2%
4	フランス	2.9%
5	スイス	2.6%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	中国	31.0%
2	台湾	18.6%
3	インド	17.0%
4	韓国	9.6%
5	その他	7.0%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。[その他]にはETFを含みます。

・比率は対組入株式等評価額比です。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

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

原則として午後3時30分までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。ただし、当該時刻は販売会社によって異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にご確認ください。

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

取扱コース

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

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

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

- 販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

2【換金（解約）手続等】

換金受付

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

原則として午後3時30分までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。ただし、当該時刻は販売会社によって異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にご確認ください。

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

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

- 販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

< 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

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

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

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

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

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限です。

（４）【計算期間】

毎年2月21日から翌年2月20日までとします。

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

（５）【その他】

繰上償還

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

・受益権の口数が30億口または純資産総額が30億円を下回っている場合

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知っている受益者に交付します。
- ・ 運用報告書（全体版）は、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。

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（2024年2月21日から2025年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1 【財務諸表】

【ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2024年2月20日現在	第2期 2025年2月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	17	16,206
コール・ローン	1,780	1,027,235
親投資信託受益証券	95,474,135	3,188,969,917
未収入金	3,367,956	22,792,501
流動資産合計	98,843,888	3,212,805,859
資産合計	98,843,888	3,212,805,859
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,366,060	22,728,578
未払受託者報酬	733	230,526
未払委託者報酬	2,917	864,618
その他未払費用	323	11,437
流動負債合計	3,370,033	23,835,159
負債合計	3,370,033	23,835,159
純資産の部		
元本等		
元本	84,295,821	2,335,946,211
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,178,034	853,024,489
（分配準備積立金）	1,940,365	181,541,904
元本等合計	95,473,855	3,188,970,700
純資産合計	95,473,855	3,188,970,700
負債純資産合計	98,843,888	3,212,805,859

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2023年9月15日 至 2024年2月20日	第2期 自 2024年2月21日 至 2025年2月20日
営業収益		
受取利息	-	495
有価証券売買等損益	2,067,128	203,832,301
営業収益合計	2,067,128	203,832,796
営業費用		
受託者報酬	733	281,881
委託者報酬	2,917	1,057,381
その他費用	323	20,468
営業費用合計	3,973	1,359,730
営業利益又は営業損失（　）	2,063,155	202,473,066
経常利益又は経常損失（　）	2,063,155	202,473,066
当期純利益又は当期純損失（　）	2,063,155	202,473,066
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（　）	122,790	22,107,694
期首剰余金又は期首欠損金（　）	-	11,178,034
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,611,232	752,945,503
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,611,232	752,945,503
剰余金減少額又は欠損金増加額	373,563	91,464,420
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	373,563	91,464,420
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（　）	11,178,034	853,024,489

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第2期
	自 2024年2月21日 至 2025年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期	第2期
	2024年2月20日現在	2025年2月20日現在
1. 期首元本額	1,000,000円	84,295,821円
期中追加設定元本額	88,499,860円	2,636,085,774円
期中一部解約元本額	5,204,039円	384,435,384円
2. 受益権の総数	84,295,821口	2,335,946,211口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期	第2期
	自 2023年9月15日 至 2024年2月20日	自 2024年2月21日 至 2025年2月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,940,365円）、収益調整金（9,237,669円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は11,178,034円（1万口当たり1,326.05円）のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り（0円）としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（485円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（180,364,887円）、収益調整金（671,482,585円）及び分配準備積立金（1,176,532円）より分配対象収益は853,024,489円（1万口当たり3,651.73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	第2期
	自 2023年9月15日 至 2024年2月20日	自 2024年2月21日 至 2025年2月20日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 2024年2月20日現在	第2期 2025年2月20日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2024年2月20日現在	第2期 2025年2月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,957,563	181,654,025
合計	1,957,563	181,654,025

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2024年2月20日現在	第2期 2025年2月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1326円 (11,326円)	1.3652円 (13,652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

2025年2月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	44,088,651	145,990,750	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	537,518,894	2,725,865,815	
	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	202,214,866	317,113,352	
親投資信託受益証券 合計		783,822,411	3,188,969,917	
合計			3,188,969,917	

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2025年2月20日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	72,043,339
コール・ローン	4,566,517,190
株式	286,563,591,300
派生商品評価勘定	9,562,350
未収配当金	371,970,044
差入委託証拠金	253,481,310
流動資産合計	291,837,165,533
資産合計	291,837,165,533
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,249,000
前受金	47,144,000
未払解約金	501,609,517
流動負債合計	568,002,517
負債合計	568,002,517
純資産の部	
元本等	
元本	87,962,939,470
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	203,306,223,546
元本等合計	291,269,163,016
純資産合計	291,269,163,016
負債純資産合計	291,837,165,533

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2024年2月21日 至 2025年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2025年2月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	71,936,737,810円
同期中追加設定元本額	34,833,488,609円
同期中一部解約元本額	18,807,286,949円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,056,152,623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）	2,909,961,878円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	1,695,602円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,050,021,345円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,712,843,045円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	7,033,795,199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）	1,875,300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）	4,278,822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）	8,462,278円
DCニッセイ国内株式インデックス	5,466,408,010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	25,528,690,186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）	5,567,777,230円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	496,392,826円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	255,226,405円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	566,641,796円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	652,057,583円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	19,968,230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）	126,939,648円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	15,155,487円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	16,151,243円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	5,136,297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）	11,287,809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）	31,016,873円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	412,435,105円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	280,460,887円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	484,713,992円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	170,684,612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）	22,690,721,624円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド（ＧＤＰ型バスケット）	30,778,514円
ＦＷニッセイ国内株インデックス	79,143,003円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	221,277,879円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	44,088,651円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	8,855,412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）	1,314,716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）	529,360円
計	87,962,939,470円
２． 受益権の総数	87,962,939,470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2月21日 至 2025年2月20日
１． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年2月20日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年2月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	8,831,211,801
合計	8,831,211,801

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2025年2月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	5,017,381,000	-	5,007,795,000	9,586,000
合計	5,017,381,000	-	5,007,795,000	9,586,000

（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)

	2025年2月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3113円 (33,113円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2025年2月20日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	4,300	4,135.00	17,780,500	
ニッスイ	102,900	853.80	87,856,020	
マルハニチロ	15,300	3,140.00	48,042,000	
雪国まいたけ	8,800	1,206.00	10,612,800	
カネコ種苗	2,900	1,399.00	4,057,100	
サカタのタネ	12,700	3,450.00	43,815,000	
ホクト	9,200	1,935.00	17,802,000	
ショーボンドホールディングス	13,500	4,767.00	64,354,500	
ミライト・ワン	33,700	2,247.00	75,723,900	
タマホーム	6,500	3,295.00	21,417,500	
r o b o t h o m e	42,900	179.00	7,679,100	
住石ホールディングス	12,900	782.00	10,087,800	
日鉄鉱業	4,100	5,740.00	23,534,000	
三井松島ホールディングス	5,000	4,195.00	20,975,000	
I N P E X	311,100	1,901.50	591,556,650	
石油資源開発	56,500	1,125.00	63,562,500	
K & O エナジーグループ	4,700	3,220.00	15,134,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	11,900	2,585.00	30,761,500	
第一カッター興業	4,800	1,421.00	6,820,800	
安藤・間	59,600	1,315.00	78,374,000	
東急建設	32,200	772.00	24,858,400	
コムシスホールディングス	36,500	3,213.00	117,274,500	
ビーアールホールディングス	20,300	342.00	6,942,600	
高松コンストラクショングループ	7,600	2,737.00	20,801,200	
東建コーポレーション	2,200	12,460.00	27,412,000	
ヤマウラ	5,400	1,285.00	6,939,000	
オリエンタル白石	38,100	378.00	14,401,800	
大成建設	65,400	6,947.00	454,333,800	
大林組	237,700	2,011.00	478,014,700	
清水建設	196,800	1,416.50	278,767,200	
長谷工コーポレーション	66,100	1,986.00	131,274,600	
松井建設	4,800	925.00	4,440,000	
鹿島建設	159,700	3,090.00	493,473,000	
不動テトラ	4,500	2,182.00	9,819,000	
鉄建建設	4,700	2,575.00	12,102,500	
西松建設	11,500	4,924.00	56,626,000	
三井住友建設	58,100	412.00	23,937,200	
大豊建設	2,000	3,635.00	7,270,000	
奥村組	12,700	4,320.00	54,864,000	

東鉄工業	7,900	3,085.00	24,371,500	
浅沼組	28,800	675.00	19,440,000	
戸田建設	88,600	989.80	87,696,280	
熊谷組	11,900	3,825.00	45,517,500	
矢作建設工業	9,800	1,288.00	12,622,400	
ピーエス・コンストラクション	5,200	1,510.00	7,852,000	
日本ハウスホールディングス	21,500	322.00	6,923,000	
大東建託	24,700	15,590.00	385,073,000	
新日本建設	10,100	1,424.00	14,382,400	
東亜道路工業	12,500	1,485.00	18,562,500	
日本道路	7,200	1,910.00	13,752,000	
東亜建設工業	21,700	1,358.00	29,468,600	
日本国土開発	23,000	486.00	11,178,000	
若築建設	2,100	3,555.00	7,465,500	
東洋建設	20,700	1,333.00	27,593,100	
五洋建設	94,200	655.80	61,776,360	
世紀東急工業	10,300	1,539.00	15,851,700	
福田組	2,700	5,120.00	13,824,000	
住友林業	62,200	4,471.00	278,096,200	
大和ハウス工業	217,300	4,912.00	1,067,377,600	
ライト工業	14,600	2,582.00	37,697,200	
積水ハウス	218,400	3,354.00	732,513,600	
日特建設	6,900	1,056.00	7,286,400	
ユアテック	13,300	1,633.00	21,718,900	
日本リーテック	5,600	1,462.00	8,187,200	
四電工	9,000	1,347.00	12,123,000	
中電工	11,200	3,215.00	36,008,000	
関電工	39,500	2,614.50	103,272,750	
きんでん	50,100	3,239.00	162,273,900	
東京エネシス	7,700	1,081.00	8,323,700	
トーエネック	11,900	1,004.00	11,947,600	
住友電設	5,900	4,705.00	27,759,500	
日本電設工業	13,500	2,141.00	28,903,500	
エクシオグループ	74,500	1,745.00	130,002,500	
新日本空調	9,300	1,647.00	15,317,100	
九電工	15,600	4,529.00	70,652,400	
三機工業	15,000	3,345.00	50,175,000	
日揮ホールディングス	71,300	1,127.50	80,390,750	
中外炉工業	2,400	3,695.00	8,868,000	
太平電業	4,600	4,850.00	22,310,000	
高砂熱学工業	17,400	5,505.00	95,787,000	
N E C ネットエスアイ	28,700	3,300.00	94,710,000	
朝日工業社	6,700	2,017.00	13,513,900	
明星工業	12,100	1,256.00	15,197,600	
大気社	9,200	4,660.00	42,872,000	
ダイダン	9,500	3,845.00	36,527,500	
日比谷総合設備	5,900	3,200.00	18,880,000	
ニッポン	23,800	2,115.00	50,337,000	
日清製粉グループ本社	75,200	1,693.50	127,351,200	
日東富士製粉	1,300	6,580.00	8,554,000	

昭和産業	6,100	2,804.00	17,104,400	
中部飼料	10,000	1,268.00	12,680,000	
フィード・ワン	10,600	800.00	8,480,000	
日本甜菜製糖	3,800	2,372.00	9,013,600	
D M三井製糖ホールディングス	7,200	3,365.00	24,228,000	
ウェルネオシュガー	4,100	2,262.00	9,274,200	
L I F U L L	38,100	168.00	6,400,800	
M I X I	14,200	3,540.00	50,268,000	
ジェイエイシーリクルートメント	27,300	792.00	21,621,600	
日本M & Aセンターホールディングス	111,000	610.40	67,754,400	
U Tグループ	9,800	2,308.00	22,618,400	
アイティメディア	4,000	1,674.00	6,696,000	
ケアネット	15,400	731.00	11,257,400	
E・Jホールディングス	4,400	1,616.00	7,110,400	
オープンアップグループ	25,200	1,840.00	46,368,000	
コシダカホールディングス	23,000	1,083.00	24,909,000	
パソナグループ	9,200	2,060.00	18,952,000	
リンクアンドモチベーション	18,000	570.00	10,260,000	
エス・エム・エス	28,800	1,215.00	34,992,000	
パーソルホールディングス	688,100	228.20	157,024,420	
森永製菓	30,200	2,476.00	74,775,200	
中村屋	2,200	3,165.00	6,963,000	
江崎グリコ	20,700	4,592.00	95,054,400	
名糖産業	3,400	1,990.00	6,766,000	
井村屋グループ	4,000	2,450.00	9,800,000	
不二家	5,000	2,229.00	11,145,000	
山崎製パン	48,400	2,738.00	132,519,200	
モロゾフ	7,000	1,657.00	11,599,000	
亀田製菓	4,600	3,945.00	18,147,000	
寿スピリッツ	42,700	2,391.50	102,117,050	
カルビー	33,100	2,850.00	94,335,000	
森永乳業	26,900	3,048.00	81,991,200	
六甲バター	6,000	1,149.00	6,894,000	
ヤクルト本社	103,300	2,921.50	301,790,950	
明治ホールディングス	93,000	2,931.50	272,629,500	
雪印メグミルク	19,400	2,540.00	49,276,000	
プリマハム	9,700	2,137.00	20,728,900	
日本ハム	31,100	4,493.00	139,732,300	
丸大食品	7,300	1,650.00	12,045,000	
S F o o d s	8,000	2,353.00	18,824,000	
柿安本店	3,100	2,875.00	8,912,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,000	3,705.00	40,755,000	
学情	3,800	2,069.00	7,862,200	
スタジオアリス	3,800	2,114.00	8,033,200	
クロスキャット	6,500	1,045.00	6,792,500	
システナ	105,200	345.00	36,294,000	
N J S	1,900	4,610.00	8,759,000	
デジタルアーツ	4,700	6,500.00	30,550,000	
日鉄ソリューションズ	25,100	4,123.00	103,487,300	
総合警備保障	126,100	1,051.00	132,531,100	

キューブシステム	6,800	1,007.00	6,847,600	
いちご	61,200	355.00	21,726,000	
日本駐車場開発	86,100	201.00	17,306,100	
コア	3,700	1,836.00	6,793,200	
カカクコム	54,400	2,317.00	126,044,800	
アイロムグループ	3,000	2,794.00	8,382,000	
セントケア・ホールディング	9,300	747.00	6,947,100	
ディップ	13,200	2,207.00	29,132,400	
S B Sホールディングス	6,500	2,817.00	18,310,500	
デジタルホールディングス	4,700	1,497.00	7,035,900	
新日本科学	8,000	1,572.00	12,576,000	
エムスリー	149,200	1,951.00	291,089,200	
ワールドホールディングス	3,300	2,090.00	6,897,000	
ディー・エヌ・エー	30,200	3,534.00	106,726,800	
博報堂D Yホールディングス	85,600	1,053.00	90,136,800	
ぐるなび	20,500	342.00	7,011,000	
ファンコミュニケーションズ	17,300	402.00	6,954,600	
ライク	4,900	1,422.00	6,967,800	
エスプール	23,900	312.00	7,456,800	
W D Bホールディングス	3,900	1,795.00	7,000,500	
アドウェイズ	24,800	289.00	7,167,200	
パリュコマース	9,200	838.00	7,709,600	
インフォマート	71,200	413.00	29,405,600	
サッポロホールディングス	23,800	7,695.00	183,141,000	
アサヒグループホールディングス	542,900	1,785.00	969,076,500	
キリンホールディングス	301,100	2,001.50	602,651,650	
シマダヤ	4,400	1,522.00	6,696,800	
宝ホールディングス	48,700	1,181.50	57,539,050	
オエノンホールディングス	23,400	423.00	9,898,200	
飛島ホールディングス	7,400	1,753.00	12,972,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	45,300	2,396.00	108,538,800	
ライフドリンク カンパニー	15,800	1,859.00	29,372,200	
サントリー食品インターナショナル	50,900	4,613.00	234,801,700	
ダイドグループホールディングス	8,200	2,933.00	24,050,600	
伊藤園	24,200	3,294.00	79,714,800	
キーコーヒー	8,100	2,058.00	16,669,800	
日清オイリオグループ	10,200	4,755.00	48,501,000	
不二製油グループ本社	14,400	2,570.00	37,008,000	
J - オイルミルズ	8,300	1,967.00	16,326,100	
インターメスティック	4,400	1,844.00	8,113,600	
サンエー	13,200	2,970.00	39,204,000	
カワチ薬品	6,100	2,628.00	16,030,800	
エービーシー・マート	34,000	2,952.00	100,368,000	
ハードオフコーポレーション	3,600	1,883.00	6,778,800	
高千穂交易	3,100	4,030.00	12,493,000	
アスクル	18,400	1,628.00	29,955,200	
ゲオホールディングス	8,700	1,738.00	15,120,600	
アダストリア	10,700	3,025.00	32,367,500	
リガク・ホールディングス	37,100	1,133.00	42,034,300	

伊藤忠食品	1,800	7,400.00	13,320,000	
くら寿司	9,100	3,090.00	28,119,000	
キャンドウ	2,800	3,315.00	9,282,000	
パルグループホールディングス	17,800	3,230.00	57,494,000	
エディオン	33,800	1,722.00	58,203,600	
あらた	11,900	3,165.00	37,663,500	
サーラコーポレーション	16,300	775.00	12,632,500	
トーメンデバイス	1,100	6,100.00	6,710,000	
ハローズ	3,100	3,940.00	12,214,000	
J Pホールディングス	19,300	534.00	10,306,200	
フジオフードグループ本社	9,700	1,160.00	11,252,000	
あみやき亭	5,600	1,561.00	8,741,600	
東京エレクトロン デバイス	7,700	3,235.00	24,909,500	
円谷フィールズホールディングス	12,600	1,557.00	19,618,200	
双日	86,500	3,245.00	280,692,500	
アルフレッサ ホールディングス	72,400	2,004.00	145,089,600	
大黒天物産	2,800	6,990.00	19,572,000	
ハニーズホールディングス	6,900	1,634.00	11,274,600	
キッコーマン	239,500	1,427.50	341,886,250	
味の素	167,500	5,967.00	999,472,500	
ブルドックソース	4,000	1,760.00	7,040,000	
キュービー	38,800	2,802.50	108,737,000	
ハウス食品グループ本社	24,300	2,767.50	67,250,250	
カゴメ	30,900	2,832.50	87,524,250	
アリアケジャパン	7,200	5,970.00	42,984,000	
エバラ食品工業	2,400	2,853.00	6,847,200	
キオクシアホールディングス	33,300	2,385.00	79,420,500	
ニチレイ	28,200	3,505.00	98,841,000	
横浜冷凍	19,500	876.00	17,082,000	
東洋水産	33,500	9,159.00	306,826,500	
イートアンドホールディングス	3,700	2,105.00	7,788,500	
日清食品ホールディングス	91,400	2,913.00	266,248,200	
フジッコ	7,400	1,628.00	12,047,200	
ロック・フィールド	8,100	1,558.00	12,619,800	
日本たばこ産業	439,300	3,713.00	1,631,120,900	
ケンコーマヨネーズ	4,500	1,861.00	8,374,500	
わらべや日洋ホールディングス	4,800	2,101.00	10,084,800	
なとり	4,500	2,160.00	9,720,000	
ファーマフーズ	9,600	937.00	8,995,200	
北の達人コーポレーション	41,100	170.00	6,987,000	
ユーグレナ	44,900	481.00	21,596,900	
紀文食品	6,300	1,041.00	6,558,300	
ピククルスホールディングス	6,800	1,018.00	6,922,400	
S R Eホールディングス	2,700	3,190.00	8,613,000	
片倉工業	6,800	1,965.00	13,362,000	
グンゼ	5,200	5,060.00	26,312,000	
ヒューリック	168,700	1,348.50	227,491,950	
アルペン	7,500	2,193.00	16,447,500	
ラクーンホールディングス	7,700	876.00	6,745,200	
クオールホールディングス	9,600	1,571.00	15,081,600	

アルコニックス	11,100	1,483.00	16,461,300	
神戸物産	60,100	3,179.00	191,057,900	
ジンズホールディングス	5,900	6,910.00	40,769,000	
ビックカメラ	46,500	1,610.50	74,888,250	
D C Mホールディングス	40,200	1,360.00	54,672,000	
M o n o t a R O	110,100	2,526.50	278,167,650	
あい ホールディングス	14,000	1,974.00	27,636,000	
J . フロント リテイリング	89,100	1,961.00	174,725,100	
ドトール・日レスホールディングス	13,800	2,345.00	32,361,000	
マツキヨココカラ & カンパニー	136,900	2,342.50	320,688,250	
ブロンコピリー	4,600	3,505.00	16,123,000	
Z O Z O	57,700	4,696.00	270,959,200	
トレジャー・ファクトリー	5,300	1,477.00	7,828,100	
物語コーポレーション	15,100	3,175.00	47,942,500	
三越伊勢丹ホールディングス	116,100	2,300.00	267,030,000	
東洋紡	31,800	964.00	30,655,200	
富士紡ホールディングス	2,900	4,690.00	13,601,000	
日清紡ホールディングス	55,800	895.50	49,968,900	
倉敷紡績	4,900	5,930.00	29,057,000	
ダイワボウホールディングス	34,400	2,634.00	90,609,600	
シキボウ	6,900	1,015.00	7,003,500	
日東紡績	8,300	4,965.00	41,209,500	
トヨタ紡織	30,900	1,961.50	60,610,350	
マクニカホールディングス	60,200	1,840.50	110,798,100	
H a m e e	5,300	1,267.00	6,715,100	
ラクト・ジャパン	3,300	2,876.00	9,490,800	
ウエルシアホールディングス	40,300	2,227.50	89,768,250	
クリエイトS Dホールディングス	11,000	2,806.00	30,866,000	
グリムス	3,300	2,190.00	7,227,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	10,700	1,152.00	12,326,400	
八洲電機	6,300	1,743.00	10,980,900	
レスター	6,600	2,392.00	15,787,200	
T O K A Iホールディングス	42,200	935.00	39,457,000	
三洋貿易	8,000	1,428.00	11,424,000	
シュッピン	7,600	1,008.00	7,660,800	
ピューティガレージ	4,900	1,379.00	6,757,100	
オイシックス・ラ・大地	12,500	1,333.00	16,662,500	
ウイン・パートナーズ	5,700	1,282.00	7,307,400	
ネクステージ	17,700	1,454.00	25,735,800	
ジョイフル本田	21,600	1,902.00	41,083,200	
エターナルホスピタリティグループ	2,900	2,523.00	7,316,700	
ホットランド	5,900	2,073.00	12,230,700	
すかいらーくホールディングス	106,200	2,492.50	264,703,500	
S F Pホールディングス	4,400	2,146.00	9,442,400	
綿半ホールディングス	6,000	1,632.00	9,792,000	
日本毛織	18,800	1,308.00	24,590,400	
ヨシックスホールディングス	2,600	2,787.00	7,246,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	33,200	772.00	25,630,400	

野村不動産ホールディングス	45,300	4,081.00	184,869,300	
三重交通グループホールディングス	15,500	517.00	8,013,500	
ディア・ライフ	12,300	1,057.00	13,001,100	
地主	6,400	2,119.00	13,561,600	
プレサンスコーポレーション	9,600	2,388.00	22,924,800	
J P M C	6,200	1,130.00	7,006,000	
フージャースホールディングス	11,100	1,084.00	12,032,400	
オープンハウスグループ	26,600	5,269.00	140,155,400	
東急不動産ホールディングス	217,400	965.40	209,877,960	
飯田グループホールディングス	69,300	2,229.50	154,504,350	
帝国繊維	8,300	2,406.00	19,969,800	
日本コークス工業	74,800	92.00	6,881,600	
B E E N O S	4,900	3,975.00	19,477,500	
あさひ	6,500	1,445.00	9,392,500	
日本調剤	5,100	1,370.00	6,987,000	
コスモス薬品	15,400	6,791.00	104,581,400	
シップヘルスケアホールディングス	30,700	1,975.00	60,632,500	
ソフトクリエイティブホールディングス	5,300	2,041.00	10,817,300	
セブン＆アイ・ホールディングス	858,100	2,400.00	2,059,440,000	
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	58,400	1,265.00	73,876,000	
明治電機工業	4,600	1,431.00	6,582,600	
ツルハホールディングス	13,600	9,315.00	126,684,000	
サンマルクホールディングス	6,300	2,226.00	14,023,800	
トリドールホールディングス	21,800	3,727.00	81,248,600	
帝人	70,700	1,299.50	91,874,650	
東レ	537,500	984.00	528,900,000	
クラレ	98,100	1,867.00	183,152,700	
旭化成	497,500	1,003.00	498,992,500	
T O K Y O B A S E	20,700	328.00	6,789,600	
稲葉製作所	4,200	1,674.00	7,030,800	
宮地エンジニアリンググループ	9,100	1,805.00	16,425,500	
トーカロ	21,800	1,764.00	38,455,200	
S U M C O	144,300	1,186.50	171,211,950	
川田テクノロジーズ	4,900	3,065.00	15,018,500	
R S T e c h n o l o g i e s	5,900	3,475.00	20,502,500	
A n d D o ホールディングス	5,700	1,194.00	6,805,800	
シーアールイー	3,800	1,698.00	6,452,400	
ケイアイスター不動産	3,900	4,475.00	17,452,500	
ジェイ・エス・ビー	3,000	3,155.00	9,465,000	
ロードスターキャピタル	4,100	2,481.00	10,172,100	
霞ヶ関キャピタル	3,000	14,320.00	42,960,000	
J M ホールディングス	5,600	2,237.00	12,527,200	
コメダホールディングス	20,300	2,681.00	54,424,300	
アレンザホールディングス	6,300	1,093.00	6,885,900	
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,334.00	6,936,800	
パロックジャパンリミテッド	9,100	775.00	7,052,500	
クスリのアオキホールディングス	20,200	3,132.00	63,266,400	
力の源ホールディングス	5,800	1,375.00	7,975,000	

FOOD & LIFE COMPANIES	41,400	4,187.00	173,341,800	
セーレン	14,200	2,642.00	37,516,400	
小松マテーレ	10,700	793.00	8,485,100	
ワコールホールディングス	15,200	5,166.00	78,523,200	
ホギメディカル	9,900	4,840.00	47,916,000	
T S Iホールディングス	23,200	1,235.00	28,652,000	
ワールド	11,300	2,330.00	26,329,000	
T I S	77,800	3,810.00	296,418,000	
グリーホールディングス	24,700	566.00	13,980,200	
GMOベパボ	4,900	1,445.00	7,080,500	
コーエーテックモホールディングス	55,400	2,020.50	111,935,700	
三菱総合研究所	3,500	4,660.00	16,310,000	
ファインデックス	8,500	747.00	6,349,500	
ブレインパッド	5,500	1,277.00	7,023,500	
ポールトゥウィンホールディングス	15,500	454.00	7,037,000	
ネクソン	161,900	2,020.00	327,038,000	
アイスタイル	22,400	498.00	11,155,200	
エムアップホールディングス	9,000	1,553.00	13,977,000	
エイチーム	7,400	923.00	6,830,200	
セルシス	10,500	1,252.00	13,146,000	
エニグモ	20,400	338.00	6,895,200	
コロブラ	25,000	489.00	12,225,000	
ブロードリーフ	29,600	647.00	19,151,200	
デジタルハーツホールディングス	6,200	1,087.00	6,739,400	
メディアドゥ	4,200	1,739.00	7,303,800	
じげん	18,400	445.00	8,188,000	
フィックスターズ	7,400	1,868.00	13,823,200	
CARTA HOLDINGS	4,600	1,445.00	6,647,000	
オブティム	10,000	715.00	7,150,000	
セレス	3,300	2,739.00	9,038,700	
S H I F T	73,400	1,365.00	100,191,000	
特種東海製紙	3,600	3,705.00	13,338,000	
テクマトリックス	15,900	2,213.00	35,186,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	18,300	3,068.00	56,144,400	
GMOペイメントゲートウェイ	16,800	7,999.00	134,383,200	
システムリサーチ	5,000	1,681.00	8,405,000	
インターネットイニシアティブ	40,200	2,575.00	103,515,000	
さくらインターネット	11,500	4,330.00	49,795,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,000	2,239.00	6,717,000	
S R Aホールディングス	4,200	4,315.00	18,123,000	
朝日ネット	10,300	672.00	6,921,600	
e B A S E	11,600	597.00	6,925,200	
アバントグループ	10,300	1,911.00	19,683,300	
アドソル日進	3,300	2,142.00	7,068,600	
コムチュア	9,700	1,931.00	18,730,700	
アステリア	11,400	600.00	6,840,000	
アイル	4,100	2,430.00	9,963,000	

王子ホールディングス	278,500	629.50	175,315,750	
日本製紙	38,300	1,016.00	38,912,800	
北越コーポレーション	41,300	1,399.00	57,778,700	
大王製紙	37,100	823.00	30,533,300	
マークラインズ	4,400	2,450.00	10,780,000	
g u m i	13,600	564.00	7,670,400	
テラスカイ	2,800	2,387.00	6,683,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,300	2,540.00	10,922,000	
ネオジャパン	4,100	1,639.00	6,719,900	
P R T I M E S	3,000	2,317.00	6,951,000	
ラクス	34,800	2,147.00	74,715,600	
ダブルスタンダード	4,000	1,630.00	6,520,000	
オープンドア	11,500	616.00	7,084,000	
アカツキ	3,600	2,936.00	10,569,600	
U b i c o mホールディングス	4,800	1,420.00	6,816,000	
カナミックネットワーク	15,100	486.00	7,338,600	
レンゴー	66,900	800.80	53,573,520	
トーモク	4,200	2,401.00	10,084,200	
ザ・パック	5,500	3,375.00	18,562,500	
チェンジホールディングス	18,200	1,336.00	24,315,200	
オークネット	3,400	2,423.00	8,238,200	
マクロミル	14,500	1,247.00	18,081,500	
オロ	3,100	2,624.00	8,134,400	
ユーザーローカル	3,600	1,802.00	6,487,200	
P K S H A T e c h n o l o g y	5,900	4,075.00	24,042,500	
マネーフォワード	18,100	4,439.00	80,345,900	
レゾナック・ホールディングス	66,000	3,513.00	231,858,000	
住友化学	591,500	344.10	203,535,150	
住友精化	3,500	5,020.00	17,570,000	
日産化学	37,800	4,364.00	164,959,200	
ラサ工業	2,800	2,665.00	7,462,000	
クレハ	15,200	2,761.00	41,967,200	
多木化学	2,900	3,470.00	10,063,000	
テイカ	5,300	1,472.00	7,801,600	
石原産業	12,200	1,699.00	20,727,800	
日本曹達	15,600	2,907.00	45,349,200	
東ソー	98,200	2,107.50	206,956,500	
トクヤマ	23,800	2,651.00	63,093,800	
セントラル硝子	9,300	3,225.00	29,992,500	
東亜合成	34,100	1,401.00	47,774,100	
大阪ソーダ	25,700	1,379.00	35,440,300	
関東電化工業	15,800	891.00	14,077,800	
デンカ	26,700	2,089.50	55,789,650	
イビデン	42,500	3,624.00	154,020,000	
信越化学工業	654,000	4,628.00	3,026,712,000	
日本カーバイド工業	3,900	1,911.00	7,452,900	
プラスアルファ・コンサルティング	9,300	1,479.00	13,754,700	
電算システムホールディングス	3,300	2,404.00	7,933,200	
堺化学工業	5,100	2,727.00	13,907,700	

第一稀元素化学工業	9,700	694.00	6,731,800	
エア・ウォーター	69,400	1,890.00	131,166,000	
日本酸素ホールディングス	71,300	4,308.00	307,160,400	
日本パーカライジング	32,800	1,280.00	41,984,000	
高压ガス工業	10,700	854.00	9,137,800	
四国化成ホールディングス	8,300	1,933.00	16,043,900	
ステラ ケミファ	4,000	4,275.00	17,100,000	
保土谷化学工業	2,300	3,140.00	7,222,000	
日本触媒	47,100	1,809.00	85,203,900	
大日精化工業	5,100	3,065.00	15,631,500	
カネカ	18,200	3,716.00	67,631,200	
協和キリン	86,600	2,037.50	176,447,500	
A P P I E R G R O U P	22,500	1,740.00	39,150,000	
三菱瓦斯化学	59,600	2,349.50	140,030,200	
三井化学	66,200	3,350.00	221,770,000	
東京応化工業	35,100	3,736.00	131,133,600	
大阪有機化学工業	6,200	2,596.00	16,095,200	
三菱ケミカルグループ	537,600	762.80	410,081,280	
K H ネオケム	13,300	2,502.00	33,276,600	
ピジョナル	8,700	7,497.00	65,223,900	
ダイセル	83,600	1,328.50	111,062,600	
住友ベークライト	23,200	3,471.00	80,527,200	
積水化学工業	146,400	2,500.00	366,000,000	
日本ゼオン	56,700	1,489.00	84,426,300	
アイカ工業	18,600	3,322.00	61,789,200	
U B E	37,900	2,200.50	83,398,950	
積水樹脂	9,600	1,860.00	17,856,000	
旭有機材	4,900	4,010.00	19,649,000	
ニチバン	4,600	2,008.00	9,236,800	
リケンテクノス	13,200	998.00	13,173,600	
大倉工業	3,400	3,565.00	12,121,000	
積水化成品工業	19,400	353.00	6,848,200	
群栄化学工業	2,500	2,710.00	6,775,000	
ダイキョーニシカワ	16,200	608.00	9,849,600	
森六ホールディングス	4,100	2,000.00	8,200,000	
恵和	6,800	1,270.00	8,636,000	
日本化薬	49,800	1,343.50	66,906,300	
カーリット	7,300	1,085.00	7,920,500	
プレステージ・インターナショナル	35,300	710.00	25,063,000	
プロトコーポレーション	8,100	2,170.00	17,577,000	
ハイマックス	5,100	1,361.00	6,941,100	
アミューズ	4,600	1,545.00	7,107,000	
野村総合研究所	159,600	5,161.00	823,695,600	
ドリームインキュベータ	1,800	4,000.00	7,200,000	
クイック	5,200	1,893.00	9,843,600	
日本システム技術	6,800	2,040.00	13,872,000	
電通グループ	80,300	3,065.00	246,119,500	
インテージホールディングス	4,200	1,720.00	7,224,000	
ぴあ	2,600	3,170.00	8,242,000	
イオンファンタジー	3,300	2,994.00	9,880,200	

ソースネクスト	37,600	219.00	8,234,400	
シーティーエス	10,400	820.00	8,528,000	
メディカルシステムネットワーク	16,800	407.00	6,837,600	
日本精化	4,900	2,196.00	10,760,400	
扶桑化学工業	6,800	3,545.00	24,106,000	
トリケミカル研究所	8,000	3,795.00	30,360,000	
シンプレクス・ホールディングス	14,500	2,799.00	40,585,500	
ラクスル	17,800	1,250.00	22,250,000	
メルカリ	40,600	2,253.00	91,471,800	
A D E K A	25,600	2,765.00	70,784,000	
日油	86,600	2,106.00	182,379,600	
ハリマ化成グループ	8,100	860.00	6,966,000	
ウイングアーク 1 s t	7,700	3,595.00	27,681,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,300	924.00	3,049,200	
S a n s a n	20,800	2,385.00	49,608,000	
ギフトィ	6,500	1,537.00	9,990,500	
花王	179,100	6,451.00	1,155,374,100	
第一工業製薬	2,600	2,692.00	6,999,200	
石原ケミカル	3,200	2,132.00	6,822,400	
三洋化成工業	4,500	3,980.00	17,910,000	
メドレー	8,100	2,963.00	24,000,300	
ベース	3,600	3,300.00	11,880,000	
J M D C	9,000	3,175.00	28,575,000	
武田薬品工業	655,200	4,161.00	2,726,287,200	
アステラス製薬	645,900	1,453.50	938,815,650	
住友ファーマ	65,500	767.00	50,238,500	
塩野義製薬	244,200	2,198.00	536,751,600	
日本新薬	19,300	3,851.00	74,324,300	
中外製薬	230,500	7,356.00	1,695,558,000	
科研製薬	12,700	4,400.00	55,880,000	
エーザイ	96,100	4,242.00	407,656,200	
理研ビタミン	6,200	2,325.00	14,415,000	
ロート製薬	77,900	2,282.50	177,806,750	
小野薬品工業	150,600	1,524.50	229,589,700	
久光製薬	16,400	4,237.00	69,486,800	
持田製薬	9,300	3,090.00	28,737,000	
参天製薬	133,400	1,407.50	187,760,500	
扶桑薬品工業	2,900	2,425.00	7,032,500	
ツムラ	25,300	4,355.00	110,181,500	
テルモ	491,100	2,683.00	1,317,621,300	
H . U . グループホールディングス	22,100	2,608.00	57,636,800	
キッセイ薬品工業	11,900	3,630.00	43,197,000	
生化学工業	14,000	772.00	10,808,000	
栄研化学	11,600	2,143.00	24,858,800	
鳥居薬品	4,000	4,175.00	16,700,000	
J C R ファーマ	24,900	530.00	13,197,000	
東和薬品	9,900	2,855.00	28,264,500	
富士製薬工業	5,500	1,348.00	7,414,000	
ゼリア新薬工業	11,700	1,994.00	23,329,800	

ネクセラファーマ	34,600	845.00	29,237,000	
第一三共	695,000	3,417.00	2,374,815,000	
杏林製薬	16,000	1,341.00	21,456,000	
ダイト	5,100	2,045.00	10,429,500	
大塚ホールディングス	181,900	7,132.00	1,297,310,800	
ペプチドリーム	35,700	2,092.00	74,684,400	
大日本塗料	8,200	1,221.00	10,012,200	
日本ペイントホールディングス	325,400	1,032.00	335,812,800	
関西ペイント	61,600	2,195.50	135,242,800	
中国塗料	16,600	2,181.00	36,204,600	
藤倉化成	13,900	492.00	6,838,800	
太陽ホールディングス	12,800	4,080.00	52,224,000	
D I C	26,100	3,230.00	84,303,000	
サカタインクス	16,400	1,783.00	29,241,200	
a r t i e n c e	13,200	2,991.00	39,481,200	
アルプス技研	6,600	2,502.00	16,513,200	
日本空調サービス	8,100	992.00	8,035,200	
オリエンタルランド	444,900	3,056.00	1,359,614,400	
フォーカスシステムズ	6,300	1,074.00	6,766,200	
ダスキン	16,500	3,670.00	60,555,000	
パーク 2 4	56,400	2,033.50	114,689,400	
明光ネットワークジャパン	9,400	745.00	7,003,000	
ファルコホールディングス	3,000	2,341.00	7,023,000	
クレスコ	12,100	1,118.00	13,527,800	
フジ・メディア・ホールディングス	70,700	2,733.00	193,223,100	
ラウンドワン	71,300	1,180.00	84,134,000	
リゾートトラスト	29,800	3,030.00	90,294,000	
オービック	136,700	4,411.00	602,983,700	
ジャストシステム	10,600	3,715.00	39,379,000	
T D C ソフト	12,400	1,355.00	16,802,000	
L I N E ヤフー	1,178,200	479.30	564,711,260	
ビー・エム・エル	9,300	2,843.00	26,439,900	
トレンドマイクロ	38,700	11,480.00	444,276,000	
I D ホールディングス	5,000	1,893.00	9,465,000	
リソー教育	47,200	275.00	12,980,000	
日本オラクル	14,100	14,610.00	206,001,000	
早稲田アカデミー	4,200	2,000.00	8,400,000	
アルファシステムズ	2,300	3,310.00	7,613,000	
フューチャー	18,300	1,786.00	32,683,800	
C A C H o l d i n g s	4,500	1,995.00	8,977,500	
ユー・エス・エス	155,200	1,373.50	213,167,200	
オービックビジネスコンサルタント	12,400	7,337.00	90,978,800	
アイティフォー	8,600	1,278.00	10,990,800	
東京個別指導学院	19,600	350.00	6,860,000	
東計電算	2,100	4,410.00	9,261,000	
サイバーエージェント	166,800	1,166.50	194,572,200	
楽天グループ	532,400	974.30	518,717,320	
クリーク・アンド・リバー社	4,100	1,765.00	7,236,500	
S B I グローバルアセットマネジメント	14,800	699.00	10,345,200	

テー・オー・ダブリュー	21,700	311.00	6,748,700	
大塚商会	83,500	3,476.00	290,246,000	
サイボウズ	10,100	3,090.00	31,209,000	
山田コンサルティンググループ	3,800	1,755.00	6,669,000	
セントラルスポーツ	2,900	2,419.00	7,015,100	
パラカ	3,800	1,803.00	6,851,400	
電通総研	7,200	6,150.00	44,280,000	
A C C E S S	7,700	1,042.00	8,023,400	
デジタルガレージ	11,800	4,600.00	54,280,000	
イーエムシステムズ	11,600	800.00	9,280,000	
ウェザーニューズ	5,900	3,575.00	21,092,500	
C I J	20,200	472.00	9,534,400	
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,940.00	7,092,000	
WOWOW	6,900	1,004.00	6,927,600	
スカラ	17,400	415.00	7,221,000	
フルキャストホールディングス	6,200	1,618.00	10,031,600	
エン・ジャパン	12,300	1,679.00	20,651,700	
セルソース	8,300	835.00	6,930,500	
あすか製薬ホールディングス	6,700	1,948.00	13,051,600	
サワイグループホールディングス	43,300	2,059.00	89,154,700	
富士フイルムホールディングス	444,000	3,024.00	1,342,656,000	
コニカミノルタ	165,600	533.00	88,264,800	
資生堂	153,700	2,667.00	409,917,900	
ライオン	93,700	1,800.00	168,660,000	
高砂香料工業	5,000	6,650.00	33,250,000	
マンダム	14,600	1,237.00	18,060,200	
ミルボン	11,800	2,935.00	34,633,000	
コーセー	15,000	6,200.00	93,000,000	
コタ	7,500	1,510.00	11,325,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	37,700	1,223.00	46,107,100	
ノエビアホールディングス	6,600	4,160.00	27,456,000	
新日本製薬	4,200	2,181.00	9,160,200	
エスター	6,000	1,478.00	8,868,000	
コニシ	23,200	1,206.00	27,979,200	
長谷川香料	14,100	2,687.00	37,886,700	
小林製薬	19,300	5,653.00	109,102,900	
荒川化学工業	6,800	1,161.00	7,894,800	
メック	6,100	2,621.00	15,988,100	
日本高純度化学	2,200	3,130.00	6,886,000	
タカラバイオ	23,100	890.00	20,559,000	
J C U	8,100	3,730.00	30,213,000	
デクセリアルズ	64,500	2,260.00	145,770,000	
アース製薬	6,800	5,000.00	34,000,000	
北興化学工業	6,600	1,296.00	8,553,600	
大成ラミック	2,700	2,500.00	6,750,000	
クミアイ化学工業	29,300	756.00	22,150,800	
日本農薬	11,300	763.00	8,621,900	
ニチレキグループ	7,800	2,260.00	17,628,000	
ユシロ化学工業	3,800	2,059.00	7,824,200	
富士石油	18,800	326.00	6,128,800	

出光興産	344,100	1,027.50	353,562,750	
E N E O S ホールディングス	1,249,000	846.10	1,056,778,900	
コスモエネルギーホールディングス	24,300	6,715.00	163,174,500	
A N Y C O L O R	10,000	3,130.00	31,300,000	
テスホールディングス	22,900	275.00	6,297,500	
インフロニア・ホールディングス	75,500	1,144.00	86,372,000	
横浜ゴム	37,200	3,352.00	124,694,400	
T O Y O T I R E	42,300	2,486.00	105,157,800	
ブリヂストン	215,600	5,859.00	1,263,200,400	
住友ゴム工業	72,300	1,710.00	123,633,000	
藤倉コンポジット	7,100	1,438.00	10,209,800	
オカモト	3,900	4,980.00	19,422,000	
アキレス	4,700	1,460.00	6,862,000	
フコク	4,400	1,604.00	7,057,600	
ニッタ	7,200	3,560.00	25,632,000	
住友理工	14,300	1,683.00	24,066,900	
三ツ星ベルト	10,200	3,810.00	38,862,000	
バンドー化学	10,900	1,721.00	18,758,900	
A G C	71,600	4,463.00	319,550,800	
日本板硝子	37,700	393.00	14,816,100	
有沢製作所	11,100	1,418.00	15,739,800	
日本電気硝子	27,300	3,560.00	97,188,000	
オハラ	6,300	1,062.00	6,690,600	
住友大阪セメント	12,800	3,502.00	44,825,600	
太平洋セメント	45,400	3,978.00	180,601,200	
日本ヒューム	6,400	1,982.00	12,684,800	
日本コンクリート工業	19,100	359.00	6,856,900	
三谷セキサン	2,600	5,840.00	15,184,000	
アジアパイルホールディングス	10,500	892.00	9,366,000	
東海カーボン	67,900	914.20	62,074,180	
日本カーボン	4,200	4,090.00	17,178,000	
東洋炭素	5,200	3,920.00	20,384,000	
ノリタケ	8,200	3,550.00	29,110,000	
T O T O	53,400	3,996.00	213,386,400	
日本碍子	81,800	1,864.50	152,516,100	
日本特殊陶業	60,200	4,476.00	269,455,200	
M A R U W A	3,100	37,020.00	114,762,000	
品川リフラクトリーズ	9,100	1,769.00	16,097,900	
黒崎播磨	5,000	2,585.00	12,925,000	
ヨータイ	100	1,702.00	170,200	
フジミインコーポレーテッド	19,800	2,076.00	41,104,800	
ニチアス	18,600	4,503.00	83,755,800	
日本製鉄	383,600	3,380.00	1,296,568,000	
神戸製鋼所	152,300	1,750.00	266,525,000	
中山製鋼所	15,600	755.00	11,778,000	
合同製鐵	4,200	3,875.00	16,275,000	
J F E ホールディングス	228,200	1,800.00	410,760,000	
東京製鐵	21,200	1,562.00	33,114,400	
共英製鋼	7,400	1,969.00	14,570,600	
大和工業	14,300	8,103.00	115,872,900	

東京鐵鋼	3,300	5,780.00	19,074,000	
大阪製鐵	3,500	2,664.00	9,324,000	
淀川製鋼所	7,000	5,950.00	41,650,000	
中部鋼鈹	5,000	2,176.00	10,880,000	
丸一鋼管	23,100	3,450.00	79,695,000	
モリ工業	1,900	4,515.00	8,578,500	
大同特殊鋼	47,700	1,203.50	57,406,950	
日本冶金工業	5,100	4,170.00	21,267,000	
山陽特殊製鋼	7,500	2,745.00	20,587,500	
愛知製鋼	4,400	7,180.00	31,592,000	
大平洋金属	7,000	1,557.00	10,899,000	
新日本電工	45,200	277.00	12,520,400	
栗本鐵工所	3,500	4,950.00	17,325,000	
日本製鋼所	22,500	5,322.00	119,745,000	
三菱製鋼	5,600	1,673.00	9,368,800	
日本精線	6,000	1,330.00	7,980,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,100	384.00	2,726,400	
大紀アルミニウム工業所	10,800	999.00	10,789,200	
日本輕金属ホールディングス	22,200	1,559.00	34,609,800	
三井金属鈹業	19,000	4,315.00	81,985,000	
三菱マテリアル	54,200	2,342.00	126,936,400	
住友金属鈹山	95,900	3,389.00	325,005,100	
D O W Aホールディングス	20,500	4,607.00	94,443,500	
古河機械金属	10,000	2,263.00	22,630,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,100	1,928.00	25,256,800	
東邦チタニウム	15,700	1,002.00	15,731,400	
U A C J	10,700	5,010.00	53,607,000	
C Kサンエツ	1,900	3,825.00	7,267,500	
古河電気工業	25,300	7,122.00	180,186,600	
住友電気工業	261,600	2,776.50	726,332,400	
フジクラ	81,300	6,734.00	547,474,200	
S W C C	10,200	6,400.00	65,280,000	
平河ヒューテック	4,800	1,457.00	6,993,600	
いよぎんホールディングス	94,700	1,590.00	150,573,000	
しずおかフィナンシャルグループ	159,300	1,540.00	245,322,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	60,900	1,574.00	95,856,600	
楽天銀行	33,500	5,860.00	196,310,000	
京都フィナンシャルグループ	91,000	2,133.50	194,148,500	
リョービ	8,100	2,197.00	17,795,700	
A R Eホールディングス	30,600	1,873.00	57,313,800	
東洋製罐グループホールディングス	48,300	2,333.50	112,708,050	
ホッカンホールディングス	4,100	1,672.00	6,855,200	
コロナ	7,400	938.00	6,941,200	
横河ブリッジホールディングス	13,000	2,570.00	33,410,000	
三和ホールディングス	74,800	4,938.00	369,362,400	
文化シャッター	19,800	1,854.00	36,709,200	
三協立山	11,500	597.00	6,865,500	
アルインコ	6,600	1,031.00	6,804,600	
L I X I L	110,400	1,728.00	190,771,200	
ノーリツ	10,700	1,673.00	17,901,100	

長府製作所	8,500	1,868.00	15,878,000	
リンナイ	40,300	3,428.00	138,148,400	
ユニプレス	13,200	1,041.00	13,741,200	
日東精工	12,000	591.00	7,092,000	
岡部	13,500	819.00	11,056,500	
ジーテクト	8,400	1,609.00	13,515,600	
東ブレ	13,300	1,815.00	24,139,500	
高周波熱錬	11,200	995.00	11,144,000	
サンコール	26,500	417.00	11,050,500	
パイオラックス	10,200	2,364.00	24,112,800	
エイチワン	7,800	1,084.00	8,455,200	
日本発条	67,000	1,745.50	116,948,500	
中央発條	4,900	1,549.00	7,590,100	
三浦工業	34,400	3,220.00	110,768,000	
タクマ	25,100	1,814.00	45,531,400	
テクノプロ・ホールディングス	45,900	3,060.00	140,454,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,200	742.00	6,826,400	
K e e P e r 技研	4,700	3,935.00	18,494,500	
イー・ガーディアン	3,600	1,935.00	6,966,000	
ジャパンマテリアル	23,100	1,510.00	34,881,000	
ベクトル	10,300	975.00	10,042,500	
チャーム・ケア・コーポレーション	6,300	1,280.00	8,064,000	
キャリアリンク	2,800	2,305.00	6,454,000	
I B J	10,400	693.00	7,207,200	
アサンテ	4,200	1,643.00	6,900,600	
バリューHR	6,800	1,436.00	9,764,800	
M & A キャピタルパートナーズ	6,100	2,985.00	18,208,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,040.00	7,072,000	
シグマクシス・ホールディングス	22,000	968.00	21,296,000	
ウィルグループ	6,900	995.00	6,865,500	
リクルートホールディングス	588,900	9,875.00	5,815,387,500	
エラン	10,000	778.00	7,780,000	
ツガミ	15,800	1,660.00	26,228,000	
オークマ	13,000	3,320.00	43,160,000	
芝浦機械	9,500	3,580.00	34,010,000	
アマダ	103,000	1,459.00	150,277,000	
アイダエンジニアリング	16,600	809.00	13,429,400	
F U J I	32,200	2,190.50	70,534,100	
牧野フライス製作所	8,300	11,650.00	96,695,000	
オーエスジー	32,700	1,688.50	55,213,950	
旭ダイヤモンド工業	18,500	844.00	15,614,000	
D M G 森精機	46,800	2,587.50	121,095,000	
ソディック	19,600	916.00	17,953,600	
ディスコ	35,700	46,300.00	1,652,910,000	
日東工器	3,200	2,102.00	6,726,400	
日進工具	9,200	755.00	6,946,000	
日本郵政	845,300	1,591.00	1,344,872,300	
ベルシステム24ホールディングス	8,100	1,264.00	10,238,400	

鎌倉新書	13,300	505.00	6,716,500	
エアトリ	5,500	1,152.00	6,336,000	
アトラエ	8,700	763.00	6,638,100	
ストライク	3,700	3,205.00	11,858,500	
ソラスト	20,800	472.00	9,817,600	
インソース	16,400	986.00	16,170,400	
豊田自動織機	62,700	12,660.00	793,782,000	
リケンN P R	9,300	2,589.00	24,077,700	
島精機製作所	11,800	931.00	10,985,800	
オプトラン	12,200	1,743.00	21,264,600	
イワキ	4,900	2,442.00	11,965,800	
フリーー	7,000	1,072.00	7,504,000	
ヤマシンフィルタ	15,700	617.00	9,686,900	
日阪製作所	9,000	1,032.00	9,288,000	
やまびこ	12,100	2,416.00	29,233,600	
野村マイクロ・サイエンス	12,300	2,569.00	31,598,700	
平田機工	3,500	4,910.00	17,185,000	
P E G A S U S	14,000	495.00	6,930,000	
タツモ	5,300	2,290.00	12,137,000	
ナブテスコ	46,500	2,398.00	111,507,000	
三井海洋開発	9,400	4,245.00	39,903,000	
レオン自動機	7,800	1,306.00	10,186,800	
S M C	22,200	54,730.00	1,215,006,000	
ホソカワミクロン	5,200	3,825.00	19,890,000	
ユニオンツール	3,300	4,550.00	15,015,000	
オイレス工業	10,100	2,260.00	22,826,000	
日精エー・エス・ビー機械	2,500	5,300.00	13,250,000	
サトーホールディングス	9,200	2,072.00	19,062,400	
技研製作所	7,000	1,424.00	9,968,000	
日本エアーテック	6,300	1,070.00	6,741,000	
日精樹脂工業	7,300	940.00	6,862,000	
ワイエイシイホールディングス	7,600	994.00	7,554,400	
小松製作所	365,500	4,654.00	1,701,037,000	
住友重機械工業	43,900	2,962.00	130,031,800	
日立建機	29,500	3,897.00	114,961,500	
日工	11,000	697.00	7,667,000	
巴工業	2,900	3,650.00	10,585,000	
井関農機	7,400	1,011.00	7,481,400	
T O W A	22,700	1,620.00	36,774,000	
北川鉄工所	5,600	1,205.00	6,748,000	
ローツェ	38,700	1,759.50	68,092,650	
クボタ	379,200	1,952.00	740,198,400	
荏原実業	3,500	4,025.00	14,087,500	
東洋エンジニアリング	10,600	716.00	7,589,600	
三菱化工機	2,600	3,820.00	9,932,000	
月島ホールディングス	10,000	1,582.00	15,820,000	
帝国電機製作所	5,100	2,922.00	14,902,200	
新東工業	16,500	901.00	14,866,500	
澁谷工業	7,000	3,315.00	23,205,000	
アイチコーポレーション	12,300	1,481.00	18,216,300	

小森コーポレーション	18,300	1,290.00	23,607,000	
鶴見製作所	5,700	3,105.00	17,698,500	
酒井重工業	2,900	2,262.00	6,559,800	
荏原製作所	152,200	2,630.00	400,286,000	
西島製作所	6,400	2,374.00	15,193,600	
北越工業	7,500	2,049.00	15,367,500	
ダイキン工業	96,600	15,950.00	1,540,770,000	
オルガノ	11,500	7,270.00	83,605,000	
トーヨーカネツ	2,600	3,870.00	10,062,000	
栗田工業	41,500	4,946.00	205,259,000	
椿本チエイン	33,600	1,848.00	62,092,800	
日機装	19,000	1,225.00	23,275,000	
木村化工機	8,500	796.00	6,766,000	
レイズネクスト	10,400	1,559.00	16,213,600	
アネスト岩田	12,600	1,241.00	15,636,600	
ダイフク	125,200	3,947.00	494,164,400	
タダノ	42,700	1,087.00	46,414,900	
フジテック	23,800	5,750.00	136,850,000	
C K D	20,500	2,311.00	47,375,500	
平和	24,700	2,293.00	56,637,100	
理想科学工業	11,900	1,426.00	16,969,400	
S A N K Y O	85,700	2,047.00	175,427,900	
日本金銭機械	9,000	1,162.00	10,458,000	
マースグループホールディングス	5,000	3,170.00	15,850,000	
フクシマガリレイ	10,900	2,711.00	29,549,900	
ダイコク電機	3,200	2,624.00	8,396,800	
竹内製作所	13,500	5,480.00	73,980,000	
アマノ	21,000	3,772.00	79,212,000	
ジャノメ	7,000	999.00	6,993,000	
ブラザー工業	99,100	2,639.50	261,574,450	
マックス	8,900	4,065.00	36,178,500	
モリタホールディングス	11,600	2,101.00	24,371,600	
グローリー	19,400	2,597.00	50,381,800	
新晃工業	21,200	1,264.00	26,796,800	
大和冷機工業	11,400	1,557.00	17,749,800	
セガサミーホールディングス	66,200	2,926.50	193,734,300	
T P R	9,400	2,316.00	21,770,400	
ツバキ・ナカシマ	18,300	486.00	8,893,800	
ホシザキ	47,700	5,802.00	276,755,400	
大豊工業	11,000	630.00	6,930,000	
日本精工	137,300	634.70	87,144,310	
N T N	175,500	238.00	41,769,000	
ジェイテクト	66,000	1,138.00	75,108,000	
不二越	5,500	3,295.00	18,122,500	
ミネベアミツミ	129,000	2,294.00	295,926,000	
日本トムソン	20,200	487.00	9,837,400	
T H K	42,800	3,704.00	158,531,200	
ユーシン精機	10,500	649.00	6,814,500	
前澤給装工業	5,300	1,373.00	7,276,900	
イーグル工業	8,200	1,999.00	16,391,800	

P I L L A R	6,900	3,640.00	25,116,000	
キット	24,000	1,162.00	27,888,000	
日立製作所	1,909,500	4,317.00	8,243,311,500	
三菱電機	754,200	2,364.00	1,782,928,800	
富士電機	45,100	6,783.00	305,913,300	
安川電機	80,500	4,297.00	345,908,500	
シンフォニア テクノロジー	7,400	6,210.00	45,954,000	
明電舎	12,500	4,590.00	57,375,000	
山洋電気	3,200	9,250.00	29,600,000	
デンヨー	5,600	2,611.00	14,621,600	
PHCホールディングス	13,900	1,082.00	15,039,800	
KOKUSAI ELECTRIC	52,000	3,500.00	182,000,000	
ソシオネクスト	73,900	2,088.50	154,340,150	
ベйкаレント	55,500	6,697.00	371,683,500	
Orchestra Holdings	8,700	804.00	6,994,800	
アイモバイル	14,100	484.00	6,824,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	29,300	3,020.00	88,486,000	
ミダックホールディングス	4,600	1,886.00	8,675,600	
キュービーネットホールディングス	6,600	1,024.00	6,758,400	
三櫻工業	10,500	643.00	6,751,500	
マキタ	92,300	4,781.00	441,286,300	
東芝テック	11,100	3,030.00	33,633,000	
芝浦メカトロニクス	5,400	9,090.00	49,086,000	
マブチモーター	32,200	2,303.50	74,172,700	
ニデック	327,400	2,778.00	909,517,200	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	23,100	302.00	6,976,200	
トレックス・セミコンダクター	5,800	1,309.00	7,592,200	
東光高岳	4,000	2,033.00	8,132,000	
ダイヘン	7,000	7,270.00	50,890,000	
ヤーマン	14,500	774.00	11,223,000	
JVCケンウッド	58,500	1,425.50	83,391,750	
ミマキエンジニアリング	6,200	1,530.00	9,486,000	
大崎電気工業	15,900	774.00	12,306,600	
オムロン	67,900	4,558.00	309,488,200	
日東工業	10,000	2,942.00	29,420,000	
I D E C	10,900	2,533.00	27,609,700	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	33,100	2,413.50	79,886,850	
メルコホールディングス	1,100	2,365.00	2,601,500	
テクノメディカ	3,900	1,759.00	6,860,100	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	12,400	575.00	7,130,000	
日本電気	104,900	15,295.00	1,604,445,500	
富士通	682,300	2,975.00	2,029,842,500	
沖電気工業	35,900	925.00	33,207,500	
電気興業	4,100	1,614.00	6,617,400	
サンケン電気	7,600	6,527.00	49,605,200	
アイホン	4,500	2,624.00	11,808,000	
ルネサスエレクトロニクス	564,900	2,700.00	1,525,230,000	

セイコーエプソン	95,100	2,449.00	232,899,900	
ワコム	52,100	636.00	33,135,600	
アルバック	16,300	5,632.00	91,801,600	
E I Z O	9,700	2,119.00	20,554,300	
日本信号	16,900	897.00	15,159,300	
京三製作所	17,300	497.00	8,598,100	
能美防災	10,000	3,025.00	30,250,000	
ホーチキ	4,700	2,537.00	11,923,900	
エレコム	17,700	1,605.00	28,408,500	
パナソニック ホールディングス	876,000	1,808.50	1,584,246,000	
シャープ	107,100	965.30	103,383,630	
アンリツ	52,200	1,441.00	75,220,200	
富士通ゼネラル	21,000	2,755.00	57,855,000	
ソニーグループ	2,532,700	3,732.00	9,452,036,400	
T D K	640,400	1,690.50	1,082,596,200	
帝国通信工業	3,200	2,356.00	7,539,200	
タムラ製作所	29,500	570.00	16,815,000	
アルプスアルパイン	60,200	1,551.00	93,370,200	
鈴木	4,000	1,706.00	6,824,000	
メイコー	7,400	7,920.00	58,608,000	
フォスター電機	7,500	1,476.00	11,070,000	
S M K	2,400	2,703.00	6,487,200	
ヨコオ	6,500	1,486.00	9,659,000	
ホシデン	18,200	2,078.00	37,819,600	
ヒロセ電機	10,800	18,220.00	196,776,000	
日本航空電子工業	19,300	2,661.00	51,357,300	
T O A	7,500	942.00	7,065,000	
マクセル	14,200	1,879.00	26,681,800	
古野電気	8,800	2,300.00	20,240,000	
スミダコーポレーション	10,000	959.00	9,590,000	
アイコム	2,900	2,761.00	8,006,900	
リオン	3,000	2,481.00	7,443,000	
横河電機	81,100	2,879.00	233,486,900	
新電元工業	2,800	2,607.00	7,299,600	
アズビル	200,100	1,180.00	236,118,000	
日本光電工業	65,700	2,219.50	145,821,150	
チノー	3,100	2,068.00	6,410,800	
日本電子材料	4,500	2,229.00	10,030,500	
堀場製作所	13,900	9,782.00	135,969,800	
アドバンテスト	231,400	9,580.00	2,216,812,000	
エスベック	6,500	2,356.00	15,314,000	
キーエンス	73,500	62,780.00	4,614,330,000	
日置電機	3,900	7,110.00	27,729,000	
シスメックス	190,100	2,747.00	522,204,700	
日本マイクロニクス	12,100	4,835.00	58,503,500	
メガチップス	5,700	5,030.00	28,671,000	
O B A R A G R O U P	4,600	3,435.00	15,801,000	
I M A G I C A G R O U P	13,400	499.00	6,686,600	
デンソー	719,300	1,906.00	1,370,985,800	
コーセル	9,000	1,018.00	9,162,000	

イリソ電子工業	7,400	2,717.00	20,105,800	
オブテックスグループ	13,500	1,666.00	22,491,000	
千代田インテグレ	2,600	3,110.00	8,086,000	
レーザーテック	28,500	14,690.00	418,665,000	
スタンレー電気	46,000	2,471.50	113,689,000	
ウシオ電機	32,500	2,087.00	67,827,500	
日本セラミック	6,700	2,688.00	18,009,600	
古河電池	5,400	1,382.00	7,462,800	
山一電機	6,000	2,150.00	12,900,000	
図研	6,700	4,670.00	31,289,000	
日本電子	17,000	5,183.00	88,111,000	
カシオ計算機	58,700	1,246.00	73,140,200	
ファナック	355,300	4,424.00	1,571,847,200	
日本シイエムケイ	21,500	486.00	10,449,000	
エンプラス	2,100	4,795.00	10,069,500	
大真空	11,300	593.00	6,700,900	
ローム	133,000	1,667.00	221,711,000	
浜松ホトニクス	117,800	1,684.00	198,375,200	
三井ハイテック	32,500	903.00	29,347,500	
新光電気工業	26,000	5,902.00	153,452,000	
京セラ	456,200	1,725.00	786,945,000	
太陽誘電	32,200	2,623.00	84,460,600	
村田製作所	646,700	2,720.00	1,759,024,000	
双葉電子工業	14,000	528.00	7,392,000	
日東電工	232,800	2,971.50	691,765,200	
東海理化電機製作所	20,700	2,151.00	44,525,700	
ニチコン	19,300	1,241.00	23,951,300	
日本ケミコン	9,000	939.00	8,451,000	
K O A	12,200	1,007.00	12,285,400	
三井E & S	39,600	1,714.00	67,874,400	
カナデビア	60,800	936.00	56,908,800	
三菱重工業	1,296,700	2,162.50	2,804,113,750	
川崎重工業	55,300	8,047.00	444,999,100	
I H I	59,500	9,509.00	565,785,500	
名村造船所	21,000	1,995.00	41,895,000	
プロレド・パートナーズ	16,000	440.00	7,040,000	
アンビスホールディングス	16,200	694.00	11,242,800	
カーブスホールディングス	20,600	672.00	13,843,200	
フォーラムエンジニアリング	8,800	1,075.00	9,460,000	
M a c b e e P l a n e t	2,100	3,300.00	6,930,000	
日本車輛製造	3,300	2,060.00	6,798,000	
三菱ロジスネクスト	11,700	2,002.00	23,423,400	
フルサト・マルカホールディングス	6,200	2,258.00	13,999,600	
ヤマエグループホールディングス	8,400	2,200.00	18,480,000	
F P G	25,600	2,458.00	62,924,800	
全国保証	18,900	5,464.00	103,269,600	
めぶきフィナンシャルグループ	363,000	628.10	228,000,300	
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,700	1,756.00	20,545,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,300	5,160.00	47,988,000	

九州フィナンシャルグループ	127,200	750.80	95,501,760	
かんぽ生命保険	84,200	2,851.00	240,054,200	
ゆうちょ銀行	595,900	1,535.50	915,004,450	
富山第一銀行	23,000	1,010.00	23,230,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	384,700	913.10	351,269,570	
ジェイリース	5,400	1,315.00	7,101,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	44,500	2,033.00	90,468,500	
S B I アルヒ	7,100	841.00	5,971,100	
プレミアグループ	12,200	2,231.00	27,218,200	
日産自動車	917,700	419.10	384,608,070	
いすゞ自動車	226,800	1,970.50	446,909,400	
トヨタ自動車	3,902,900	2,710.50	10,578,810,450	
日野自動車	110,400	482.00	53,212,800	
三菱自動車工業	280,700	404.60	113,571,220	
武蔵精密工業	18,000	2,712.00	48,816,000	
日産車体	11,200	1,027.00	11,502,400	
新明和工業	21,200	1,373.00	29,107,600	
極東開発工業	9,900	2,480.00	24,552,000	
トビー工業	5,900	2,108.00	12,437,200	
ティラド	1,900	3,595.00	6,830,500	
タチエス	13,500	1,768.00	23,868,000	
N O K	28,500	2,310.50	65,849,250	
フタバ産業	22,100	755.00	16,685,500	
カヤバ	12,500	2,923.00	36,537,500	
市光工業	16,900	401.00	6,776,900	
大同メタル工業	14,400	498.00	7,171,200	
プレス工業	28,700	565.00	16,215,500	
太平洋工業	16,800	1,390.00	23,352,000	
アイシン	155,500	1,725.00	268,237,500	
マツダ	225,500	996.00	224,598,000	
本田技研工業	1,739,600	1,366.50	2,377,163,400	
スズキ	593,300	1,944.00	1,153,375,200	
S U B A R U	221,400	2,655.00	587,817,000	
ヤマハ発動機	310,000	1,202.50	372,775,000	
小糸製作所	76,100	1,894.00	144,133,400	
エクセディ	12,000	4,715.00	56,580,000	
ミツバ	13,800	782.00	10,791,600	
豊田合成	21,000	2,652.50	55,702,500	
愛三工業	13,900	1,909.00	26,535,100	
ヨロズ	7,600	1,006.00	7,645,600	
エフ・シー・シー	12,900	3,160.00	40,764,000	
シマノ	31,900	20,125.00	641,987,500	
テイ・エス テック	29,900	1,710.00	51,129,000	
三十三フィナンシャルグループ	6,500	2,357.00	15,320,500	
第四北越フィナンシャルグループ	22,700	2,805.00	63,673,500	
ひろぎんホールディングス	101,700	1,195.00	121,531,500	
おきなわフィナンシャルグループ	5,700	2,526.00	14,398,200	
ダイレクトマーケティングミックス	25,400	294.00	7,467,600	

LITALICO	6,900	1,158.00	7,990,200	
十六フィナンシャルグループ	10,200	4,580.00	46,716,000	
北國フィナンシャルホールディングス	7,100	5,340.00	37,914,000	
ネットプロテクションズホールディングス	24,100	490.00	11,809,000	
プロクレアホールディングス	8,300	1,756.00	14,574,800	
F P パートナー	3,200	2,332.00	7,462,400	
あいちフィナンシャルグループ	13,500	2,787.00	37,624,500	
ジャムコ	4,400	1,782.00	7,840,800	
小野建	8,500	1,475.00	12,537,500	
ノジマ	25,300	2,280.00	57,684,000	
佐島電機	4,900	1,648.00	8,075,200	
カップ・クリエイト	12,200	1,449.00	17,677,800	
伯東	4,400	4,510.00	19,844,000	
コンドーテック	6,000	1,312.00	7,872,000	
ナガイレーベン	9,800	1,794.00	17,581,200	
三菱食品	7,200	4,700.00	33,840,000	
良品計画	92,500	3,920.00	362,600,000	
松田産業	5,900	3,145.00	18,555,500	
第一興商	30,100	1,601.50	48,205,150	
メディバルホールディングス	84,300	2,236.50	188,536,950	
アドヴァングループ	7,300	915.00	6,679,500	
S P K	3,300	2,116.00	6,982,800	
萩原電気ホールディングス	3,300	3,380.00	11,154,000	
アルビス	2,700	2,627.00	7,092,900	
アズワン	24,100	2,418.00	58,273,800	
スズデン	3,600	1,955.00	7,038,000	
シモジマ	5,300	1,299.00	6,884,700	
ドウシシャ	7,200	2,063.00	14,853,600	
高速	4,600	2,096.00	9,641,600	
G - 7 ホールディングス	8,500	1,272.00	10,812,000	
イオン北海道	19,100	847.00	16,177,700	
コジマ	15,000	1,000.00	15,000,000	
コーナン商事	8,600	3,580.00	30,788,000	
ネットワンシステムズ	8,800	4,481.00	39,432,800	
エコス	3,500	1,991.00	6,968,500	
ワタミ	9,400	1,020.00	9,588,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	156,900	4,063.00	637,484,700	
丸文	6,900	1,025.00	7,072,500	
西松屋チェーン	17,200	2,203.00	37,891,600	
ゼンショーホールディングス	44,100	7,657.00	337,673,700	
ハビネット	5,900	4,845.00	28,585,500	
幸楽苑	6,700	1,092.00	7,316,400	
橋本総業ホールディングス	5,800	1,200.00	6,960,000	
日本ライフライン	20,800	1,574.00	32,739,200	
サイゼリヤ	11,500	4,440.00	51,060,000	
タカショー	17,200	396.00	6,811,200	
V T ホールディングス	30,300	491.00	14,877,300	
アルゴグラフィックス	6,800	5,160.00	35,088,000	

魚力	2,900	2,408.00	6,983,200	
I D O M	26,400	1,130.00	29,832,000	
フジ・コーポレーション	3,600	1,886.00	6,789,600	
ユナイテッドアローズ	8,300	2,180.00	18,094,000	
進和	4,700	2,800.00	13,160,000	
ダイترون	3,400	3,255.00	11,067,000	
ハイデイ日高	12,600	2,694.00	33,944,400	
シークス	11,100	1,053.00	11,688,300	
コロワイド	43,800	1,706.00	74,722,800	
オーハシテクニカ	3,600	1,897.00	6,829,200	
壱番屋	30,700	941.00	28,888,700	
白銅	3,000	2,308.00	6,924,000	
スギホールディングス	41,700	2,728.00	113,757,600	
薬王堂ホールディングス	3,800	1,856.00	7,052,800	
島津製作所	105,700	3,894.00	411,595,800	
J M S	14,600	476.00	6,949,600	
長野計器	4,800	2,002.00	9,609,600	
ブイ・テクノロジー	3,600	2,339.00	8,420,400	
スター精密	12,500	1,955.00	24,437,500	
東京計器	5,200	3,365.00	17,498,000	
愛知時計電機	2,700	1,802.00	4,865,400	
インターアクション	6,100	1,191.00	7,265,100	
東京精密	15,000	9,034.00	135,510,000	
マニー	29,400	1,388.50	40,821,900	
ニコン	115,800	1,540.50	178,389,900	
トプコン	41,700	2,830.50	118,031,850	
オリンパス	420,300	2,001.00	841,020,300	
理研計器	10,400	2,886.00	30,014,400	
S C R E E Nホールディングス	30,700	11,160.00	342,612,000	
キャノン電子	7,000	2,457.00	17,199,000	
タムロン	10,100	3,795.00	38,329,500	
H O Y A	143,400	18,200.00	2,609,880,000	
ノーリツ鋼機	7,000	4,590.00	32,130,000	
A & Dホロンホールディングス	9,200	2,030.00	18,676,000	
朝日インテック	89,500	2,696.50	241,336,750	
キャノン	366,200	5,112.00	1,872,014,400	
リコー	193,400	1,520.00	293,968,000	
シチズン時計	67,500	886.00	59,805,000	
メニコン	27,400	1,367.00	37,455,800	
パラマウントベッドホールディングス	15,800	2,637.00	41,664,600	
トランザクション	4,800	2,096.00	10,060,800	
ニホンフラッシュ	8,600	801.00	6,888,600	
前田工織	15,000	1,803.00	27,045,000	
アートネイチャー	9,100	756.00	6,879,600	
フルヤ金属	6,300	2,919.00	18,389,700	
バンダイナムコホールディングス	199,300	4,852.00	967,003,600	
S H O E I	20,600	1,920.00	39,552,000	
フランスベッドホールディングス	10,500	1,270.00	13,335,000	
マーベラス	13,700	511.00	7,000,700	
パイロットコーポレーション	11,200	4,219.00	47,252,800	

萩原工業	4,900	1,500.00	7,350,000	
エイベックス	13,800	1,269.00	17,512,200	
フジシールインターナショナル	16,500	2,760.00	45,540,000	
タカラトミー	30,800	3,824.00	117,779,200	
広済堂ホールディングス	27,700	490.00	13,573,000	
レック	9,400	1,237.00	11,627,800	
三光合成	10,200	655.00	6,681,000	
プロネクス	7,600	1,262.00	9,591,200	
TOPPANホールディングス	96,300	4,597.00	442,691,100	
大日本印刷	152,200	2,140.50	325,784,100	
共同印刷	2,100	4,275.00	8,977,500	
NISSHA	12,600	1,381.00	17,400,600	
ZACROS	5,800	4,215.00	24,447,000	
TAKARA & COMPANY	4,000	3,010.00	12,040,000	
前澤化成工業	5,200	1,786.00	9,287,200	
未来工業	2,600	3,385.00	8,801,000	
アシックス	271,100	3,559.00	964,844,900	
JSP	6,000	2,046.00	12,276,000	
ニチハ	9,200	3,040.00	27,968,000	
ローランド	5,400	3,695.00	19,953,000	
エフピコ	16,300	2,993.00	48,785,900	
小松ウオール工業	4,900	1,498.00	7,340,200	
ヤマハ	131,200	1,073.50	140,843,200	
河合楽器製作所	2,200	3,190.00	7,018,000	
クリナップ	10,500	650.00	6,825,000	
ビジョン	46,800	1,648.50	77,149,800	
天馬	6,100	2,624.00	16,006,400	
キングジム	8,100	851.00	6,893,100	
象印マホービン	21,900	1,530.00	33,507,000	
リンテック	13,900	2,858.00	39,726,200	
信越ポリマー	15,900	1,555.00	24,724,500	
イトーキ	14,700	1,752.00	25,754,400	
任天堂	463,500	11,490.00	5,325,615,000	
三菱鉛筆	10,100	2,616.00	26,421,600	
松風	7,400	2,193.00	16,228,200	
タカラスタANDARD	16,900	1,737.00	29,355,300	
コクヨ	35,000	2,910.00	101,850,000	
ナカバヤシ	3,300	528.00	1,742,400	
ニフコ	27,500	3,650.00	100,375,000	
グローブライト	7,200	1,898.00	13,665,600	
オカムラ	22,100	1,990.00	43,979,000	
バルカー	5,600	3,315.00	18,564,000	
伊藤忠商事	522,200	6,104.00	3,187,508,800	
丸紅	638,300	2,263.00	1,444,472,900	
スクロール	11,600	1,034.00	11,994,400	
ヨンドシーホールディングス	7,300	1,818.00	13,271,400	
三陽商会	3,900	2,807.00	10,947,300	
長瀬産業	34,700	2,731.00	94,765,700	
蝶理	4,200	3,075.00	12,915,000	
豊田通商	233,300	2,406.00	561,319,800	

オンワードホールディングス	47,700	554.00	26,425,800	
三共生興	11,500	631.00	7,256,500	
兼松	32,500	2,465.00	80,112,500	
美津濃	7,300	8,290.00	60,517,000	
ルックホールディングス	3,100	2,267.00	7,027,700	
三井物産	1,141,300	2,720.50	3,104,906,650	
日本紙パルプ商事	37,100	595.00	22,074,500	
東京エレクトロン	155,400	25,200.00	3,916,080,000	
カメイ	8,300	1,912.00	15,869,600	
スターゼン	5,400	2,889.00	15,600,600	
セイコーグループ	11,400	4,860.00	55,404,000	
山善	26,200	1,272.00	33,326,400	
椿本興業	4,300	2,110.00	9,073,000	
住友商事	465,500	3,228.00	1,502,634,000	
B I P R O G Y	24,900	4,301.00	107,094,900	
内田洋行	3,100	6,910.00	21,421,000	
三菱商事	1,435,700	2,369.00	3,401,173,300	
第一実業	7,300	2,380.00	17,374,000	
キヤノンマーケティングジャパン	15,200	5,016.00	76,243,200	
西華産業	3,700	4,400.00	16,280,000	
佐藤商事	5,400	1,473.00	7,954,200	
東京産業	9,400	724.00	6,805,600	
ユアサ商事	6,700	4,495.00	30,116,500	
神鋼商事	1,700	5,920.00	10,064,000	
阪和興業	12,800	4,950.00	63,360,000	
正栄食品工業	5,200	3,775.00	19,630,000	
カナデン	5,800	1,468.00	8,514,400	
R Y O D E N	6,300	2,389.00	15,050,700	
ニプロ	61,200	1,312.50	80,325,000	
岩谷産業	77,200	1,566.00	120,895,200	
極東貿易	4,600	1,664.00	7,654,400	
アステナホールディングス	15,600	437.00	6,817,200	
三愛オブリ	18,200	1,759.00	32,013,800	
稲畑産業	21,000	3,100.00	65,100,000	
G S I クレオス	4,200	2,080.00	8,736,000	
明和産業	11,100	713.00	7,914,300	
ゴールドウイン	13,100	7,211.00	94,464,100	
ユニ・チャーム	460,200	1,125.50	517,955,100	
ワキタ	11,400	1,691.00	19,277,400	
東邦ホールディングス	21,000	4,170.00	87,570,000	
サンゲツ	19,500	2,903.00	56,608,500	
ミツウロコグループホールディングス	9,900	1,822.00	18,037,800	
シナネンホールディングス	2,100	6,010.00	12,621,000	
伊藤忠エネクス	19,300	1,592.00	30,725,600	
サンリオ	63,100	6,917.00	436,462,700	
サンワ テクノス	3,500	2,155.00	7,542,500	
新光商事	10,400	982.00	10,212,800	
トーヨー	3,300	2,649.00	8,741,700	
三信電気	3,300	2,006.00	6,619,800	
東陽テクニカ	7,200	1,406.00	10,123,200	

モスフードサービス	11,400	3,555.00	40,527,000	
加賀電子	15,800	2,688.00	42,470,400	
都築電気	4,400	2,413.00	10,617,200	
ソーダニッカ	7,600	1,112.00	8,451,200	
立花エレテック	4,600	2,502.00	11,509,200	
木曽路	11,800	2,157.00	25,452,600	
S R S ホールディングス	12,800	1,233.00	15,782,400	
リテールパートナーズ	11,500	1,215.00	13,972,500	
上新電機	7,700	2,169.00	16,701,300	
日本瓦斯	37,200	2,209.50	82,193,400	
ロイヤルホールディングス	13,700	2,360.00	32,332,000	
チヨダ	7,400	1,112.00	8,228,800	
ライフコーポレーション	8,100	3,585.00	29,038,500	
リンガーハット	10,000	2,250.00	22,500,000	
M r M a x H D	10,200	682.00	6,956,400	
A O K I ホールディングス	16,700	1,253.00	20,925,100	
オークワ	12,400	775.00	9,610,000	
コメリ	10,500	2,818.00	29,589,000	
青山商事	16,600	2,088.00	34,660,800	
しまむら	18,200	8,949.00	162,871,800	
高島屋	107,900	1,240.00	133,796,000	
松屋	13,200	1,027.00	13,556,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	37,800	2,268.00	85,730,400	
近鉄百貨店	4,400	2,109.00	9,279,600	
丸井グループ	51,600	2,582.50	133,257,000	
クレディセゾン	45,800	3,585.00	164,193,000	
アクシアル リテイリング	21,200	951.00	20,161,200	
イオン	287,300	3,625.00	1,041,462,500	
イズミ	11,800	2,998.00	35,376,400	
平和堂	12,700	2,335.00	29,654,500	
フジ	14,300	2,021.00	28,900,300	
ヤオコー	9,200	9,075.00	83,490,000	
ゼビオホールディングス	10,500	1,228.00	12,894,000	
ケーズホールディングス	52,200	1,388.00	72,453,600	
P A L T A C	12,100	3,921.00	47,444,100	
三谷産業	20,700	330.00	6,831,000	
あおぞら銀行	49,900	2,194.00	109,480,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,638,500	1,972.50	9,149,441,250	
りそなホールディングス	893,100	1,244.00	1,111,016,400	
三井住友トラストグループ	257,500	3,911.00	1,007,082,500	
三井住友フィナンシャルグループ	1,508,500	3,917.00	5,908,794,500	
千葉銀行	223,900	1,343.50	300,809,650	
群馬銀行	125,600	1,051.50	132,068,400	
武蔵野銀行	11,000	3,190.00	35,090,000	
千葉興業銀行	17,100	1,525.00	26,077,500	
筑波銀行	31,700	251.00	7,956,700	
七十七銀行	23,200	4,484.00	104,028,800	
秋田銀行	4,800	2,260.00	10,848,000	
山形銀行	8,000	1,418.00	11,344,000	
岩手銀行	4,600	3,130.00	14,398,000	

東邦銀行	62,400	316.00	19,718,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	63,000	4,011.00	252,693,000	
スルガ銀行	48,700	1,329.00	64,722,300	
八十二銀行	169,300	977.40	165,473,820	
山梨中央銀行	8,100	2,074.00	16,799,400	
大垣共立銀行	13,800	2,226.00	30,718,800	
福井銀行	6,500	1,869.00	12,148,500	
清水銀行	2,100	1,510.00	3,171,000	
滋賀銀行	10,900	4,800.00	52,320,000	
南都銀行	10,900	3,570.00	38,913,000	
百五銀行	68,000	710.00	48,280,000	
紀陽銀行	25,900	2,206.00	57,135,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	40,700	2,150.00	87,505,000	
山陰合同銀行	45,300	1,259.00	57,032,700	
百十四銀行	7,100	3,340.00	23,714,000	
四国銀行	10,600	1,182.00	12,529,200	
阿波銀行	10,100	2,769.00	27,966,900	
大分銀行	4,300	3,375.00	14,512,500	
宮崎銀行	4,700	3,295.00	15,486,500	
佐賀銀行	4,200	2,226.00	9,349,200	
琉球銀行	16,600	1,150.00	19,090,000	
セブン銀行	259,000	301.40	78,062,600	
みずほフィナンシャルグループ	976,000	4,360.00	4,255,360,000	
山口フィナンシャルグループ	70,900	1,665.00	118,048,500	
芙蓉総合リース	6,700	11,110.00	74,437,000	
みずほリース	54,300	1,022.00	55,494,600	
東京センチュリー	54,000	1,428.50	77,139,000	
S B I ホールディングス	116,400	4,553.00	529,969,200	
日本証券金融	26,600	1,794.00	47,720,400	
アイフル	119,700	349.00	41,775,300	
名古屋銀行	4,500	7,480.00	33,660,000	
北洋銀行	98,600	508.00	50,088,800	
愛媛銀行	10,600	1,103.00	11,691,800	
京葉銀行	32,500	826.00	26,845,000	
栃木銀行	33,100	302.00	9,996,200	
北日本銀行	2,500	3,520.00	8,800,000	
東和銀行	13,300	653.00	8,684,900	
リコーリース	6,900	5,250.00	36,225,000	
イオンフィナンシャルサービス	41,500	1,235.00	51,252,500	
アコム	172,000	389.20	66,942,400	
ジャックス	8,700	3,895.00	33,886,500	
オリエントコーポレーション	23,600	809.00	19,092,400	
オリックス	433,600	3,051.00	1,322,913,600	
三菱H C キャピタル	362,500	1,003.00	363,587,500	
ジャフコ グループ	21,500	2,291.00	49,256,500	
トモニホールディングス	69,000	502.00	34,638,000	
大和証券グループ本社	517,000	1,049.50	542,591,500	
野村ホールディングス	1,216,000	1,004.00	1,220,864,000	
岡三証券グループ	57,200	614.00	35,120,800	
丸三証券	24,100	989.00	23,834,900	

東洋証券	21,600	576.00	12,441,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	85,900	498.00	42,778,200	
水戸証券	19,800	550.00	10,890,000	
いちよし証券	14,600	775.00	11,315,000	
松井証券	49,800	802.00	39,939,600	
S O M P Oホールディングス	353,500	4,272.00	1,510,152,000	
日本取引所グループ	430,200	1,578.00	678,855,600	
マネックスグループ	70,800	827.00	58,551,600	
極東証券	9,000	1,630.00	14,670,000	
岩井コスモホールディングス	8,200	2,534.00	20,778,800	
アイザワ証券グループ	10,400	1,802.00	18,740,800	
フィデアホールディングス	7,500	1,532.00	11,490,000	
池田泉州ホールディングス	100,300	417.00	41,825,100	
アニコム ホールディングス	24,600	537.00	13,210,200	
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	529,900	3,043.00	1,612,485,700	
スパークス・グループ	8,100	1,565.00	12,676,500	
第一生命ホールディングス	340,000	4,508.00	1,532,720,000	
東京海上ホールディングス	706,000	5,073.00	3,581,538,000	
イー・ギャランティ	11,800	1,755.00	20,709,000	
N E Cキャピタルソリューション	3,500	3,860.00	13,510,000	
T & Dホールディングス	194,200	3,159.00	613,477,800	
アドバンスクリエイト	5,400	565.00	3,051,000	
三井不動産	993,000	1,267.50	1,258,627,500	
三菱地所	412,100	2,158.00	889,311,800	
平和不動産	11,800	4,720.00	55,696,000	
東京建物	63,200	2,380.00	150,416,000	
京阪神ビルディング	12,200	1,471.00	17,946,200	
住友不動産	117,600	4,989.00	586,706,400	
テーオーシー	12,900	663.00	8,552,700	
レオパレス 2 1	63,300	593.00	37,536,900	
スターツコーポレーション	11,900	4,000.00	47,600,000	
フジ住宅	9,300	725.00	6,742,500	
空港施設	11,600	597.00	6,925,200	
明和地所	6,600	1,047.00	6,910,200	
ゴールドクレスト	4,900	3,040.00	14,896,000	
リログループ	42,000	1,911.00	80,262,000	
エスリード	3,400	4,395.00	14,943,000	
日神グループホールディングス	12,800	534.00	6,835,200	
日本エスコン	18,900	1,022.00	19,315,800	
M I R A R T Hホールディングス	42,400	506.00	21,454,400	
イオンモール	43,700	1,921.50	83,969,550	
カチタス	19,400	2,060.00	39,964,000	
東祥	9,700	679.00	6,586,300	
トーセイ	12,000	2,416.00	28,992,000	
サンフロンティア不動産	12,000	1,950.00	23,400,000	
F Jネクストホールディングス	7,600	1,161.00	8,823,600	
グランディハウス	11,800	587.00	6,926,600	
東武鉄道	77,300	2,575.00	199,047,500	

相鉄ホールディングス	24,300	2,407.50	58,502,250	
東急	205,900	1,680.50	346,014,950	
京浜急行電鉄	90,900	1,530.00	139,077,000	
小田急電鉄	121,400	1,460.00	177,244,000	
京王電鉄	38,800	3,894.00	151,087,200	
京成電鉄	127,800	1,476.50	188,696,700	
富士急行	9,000	2,347.00	21,123,000	
東日本旅客鉄道	404,900	2,839.50	1,149,713,550	
西日本旅客鉄道	181,000	2,932.50	530,782,500	
東海旅客鉄道	282,800	2,884.50	815,736,600	
東京地下鉄	122,800	1,765.00	216,742,000	
西武ホールディングス	79,900	3,098.00	247,530,200	
鴻池運輸	12,500	2,924.00	36,550,000	
西日本鉄道	21,200	2,173.00	46,067,600	
ハマキョウレックス	25,100	1,251.00	31,400,100	
サカイ引越センター	9,300	2,305.00	21,436,500	
近鉄グループホールディングス	78,500	3,293.00	258,500,500	
阪急阪神ホールディングス	97,200	3,635.00	353,322,000	
南海電気鉄道	32,700	2,489.50	81,406,650	
京阪ホールディングス	40,400	3,364.00	135,905,600	
神戸電鉄	2,300	2,443.00	5,618,900	
名古屋鉄道	81,000	1,800.00	145,800,000	
山陽電気鉄道	5,500	2,015.00	11,082,500	
ヤマトホールディングス	89,100	2,001.50	178,333,650	
山九	17,700	5,812.00	102,872,400	
日新	5,000	4,325.00	21,625,000	
丸全昭和運輸	4,500	5,790.00	26,055,000	
センコーグループホールディングス	48,200	1,415.00	68,203,000	
トナミホールディングス	1,600	5,970.00	9,552,000	
ニッコンホールディングス	41,700	2,298.00	95,826,600	
福山通運	7,800	3,690.00	28,782,000	
セイノーホールディングス	36,100	2,233.00	80,611,300	
神奈川中央交通	2,100	3,905.00	8,200,500	
A Z - C O M 丸和ホールディングス	22,700	1,226.00	27,830,200	
日本郵船	151,900	5,257.00	798,538,300	
商船三井	139,400	5,504.00	767,257,600	
川崎汽船	166,800	2,127.00	354,783,600	
N S ユナイテッド海運	4,600	4,060.00	18,676,000	
飯野海運	26,900	1,041.00	28,002,900	
九州旅客鉄道	56,100	3,580.00	200,838,000	
S G ホールディングス	123,100	1,439.50	177,202,450	
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	78,800	2,665.50	210,041,400	
I D & E ホールディングス	5,000	6,470.00	32,350,000	
日本航空	168,000	2,619.00	439,992,000	
A N A ホールディングス	199,400	2,901.50	578,559,100	
サンウェルズ	12,500	792.00	9,900,000	
T R E ホールディングス	17,300	1,518.00	26,261,400	
人・夢・技術グループ	4,300	1,505.00	6,471,500	

西本Wismettacホールディングス	3,300	1,922.00	6,342,600	
シルバーライフ	4,000	798.00	3,192,000	
Genky DrugStores	6,800	2,873.00	19,536,400	
コア商事ホールディングス	9,500	716.00	6,802,000	
KPPグループホールディングス	16,100	684.00	11,012,400	
ブックオフグループホールディングス	5,600	1,327.00	7,431,200	
ギフトホールディングス	3,800	3,750.00	14,250,000	
三菱倉庫	74,600	1,027.00	76,614,200	
三井倉庫ホールディングス	7,500	7,440.00	55,800,000	
住友倉庫	21,800	2,722.00	59,339,600	
澁澤倉庫	3,300	3,120.00	10,296,000	
ヤマタネ	3,100	3,835.00	11,888,500	
乾汽船	9,100	1,457.00	13,258,700	
日本トランスシティ	14,700	947.00	13,920,900	
中央倉庫	3,400	1,417.00	4,817,800	
安田倉庫	5,000	1,785.00	8,925,000	
大栄環境	16,500	2,763.00	45,589,500	
日本管財ホールディングス	7,900	2,563.00	20,247,700	
上組	33,800	3,278.00	110,796,400	
キューソー流通システム	4,900	1,932.00	9,466,800	
エーアイティー	4,600	1,658.00	7,626,800	
内外トランスライン	2,900	2,445.00	7,090,500	
日本コンセプト	3,800	1,849.00	7,026,200	
TBSホールディングス	36,400	4,349.00	158,303,600	
日本テレビホールディングス	65,200	2,822.50	184,027,000	
朝日放送グループホールディングス	100	686.00	68,600	
テレビ朝日ホールディングス	17,900	2,567.00	45,949,300	
スカパーJSATホールディングス	57,200	1,088.00	62,233,600	
テレビ東京ホールディングス	4,500	3,505.00	15,772,500	
ビジョン	11,100	1,158.00	12,853,800	
U-NEXT HOLDINGS	24,800	1,804.00	44,739,200	
日本通信	59,200	161.00	9,531,200	
日本電信電話	21,902,800	146.00	3,197,808,800	
KDDI	541,600	4,871.00	2,638,133,600	
ソフトバンク	11,787,000	210.60	2,482,342,200	
光通信	8,500	36,800.00	312,800,000	
GMOインターネットグループ	24,000	2,858.00	68,592,000	
KADOKAWA	38,900	3,678.00	143,074,200	
学研ホールディングス	13,500	987.00	13,324,500	
ゼンリン	12,600	984.00	12,398,400	
東京電力ホールディングス	617,700	392.00	242,138,400	
中部電力	270,500	1,575.50	426,172,750	
関西電力	358,100	1,712.00	613,067,200	
中国電力	127,600	841.00	107,311,600	
北陸電力	75,100	775.40	58,232,540	
東北電力	193,300	1,049.00	202,771,700	
四国電力	68,400	1,129.00	77,223,600	
九州電力	169,200	1,269.50	214,799,400	
北海道電力	76,800	719.90	55,288,320	

沖縄電力	18,800	911.00	17,126,800	
電源開発	55,300	2,483.00	137,309,900	
イーレックス	14,300	775.00	11,082,500	
レノバ	20,000	724.00	14,480,000	
東京瓦斯	138,900	4,753.00	660,191,700	
大阪瓦斯	144,200	3,326.00	479,609,200	
東邦瓦斯	28,900	4,029.00	116,438,100	
北海道瓦斯	22,000	509.00	11,198,000	
広島ガス	19,800	350.00	6,930,000	
西部ガスホールディングス	7,700	1,639.00	12,620,300	
静岡ガス	16,700	1,011.00	16,883,700	
メタウォーター	10,100	1,954.00	19,735,400	
M & A総研ホールディングス	8,100	1,470.00	11,907,000	
アイネット	4,500	1,941.00	8,734,500	
松竹	4,200	11,560.00	48,552,000	
東宝	46,100	7,119.00	328,185,900	
エイチ・アイ・エス	24,100	1,439.00	34,679,900	
東映	12,200	5,220.00	63,684,000	
N T Tデータグループ	192,500	2,964.50	570,666,250	
共立メンテナンス	23,700	3,022.00	71,621,400	
イチネンホールディングス	7,300	1,695.00	12,373,500	
建設技術研究所	7,800	2,411.00	18,805,800	
スペース	6,400	1,073.00	6,867,200	
アインホールディングス	7,800	4,420.00	34,476,000	
燦ホールディングス	6,300	1,207.00	7,604,100	
ピー・シー・エー	4,800	1,952.00	9,369,600	
スバル興業	2,900	3,355.00	9,729,500	
ビジネスブレイン太田昭和	3,100	2,559.00	7,932,900	
ナガワ	2,000	6,600.00	13,200,000	
東京都競馬	5,500	4,600.00	25,300,000	
カナモト	11,700	3,040.00	35,568,000	
D T S	12,900	4,230.00	54,567,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	37,000	7,176.00	265,512,000	
シーイーシー	9,300	1,854.00	17,242,200	
カブコン	146,300	3,882.00	567,936,600	
ニシオホールディングス	6,200	4,235.00	26,257,000	
アイ・エス・ビー	5,100	1,305.00	6,655,500	
日本空港ビルデング	25,600	4,599.00	117,734,400	
トランス・コスモス	9,600	3,125.00	30,000,000	
乃村工藝社	32,900	887.00	29,182,300	
S C S K	60,100	3,624.00	217,802,400	
藤田観光	3,400	9,620.00	32,708,000	
トーカイ	6,700	2,035.00	13,634,500	
セコム	153,700	5,106.00	784,792,200	
N S W	3,300	2,858.00	9,431,400	
セントラル警備保障	4,100	2,964.00	12,152,400	
アイネス	5,700	1,761.00	10,037,700	
丹青社	16,000	878.00	14,048,000	
メイテックグループホールディングス	27,800	2,980.50	82,857,900	

TKC	13,100	3,815.00	49,976,500	
富士ソフト	20,400	9,795.00	199,818,000	
応用地質	6,800	3,005.00	20,434,000	
船井総研ホールディングス	15,100	2,325.00	35,107,500	
NSD	28,300	3,433.00	97,153,900	
コナミグループ	27,600	18,660.00	515,016,000	
学究社	3,400	2,037.00	6,925,800	
イオンディライト	8,100	4,500.00	36,450,000	
ナック	10,400	677.00	7,040,800	
福井コンピュータホールディングス	5,100	3,020.00	15,402,000	
ダイセキ	18,200	3,665.00	66,703,000	
ステップ	3,200	2,180.00	6,976,000	
泉州電業	5,100	4,960.00	25,296,000	
GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS	4,400	3,165.00	13,926,000	
トラスコ中山	16,300	1,957.00	31,899,100	
ヤマダホールディングス	238,900	432.90	103,419,810	
オートバックスセブン	27,000	1,469.00	39,663,000	
モリト	6,200	1,500.00	9,300,000	
アー克蘭ズ	23,100	1,615.00	37,306,500	
ニトリホールディングス	28,300	15,660.00	443,178,000	
ケーユーホールディングス	6,200	1,105.00	6,851,000	
吉野家ホールディングス	30,400	2,915.00	88,616,000	
加藤産業	9,600	4,300.00	41,280,000	
イノテック	5,300	1,379.00	7,308,700	
イエローハット	13,700	2,876.00	39,401,200	
松屋フーズホールディングス	3,700	5,740.00	21,238,000	
JBCホールディングス	4,900	4,745.00	23,250,500	
JKホールディングス	6,800	998.00	6,786,400	
サガミホールディングス	12,500	1,769.00	22,112,500	
日伝	4,500	2,877.00	12,946,500	
ミロク情報サービス	6,700	1,828.00	12,247,600	
杉本商事	6,900	1,214.00	8,376,600	
因幡電機産業	21,700	3,861.00	83,783,700	
王将フードサービス	15,300	3,010.00	46,053,000	
ミニストップ	6,500	1,706.00	11,089,000	
アークス	13,100	2,686.00	35,186,600	
バローホールディングス	14,800	2,226.00	32,944,800	
東テク	7,800	2,480.00	19,344,000	
ミスミグループ本社	117,400	2,466.00	289,508,400	
ベルク	3,900	6,350.00	24,765,000	
大 庄	6,300	1,090.00	6,867,000	
ファーストリテイリング	43,700	47,530.00	2,077,061,000	
ソフトバンクグループ	363,200	9,451.00	3,432,603,200	
スズケン	25,600	4,992.00	127,795,200	
サンドラッグ	26,200	4,300.00	112,660,000	
ジェコス	6,800	1,018.00	6,922,400	
ペルーナ	18,700	910.00	17,017,000	
合計	138,136,800		286,563,591,300	

（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）

2025年2月20日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	5,093,081,991
金銭信託	237,529,172
コール・ローン	15,055,951,907
株式	1,154,747,218,583
投資証券	20,515,799,359
派生商品評価勘定	255,987,635
未収入金	43,071,870
未収配当金	824,071,262
差入委託証拠金	14,211,829,100
流動資産合計	1,210,984,540,879
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	115,700,839
未払解約金	1,232,247,876
流動負債合計	1,347,948,715
負債合計	1,347,948,715
純資産の部	
元本等	
元本	238,531,602,918
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	971,104,989,246
元本等合計	1,209,636,592,164
純資産合計	1,209,636,592,164
負債純資産合計	1,210,984,540,879

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月21日 至 2025年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 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	2025年2月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	223,761,836,770円
同期中追加設定元本額	46,350,496,481円
同期中一部解約元本額	31,580,730,333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）	672,946,880円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,375,851,202円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,463,523,996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）	2,388,856,630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）	615,604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）	1,872,801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）	4,204,397円
ニッセイ外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	490,895,516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	160,692,751,763円
DCニッセイ外国株式インデックス	45,718,411,035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)	3,655,218,843円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	456,475,387円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	167,565,347円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	522,099,274円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	553,234,758円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	5,547,000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)	83,346,388円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	9,914,657円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	10,568,225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)	3,360,553円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	20,295,884円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	381,129,818円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	256,825,222円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	439,033,810円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	110,817,676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)	124,639,846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)	276,867,469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)	125,441,757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)	123,022,082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)	122,558,991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)	109,476,587円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)	31,568,207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)	13,221,917,171円
FWニッセイ先進国株インデックス	79,326,410円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	205,012,001円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	537,518,894円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	8,202,719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)	73,089,313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)	1,150,164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)	6,448,641円
計	238,531,602,918円
2. 受益権の総数	238,531,602,918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2月21日 至 2025年2月20日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3． 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年2月20日現在
1． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2． 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年2月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	54,503,791,190	
投資証券	586,342,862	
合計	53,917,448,328	

（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2025年2月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2025年2月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	10,555,754,112	-	10,457,519,219	98,234,893
アメリカ・ドル	6,532,948,788	-	6,450,019,132	82,929,656
イギリス・ポンド	1,882,291,529	-	1,880,466,944	1,824,585
ユーロ	2,140,513,795	-	2,127,033,143	13,480,652
合計	10,555,754,112	-	10,457,519,219	98,234,893

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2025年2月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	33,157,774,733	-	33,396,296,423	238,521,690
合計	33,157,774,733	-	33,396,296,423	238,521,690

（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）

	2025年2月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.0712円 (50,712円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2025年2月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	61,288	150.200	9,205,457.60	
	ABBOTT LABORATORIES	194,126	132.130	25,649,868.38	
	ABBVIE INC	197,069	197.350	38,891,567.15	
	ACCENTURE PLC	69,714	390.220	27,203,797.08	
	ADOBE INC	49,111	456.990	22,443,235.89	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	180,569	114.690	20,709,458.61	
	AECOM	14,948	101.000	1,509,748.00	
	AERCAP HOLDINGS NV	21,626	105.440	2,280,245.44	
	AES CORP	79,324	10.400	824,969.60	
	AFLAC INC	59,333	104.510	6,200,891.83	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	32,056	137.150	4,396,480.40	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,805	317.050	7,864,425.25	
	AIRBNB INC-CLASS A	49,089	157.980	7,755,080.22	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	16,898	100.260	1,694,193.48	
	ALBEMARLE CORP	13,125	83.670	1,098,168.75	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	42,025	20.530	862,773.25	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	7,916	201.790	1,597,369.64	
	ALLEGION PLC	9,719	126.580	1,230,231.02	
	ALLIANT ENERGY CORP	28,611	61.640	1,763,582.04	
	ALLSTATE CORP	29,459	191.600	5,644,344.40	
	ALLY FINANCIAL INC	30,595	39.100	1,196,264.50	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14,325	250.510	3,588,555.75	
	ALPHABET INC-CL A	653,572	185.270	121,087,284.44	
	ALPHABET INC-CL C	560,841	187.130	104,950,176.33	
	ALTRIA GROUP INC	190,400	53.340	10,155,936.00	
	AMAZON.COM INC	1,053,825	226.630	238,828,359.75	
	AMCOR PLC	161,516	10.200	1,647,463.20	
	AMEREN CORPORATION	29,770	97.900	2,914,483.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	59,369	103.090	6,120,350.21	
	AMERICAN EXPRESS CO	63,445	309.920	19,662,874.40	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,964	121.900	970,811.60	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	71,816	75.280	5,406,308.48	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,743	127.860	2,780,059.98	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,946	549.440	6,014,170.24	
AMETEK INC	25,839	188.860	4,879,953.54	
AMGEN INC	59,952	294.270	17,642,075.04	
AMPHENOL CORP-CL A	134,338	69.810	9,378,135.78	
ANALOG DEVICES INC	55,395	241.660	13,386,755.70	
ANSYS INC	9,749	336.740	3,282,878.26	
AON PLC	21,814	394.870	8,613,694.18	
APA CORP	41,132	23.590	970,303.88	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	44,475	160.270	7,128,008.25	
APPLE INC	1,696,218	244.870	415,352,901.66	
APPLIED MATERIALS INC	91,962	174.060	16,006,905.72	
APPLOVIN CORP-CLASS A	23,198	494.170	11,463,755.66	
APTIVE PLC	29,651	66.660	1,976,535.66	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	41,936	88.690	3,719,303.84	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	53,370	46.040	2,457,154.80	
ARES MANAGEMENT CORP - A	21,016	186.740	3,924,527.84	
ARISTA NETWORKS INC	119,168	103.920	12,383,938.56	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,450	327.330	8,003,218.50	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,177	264.590	840,602.43	
ASSURANT INC	5,772	200.140	1,155,208.08	
AT&T INC	801,308	26.240	21,026,321.92	
ATLASSIAN CORP-CL A	17,853	303.720	5,422,313.16	
ATMOS ENERGY CORP	17,307	148.600	2,571,820.20	
AUTODESK INC	23,978	299.060	7,170,860.68	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	45,500	313.220	14,251,510.00	
AUTOZONE INC	1,905	3,396.460	6,470,256.30	
AVANTOR INC	75,856	17.680	1,341,134.08	
AVERY DENNISON CORP	8,984	182.980	1,643,892.32	
AXON ENTERPRISE INC	8,010	593.420	4,753,294.20	
BAKER HUGHES COMPANY	110,822	46.890	5,196,443.58	
BALL CORP	33,863	49.040	1,660,641.52	
BANK OF AMERICA CORP	779,088	46.010	35,845,838.88	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	82,282	88.310	7,266,323.42	
BAXTER INTERNATIONAL INC	56,970	30.820	1,755,815.40	
BECTON DICKINSON & CO	32,252	227.560	7,339,265.12	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	17,847	47.440	846,661.68	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	147,834	483.770	71,517,654.18	

BEST BUY CO INC	22,770	91.100	2,074,347.00	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,163	283.730	613,707.99	
BIO-TECHNE CORP	17,708	65.800	1,165,186.40	
BIOGEN INC	16,251	136.680	2,221,186.68	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21,261	65.610	1,394,934.21	
BLACKROCK INC	16,523	986.340	16,297,295.82	
BLACKSTONE INC	80,331	166.850	13,403,227.35	
BLOCK INC	61,958	83.890	5,197,656.62	
BOEING CO	81,305	186.150	15,134,925.75	
BOOKING HOLDINGS INC	3,740	5,110.600	19,113,644.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	14,411	117.800	1,697,615.80	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	164,249	105.670	17,356,191.83	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	226,216	54.980	12,437,355.68	
BROADCOM INC	495,006	228.730	113,222,722.38	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	13,041	238.930	3,115,886.13	
BROWN & BROWN INC	27,043	112.310	3,037,199.33	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	20,361	31.000	631,191.00	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	12,986	144.790	1,880,242.94	
BUNGE GLOBAL SA	15,809	70.180	1,109,475.62	
BURLINGTON STORES INC	7,104	242.100	1,719,878.40	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,088	99.020	1,295,973.76	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	30,549	274.040	8,371,647.96	
CAMPBELL SOUP CO	21,614	38.640	835,164.96	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,600	209.820	8,938,332.00	
CARDINAL HEALTH INC	26,989	126.750	3,420,855.75	
CARLISLE COS INC	5,156	350.650	1,807,951.40	
CARLYLE GROUP INC/THE	25,826	52.510	1,356,123.26	
CARMAX INC	17,280	87.440	1,510,963.20	
CARNIVAL CORP	115,829	26.090	3,021,978.61	
CARRIER GLOBAL CORP	90,634	65.980	5,980,031.32	
CARVANA CO	12,712	281.820	3,582,495.84	
CATERPILLAR INC	54,093	353.000	19,094,829.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,678	210.250	2,455,299.50	
CBRE GROUP INC	34,178	143.680	4,910,695.04	
CDW CORP/DE	14,905	194.500	2,899,022.50	
CELANESE CORP-SERIES A	12,183	54.910	668,968.53	
CENCORA, INC.	19,782	245.420	4,854,898.44	
CENTENE CORP	58,686	57.660	3,383,834.76	
CENTERPOINT ENERGY INC	72,696	34.090	2,478,206.64	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,126	83.810	1,686,760.06	

CHARLES RIVER LABORATORIES	5,760	165.000	950,400.00	
CHARLES SCHWAB CORP	178,575	82.010	14,644,935.75	
CHARTER COMMUNICATIONS- CL A	10,351	361.580	3,742,714.58	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,806	223.080	2,187,522.48	
CHENIERE ENERGY INC	25,226	218.810	5,519,701.06	
CHEVRON CORP	193,841	157.230	30,477,620.43	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	152,789	53.800	8,220,048.20	
CHUBB LTD	42,827	266.440	11,410,825.88	
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,324	104.360	2,851,532.64	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,428	136.430	2,377,702.04	
CINTAS CORP	40,482	208.140	8,425,923.48	
CISCO SYSTEMS INC	445,271	64.840	28,871,371.64	
CITIGROUP INC	212,830	83.940	17,864,950.20	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,012	47.390	2,370,068.68	
CLOROX CO	13,804	151.090	2,085,646.36	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	33,950	160.590	5,452,030.50	
CME GROUP INC	40,190	250.750	10,077,642.50	
CMS ENERGY CORP	33,291	70.150	2,335,363.65	
CNH INDUSTRIAL NV	98,025	13.460	1,319,416.50	
COCA-COLA CO	456,824	70.070	32,009,657.68	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	23,063	86.850	2,003,021.55	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	55,289	88.430	4,889,206.27	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	21,512	258.670	5,564,509.04	
COLGATE-PALMOLIVE CO	86,621	87.420	7,572,407.82	
COMCAST CORP	431,004	36.480	15,723,025.92	
CONAGRA BRANDS INC	53,319	24.290	1,295,118.51	
CONOCOPHILLIPS	145,419	99.570	14,479,369.83	
CONSOLIDATED EDISON INC	38,610	95.260	3,677,988.60	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18,232	172.420	3,143,561.44	
CONSTELLATION ENERGY	34,881	321.665	11,219,996.86	
COOPER COS INC/THE	22,212	86.460	1,920,449.52	
COPART INC	96,715	59.740	5,777,754.10	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	29,712	33.550	996,837.60	
CORNING INC	90,701	52.670	4,777,221.67	
CORTEVA INC	77,231	63.640	4,914,980.84	
COSTAR GROUP INC	45,742	79.210	3,623,223.82	
COSTCO WHOLESALE CORP	49,428	1,062.540	52,519,227.12	
COTERRA ENERGY INC	82,494	28.690	2,366,752.86	
CRH PLC	76,155	106.100	8,080,045.50	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	25,962	450.140	11,686,534.68	
CROWN HOLDINGS INC	13,451	88.360	1,188,530.36	
CSX CORP	216,268	32.410	7,009,245.88	
CUMMINS INC	15,290	386.070	5,903,010.30	
CVS HEALTH CORP	140,370	66.400	9,320,568.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,811	409.170	1,968,516.87	
DANAHER CORP	72,518	204.980	14,864,739.64	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,121	196.850	2,582,868.85	
DATADOG INC - CLASS A	31,310	128.850	4,034,293.50	
DAVITA INC	5,140	154.960	796,494.40	
DAYFORCE, INC.	17,635	68.270	1,203,941.45	
DECKERS OUTDOOR CORP	17,008	152.550	2,594,570.40	
DEERE & CO	28,998	509.270	14,767,811.46	
DELL TECHNOLOGIES -C	35,384	120.960	4,280,048.64	
DELTA AIR LINES INC	17,968	65.040	1,168,638.72	
DEVON ENERGY CORPORATION	69,738	37.570	2,620,056.66	
DEXCOM INC	44,725	89.680	4,010,938.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	21,208	160.260	3,398,794.08	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,453	230.960	1,490,384.88	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	28,014	203.250	5,693,845.50	
DOCUSIGN INC	22,639	86.730	1,963,480.47	
DOLLAR GENERAL CORP	24,561	75.630	1,857,548.43	
DOLLAR TREE INC	22,810	75.620	1,724,892.20	
DOMINION ENERGY INC	93,630	55.670	5,212,382.10	
DOMINO'S PIZZA INC	3,854	475.350	1,831,998.90	
DOORDASH INC - A	34,329	213.240	7,320,315.96	
DOVER CORP	15,328	204.880	3,140,400.64	
DOW INC	78,312	38.920	3,047,903.04	
DR HORTON INC	32,732	126.830	4,151,399.56	
DRAFTKINGS INC	48,758	50.780	2,475,931.24	
DTE ENERGY COMPANY	23,085	130.380	3,009,822.30	
DUKE ENERGY CORP	86,144	111.790	9,630,037.76	
DUPONT DE NEMOURS INC	46,558	82.420	3,837,310.36	
DYNATRACE INC	33,232	61.640	2,048,420.48	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	13,021	101.260	1,318,506.46	
EATON CORP PLC	44,410	309.430	13,741,786.30	
EBAY INC	54,535	69.320	3,780,366.20	
ECOLAB INC	28,567	266.240	7,605,678.08	
EDISON INTERNATIONAL	43,054	52.420	2,256,890.68	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	67,208	74.670	5,018,421.36	
ELECTRONIC ARTS INC	27,999	129.340	3,621,390.66	
ELEVANCE HEALTH, INC	25,874	391.710	10,135,104.54	
ELI LILLY & CO	90,128	867.050	78,145,482.40	
EMCOR GROUP INC	5,203	434.850	2,262,524.55	

EMERSON ELECTRIC CO	63,898	124.430	7,950,828.14	
ENPHASE ENERGY INC	15,123	66.360	1,003,562.28	
ENTEGRIS INC	16,850	107.990	1,819,631.50	
ENTERGY CORP	47,686	87.320	4,163,941.52	
EOG RESOURCES INC	63,404	134.530	8,529,740.12	
EPAM SYSTEMS INC	6,355	258.110	1,640,289.05	
EQT CORP	63,022	54.240	3,418,313.28	
EQUIFAX INC	13,802	243.240	3,357,198.48	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,297	55.680	1,965,336.96	
ERIE INDEMNITY COMPANY- CL A	2,835	389.070	1,103,013.45	
ESSENTIAL UTILITIES INC	29,064	35.520	1,032,353.28	
ESTEE LAUDER COS INC	26,074	71.400	1,861,683.60	
EVEREST GROUP LTD	4,823	336.290	1,621,926.67	
EVERGY INC	25,661	67.260	1,725,958.86	
EVERSOURCE ENERGY	39,908	62.700	2,502,231.60	
EXACT SCIENCES CORP	20,629	50.480	1,041,351.92	
EXELON CORP	111,607	42.650	4,760,038.55	
EXPAND ENERGY CORPORATION	22,771	107.450	2,446,743.95	
EXPEDIA GROUP INC	13,895	206.520	2,869,595.40	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	15,736	116.270	1,829,624.72	
EXXON MOBIL CORP	495,639	110.300	54,668,981.70	
F5 INC	6,497	310.080	2,014,589.76	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,245	466.180	1,978,934.10	
FAIR ISAAC CORP	2,734	1,755.260	4,798,880.84	
FASTENAL CO	63,905	75.570	4,829,300.85	
FEDEX CORP	25,893	266.870	6,910,064.91	
FERGUSON ENTERPRISES INC	22,397	182.000	4,076,254.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	28,974	58.410	1,692,371.34	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	60,862	69.420	4,225,040.04	
FIFTH THIRD BANCORP	75,462	44.350	3,346,739.70	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,126	2,156.780	2,428,534.28	
FIRST SOLAR INC	11,349	162.500	1,844,212.50	
FIRSTENERGY CORP	61,055	40.660	2,482,496.30	
FISERV INC	64,216	236.340	15,176,809.44	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,356	378.260	2,782,480.56	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	19,845	291.750	5,789,778.75	
FORD MOTOR CO	435,620	9.340	4,068,690.80	
FORTINET INC	72,533	114.570	8,310,105.81	
FORTIVE CORP	39,070	82.980	3,242,028.60	

FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	13,841	66.980	927,070.18	
FOX CORP - CLASS A	24,655	57.460	1,416,676.30	
FOX CORP- CLASS B	15,926	53.610	853,792.86	
FRANKLIN RESOURCES INC	32,286	20.880	674,131.68	
FREEPORT-MCMORAN INC	160,216	38.570	6,179,531.12	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,248	121.360	758,257.28	
GARMIN LTD	17,160	241.930	4,151,518.80	
GARTNER INC	8,593	516.010	4,434,073.93	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	50,930	92.520	4,712,043.60	
GE VERNOVA INC	30,658	375.200	11,502,881.60	
GEN DIGITAL INC	61,791	27.500	1,699,252.50	
GENERAL DYNAMICS CORP	26,060	244.180	6,363,330.80	
GENERAL ELECTRIC CO	120,963	210.500	25,462,711.50	
GENERAL MILLS INC	61,963	57.990	3,593,234.37	
GENERAL MOTORS CO	125,339	47.800	5,991,204.20	
GENUINE PARTS CO	15,580	122.070	1,901,850.60	
GILEAD SCIENCES INC	138,907	107.650	14,953,338.55	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,395	106.560	3,025,771.20	
GLOBAL-E ONLINE LTD	11,180	50.900	569,062.00	
GODADDY INC - CLASS A	15,716	176.550	2,774,659.80	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	35,229	668.150	23,538,256.35	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	235,727	5.340	1,258,782.18	
GRACO INC	18,872	87.190	1,645,449.68	
HALLIBURTON CO	98,483	26.740	2,633,435.42	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	32,659	112.940	3,688,507.46	
HCA HEALTHCARE INC	21,589	320.560	6,920,569.84	
HEICO CORP	4,887	222.330	1,086,526.71	
HEICO CORP-CLASS A	8,424	179.160	1,509,243.84	
HENRY SCHEIN INC	14,139	77.830	1,100,438.37	
HERSHEY CO/THE	16,494	163.900	2,703,366.60	
HESS CORP	30,922	149.270	4,615,726.94	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	144,863	21.850	3,165,256.55	
HF SINCLAIR CORP	18,092	37.860	684,963.12	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	27,474	269.510	7,404,517.74	
HOLOGIC INC	25,896	64.200	1,662,523.20	
HOME DEPOT INC	110,817	395.430	43,820,366.31	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	72,486	210.810	15,280,773.66	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	123,300	4.390	541,287.00	
HORMEL FOODS CORP	33,745	28.560	963,757.20	
HOWMET AEROSPACE INC	43,240	139.390	6,027,223.60	
HP INC	107,496	34.680	3,727,961.28	
HUBBELL INC	5,987	392.380	2,349,179.06	
HUBSPOT INC	5,442	770.950	4,195,509.90	

HUMANA INC	13,437	265.520	3,567,792.24	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	162,042	16.830	2,727,166.86	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,386	173.770	762,155.22	
HYATT HOTELS CORP - CL A	5,002	146.890	734,743.78	
IDEX CORP	8,458	198.650	1,680,181.70	
IDEXX LABORATORIES INC	9,183	450.990	4,141,441.17	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	33,130	264.100	8,749,633.00	
ILLUMINA INC	17,733	103.000	1,826,499.00	
INCYTE CORP	18,266	70.160	1,281,542.56	
INGERSOLL-RAND INC	45,005	85.690	3,856,478.45	
INSULET CORP	7,823	283.680	2,219,228.64	
INTEL CORP	477,092	25.720	12,270,806.24	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	64,049	166.960	10,693,621.04	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	102,765	264.320	27,162,844.80	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	28,537	81.990	2,339,748.63	
INTERNATIONAL PAPER CO	36,821	57.150	2,104,320.15	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	41,963	27.550	1,156,080.65	
INTUIT INC	31,271	582.190	18,205,663.49	
INTUITIVE SURGICAL INC	39,642	608.480	24,121,364.16	
IQVIA HOLDINGS INC	20,333	196.510	3,995,637.83	
JABIL CIRCUIT INC	12,644	169.090	2,137,973.96	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,140	167.360	1,362,310.40	
JACOBS SOLUTIONS INC	13,853	130.400	1,806,431.20	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,900	40.850	731,215.00	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,099	169.250	1,540,005.75	
JM SMUCKER CO	11,882	103.020	1,224,083.64	
JOHNSON & JOHNSON	268,588	157.890	42,407,359.32	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	74,520	90.450	6,740,334.00	
JPMORGAN CHASE & CO	317,407	279.250	88,635,904.75	
JUNIPER NETWORKS INC	36,788	36.040	1,325,839.52	
KELLANOVA	30,764	82.410	2,535,261.24	
KENVUE INC	213,726	22.270	4,759,678.02	
KEURIG DR PEPPER INC	128,626	32.780	4,216,360.28	
KEYCORP	105,266	18.030	1,897,945.98	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	19,357	185.110	3,583,174.27	
KIMBERLY-CLARK CORP	37,596	137.930	5,185,616.28	
KINDER MORGAN INC	223,125	26.890	5,999,831.25	
KKR & CO INC -A	69,289	138.470	9,594,447.83	
KLA CORPORATION	14,944	774.750	11,577,864.00	

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	18,066	52.870	955,149.42	
KRAFT HEINZ CO/THE	101,236	29.790	3,015,820.44	
KROGER CO	76,666	65.450	5,017,789.70	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,169	194.650	4,120,545.85	
LABCORP HOLDINGS INC	9,367	247.820	2,321,329.94	
LAM RESEARCH CORP	144,584	87.660	12,674,233.44	
LAMB WESTON HOLDING INC	15,912	57.170	909,689.04	
LAS VEGAS SANDS CORP	41,079	44.040	1,809,119.16	
LEIDOS HOLDINGS INC	14,269	131.500	1,876,373.50	
LENNAR CORP-CL A	26,633	120.940	3,220,995.02	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,575	651.160	2,327,897.00	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	23,546	98.290	2,314,336.34	
LINDE PLC	53,268	462.070	24,613,544.76	
LIVE NATION INC	17,985	153.670	2,763,754.95	
LKQ CORP	29,441	39.400	1,159,975.40	
LOCKHEED MARTIN CORP	23,937	432.950	10,363,524.15	
LOEWS CORP	20,739	83.250	1,726,521.75	
LOWE'S COS INC	63,287	246.680	15,611,637.16	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	8,340	383.330	3,196,972.20	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,473	367.220	4,580,335.06	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,063	77.500	2,252,382.50	
M&T BANK CORP	18,630	199.230	3,711,654.90	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	6,829	183.210	1,251,141.09	
MARATHON PETROLEUM CORP	37,312	156.640	5,844,551.68	
MARKEL GROUP INC	1,442	1,856.960	2,677,736.32	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,214	191.540	807,149.56	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	26,686	287.560	7,673,826.16	
MARSH & MCLENNAN COS INC	54,864	231.130	12,680,716.32	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,817	520.950	3,551,316.15	
MARVELL TECHNOLOGY INC	96,636	111.040	10,730,461.44	
MASCO CORP	24,321	76.660	1,864,447.86	
MASTERCARD INC-CLASS A	92,046	568.500	52,328,151.00	
MATCH GROUP INC	27,342	34.470	942,478.74	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	28,148	78.660	2,214,121.68	
MCDONALD'S CORP	80,038	301.940	24,166,673.72	
MCKESSON CORP	14,467	602.740	8,719,839.58	
MEDTRONIC PLC	143,094	87.000	12,449,178.00	
MERCADOLIBRE INC	5,090	2,075.790	10,565,771.10	
MERCK & CO INC	282,835	85.600	24,210,676.00	
META PLATFORMS INC-A	243,816	703.770	171,590,386.32	
METLIFE INC	66,398	83.070	5,515,681.86	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,382	1,302.930	3,103,579.26	

MGM MIRAGE	25,377	38.340	972,954.18	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	59,873	63.590	3,807,324.07	
MICRON TECHNOLOGY INC	123,687	104.360	12,907,975.32	
MICROSOFT CORP	787,790	414.770	326,751,658.30	
MICROSTRATEGY INC-CL A	20,415	318.670	6,505,648.05	
MODERNA INC	36,501	35.900	1,310,385.90	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,538	286.790	1,875,033.02	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	20,277	60.140	1,219,458.78	
MONDAY.COM LTD	4,177	308.270	1,287,643.79	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	149,043	61.930	9,230,232.99	
MONGODB INC	8,243	295.000	2,431,685.00	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,439	692.510	3,766,561.89	
MONSTER BEVERAGE CORP	81,968	51.690	4,236,925.92	
MOODY'S CORP	18,283	519.270	9,493,813.41	
MORGAN STANLEY	135,364	140.690	19,044,361.16	
MOSAIC CO/THE	35,576	27.130	965,176.88	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,614	439.080	8,173,035.12	
MSCI INC	8,775	574.730	5,043,255.75	
NASDAQ INC	48,093	82.590	3,972,000.87	
NETAPP INC	22,841	124.530	2,844,389.73	
NETFLIX INC	47,879	1,043.330	49,953,597.07	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,272	114.260	1,287,938.72	
NEWMONT CORP	127,560	47.410	6,047,619.60	
NEWS CORP - CLASS A	42,307	30.490	1,289,940.43	
NEXTERA ENERGY INC	229,296	69.060	15,835,181.76	
NIKE INC	132,850	76.780	10,200,223.00	
NISOURCE INC	49,977	40.100	2,004,077.70	
NORDSON CORP	6,065	217.730	1,320,532.45	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,226	249.050	6,282,535.30	
NORTHERN TRUST CORP	22,483	113.750	2,557,441.25	
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,503	433.450	6,719,775.35	
NRG ENERGY INC	23,013	112.410	2,586,891.33	
NUCOR CORP	26,487	139.770	3,702,087.99	
NUTANIX INC - A	28,108	72.070	2,025,743.56	
NVIDIA CORP	2,736,637	139.230	381,021,969.51	
NVR INC	343	7,176.910	2,461,680.13	
NXP SEMICONDUCTORS NV	28,417	245.580	6,978,646.86	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,471	1,295.800	8,385,121.80	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	70,651	50.990	3,602,494.49	
OKTA INC	18,125	96.980	1,757,762.50	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	21,514	205.110	4,412,736.54	
OMNICOM GROUP	21,820	83.680	1,825,897.60	

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	47,784	55.520	2,652,967.68	
ONEOK INC	65,144	99.200	6,462,284.80	
ORACLE CORP	185,482	181.520	33,668,692.64	
OTIS WORLDWIDE CORP	44,688	98.300	4,392,830.40	
OVINTIV INC	29,302	45.410	1,330,603.82	
OWENS CORNING	9,683	174.130	1,686,100.79	
PACCAR INC	58,502	107.210	6,271,999.42	
PACKAGING CORP OF AMERICA	10,013	212.310	2,125,860.03	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	227,054	112.060	25,443,671.24	
PALO ALTO NETWORKS INC	72,646	205.190	14,906,232.74	
PARKER HANNIFIN CORP	14,352	701.550	10,068,645.60	
PAYCHEX INC	36,147	150.040	5,423,495.88	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,767	216.170	1,246,652.39	
PAYPAL HOLDINGS INC	108,350	78.360	8,490,306.00	
PENTAIR PLC	18,447	96.170	1,774,047.99	
PEPSICO INC	153,085	145.810	22,321,323.85	
PFIZER INC	632,401	25.890	16,372,861.89	
PG&E CORP	226,337	15.660	3,544,437.42	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	173,471	149.800	25,985,955.80	
PHILLIPS 66	46,677	129.960	6,066,142.92	
PINTEREST INC- CLASS A	67,345	38.690	2,605,578.05	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	44,347	194.210	8,612,630.87	
POOL CORP	4,273	340.870	1,456,537.51	
PPG INDUSTRIES INC	26,032	116.790	3,040,277.28	
PPL CORPORATION	82,214	34.390	2,827,339.46	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,839	86.190	2,227,063.41	
PROCTER & GAMBLE CO	262,157	166.490	43,646,518.93	
PROGRESSIVE CORP	65,340	269.620	17,616,970.80	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39,810	111.660	4,445,184.60	
PTC INC	13,391	169.920	2,275,398.72	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	55,546	85.800	4,765,846.80	
PULTE GROUP INC	23,129	104.860	2,425,306.94	
PURE STORAGE INC - CLASS A	34,731	67.890	2,357,887.59	
QORVO INC	10,585	78.890	835,050.65	
QUALCOMM INC	124,281	175.220	21,776,516.82	
QUANTA SERVICES INC	16,433	292.070	4,799,586.31	
QUEST DIAGNOSTICS	12,421	171.750	2,133,306.75	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,820	159.580	3,482,035.60	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,096	685.660	8,293,743.36	

REGIONS FINANCIAL CORP	102,038	24.520	2,501,971.76	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	6,137	293.620	1,801,945.94	
REPUBLIC SERVICES INC	24,526	229.660	5,632,641.16	
RESMED INC	16,373	234.510	3,839,632.23	
REVVITY INC	13,759	115.010	1,582,422.59	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	83,845	13.930	1,167,960.85	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	59,571	59.230	3,528,390.33	
ROBLOX CORP -CLASS A	53,426	63.640	3,400,030.64	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,663	299.340	3,790,542.42	
ROKU INC	14,217	92.410	1,313,792.97	
ROLLINS INC	32,441	50.760	1,646,705.16	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,960	577.040	6,901,398.40	
ROSS STORES INC	37,016	139.730	5,172,245.68	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,276	264.010	7,201,136.76	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	42,519	32.590	1,385,694.21	
RPM INTERNATIONAL INC	14,355	123.030	1,766,095.65	
RTX CORPORATION	148,417	125.410	18,612,975.97	
S&P GLOBAL INC	35,726	542.700	19,388,500.20	
SALESFORCE INC	106,652	324.530	34,611,773.56	
SAMSARA INC-CL A	24,371	58.830	1,433,745.93	
SCHLUMBERGER LTD	158,432	42.180	6,682,661.76	
SEA LTD-ADR	41,293	136.220	5,624,932.46	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,471	103.000	2,417,513.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,285	82.840	1,017,689.40	
SEMPRA	70,633	85.340	6,027,820.22	
SERVICENOW INC	22,981	987.140	22,685,464.34	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26,733	351.850	9,406,006.05	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17,829	67.620	1,205,596.98	
SMITH (A.O.) CORP	13,398	67.360	902,489.28	
SMURFIT WESTROCK PLC	58,008	55.320	3,209,002.56	
SNAP INC - A	117,624	10.780	1,267,986.72	
SNAP-ON INC	5,877	342.340	2,011,932.18	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	33,665	186.560	6,280,542.40	
SOLVENTUM CORP	16,371	73.980	1,211,126.58	
SOUTHERN CO	122,094	86.480	10,558,689.12	
SOUTHWEST AIRLINES CO	16,777	30.200	506,665.40	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	17,089	642.730	10,983,612.97	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	24,607	89.120	2,192,975.84	
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,189	88.290	1,517,616.81	
STARBUCKS CORP	126,444	112.490	14,223,685.56	
STATE STREET CORP	32,803	99.810	3,274,067.43	
STEEL DYNAMICS INC	16,350	136.760	2,236,026.00	
STERIS PLC	11,006	221.390	2,436,618.34	
STRYKER CORP	38,261	388.520	14,865,163.72	

SUPER MICRO COMPUTER INC	58,799	60.250	3,542,639.75	
SYNCHRONY FINANCIAL	44,076	65.590	2,890,944.84	
SYNOPSYS INC	17,137	500.980	8,585,294.26	
SYSCO CORP	54,828	70.690	3,875,791.32	
T ROWE PRICE GROUP INC	24,846	108.360	2,692,312.56	
T-MOBILE US INC	58,718	263.350	15,463,385.30	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	19,559	215.180	4,208,705.62	
TARGA RESOURCES CORP	23,196	210.290	4,877,886.84	
TARGET CORP	51,398	130.750	6,720,288.50	
TE CONNECTIVITY PLC	33,899	156.050	5,289,938.95	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,222	502.070	2,621,809.54	
TELEFLEX INC	5,256	174.820	918,853.92	
TERADYNE INC	18,200	115.900	2,109,380.00	
TESLA, INC.	320,764	360.560	115,654,667.84	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	126,268	17.160	2,166,758.88	
TEXAS INSTRUMENTS INC	101,871	196.320	19,999,314.72	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,178	1,404.870	3,059,806.86	
TEXTRON INC	20,878	72.600	1,515,742.80	
THE CIGNA GROUP	31,188	297.230	9,270,009.24	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	42,618	530.860	22,624,191.48	
TJX COS INC	125,833	123.420	15,530,308.86	
TOAST INC-CLASS A	43,724	39.980	1,748,085.52	
TORO CO	11,466	82.830	949,728.78	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	60,185	57.860	3,482,304.10	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	50,087	76.750	3,844,177.25	
TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A	12,970	129.570	1,680,522.90	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	25,173	370.550	9,327,855.15	
TRANSDIGM GROUP INC	6,261	1,342.450	8,405,079.45	
TRANSUNION	21,662	96.370	2,087,566.94	
TRAVELERS COS INC/THE	25,427	242.350	6,162,233.45	
TRIMBLE INC	27,238	75.570	2,058,375.66	
TRUIST FINANCIAL CORP	149,441	47.530	7,102,930.73	
TWILIO INC - A	17,026	121.230	2,064,061.98	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,760	644.680	3,068,676.80	
TYSON FOODS INC-CL A	31,906	57.600	1,837,785.60	
U-HAUL HOLDING CO	10,807	66.500	718,665.50	
UBER TECHNOLOGIES INC	210,943	81.160	17,120,133.88	
ULTA BEAUTY INC	5,257	359.960	1,892,309.72	
UNION PACIFIC CORP	67,966	247.060	16,791,679.96	
UNITED PARCEL SERVICE INC	81,740	115.000	9,400,100.00	
UNITED RENTALS INC	7,376	709.310	5,231,870.56	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,714	380.780	1,794,996.92	

UNITEDHEALTH GROUP INC	103,022	511.040	52,648,362.88	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,629	183.420	1,215,891.18	
US BANCORP	174,102	47.120	8,203,686.24	
VALERO ENERGY CORP	35,725	137.150	4,899,683.75	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17,163	229.190	3,933,587.97	
VERALTO CORP	27,559	97.680	2,691,963.12	
VERISIGN INC	9,800	231.730	2,270,954.00	
VERISK ANALYTICS INC	15,886	295.860	4,700,031.96	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	470,323	42.010	19,758,269.23	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,794	471.760	13,583,857.44	
VERTIV HOLDINGS CO	39,756	107.840	4,287,287.04	
VIATRIS INC	133,191	10.930	1,455,777.63	
VISA INC-CLASS A SHARES	186,365	355.230	66,202,438.95	
VISTRA CORP	38,321	169.350	6,489,661.35	
VULCAN MATERIALS CO	14,731	264.970	3,903,273.07	
WABTEC CORP	19,525	193.320	3,774,573.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	82,214	10.790	887,089.06	
WALMART INC	493,197	104.000	51,292,488.00	
WALT DISNEY CO	202,343	111.350	22,530,893.05	
WARNER BROS DISCOVERY INC	260,056	10.890	2,832,009.84	
WASTE CONNECTIONS INC	28,787	187.820	5,406,774.34	
WASTE MANAGEMENT INC	44,776	228.520	10,232,211.52	
WATERS CORP	6,623	377.970	2,503,295.31	
WATSCO INC	3,883	511.670	1,986,814.61	
WEC ENERGY GROUP INC	35,266	103.580	3,652,852.28	
WELLS FARGO & CO	379,723	80.350	30,510,743.05	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,096	202.490	1,639,359.04	
WESTERN DIGITAL CORP	38,540	71.500	2,755,610.00	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,301	113.590	488,550.59	
WEYERHAEUSER CO	81,173	29.200	2,370,251.60	
WILLIAMS COS INC	135,940	58.270	7,921,223.80	
WILLIAMS-SONOMA INC	14,094	213.650	3,011,183.10	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,330	325.630	3,689,387.90	
WIX.COM LTD	5,895	217.000	1,279,215.00	
WORKDAY INC-CLASS A	23,765	261.100	6,205,041.50	
WR BERKLEY CORP	33,957	60.800	2,064,585.60	
WW GRAINGER INC	4,902	1,021.040	5,005,138.08	
WYNN RESORTS LTD	11,142	92.260	1,027,960.92	
XCEL ENERGY INC	62,213	69.070	4,297,051.91	
XYLEM INC	27,109	130.260	3,531,218.34	
YUM! BRANDS INC	31,384	148.290	4,653,933.36	

	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,752	324.750	1,867,962.00	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	17,144	79.830	1,368,605.52	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,718	103.340	2,347,678.12	
	ZOETIS INC	50,548	156.640	7,917,838.72	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	27,786	85.170	2,366,533.62	
	ZSCALER INC	10,207	214.670	2,191,136.69	
アメリカ・ドル	小計	41,265,845		5,941,326,022.32 (897,912,601,750)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	108,464	41.020	4,449,193.28	
	ADMIRAL GROUP PLC	29,120	28.190	820,892.80	
	ANGLO AMERICAN PLC	141,725	23.700	3,358,882.50	
	ANTOFAGASTA PLC	43,886	18.505	812,110.43	
	ASHTED GROUP PLC	48,768	49.470	2,412,552.96	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	37,194	18.805	699,433.17	
	ASTRAZENECA PLC	172,963	117.040	20,243,589.52	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	99,735	7.694	767,361.09	
	AVIVA PLC	298,911	4.961	1,482,897.47	
	BAE SYSTEMS PLC	337,121	13.450	4,534,277.45	
	BARCLAYS PLC	1,620,222	3.059	4,956,259.09	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	153,876	4.260	655,511.76	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	11,385	37.400	425,799.00	
	BP PLC	1,804,508	4.633	8,360,285.56	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	222,387	30.300	6,738,326.10	
	BT GROUP PLC	727,889	1.474	1,072,908.38	
	BUNZL PLC	37,458	33.760	1,264,582.08	
	CENTRICA PLC	573,884	1.359	779,908.35	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	24,175	32.500	785,687.50	
	COMPASS GROUP PLC	189,276	28.050	5,309,191.80	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	14,840	31.720	470,724.80	
	DCC PLC	11,035	53.650	592,027.75	
	DIAGEO PLC	248,247	21.135	5,246,700.34	
	ENDEAVOUR MINING PLC	20,354	17.410	354,363.14	
	ENTAIN PLC	67,834	7.504	509,026.33	
	EXPERIAN PLC	102,504	38.640	3,960,754.56	
	GLENORE PLC	1,156,359	3.278	3,790,544.80	
	GSK PLC	462,434	14.375	6,647,488.75	
	HALEON PLC	858,090	3.905	3,350,841.45	
	HALMA PLC	42,318	29.410	1,244,572.38	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	39,673	10.995	436,204.63	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,534	22.940	425,169.96	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,031,015	8.954	18,185,708.31	

IMPERIAL BRANDS PLC	89,456	27.780	2,485,087.68	
INFORMA PLC	148,232	8.878	1,316,003.69	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	17,742	101.000	1,791,942.00	
INTERTEK GROUP PLC	17,999	52.750	949,447.25	
JD SPORTS FASHION PLC	288,971	0.811	234,355.48	
KINGFISHER PLC	203,428	2.448	497,991.74	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	659,874	2.390	1,577,098.86	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,840,965	0.628	4,296,126.02	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	53,337	117.050	6,243,095.85	
M&G PLC	252,787	2.089	528,072.04	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	228,178	3.452	787,670.45	
MELROSE INDUSTRIES PLC	143,840	6.338	911,657.92	
MONDI PLC/WI	49,286	12.745	628,150.07	
NATIONAL GRID PLC	545,092	9.530	5,194,726.76	
NATWEST GROUP PLC	787,159	4.397	3,461,138.12	
NEXT PLC	13,276	99.840	1,325,475.84	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
PEARSON PLC	66,809	13.630	910,606.67	
PERSIMMON PLC	35,719	12.140	433,628.66	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	78,979	4.992	394,263.16	
PRUDENTIAL PLC	300,677	7.050	2,119,772.85	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	77,132	53.260	4,108,050.32	
RELX PLC	207,778	39.960	8,302,808.88	
RENTOKIL INITIAL PLC	281,837	4.161	1,172,723.75	
RIO TINTO PLC	125,767	50.360	6,333,626.12	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	948,492	6.426	6,095,009.59	
SAGE GROUP PLC	112,063	13.195	1,478,671.28	
SAINSBURY (J) PLC	197,217	2.490	491,070.33	
SCHRODERS PLC	90,611	3.808	345,046.68	
SEVERN TRENT PLC	30,174	24.430	737,150.82	
SHELL PLC-NEW	691,993	26.860	18,586,931.98	
SMITH & NEPHEW PLC	97,598	10.215	996,963.57	
SMITHS GROUP PLC	38,445	20.880	802,731.60	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,250	76.000	627,000.00	
SSE PLC	123,014	14.805	1,821,222.27	
STANDARD CHARTERED PLC	234,205	11.400	2,669,937.00	
TAYLOR WIMPEY PLC	395,598	1.134	448,608.13	
TESCO PLC	763,577	3.809	2,908,464.79	
UNILEVER PLC	276,929	44.010	12,187,645.29	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	76,129	9.748	742,105.49	
VODAFONE GROUP PLC	2,514,355	0.656	1,649,416.88	

	WHITBREAD PLC	20,016	26.160	523,618.56	
	WISE PLC - A	74,343	10.920	811,825.56	
	WPP PLC	120,276	7.656	920,833.05	
イギリス・ボンド 小計		30,088,547		225,991,555.29 (43,006,192,972)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	4,766	305.200	1,454,583.20	
	BANK HAPOLIM BM	140,995	48.500	6,838,257.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	168,107	47.380	7,964,909.66	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,978	1,069.000	3,183,482.00	
	ICL GROUP LTD	86,564	21.910	1,896,617.24	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	137,966	28.130	3,880,983.58	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,313	172.700	2,989,955.10	
	NICE LTD	7,014	625.100	4,384,451.40	
イスラエル・シュケル 小計		565,703		32,593,239.68 (1,389,316,175)	
オーストラリア・ドル	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	332,270	30.130	10,011,295.10	
	APA GROUP	145,457	6.630	964,379.91	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	63,159	78.510	4,958,613.09	
	ASX LTD	21,642	68.030	1,472,305.26	
	BHP GROUP LIMITED	566,004	40.980	23,194,843.92	
	BLUESCOPE STEEL LTD	48,860	24.820	1,212,705.20	
	BRAMBLES LTD	155,306	19.620	3,047,103.72	
	CARSALES.COM LTD	42,108	37.500	1,579,050.00	
	COCHLEAR LTD	7,302	278.000	2,029,956.00	
	COLES GROUP LTD	149,485	19.620	2,932,895.70	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	186,694	158.940	29,673,144.36	
	COMPUTERSHARE LIMITED	59,168	42.590	2,519,965.12	
	CSL LIMITED	54,022	264.850	14,307,726.70	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	170,334	4.370	744,359.58	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	188,992	19.450	3,675,894.40	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	264,326	7.690	2,032,666.94	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	47,896	51.940	2,487,718.24	
	LOTTERY CORP LTD/THE	248,040	5.070	1,257,562.80	
	MACQUARIE GROUP LTD	40,383	234.370	9,464,563.71	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	307,846	3.950	1,215,991.70	
	MINERAL RESOURCES LTD	19,764	24.180	477,893.52	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	342,902	36.300	12,447,342.60	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	127,994	17.940	2,296,212.36	
	ORICA LTD	54,257	17.020	923,454.14	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	192,256	10.700	2,057,139.20	
	PRO MEDICUS LTD	6,401	297.140	1,901,993.14	

	QANTAS AIRWAYS LTD	85,081	9.120	775,938.72	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	167,959	20.340	3,416,286.06	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	20,584	34.870	717,764.08	
	REA GROUP LTD	5,887	267.120	1,572,535.44	
	REECE LTD	25,215	21.620	545,148.30	
	RIO TINTO LTD	41,379	121.950	5,046,169.05	
	SANTOS LTD	362,523	6.580	2,385,401.34	
	SEEK LTD	39,813	26.090	1,038,721.17	
	SGH LTD	22,679	53.460	1,212,419.34	
	SONIC HEALTHCARE LTD	50,959	28.840	1,469,657.56	
	SOUTH32 LTD	504,463	3.660	1,846,334.58	
	SUNCORP GROUP LTD	120,746	19.180	2,315,908.28	
	TELSTRA GROUP LTD	462,387	3.920	1,812,557.04	
	TRANSURBAN GROUP	346,917	13.200	4,579,304.40	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	90,607	10.700	969,494.90	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	26,632	35.000	932,120.00	
	WESFARMERS LIMITED	126,589	76.600	9,696,717.40	
	WESTPAC BANKING CORP	383,520	32.200	12,349,344.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	20,522	121.700	2,497,527.40	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	212,061	23.030	4,883,764.83	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	136,306	30.550	4,164,148.30	
	XERO LTD	16,179	186.260	3,013,500.54	
オーストラリア・ドル 小計		7,111,876		206,127,539.14 (19,782,059,931)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	56,016	139.430	7,810,310.88	
	AIR CANADA	19,743	17.450	344,515.35	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	84,743	71.590	6,066,751.37	
	ALTAGAS LTD	33,596	34.780	1,168,468.88	
	ARC RESOURCES LTD	66,446	27.020	1,795,370.92	
	BANK OF MONTREAL	81,524	143.710	11,715,814.04	
	BANK OF NOVA SCOTIA	138,329	72.400	10,015,019.60	
	BARRICK GOLD CORP	195,658	26.720	5,227,981.76	
	BCE INC	10,084	33.330	336,099.72	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	39,795	86.260	3,432,716.70	
	BROOKFIELD CORPORATION-A	152,607	86.060	13,133,358.42	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	15,179	41.000	622,339.00	
	CAE INC	35,735	36.880	1,317,906.80	
	CAMECO CORP	48,589	66.190	3,216,105.91	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	105,387	87.920	9,265,625.04	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	59,807	145.730	8,715,674.11	

CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	236,057	43.300	10,221,268.10	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	104,225	111.380	11,608,580.50	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,906	145.090	856,901.54	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	15,460	34.020	525,949.20	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	16,801	70.650	1,186,990.65	
CENOVUS ENERGY INC	153,592	22.270	3,420,493.84	
CGI INC	22,810	168.550	3,844,625.50	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,249	4,886.810	10,990,435.69	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	9,601	163.300	1,567,843.30	
DOLLARAMA INC	31,434	143.580	4,513,293.72	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	45,463	29.420	1,337,521.46	
EMERA INC	32,610	56.090	1,829,094.90	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,038	42.580	640,318.04	
ENBRIDGE INC	243,323	60.210	14,650,477.83	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,310	2,071.530	4,785,234.30	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	79,241	18.600	1,473,882.60	
FIRSTSERVICE CORP	4,570	247.880	1,132,811.60	
FORTIS INC	55,631	62.510	3,477,493.81	
FRANCO-NEVADA CORP	21,513	199.190	4,285,174.47	
GEORGE WESTON LTD	6,630	224.610	1,489,164.30	
GFL ENVIRONMENTAL INC- SUB VT	25,618	66.340	1,699,498.12	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,832	76.710	1,214,472.72	
GREAT-WEST LIFECO INC	31,518	52.020	1,639,566.36	
HYDRO ONE LTD	37,154	44.690	1,660,412.26	
IA FINANCIAL CORP INC	10,528	133.700	1,407,593.60	
IGM FINANCIAL INC	9,544	45.610	435,301.84	
IMPERIAL OIL LTD	20,505	101.700	2,085,358.50	
INTACT FINANCIAL CORP	19,980	279.940	5,593,201.20	
IVANHOE MINES LTD-CL A	83,062	15.780	1,310,718.36	
KEYERA CORP	25,823	42.630	1,100,834.49	
KINROSS GOLD CORP	137,026	16.170	2,215,710.42	
LOBLAW COS LTD	17,016	179.460	3,053,691.36	
LUNDIN MINING CORP	74,021	12.310	911,198.51	
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,624	54.340	1,664,108.16	
MANULIFE FINANCIAL CORP	196,483	42.320	8,315,160.56	
MEG ENERGY CORP	29,875	23.750	709,531.25	
METRO INC	23,800	93.970	2,236,486.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	38,090	123.990	4,722,779.10	
NUTRIEN LTD	55,394	74.600	4,132,392.40	
ONEX CORPORATION	7,048	110.660	779,931.68	

	OPEN TEXT CORP	29,779	39.110	1,164,656.69	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	40,439	34.590	1,398,785.01	
	PARKLAND CORP	15,837	38.520	610,041.24	
	PEMBINA PIPELINE CORP	65,043	51.760	3,366,625.68	
	POWER CORP OF CANADA	63,036	48.020	3,026,988.72	
	QUEBECOR INC -CL B	18,251	32.620	595,347.62	
	RB GLOBAL INC	20,598	148.930	3,067,660.14	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	34,446	89.880	3,096,006.48	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	40,731	39.930	1,626,388.83	
	ROYAL BANK OF CANADA	157,986	171.520	27,097,758.72	
	SAPUTO INC	28,834	25.340	730,653.56	
	SHOPIFY INC - CLASS A	135,284	181.670	24,577,044.28	
	STANTEC INC	12,821	111.190	1,425,566.99	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	64,689	79.640	5,151,831.96	
	SUNCOR ENERGY INC	141,001	56.740	8,000,396.74	
	TC ENERGY CORP	115,918	65.260	7,564,808.68	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	50,875	60.700	3,088,112.50	
	TFI INTERNATIONAL INC	8,986	181.510	1,631,048.86	
	THOMSON REUTERS CORP	17,630	245.450	4,327,283.50	
	TMX GROUP LTD	31,257	50.860	1,589,731.02	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,261	123.070	1,139,751.27	
	TORONTO-DOMINION BANK	195,213	85.560	16,702,424.28	
	TOURMALINE OIL CORP	39,476	69.110	2,728,186.36	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,149	112.240	690,163.76	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	50,638	98.850	5,005,566.30	
	WSP GLOBAL INC	14,606	256.400	3,744,978.40	
カナダ・ドル 小計		4,545,427		348,057,368.33 (36,970,653,664)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	261,700	2.480	649,016.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	222,220	46.040	10,231,008.80	
	GENTING SINGAPORE LTD	676,300	0.775	524,132.50	
	KEPPEL CORP LTD	162,500	6.850	1,113,125.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	377,600	17.850	6,740,160.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	99,100	5.630	557,933.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	166,200	6.430	1,068,666.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	95,400	12.710	1,212,534.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	173,900	5.110	888,629.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	838,100	3.370	2,824,397.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	141,100	38.580	5,443,638.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	214,500	3.180	682,110.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	287,900	3.200	921,280.00	
シンガポール・ドル 小計		3,716,520		32,856,629.30	

(3,700,970,724)

スイス・フラン	ABB LTD	176,333	52.020	9,172,842.66	
	ADECCO GROUP AG-REG	18,899	21.980	415,400.02	
	ALCON INC	55,715	80.960	4,510,686.40	
	AVOLTA AG	10,180	40.800	415,344.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	3,770	57.750	217,717.50	
	BALOISE HOLDING AG	4,856	168.000	815,808.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,391	93.050	315,532.55	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	398	1,039.000	413,522.00	
	BKW AG	2,346	152.600	357,999.60	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	110	10,680.000	1,174,800.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	12	103,800.000	1,245,600.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON- REG	59,972	178.800	10,722,993.60	
	CLARIANT AG	24,078	10.720	258,116.16	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG- REG	783	639.000	500,337.00	
	GALDERMA GROUP AG	9,275	115.540	1,071,633.50	
	GEBERIT AG-REG	3,728	522.600	1,948,252.80	
	GIVAUDAN-REG	1,030	3,921.000	4,038,630.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	4,141	160.300	663,802.30	
	HOLCIM LTD	58,087	95.480	5,546,146.76	
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,986	58.660	1,348,358.76	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG- REG	5,394	211.500	1,140,831.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL- REG	16,957	93.820	1,590,905.74	
	LONZA GROUP AG	8,056	580.000	4,672,480.00	
	NESTLE SA	292,312	82.500	24,115,740.00	
	NOVARTIS AG	219,869	96.590	21,237,146.71	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,531	1,384.000	3,502,904.00	
	ROCHE HOLDING AG	78,367	294.700	23,094,754.90	
	ROCHE HOLDING AG-BR	3,582	316.400	1,133,344.80	
	SANDOZ GROUP AG	45,664	42.260	1,929,760.64	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,623	265.500	696,406.50	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,532	274.800	1,245,393.60	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	16,921	97.000	1,641,337.00	
	SIG GROUP AG	34,145	20.520	700,655.40	
	SIKA AG-BEARER	17,002	234.600	3,988,669.20	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,646	297.700	1,680,814.20	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,446	134.400	1,672,742.40	
	SWATCH GROUP AG	3,233	166.500	538,294.50	

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,201	764.600	2,447,484.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	8,627	109.000	940,343.00	
	SWISS RE AG	33,655	139.150	4,683,093.25	
	SWISSCOM AG	2,943	496.000	1,459,728.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	6,285	76.200	478,917.00	
	UBS GROUP AG	366,802	30.500	11,187,461.00	
	VAT GROUP AG	3,013	357.200	1,076,243.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,327	563.800	9,205,162.60	
スイス・フラン	小計	1,670,223		171,214,137.25 (28,623,579,465)	
スウェーデン・クローナ	ADDTECH AB-B SHARES	28,961	337.600	9,777,233.60	
	ALFA LAVAL AB	32,240	463.900	14,956,136.00	
	ASSA ABLOY AB	111,731	323.700	36,167,324.70	
	ATLAS COPCO AB	174,149	161.400	28,107,648.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	299,626	184.850	55,385,866.10	
	BEIJER REF AB	42,962	167.600	7,200,431.20	
	BIOVITRUM	21,821	314.200	6,856,158.20	
	BOLIDEN AB	30,453	380.000	11,572,140.00	
	EPIROC AB-A	73,483	215.300	15,820,889.90	
	EPIROC AB-B	43,538	190.600	8,298,342.80	
	EQT AB	41,526	357.900	14,862,155.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	67,988	283.900	19,301,793.20	
	EVOLUTION AB	18,926	827.400	15,659,372.40	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	73,791	75.780	5,591,881.98	
	GETINGE AB-B SHS	25,505	210.700	5,373,903.50	
	HENNES & MAURITZ AB	63,241	142.150	8,989,708.15	
	HEXAGON AB-B SHS	231,671	127.850	29,619,137.35	
	HOLMEN AB-B SHARES	8,472	421.000	3,566,712.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	14,236	401.200	5,711,483.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,903	400.400	6,767,961.20	
	INDUTRADE AB	30,438	320.000	9,740,160.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	16,476	298.400	4,916,438.40	
	INVESTOR AB	192,737	320.950	61,858,940.15	
	LIFCO AB-B SHS	25,951	388.400	10,079,368.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	8,391	530.000	4,447,230.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	169,260	40.280	6,817,792.80	
	SAAB AB-B	35,722	294.150	10,507,626.30	
	SAGAX AB-B	24,504	222.600	5,454,590.40	
	SANDVIK AB	118,916	233.900	27,814,452.40	
	SECURITAS AB	54,718	156.150	8,544,215.70	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	176,977	168.450	29,811,775.65	
	SKANSKA AB-B SHS	37,866	252.000	9,542,232.00	
	SKF AB	38,022	230.100	8,748,862.20	

	SVENSKA CELLULOSA AB	67,677	149.700	10,131,246.90	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	162,837	131.100	21,347,930.70	
	SWEDBANK AB - A SHARES	94,762	254.100	24,079,024.20	
	TELE2 AB	63,215	122.900	7,769,123.50	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	309,814	84.840	26,284,619.76	
	TELIA CO AB	271,652	33.820	9,187,270.64	
	TRELLEBORG AB-B SHS	23,732	422.000	10,014,904.00	
	VOLVO AB	176,898	328.800	58,164,062.40	
	VOLVO AB-A SHS	22,669	328.000	7,435,432.00	
スウェーデン・クローナ 小計		3,544,457		682,283,577.98 (9,620,198,450)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	502	12,455.000	6,252,410.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	333	12,140.000	4,042,620.00	
	CARLSBERG AS-B	10,653	845.800	9,010,307.40	
	COLOPLAST-B	14,078	796.000	11,206,088.00	
	DANSKE BANK A/S	76,984	237.300	18,268,303.20	
	DEMANT A/S	9,842	268.400	2,641,592.80	
	DSV A/S	22,794	1,472.000	33,552,768.00	
	GENMAB A/S	7,018	1,549.500	10,874,391.00	
	NOVO-NORDISK A/S	359,309	597.500	214,687,127.50	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	39,297	400.800	15,750,237.60	
	ORSTED A/S	18,739	299.400	5,610,456.60	
	PANDORA A/S	9,139	1,247.000	11,396,333.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,043	2,782.000	2,901,626.00	
	TRYGVESTA AS	37,932	149.300	5,663,247.60	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	112,756	97.180	10,957,628.08	
	ZEALAND PHARMA A/S	7,129	771.000	5,496,459.00	
デンマーク・クローネ 小計		727,548		368,311,595.78 (7,782,424,019)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	168,922	8.440	1,425,701.68	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	65,342	35.400	2,313,106.80	
	INFRATIL LTD	102,452	10.980	1,124,922.96	
	MERCURY NZ LTD	78,155	6.380	498,628.90	
	MERIDIAN ENERGY LTD	145,616	6.000	873,696.00	
ニュージーランド・ドル 小計		560,487		6,236,056.34 (537,672,778)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	35,326	239.600	8,464,109.60	
	DNB BANK ASA	99,779	249.800	24,924,794.20	
	EQUINOR ASA	93,435	260.150	24,307,115.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	22,225	226.400	5,031,740.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	9,797	1,281.000	12,549,957.00	
	MOWI ASA	51,743	219.000	11,331,717.00	
	NORSK HYDRO ASA	156,474	66.060	10,336,672.44	

	ORKLA ASA	77,627	105.900	8,220,699.30	
	SALMAR ASA	7,362	585.500	4,310,451.00	
	TELENOR ASA	70,594	139.200	9,826,684.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,362	321.900	5,910,727.80	
ノルウェー・クローネ 小計		642,724		125,214,668.39 (1,701,667,343)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	51,035	17.600	898,216.00	
	ACCIONA SA	2,757	109.000	300,513.00	
	ACCOR	21,669	48.550	1,052,029.95	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,616	51.200	1,004,339.20	
	ADIDAS AG	18,071	250.700	4,530,399.70	
	ADP	3,858	114.700	442,512.60	
	ADYEN NV	2,426	1,835.800	4,453,650.80	
	AEGON LTD	150,252	6.468	971,829.93	
	AENA SME SA	8,351	214.800	1,793,794.80	
	AGEAS	17,796	52.050	926,281.80	
	AIB GROUP PLC	207,851	6.175	1,283,479.92	
	AIR LIQUIDE	64,494	172.400	11,118,765.60	
	AIRBUS SE	66,287	168.920	11,197,200.04	
	AKZO NOBEL NV	19,052	57.820	1,101,586.64	
	ALLIANZ SE	43,691	320.000	13,981,120.00	
	ALSTOM RGPT	38,586	20.310	783,681.66	
	AMADEUS IT GROUP SA	50,209	70.360	3,532,705.24	
	AMPLIFON SPA	13,899	25.140	349,420.86	
	AMUNDI SA	6,840	69.050	472,302.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	100,184	50.500	5,059,292.00	
	ARCELORMITTAL	52,205	27.220	1,421,020.10	
	ARGENX SE	6,672	618.600	4,127,299.20	
	ARKEMA	6,271	79.950	501,366.45	
	ASM INTERNATIONAL NV	5,237	572.400	2,997,658.80	
	ASML HOLDING NV	44,579	717.500	31,985,432.50	
	ASR NEDERLAND NV	17,716	49.340	874,107.44	
	AXA SA	196,431	36.770	7,222,767.87	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	642,826	12.125	7,794,265.25	
	BANCO BPM SPA	143,876	8.944	1,286,826.94	
	BANCO DE SABADELL SA	606,535	2.500	1,516,337.50	
	BANCO SANTANDER SA	1,727,211	5.805	10,026,459.85	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	112,119	10.070	1,129,038.33	
	BASF SE	99,605	48.090	4,790,004.45	
	BAYER AG	109,581	21.300	2,334,075.30	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,337	82.400	2,664,568.80	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,264	76.850	481,388.40	

BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	8,603	116.200	999,668.60	
BECHTLE AG	9,156	33.400	305,810.40	
BEIERSDORF AG	11,051	126.900	1,402,371.90	
BIOMERIEUX	4,608	114.100	525,772.80	
BNP PARIBAS	113,541	70.300	7,981,932.30	
BOLLORE SE	79,043	5.820	460,030.26	
BOUYGUES	21,269	32.060	681,884.14	
BPER BANCA SPA	110,834	6.758	749,016.17	
BRENTAG SE	14,517	62.680	909,925.56	
BUREAU VERITAS SA	35,412	30.860	1,092,814.32	
CAIXABANK	446,017	6.468	2,884,837.95	
CAPGEMINI SA	17,327	162.100	2,808,706.70	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,503	54.700	246,314.10	
CARREFOUR SA	60,495	13.705	829,083.97	
CELLNEX TELECOM SAU	59,617	31.090	1,853,492.53	
CIE DE SAINT-GOBAIN	50,550	94.080	4,755,744.00	
COMMERZBANK AG	105,660	19.585	2,069,351.10	
CONTINENTAL AG	12,267	69.560	853,292.52	
COVESTRO AG-TEND	20,007	59.400	1,188,415.80	
CREDIT AGRICOLE SA	118,757	15.490	1,839,545.93	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	6,957	103.800	722,136.60	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	23,675	22.730	538,132.75	
D'IETEREN GROUP	2,394	160.800	384,955.20	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	55,080	42.080	2,317,766.40	
DANONE	71,973	67.880	4,885,527.24	
DASSAULT AVIATION SA	2,192	235.200	515,558.40	
DASSAULT SYSTEMES SA	74,670	39.980	2,985,306.60	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	68,856	5.376	370,169.85	
DELIVERY HERO SE	20,834	29.320	610,852.88	
DEUTSCHE BANK AG	211,240	19.486	4,116,222.64	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,999	248.200	5,211,951.80	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	66,896	6.394	427,733.02	
DEUTSCHE TELEKOM AG	390,841	34.340	13,421,479.94	
DHL GROUP	113,789	36.370	4,138,505.93	
DIASORIN ITALIA SPA	2,491	99.980	249,050.18	
DR ING HC F PORSCHE AG	12,727	57.280	729,002.56	
DSM-FIRMENICH AG	20,764	101.800	2,113,775.20	
E.ON SE	250,306	11.590	2,901,046.54	
EDENRED	27,442	31.610	867,441.62	
EDP RENOVAVEIS SA	34,998	8.685	303,957.63	
EDP SA	350,597	2.975	1,043,026.07	
EIFFAGE	8,199	90.020	738,073.98	
ELIA GROUP SA/NV	3,277	63.700	208,744.90	
ELISA OYJ	16,403	42.380	695,159.14	
ENDESA SA	35,411	21.520	762,044.72	
ENEL SPA	907,046	6.825	6,190,588.95	
ENGIE	203,756	15.835	3,226,476.26	

ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	256,289	14.054	3,601,885.60	
ERSTE GROUP BANK AG	37,541	67.000	2,515,247.00	
ESSILORLUXOTTICA	33,158	293.900	9,745,136.20	
EURAZEO	4,638	79.250	367,561.50	
EUROFINS SCIENTIFIC	15,071	48.180	726,120.78	
EURONEXT NV	8,715	120.500	1,050,157.50	
EVONIK INDUSTRIES AG	28,719	18.760	538,768.44	
EXOR NV	10,992	93.400	1,026,652.80	
FERRARI NV	14,058	479.300	6,737,999.40	
FERROVIAL SE	53,018	43.060	2,282,955.08	
FINECOBANK SPA	68,163	17.650	1,203,076.95	
FORTUM OYJ	49,921	14.820	739,829.22	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	22,905	44.680	1,023,395.40	
FRESENIUS SE & CO KGAA	47,045	36.750	1,728,903.75	
GALP ENERGIA SGPS SA	51,731	15.410	797,174.71	
GEA GROUP AG	17,257	54.450	939,643.65	
GENERALI	104,952	31.890	3,346,919.28	
GETLINK SE - REGR	33,738	15.735	530,867.43	
GRIFOLS SA	33,242	9.470	314,801.74	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,277	67.600	627,125.20	
HANNOVER RUECK SE	6,721	248.200	1,668,152.20	
HEIDELBERG MATERIALS AG	15,206	140.550	2,137,203.30	
HEINEKEN HOLDING NV	14,448	68.350	987,520.80	
HEINEKEN NV	32,123	77.980	2,504,951.54	
HENKEL AG & CO KGAA	11,613	74.100	860,523.30	
HENKEL KGAA-VORZUG	18,843	84.000	1,582,812.00	
HERMES INTERNATIONAL	3,533	2,723.000	9,620,359.00	
IBERDROLA SA	673,946	13.425	9,047,725.05	
IMCD NV	6,361	145.550	925,843.55	
INDITEX SA	121,627	53.700	6,531,369.90	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	145,676	38.060	5,544,428.56	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	40,086	9.375	375,806.25	
ING GROEP NV-CVA	368,487	16.424	6,052,030.48	
INPOST SA	25,048	17.200	430,825.60	
INTESA SANPAOLO	1,631,804	4.511	7,361,067.84	
IPSEN	4,184	110.100	460,658.40	
JDE PEET'S BV	13,670	16.960	231,843.20	
JERONIMO MARTINS	31,630	19.940	630,702.20	
KBC GROEP NV	25,603	81.340	2,082,548.02	
KERING	8,315	270.250	2,247,128.75	
KERRY GROUP PLC-A	17,067	97.500	1,664,032.50	
KESKO OYJ-B SHS	30,412	18.015	547,872.18	
KINGSPAN GROUP PLC	17,233	67.300	1,159,780.90	
KNORR-BREMSE AG	8,077	79.550	642,525.35	
KONE OYJ	37,888	53.860	2,040,647.68	

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	103,606	33.830	3,504,990.98	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	89,110	24.080	2,145,768.80	
L'OREAL SA	26,792	333.950	8,947,188.40	
LA FRANCAISE DES JEUX SACA	11,391	36.920	420,555.72	
LEG IMMOBILIE SE	8,311	76.040	631,968.44	
LEGRAND SA	29,237	109.600	3,204,375.20	
LEONARDO SPA	45,066	35.910	1,618,320.06	
LOTUS BAKERIES	45	9,060.000	407,700.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	30,690	690.900	21,203,721.00	
MEDIOBANCA SPA	55,793	16.635	928,116.55	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	83,566	61.180	5,112,567.88	
MERCK KGAA	14,414	135.450	1,952,376.30	
METSO CORPORATION	69,323	10.880	754,234.24	
MICHELIN (C.G.D.E.)	74,513	33.600	2,503,636.80	
MONCLER SPA	26,078	65.960	1,720,104.88	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,000	328.900	1,973,400.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	14,916	517.200	7,714,555.20	
NEMETSCHEK SE	6,430	121.200	779,316.00	
NESTE OYJ	47,248	9.108	430,334.78	
NEXI SPA	57,613	4.725	272,221.42	
NN GROUP NV	30,192	45.620	1,377,359.04	
NOKIA OYJ	594,641	4.720	2,806,705.52	
NORDEA BANK ABP	351,961	12.110	4,262,247.71	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS- A	7,599	71.150	540,668.85	
OMV AG	16,482	40.040	659,939.28	
ORANGE S.A.	212,376	10.910	2,317,022.16	
ORION OYJ-CLASS B	12,057	52.360	631,304.52	
PERNOD-RICARD	22,623	97.340	2,202,122.82	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	17,072	36.930	630,468.96	
POSTE ITALIANE SPA	50,921	14.605	743,701.20	
PROSUS	152,578	44.305	6,759,968.29	
PRYSMIAN SPA	31,291	68.700	2,149,691.70	
PUBLICIS GROUPE	25,512	105.750	2,697,894.00	
PUMA AG	11,788	29.020	342,087.76	
QIAGEN NV	24,018	37.585	902,716.53	
RANDSTAD NV	12,139	38.200	463,709.80	
RATIONAL AG	570	860.500	490,485.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	11,638	55.850	649,982.30	
REDEIA CORPORACION SA	45,523	16.800	764,786.40	
RENAULT SA	21,425	51.200	1,096,960.00	
REPSOL SA	131,106	12.175	1,596,215.55	

	REXEL SA	24,919	26.050	649,139.95	
	RHEINMETALL AG	4,859	932.800	4,532,475.20	
	ROYAL KPN NV	441,032	3.498	1,542,729.93	
	RWE AG	70,513	28.480	2,008,210.24	
	SAFRAN SA	40,501	252.000	10,206,252.00	
	SAMPO OYJ	275,655	8.102	2,233,356.81	
	SANOFI	127,401	103.080	13,132,495.08	
	SAP SE	116,482	276.300	32,183,976.60	
	SARTORIUS AG-VORZUG	2,925	238.700	698,197.50	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,260	203.800	664,388.00	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	60,993	247.200	15,077,469.60	
	SCOUT24 SE	8,340	94.200	785,628.00	
	SEB SA	2,768	88.600	245,244.80	
	SIEMENS AG	84,774	220.350	18,679,950.90	
	SIEMENS ENERGY AG	71,305	60.660	4,325,361.30	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	31,459	56.280	1,770,512.52	
	SNAM SPA	225,261	4.433	998,582.01	
	SOCIETE GENERALE	80,285	37.760	3,031,561.60	
	SODEXO	9,868	72.150	711,976.20	
	SOFINA	1,721	228.600	393,420.60	
	STELLANTIS NV	219,324	13.332	2,924,027.56	
	STMICROELECTRONICS NV	76,222	24.945	1,901,357.79	
	STORA ENSO OYJ	64,803	10.750	696,632.25	
	SYENQO SA	8,253	78.720	649,676.16	
	SYMRISE AG	14,807	95.680	1,416,733.76	
	TALANX AG	7,184	84.150	604,533.60	
	TELECOM ITALIA SPA	1,139,036	0.274	312,095.86	
	TELEFONICA SA	450,563	4.092	1,843,703.79	
	TELEPERFORMANCE	6,098	98.200	598,823.60	
	TENARIS SA	45,289	18.690	846,451.41	
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	156,642	7.846	1,229,013.13	
	THALES SA	10,336	184.350	1,905,441.60	
	TOTALENERGIES SE	240,643	58.710	14,128,150.53	
	UCB SA	14,093	180.000	2,536,740.00	
	UNICREDIT SPA	164,277	47.910	7,870,511.07	
	UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	43,650	14.130	616,774.50	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	91,867	28.200	2,590,649.40	
	UPM-KYMMENE OYJ	59,566	29.260	1,742,901.16	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	78,415	27.210	2,133,672.15	
	VINCI SA	55,822	108.500	6,056,687.00	
	VOLKSWAGEN AG	23,036	97.460	2,245,088.56	
	VONOVIA SE	82,643	28.440	2,350,366.92	
	WARTSILA OYJ	55,950	17.910	1,002,064.50	
	WOLTERS KLUWER NV	26,587	176.850	4,701,910.95	
	ZALANDO SE	25,026	37.610	941,227.86	
ユーロ 小計		20,661,574		626,728,671.14 (98,772,438,572)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,219,275	55.800	68,035,545.00	

BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	412,539	26.750	11,035,418.25	
CK ASSET HOLDINGS LTD	214,409	33.750	7,236,303.75	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	298,909	39.300	11,747,123.70	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	70,000	51.850	3,629,500.00	
CLP HOLDINGS LTD	183,143	64.300	11,776,094.90	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	243,810	29.650	7,228,966.50	
HANG SENG BANK LTD	84,012	100.500	8,443,206.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	162,641	21.200	3,447,989.20	
HKT TRUST AND HKT LTD	437,000	9.800	4,282,600.00	
HONG KONG & CHINA GAS	1,249,437	6.120	7,646,554.44	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	134,311	338.600	45,477,704.60	
MTR CORP	173,255	24.950	4,322,712.25	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	154,587	49.950	7,721,620.65	
SANDS CHINA LTD	269,780	17.300	4,667,194.00	
SINO LAND CO	436,000	7.680	3,348,480.00	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	150,000	17.560	2,634,000.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	161,523	70.800	11,435,828.40	
SWIRE PACIFIC LTD	45,366	63.500	2,880,741.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	153,500	105.700	16,224,950.00	
WH GROUP LTD	927,500	6.020	5,583,550.00	
WHARF HOLDINGS LTD	119,000	17.800	2,118,200.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	186,733	19.840	3,704,782.72	
香港・ドル 小計	7,486,730		254,629,065.36 (4,947,442,740)	
合計	122,587,661		1,154,747,218,583 (1,154,747,218,583)	

(2) 株式以外の有価証券

2025年2月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,599.00	1,677,360.69	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	36,757.00	1,297,889.67	
		AMERICAN TOWER REIT INC	52,118.00	9,827,370.08	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	60,292.00	1,299,292.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,855.00	3,449,572.35	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,726.00	1,168,980.14	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,893.00	1,414,077.70	

	CROWN CASTLE INC	48,513.00	4,330,270.38	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	36,524.00	6,194,835.64	
	EQUINIX INC	10,592.00	9,946,735.36	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,781.00	1,290,116.82	
	EQUITY RESIDENTIAL	38,063.00	2,707,040.56	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,160.00	2,084,992.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	23,653.00	3,637,121.81	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30,674.00	1,502,719.26	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	78,012.00	1,521,234.00	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	78,399.00	1,339,054.92	
	INVITATION HOMES INC	64,960.00	2,062,480.00	
	IRON MOUNTAIN INC	32,700.00	3,036,849.00	
	KIMCO REALTY CORP	75,205.00	1,619,163.65	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,043.00	2,053,750.78	
	PROLOGIS INC	103,316.00	12,566,325.08	
	PUBLIC STORAGE	17,573.00	5,226,737.39	
	REALTY INCOME CORP	97,276.00	5,415,354.92	
	REGENCY CENTERS CORP	19,224.00	1,411,810.56	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	11,991.00	2,491,370.07	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	36,366.00	6,761,530.38	
	SUN COMMUNITIES INC	13,924.00	1,740,639.24	
	UDR INC	34,983.00	1,491,675.12	
	VENTAS INC	46,218.00	3,094,757.28	
	VICI PROPERTIES INC	116,964.00	3,565,062.72	
	WELLTOWER INC	68,995.00	10,329,241.45	
	WP CAREY INC	24,490.00	1,479,685.80	
アメリカ・ドル 小計		1,359,839.00	119,035,097.42 (17,989,774,273)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	79,118.00	460,466.76	
	SEGRO PLC	143,377.00	1,007,940.31	
イギリス・ポンド 小計		222,495.00	1,468,407.07 (279,437,865)	
オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	191,799.00	6,900,928.02	
	GPT GROUP	213,545.00	1,025,016.00	
	MIRVAC GROUP	440,599.00	951,693.84	
	SCENTRE GROUP	578,996.00	2,124,915.32	
	STOCKLAND	265,529.00	1,372,784.93	
	VICINITY CENTRES	430,961.00	982,591.08	
オーストラリア・ドル 小計		2,121,429.00	13,357,929.19 (1,281,960,464)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,366.00	373,984.38	
カナダ・ドル 小計		9,366.00	373,984.38	

			(39,724,621)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	417,500.00	1,060,450.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	650,390.00	1,274,764.40	
シンガポール・ドル 小計		1,067,890.00	2,335,214.40 (263,038,550)	
ユーロ	COVIVIO	6,238.00	309,529.56	
	GECINA SA	5,142.00	469,721.70	
	KLEPIERRE	23,910.00	710,127.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,175.00	1,052,682.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	20,208.00	420,730.56	
ユーロ 小計		68,673.00	2,962,791.32 (466,935,912)	
香港・ドル	LINK REIT	287,871.00	10,032,304.35	
香港・ドル 小計		287,871.00	10,032,304.35 (194,927,674)	
投資証券 合計		5,137,563	20,515,799,359 (20,515,799,359)	
合計			20,515,799,359 (20,515,799,359)	

（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	74.23	-	77.93
	投資証券 33銘柄	-	1.49	
イギリス・ポンド	株式 77銘柄	3.56	-	3.68
	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	-	0.12
オーストラリア・ドル	株式 48銘柄	1.64	-	1.79
	投資証券 6銘柄	-	0.11	
カナダ・ドル	株式 82銘柄	3.06	-	3.15
	投資証券 1銘柄	-	0.00	
シンガポール・ドル	株式 13銘柄	0.31	-	0.34
	投資証券 2銘柄	-	0.02	
スイス・フラン	株式 45銘柄	2.37	-	2.44
スウェーデン・クローナ	株式 42銘柄	0.80	-	0.82
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.64	-	0.66
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.04	-	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 214銘柄	8.17	-	8.44
	投資証券 5銘柄	-	0.04	
香港・ドル	株式 23銘柄	0.41	-	0.44
	投資証券 1銘柄	-	0.02	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2025年2月20日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	217,044,164
金銭信託	18,597,590
コール・ローン	1,178,821,174
株式	13,570,924,572
投資信託受益証券	1,031,648,155
投資証券	7,178,279
派生商品評価勘定	55,308,673
未収入金	22,869
未収配当金	17,057,905
差入委託証拠金	468,378,508
流動資産合計	16,564,981,889
資産合計	16,564,981,889
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,366,597
未払金	2,124
未払解約金	33,343,686
流動負債合計	46,712,407
負債合計	46,712,407
純資産の部	
元本等	
元本	10,532,947,501
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,985,321,981
元本等合計	16,518,269,482
純資産合計	16,518,269,482
負債純資産合計	16,564,981,889

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月21日 至 2025年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2025年2月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	7,713,247,784円
同期中追加設定元本額	4,480,856,659円
同期中一部解約元本額	1,661,156,942円
元本の内訳	
ファンド名	
<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド	2,984,999,392円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	32,974,167円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式ノリート）	35,135,475円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式ノリートノ債券）	11,173,113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）	67,464,340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）	686,276,256円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	4,488,687,517円
FWニッセイ新興国株インデックス	17,964,065円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	202,214,866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）	2,429,162円
DCニッセイ新興国株式インデックス	2,003,629,148円
計	10,532,947,501円
2. 受益権の総数	10,532,947,501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2月21日 至 2025年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年2月20日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年2月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	639,804,665
投資信託受益証券	39,833,901
投資証券	301,205
合計	679,939,771

（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2025年2月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2025年2月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	1,159,638,114	-	1,146,271,899	13,366,215
	1,159,638,114	-	1,146,271,899	13,366,215
合計	1,159,638,114	-	1,146,271,899	13,366,215

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2025年2月20日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	1,815,055,431	-	1,870,363,721	55,308,290
合計	1,815,055,431	-	1,870,363,721	55,308,290

（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）

	2025年2月20日現在
１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	1.5682円 (15,682円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

2025年2月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AUTOHOME INC-ADR	534	30.110	16,078.74	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,233	13.250	29,587.25	
	CREDICORP LTD	695	184.150	127,984.25	
	H WORLD GROUP LIMITED (ADR)	2,293	37.580	86,170.94	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	9,900	1.984	19,641.60	
	INTER & CO INC - CL A	3,300	5.350	17,655.00	
	KANZHUN LTD	3,300	15.400	50,820.00	
	KE HOLDINGS INC	8,099	20.020	162,141.98	

	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	567	38.750	21,971.25	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,892	0.000	0.18	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	2,982	0.000	0.29	
	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	468	0.000	0.04	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	729	0.000	0.07	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	34,000	13.480	458,320.00	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	300	0.000	0.03	
	PDD HOLDINGS INC(ADR)	8,341	124.430	1,037,870.63	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	552	0.000	0.05	
	PJSC GAZPROM ADR	27,971	0.000	2.79	
	PJSC MMC NORILSK NICKEL- ADR	2,732	0.000	0.27	
	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	1,915	0.000	0.19	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	460	0.000	0.04	
	QIFU TECHNOLOGY INC(ADR)	1,800	44.040	79,272.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	5,479	0.000	0.54	
	SBERBANK OF RUSSIA	49,840	0.000	4.98	
	SEVERSTAL PAO - GDR REG S	1,314	0.000	0.13	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	5,184	1.773	9,191.23	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,145	96.380	110,355.10	
	STONECO LTD-A	3,000	10.070	30,210.00	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	5,163	0.000	0.51	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	4,524	14.580	65,959.92	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	1,225	0.000	0.12	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	568	0.000	0.05	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	8,573	13.100	112,306.30	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	4,325	14.570	63,015.25	
	VK COMPANY LTD-GDR	380	0.000	0.03	
	VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	6,620	0.000	0.66	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	422	0.000	0.04	
	XP INC - CLASS A	4,500	14.830	66,735.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	4,626	47.290	218,763.54	
アメリカ・ドル	小計	221,951		2,784,060.99 (420,755,137)	
インド・ル ピー	ABB INDIA LTD	517	5,123.850	2,649,030.45	
	ADANI ENTERPRISES LTD	1,562	2,180.800	3,406,409.60	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	2,770	864.700	2,395,219.00	

ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	6,816	1,082.850	7,380,705.60	
ADANI POWER LTD	9,132	482.550	4,406,646.60	
ALKEM LABORATORIES LTD	517	4,741.700	2,451,458.90	
AMBUJA CEMENTS LTD	8,774	479.900	4,210,642.60	
APL APOLLO TUBES LTD	1,926	1,380.650	2,659,131.90	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,192	6,422.650	7,655,798.80	
ASHOK LEYLAND LTD	19,677	225.410	4,435,392.57	
ASIAN PAINTS LTD	4,520	2,239.100	10,120,732.00	
ASTRAL LTD	1,023	1,371.700	1,403,249.10	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	4,770	525.650	2,507,350.50	
AUROBINDO PHARMA LTD	2,097	1,135.200	2,380,514.40	
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,837	3,685.000	6,769,345.00	
AXIS BANK LTD	27,876	1,011.350	28,192,392.60	
BAJAJ AUTO LTD	811	8,479.500	6,876,874.50	
BAJAJ FINANCE LTD	3,284	8,439.450	27,715,153.80	
BAJAJ FINSERV LTD	4,831	1,875.350	9,059,815.85	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	215	11,732.100	2,522,401.50	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,012	2,675.550	2,707,656.60	
BANK OF BARODA	9,496	208.890	1,983,619.44	
BHARAT ELECTRONICS LTD	40,951	253.400	10,376,983.40	
BHARAT FORGE LTD	3,156	1,076.050	3,396,013.80	
BHARAT HEAVY ELECTROCALCS	12,085	195.090	2,357,662.65	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	16,172	255.600	4,133,563.20	
BHARTI AIRTEL LTD	30,801	1,645.200	50,673,805.20	
BOSCH LTD	100	27,295.400	2,729,540.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,379	4,837.500	6,670,912.50	
BSE LTD	797	5,631.000	4,487,907.00	
CADILA HEALTHCARE LTD	3,563	891.450	3,176,236.35	
CANARA BANK	25,567	85.560	2,187,512.52	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LIMITED	7,587	584.200	4,432,325.40	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	5,390	1,375.400	7,413,406.00	
CIPLA LIMITED	6,070	1,464.150	8,887,390.50	
COAL INDIA LTD	23,487	362.300	8,509,340.10	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,470	2,460.450	3,616,861.50	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,009	696.250	2,791,266.25	
CUMMINS INDIA LTD	1,728	2,690.300	4,648,838.40	
DABUR INDIA LTD	7,985	504.450	4,028,033.25	
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,272	5,934.900	7,549,192.80	

DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	417	14,088.300	5,874,821.10	
DLF LTD	7,713	690.150	5,323,126.95	
DR. REDDY'S LABORATORIES	5,925	1,165.850	6,907,661.25	
EICHER MOTORS LTD	1,576	4,810.600	7,581,505.60	
GAIL INDIA LTD	26,237	163.530	4,290,536.61	
GMR INFRASTRUCTURE LTD	26,931	70.270	1,892,441.37	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	4,616	1,024.500	4,729,092.00	
GODREJ PROPERTIES LTD	1,395	2,047.500	2,856,262.50	
GRASIM INDUSTRIES LTD	2,865	2,463.200	7,057,068.00	
HAVELLS INDIA LTD	2,949	1,515.650	4,469,651.85	
HCL TECHNOLOGIES LTD	11,047	1,712.300	18,915,778.10	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,289	3,791.750	4,887,565.75	
HDFC BANK LTD	68,075	1,727.200	117,579,140.00	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	12,103	622.850	7,538,353.55	
HERO MOTOCORP LTD	1,289	3,879.150	5,000,224.35	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	14,614	626.300	9,152,748.20	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	2,125	3,363.750	7,147,968.75	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	9,526	324.600	3,092,139.60	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	10,417	2,250.400	23,442,416.80	
ICICI BANK LTD	62,942	1,261.650	79,410,774.30	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	2,980	1,728.950	5,152,271.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,346	576.000	1,351,296.00	
IDFC BANK LTD	56,848	59.990	3,410,311.52	
INDIAN HOTELS CO LTD	10,329	746.700	7,712,664.30	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	37,833	119.870	4,535,041.71	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,327	728.300	3,151,354.10	
INDUS TOWERS LTD	14,838	341.400	5,065,693.20	
INDUSIND BANK LTD	3,140	1,035.800	3,252,412.00	
INFO EDGE INDIA LTD	914	7,595.050	6,941,875.70	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	40,031	1,810.800	72,488,134.80	
INTERGLOBE AVIATION LTD	2,280	4,399.900	10,031,772.00	
ITC LTD	34,818	406.400	14,150,035.20	
JINDAL STAINLESS LTD	4,346	602.550	2,618,682.30	
JINDAL STEEL & POWER LTD	5,534	860.100	4,759,793.40	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	31,385	228.920	7,184,654.20	
JSW ENERGY LTD	4,815	454.850	2,190,102.75	
JSW STEEL LTD	7,756	977.350	7,580,326.60	
JUBILANT FOODWORKS LTD	2,065	709.450	1,465,014.25	

KALYAN JEWELLERS INDIA LTD	4,819	483.150	2,328,299.85	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,637	1,985.000	27,069,445.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	8,250	3,275.900	27,026,175.00	
LTIMINDTREE LIMITED	943	5,470.100	5,158,304.30	
LUPIN LTD	2,422	1,978.250	4,791,321.50	
MACROTECH DEVELOPERS LTD	2,725	1,181.750	3,220,268.75	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	10,750	2,757.400	29,642,050.00	
MANKIND PHARMA LTD	1,387	2,364.550	3,279,630.85	
MARICO LTD	4,615	634.950	2,930,294.25	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,495	12,686.150	18,965,794.25	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	9,488	1,019.500	9,673,016.00	
MPHASIS LTD	1,316	2,611.250	3,436,405.00	
MRF LTD	24	109,570.700	2,629,696.80	
MUTHOOT FINANCE LTD	1,734	2,264.200	3,926,122.80	
NESTLE INDIA LTD	4,509	2,204.950	9,942,119.55	
NHPC LTD	38,515	74.620	2,873,989.30	
NMDC LTD	35,043	64.950	2,276,042.85	
NTPC LTD	52,250	314.800	16,448,300.00	
OBEROI REALTY LTD	1,611	1,602.150	2,581,063.65	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	41,708	238.300	9,939,016.40	
OIL INDIA LTD	6,297	396.350	2,495,815.95	
ORACLE FINANCIAL SERVICES	277	8,793.400	2,435,771.80	
PAGE INDUSTRIES LTD	55	41,530.450	2,284,174.75	
PB FINTECH LTD	3,475	1,511.800	5,253,505.00	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	1,116	5,899.800	6,584,176.80	
PETRONET LNG LTD	6,694	298.350	1,997,154.90	
PHOENIX MILLS LTD	2,512	1,554.300	3,904,401.60	
PI INDUSTRIES LTD	717	3,203.500	2,296,909.50	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,082	2,768.700	5,764,433.40	
POLYCAB INDIA LTD	517	5,600.100	2,895,251.70	
POWER FINANCE CORPORATION	15,725	384.450	6,045,476.25	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	55,562	263.050	14,615,584.10	
PRESTIGE ESTATES PROJECTS	1,809	1,230.050	2,225,160.45	
PUNJAB NATIONAL BANK	25,385	92.860	2,357,251.10	
RAIL VIKAS NIGAM LTD	6,549	376.850	2,467,990.65	
REC LTD	14,200	395.650	5,618,230.00	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	74,094	1,227.450	90,946,680.30	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	39,725	128.460	5,103,073.50	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	2,791	857.900	2,394,398.90	

	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	4,948	1,475.600	7,301,268.80	
	SHREE CEMENT LTD	75	28,655.150	2,149,136.25	
	SHRIRAM FINANCE LIMITED	16,390	557.800	9,142,342.00	
	SIEMENS LTD	1,037	4,954.900	5,138,231.30	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	350	8,783.700	3,074,295.00	
	SONA BLW PRECISION FORGINGS	3,909	509.350	1,991,049.15	
	SRF LTD	1,334	2,728.000	3,639,152.00	
	STATE BANK OF INDIA	21,173	727.300	15,399,122.90	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	11,764	1,676.600	19,723,522.40	
	SUNDARAM FINANCE LTD	868	4,741.300	4,115,448.40	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	839	3,713.600	3,115,710.40	
	SUZLON ENERGY LTD	116,921	54.160	6,332,441.36	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	1,415	1,501.800	2,125,047.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	11,098	3,784.100	41,995,941.80	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	6,156	1,025.300	6,311,746.80	
	TATA ELXSI LTD	496	6,017.600	2,984,729.60	
	TATA MOTORS LTD	25,109	681.000	17,099,229.00	
	TATA POWER CO LTD	20,526	347.650	7,135,863.90	
	TATA STEEL LTD	94,976	135.760	12,893,941.76	
	TECH MAHINDRA LTD	6,408	1,685.800	10,802,606.40	
	THERMAX LTD	559	3,339.650	1,866,864.35	
	TITAN CO LTD	4,248	3,210.300	13,637,354.40	
	TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	1,426	3,120.550	4,449,904.30	
	TORRENT POWER LTD	2,238	1,258.700	2,816,970.60	
	TRENT LTD	2,141	4,991.450	10,686,694.45	
	TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	1,349	2,678.000	3,612,622.00	
	TVS MOTOR CO LTD	2,887	2,381.900	6,876,545.30	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,399	11,291.550	15,796,878.45	
	UNION BANK OF INDIA	17,927	114.920	2,060,170.84	
	UNITED SPIRITS LTD	3,724	1,328.850	4,948,637.40	
	UPL LTD	4,658	650.050	3,027,932.90	
	VARUN BEVERAGES LTD	13,990	475.900	6,657,841.00	
	VEDANTA LTD	18,194	423.500	7,705,159.00	
	VODAFONE IDEA LTD	301,243	8.300	2,500,316.90	
	VOLTAS LTD	2,560	1,284.100	3,287,296.00	
	WIPRO LTD	31,370	314.100	9,853,317.00	
	YES BANK LTD	186,706	18.000	3,360,708.00	
	ZOMATO LTD	79,069	234.100	18,510,052.90	
インド・ルビー	小計	2,367,163		1,436,095,932.55 (2,513,167,882)	
インドネシア・ルビア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	220,000	2,250.000	495,000,000.00	

	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	75,300	7,025.000	528,982,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	289,000	4,700.000	1,358,300,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	702,300	8,950.000	6,285,585,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	435,300	5,175.000	2,252,677,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	185,200	4,520.000	837,104,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	890,800	4,020.000	3,581,016,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	272,946	855.000	233,368,830.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	89,600	8,000.000	716,800,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	45,500	4,640.000	211,120,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	11,203,400	80.000	896,272,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	6,000	6,350.000	38,100,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	9,600	11,650.000	111,840,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	10,400	8,000.000	83,200,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	176,100	1,235.000	217,483,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	113,600	1,750.000	198,800,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	221,600	2,480.000	549,568,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	647,100	2,670.000	1,727,757,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	49,100	1,375.000	67,512,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	10,600	25,200.000	267,120,000.00	
インドネシア・ルピア 小計		15,653,446		20,657,606,830.00 (192,115,744)	
オフショア・ 人民元	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,500	12.000	54,000.00	
	ADVANCED MICRO- FABRICATION-A	528	201.270	106,270.56	
	AECC AVIATION POWER CO-A	3,100	37.000	114,700.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	71,800	5.250	376,950.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	4,637	13.480	62,506.76	
	AIR CHINA LTD-A	10,100	6.850	69,185.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	14,800	7.490	110,852.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	23.290	23,290.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	161.340	48,402.00	

ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	140	81.400	11,396.00	
BANK OF BEIJING CO LTD - A	8,600	6.000	51,600.00	
BANK OF CHINA LTD-A	32,100	5.530	177,513.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	22,200	7.430	164,946.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	7,800	9.430	73,554.00	
BANK OF NANJING CO LTD - A	8,800	10.400	91,520.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	4,300	24.730	106,339.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD- A	4,500	9.420	42,390.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO- A	33,200	6.650	220,780.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	218	365.000	79,570.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,000	36.910	73,820.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	560	69.690	39,026.40	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	51,100	5.630	287,693.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	45,400	4.500	204,300.00	
BYD CO LTD -A	1,300	358.500	466,050.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	7,500	8.340	62,550.00	
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	366	625.510	228,936.66	
CGN POWER CO LTD-A	17,400	3.740	65,076.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	95.770	9,577.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	12,300	6.510	80,073.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK- A	9,600	8.780	84,288.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD- A	3,200	32.520	104,064.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6,800	3.660	24,888.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	37,000	3.830	141,710.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	6,900	14.940	103,086.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	16,200	7.940	128,628.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	2,400	33.690	80,856.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO- A	4,100	39.800	163,180.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	17,500	41.980	734,650.00	

CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	10,500	18.320	192,360.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	9.520	18,088.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	21,200	4.170	88,404.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	10.170	107,802.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	11,500	22.980	264,270.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,000	32.420	129,680.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	25,900	5.920	153,328.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	39,200	5.930	232,456.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	10,871	5.710	62,073.41	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	1,473	48.730	71,779.29	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	4,800	36.100	173,280.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4,700	5.660	26,602.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	22,900	5.540	126,866.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	57,100	4.250	242,675.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	2,800	60.860	170,408.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	8,100	7.650	61,965.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	22,600	28.070	634,382.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	24,600	2.900	71,340.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	5,850	13.340	78,039.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	3,200	25.630	82,016.00	
CITI PACIFIC SPECIAL STEE-A	13,400	11.860	158,924.00	
CITIC SECURITIES CO-A	12,500	27.990	349,875.00	
CMOC GROUP LTD-A	11,300	6.960	78,648.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	1,820	36.050	65,611.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	3,480	273.550	951,954.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	5,070	14.530	73,667.10	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	6,600	24.830	163,878.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	24,500	6.860	168,070.00	

DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,200	14.930	62,706.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	13,113	23.820	312,351.66	
EVE ENERGY CO LTD-A	900	44.980	40,482.00	
EVERBRIGHT SECURITIES CO -A	7,800	17.540	136,812.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	6.350	37,465.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	2,554	40.950	104,586.30	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	11,600	8.040	93,264.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	11,900	23.240	276,556.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	2,800	57.230	160,244.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	2,800	35.690	99,932.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	13,200	4.250	56,100.00	
GEM CO LTD-A	13,300	6.580	87,514.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	3,700	15.570	57,609.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	196	127.510	24,991.96	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	200	52.750	10,550.00	
GOERTEK INC -A	1,000	28.540	28,540.00	
GOLDWIND SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A	3,900	9.080	35,412.00	
GONGNIU GROUP CO LTD-A	1,015	75.700	76,835.50	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,800	22.570	40,626.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,500	25.350	88,725.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,200	41.940	134,208.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,000	48.550	48,550.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	5,400	6.190	33,426.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	8,700	9.120	79,344.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,300	26.910	34,983.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,000	19.500	19,500.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,200	10.630	119,056.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	14,412	17.580	253,362.96	

HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,500	26.400	145,200.00	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,646	14.380	23,669.48	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	3,900	26.700	104,130.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	25.950	20,760.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	7,900	15.580	123,082.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2,800	15.780	44,184.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	700	308.750	216,125.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	400	53.720	21,488.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,300	33.380	43,394.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	7,700	6.530	50,281.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,500	17.540	149,090.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	7.360	45,632.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	17.500	24,500.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	134.000	67,000.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	1,183	33.580	39,725.14	
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	1,886	137.370	259,079.82	
IFLYTEK CO LTD - A	1,200	54.420	65,304.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	140	178.630	25,008.20	
IND & COMM BK OF CHINA-A	54,400	7.050	383,520.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD - A	14,000	21.000	294,000.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	21,900	6.050	132,495.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	1.800	58,320.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	6.260	13,146.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	2,800	28.100	78,680.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,372	12.800	17,561.60	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	2,900	9.200	26,680.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,000	78.910	78,910.00	

JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS CO LTD-A	6,484	44.710	289,899.64	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,300	47.110	61,243.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY - A	900	77.970	70,173.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,200	13.900	30,580.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	9,300	21.100	196,230.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	6,076	6.370	38,704.12	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	41.060	90,332.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	900	1,491.000	1,341,900.00	
LB GROUP CO LTD-A	2,900	17.850	51,765.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	2,400	28.930	69,432.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	13,900	9.990	138,861.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,480	16.350	105,948.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	6,689	42.750	285,954.75	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	900	119.000	107,100.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,300	27.330	35,529.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	480	92.080	44,198.40	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	3.140	64,370.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	3,300	71.450	235,785.00	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	974	73.340	71,433.16	
MUYUAN FOODS CO LTD-A	5,790	37.400	216,546.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,110	23.330	72,556.30	
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,776	20.400	117,830.40	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	600	457.000	274,200.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	48.720	43,848.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	10.440	18,792.00	
NINESTAR CORP-A	1,700	26.600	45,220.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,015	73.190	74,287.85	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	4,400	16.030	70,532.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	4,500	9.770	43,965.00	
PETROCHINA CO LTD-A	29,700	7.980	237,006.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	675	26.880	18,144.00	

PICC HOLDING CO-A	14,900	6.980	104,002.00	
PING AN BANK CO LTD-A	23,300	11.710	272,843.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	9,900	51.450	509,355.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	8.330	22,491.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	12,200	5.440	66,368.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	5.110	51,100.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	11,400	16.430	187,302.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	17,500	8.890	155,575.00	
S F HOLDING CO LTD-A	7,300	41.250	301,125.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,000	17.660	141,280.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	5,100	12.380	63,138.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,000	17.450	52,350.00	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	4,600	21.400	98,440.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	13,700	7.260	99,462.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	12,900	14.480	186,792.00	
SERES GROUP CO L-A	1,400	119.490	167,286.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	4,700	19.830	93,201.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,360	24.730	157,282.80	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,900	20.660	39,254.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	30,200	3.840	115,968.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,872	33.820	63,311.04	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	8.420	53,046.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	25.500	91,800.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	5,100	9.530	48,603.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	5,500	19.820	109,010.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	18,900	10.440	197,316.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	1,160	16.160	18,745.60	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	14,800	8.050	119,140.00	

SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,296	130.260	168,816.96	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,280	189.770	242,905.60	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD- A	140	147.940	20,711.60	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	11,000	5.170	56,870.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,500	72.560	108,840.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDIC-A	1,300	256.000	332,800.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	470	96.930	45,557.10	
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	1,800	14.220	25,596.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	700	68.250	47,775.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	91.970	14,715.20	
TBEA CO LTD-A	2,860	12.320	35,235.20	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4,400	4.840	21,296.00	
TCL ZHONGHUA RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	1,875	9.120	17,100.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	1,300	32.690	42,497.00	
TONGWEI CO LTD-A	3,900	21.190	82,641.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	1,092	17.720	19,350.24	
TSINGTAO BREWERY CO LTD- A	600	69.200	41,520.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	419	64.110	26,862.09	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	980	29.890	29,292.20	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	4,400	69.650	306,460.00	
WEICHAO POWER CO LTD-A	3,400	14.760	50,184.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1,800	16.250	29,250.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	9,700	7.940	77,018.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	405	157.960	63,973.80	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	35.530	7,106.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	5,200	7.490	38,948.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,100	131.110	537,551.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-A	1,872	62.500	117,000.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2,600	8.530	22,178.00	

	XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	4,700	19.630	92,261.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	6,760	13.030	88,082.80	
	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	1,300	31.080	40,404.00	
	YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,690	17.250	29,152.50	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	2,500	13.570	33,925.00	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	700	56.490	39,543.00	
	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	300	31.760	9,528.00	
	ZHANGZHOU PIEN TZE HUANG PHA-A	900	204.980	184,482.00	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	1,100	25.040	27,544.00	
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	3,000	17.490	52,470.00	
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	650	30.340	19,721.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	800	31.480	25,184.00	
	ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,008	21.570	21,742.56	
	ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2,000	11.840	23,680.00	
	ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	1,000	114.240	114,240.00	
	ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	12,400	6.400	79,360.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	21,100	16.350	344,985.00	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9,400	7.350	69,090.00	
	ZTE CORP-A	9,200	40.390	371,588.00	
オフショア・人民元 小計		1,743,628		27,616,339.71 (573,196,462)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	2,517	45,580.000	114,724,860.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,540	42,540.000	193,131,600.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,691	19,400.000	129,805,400.00	
コロンビア・ペソ 小計		13,748		437,661,860.00 (16,115,147)	
タイ・バーツ	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	14,700	295.000	4,336,500.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	59,400	43.250	2,569,050.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	129,100	23.300	3,008,030.00	

	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	71,300	6.500	463,450.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	7,700	185.000	1,424,500.00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	31,900	51.500	1,642,850.00	
	CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN	15,700	34.500	541,650.00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	26,800	23.000	616,400.00	
	CP ALL PCL-FOREIGN	68,800	51.250	3,526,000.00	
	CP AXTRA PCL-FOREIGN	19,613	28.250	554,067.25	
	DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN	38,400	77.750	2,985,600.00	
	GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	42,400	56.500	2,395,600.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	44,400	8.700	386,280.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	6,300	92.000	579,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	4,900	163.500	801,150.00	
	KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	32,300	24.000	775,200.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN	15,500	51.750	802,125.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	53,400	28.250	1,508,550.00	
	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	15,800	128.000	2,022,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	14,300	19.400	277,420.00	
	PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN	32,900	12.500	411,250.00	
	PTT PCL/FOREIGN	134,300	31.500	4,230,450.00	
	SCB X PCL-FOREIGN	6,800	127.000	863,600.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	12,700	147.000	1,866,900.00	
	THAI OIL PCL-FRGN	9,300	26.750	248,775.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	428,400	2.020	865,368.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-FOREIGN	122,498	13.200	1,616,973.60	
タイ・パーツ 小計		1,459,611		41,319,738.85 (185,525,627)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	2,199	1,020.000	2,242,980.00	
	KOMERCNI BANKA AS	654	1,047.000	684,738.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	141.000	158,484.00	
チェコ・コルナ 小計		3,977		3,086,202.00 (19,364,992)	
チリ・ペソ	BANCO DE CHILE	554,983	125.940	69,894,559.02	

	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,450	31,918.000	46,281,100.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,088,852	52.300	56,946,959.60	
	CENCOSUD SA	9,218	2,515.000	23,183,270.00	
	EMPRESAS CMPC SA	10,124	1,620.000	16,400,880.00	
	EMPRESAS COPEC SA	7,046	6,590.000	46,433,140.00	
	ENEL CHILE SA	90,486	64.300	5,818,249.80	
	ENERSIS SA	205,266	87.100	17,878,668.60	
	FALABELLA SA	7,564	3,601.000	27,237,964.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	1,914,707	15.490	29,658,811.43	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,584	36,700.000	58,132,800.00	
チリ・ペソ 小計		3,891,280		397,866,402.45 (63,197,895)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	49,905	64.300	3,208,891.50	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	11,662	83.800	977,275.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,758	555.000	2,640,690.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	16,544	53.900	891,721.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	16,270	22.800	370,956.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	593	935.000	554,455.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	15,178	99.300	1,507,175.40	
	KOC HOLDING AS	9,876	150.000	1,481,400.00	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	2,013	242.400	487,951.20	
	SASA POLYESTER SANAYI	66,344	3.470	230,213.68	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	17,645	125.700	2,217,976.50	
	TURK HAVA YOLLARI AO	6,115	318.250	1,946,098.75	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	10,503	36.420	382,519.26	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,833	104.900	1,241,281.70	
	TURKIYE IS BANKASI-C	81,449	14.340	1,167,978.66	
	YAPI VE KREDI BANKASI	39,247	28.220	1,107,550.34	
トルコ・リラ 小計		359,935		20,414,135.19 (85,030,997)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	4,259	2,994.000	12,751,446.00	
	OTP BANK RT	2,868	24,640.000	70,667,520.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,879	10,850.000	20,387,150.00	
ハンガリー・フォリント 小計		9,006		103,806,116.00 (40,635,008)	
フィリピン・ペソ	AYALA CORPORATION	3,625	566.500	2,053,562.50	
	AYALA LAND INC	55,300	24.800	1,371,440.00	

	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	25,735	127.600	3,283,786.00	
	BDO UNIBANK INC	32,808	141.900	4,655,455.20	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	13,250	347.000	4,597,750.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	18,558	17.200	319,197.60	
	JOLLIBEE FOODS CORP	7,320	252.200	1,846,104.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,370	500.000	685,000.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	15,127	71.550	1,082,336.85	
	PLDT INC	585	1,398.000	817,830.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,195	795.000	2,540,025.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	105,700	23.150	2,446,955.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	7,280	71.500	520,520.00	
フィリピン・ペソ 小計		289,853		26,219,962.15 (68,200,744)	
ブラジル・レアル	AMBEV SA	61,000	10.970	669,170.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	44,903	10.900	489,442.70	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	48,479	11.980	580,778.42	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	12,900	32.880	424,152.00	
	BANCO DO BRASIL SA	23,900	28.860	689,754.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	7,900	39.740	313,946.00	
	BM&FBOVESPA SA	68,500	11.370	778,845.00	
	BRF SA	7,600	19.030	144,628.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	9,100	15.280	139,048.00	
	CCR SA	6,800	11.760	79,968.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,600	41.960	109,096.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	15,200	37.920	576,384.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	23,917	11.290	270,022.93	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	13,900	10.150	141,085.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,300	99.020	524,806.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	5,100	8.760	44,676.00	
	COSAN SA	10,400	7.410	77,064.00	
	CPFL ENERGIA SA	3,000	34.890	104,670.00	
	EMBRAER SA	8,500	60.880	517,480.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,300	41.280	94,944.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,575	36.160	165,432.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	14,100	31.170	439,497.00	
	GERDAU SA-PREF	12,024	17.360	208,736.64	

	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	43,506	2.430	105,719.58	
	HYPERA S.A	2,900	19.980	57,942.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	61,150	32.890	2,011,223.50	
	ITAUSA SA	75,895	9.120	692,162.40	
	JBS SA	7,100	31.650	224,715.00	
	KLABIN SA - UNIT	10,700	21.190	226,733.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	9,995	30.450	304,347.75	
	NATURA &CO HOLDING SA	7,300	13.690	99,937.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	50,500	42.250	2,133,625.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	49,700	38.440	1,910,468.00	
	PRIIO S.A.	10,000	39.010	390,100.00	
	RAIA DROGASIL SA	16,236	18.860	306,210.96	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	10,500	29.400	308,700.00	
	RUMO SA	13,500	18.650	251,775.00	
	SUZANO S.A.	7,622	58.070	442,609.54	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	5,700	52.730	300,561.00	
	TIM SA	10,500	17.190	180,495.00	
	TOTVS SA	4,400	34.040	149,776.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	5,200	16.770	87,204.00	
	VALE SA	40,454	55.690	2,252,883.26	
	VIBRA ENERGIA SA	12,300	17.810	219,063.00	
	WEG SA	19,720	52.210	1,029,581.20	
ブラジル・リアル 小計		886,876		21,269,457.88 (561,196,773)	
ポーランド・ズロチ	ALIOR BANK SA	1,454	97.220	141,357.88	
	ALLEGRO.EU SA	6,936	30.260	209,883.36	
	BANK PEKAO SA	2,397	178.400	427,624.80	
	BUDIMEX	97	557.000	54,029.00	
	CD PROJEKT SA	427	228.300	97,484.10	
	DINO POLSKA SA	513	484.000	248,292.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,585	137.200	217,462.00	
	LPP SA	9	18,170.000	163,530.00	
	MBANK SA	114	745.000	84,930.00	
	ORLEN SA	8,185	60.790	497,566.15	
	PGE SA	8,858	6.972	61,757.97	
	PKO BANK POLSKI SA	10,872	72.200	784,958.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	8,080	54.260	438,420.80	
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	693	537.400	372,418.20	
ポーランド・ズロチ 小計		50,220		3,799,714.66 (143,313,838)	
マレーシア・リンギット	AMBank HOLDINGS BHD	35,600	5.820	207,192.00	

	AXIATA GROUP BERHAD	20,500	2.100	43,050.00	
	CELCOMDIGI BERHAD	51,800	3.390	175,602.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	93,200	8.290	772,628.00	
	GAMUDA BHD	37,600	4.510	169,576.00	
	GENTING BHD	33,300	3.760	125,208.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	11,300	2.380	26,894.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	10,000	20.500	205,000.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	17,200	7.210	124,012.00	
	INARI AMERTRON BHD	47,200	2.620	123,664.00	
	IOI CORPORATION BHD	19,700	3.750	73,875.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	3,400	20.700	70,380.00	
	MALAYAN BANKING BHD	68,800	10.500	722,400.00	
	MAXIS BHD	53,100	3.520	186,912.00	
	MISC BHD	21,000	7.190	150,990.00	
	MR DIY GROUP M BHD	16,300	1.400	22,820.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	90.000	54,000.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	49,600	3.890	192,944.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,300	19.900	65,670.00	
	PETRONAS GAS BHD	11,300	17.540	198,202.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,680	10.560	59,980.80	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	54,800	5.090	278,932.00	
	PUBLIC BANK BHD	187,800	4.540	852,612.00	
	QL RESOURCES BHD	4,500	4.600	20,700.00	
	RHB BANK BHD	17,000	6.710	114,070.00	
	SIME DARBY BERHAD	4,800	2.220	10,656.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	19,000	4.830	91,770.00	
	SUNWAY BHD	34,300	4.650	159,495.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	12,500	6.900	86,250.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	33,500	13.860	464,310.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	42,800	2.000	85,600.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	30,900	3.330	102,897.00	
マレーシア・リンギット 小計		1,052,380		6,038,291.80 (205,440,198)	
メキシコ・ペソ	ALFA S.A.B. -A	17,900	17.200	307,880.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	228,600	14.900	3,406,140.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	6,700	203.910	1,366,197.00	
	CEMEX SAB-CPO	161,100	13.600	2,190,960.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	6,475	172.750	1,118,556.25	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	20,900	185.420	3,875,278.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,665	357.790	953,510.35	

	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	1,580	580.160	916,652.80	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	3,800	206.020	782,876.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	4,425	414.200	1,832,835.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	16,400	56.410	925,124.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	5,300	123.650	655,345.00	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	3,700	117.830	435,971.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	32,100	155.700	4,997,970.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	27,600	49.230	1,358,748.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	35,600	104.780	3,730,168.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,960	319.510	945,749.60	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	10,000	32.340	323,400.00	
	OPERADORA DE SITES MEX-A-1	12,000	9.740	116,880.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,765	208.670	368,302.55	
	WALMART DE MEXICO-SER V	75,500	55.750	4,209,125.00	
メキシコ・ペソ 小計		677,070		34,817,668.55 (257,337,388)	
ユーロ	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	25,965	1.860	48,294.90	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	29,366	2.500	73,415.00	
	FF GROUP	129	0.000	0.01	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	1,778	14.900	26,492.20	
	JUMBO SA	1,127	27.780	31,308.06	
	MYTILINEOS S.A.	1,452	36.700	53,288.40	
	NATIONAL BANK OF GREECE	8,342	8.550	71,324.10	
	OPAP SA	2,062	16.950	34,950.90	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	12,984	4.680	60,765.12	
	PUBLIC POWER CORP	1,420	13.440	19,084.80	
ユーロ 小計		84,625		418,923.49 (66,022,342)	
韓国・ウォン	ALTEOGEN INC	459	387,000.000	177,633,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP	353	117,900.000	41,618,700.00	
	CELLTRION INC	1,928	180,600.000	348,196,800.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	61	245,000.000	14,945,000.00	

COWAY CO LTD	312	86,400.000	26,956,800.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	1,321	78,200.000	103,302,200.00	
DAUM COMMUNICATIONS CORP	4,215	39,300.000	165,649,500.00	
DB INSURANCE CO LTD	363	100,900.000	36,626,700.00	
DOOSAN BOBCAT INC	272	49,100.000	13,355,200.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	5,255	29,850.000	156,861,750.00	
ECOPRO BM CO LTD	636	135,200.000	85,987,200.00	
ECOPRO CO LTD	1,045	63,800.000	66,671,000.00	
ECOPRO MATERIALS CO LTD	170	93,000.000	15,810,000.00	
ENCHEM CO LTD	141	112,100.000	15,806,100.00	
GS HOLDINGS CORP	407	40,450.000	16,463,150.00	
HANA FINANCIAL GROUP	3,543	62,100.000	220,020,300.00	
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	531	38,500.000	20,443,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	60	264,000.000	15,840,000.00	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	367	107,000.000	39,269,000.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	381	639,000.000	243,459,000.00	
HD HYUNDAI	361	77,600.000	28,013,600.00	
HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	269	386,500.000	103,968,500.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	316	347,000.000	109,652,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	566	239,000.000	135,274,000.00	
HLB INC	1,238	88,000.000	108,944,000.00	
HMM CO LTD	3,612	18,300.000	66,099,600.00	
HYBE CO LTD	300	245,000.000	73,500,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	476	130,300.000	62,022,800.00	
HYUNDAI MOBIS	767	255,500.000	195,968,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,663	204,000.000	339,252,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	423	160,400.000	67,849,200.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	157,100.000	26,707,000.00	
HYUNDAI ROTEM COMPANY	916	85,700.000	78,501,200.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5,116	15,550.000	79,553,800.00	
KAKAOBANK CORP	1,670	23,950.000	39,996,500.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	4,539	82,200.000	373,105,800.00	
KIA CORPORATION	2,840	95,000.000	269,800,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	932	58,300.000	54,335,600.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,254	21,250.000	69,147,500.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	481	80,500.000	38,720,500.00	
KOREA ZINC CO LTD	65	840,000.000	54,600,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,631	24,000.000	63,144,000.00	

KRAFTON INC	369	335,000.000	123,615,000.00	
KT&G CORP	1,142	105,900.000	120,937,800.00	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	101	124,400.000	12,564,400.00	
L&F CO LTD	197	89,700.000	17,670,900.00	
LG CHEM LTD	599	245,500.000	147,054,500.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	56	124,100.000	6,949,600.00	
LG CORP	1,400	70,100.000	98,140,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,203	9,650.000	40,558,950.00	
LG ELECTRONICS INC	1,310	81,500.000	106,765,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	580	366,000.000	212,280,000.00	
LG H AND H CO LTD	100	315,500.000	31,550,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	244	168,000.000	40,992,000.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	1,340	15,160.000	20,314,400.00	
LG UPLUS CORP	815	10,620.000	8,655,300.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	113	68,900.000	7,785,700.00	
LS ELECTRIC CO LTD	229	286,500.000	65,608,500.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	1,199	119,400.000	143,160,600.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	1,312	8,840.000	11,598,080.00	
NAVER CORP	1,790	222,000.000	397,380,000.00	
NCSOFT CORPORATION	137	174,900.000	23,961,300.00	
NETMARBLE CORPORATION	58	46,700.000	2,708,600.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	234	106,900.000	25,014,600.00	
POSCO DX CO LTD	586	24,700.000	14,474,200.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	431	139,100.000	59,952,100.00	
POSCO HOLDINGS INC	793	258,500.000	204,990,500.00	
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	426	43,800.000	18,658,800.00	
S-OIL CORPORATION	988	60,800.000	60,070,400.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	228	1,156,000.000	263,568,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,181	134,400.000	158,726,400.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	807	144,700.000	116,772,900.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	57,359	58,700.000	3,366,973,300.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	10,222	49,400.000	504,966,800.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,205	18,720.000	22,557,600.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	334	403,000.000	134,602,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	8,752	14,730.000	128,916,960.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	892	100,500.000	89,646,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	633	226,000.000	143,058,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	623	130,900.000	81,550,700.00	

	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	5,222	48,450.000	253,005,900.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	470	119,100.000	55,977,000.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	115	48,000.000	5,520,000.00	
	SK HYNIX INC	6,610	218,500.000	1,444,285,000.00	
	SK INC	528	149,300.000	78,830,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	728	130,000.000	94,640,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	1,151	104,300.000	120,049,300.00	
	SK TELECOM CO LTD	720	57,700.000	41,544,000.00	
	SKC CO LTD	129	152,100.000	19,620,900.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	6,866	17,330.000	118,987,780.00	
	YUHAN CORP	684	122,700.000	83,926,800.00	
韓国・ウォン 小計		180,636		13,614,207,970.00 (1,430,853,258)	
香港・ドル	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	10,000	48.950	489,500.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	339,000	4.540	1,539,060.00	
	AKESO INC	8,000	62.650	501,200.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	195,200	124.100	24,224,320.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	52,000	5.740	298,480.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	24,000	4.870	116,880.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	23,000	20.750	477,250.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,000	115.200	230,400.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	16,600	84.250	1,398,550.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	41,000	4.000	164,000.00	
	BAIDU INC-CLASS A	28,050	88.350	2,478,217.50	
	BANK OF CHINA LTD - H	871,000	4.320	3,762,720.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	110,000	6.570	722,700.00	
	BEIGENE LTD	8,600	143.500	1,234,100.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	4,500	27.550	123,975.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	16,000	2.280	36,480.00	
	BILIBILI INC-CLASS Z	3,040	163.500	497,040.00	
	BOC AVIATION LTD	1,900	59.100	112,290.00	
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	58,000	3.940	228,520.00	
	BYD CO LTD	12,500	368.200	4,602,500.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	6,500	57.300	372,450.00	

C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	6,000	14.320	85,920.00	
CGN POWER CO LTD-H	137,000	2.540	347,980.00	
CHINA CITIC BANK	117,000	5.700	666,900.00	
CHINA COAL ENERGY CO - H	20,000	8.130	162,600.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	4.880	39,040.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,162,000	6.730	7,820,260.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	30,150	12.520	377,478.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	67,000	3.130	209,710.00	
CHINA FEIHE LTD	32,000	5.620	179,840.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	51,500	7.830	403,245.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	26,800	6.890	184,652.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	38,000	12.720	483,360.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	13,200	13.800	182,160.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	87,000	14.980	1,303,260.00	
CHINA LITERATURE LTD	3,600	32.300	116,280.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	6.360	203,520.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	38,000	17.260	655,880.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	47,500	44.750	2,125,625.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	10,000	13.000	130,000.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	107,400	3.720	399,528.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	42,000	3.900	163,800.00	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	6.510	78,120.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	56,500	13.820	780,830.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	32,800	24.300	797,040.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	274,000	4.230	1,159,020.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	106,880	4.880	521,574.40	
CHINA POWER INTERNATIONAL	33,000	2.980	98,340.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	28,000	3.810	106,680.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	20,000	25.200	504,000.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	8,200	27.000	221,400.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,500	25.150	1,119,175.00	

CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	10,000	30.000	300,000.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	18,000	5.410	97,380.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	26,000	17.880	464,880.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	52,000	2.330	121,160.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	41,500	29.750	1,234,625.00	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	14,000	7.180	100,520.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	26,000	12.180	316,680.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	30,000	12.140	364,200.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	548,000	1.210	663,080.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	13,800	5.930	81,834.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	29,800	7.900	235,420.00	
CITIC LTD	72,000	9.310	670,320.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	16,500	22.800	376,200.00	
CMOC GROUP LIMITED-H	54,000	5.710	308,340.00	
CRRG CORP LTD H	79,000	5.020	396,580.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	8,900	55.400	493,060.00	
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	5.820	40,740.00	
FOSUN INTERNATIONAL	17,000	4.340	73,780.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	8,000	53.450	427,600.00	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	282,000	1.270	358,140.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	81,000	17.900	1,449,900.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	12.440	124,400.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	4,000	59.650	238,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	29,000	12.580	364,820.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	30,000	5.990	179,700.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	6,200	11.620	72,044.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	16,000	15.900	254,400.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	25,400	25.450	646,430.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	5,000	20.850	104,250.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	20,000	18.440	368,800.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	4,500	21.850	98,325.00	

HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	6,000	26.300	157,800.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	38.300	114,900.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	50,000	4.180	209,000.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	15,800	13.520	213,616.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	839,000	5.600	4,698,400.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	12,500	38.500	481,250.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	20,750	35.250	731,437.50	
JD LOGISTICS INC	22,100	13.940	308,074.00	
JD.COM INC - CL A	29,457	154.200	4,542,269.40	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2,000	8.610	17,220.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	9,000	12.640	113,760.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	44,000	14.440	635,360.00	
KINGSOFT CORP LTD	8,000	43.850	350,800.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	33,500	58.900	1,973,150.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	36,000	7.740	278,640.00	
LEGEND GROUP LTD	86,000	12.580	1,081,880.00	
LI AUTO INC-CLASS A	14,200	104.500	1,483,900.00	
LI NING CO LTD	30,000	16.480	494,400.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	15,500	10.200	158,100.00	
MEITUAN-B	59,460	167.700	9,971,442.00	
MIDEA GROUP CO LTD	3,700	73.750	272,875.00	
MINISO GROUP HOLDING LTD	4,200	43.000	180,600.00	
MMG LTD	56,000	2.530	141,680.00	
NETEASE INC	22,800	162.500	3,705,000.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	18,800	25.700	483,160.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	18,100	42.200	763,820.00	
NIO INC-CLASS A	17,210	34.900	600,629.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	27,800	34.800	967,440.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	1,000	108.800	108,800.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	105,000	4.000	420,000.00	
PETROCHINA CO LTD-H	244,000	6.010	1,466,440.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	85,000	13.320	1,132,200.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	79,000	46.800	3,697,200.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	6,400	111.200	711,680.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	106,000	4.930	522,580.00	

SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	5,750	15.580	89,585.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,400	4.880	80,032.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,700	12.180	32,886.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	9,400	58.900	553,660.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	138,000	3.320	458,160.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	18,000	19.760	355,680.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	6,000	21.550	129,300.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	21,000	12.500	262,500.00	
SUNNY OPTICAL TECH	9,300	90.750	843,975.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	77,800	497.800	38,728,840.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	12,000	11.780	141,360.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	16,000	18.280	292,480.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	10,000	11.500	115,000.00	
TRIP.COM GROUP LTD	7,450	528.500	3,937,325.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD- H	8,000	51.000	408,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	66,000	4.610	304,260.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	24,000	13.980	335,520.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	2,840	64.100	182,044.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	36,500	24.300	886,950.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	180,400	49.450	8,920,780.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	44,000	3.530	155,320.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	15,700	71.100	1,116,270.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	10,000	12.960	129,600.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	41,500	7.800	323,700.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	12,500	13.980	174,750.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	2,000	5.660	11,320.00	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	5,900	34.600	204,140.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,500	12.540	81,510.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	3,900	31.750	123,825.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	68,000	15.820	1,075,760.00	
ZTE CORP-H	6,200	28.750	178,250.00	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	5,650	157.000	887,050.00	

香港・ドル 小計		9,128,187		180,973,392.80 (3,516,313,019)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	6,000	713.000	4,278,000.00	
	ACER INC	38,000	39.550	1,502,900.00	
	ADVANTECH CO LTD	5,408	406.500	2,198,352.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	962.000	1,924,000.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	1,000	3,380.000	3,380,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	41,000	183.500	7,523,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	16,000	41.100	657,600.00	
	ASIA VITAL COMPONENTS	4,000	564.000	2,256,000.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	8,000	691.000	5,528,000.00	
	AUO CORPORATION	51,800	15.000	777,000.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	201.000	1,809,000.00	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	115,000	68.700	7,900,500.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	17,408	127.500	2,219,520.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	73,736	18.150	1,338,308.40	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	13,000	51.200	665,600.00	
	CHINA AIRLINES LTD	20,000	24.050	481,000.00	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	208,083	18.000	3,745,494.00	
	CHINA STEEL CORP	134,000	22.350	2,994,900.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	45,000	126.500	5,692,500.00	
	COMPAL ELECTRONICS	52,000	38.750	2,015,000.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	203,000	40.000	8,120,000.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	24,000	392.000	9,408,000.00	
	E INK HOLDINGS INC	10,000	282.500	2,825,000.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	164,364	29.500	4,848,738.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,000	538.000	1,614,000.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	3,045.000	3,045,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	32,000	43.750	1,400,000.00	
	EVERGREEN MARINE	10,660	217.500	2,318,550.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	21,000	31.700	665,700.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	17,000	88.000	1,496,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,718	129.000	479,622.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	150,047	27.650	4,148,799.55	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	39,000	29.050	1,132,950.00	

FORMOSA PLASTICS CORP	45,000	39.000	1,755,000.00	
FORTUNE ELECTRIC CO LTD	1,100	567.000	623,700.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	98,302	92.400	9,083,104.80	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	7,000	265.500	1,858,500.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	1,000	1,420.000	1,420,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	358.500	1,434,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	149,200	183.000	27,303,600.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,040	612.000	2,472,480.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	105,357	27.950	2,944,728.15	
INNOLUX CORPORATION	66,491	14.900	990,715.90	
INTERNATIONAL GAMES SYSTEM C	3,000	921.000	2,763,000.00	
INVENTEC CO LTD	23,000	46.950	1,079,850.00	
JENTECH PRECISION INDUSTRIAL	1,000	1,420.000	1,420,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	2,710.000	2,710,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	23,000	111.000	2,553,000.00	
MEDIATEK INC	18,000	1,540.000	27,720,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	152,802	39.150	5,982,198.30	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	9,000	199.000	1,791,000.00	
NAN YA PLASTICS CORP	77,000	33.650	2,591,050.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	8,000	39.150	313,200.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	429.500	429,500.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	8,000	542.000	4,336,000.00	
PEGATRON CORP	24,000	98.200	2,356,800.00	
PHARMAESSENTIA CORP	2,000	679.000	1,358,000.00	
POU CHEN	26,000	37.500	975,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,000	266.000	1,330,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	33,000	269.500	8,893,500.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	553.000	3,318,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	8,802	42.800	376,725.60	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	150,244	12.300	1,848,001.20	
SILERGY CORP	3,000	432.500	1,297,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	140,195	22.850	3,203,455.75	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	21,000	71.400	1,499,400.00	

	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	158,768	17.450	2,770,501.60	
	TAIWAN BUSINESS BANK	52,520	15.400	808,808.00	
	TAIWAN CEMENT	71,090	33.050	2,349,524.50	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	129,909	24.550	3,189,265.95	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	28.250	169,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	23,000	112.000	2,576,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	295,000	1,090.000	321,550,000.00	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	60,000	44.350	2,661,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	58,000	81.500	4,727,000.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	15,000	130.000	1,950,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	137,000	42.550	5,829,350.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	8,000	90.000	720,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,785.000	1,785,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	24,000	29.200	700,800.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	3,795	85.000	322,575.00	
	WISTRON CORP	29,000	116.000	3,364,000.00	
	WIWYNN CORP	1,000	2,115.000	2,115,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	23,760	69.600	1,653,696.00	
	YAGEO CORPORATION	6,046	590.000	3,567,140.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	20,000	71.700	1,434,000.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	135,600	36.900	5,003,640.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	11,000	121.500	1,336,500.00	
台湾・ドル 小計		4,034,245		601,003,844.70 (2,772,070,133)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	10,352	187.950	1,945,658.40	
	ANGLO PLATINUM LTD	730	607.300	443,329.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	6,350	552.810	3,510,343.50	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	4,644	170.000	789,480.00	
	BID CORP LTD	3,754	471.860	1,771,362.44	
	BIDVEST GROUP LTD	4,492	253.250	1,137,599.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,032	3,124.060	3,224,029.92	
	CLICKS GROUP LTD	2,024	347.950	704,250.80	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	7,097	209.360	1,485,827.92	

EXXARO RESOURCES LTD	1,516	163.960	248,563.36	
FIRSTRAND LTD	58,574	72.220	4,230,214.28	
GOLD FIELDS LTD	10,244	349.120	3,576,385.28	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	7,258	206.250	1,496,962.50	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,898	97.170	1,156,128.66	
KUMBA IRON ORE LTD	436	375.850	163,870.60	
MTN GROUP LTD	19,216	113.250	2,176,212.00	
NASPERS LTD-N SHS	2,013	4,809.090	9,680,698.17	
NEDBANK GROUP LTD	5,871	281.730	1,654,036.83	
NEPI ROCKCASTLE S.A.	7,914	143.820	1,138,191.48	
OLD MUTUAL LTD	74,869	12.110	906,663.59	
OUTSURANCE GROUP LTD	6,649	66.490	442,092.01	
PEPKOR HOLDINGS LTD	14,569	26.790	390,303.51	
REINET INVESTMENTS SCA	1,873	469.550	879,467.15	
REMGRO LTD	6,411	144.570	926,838.27	
SANLAM LIMITED	23,353	86.470	2,019,333.91	
SASOL LTD	7,508	81.790	614,079.32	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	5,730	274.470	1,572,713.10	
SIBANYE STILLWATER LTD	24,991	16.820	420,348.62	
STANDARD BANK GROUP LTD	17,624	217.530	3,833,748.72	
VODACOM GROUP LTD	6,605	119.000	785,995.00	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	13,949	56.960	794,535.04	
南アフリカ・ランド 小計	369,546		54,119,262.38 (441,071,988)	
合計	42,477,383		13,570,924,572 (13,570,924,572)	

（２）株式以外の有価証券

2025年2月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	21,079.00	749,484.92	
		ISHARES MSCI QATAR CP ETF	43,167.00	780,027.69	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	91,849.00	3,867,761.39	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	81,422.00	1,428,956.10	
	アメリカ・ドル	小計	237,517.00	6,826,230.10 (1,031,648,155)	
投資信託受益証券 合計			237,517	1,031,648,155 (1,031,648,155)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	43,300.00	971,219.00	
	メキシコ・ペソ	小計	43,300.00	971,219.00 (7,178,279)	
投資証券 合計			43,300	7,178,279 (7,178,279)	
合計				1,038,826,434 (1,038,826,434)	

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

（注）

１．各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 39銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	2.55 -	- 6.25	- -	9.94
インド・ルピー	株式 156銘柄	15.21	-	-	17.20
インドネシア・ルピア	株式 20銘柄	1.16	-	-	1.31
オフショア・人民元	株式 228銘柄	3.47	-	-	3.92
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.10	-	-	0.11
タイ・バーツ	株式 27銘柄	1.12	-	-	1.27
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.12	-	-	0.13
チリ・ペソ	株式 11銘柄	0.38	-	-	0.43
トルコ・リラ	株式 16銘柄	0.51	-	-	0.58
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.25	-	-	0.28
フィリピン・ペソ	株式 13銘柄	0.41	-	-	0.47
ブラジル・レアル	株式 45銘柄	3.40	-	-	3.84
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.87	-	-	0.98
マレーシア・リンギット	株式 32銘柄	1.24	-	-	1.41
メキシコ・ペソ	株式 21銘柄 投資証券 1銘柄	1.56 -	- -	- 0.04	1.81
ユーロ	株式 10銘柄	0.40	-	-	0.45
韓国・ウォン	株式 91銘柄	8.66	-	-	9.79
香港・ドル	株式 150銘柄	21.29	-	-	24.07
台湾・ドル	株式 88銘柄	16.78	-	-	18.97
南アフリカ・ランド	株式 31銘柄	2.67	-	-	3.02

（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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2025年2月28日現在

資産総額	3,155,711,565円
負債総額	3,126,526円
純資産総額（ - ）	3,152,585,039円
発行済数量	2,413,596,418口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3062円

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2025年2月28日現在

資産総額	286,766,214,801円
負債総額	511,207,083円
純資産総額（ - ）	286,255,007,718円
発行済数量	88,119,571,713口
1口当たり純資産額（ / ）	3.2485円

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2025年2月28日現在

資産総額	1,156,931,018,922円
負債総額	2,951,240,306円
純資産総額（ - ）	1,153,979,778,616円
発行済数量	238,729,977,168口
1口当たり純資産額（ / ）	4.8338円

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2025年2月28日現在

資産総額	16,315,364,826円
負債総額	96,294,427円
純資産総額（ - ）	16,219,070,399円
発行済数量	10,587,928,562口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5318円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

（２）受益者に対する特典

ありません。

（３）譲渡制限

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

（４）受益権の譲渡

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

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

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第 1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2025年2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 年間ににおける資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2025年2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	400	76,246
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	113	18,267
単位型公社債投資信託	0	0
合計	513	94,514

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

3【委託会社等の経理状況】

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

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

当事業年度(自2023年4月1日 至2024年3月31日)

(単位：千円)

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 その他有価証券 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。 関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
4．引当金の計上基準	賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当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。 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。 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。 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。 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。 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	ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 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 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。 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

配当金支払額

2022年6月30日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度（自2023年4月1日 至2024年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数 (千株)	当事業年度 増加株式数 (千株)	当事業年度 減少株式数 (千株)	当事業年度末 株式数 (千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2023年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

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

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

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

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

当事業年度（2024年3月31日）

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

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

当事業年度（2024年3月31日）

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

(注) 時価の算定に用いた評価技法および時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

デリバティブ取引

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

4．金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(2023年3月31日)

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

（注）投資信託受益証券であります。

当事業年度(2024年3月31日)

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

（注）投資信託受益証券であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度（2023年3月31日）

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

当事業年度（2024年3月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2023年3月31日）

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

（注１）投資信託受益証券等であります。

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

当事業年度（2024年3月31日）

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

（注１）投資信託受益証券等であります。

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自2022年4月1日 至2023年3月31日）

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

当事業年度（自2023年4月1日 至2024年3月31日）

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

（デリバティブ取引関係）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度（2023年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2024年3月31日）

該当事項はありません。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（１）通貨関連

前事業年度（2023年3月31日）

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

（注１） 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

（注２） デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 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									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余金 合計	
				資本準備 金	資本剰余 金合計	利益準備 金	その他利益剰余金			
		配当準備 積立金	研究開発 積立金				別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	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	満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 その他有価証券 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
4．引当金の計上基準	賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。 退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。 年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。

5．収益及び費用の計上基準	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。 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。 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。 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	ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 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 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。 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
有価証券			
満期保有目的の債券	7,177,496	7,170,723	6,773
その他有価証券	-	-	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	23,736,340	23,610,939	125,401
その他有価証券	26,902,898	26,902,898	-
デリバティブ取引 （ ）			
ヘッジ会計が適用され ていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用され ているもの	18,913	18,913	-

（ ）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 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			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注）	7,320,000	7,939,819	619,819
	小計	7,320,000	7,939,819	619,819
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	3,459,180	3,405,300	53,880
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注）	16,759,000	15,557,778	1,201,221
	小計	20,218,180	18,963,078	1,255,101
合計		27,538,180	26,902,898	635,281

（注）投資信託受益証券等であります。

（デリバティブ取引関係）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第30期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

該当事項はありません。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（１）通貨関連

第30期中間会計期間末（2024年9月30日現在）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資有価証券	773,596	-	18,913
合計			773,596	-	18,913

（注１）時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

区分	第30期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）
営業収益	
投資信託委託業務	15,951,960千円
投資運用業務	11,538,636千円
投資助言業務	618,305千円
その他	9,627千円
計	28,118,529千円

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

３．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	3,300,663

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第30期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	第30期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）
1株当たり純資産額	694,883円19銭
1株当たり中間純利益金額	46,689円34銭

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

２．１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	5,063,365千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	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。

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第 2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

（ 1 ）受託会社

a . 名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

b . 資本金の額

2024年3月末現在、324,279百万円

c . 事業の内容

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

（参考）再信託受託会社の概況

a . 名称

日本マスタートラスト信託銀行株式会社

b . 資本金の額

2024年3月末現在、10,000百万円

c . 事業の内容

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

（ 2 ）販売会社

（資本金の額：2024年3月末現在）

a . 名称	b . 資本金の額 (単位：百万円)	c . 事業の内容
三菱ＵＦＪ e スマート証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	54,323	
株式会社スマートプラス ¹	100	
楽天証券株式会社	19,495	
moomoo証券株式会社	3,500	
松井証券株式会社	11,945	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。
株式会社千葉銀行	145,069	
日本生命保険相互会社	1,450,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。
ニッセイアセットマネジメント株式会社 ²	10,000	金融商品取引法に定める第二種金融商品取引業を営んでいます。

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

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

(3) 投資助言会社（参考情報）

- a . 名称
株式会社ニッセイ基礎研究所
- b . 資本金の額
2024年3月末現在、450百万円
- c . 事業の内容
「有価証券に係る投資顧問業の規制に関する法律」に基づき監督官庁の登録を受け、投資顧問業を営むとともに、内外の経済、産業動向や金融・投資手法等に関する調査研究の受託、コンサルティング業等を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

- (1) 受託会社
信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。
- (2) 販売会社
証券投資信託の募集の取扱いおよび販売を行い、一部解約に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を代行します。
- (3) 投資助言会社（参考情報）
委託会社に対し、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」の運用に関する投資助言を行います。

3 【資本関係】

- (1) 日本生命保険相互会社（販売会社）は、委託会社の株式を108,448株（持株比率100%）保有しています。
- (2) 委託会社は、株式会社ニッセイ基礎研究所（投資助言会社）の株式を1,350株（持株比率15.0%）保有しています（参考情報）。
 - 委託会社が所有する関係法人の株式または関係法人が所有する委託会社の株式のうち、持株比率が5%以上のものを記しています。

第 3 【参考情報】

下記の書類が関東財務局長に提出されています。

2024年5月20日	有価証券報告書 有価証券届出書の訂正届出書
2024年11月20日	半期報告書 有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2024年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠 之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大 竹 新

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2025年5月16日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬 和 政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイ全世界株式インデックスコレクトの2024年2月21日から2025年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイ全世界株式インデックスコレクトの2025年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月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．X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。