【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年8月20日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　　大関　洋
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目６番６号
【事務連絡者氏名】	投資信託業務部　　茶木　健
【電話番号】	０３－５５３３－４６０８
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型） ＜購入・換金手数料なし＞
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額　上限１兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞
（以下「ファンド」または「ベビーファンド」ということがあります）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

① 契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。
ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

② 委託会社（ニッセイアセットマネジメント株式会社）の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。基準価額は日々変動します。なお、便宜上１万口当りに換算した価額で表示されます。

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

なお、委託会社へは後記「（８）申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

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

（７）【申込期間】

継続申込期間：2025年8月21日から2026年2月20日まで
○ 継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

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

（９）【払込期日】

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

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

（１０）【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① 基本方針

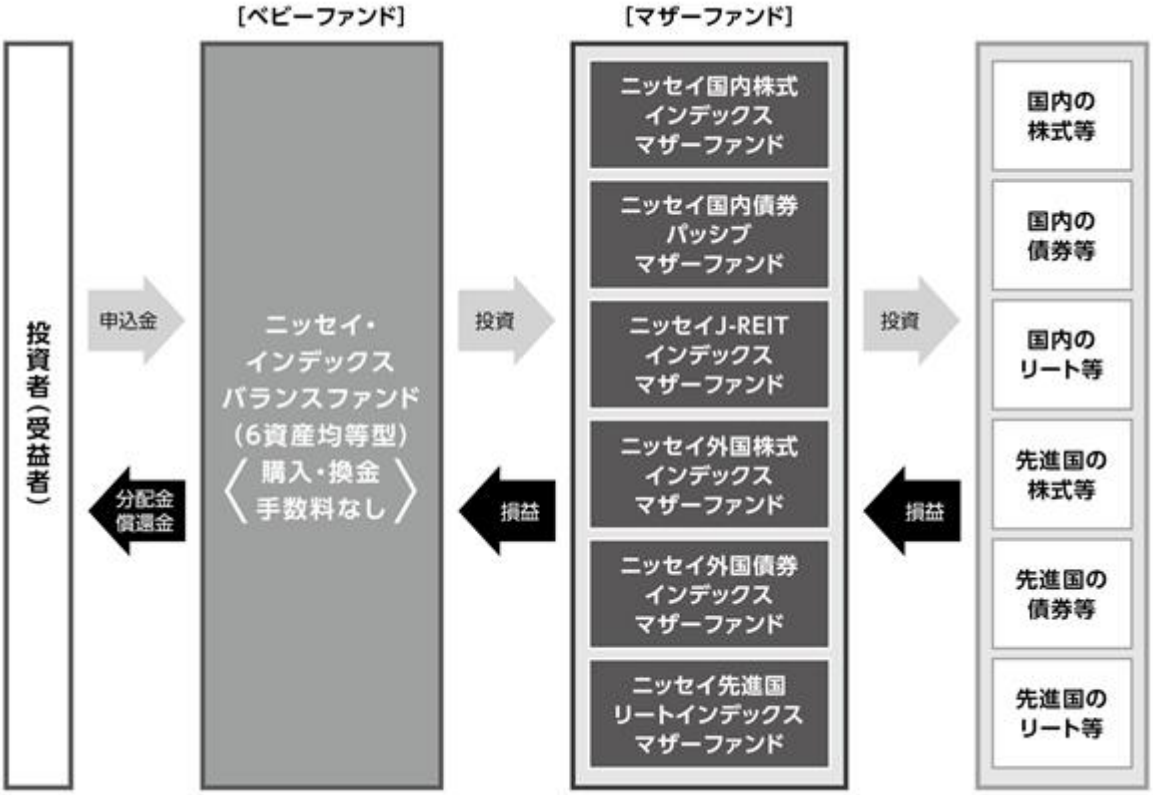
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

② 運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

＜イメージ図＞



③　ファンドの特色

1国内外の株式・債券・リート（不動産投資信託証券）に分散投資を行います。

●各投資対象資産の指数の動きに連動する投資成果をめざす6つのマザーファンドを主要投資対象とします。

【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。
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	「NOMURA−BPI総合」の動きに連動する投資成果をめざします。
ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド	「東証REIT指数（配当込み）」の動きに連動する投資成果をめざします。
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。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）」の動きに連動する投資成果をめざします。
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	「S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）」の動きに連動する投資成果をめざします。

●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。

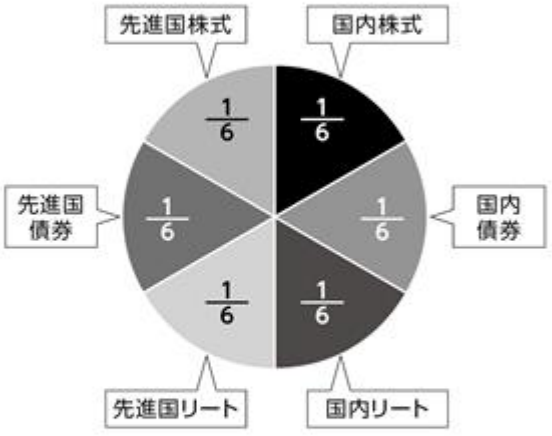
※為替ヘッジとは、為替変動による資産価値の変動を回避する取引のことをいいます。

2 6つの資産への投資割合は均等を基本とします。

●各投資対象資産の指数を6分の1ずつ組合せた合成ベンチマーク※の動きに連動する投資成果をめざします。

※TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、NOMURA−BPI総合、東証REIT指数（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を6分の1ずつ組合せ、委託会社が独自に指数化したもの（以下「ベンチマーク」ということがあります）。

<基本投資割合>



<各マザーファンドの運用プロセス>

〈基準価額と合成ベンチマークの連動性に関する留意点〉

ファンドは合成ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざしますが、基本投資割合と実際の投資割合がかい離すること、各指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングがずれること、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから基準価額と合成ベンチマークとの動きが完全に一致しないことがあります。

3購入時および換金時の手数料は無料です。

●購入時の購入時手数料および換金時の換金時手数料、信託財産留保額はありません。

・保有期間中に運用管理費用（信託報酬）等をファンドからご負担いただきます。

〈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。

●NOMURA−BPI総合

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

●東証REIT指数

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

●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。

●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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

●S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

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

＜ＭＳＣＩ指数にかかる免責条項等＞

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

④　信託金の上限

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

⑤　ファンドの分類

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型に属します。

○　課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

商品分類表

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

属性区分表

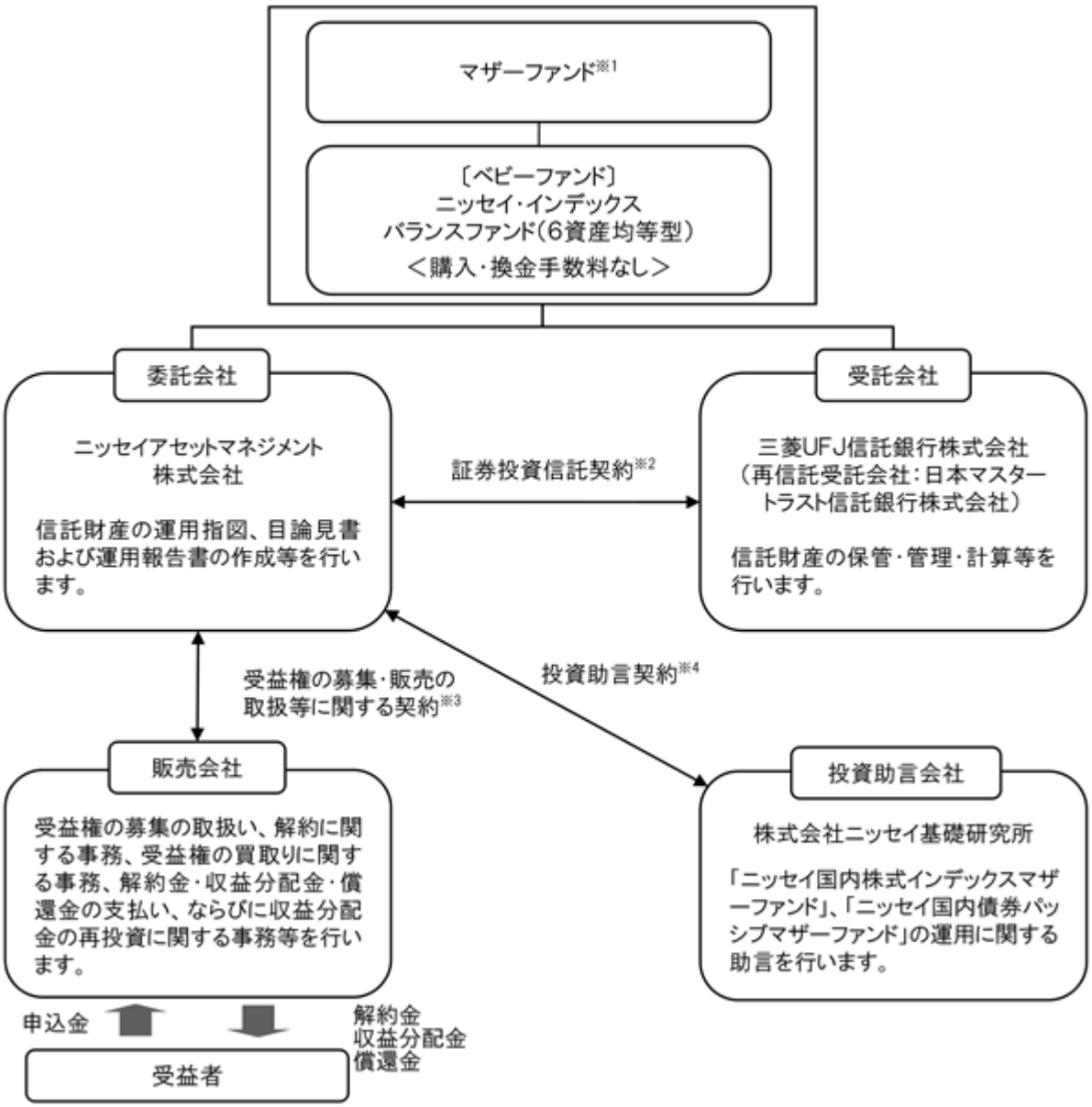
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式・債券・ 不動産投信） 資産配分固定型））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式、公社債等、不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資する旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本含む）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

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

（２）【ファンドの沿革】

2017年10月13日　信託契約締結、ファンドの設定、運用開始
2025年 6月21日　ファンドの名称を「＜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）」から「ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞」に変更

（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、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド、ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド、ニッセイ先進国リート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5月末現在）

・金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第369号
・設立年月日　　：1995年4月4日
・資本金の額　　：100億円
・沿革

1985年7月1日	ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立され、投資顧問業務を開始しました。
1995年4月4日	ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始しました。
1998年7月1日	ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託委託業務の併営を開始しました。
2000年5月8日	定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社としました。

・大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

① 複数のマザーファンド※への投資を通じ、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）、ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ総合、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）を６分の１ずつ組合せた合成ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

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

② 各マザーファンドへの基本投資割合は、それぞれ信託財産の純資産総額の６分の１とします。
③ 各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。
④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
⑤ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

ａ　投資対象

国内の証券取引所※上場株式を主要投資対象とします。

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

ｂ　投資態度

①　国内の証券取引所上場株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

②　株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

③　株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

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

（３）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

②　同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

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

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

⑤　同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑦　外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

ａ　投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

ｂ　投資態度

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

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

③　組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

④　公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

（3）投資制限

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

②　同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

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

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

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

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

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

ａ　投資対象

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

ｂ　投資態度

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

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

③　不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

④　対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

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

（3）投資制限

①　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

③　株式への直接投資は行いません。

④　外貨建資産への投資は行いません。

⑤　不動産投信指数先物取引を行うことができます。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b　投資態度

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

②　株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

①　株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

⑥　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑦　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

a　投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

b　投資態度

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

②　公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

③　組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

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

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

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

④　投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

（1）基本方針

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

（2）運用方法

ａ　投資対象

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

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

ｂ　投資態度

①　主として、世界各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国の不動産投資信託証券に投資することにより、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざします。

②　不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

③　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（3）投資制限

①　投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

②　株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30％以下とします。

③　同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以下とします。

④　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑤　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

（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、公社債、上場不動産投資信託証券等に投資を行う場合があります。

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

ｂ　約款に定める投資対象

①　投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　有価証券

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

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます）

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

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

③　金融商品

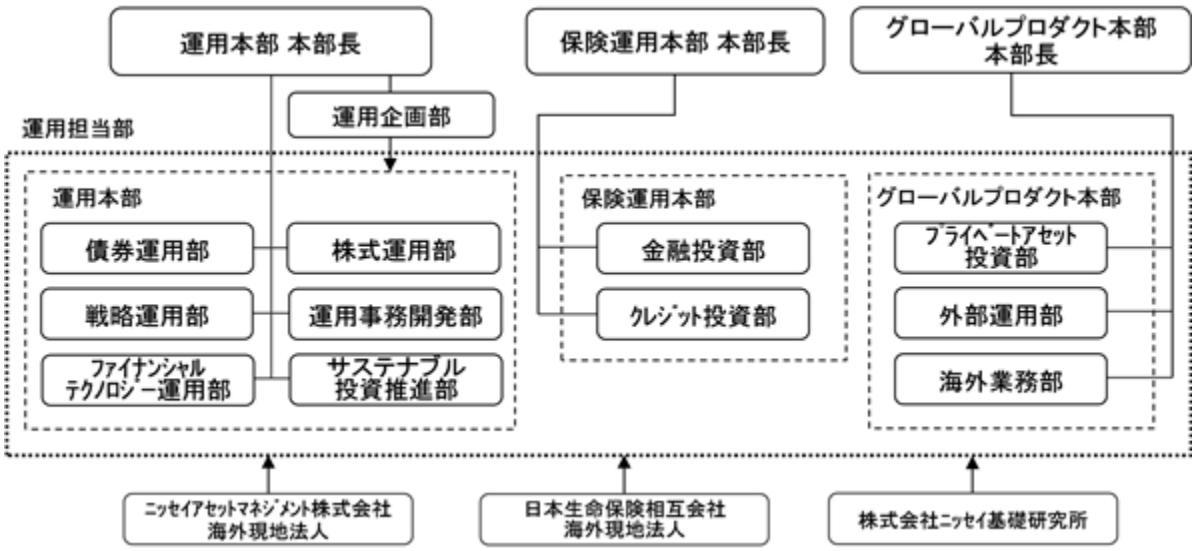
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

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

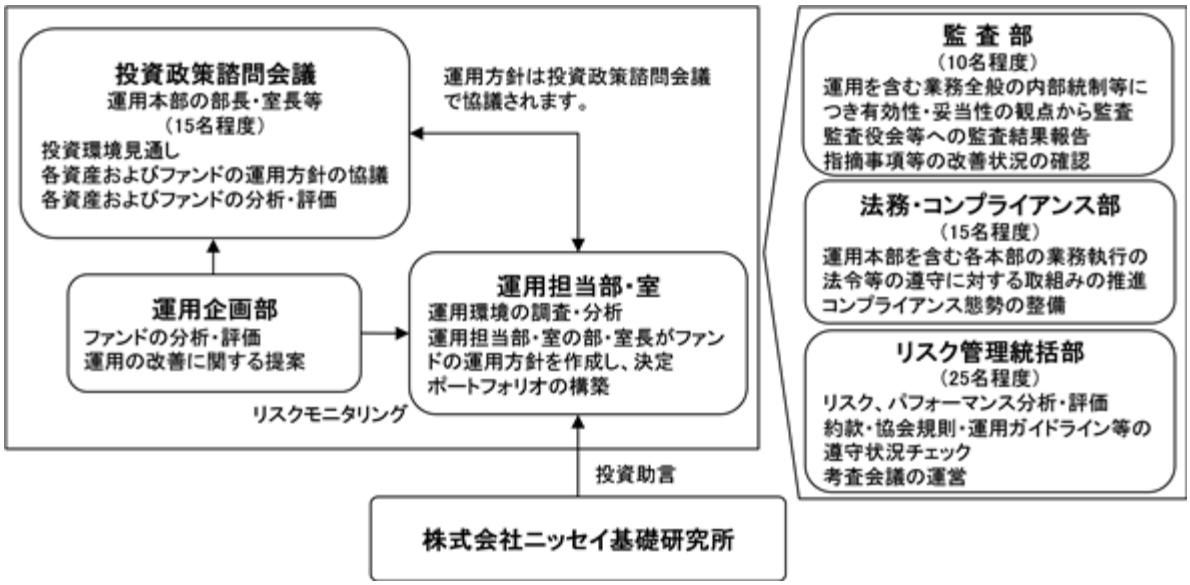
（３）【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



＜受託会社に対する管理体制等＞

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

○　上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

①　原則として以下の方針に基づき分配を行います。

１．分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

２．分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

３．留保益の運用方針

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

②　分配時期

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

③　支払方法

＜分配金受取コースの場合＞

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

＜分配金再投資コースの場合＞

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

○　将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

（５）【投資制限】

ａ　約款に定める主な投資制限

①　株式、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。

②　同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③　同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

④　同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

⑥　外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の65%以下とします。

⑦　デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

⑧　デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

⑨　一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ｂ　約款に定めるその他の投資制限

①　投資する株式等の範囲

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

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

②　信用取引の範囲

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

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

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

③　先物取引等

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

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

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

④　スワップ取引

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

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

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

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

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

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

⑤　金利先渡取引および為替先渡取引

１．金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

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

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

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

⑥　有価証券の貸付けおよび範囲

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

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

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

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

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

⑦　有価証券の空売り

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

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

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

⑧　有価証券の借入れ

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

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

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

４．前記１．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨　外国為替予約等

１．外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

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

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

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

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

⑩　資金の借入れ

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

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

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

４．借入金の利息は信託財産中より支払われます。

c　法令に定める投資制限

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

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

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

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

③　同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

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

3【投資リスク】

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・不動産投資信託（リート）投資リスク

保有不動産に関するリスク

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

金利変動リスク

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

信用リスク

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

Ｊ－ＲＥＩＴの税制に関するリスク

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

リートおよび不動産等の法制度に関するリスク

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

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

・流動性リスク

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

・基準価額と指数の連動性に関する留意点

ファンドは合成ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざしますが、基本投資割合と実際の投資割合がかい離すること、各指数の構成銘柄すべてを組入れないこと、資金の流出入と実際の銘柄等の売買のタイミングがずれること、売買時のコストや運用管理費用（信託報酬）等の費用を負担することなどから基準価額と合成ベンチマークとの動きが完全に一致しないことがあります。

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

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

・委託会社等による当ファンド等の信託財産の保有に関する留意点

委託会社の株主である日本生命保険相互会社は2024年10月末現在、ファンドの投資対象であるニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドを他のベビーファンドを通じて実質的に19.0%保有しています。

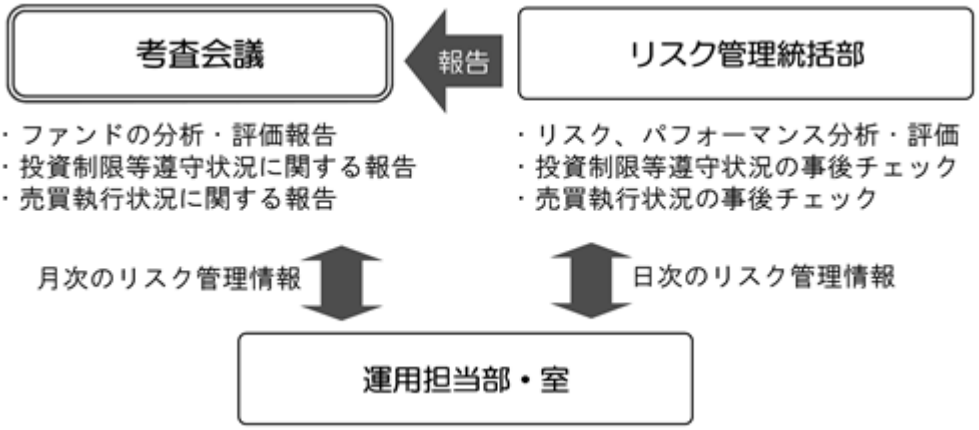
当該保有分は日本生命保険相互会社により換金されることがあります。

・流動性に関する留意点

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

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

（2）投資リスク管理体制



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

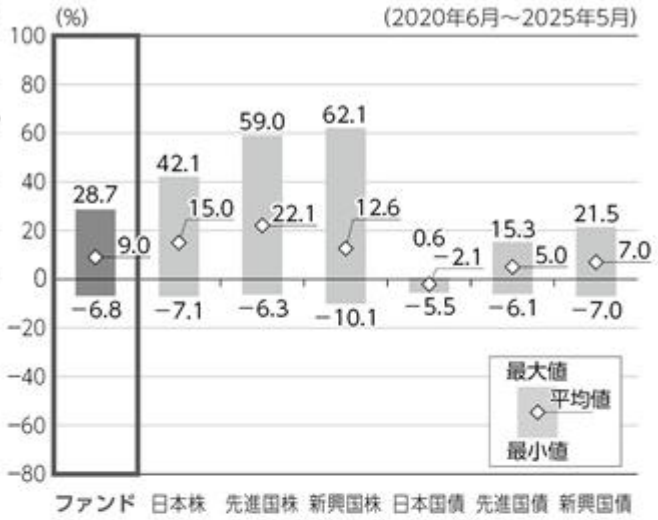
○　上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

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

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

①ファンドの年間騰落率および税引前分配金再投資基準価額の推移

②ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.1749%（税抜0.159%）以内の率（以下「信託報酬率」といいます）をかけた額とします。

なお、2025年8月21日現在の信託報酬率は年0.1749%（税抜0.159%）であり、その配分は次の通りとします。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.069%	0.070%	0.020%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

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

（4）【その他の手数料等】

① 証券取引の手数料等

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

② 監査費用

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

③ 信託事務の諸費用

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

④ 借入金の利息

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

⑤ 信託財産留保額

ありません。

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

＜ご参考＞

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

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

（5）【課税上の取扱い】

課税対象

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

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

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

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

個人の課税の取扱い

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

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

税率（個人）

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

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

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

＜少額投資非課税制度について＞

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

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

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

詳しくは、販売会社にお問合せください。

法人の課税の取扱い（分配時、解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

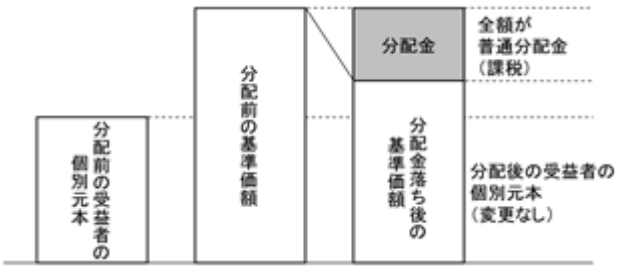
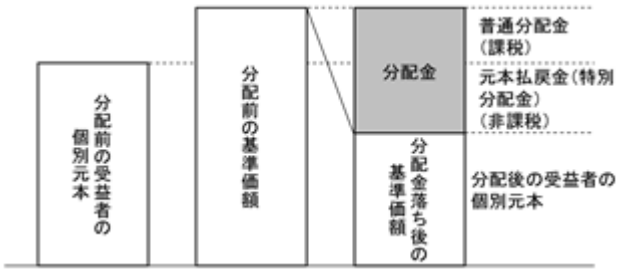
個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

○　投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

(参考情報)ファンドの総経費率

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.21%	0.18%	0.03%

・対象期間:2023年11月21日～2024年11月20日
・対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。
・費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。
・①運用管理費用の比率、②その他費用の比率および総経費率は、表示桁数未満を四捨五入しているため、①と②の合計が総経費率の数字と一致しないことがあります。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5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		2,537,764,312	100.00
	内　日本	2,537,764,312	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△12,287	△0.00
純資産総額		2,537,752,025	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5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		296,822,207,870	96.93
	内　日本	296,822,207,870	96.93
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,391,287,002	3.07
純資産総額		306,213,494,872	100.00

その他資産の投資状況

2025年5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		9,539,475,000	3.12
	内　日本	9,539,475,000	3.12

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2025年5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		51,816,910,480	81.17
	内　日本	51,816,910,480	81.17
地方債証券		3,031,526,506	4.75
	内　日本	3,031,526,506	4.75
特殊債券		4,401,816,975	6.90
	内　日本	4,401,816,975	6.90
社債券		3,996,694,200	6.26
	内　日本	3,996,694,200	6.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		587,730,280	0.92
純資産総額		63,834,678,441	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		32,520,775,300	97.23
	内　日本	32,520,775,300	97.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		927,021,688	2.77
純資産総額		33,447,796,988	100.00

その他資産の投資状況

2025年5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		927,558,000	2.77
	内　日本	927,558,000	2.77

（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5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		1,117,280,232,735	95.55
	内　アメリカ	827,922,279,790	70.81
	内　イギリス	44,238,968,162	3.78
	内　カナダ	39,265,641,016	3.36
	内　スイス	32,648,832,053	2.79
	内　フランス	31,291,875,523	2.68
	内　ドイツ	31,252,957,820	2.67
	内　オーストラリア	19,152,394,036	1.64
	内　オランダ	18,289,229,496	1.56
	内　アイルランド	13,823,565,455	1.18
	内　スペイン	9,955,710,912	0.85
	内　スウェーデン	9,499,011,652	0.81
	内　イタリア	8,422,515,983	0.72
	内　デンマーク	7,203,738,352	0.62
	内　香港	5,097,024,146	0.44
	内　シンガポール	3,763,701,866	0.32
	内　フィンランド	3,199,848,251	0.27
	内　ベルギー	2,970,359,282	0.25
	内　イスラエル	2,303,650,343	0.20
	内　ノルウェー	1,922,750,994	0.16
	内　バミューダ	840,019,950	0.07
	内　ジャージィー	791,466,634	0.07
	内　オランダ領キュラソー	790,695,478	0.07
	内　オーストリア	627,951,610	0.05
	内　ケイマン諸島	592,709,930	0.05
	内　ニュージーランド	571,065,976	0.05
	内　ポルトガル	489,283,029	0.04
	内　ルクセンブルグ	352,984,996	0.03
投資証券		20,188,524,885	1.73
	内　アメリカ	17,657,275,118	1.51
	内　オーストラリア	1,248,307,187	0.11
	内　フランス	471,668,650	0.04
	内　イギリス	302,354,351	0.03
	内　シンガポール	281,579,045	0.02
	内　香港	227,340,534	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		31,829,242,985	2.72
純資産総額		1,169,298,000,605	100.00

その他資産の投資状況

2025年5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		31,629,180,355	2.70
	内　アメリカ	25,648,391,879	2.19
	内　イギリス	3,138,367,158	0.27
	内　ドイツ	2,842,421,318	0.24

（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。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		94,058,895,387	98.59
	内　アメリカ	43,415,397,886	45.50
	内　中国	10,431,218,267	10.93
	内　フランス	7,021,656,088	7.36
	内　イタリア	6,520,905,241	6.83
	内　ドイツ	5,471,633,607	5.73
	内　イギリス	5,249,019,679	5.50
	内　スペイン	4,348,241,283	4.56
	内　カナダ	1,851,984,777	1.94
	内　ベルギー	1,481,175,697	1.55
	内　オランダ	1,252,486,689	1.31
	内　オーストラリア	1,137,192,882	1.19
	内　オーストリア	1,054,741,266	1.11
	内　メキシコ	730,534,268	0.77
	内　ポーランド	583,986,064	0.61
	内　ポルトガル	579,536,971	0.61
	内　マレーシア	485,264,295	0.51
	内　フィンランド	468,366,849	0.49
	内　アイルランド	453,436,086	0.48
	内　シンガポール	384,673,521	0.40
	内　イスラエル	331,477,765	0.35
	内　ニュージーランド	270,553,626	0.28
	内　デンマーク	205,998,802	0.22
	内　スウェーデン	178,329,406	0.19
	内　ノルウェー	151,084,372	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,349,159,254	1.41
純資産総額		95,408,054,641	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		17,343,883,753	94.52
	内　アメリカ	13,548,634,906	73.84
	内　オーストラリア	1,303,232,022	7.10
	内　イギリス	804,954,405	4.39
	内　シンガポール	515,733,115	2.81
	内　フランス	367,625,378	2.00
	内　カナダ	219,061,625	1.19
	内　ベルギー	201,378,820	1.10
	内　香港	183,715,998	1.00
	内　スペイン	86,934,758	0.47
	内　韓国	28,310,909	0.15
	内　オランダ	27,564,887	0.15
	内　イスラエル	25,805,535	0.14
	内　ニュージーランド	14,949,530	0.08
	内　アイルランド	8,917,574	0.05
	内　ドイツ	6,403,353	0.03
	内　イタリア	660,938	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,004,635,773	5.48
純資産総額		18,348,519,526	100.00

その他資産の投資状況

2025年5月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		948,980,710	5.17
	内　アメリカ	835,260,304	4.55
	内　ドイツ	113,720,406	0.62

（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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2025年5月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	127,555,175	3.2558 415,301,855	3.4325 437,833,138	－ －	17.25
2	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	91,299,708	4.9053 447,857,843	4.7848 436,850,842	－ －	17.21
3	ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	243,728,492	1.8861 459,719,310	1.7343 422,698,323	－ －	16.66
4	ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	217,539,619	1.7994 391,459,613	1.9088 415,239,624	－ －	16.36
5	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	237,762,911	1.7909 425,827,793	1.7401 413,731,241	－ －	16.30
6	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	466,452,545	0.9069 423,054,559	0.8820 411,411,144	－ －	16.21

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2025年5月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	3,967,600	2,712.58 10,762,443,760	2,769.00 10,986,284,400	－ －	3.59
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	2,574,600	3,727.59 9,597,070,752	3,810.00 9,809,226,000	－ －	3.20
3	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	4,715,300	1,967.44 9,277,109,547	2,025.50 9,550,840,150	－ －	3.12
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	1,917,600	4,307.92 8,260,875,320	4,046.00 7,758,609,600	－ －	2.53

5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,517,800	3,907.00 5,930,056,290	3,700.00 5,615,860,000	－ －	1.83
6	任天堂 日本	株式 その他製品	471,200	11,492.49 5,415,263,790	11,835.00 5,576,652,000	－ －	1.82
7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	567,500	9,870.77 5,601,667,600	8,689.00 4,931,007,500	－ －	1.61
8	キーエンス 日本	株式 電気機器	74,700	62,730.64 4,685,979,255	60,740.00 4,537,278,000	－ －	1.48
9	三菱重工業 日本	株式 機械	1,318,200	2,184.61 2,879,759,008	3,352.00 4,418,606,400	－ －	1.44
10	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	701,800	5,080.28 3,565,346,058	6,112.00 4,289,401,600	－ －	1.40
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,459,400	2,380.42 3,473,996,396	2,935.00 4,283,339,000	－ －	1.40
12	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	530,800	6,141.36 3,259,835,554	7,740.00 4,108,392,000	－ －	1.34
13	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	982,200	4,345.29 4,267,951,860	4,002.00 3,930,764,400	－ －	1.28
14	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	158,000	25,092.38 3,964,596,411	23,000.00 3,634,000,000	－ －	1.19
15	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	22,265,800	146.12 3,253,547,810	160.40 3,571,434,320	－ －	1.17
16	三井物産 日本	株式 卸売業	1,135,200	2,722.57 3,090,670,594	3,029.00 3,438,520,800	－ －	1.12
17	信越化学工業 日本	株式 化学	664,800	4,619.93 3,071,330,537	4,641.00 3,085,336,800	－ －	1.01
18	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	666,100	4,164.88 2,774,230,994	4,314.00 2,873,555,400	－ －	0.94
19	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	369,200	9,384.68 3,464,826,222	7,614.00 2,811,088,800	－ －	0.92
20	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,101,100	2,438.38 2,684,908,512	2,499.00 2,751,648,900	－ －	0.90
21	第一三共 日本	株式 医薬品	692,400	3,419.79 2,367,864,041	3,842.00 2,660,200,800	－ －	0.87
22	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	12,000,100	210.82 2,529,971,688	221.40 2,656,822,140	－ －	0.87
23	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,768,400	1,369.29 2,421,463,032	1,468.00 2,596,011,200	－ －	0.85
24	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	53,300	47,616.28 2,537,948,016	48,350.00 2,577,055,000	－ －	0.84

25	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	144,800	18,167.37 2,630,635,721	17,115.00 2,478,252,000	－ －	0.81
26	富士通 日本	株式 電気機器	693,700	2,981.10 2,067,991,656	3,318.00 2,301,696,600	－ －	0.75
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	766,700	2,373.29 1,819,605,296	2,904.00 2,226,496,800	－ －	0.73
28	日本電気 日本	株式 電気機器	533,100	3,067.21 1,635,130,860	3,785.00 2,017,783,500	－ －	0.66
29	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	446,600	3,733.66 1,667,454,425	4,438.00 1,982,010,800	－ －	0.65
30	丸紅 日本	株式 卸売業	648,900	2,272.90 1,474,888,470	2,945.00 1,911,010,500	－ －	0.62

（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5月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	電気機器	16.84
		銀行業	8.77
		情報・通信業	7.61
		輸送用機器	7.10
		卸売業	6.79
		機械	5.68
		化学	4.67
		小売業	4.66
		サービス業	4.39
		医薬品	3.98
		保険業	3.33
		その他製品	3.00
		食料品	3.00
		陸運業	2.30
		建設業	2.19
		精密機器	1.98
		不動産業	1.86
		電気・ガス業	1.18
		その他金融業	1.08
		非鉄金属	0.87
		証券、商品先物取引業	0.83
		鉄鋼	0.76
		海運業	0.64
		ゴム製品	0.62
		ガラス・土石製品	0.59
		金属製品	0.47
		石油・石炭製品	0.41
		繊維製品	0.39
		空運業	0.35
		鉱業	0.24
		倉庫・運輸関連業	0.16
		パルプ・紙	0.13
		水産・農林業	0.08
	小計		96.93
合　計（対純資産総額比）			96.93

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2025年5月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	第３７７回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	534,000,000	97.16 518,858,360	97.65 521,483,040	1.2 2034/12/20	0.82
2	第３４４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	493,000,000	98.94 487,774,200	99.27 489,435,610	0.1 2026/9/20	0.77
3	第３４５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	489,000,000	98.72 482,740,800	99.08 484,535,430	0.1 2026/12/20	0.76
4	第３７１回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	509,000,000	92.30 469,847,720	93.33 475,095,510	0.4 2033/6/20	0.74
5	第３７０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	496,000,000	93.48 463,678,420	94.47 468,571,200	0.5 2033/3/20	0.73
6	第３７２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	473,000,000	95.06 449,662,180	96.07 454,425,290	0.8 2033/9/20	0.71
7	第３４６回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	458,000,000	98.47 450,992,600	98.89 452,920,780	0.1 2027/3/20	0.71
8	第３７３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	474,000,000	93.05 441,080,700	94.10 446,062,440	0.6 2033/12/20	0.70
9	第１５３回　利付国債（５年） 日本	国債証券	451,000,000	98.06 442,287,380	98.50 444,262,060	0.005 2027/6/20	0.70
10	第３７４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	457,000,000	94.32 431,056,110	95.33 435,690,090	0.8 2034/3/20	0.68
11	第３６９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	452,000,000	93.85 424,202,000	94.85 428,758,160	0.5 2032/12/20	0.67
12	第３５５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	431,000,000	95.79 412,871,460	96.70 416,794,240	0.1 2029/6/20	0.65
13	第１４９回　利付国債（５年） 日本	国債証券	409,000,000	98.79 404,051,100	99.15 405,539,860	0.005 2026/9/20	0.64
14	第３６６回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	426,000,000	92.91 395,834,940	93.86 399,852,120	0.2 2032/3/20	0.63
15	第５回　電通グループ 日本	社債券	400,000,000	98.09 392,398,800	98.48 393,932,400	0.32 2027/7/8	0.62
16	第１５０回　利付国債（５年） 日本	国債証券	397,000,000	98.55 391,243,500	98.94 392,795,770	0.005 2026/12/20	0.62

17	第３４８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	398,000,000	98.08 390,384,960	98.49 392,014,080	0.1 2027/9/20	0.61
18	第３６８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	413,000,000	92.07 380,278,010	93.09 384,498,870	0.2 2032/9/20	0.60
19	第３４７回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	384,000,000	98.23 377,203,200	98.69 379,000,320	0.1 2027/6/20	0.59
20	第３５０回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	380,000,000	97.44 370,283,400	98.07 372,669,800	0.1 2028/3/20	0.58
21	第３６５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	398,000,000	92.58 368,476,360	93.57 372,428,500	0.1 2031/12/20	0.58
22	第３７８回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	375,000,000	99.30 372,408,770	99.14 371,793,750	1.4 2035/3/20	0.58
23	第３６４回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	392,000,000	92.91 364,238,560	93.91 368,138,960	0.1 2031/9/20	0.58
24	第１７８回　利付国債（５年） 日本	国債証券	368,000,000	99.93 367,746,080	99.93 367,746,080	1 2030/3/20	0.58
25	第３５９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	385,000,000	94.85 365,185,590	95.49 367,636,500	0.1 2030/6/20	0.58
26	第１５４回　利付国債（５年） 日本	国債証券	371,000,000	98.00 363,588,480	98.49 365,420,160	0.1 2027/9/20	0.57
27	第３６２回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	384,000,000	93.60 359,458,560	94.57 363,171,840	0.1 2031/3/20	0.57
28	第３６３回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	384,000,000	93.25 358,087,680	94.24 361,908,480	0.1 2031/6/20	0.57
29	第３４９回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	368,000,000	97.83 360,036,480	98.29 361,740,320	0.1 2027/12/20	0.57
30	第３７５回　利付国債（１０年） 日本	国債証券	369,000,000	96.54 356,254,740	97.47 359,675,370	1.1 2034/6/20	0.56

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2025年5月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
公社債券	国内	国債証券	81.17
		特殊債券	6.90
		社債券	6.26
		地方債証券	4.75
	小計		99.08
合　計（対純資産総額比）			99.08

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	18,898	134,931.45 2,549,934,571	131,600.00 2,486,976,800	－ －	7.44
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	16,640	114,922.82 1,912,315,773	117,000.00 1,946,880,000	－ －	5.82
3	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	16,800	98,090.49 1,647,920,369	98,600.00 1,656,480,000	－ －	4.95
4	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	10,324	145,369.81 1,500,797,973	144,700.00 1,493,882,800	－ －	4.47
5	ＫＤＸ不動産投資法人 日本	投資証券	8,975	150,479.75 1,350,555,768	151,700.00 1,361,507,500	－ －	4.07
6	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	10,660	127,960.88 1,364,063,012	127,100.00 1,354,886,000	－ －	4.05
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	16,932	80,113.17 1,356,476,243	77,000.00 1,303,764,000	－ －	3.90
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,832	243,034.94 1,174,344,847	239,900.00 1,159,196,800	－ －	3.47
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,455	180,164.51 1,162,961,934	179,000.00 1,155,445,000	－ －	3.45
10	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	17,850	60,015.73 1,071,280,871	61,300.00 1,094,205,000	－ －	3.27
11	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,163	154,566.07 1,107,156,815	151,200.00 1,083,045,600	－ －	3.24
12	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	6,368	150,817.61 960,406,545	148,100.00 943,100,800	－ －	2.82
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	11,902	73,017.80 869,057,914	74,700.00 889,079,400	－ －	2.66
14	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,216	359,511.32 796,677,102	359,500.00 796,652,000	－ －	2.38

15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	9,678	78,178.35 756,610,129	77,100.00 746,173,800	－ －	2.23
16	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	7,062	103,252.67 729,170,363	101,600.00 717,499,200	－ －	2.15
17	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	5,932	117,780.06 698,671,336	118,000.00 699,976,000	－ －	2.09
18	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	5,594	118,526.35 663,036,454	114,900.00 642,750,600	－ －	1.92
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	6,460	94,360.62 609,569,665	91,600.00 591,736,000	－ －	1.77
20	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	4,724	118,124.40 558,019,678	115,100.00 543,732,400	－ －	1.63
21	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	4,023	138,825.95 558,496,810	134,300.00 540,288,900	－ －	1.62
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,810	134,149.54 511,109,752	130,600.00 497,586,000	－ －	1.49
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,010	81,900.13 492,219,811	82,400.00 495,224,000	－ －	1.48
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,934	125,887.18 495,240,177	125,100.00 492,143,400	－ －	1.47
25	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,640	284,722.04 466,944,156	283,500.00 464,940,000	－ －	1.39
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	4,785	92,311.60 441,711,021	94,100.00 450,268,500	－ －	1.35
27	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,863	149,998.91 429,446,901	151,300.00 433,171,900	－ －	1.30
28	ＮＴＴ都市開発リート投資法人 日本	投資証券	3,262	133,754.35 436,306,717	131,300.00 428,300,600	－ －	1.28
29	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	6,245	65,014.51 406,015,662	66,300.00 414,043,500	－ －	1.24
30	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,172	182,357.64 396,080,795	185,000.00 401,820,000	－ －	1.20

（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5月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
投資証券	国内		97.23
	小計		97.23
合　計（対純資産総額比）			97.23

（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5月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	2,829,520	19,504.45 55,188,248,058	20,025.26 56,661,888,671	－ －	4.85
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	816,058	66,017.62 53,874,212,572	65,990.29 53,851,905,382	－ －	4.61
3	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	1,737,445	30,037.17 52,187,945,772	28,766.80 49,980,744,119	－ －	4.27
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	1,093,389	29,660.23 32,430,179,278	29,594.05 32,357,818,575	－ －	2.77
5	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディア・娯楽	251,887	92,138.66 23,208,531,684	92,803.34 23,375,955,784	－ －	2.00
6	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	514,487	33,180.73 17,071,058,402	34,812.22 17,910,436,637	－ －	1.53
7	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・自動車部品	333,796	49,216.48 16,428,266,928	51,567.32 17,212,966,515	－ －	1.47
8	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア・娯楽	674,760	23,960.10 16,167,323,688	24,725.49 16,683,777,165	－ －	1.43
9	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア・娯楽	575,770	24,151.45 13,905,684,339	24,883.75 14,327,319,731	－ －	1.23
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	325,264	38,108.28 12,395,253,407	38,034.91 12,371,387,584	－ －	1.06
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サービス	153,755	73,717.54 11,334,441,792	72,824.11 11,197,072,047	－ －	0.96
12	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サービス	199,815	52,929.77 10,576,162,591	52,138.48 10,418,051,979	－ －	0.89

13	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	93,230	108,637.67 10,128,290,505	103,956.14 9,691,831,482	－ －	0.83
14	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディア・娯楽	49,388	171,441.24 8,467,140,296	170,465.80 8,418,965,335	－ －	0.72
15	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 金融サービス	94,709	84,366.80 7,990,295,895	83,125.20 7,872,705,381	－ －	0.67
16	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	507,800	15,317.83 7,778,398,593	14,774.01 7,502,242,430	－ －	0.64
17	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	51,286	148,810.49 7,631,895,087	145,127.42 7,443,005,057	－ －	0.64
18	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	510,465	14,116.52 7,205,991,627	13,969.77 7,131,082,216	－ －	0.61
19	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・パーソナル用品	272,108	23,705.45 6,450,445,282	24,250.72 6,598,816,876	－ －	0.56
20	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	278,193	21,938.73 6,103,202,867	22,095.55 6,146,828,620	－ －	0.53
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 一般消費財・サービス流通・小売り	114,774	54,581.40 6,264,525,672	52,985.88 6,081,401,655	－ －	0.52
22	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	204,180	26,718.09 5,455,301,188	26,705.14 5,452,657,404	－ －	0.47

23	SAP SE ドイツ	株式 ソフトウェア・サービス	120,635	43,419.65 5,237,930,261	42,928.94 5,178,733,461	－ －	0.44
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	791,365	6,441.05 5,097,229,367	6,364.80 5,036,886,916	－ －	0.43
25	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	45,503	108,348.76 4,930,193,990	108,855.83 4,953,267,060	－ －	0.42
26	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	472,859	10,348.56 4,893,414,036	10,285.26 4,863,480,737	－ －	0.42
27	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	302,730	15,268.74 4,622,308,687	15,314.24 4,636,082,902	－ －	0.40
28	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	179,653	24,913.96 4,475,869,075	25,590.15 4,597,348,457	－ －	0.39
29	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	106,331	45,447.09 4,832,434,984	42,897.71 4,561,357,242	－ －	0.39
30	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	193,891	22,967.40 4,453,173,471	23,436.42 4,544,111,491	－ －	0.39

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2025年5月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	ソフトウェア・サービス	10.29
		半導体・半導体製造装置	8.95
		資本財	7.46
		金融サービス	7.30
		メディア・娯楽	6.74
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.21
		銀行	6.18
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.79
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.83
		エネルギー	3.56
		ヘルスケア機器・サービス	3.48
		保険	3.24
		素材	3.18
		食品・飲料・タバコ	2.94
		公益事業	2.68
		自動車・自動車部品	1.99
		消費者サービス	1.92
		生活必需品流通・小売り	1.87
		商業・専門サービス	1.59
		運輸	1.41
		家庭用品・パーソナル用品	1.38
		電気通信サービス	1.25
		耐久消費財・アパレル	1.00
		不動産管理・開発	0.27
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.03
	小計		95.55
投資証券	外国		1.73
	小計		1.73
合　計（対純資産総額比）			97.28

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

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,123,521,200	97.57 2,072,047,046	97.60 2,072,641,632	1.625 2026/5/15	2.17
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,097,624,600	97.02 2,035,317,937	97.09 2,036,730,557	2 2026/11/15	2.13
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,030,005,700	96.86 1,966,324,421	96.93 1,967,826,625	1.5 2026/8/15	2.06
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,727,878,700	97.03 1,676,716,211	97.12 1,678,133,072	2.25 2027/2/15	1.76
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,664,575,900	96.94 1,613,656,523	97.03 1,615,154,641	2.375 2027/5/15	1.69
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,560,989,500	95.92 1,497,316,738	96.08 1,499,829,931	2.25 2027/11/15	1.57
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,490,493,200	96.82 1,443,155,135	97.01 1,445,942,358	2.75 2028/2/15	1.52

8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,494,809,300	96.33 1,439,979,694	96.45 1,441,893,050	2.25 2027/8/15	1.51
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,350,939,300	95.20 1,286,138,410	95.46 1,289,714,730	2.625 2029/2/15	1.35
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,329,358,800	93.93 1,248,706,601	94.25 1,253,013,724	2.375 2029/5/15	1.31
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,322,165,300	89.00 1,176,795,931	89.38 1,181,883,561	1.5 2030/2/15	1.24
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,277,565,600	90.79 1,159,978,462	91.12 1,164,181,653	1.625 2029/8/15	1.22
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,232,965,900	90.70 1,118,423,367	91.08 1,123,046,990	1.75 2029/11/15	1.18
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,047,373,600	96.60 1,011,857,161	96.83 1,014,224,225	2.875 2028/8/15	1.06
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	915,013,200	96.88 886,556,289	97.11 888,596,768	2.875 2028/5/15	0.93
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	825,813,800	97.15 802,330,676	97.38 804,227,027	3.125 2028/11/15	0.84
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	866,097,400	83.79 725,720,333	84.25 729,713,042	1.25 2031/8/15	0.76
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	831,568,600	86.50 719,365,048	86.93 722,907,531	1.625 2031/5/15	0.76
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	825,813,800	86.04 710,554,366	86.51 714,485,841	1.875 2032/2/15	0.75
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	825,813,800	84.81 700,388,739	85.24 703,973,231	1.125 2031/2/15	0.74
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	794,162,400	84.10 667,898,520	84.51 671,218,118	0.875 2030/11/15	0.70
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	742,369,200	83.67 621,147,733	84.06 624,080,091	0.625 2030/8/15	0.65
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	650,292,400	91.74 596,591,253	91.95 597,963,370	0.625 2027/12/31	0.63
24	WI TREASURY SEC. アメリカ	国債証券	657,485,900	84.48 555,507,353	84.89 558,166,079	0.625 2030/5/15	0.59
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	528,002,900	83.78 442,408,954	84.24 444,821,323	1.375 2031/11/15	0.47
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	402,836,000	101.20 407,698,918	101.62 409,382,085	4.625 2035/2/15	0.43
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	402,836,000	99.58 401,152,145	100.02 402,944,765	4.375 2034/5/15	0.42
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	402,836,000	98.34 396,161,007	98.76 397,860,975	4.25 2034/11/15	0.42
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	399,958,600	97.01 388,030,683	97.44 389,739,657	4 2034/2/15	0.41
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	379,816,800	100.77 382,767,976	101.22 384,488,546	4.5 2033/11/15	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5月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
公社債券	外国	国債証券	98.59
	小計		98.59
合　計（対純資産総額比）			98.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額面金額	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	76,294	16,471.48 1,256,675,186	15,714.92 1,198,954,114	－ －	6.53
2	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	50,137	19,993.00 1,002,389,315	22,022.18 1,104,126,083	－ －	6.02
3	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	8,017	131,932.55 1,057,703,330	127,674.55 1,023,566,900	－ －	5.58
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	26,046	26,418.72 688,102,020	24,783.04 645,499,221	－ －	3.52
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	25,211	25,804.05 650,546,140	23,483.90 592,052,605	－ －	3.23
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	71,974	8,186.05 589,182,811	8,108.51 583,602,129	－ －	3.18
7	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	12,960	47,319.23 613,257,305	44,027.09 570,591,182	－ －	3.11
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資証券	167,172	3,370.22 563,406,569	3,009.77 503,150,240	－ －	2.74
9	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	86,604	4,606.85 398,971,943	4,556.36 394,599,252	－ －	2.15
10	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	17,446	23,442.31 408,974,698	21,697.03 378,526,467	－ －	2.06
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	11,662	32,640.48 380,653,391	29,640.09 345,662,815	－ －	1.88
12	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	24,173	16,301.35 394,052,691	14,070.48 340,125,858	－ －	1.85
13	VENTAS INC アメリカ	投資証券	35,937	9,263.07 332,887,231	9,229.26 331,671,934	－ －	1.81
14	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	28,057	10,632.76 298,323,431	10,068.02 282,478,510	－ －	1.54
15	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	46,785	4,868.81 227,787,542	4,819.64 225,487,091	－ －	1.23
16	MID-AMERICA APARTMENT COMM アメリカ	投資証券	9,595	22,774.58 218,522,127	22,407.75 215,002,385	－ －	1.17
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	5,276	43,110.60 227,451,569	40,582.84 214,115,114	－ －	1.17
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	9,870	18,158.09 179,220,379	17,611.12 173,821,820	－ －	0.95

19	KIMCO REALTY CORP アメリカ	投資証券	55,809	3,524.56 196,702,362	3,071.62 171,424,291	－ －	0.93
20	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	17,951	8,186.95 146,964,117	9,076.75 162,936,888	－ －	0.89
21	LINK REIT 香港	投資証券	213,000	620.87 132,247,333	755.60 160,944,504	－ －	0.88
22	SEGRO PLC イギリス	投資証券	111,058	1,459.20 162,056,337	1,360.78 151,125,638	－ －	0.82
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIE アメリカ	投資証券	22,408	7,182.45 160,944,363	6,646.79 148,941,359	－ －	0.81
24	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	8,849	17,363.58 153,650,334	16,819.84 148,838,779	－ －	0.81
25	UDR INC アメリカ	投資証券	24,660	6,354.73 156,707,767	5,944.70 146,596,509	－ －	0.80
26	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資証券	429,867	328.58 141,248,175	340.69 146,453,279	－ －	0.80
27	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	57,899	3,030.85 175,483,298	2,520.60 145,940,358	－ －	0.80
28	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	15,809	10,050.60 158,890,045	9,056.61 143,176,050	－ －	0.78
29	AMERICAN HOMES 4 RENT- A アメリカ	投資証券	26,392	5,385.50 142,134,314	5,395.12 142,388,139	－ －	0.78
30	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	13,347	10,640.22 142,015,035	10,414.74 139,005,658	－ －	0.76

（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5月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
投資証券	外国		94.52
	小計		94.52
合　計（対純資産総額比）			94.52

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ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。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】
該当事項はありません。

（参考）
ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０７０６月	買建	341	8,857,247,550	9,539,475,000	3.12

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

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０７０６月	買建	534	921,864,740	927,558,000	2.77

（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5月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P 500 EMINI FUTURE 202506	買建	602	25,888,344,020	25,648,391,879	2.19
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE 202506	買建	185	3,132,659,059	3,138,367,158	0.27
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 202506	買建	323	2,871,334,932	2,842,421,318	0.24

（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。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴオプション取引所	DOW JONES U.S. REAL ESTATE INDEX FUTURES 202506	買建	161	834,597,739	835,260,304	4.55
	ＥＵＲＥＸ取引所	THE STOXX 600 REAL ESTATE INDEX FUTURE 202506	買建	104	110,954,928	113,720,406	0.62

（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】
①【純資産の推移】
直近日（2025年5月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（円）	純資産総額（分配付）（円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(2018年11月20日)	145,641,686	145,641,686	1.0220	1.0220
第2計算期間末(2019年11月20日)	449,995,397	449,995,397	1.1350	1.1350
第3計算期間末(2020年11月20日)	643,180,193	643,180,193	1.1163	1.1163
第4計算期間末(2021年11月22日)	1,139,449,000	1,139,449,000	1.3641	1.3641
第5計算期間末(2022年11月21日)	1,598,705,661	1,598,705,661	1.3619	1.3619
第6計算期間末(2023年11月20日)	2,057,282,350	2,057,282,350	1.4789	1.4789
第7計算期間末(2024年11月20日)	2,522,676,958	2,522,676,958	1.6686	1.6686
2024年5月末日	2,369,815,223	－	1.6074	－
6月末日	2,454,761,444	－	1.6492	－
7月末日	2,421,297,906	－	1.6274	－
8月末日	2,426,911,929	－	1.6195	－
9月末日	2,455,560,026	－	1.6217	－
10月末日	2,510,358,628	－	1.6660	－
11月末日	2,501,994,242	－	1.6556	－
12月末日	2,533,112,362	－	1.6758	－
2025年1月末日	2,537,292,792	－	1.6762	－
2月末日	2,465,786,010	－	1.6415	－
3月末日	2,461,343,270	－	1.6238	－
4月末日	2,451,127,750	－	1.6006	－
5月末日	2,537,752,025	－	1.6476	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
2024年11月21日～2025年5月20日	－

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	2.2
第2計算期間	11.1
第3計算期間	△1.6
第4計算期間	22.2
第5計算期間	△0.2
第6計算期間	8.6
第7計算期間	12.8
2024年11月21日～2025年5月20日	△1.5

（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	205,532,661	63,019,338	142,513,323
第2計算期間	363,613,995	109,641,838	396,485,480
第3計算期間	357,040,495	177,347,180	576,178,795
第4計算期間	398,577,616	139,453,723	835,302,688
第5計算期間	489,741,073	151,198,265	1,173,845,496
第6計算期間	418,527,532	201,281,158	1,391,091,870
第7計算期間	450,760,927	330,013,374	1,511,839,423
2024年11月21日～2025年5月20日	157,187,454	131,846,599	1,537,180,278

（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5月末現在

●基準価額・純資産の推移

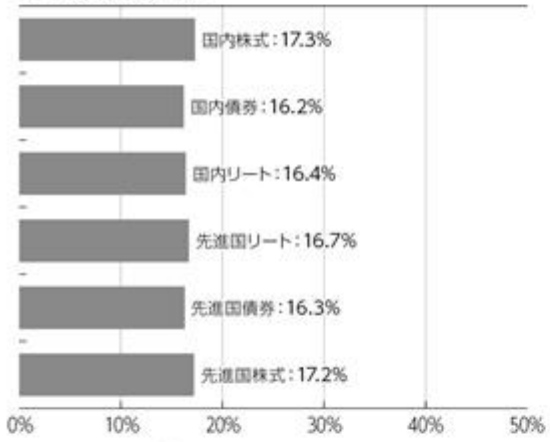
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

基準価額	16,476円
純資産総額	25億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

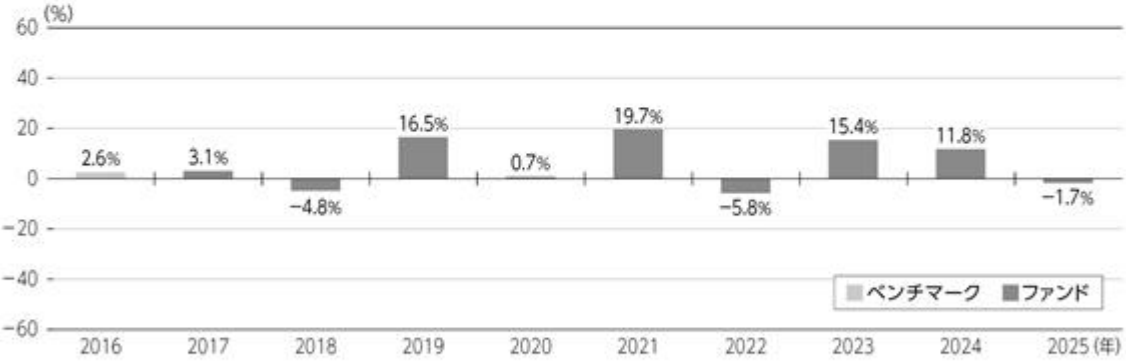
2020年11月	0円
2021年11月	0円
2022年11月	0円
2023年11月	0円
2024年11月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

●資産別組入比率



・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

●年間収益率の推移



・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
・2017年はファンド設定時から年末まで、2025年は年始から上記作成基準日までの収益率です。
・2016年はベンチマークの収益率です。ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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

3.運用実績

2025年5月末現在

●マザーファンドの状況

1.ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.7%
2	ソニーグループ	3.3%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3.2%
4	日立製作所	2.6%
5	三井住友フィナンシャルグループ	1.9%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	17.3%
2	銀行業	9.1%
3	情報・通信業	7.8%
4	輸送用機器	7.3%
5	卸売業	7.0%

・比率は対組入株式評価額比です。

2.ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	償還日	クーポン	比率
1	第377回　利付国債(10年)	2034/12/20	1.200%	0.8%
2	第344回　利付国債(10年)	2026/09/20	0.100%	0.8%
3	第345回　利付国債(10年)	2026/12/20	0.100%	0.8%
4	第371回　利付国債(10年)	2033/06/20	0.400%	0.8%
5	第370回　利付国債(10年)	2033/03/20	0.500%	0.7%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入比率

種別	比率
債券	99.4%
債券先物	－
現金、その他	0.6%

・比率は対純資産総額比です。

3.ニッセイJ−REITインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.6%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.1%
3	日本都市ファンド投資法人	5.1%
4	野村不動産マスターファンド投資法人	4.6%
5	KDX不動産投資法人	4.3%

・比率は対組入投資信託証券評価額比です。

組入比率

投資対象	比率
不動産投資信託証券等	100.8%
短期金融資産等	−0.8%

・比率は対純資産総額比です。

4.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	エヌビディア	情報技術	5.0%
2	マイクロソフト	情報技術	4.7%
3	アップル	情報技術	4.4%
4	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.8%
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。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	75.7%
2	イギリス	4.0%
3	カナダ	3.4%
4	フランス	3.0%
5	ドイツ	2.8%

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

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

5. ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	通貨	償還日	クーポン	比率
1	アメリカ国債	アメリカドル	2026/05/15	1.625%	2.2%
2	アメリカ国債	アメリカドル	2026/11/15	2.000%	2.2%
3	アメリカ国債	アメリカドル	2026/08/15	1.500%	2.1%
4	アメリカ国債	アメリカドル	2027/02/15	2.250%	1.8%
5	アメリカ国債	アメリカドル	2027/05/15	2.375%	1.7%

・比率は対組入債券評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	46.0%
2	中国	11.1%
3	フランス	7.5%
4	イタリア	6.9%
5	ドイツ	5.8%

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

6. ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	国・地域	比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	6.9%
2	WELLTOWER INC	アメリカ	6.4%
3	EQUINIX INC	アメリカ	5.9%
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.7%
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.4%

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

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	78.1%
2	オーストラリア	7.5%
3	イギリス	4.7%
4	シンガポール	3.0%
5	フランス	2.1%

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

①　申込受付

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

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

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

②　取扱コース

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

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

③　申込単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑤　販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥　申込手数料

ありません。

⑦　その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）
ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

２【換金（解約）手続等】

①　換金受付

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

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

金融商品取引所の取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することおよび既に受付けた換金の受付けを取消すことがあります。

②　換金方法

「解約請求」および「買取請求」の２つの方法があります。

③　換金単位

各販売会社が定める単位とします。

○　販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④　換金価額

＜解約請求の場合＞

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

＜買取請求の場合＞

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

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

○　換金手数料はありません。

⑤　信託財産留保額

ありません。

⑥　支払開始日

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

⑦　その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社
コールセンター　０１２０-７６２-５０６
（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）
ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

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

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

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

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

⑤ 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター　０１２０-７６２-５０６

（9:00～17:00　土日祝日・年末年始を除く）

ホームページ　　https://www.nam.co.jp/

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限です。

（4）【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。

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

（5）【その他】

① 繰上償還

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

ⅰ．受益権の口数が30億口を下回っている場合

ⅱ．この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

ⅲ．やむを得ない事情が発生したとき

２．委託会社は、前記１．により解約するときには、書面による決議（以下「書面決議」といいます）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までにこの信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
３．前記２．の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該３．において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
４．前記２．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。
５．前記２．から４．までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記２．から４．までに規定するこの信託契約の解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。
６．委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
７．委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「②　約款の変更等　２．」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
８．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記「②　約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
９．償還金については、原則として償還日から起算して５営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して５営業日目）までにお支払いします。

②　約款の変更等

１．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第２号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、約款は当該「②　約款の変更等」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
２．委託会社は、前記１．の事項（前記１．の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
３．前記２．の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下当該３．において同じ）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議に賛成するものとみなします。
４．前記２．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。
５．書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

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

③　反対者の買取請求の不適用

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

④　公告

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

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

⑤　運用報告書の作成

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

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

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

⑥　信託事務処理の再信託

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

⑦　関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

（１）収益分配金に対する請求権

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

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

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

（２）償還金に対する請求権

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

（３）解約請求権

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

（４）帳簿閲覧権

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

（５）書面決議における議決権

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

（６）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

第３【ファンドの経理状況】

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

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（2023年11月21日から2024年11月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【＜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）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 2023年11月20日現在	第7期 2024年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	34,036	57,805
コール・ローン	1,609,642	2,028,327
親投資信託受益証券	2,057,312,164	2,522,689,050
未収入金	3,497,124	3,490,723
流動資産合計	2,062,452,966	2,528,265,905
資産合計	2,062,452,966	2,528,265,905
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,467,485	3,430,104
未払受託者報酬	212,865	269,832
未払委託者報酬	1,479,722	1,875,618
その他未払費用	10,544	13,393
流動負債合計	5,170,616	5,588,947
負債合計	5,170,616	5,588,947
純資産の部		
元本等		
元本	1,391,091,870	1,511,839,423
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	666,190,480	1,010,837,535
（分配準備積立金）	283,264,406	469,918,096
元本等合計	2,057,282,350	2,522,676,958
純資産合計	2,057,282,350	2,522,676,958
負債純資産合計	2,062,452,966	2,528,265,905

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期 自　2022年11月22日 至　2023年11月20日	第7期 自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
営業収益		
受取利息	15	969
有価証券売買等損益	162,947,436	277,800,558
営業収益合計	162,947,451	277,801,527
営業費用		
支払利息	187	－
受託者報酬	396,821	507,593
委託者報酬	2,758,517	3,528,391
その他費用	19,659	25,183
営業費用合計	3,175,184	4,061,167
営業利益又は営業損失（△）	159,772,267	273,740,360
経常利益又は経常損失（△）	159,772,267	273,740,360
当期純利益又は当期純損失（△）	159,772,267	273,740,360
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（△）	6,942,531	29,129,269
期首剰余金又は期首欠損金（△）	424,860,165	666,190,480
剰余金増加額又は欠損金減少額	161,160,300	261,440,155
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	161,160,300	261,440,155
剰余金減少額又は欠損金増加額	72,659,721	161,404,191
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	72,659,721	161,404,191
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（△）	666,190,480	1,010,837,535

（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7期 自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第6期 2023年11月20日現在	第7期 2024年11月20日現在
１．　期首元本額	1,173,845,496円	1,391,091,870円
期中追加設定元本額	418,527,532円	450,760,927円
期中一部解約元本額	201,281,158円	330,013,374円
２．　受益権の総数	1,391,091,870口	1,511,839,423口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第6期 自　2022年11月22日 至　2023年11月20日	第7期 自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（152,829,767円）、収益調整金（382,926,244円）及び分配準備積立金（130,434,639円）より分配対象収益は666,190,650円（1万口当たり4,788.98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（946円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（244,609,991円）、収益調整金（540,919,439円）及び分配準備積立金（225,307,159円）より分配対象収益は1,010,837,535円（1万口当たり6,686.14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6期 自　2022年11月22日 至　2023年11月20日	第7期 自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第6期 2023年11月20日現在	第7期 2024年11月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	149,266,762	220,320,243
合計	149,266,762	220,320,243

（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6期 2023年11月20日現在	第7期 2024年11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4789円 (14,789円)	1.6686円 (16,686円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年11月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド	128,997,581	420,841,708	
	ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド	232,962,464	418,260,807	
	ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド	87,345,461	433,329,566	
	ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	230,977,595	415,251,520	
	ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド	450,431,556	409,577,413	
	ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド	221,947,014	425,428,036	
親投資信託受益証券　合計		1,352,661,671	2,522,689,050	
合計			2,522,689,050	

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

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

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年11月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	154,320,605
コール・ローン	5,414,970,655
株式	248,879,736,050
派生商品評価勘定	111,050,750
未収配当金	2,434,174,226
差入委託証拠金	453,296,294
流動資産合計	257,447,548,580
資産合計	257,447,548,580
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	33,963,050
前受金	94,405,000
未払解約金	483,658,224
流動負債合計	612,026,274
負債合計	612,026,274
純資産の部	
元本等	
元本	78,725,847,548
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	178,109,674,758
元本等合計	256,835,522,306
純資産合計	256,835,522,306
負債純資産合計	257,447,548,580

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年11月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	71,774,824,873円
同期中追加設定元本額	26,886,839,601円
同期中一部解約元本額	19,935,816,926円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイＴＯＰＩＸオープン	5,094,375,678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）	2,950,236,614円
ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	2,957,715円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,059,806,157円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,689,587,932円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	6,909,880,177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）	1,936,737円
ニッセイインデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	3,024,398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）	8,543,058円
ＤＣニッセイ国内株式インデックス	5,139,876,902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	25,782,743,156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）	5,207,963,112円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	469,349,624円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	252,263,818円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	543,772,107円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	703,298,051円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	29,659,036円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	128,997,581円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	13,880,172円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	15,765,221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）	5,209,341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）	11,318,647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）	29,968,712円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	390,432,098円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	263,403,562円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	465,567,152円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	206,330,985円
ニッセイ国内株式市場連動ＳＡファンド（適格機関投資家限定）	13,994,539,967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）	30,900,655円
ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（安定型）	41,300円
ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（積極型）	92,048円
ＦＷニッセイ国内株インデックス	100,289,605円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	185,043,841円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	31,369,387円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	3,423,002円
計	78,725,847,548円
２．　受益権の総数	78,725,847,548口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	5,536,491,880
合計	5,536,491,880

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年2月21日から2024年11月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2024年11月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 　先物取引 　　買建	7,661,915,000	－	7,739,160,000	77,245,000
合計	7,661,915,000	－	7,739,160,000	77,245,000

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年11月20日現在
1口当たり純資産額	3.2624円
（1万口当たり純資産額）	(32,624円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2024年11月20日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	3,800	3,980.00	15,124,000	
ニッスイ	90,200	916.70	82,686,340	
マルハニチロ	13,400	3,059.00	40,990,600	
雪国まいたけ	7,700	1,039.00	8,000,300	
カネコ種苗	2,500	1,388.00	3,470,000	
サカタのタネ	10,100	3,405.00	34,390,500	
ホクト	8,000	1,708.00	13,664,000	
ショーボンドホールディングス	11,900	5,221.00	62,129,900	
ミライト・ワン	29,500	2,189.50	64,590,250	
タマホーム	5,700	3,685.00	21,004,500	
住石ホールディングス	9,900	842.00	8,335,800	
日鉄鉱業	3,600	4,220.00	15,192,000	
三井松島ホールディングス	4,400	3,565.00	15,686,000	
ＩＮＰＥＸ	272,700	2,020.00	550,854,000	
石油資源開発	49,500	1,093.00	54,103,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	4,100	3,025.00	12,402,500	
リョーサン菱洋ホールディングス	11,500	2,350.00	27,025,000	
安藤・間	52,300	1,191.00	62,289,300	
東急建設	28,300	698.00	19,753,400	
コムシスホールディングス	32,000	3,303.00	105,696,000	
ビーアールホールディングス	22,800	342.00	7,797,600	
高松コンストラクショングループ	6,700	2,668.00	17,875,600	
東建コーポレーション	2,300	10,860.00	24,978,000	
ヤマウラ	6,600	1,155.00	7,623,000	
オリエンタル白石	33,400	385.00	12,859,000	
大成建設	57,300	6,835.00	391,645,500	
大林組	208,400	2,072.00	431,804,800	
清水建設	179,000	1,171.00	209,609,000	
長谷工コーポレーション	57,900	1,891.50	109,517,850	
松井建設	9,400	855.00	8,037,000	
鹿島建設	139,900	2,695.00	377,030,500	
不動テトラ	4,000	2,105.00	8,420,000	
鉄建建設	4,100	2,262.00	9,274,200	
西松建設	10,100	5,017.00	50,671,700	
三井住友建設	50,900	368.00	18,731,200	
大豊建設	2,300	3,425.00	7,877,500	
奥村組	11,200	3,970.00	44,464,000	
東鉄工業	6,900	3,115.00	21,493,500	
淺沼組	25,300	659.00	16,672,700	

戸田建設	77,600	992.00	76,979,200	
熊谷組	10,400	3,610.00	37,544,000	
矢作建設工業	8,600	1,497.00	12,874,200	
日本ハウスホールディングス	23,500	324.00	7,614,000	
大東建託	21,600	17,260.00	372,816,000	
新日本建設	8,900	1,509.00	13,430,100	
サムティホールディングス	12,300	3,295.00	40,528,500	
東亜道路工業	10,900	1,250.00	13,625,000	
日本道路	6,300	1,666.00	10,495,800	
東亜建設工業	19,100	1,146.00	21,888,600	
日本国土開発	18,000	509.00	9,162,000	
若築建設	2,300	3,570.00	8,211,000	
東洋建設	18,200	1,301.00	23,678,200	
五洋建設	82,600	622.40	51,410,240	
世紀東急工業	9,000	1,553.00	13,977,000	
福田組	2,400	5,280.00	12,672,000	
住友林業	54,500	5,426.00	295,717,000	
大和ハウス工業	190,400	4,671.00	889,358,400	
ライト工業	12,800	2,152.00	27,545,600	
積水ハウス	191,500	3,547.00	679,250,500	
日特建設	7,800	996.00	7,768,800	
ユアテック	12,200	1,493.00	18,214,600	
日本リーテック	7,700	1,119.00	8,616,300	
四電工	7,900	1,497.00	11,826,300	
中電工	9,800	3,435.00	33,663,000	
関電工	34,600	2,274.00	78,680,400	
きんでん	43,900	3,075.00	134,992,500	
東京エネシス	7,000	1,011.00	7,077,000	
トーエネック	10,500	921.00	9,670,500	
住友電設	5,100	4,835.00	24,658,500	
日本電設工業	11,800	1,804.00	21,287,200	
エクシオグループ	66,800	1,800.00	120,240,000	
新日本空調	4,100	3,915.00	16,051,500	
九電工	13,600	5,185.00	70,516,000	
三機工業	13,200	2,991.00	39,481,200	
日揮ホールディングス	62,500	1,307.50	81,718,750	
中外炉工業	3,000	2,850.00	8,550,000	
太平電業	4,000	4,965.00	19,860,000	
高砂熱学工業	15,200	6,045.00	91,884,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	25,200	3,290.00	82,908,000	
朝日工業社	6,200	1,807.00	11,203,400	
明星工業	10,900	1,300.00	14,170,000	
大氣社	8,100	4,925.00	39,892,500	
ダイダン	8,300	3,550.00	29,465,000	
日比谷総合設備	5,100	3,750.00	19,125,000	
ニップン	20,900	2,138.00	44,684,200	
日清製粉グループ本社	65,900	1,840.00	121,256,000	
日東富士製粉	1,200	6,520.00	7,824,000	
昭和産業	5,400	2,790.00	15,066,000	
中部飼料	8,800	1,323.00	11,642,400	

フィード・ワン	9,500	819.00	7,780,500	
日本甜菜製糖	3,300	2,409.00	7,949,700	
DM三井製糖ホールディングス	6,300	3,175.00	20,002,500	
ウェルネオシュガー	3,800	2,216.00	8,420,800	
ＬＩＦＵＬＬ	55,300	164.00	9,069,200	
ＭＩＸＩ	12,400	2,848.00	35,315,200	
ジェイエイシーリクルートメント	23,900	692.00	16,538,800	
日本M&Aセンターホールディングス	97,300	636.80	61,960,640	
メンバーズ	8,700	1,168.00	10,161,600	
ＵＴグループ	8,600	2,001.00	17,208,600	
ケアネット	13,500	653.00	8,815,500	
Ｅ・Ｊホールディングス	4,600	1,730.00	7,958,000	
オープンアップグループ	19,900	1,801.00	35,839,900	
コシダカホールディングス	19,800	1,178.00	23,324,400	
パソナグループ	8,000	1,953.00	15,624,000	
リンクアンドモチベーション	16,300	551.00	8,981,300	
エス・エム・エス	25,300	1,593.00	40,302,900	
パーソルホールディングス	617,300	232.70	143,645,710	
森永製菓	26,500	2,726.00	72,239,000	
中村屋	2,500	3,165.00	7,912,500	
江崎グリコ	18,100	4,350.00	78,735,000	
名糖産業	4,300	1,928.00	8,290,400	
井村屋グループ	3,500	2,410.00	8,435,000	
不二家	4,300	2,668.00	11,472,400	
山崎製パン	42,400	2,862.50	121,370,000	
モロゾフ	2,000	4,455.00	8,910,000	
亀田製菓	4,000	4,130.00	16,520,000	
寿スピリッツ	37,500	1,970.00	73,875,000	
カルビー	29,000	3,067.00	88,943,000	
森永乳業	24,300	2,939.00	71,417,700	
六甲バター	2,400	1,409.00	3,381,600	
ヤクルト本社	90,600	3,019.00	273,521,400	
明治ホールディングス	84,700	3,317.00	280,949,900	
雪印メグミルク	17,000	2,757.00	46,869,000	
プリマハム	8,500	2,193.00	18,640,500	
日本ハム	27,300	5,031.00	137,346,300	
丸大食品	6,400	1,748.00	11,187,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	7,000	2,650.00	18,550,000	
柿安本店	3,000	2,761.00	8,283,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	9,700	3,785.00	36,714,500	
学情	4,400	1,724.00	7,585,600	
クロスキャット	7,200	1,118.00	8,049,600	
システナ	92,200	347.00	31,993,400	
デジタルアーツ	4,100	5,930.00	24,313,000	
日鉄ソリューションズ	22,000	4,216.00	92,752,000	
綜合警備保障	110,500	1,099.50	121,494,750	
キューブシステム	8,000	1,048.00	8,384,000	
いちご	53,600	388.00	20,796,800	
日本駐車場開発	75,400	223.00	16,814,200	
コア	4,300	1,830.00	7,869,000	

カカクコム	47,700	2,318.00	110,568,600	
アイロムグループ	2,700	2,609.00	7,044,300	
セントケア・ホールディング	10,700	720.00	7,704,000	
ディップ	11,600	2,556.00	29,649,600	
ＳＢＳホールディングス	5,700	2,400.00	13,680,000	
新日本科学	7,000	1,450.00	10,150,000	
エムスリー	130,700	1,376.50	179,908,550	
ワールドホールディングス	4,100	2,099.00	8,605,900	
ディー・エヌ・エー	26,500	2,469.00	65,428,500	
博報堂ＤＹホールディングス	75,000	1,140.50	85,537,500	
ファンコミュニケーションズ	19,200	417.00	8,006,400	
エスプール	20,900	353.00	7,377,700	
ＷＤＢホールディングス	4,600	1,664.00	7,654,400	
アドウェイズ	23,900	322.00	7,695,800	
バリューコマース	7,200	1,118.00	8,049,600	
インフォマート	62,400	283.00	17,659,200	
サッポロホールディングス	20,900	8,239.00	172,195,100	
アサヒグループホールディングス	475,800	1,618.50	770,082,300	
キリンホールディングス	263,900	2,100.50	554,321,950	
シマダヤ	5,400	1,400.00	7,560,000	
宝ホールディングス	42,700	1,216.50	51,944,550	
オエノンホールディングス	20,500	415.00	8,507,500	
飛島ホールディングス	6,500	1,577.00	10,250,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	44,700	2,429.00	108,576,300	
ライフドリンク　カンパニー	13,800	2,420.00	33,396,000	
サントリー食品インターナショナル	44,600	5,076.00	226,389,600	
ダイドーグループホールディングス	7,200	2,946.00	21,211,200	
伊藤園	21,200	3,111.00	65,953,200	
キーコーヒー	7,100	2,036.00	14,455,600	
日清オイリオグループ	8,900	5,120.00	45,568,000	
不二製油グループ本社	12,600	3,474.00	43,772,400	
Ｊ－オイルミルズ	7,300	2,135.00	15,585,500	
サンエー	11,500	2,802.00	32,223,000	
カワチ薬品	5,300	2,468.00	13,080,400	
エービーシー・マート	29,800	3,073.00	91,575,400	
ハードオフコーポレーション	4,100	1,807.00	7,408,700	
高千穂交易	2,700	3,845.00	10,381,500	
アスクル	16,100	1,875.00	30,187,500	
ゲオホールディングス	7,600	1,466.00	11,141,600	
アダストリア	9,400	3,430.00	32,242,000	
伊藤忠食品	1,500	6,980.00	10,470,000	
くら寿司	8,000	3,845.00	30,760,000	
キャンドゥ	2,500	3,245.00	8,112,500	
エレマテック	6,100	2,396.00	14,615,600	
パルグループホールディングス	15,600	2,918.00	45,520,800	
エディオン	29,600	1,812.00	53,635,200	
あらた	10,400	3,010.00	31,304,000	
サーラコーポレーション	14,300	800.00	11,440,000	
ハローズ	2,700	4,125.00	11,137,500	

ＪＰホールディングス	16,900	643.00	10,866,700	
フジオフードグループ本社	7,700	1,329.00	10,233,300	
あみやき亭	4,900	1,623.00	7,952,700	
東京エレクトロン　デバイス	6,800	3,060.00	20,808,000	
円谷フィールズホールディングス	11,000	2,145.00	23,595,000	
双日	75,800	3,080.00	233,464,000	
アルフレッサ　ホールディングス	63,500	2,249.00	142,811,500	
大黒天物産	2,100	10,160.00	21,336,000	
ハニーズホールディングス	6,000	1,626.00	9,756,000	
キッコーマン	210,000	1,677.00	352,170,000	
味の素	148,900	6,255.00	931,369,500	
ブルドックソース	4,400	1,820.00	8,008,000	
キユーピー	34,100	3,528.00	120,304,800	
ハウス食品グループ本社	21,300	2,842.00	60,534,600	
カゴメ	27,100	3,002.00	81,354,200	
アリアケジャパン	6,300	5,320.00	33,516,000	
エバラ食品工業	2,700	2,876.00	7,765,200	
ニチレイ	25,800	4,084.00	105,367,200	
横浜冷凍	17,100	813.00	13,902,300	
東洋水産	29,400	10,315.00	303,261,000	
イートアンドホールディングス	3,600	2,112.00	7,603,200	
日清食品ホールディングス	81,700	3,804.00	310,786,800	
フジッコ	6,500	1,711.00	11,121,500	
ロック・フィールド	7,700	1,463.00	11,265,100	
日本たばこ産業	385,000	4,196.00	1,615,460,000	
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,252.00	9,008,000	
わらべや日洋ホールディングス	4,200	2,017.00	8,471,400	
なとり	4,000	2,120.00	8,480,000	
ファーマフーズ	8,700	951.00	8,273,700	
北の達人コーポレーション	51,100	151.00	7,716,100	
ユーグレナ	39,300	428.00	16,820,400	
紀文食品	7,200	1,115.00	8,028,000	
ＳＲＥホールディングス	2,300	3,315.00	7,624,500	
片倉工業	5,900	1,993.00	11,758,700	
グンゼ	4,600	5,120.00	23,552,000	
ヒューリック	147,800	1,432.50	211,723,500	
アルペン	5,600	2,001.00	11,205,600	
クオールホールディングス	8,400	1,439.00	12,087,600	
アルコニックス	9,700	1,438.00	13,948,600	
神戸物産	52,700	3,529.00	185,978,300	
ジンズホールディングス	5,200	6,390.00	33,228,000	
ビックカメラ	40,700	1,653.00	67,277,100	
ＤＣＭホールディングス	35,300	1,413.00	49,878,900	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	96,500	2,482.00	239,513,000	
あい　ホールディングス	10,900	2,161.00	23,554,900	
Ｊ．フロント　リテイリング	78,100	1,710.50	133,590,050	
ドトール・日レスホールディングス	12,100	2,238.00	27,079,800	
マツキヨココカラ&カンパニー	120,000	2,080.00	249,600,000	
ブロンコビリー	4,000	3,680.00	14,720,000	
ＺＯＺＯ	50,600	4,675.00	236,555,000	

トレジャー・ファクトリー	5,800	1,277.00	7,406,600	
物語コーポレーション	11,900	3,435.00	40,876,500	
三越伊勢丹ホールディングス	103,300	2,240.00	231,392,000	
東洋紡	27,900	936.00	26,114,400	
富士紡ホールディングス	2,500	5,110.00	12,775,000	
日清紡ホールディングス	48,900	892.00	43,618,800	
倉敷紡績	4,600	5,350.00	24,610,000	
ダイワボウホールディングス	30,100	3,182.00	95,778,200	
日東紡績	7,300	5,680.00	41,464,000	
トヨタ紡織	27,100	1,992.00	53,983,200	
マクニカホールディングス	52,700	1,756.00	92,541,200	
Ｈａｍｅｅ	7,900	1,080.00	8,532,000	
ラクト・ジャパン	2,900	2,788.00	8,085,200	
ウエルシアホールディングス	35,300	1,867.00	65,905,100	
クリエイトＳＤホールディングス	9,600	2,881.00	27,657,600	
グリムス	2,500	2,566.00	6,415,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9,400	1,154.00	10,847,600	
八洲電機	5,500	1,606.00	8,833,000	
レスター	5,800	2,431.00	14,099,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	37,000	920.00	34,040,000	
三洋貿易	7,000	1,527.00	10,689,000	
シュッピン	7,500	1,001.00	7,507,500	
ビューティガレージ	5,400	1,460.00	7,884,000	
オイシックス・ラ・大地	11,000	1,615.00	17,765,000	
ネクステージ	15,600	1,491.00	23,259,600	
ジョイフル本田	18,900	1,809.00	34,190,100	
エターナルホスピタリティグループ	2,500	3,270.00	8,175,000	
ホットランド	5,200	2,073.00	10,779,600	
すかいらーくホールディングス	93,100	2,228.50	207,473,350	
ＳＦＰホールディングス	4,100	1,907.00	7,818,700	
綿半ホールディングス	5,300	1,556.00	8,246,800	
日本毛織	16,500	1,276.00	21,054,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	22,200	814.00	18,070,800	
野村不動産ホールディングス	39,700	3,789.00	150,423,300	
三重交通グループホールディングス	15,300	482.00	7,374,600	
ディア・ライフ	10,800	1,032.00	11,145,600	
地主	5,600	2,094.00	11,726,400	
プレサンスコーポレーション	8,400	1,822.00	15,304,800	
ＪＰＭＣ	7,000	1,170.00	8,190,000	
フージャースホールディングス	9,800	1,018.00	9,976,400	
オープンハウスグループ	23,200	5,742.00	133,214,400	
東急不動産ホールディングス	190,500	963.30	183,508,650	
飯田グループホールディングス	60,700	2,199.00	133,479,300	
帝国繊維	7,300	2,514.00	18,352,200	
日本コークス工業	81,600	98.00	7,996,800	
ＢＥＥＮＯＳ	4,300	3,340.00	14,362,000	
あさひ	5,700	1,500.00	8,550,000	
日本調剤	500	1,359.00	679,500	

コスモス薬品	11,600	6,767.00	78,497,200	
シップヘルスケアホールディングス	26,900	2,146.00	57,727,400	
ソフトクリエイトホールディングス	4,600	2,217.00	10,198,200	
セブン&アイ・ホールディングス	752,100	2,597.00	1,953,203,700	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	51,200	1,151.00	58,931,200	
明治電機工業	5,800	1,398.00	8,108,400	
ツルハホールディングス	14,300	8,068.00	115,372,400	
サンマルクホールディングス	5,500	2,399.00	13,194,500	
トリドールホールディングス	19,100	3,507.00	66,983,700	
帝人	61,900	1,325.00	82,017,500	
東レ	471,100	921.80	434,259,980	
クラレ	93,900	1,965.50	184,560,450	
旭化成	436,100	1,098.00	478,837,800	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	31,800	285.00	9,063,000	
宮地エンジニアリンググループ	8,000	1,892.00	15,136,000	
トーカロ	19,100	1,797.00	34,322,700	
ＳＵＭＣＯ	126,400	1,257.00	158,884,800	
川田テクノロジーズ	4,300	2,672.00	11,489,600	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,100	3,485.00	17,773,500	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	7,600	1,001.00	7,607,600	
シーアールイー	6,600	1,207.00	7,966,200	
ケイアイスター不動産	3,400	4,345.00	14,773,000	
ジェイ・エス・ビー	2,900	2,650.00	7,685,000	
ロードスターキャピタル	3,600	2,448.00	8,812,800	
霞ヶ関キャピタル	2,600	12,480.00	32,448,000	
日本フエルト	5,500	472.00	2,596,000	
イチカワ	2,400	1,535.00	3,684,000	
ＪＭホールディングス	5,100	2,678.00	13,657,800	
コメダホールディングス	17,800	2,852.00	50,765,600	
アレンザホールディングス	7,300	1,062.00	7,752,600	
バロックジャパンリミテッド	10,300	775.00	7,982,500	
クスリのアオキホールディングス	22,800	3,186.00	72,640,800	
力の源ホールディングス	7,200	1,085.00	7,812,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	36,300	3,106.00	112,747,800	
セーレン	12,400	2,724.00	33,777,600	
ソトー	5,700	686.00	3,910,200	
東海染工	1,600	687.00	1,099,200	
小松マテーレ	10,400	775.00	8,060,000	
ワコールホールディングス	13,400	4,716.00	63,194,400	
ホギメディカル	8,700	4,570.00	39,759,000	
ＴＳＩホールディングス	21,300	862.00	18,360,600	
マツオカコーポレーション	2,500	1,868.00	4,670,000	
ワールド	9,900	1,918.00	18,988,200	
ＴＩＳ	68,200	3,850.00	262,570,000	
グリー	21,600	421.00	9,093,600	
コーエーテクモホールディングス	48,500	1,638.00	79,443,000	
三菱総合研究所	3,200	4,330.00	13,856,000	
ポールトゥウィンホールディングス	17,200	452.00	7,774,400	

ネクソン	141,800	2,145.00	304,161,000	
アイスタイル	21,600	450.00	9,720,000	
エムアップホールディングス	7,900	1,528.00	12,071,200	
エイチーム	12,900	657.00	8,475,300	
セルシス	9,200	1,389.00	12,778,800	
エニグモ	25,800	294.00	7,585,200	
コロプラ	21,900	478.00	10,468,200	
ブロードリーフ	25,900	670.00	17,353,000	
デジタルハーツホールディングス	9,700	811.00	7,866,700	
メディアドゥ	6,100	1,324.00	8,076,400	
じげん	16,100	531.00	8,549,100	
フィックスターズ	6,500	1,684.00	10,946,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,600	1,448.00	8,108,800	
オプティム	13,200	680.00	8,976,000	
ＳＨＩＦＴ	4,300	15,180.00	65,274,000	
特種東海製紙	3,100	3,530.00	10,943,000	
ティーガイア	5,400	2,659.00	14,358,600	
テクマトリックス	13,900	2,472.00	34,360,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	16,000	3,085.00	49,360,000	
GMOペイメントゲートウェイ	14,700	7,638.00	112,278,600	
システムリサーチ	5,700	1,428.00	8,139,600	
インターネットイニシアティブ	35,300	2,992.50	105,635,250	
さくらインターネット	10,100	4,705.00	47,520,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,800	2,630.00	7,364,000	
ＳＲＡホールディングス	3,700	4,190.00	15,503,000	
朝日ネット	12,500	632.00	7,900,000	
ｅＢＡＳＥ	12,300	661.00	8,130,300	
アバントグループ	8,200	2,113.00	17,326,600	
アドソル日進	4,300	2,082.00	8,952,600	
コムチュア	8,500	2,236.00	19,006,000	
アステリア	15,300	503.00	7,695,900	
アイル	3,600	3,105.00	11,178,000	
王子ホールディングス	244,100	558.10	136,232,210	
日本製紙	33,600	841.00	28,257,600	
三菱製紙	900	486.00	437,400	
北越コーポレーション	36,200	1,565.00	56,653,000	
大王製紙	32,500	801.00	26,032,500	
阿波製紙	1,400	469.00	656,600	
マークラインズ	3,800	2,386.00	9,066,800	
ｇｕｍｉ	26,000	357.00	9,282,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,900	2,125.00	8,287,500	
ラクス	30,500	1,958.00	59,719,000	
ダブルスタンダード	4,900	1,577.00	7,727,300	
オープンドア	11,800	684.00	8,071,200	
アカツキ	3,700	2,438.00	9,020,600	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	5,800	1,323.00	7,673,400	
カナミックネットワーク	14,700	500.00	7,350,000	

レンゴー	58,700	894.10	52,483,670	
トーモク	3,700	2,264.00	8,376,800	
ザ・パック	4,800	3,550.00	17,040,000	
チェンジホールディングス	16,000	1,340.00	21,440,000	
オークネット	3,200	2,520.00	8,064,000	
マクロミル	12,700	1,187.00	15,074,900	
オロ	3,500	2,415.00	8,452,500	
ＰＫＳＨＡ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｙ	5,200	3,600.00	18,720,000	
マネーフォワード	15,800	4,406.00	69,614,800	
レゾナック・ホールディングス	57,800	3,780.00	218,484,000	
住友化学	518,400	378.50	196,214,400	
住友精化	3,000	4,740.00	14,220,000	
日産化学	33,200	5,419.00	179,910,800	
ラサ工業	2,900	2,681.00	7,774,900	
クレハ	13,300	2,753.00	36,614,900	
多木化学	2,500	3,510.00	8,775,000	
石原産業	10,700	1,431.00	15,311,700	
日本曹達	13,700	2,656.00	36,387,200	
東ソー	86,100	2,083.50	179,389,350	
トクヤマ	20,800	2,659.00	55,307,200	
セントラル硝子	8,100	3,370.00	27,297,000	
東亞合成	31,000	1,511.50	46,856,500	
大阪ソーダ	22,500	1,509.00	33,952,500	
関東電化工業	13,800	995.00	13,731,000	
デンカ	23,400	2,072.00	48,484,800	
イビデン	37,300	4,678.00	174,489,400	
信越化学工業	578,000	5,620.00	3,248,360,000	
日本カーバイド工業	4,800	1,660.00	7,968,000	
プラスアルファ・コンサルティング	8,200	1,687.00	13,833,400	
電算システムホールディングス	3,000	2,484.00	7,452,000	
堺化学工業	4,500	2,557.00	11,506,500	
第一稀元素化学工業	10,100	729.00	7,362,900	
エア・ウォーター	60,800	1,860.00	113,088,000	
日本酸素ホールディングス	62,500	4,385.00	274,062,500	
日本パーカライジング	28,700	1,258.00	36,104,600	
高圧ガス工業	9,300	801.00	7,449,300	
四国化成ホールディングス	7,300	2,102.00	15,344,600	
ステラ　ケミファ	3,500	3,870.00	13,545,000	
保土谷化学工業	2,000	3,730.00	7,460,000	
日本触媒	41,300	1,855.50	76,632,150	
大日精化工業	4,500	2,838.00	12,771,000	
カネカ	15,900	3,418.00	54,346,200	
協和キリン	78,000	2,528.00	197,184,000	
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	19,700	1,462.00	28,801,400	
三菱瓦斯化学	52,300	2,871.00	150,153,300	
三井化学	58,000	3,408.00	197,664,000	
東京応化工業	30,800	3,500.00	107,800,000	
大阪有機化学工業	5,400	2,770.00	14,958,000	
三菱ケミカルグループ	471,200	846.10	398,682,320	
ＫＨネオケム	11,600	2,044.00	23,710,400	

ビジョナル	7,600	7,874.00	59,842,400	
ダイセル	73,300	1,323.50	97,012,550	
住友ベークライト	20,300	3,820.00	77,546,000	
積水化学工業	128,400	2,343.50	300,905,400	
日本ゼオン	49,700	1,423.00	70,723,100	
アイカ工業	16,300	3,341.00	54,458,300	
ＵＢＥ	33,200	2,326.50	77,239,800	
積水樹脂	8,800	2,120.00	18,656,000	
旭有機材	4,300	4,300.00	18,490,000	
ニチバン	4,100	1,929.00	7,908,900	
リケンテクノス	12,100	1,081.00	13,080,100	
大倉工業	3,000	3,120.00	9,360,000	
積水化成品工業	20,200	360.00	7,272,000	
群栄化学工業	2,900	2,709.00	7,856,100	
ダイキョーニシカワ	14,200	627.00	8,903,400	
森六ホールディングス	3,600	2,073.00	7,462,800	
恵和	7,600	1,029.00	7,820,400	
日本化薬	45,100	1,237.50	55,811,250	
カーリット	6,400	1,262.00	8,076,800	
プレステージ・インターナショナル	31,000	667.00	20,677,000	
プロトコーポレーション	7,100	1,357.00	9,634,700	
ハイマックス	5,700	1,356.00	7,729,200	
アミューズ	5,800	1,357.00	7,870,600	
野村総合研究所	139,900	4,498.00	629,270,200	
ドリームインキュベータ	3,500	2,974.00	10,409,000	
クイック	4,600	2,001.00	9,204,600	
日本システム技術	6,000	1,850.00	11,100,000	
電通グループ	71,500	3,692.00	263,978,000	
インテージホールディングス	7,300	1,592.00	11,621,600	
イオンファンタジー	3,000	2,962.00	8,886,000	
ソースネクスト	37,200	199.00	7,402,800	
シーティーエス	9,100	928.00	8,444,800	
メディカルシステムネットワーク	18,800	415.00	7,802,000	
日本精化	4,300	2,511.00	10,797,300	
扶桑化学工業	6,000	3,450.00	20,700,000	
トリケミカル研究所	7,000	2,831.00	19,817,000	
シンプレクス・ホールディングス	12,600	2,553.00	32,167,800	
ラクスル	15,600	1,158.00	18,064,800	
メルカリ	31,500	2,045.00	64,417,500	
ＡＤＥＫＡ	22,500	2,832.00	63,720,000	
日油	75,900	2,322.50	176,277,750	
ハリマ化成グループ	9,300	870.00	8,091,000	
ウイングアーク１ｓｔ	6,700	3,305.00	22,143,500	
Ｓａｎｓａｎ	21,200	1,975.00	41,870,000	
ギフティ	8,500	1,297.00	11,024,500	
花王	157,000	6,243.00	980,151,000	
第一工業製薬	1,700	3,695.00	6,281,500	
石原ケミカル	3,300	2,442.00	8,058,600	
三洋化成工業	4,000	3,995.00	15,980,000	
メドレー	7,100	4,280.00	30,388,000	

ベース	3,200	3,215.00	10,288,000	
ＪＭＤＣ	7,900	4,200.00	33,180,000	
武田薬品工業	574,300	4,182.00	2,401,722,600	
アステラス製薬	566,100	1,572.50	890,192,250	
住友ファーマ	57,500	593.00	34,097,500	
塩野義製薬	214,100	2,059.50	440,938,950	
日本新薬	16,900	4,018.00	67,904,200	
中外製薬	202,000	6,384.00	1,289,568,000	
科研製薬	11,100	4,435.00	49,228,500	
エーザイ	85,600	4,645.00	397,612,000	
理研ビタミン	5,500	2,526.00	13,893,000	
ロート製薬	68,200	2,718.00	185,367,600	
小野薬品工業	132,000	1,745.00	230,340,000	
久光製薬	14,300	4,234.00	60,546,200	
持田製薬	8,100	3,260.00	26,406,000	
参天製薬	122,600	1,666.50	204,312,900	
扶桑薬品工業	3,000	2,613.00	7,839,000	
ツムラ	22,200	4,887.00	108,491,400	
テルモ	430,500	3,063.00	1,318,621,500	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	19,400	2,446.50	47,462,100	
キッセイ薬品工業	10,700	3,705.00	39,643,500	
生化学工業	12,300	813.00	9,999,900	
栄研化学	10,200	2,098.00	21,399,600	
鳥居薬品	3,500	4,755.00	16,642,500	
ＪＣＲファーマ	21,800	638.00	13,908,400	
東和薬品	8,700	2,827.00	24,594,900	
富士製薬工業	6,000	1,420.00	8,520,000	
ゼリア新薬工業	10,200	2,216.00	22,603,200	
ネクセラファーマ	30,300	1,120.00	33,936,000	
第一三共	609,100	4,502.00	2,742,168,200	
杏林製薬	14,000	1,467.00	20,538,000	
ダイト	4,800	2,070.00	9,936,000	
大塚ホールディングス	161,100	9,000.00	1,449,900,000	
ペプチドリーム	31,300	2,556.00	80,002,800	
大日本塗料	7,800	1,145.00	8,931,000	
日本ペイントホールディングス	285,200	998.70	284,829,240	
関西ペイント	54,000	2,113.50	114,129,000	
中国塗料	14,600	2,489.00	36,339,400	
藤倉化成	16,800	519.00	8,719,200	
太陽ホールディングス	11,200	4,130.00	46,256,000	
ＤＩＣ	22,900	3,203.00	73,348,700	
サカタインクス	14,300	1,525.00	21,807,500	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	11,500	3,110.00	35,765,000	
アルプス技研	5,800	2,568.00	14,894,400	
日本空調サービス	7,800	1,020.00	7,956,000	
オリエンタルランド	393,800	3,510.00	1,382,238,000	
フォーカスシステムズ	7,300	1,086.00	7,927,800	
ダスキン	14,400	3,840.00	55,296,000	
パーク２４	49,400	1,868.50	92,303,900	
明光ネットワークジャパン	11,700	715.00	8,365,500	

ファルコホールディングス	3,300	2,281.00	7,527,300	
クレスコ	10,600	1,214.00	12,868,400	
フジ・メディア・ホールディングス	62,000	1,701.50	105,493,000	
ラウンドワン	62,400	1,009.00	62,961,600	
リゾートトラスト	26,100	2,921.00	76,238,100	
オービック	119,800	4,865.00	582,827,000	
ジャストシステム	9,300	3,280.00	30,504,000	
ＴＤＣソフト	10,900	1,278.00	13,930,200	
ＬＩＮＥヤフー	1,032,300	414.10	427,475,430	
ビー・エム・エル	8,100	2,804.00	22,712,400	
トレンドマイクロ	33,900	8,035.00	272,386,500	
ＩＤホールディングス	5,600	1,627.00	9,111,200	
リソー教育	41,300	286.00	11,811,800	
日本オラクル	12,300	15,080.00	185,484,000	
アルファシステムズ	2,400	3,410.00	8,184,000	
フューチャー	16,100	1,933.00	31,121,300	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	4,500	1,728.00	7,776,000	
ユー・エス・エス	136,100	1,380.00	187,818,000	
オービックビジネスコンサルタント	10,900	6,985.00	76,136,500	
アイティフォー	7,600	1,394.00	10,594,400	
東京個別指導学院	20,000	399.00	7,980,000	
東計電算	1,800	4,535.00	8,163,000	
サイバーエージェント	146,200	1,020.50	149,197,100	
楽天グループ	466,000	876.30	408,355,800	
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,569.00	7,688,100	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	13,200	626.00	8,263,200	
テー・オー・ダブリュー	24,600	308.00	7,576,800	
大塚商会	73,200	3,631.00	265,789,200	
サイボウズ	8,900	2,029.00	18,058,100	
セントラルスポーツ	3,300	2,413.00	7,962,900	
パラカ	4,500	1,766.00	7,947,000	
電通総研	6,300	5,220.00	32,886,000	
ＡＣＣＥＳＳ	6,700	1,329.00	8,904,300	
デジタルガレージ	10,300	3,585.00	36,925,500	
イーエムシステムズ	15,000	723.00	10,845,000	
ウェザーニューズ	2,000	5,900.00	11,800,000	
ＣＩＪ	19,400	435.00	8,439,000	
スカラ	17,000	459.00	7,803,000	
フルキャストホールディングス	5,400	1,441.00	7,781,400	
エン・ジャパン	10,800	2,056.00	22,204,800	
セルソース	6,700	1,146.00	7,678,200	
あすか製薬ホールディングス	5,900	2,042.00	12,047,800	
サワイグループホールディングス	38,000	1,947.00	73,986,000	
富士フイルムホールディングス	389,100	3,271.00	1,272,746,100	
コニカミノルタ	145,200	687.40	99,810,480	
資生堂	134,800	2,740.50	369,419,400	
ライオン	82,100	1,822.00	149,586,200	
高砂香料工業	4,400	5,830.00	25,652,000	
マンダム	12,800	1,239.00	15,859,200	

ミルボン	10,400	3,420.00	35,568,000	
ファンケル	15,700	2,793.00	43,850,100	
コーセー	13,100	6,720.00	88,032,000	
コタ	6,500	1,639.00	10,653,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	33,100	1,373.00	45,446,300	
ノエビアホールディングス	5,800	4,955.00	28,739,000	
新日本製薬	4,600	1,850.00	8,510,000	
エステー	5,400	1,499.00	8,094,600	
コニシ	20,300	1,340.00	27,202,000	
長谷川香料	12,300	3,120.00	38,376,000	
小林製薬	16,900	5,714.00	96,566,600	
荒川化学工業	6,000	1,118.00	6,708,000	
メック	5,300	3,185.00	16,880,500	
日本高純度化学	2,500	3,400.00	8,500,000	
タカラバイオ	20,300	1,074.00	21,802,200	
ＪＣＵ	7,100	3,730.00	26,483,000	
デクセリアルズ	56,500	2,413.00	136,334,500	
アース製薬	5,900	5,500.00	32,450,000	
北興化学工業	6,200	1,307.00	8,103,400	
大成ラミック	3,000	2,560.00	7,680,000	
クミアイ化学工業	25,600	808.00	20,684,800	
日本農薬	12,600	704.00	8,870,400	
ニチレキグループ	6,900	2,409.00	16,622,100	
ユシロ化学工業	1,100	2,162.00	2,378,200	
富士石油	23,500	293.00	6,885,500	
出光興産	301,600	1,009.50	304,465,200	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,094,700	790.50	865,360,350	
コスモエネルギーホールディングス	21,300	6,728.00	143,306,400	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	8,800	2,212.00	19,465,600	
テスホールディングス	28,100	286.00	8,036,600	
インフロニア・ホールディングス	66,100	1,219.50	80,608,950	
横浜ゴム	32,600	3,047.00	99,332,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	37,100	2,411.00	89,448,100	
ブリヂストン	188,900	5,397.00	1,019,493,300	
住友ゴム工業	63,300	1,796.00	113,686,800	
藤倉コンポジット	5,600	1,555.00	8,708,000	
オカモト	3,400	5,350.00	18,190,000	
アキレス	5,200	1,485.00	7,722,000	
フコク	4,500	1,800.00	8,100,000	
ニッタ	6,300	3,620.00	22,806,000	
住友理工	12,500	1,603.00	20,037,500	
三ツ星ベルト	9,000	4,180.00	37,620,000	
バンドー化学	9,600	1,783.00	17,116,800	
ＡＧＣ	62,800	4,641.00	291,454,800	
日本板硝子	33,000	336.00	11,088,000	
有沢製作所	9,700	1,492.00	14,472,400	
日本電気硝子	23,900	3,441.00	82,239,900	
住友大阪セメント	11,600	3,198.00	37,096,800	
太平洋セメント	39,800	3,435.00	136,713,000	
日本ヒューム	4,900	1,258.00	6,164,200	

日本コンクリート工業	23,900	379.00	9,058,100	
三谷セキサン	2,700	5,930.00	16,011,000	
アジアパイルホールディングス	9,900	781.00	7,731,900	
東海カーボン	59,500	934.60	55,608,700	
日本カーボン	3,700	4,380.00	16,206,000	
東洋炭素	4,500	4,650.00	20,925,000	
ノリタケ	7,100	3,835.00	27,228,500	
ＴＯＴＯ	46,800	4,043.00	189,212,400	
日本碍子	75,100	2,015.50	151,364,050	
日本特殊陶業	52,700	4,883.00	257,334,100	
ＭＡＲＵＷＡ	2,700	44,440.00	119,988,000	
品川リフラクトリーズ	7,900	1,654.00	13,066,600	
黒崎播磨	4,400	2,428.00	10,683,200	
ヨータイ	4,700	1,558.00	7,322,600	
フジミインコーポレーテッド	17,300	2,376.00	41,104,800	
ニチアス	16,300	5,930.00	96,659,000	
日本製鉄	336,200	3,115.00	1,047,263,000	
神戸製鋼所	133,500	1,620.50	216,336,750	
中山製鋼所	13,700	728.00	9,973,600	
合同製鐵	3,700	3,840.00	14,208,000	
ＪＦＥホールディングス	200,000	1,747.50	349,500,000	
東京製鐵	18,500	1,454.00	26,899,000	
共英製鋼	6,500	1,759.00	11,433,500	
大和工業	12,500	8,123.00	101,537,500	
東京鐵鋼	2,900	6,460.00	18,734,000	
大阪製鐵	3,100	3,020.00	9,362,000	
淀川製鋼所	6,100	5,210.00	31,781,000	
中部鋼鈑	4,400	2,173.00	9,561,200	
丸一鋼管	20,200	3,333.00	67,326,600	
モリ工業	1,700	4,805.00	8,168,500	
大同特殊鋼	41,800	1,179.50	49,303,100	
日本冶金工業	4,500	4,015.00	18,067,500	
山陽特殊製鋼	6,600	1,866.00	12,315,600	
愛知製鋼	3,800	4,595.00	17,461,000	
大平洋金属	6,100	1,420.00	8,662,000	
新日本電工	39,600	290.00	11,484,000	
栗本鐵工所	3,100	4,050.00	12,555,000	
日本製鋼所	19,700	6,690.00	131,793,000	
三菱製鋼	6,000	1,383.00	8,298,000	
日本精線	6,200	1,293.00	8,016,600	
エンビプロ・ホールディングス	4,800	429.00	2,059,200	
大紀アルミニウム工業所	9,400	1,060.00	9,964,000	
日本軽金属ホールディングス	19,400	1,522.00	29,526,800	
三井金属鉱業	16,600	4,659.00	77,339,400	
三菱マテリアル	47,500	2,431.50	115,496,250	
住友金属鉱山	84,000	3,863.00	324,492,000	
ＤＯＷＡホールディングス	18,000	4,544.00	81,792,000	
古河機械金属	8,800	1,607.00	14,141,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,500	1,999.00	22,988,500	
東邦チタニウム	13,700	1,032.00	14,138,400	

ＵＡＣＪ	9,400	5,550.00	52,170,000	
ＣＫサンエツ	2,200	3,710.00	8,162,000	
古河電気工業	22,200	6,055.00	134,421,000	
住友電気工業	229,300	2,886.00	661,759,800	
フジクラ	71,200	5,643.00	401,781,600	
ＳＷＣＣ	9,000	7,430.00	66,870,000	
平河ヒューテック	5,000	1,532.00	7,660,000	
いよぎんホールディングス	83,000	1,540.50	127,861,500	
しずおかフィナンシャルグループ	139,700	1,315.00	183,705,500	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	53,400	1,566.00	83,624,400	
楽天銀行	29,400	3,987.00	117,217,800	
京都フィナンシャルグループ	79,800	2,220.00	177,156,000	
リョービ	7,100	1,967.00	13,965,700	
ＡＲＥホールディングス	26,900	1,773.00	47,693,700	
東洋製罐グループホールディングス	42,300	2,249.50	95,153,850	
ホッカンホールディングス	4,500	1,718.00	7,731,000	
コロナ	8,300	941.00	7,810,300	
横河ブリッジホールディングス	11,400	2,775.00	31,635,000	
三和ホールディングス	66,100	4,433.00	293,021,300	
文化シヤッター	17,400	1,855.00	32,277,000	
三協立山	4,800	726.00	3,484,800	
アルインコ	8,200	959.00	7,863,800	
ＬＩＸＩＬ	96,800	1,762.00	170,561,600	
ノーリツ	9,300	1,715.00	15,949,500	
長府製作所	7,400	1,918.00	14,193,200	
リンナイ	35,300	3,155.00	111,371,500	
ユニプレス	11,500	1,013.00	11,649,500	
日東精工	13,600	593.00	8,064,800	
岡部	11,900	799.00	9,508,100	
ジーテクト	7,400	1,589.00	11,758,600	
東プレ	11,700	1,979.00	23,154,300	
高周波熱錬	9,800	987.00	9,672,600	
東京製綱	7,100	1,260.00	8,946,000	
サンコール	19,600	337.00	6,605,200	
パイオラックス	8,900	2,472.00	22,000,800	
エイチワン	8,400	1,015.00	8,526,000	
日本発条	58,700	1,812.00	106,364,400	
三浦工業	30,200	3,777.00	114,065,400	
タクマ	22,000	1,591.00	35,002,000	
テクノプロ・ホールディングス	38,400	2,743.50	105,350,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,300	826.00	7,681,800	
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,100	4,300.00	17,630,000	
イー・ガーディアン	4,300	1,801.00	7,744,300	
ジャパンマテリアル	20,200	1,610.00	32,522,000	
ベクトル	9,000	940.00	8,460,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	6,300	1,220.00	7,686,000	
キャリアリンク	3,100	2,567.00	7,957,700	
ＩＢＪ	12,000	615.00	7,380,000	
アサンテ	4,600	1,650.00	7,590,000	

バリューＨＲ	5,900	1,838.00	10,844,200	
M&Aキャピタルパートナーズ	5,300	2,499.00	13,244,700	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,900	998.00	7,884,200	
シグマクシス・ホールディングス	9,600	1,848.00	17,740,800	
ウィルグループ	8,100	964.00	7,808,400	
メドピア	14,200	498.00	7,071,600	
リクルートホールディングス	516,100	9,565.00	4,936,496,500	
エラン	9,200	719.00	6,614,800	
ツガミ	13,900	1,380.00	19,182,000	
オークマ	11,400	3,025.00	34,485,000	
芝浦機械	8,500	3,920.00	33,320,000	
アマダ	90,300	1,451.00	131,025,300	
アイダエンジニアリング	14,600	793.00	11,577,800	
ＦＵＪＩ	28,200	2,229.50	62,871,900	
牧野フライス製作所	7,200	6,360.00	45,792,000	
オーエスジー	28,600	1,782.00	50,965,200	
旭ダイヤモンド工業	16,200	816.00	13,219,200	
DMG森精機	41,000	2,665.50	109,285,500	
ソディック	17,100	724.00	12,380,400	
ディスコ	31,300	42,310.00	1,324,303,000	
日東工器	3,100	2,699.00	8,366,900	
日進工具	10,800	762.00	8,229,600	
日本郵政	740,900	1,472.50	1,090,975,250	
ベルシステム２４ホールディングス	7,100	1,285.00	9,123,500	
鎌倉新書	15,200	521.00	7,919,200	
ストライク	3,300	3,790.00	12,507,000	
ソラスト	18,200	472.00	8,590,400	
インソース	14,400	1,020.00	14,688,000	
豊田自動織機	54,900	11,555.00	634,369,500	
リケンＮＰＲ	8,200	2,422.00	19,860,400	
島精機製作所	10,300	1,084.00	11,165,200	
オプトラン	10,700	1,859.00	19,891,300	
イワキ	4,300	2,750.00	11,825,000	
フリュー	7,200	1,132.00	8,150,400	
日阪製作所	8,000	964.00	7,712,000	
やまびこ	10,600	2,521.00	26,722,600	
野村マイクロ・サイエンス	10,700	1,848.00	19,773,600	
平田機工	3,100	5,160.00	15,996,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	17,600	445.00	7,832,000	
タツモ	4,600	2,797.00	12,866,200	
ナブテスコ	40,800	2,376.00	96,940,800	
三井海洋開発	8,200	3,305.00	27,101,000	
レオン自動機	6,800	1,415.00	9,622,000	
ＳＭＣ	19,500	66,500.00	1,296,750,000	
ホソカワミクロン	4,500	3,930.00	17,685,000	
ユニオンツール	2,900	5,880.00	17,052,000	
オイレス工業	8,800	2,312.00	20,345,600	
日精エー・エス・ビー機械	2,200	5,190.00	11,418,000	
サトーホールディングス	8,100	2,129.00	17,244,900	

技研製作所	6,100	1,761.00	10,742,100	
日本エアーテック	6,600	1,245.00	8,217,000	
日精樹脂工業	8,400	951.00	7,988,400	
ワイエイシイホールディングス	700	1,960.00	1,372,000	
小松製作所	328,100	4,075.00	1,337,007,500	
住友重機械工業	38,400	3,227.00	123,916,800	
日立建機	25,900	3,371.00	87,308,900	
日工	11,400	705.00	8,037,000	
巴工業	2,500	3,870.00	9,675,000	
井関農機	7,900	970.00	7,663,000	
ＴＯＷＡ	19,900	1,610.00	32,039,000	
北川鉄工所	6,400	1,215.00	7,776,000	
ローツェ	34,000	1,808.00	61,472,000	
クボタ	339,800	1,921.00	652,755,800	
荏原実業	3,100	4,405.00	13,655,500	
三菱化工機	2,300	3,240.00	7,452,000	
月島ホールディングス	8,800	1,471.00	12,944,800	
帝国電機製作所	4,400	2,740.00	12,056,000	
新東工業	14,400	960.00	13,824,000	
澁谷工業	6,100	3,955.00	24,125,500	
アイチコーポレーション	10,800	1,190.00	12,852,000	
小森コーポレーション	16,000	1,125.00	18,000,000	
鶴見製作所	5,000	3,670.00	18,350,000	
酒井重工業	3,400	2,426.00	8,248,400	
荏原製作所	133,400	2,322.00	309,754,800	
酉島製作所	5,600	2,454.00	13,742,400	
北越工業	6,500	1,723.00	11,199,500	
ダイキン工業	84,600	18,305.00	1,548,603,000	
オルガノ	10,000	8,530.00	85,300,000	
トーヨーカネツ	2,400	4,095.00	9,828,000	
栗田工業	36,400	6,069.00	220,911,600	
椿本チエイン	29,400	1,898.00	55,801,200	
日機装	16,600	996.00	16,533,600	
レイズネクスト	9,100	1,480.00	13,468,000	
アネスト岩田	11,000	1,494.00	16,434,000	
ダイフク	109,700	3,228.00	354,111,600	
タダノ	37,400	1,167.00	43,645,800	
フジテック	20,900	5,837.00	121,993,300	
ＣＫＤ	18,000	2,564.00	46,152,000	
平和	21,600	2,113.00	45,640,800	
理想科学工業	5,200	3,545.00	18,434,000	
ＳＡＮＫＹＯ	75,100	2,130.50	160,000,550	
日本金銭機械	8,700	1,017.00	8,847,900	
マースグループホールディングス	4,400	3,290.00	14,476,000	
フクシマガリレイ	4,800	5,280.00	25,344,000	
ダイコク電機	2,800	3,390.00	9,492,000	
竹内製作所	11,800	4,830.00	56,994,000	
アマノ	18,400	4,256.00	78,310,400	
ジャノメ	8,700	1,028.00	8,943,600	
ブラザー工業	86,800	2,706.50	234,924,200	

マックス	8,000	3,355.00	26,840,000	
モリタホールディングス	10,200	2,071.00	21,124,200	
グローリー	17,000	2,599.00	44,183,000	
新晃工業	6,500	4,005.00	26,032,500	
大和冷機工業	10,000	1,455.00	14,550,000	
セガサミーホールディングス	58,000	2,686.00	155,788,000	
ＴＰＲ	8,300	2,423.00	20,110,900	
ツバキ・ナカシマ	16,000	527.00	8,432,000	
ホシザキ	41,800	6,010.00	251,218,000	
大豊工業	12,600	603.00	7,597,800	
日本精工	120,300	670.40	80,649,120	
ＮＴＮ	153,800	243.40	37,434,920	
ジェイテクト	57,800	1,070.00	61,846,000	
不二越	4,800	3,185.00	15,288,000	
ミネベアミツミ	113,100	2,509.50	283,824,450	
日本トムソン	17,600	475.00	8,360,000	
ＴＨＫ	37,500	3,437.00	128,887,500	
ユーシン精機	12,000	661.00	7,932,000	
前澤給装工業	6,300	1,307.00	8,234,100	
イーグル工業	7,200	1,978.00	14,241,600	
ＰＩＬＬＡＲ	6,000	4,690.00	28,140,000	
キッツ	21,800	1,102.00	24,023,600	
日立製作所	1,673,600	3,816.00	6,386,457,600	
三菱電機	661,100	2,621.00	1,732,743,100	
富士電機	39,500	8,511.00	336,184,500	
安川電機	70,600	4,170.00	294,402,000	
シンフォニア　テクノロジー	6,500	6,080.00	39,520,000	
明電舎	11,000	4,180.00	45,980,000	
山洋電気	2,800	8,340.00	23,352,000	
デンヨー	5,000	2,625.00	13,125,000	
ＰＨＣホールディングス	12,200	958.00	11,687,600	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	45,400	2,277.00	103,375,800	
ソシオネクスト	64,800	2,426.50	157,237,200	
ベイカレント	48,600	5,542.00	269,341,200	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,200	862.00	7,930,400	
アイモバイル	15,700	514.00	8,069,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	25,700	2,730.00	70,161,000	
ミダックホールディングス	4,400	1,662.00	7,312,800	
キュービーネットホールディングス	7,800	1,006.00	7,846,800	
オープングループ	41,200	210.00	8,652,000	
三櫻工業	10,900	756.00	8,240,400	
マキタ	80,900	4,672.00	377,964,800	
東芝テック	9,700	3,615.00	35,065,500	
芝浦メカトロニクス	4,700	8,300.00	39,010,000	
マブチモーター	28,500	2,215.50	63,141,750	
ニデック	287,000	2,916.50	837,035,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	21,400	348.00	7,447,200	
トレックス・セミコンダクター	5,200	1,293.00	6,723,600	

東光高岳	3,500	2,012.00	7,042,000	
ダイヘン	6,200	7,160.00	44,392,000	
ヤーマン	12,600	756.00	9,525,600	
ＪＶＣケンウッド	51,300	1,485.00	76,180,500	
大崎電気工業	13,900	799.00	11,106,100	
オムロン	59,600	5,099.00	303,900,400	
日東工業	8,800	2,926.00	25,748,800	
ＩＤＥＣ	9,600	2,498.00	23,980,800	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	29,000	2,701.00	78,329,000	
メルコホールディングス	3,300	2,206.00	7,279,800	
テクノメディカ	4,400	1,820.00	8,008,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	12,900	560.00	7,224,000	
日本電気	91,900	12,360.00	1,135,884,000	
富士通	598,100	2,793.00	1,670,493,300	
沖電気工業	31,500	953.00	30,019,500	
電気興業	4,000	1,739.00	6,956,000	
サンケン電気	6,600	5,730.00	37,818,000	
アイホン	3,900	2,782.00	10,849,800	
ルネサスエレクトロニクス	495,200	2,028.50	1,004,513,200	
セイコーエプソン	83,400	2,680.00	223,512,000	
ワコム	45,700	693.00	31,670,100	
アルバック	14,300	6,264.00	89,575,200	
ＥＩＺＯ	8,500	2,218.00	18,853,000	
日本信号	14,800	901.00	13,334,800	
京三製作所	15,100	530.00	8,003,000	
能美防災	8,800	2,960.00	26,048,000	
ホーチキ	4,200	2,419.00	10,159,800	
エレコム	15,500	1,445.00	22,397,500	
パナソニック　ホールディングス	767,800	1,524.50	1,170,511,100	
シャープ	93,900	1,012.00	95,026,800	
アンリツ	45,800	1,162.50	53,242,500	
富士通ゼネラル	18,400	2,021.00	37,186,400	
ソニーグループ	2,253,500	3,018.00	6,801,063,000	
ＴＤＫ	561,300	1,918.50	1,076,854,050	
帝国通信工業	3,000	3,030.00	9,090,000	
タムラ製作所	25,900	514.00	13,312,600	
アルプスアルパイン	52,800	1,534.00	80,995,200	
メイコー	6,500	8,720.00	56,680,000	
フォスター電機	6,600	1,819.00	12,005,400	
ＳＭＫ	3,200	2,350.00	7,520,000	
ヨコオ	5,700	1,519.00	8,658,300	
ホシデン	16,300	2,266.00	36,935,800	
ヒロセ電機	9,400	17,715.00	166,521,000	
日本航空電子工業	16,900	2,690.00	45,461,000	
ＴＯＡ	8,100	921.00	7,460,100	
マクセル	13,200	1,700.00	22,440,000	
古野電気	7,700	2,799.00	21,552,300	
スミダコーポレーション	8,800	943.00	8,298,400	
アイコム	2,700	2,749.00	7,422,300	

リオン	3,500	2,401.00	8,403,500	
横河電機	71,100	3,400.00	241,740,000	
新電元工業	3,300	2,530.00	8,349,000	
アズビル	177,100	1,219.50	215,973,450	
日本光電工業	57,600	2,184.50	125,827,200	
チノー	3,600	2,216.00	7,977,600	
日本電子材料	4,000	2,038.00	8,152,000	
堀場製作所	12,200	8,103.00	98,856,600	
アドバンテスト	202,800	9,541.00	1,934,914,800	
エスペック	5,700	2,661.00	15,167,700	
キーエンス	64,400	64,880.00	4,178,272,000	
日置電機	3,400	7,920.00	26,928,000	
シスメックス	166,600	3,072.00	511,795,200	
日本マイクロニクス	10,600	3,710.00	39,326,000	
メガチップス	5,000	5,580.00	27,900,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	4,000	4,050.00	16,200,000	
デンソー	682,600	2,294.00	1,565,884,400	
コーセル	6,900	1,181.00	8,148,900	
イリソ電子工業	6,500	2,650.00	17,225,000	
オプテックスグループ	11,800	1,722.00	20,319,600	
千代田インテグレ	2,300	3,505.00	8,061,500	
レーザーテック	29,500	17,420.00	513,890,000	
スタンレー電気	40,300	2,588.50	104,316,550	
ウシオ電機	28,500	2,075.00	59,137,500	
日本セラミック	5,900	2,659.00	15,688,100	
古河電池	5,100	1,368.00	6,976,800	
山一電機	5,300	2,580.00	13,674,000	
図研	5,900	4,230.00	24,957,000	
日本電子	14,900	5,695.00	84,855,500	
カシオ計算機	51,500	1,082.50	55,748,750	
ファナック	311,400	4,072.00	1,268,020,800	
日本シイエムケイ	19,400	452.00	8,768,800	
エンプラス	1,900	5,390.00	10,241,000	
大真空	13,200	526.00	6,943,200	
ローム	116,600	1,448.50	168,895,100	
浜松ホトニクス	103,300	1,745.00	180,258,500	
三井ハイテック	28,500	768.00	21,888,000	
新光電気工業	22,800	5,220.00	119,016,000	
京セラ	399,800	1,473.00	588,905,400	
太陽誘電	28,200	2,153.50	60,728,700	
村田製作所	574,800	2,561.00	1,472,062,800	
双葉電子工業	15,600	469.00	7,316,400	
日東電工	204,100	2,463.50	502,800,350	
東海理化電機製作所	18,100	2,117.00	38,317,700	
ニチコン	16,900	1,079.00	18,235,100	
ＫＯＡ	10,700	1,003.00	10,732,100	
三井Ｅ＆Ｓ	34,700	1,558.00	54,062,600	
カナデビア	53,200	940.00	50,008,000	
三菱重工業	1,136,600	2,384.00	2,709,654,400	
川崎重工業	48,500	6,411.00	310,933,500	

ＩＨＩ	52,100	9,079.00	473,015,900	
名村造船所	18,400	1,738.00	31,979,200	
プロレド・パートナーズ	16,400	472.00	7,740,800	
アンビスホールディングス	14,200	976.00	13,859,200	
カーブスホールディングス	18,100	781.00	14,136,100	
フォーラムエンジニアリング	8,900	972.00	8,650,800	
日本車輌製造	3,600	2,267.00	8,161,200	
三菱ロジスネクスト	10,300	1,294.00	13,328,200	
フルサト・マルカホールディングス	5,400	2,241.00	12,101,400	
ヤマエグループホールディングス	7,300	2,137.00	15,600,100	
ＦＰＧ	22,700	2,988.00	67,827,600	
じもとホールディングス	100	296.00	29,600	
全国保証	16,600	5,415.00	89,889,000	
めぶきフィナンシャルグループ	318,200	652.50	207,625,500	
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,300	1,121.00	11,546,300	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	8,200	4,055.00	33,251,000	
九州フィナンシャルグループ	111,600	716.00	79,905,600	
かんぽ生命保険	73,800	3,075.00	226,935,000	
ゆうちょ銀行	522,400	1,452.50	758,786,000	
富山第一銀行	20,200	1,079.00	21,795,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	337,200	868.00	292,689,600	
ジェイリース	5,600	1,313.00	7,352,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	39,100	1,978.00	77,339,800	
ＳＢＩアルヒ	9,800	820.00	8,036,000	
プレミアグループ	10,700	2,518.00	26,942,600	
日産自動車	846,700	419.40	355,105,980	
いすゞ自動車	198,800	1,973.00	392,232,400	
トヨタ自動車	3,420,800	2,698.50	9,231,028,800	
日野自動車	96,800	413.00	39,978,400	
三菱自動車工業	251,000	447.10	112,222,100	
武蔵精密工業	15,800	3,425.00	54,115,000	
日産車体	9,800	1,088.00	10,662,400	
新明和工業	18,500	1,320.00	24,420,000	
極東開発工業	8,700	2,286.00	19,888,200	
トピー工業	5,200	1,896.00	9,859,200	
ティラド	2,300	3,455.00	7,946,500	
タチエス	11,900	1,719.00	20,456,100	
ＮＯＫ	25,000	2,278.00	56,950,000	
フタバ産業	19,400	646.00	12,532,400	
カヤバ	5,500	5,040.00	27,720,000	
市光工業	17,800	432.00	7,689,600	
大同メタル工業	15,600	481.00	7,503,600	
プレス工業	25,200	548.00	13,809,600	
太平洋工業	14,800	1,346.00	19,920,800	
アイシン	136,300	1,628.00	221,896,400	
マツダ	197,600	1,006.00	198,785,600	
本田技研工業	1,524,700	1,364.50	2,080,453,150	

スズキ	520,000	1,656.50	861,380,000	
ＳＵＢＡＲＵ	199,600	2,486.50	496,305,400	
ヤマハ発動機	271,700	1,358.00	368,968,600	
小糸製作所	66,700	1,967.50	131,232,250	
エクセディ	10,500	4,410.00	46,305,000	
ミツバ	12,100	836.00	10,115,600	
豊田合成	18,400	2,553.50	46,984,400	
愛三工業	12,200	1,438.00	17,543,600	
ヨロズ	2,100	1,178.00	2,473,800	
エフ・シー・シー	11,300	3,065.00	34,634,500	
シマノ	28,000	20,655.00	578,340,000	
テイ・エス　テック	26,200	1,706.00	44,697,200	
三十三フィナンシャルグループ	5,700	2,012.00	11,468,400	
第四北越フィナンシャルグループ	20,000	2,714.00	54,280,000	
ひろぎんホールディングス	89,200	1,139.50	101,643,400	
おきなわフィナンシャルグループ	5,000	2,430.00	12,150,000	
ダイレクトマーケティングミックス	16,100	285.00	4,588,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	7,200	929.00	6,688,800	
十六フィナンシャルグループ	8,900	4,225.00	37,602,500	
北國フィナンシャルホールディングス	6,200	5,030.00	31,186,000	
ネットプロテクションズホールディングス	13,700	440.00	6,028,000	
プロクレアホールディングス	7,300	1,806.00	13,183,800	
ＦＰパートナー	2,800	2,977.00	8,335,600	
あいちフィナンシャルグループ	11,900	2,388.00	28,417,200	
ジャムコ	6,300	1,359.00	8,561,700	
小野建	7,500	1,443.00	10,822,500	
ノジマ	22,200	2,282.00	50,660,400	
佐鳥電機	4,800	1,859.00	8,923,200	
カッパ・クリエイト	10,700	1,573.00	16,831,100	
伯東	3,900	4,465.00	17,413,500	
コンドーテック	6,300	1,375.00	8,662,500	
ナガイレーベン	8,600	2,181.00	18,756,600	
三菱食品	6,300	4,840.00	30,492,000	
良品計画	81,100	3,023.00	245,165,300	
松田産業	5,200	3,005.00	15,626,000	
第一興商	26,300	1,870.00	49,181,000	
メディパルホールディングス	73,900	2,462.50	181,978,750	
アドヴァングループ	8,600	934.00	8,032,400	
ＳＰＫ	3,900	2,026.00	7,901,400	
萩原電気ホールディングス	2,900	3,265.00	9,468,500	
アルビス	2,900	2,625.00	7,612,500	
アズワン	21,100	2,792.00	58,911,200	
スズデン	4,400	1,794.00	7,893,600	
シモジマ	6,000	1,284.00	7,704,000	
ドウシシャ	6,300	2,123.00	13,374,900	
高速	4,000	2,422.00	9,688,000	
Ｇ－７ホールディングス	7,400	1,449.00	10,722,600	
イオン北海道	16,800	865.00	14,532,000	
コジマ	13,100	1,037.00	13,584,700	

コーナン商事	7,500	3,610.00	27,075,000	
ネットワンシステムズ	27,100	4,492.00	121,733,200	
エコス	3,800	2,035.00	7,733,000	
ワタミ	8,200	1,017.00	8,339,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	137,500	3,733.00	513,287,500	
丸文	7,600	1,060.00	8,056,000	
西松屋チェーン	15,100	2,217.00	33,476,700	
ゼンショーホールディングス	38,700	9,092.00	351,860,400	
ハピネット	5,200	4,060.00	21,112,000	
橋本総業ホールディングス	6,400	1,161.00	7,430,400	
日本ライフライン	18,200	1,264.00	23,004,800	
サイゼリヤ	10,100	5,260.00	53,126,000	
タカショー	16,000	478.00	7,648,000	
ＶＴホールディングス	26,500	458.00	12,137,000	
アルゴグラフィックス	5,900	5,100.00	30,090,000	
魚力	3,200	2,389.00	7,644,800	
ＩＤＯＭ	23,100	1,064.00	24,578,400	
フジ・コーポレーション	4,300	1,933.00	8,311,900	
ユナイテッドアローズ	7,300	2,378.00	17,359,400	
進和	4,200	2,859.00	12,007,800	
ダイトロン	3,000	2,789.00	8,367,000	
ハイデイ日高	11,000	2,755.00	30,305,000	
シークス	9,700	1,132.00	10,980,400	
コロワイド	38,400	1,714.50	65,836,800	
オーハシテクニカ	4,600	1,923.00	8,845,800	
壱番屋	26,900	1,010.00	27,169,000	
白銅	3,300	2,308.00	7,616,400	
スギホールディングス	36,600	2,542.00	93,037,200	
薬王堂ホールディングス	3,700	2,040.00	7,548,000	
島津製作所	92,600	4,270.00	395,402,000	
ＪＭＳ	16,600	446.00	7,403,600	
長野計器	4,200	2,577.00	10,823,400	
ブイ・テクノロジー	700	2,158.00	1,510,600	
スター精密	11,000	1,854.00	20,394,000	
東京計器	4,500	3,745.00	16,852,500	
愛知時計電機	4,000	1,984.00	7,936,000	
インターアクション	7,300	1,006.00	7,343,800	
東京精密	13,200	7,714.00	101,824,800	
マニー	25,700	1,765.00	45,360,500	
ニコン	101,500	1,891.50	191,987,250	
トプコン	36,500	1,522.00	55,553,000	
オリンパス	368,400	2,517.50	927,447,000	
理研計器	9,100	3,765.00	34,261,500	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	26,900	9,227.00	248,206,300	
キヤノン電子	6,100	2,511.00	15,317,100	
タムロン	8,900	4,420.00	39,338,000	
ＨＯＹＡ	126,700	19,920.00	2,523,864,000	
ノーリツ鋼機	6,100	4,140.00	25,254,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	8,000	1,970.00	15,760,000	

朝日インテック	78,400	2,559.50	200,664,800	
キヤノン	321,000	4,994.00	1,603,074,000	
リコー	169,500	1,637.00	277,471,500	
シチズン時計	59,200	902.00	53,398,400	
メニコン	24,000	1,604.00	38,496,000	
パラマウントベッドホールディングス	14,900	2,548.00	37,965,200	
トランザクション	4,200	2,286.00	9,601,200	
ニホンフラッシュ	9,000	855.00	7,695,000	
前田工繊	11,500	1,864.00	21,436,000	
アートネイチャー	6,800	843.00	5,732,400	
フルヤ金属	6,100	3,500.00	21,350,000	
バンダイナムコホールディングス	174,700	3,131.00	546,985,700	
ＳＨＯＥＩ	18,100	2,368.00	42,860,800	
フランスベッドホールディングス	9,200	1,231.00	11,325,200	
マーベラス	13,600	581.00	7,901,600	
パイロットコーポレーション	10,100	4,938.00	49,873,800	
エイベックス	12,100	1,506.00	18,222,600	
フジシールインターナショナル	14,500	2,423.00	35,133,500	
タカラトミー	27,000	4,104.00	110,808,000	
広済堂ホールディングス	24,300	454.00	11,032,200	
レック	8,300	1,206.00	10,009,800	
プロネクサス	6,700	1,270.00	8,509,000	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	84,400	4,078.00	344,183,200	
大日本印刷	133,400	2,395.00	319,493,000	
共同印刷	2,300	4,010.00	9,223,000	
ＮＩＳＳＨＡ	11,000	1,673.00	18,403,000	
ＺＡＣＲＯＳ	5,100	4,035.00	20,578,500	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,800	2,650.00	10,070,000	
前澤化成工業	4,500	1,795.00	8,077,500	
未来工業	2,300	3,720.00	8,556,000	
アシックス	237,600	2,901.00	689,277,600	
ツツミ	3,700	2,090.00	7,733,000	
ＪＳＰ	5,300	2,055.00	10,891,500	
ニチハ	8,100	2,946.00	23,862,600	
ローランド	4,700	3,995.00	18,776,500	
エフピコ	14,200	2,574.00	36,550,800	
ヤマハ	117,600	1,092.50	128,478,000	
クリナップ	11,400	695.00	7,923,000	
ピジョン	41,000	1,452.50	59,552,500	
天馬	5,400	3,005.00	16,227,000	
キングジム	9,200	847.00	7,792,400	
象印マホービン	19,200	1,633.00	31,353,600	
リンテック	12,900	3,060.00	39,474,000	
信越ポリマー	13,900	1,639.00	22,782,100	
イトーキ	12,800	1,599.00	20,467,200	
任天堂	406,300	8,226.00	3,342,223,800	
三菱鉛筆	8,900	2,526.00	22,481,400	
松風	6,500	2,067.00	13,435,500	
タカラスタンダード	14,800	1,644.00	24,331,200	
コクヨ	32,200	2,814.50	90,626,900	

ナカバヤシ	15,200	514.00	7,812,800	
ニフコ	24,100	3,681.00	88,712,100	
グローブライド	6,400	1,913.00	12,243,200	
オカムラ	19,400	1,972.00	38,256,800	
バルカー	4,900	3,305.00	16,194,500	
伊藤忠商事	457,700	7,697.00	3,522,916,900	
丸紅	564,800	2,398.50	1,354,672,800	
スクロール	10,100	1,056.00	10,665,600	
ヨンドシーホールディングス	6,400	1,812.00	11,596,800	
三陽商会	3,300	2,650.00	8,745,000	
長瀬産業	30,400	3,185.00	96,824,000	
蝶理	3,700	3,895.00	14,411,500	
豊田通商	204,500	2,702.50	552,661,250	
オンワードホールディングス	41,800	517.00	21,610,600	
三共生興	13,400	575.00	7,705,000	
兼松	28,500	2,750.00	78,375,000	
美津濃	6,400	7,670.00	49,088,000	
三井物産	1,019,900	3,276.00	3,341,192,400	
日本紙パルプ商事	32,500	638.00	20,735,000	
東京エレクトロン	136,200	21,870.00	2,978,694,000	
カメイ	7,200	1,852.00	13,334,400	
スターゼン	4,700	2,787.00	13,098,900	
セイコーグループ	10,000	4,335.00	43,350,000	
山善	22,900	1,300.00	29,770,000	
椿本興業	4,200	1,892.00	7,946,400	
住友商事	408,000	3,258.00	1,329,264,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	21,800	4,328.00	94,350,400	
内田洋行	2,800	6,800.00	19,040,000	
三菱商事	1,307,300	2,661.50	3,479,378,950	
第一実業	6,400	2,504.00	16,025,600	
キヤノンマーケティングジャパン	13,400	4,750.00	63,650,000	
西華産業	3,300	4,830.00	15,939,000	
佐藤商事	5,700	1,410.00	8,037,000	
東京産業	11,400	707.00	8,059,800	
ユアサ商事	5,800	4,505.00	26,129,000	
神鋼商事	1,500	6,040.00	9,060,000	
阪和興業	11,200	5,000.00	56,000,000	
正栄食品工業	4,500	4,435.00	19,957,500	
カナデン	5,300	1,450.00	7,685,000	
ＲＹＯＤＥＮ	5,500	2,305.00	12,677,500	
ニプロ	53,600	1,382.50	74,102,000	
岩谷産業	67,600	1,908.00	128,980,800	
極東貿易	5,400	1,600.00	8,640,000	
三愛オブリ	15,900	1,987.00	31,593,300	
稲畑産業	18,400	3,425.00	63,020,000	
ＧＳＩクレオス	3,900	2,078.00	8,104,200	
明和産業	12,300	645.00	7,933,500	
ゴールドウイン	11,400	8,415.00	95,931,000	
ユニ・チャーム	134,500	3,782.00	508,679,000	
デサント	11,100	4,330.00	48,063,000	

ワキタ	10,000	1,565.00	15,650,000	
ヤマトインターナショナル	10,200	322.00	3,284,400	
東邦ホールディングス	18,400	4,213.00	77,519,200	
サンゲツ	17,100	2,923.00	49,983,300	
ミツウロコグループホールディングス	8,700	1,663.00	14,468,100	
シナネンホールディングス	1,900	6,350.00	12,065,000	
伊藤忠エネクス	16,900	1,606.00	27,141,400	
サンリオ	55,300	4,881.00	269,919,300	
サンワ　テクノス	4,100	2,166.00	8,880,600	
新光商事	9,100	980.00	8,918,000	
トーホー	2,900	2,773.00	8,041,700	
三信電気	3,900	1,902.00	7,417,800	
東陽テクニカ	6,300	1,485.00	9,355,500	
モスフードサービス	10,000	3,650.00	36,500,000	
加賀電子	13,800	2,749.00	37,936,200	
都築電気	3,900	2,450.00	9,555,000	
立花エレテック	4,100	2,601.00	10,664,100	
木曽路	10,300	2,115.00	21,784,500	
ＳＲＳホールディングス	11,200	1,121.00	12,555,200	
リテールパートナーズ	10,100	1,225.00	12,372,500	
上新電機	6,700	2,349.00	15,738,300	
日本瓦斯	32,600	2,070.00	67,482,000	
ロイヤルホールディングス	12,000	2,462.00	29,544,000	
いなげや	6,900	1,155.00	7,969,500	
チヨダ	6,500	1,407.00	9,145,500	
ライフコーポレーション	7,100	3,380.00	23,998,000	
リンガーハット	8,800	2,200.00	19,360,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	11,500	669.00	7,693,500	
ＡＯＫＩホールディングス	14,600	1,231.00	17,972,600	
オークワ	10,900	885.00	9,646,500	
コメリ	9,200	3,250.00	29,900,000	
青山商事	14,600	2,113.00	30,849,800	
しまむら	16,000	8,009.00	128,144,000	
高島屋	94,600	1,210.00	114,466,000	
松屋	11,500	868.00	9,982,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	33,100	2,019.50	66,845,450	
近鉄百貨店	3,900	2,060.00	8,034,000	
丸井グループ	45,200	2,412.50	109,045,000	
クレディセゾン	40,200	3,440.00	138,288,000	
アクシアル　リテイリング	18,600	903.00	16,795,800	
イオン	251,800	3,734.00	940,221,200	
イズミ	10,300	3,149.00	32,434,700	
平和堂	11,400	2,200.00	25,080,000	
フジ	12,500	2,052.00	25,650,000	
ヤオコー	8,100	9,420.00	76,302,000	
ゼビオホールディングス	9,200	1,077.00	9,908,400	
ケーズホールディングス	45,700	1,409.50	64,414,150	
ＰＡＬＴＡＣ	10,600	4,321.00	45,802,600	
三谷産業	24,800	317.00	7,861,600	
あおぞら銀行	43,800	2,468.00	108,098,400	

三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,156,600	1,816.00	7,548,385,600	
りそなホールディングス	782,800	1,220.50	955,407,400	
三井住友トラストグループ	225,700	3,645.00	822,676,500	
三井住友フィナンシャルグループ	1,322,200	3,615.00	4,779,753,000	
千葉銀行	196,300	1,189.50	233,498,850	
群馬銀行	112,800	1,016.00	114,604,800	
武蔵野銀行	9,700	2,809.00	27,247,300	
千葉興業銀行	15,000	1,251.00	18,765,000	
七十七銀行	20,300	4,346.00	88,223,800	
秋田銀行	4,300	2,072.00	8,909,600	
山形銀行	8,100	952.00	7,711,200	
岩手銀行	4,100	2,645.00	10,844,500	
東邦銀行	54,700	270.00	14,769,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	55,200	4,093.00	225,933,600	
スルガ銀行	42,700	1,004.00	42,870,800	
八十二銀行	148,400	987.00	146,470,800	
山梨中央銀行	7,100	1,760.00	12,496,000	
大垣共立銀行	12,100	1,855.00	22,445,500	
福井銀行	5,700	1,828.00	10,419,600	
清水銀行	5,600	1,468.00	8,220,800	
滋賀銀行	9,600	3,500.00	33,600,000	
南都銀行	9,600	3,065.00	29,424,000	
百五銀行	59,700	589.00	35,163,300	
紀陽銀行	22,700	2,057.00	46,693,900	
ほくほくフィナンシャルグループ	35,700	1,746.00	62,332,200	
山陰合同銀行	39,700	1,209.00	47,997,300	
百十四銀行	6,300	3,005.00	18,931,500	
四国銀行	9,300	1,060.00	9,858,000	
阿波銀行	8,900	2,809.00	25,000,100	
大分銀行	3,900	3,135.00	12,226,500	
宮崎銀行	4,200	2,928.00	12,297,600	
佐賀銀行	3,900	2,127.00	8,295,300	
琉球銀行	14,600	1,003.00	14,643,800	
セブン銀行	227,100	336.00	76,305,600	
みずほフィナンシャルグループ	855,500	3,798.00	3,249,189,000	
山口フィナンシャルグループ	62,200	1,583.00	98,462,600	
芙蓉総合リース	5,800	11,090.00	64,322,000	
みずほリース	47,600	1,028.00	48,932,800	
東京センチュリー	47,400	1,480.00	70,152,000	
ＳＢＩホールディングス	102,000	3,553.00	362,406,000	
日本証券金融	23,300	2,044.00	47,625,200	
アイフル	105,000	325.00	34,125,000	
名古屋銀行	4,000	6,210.00	24,840,000	
北洋銀行	86,500	428.00	37,022,000	
愛媛銀行	9,300	1,027.00	9,551,100	
京葉銀行	28,500	768.00	21,888,000	
栃木銀行	29,900	267.00	7,983,300	
北日本銀行	3,200	2,730.00	8,736,000	
リコーリース	6,000	5,100.00	30,600,000	
イオンフィナンシャルサービス	36,400	1,243.50	45,263,400	

アコム	150,800	393.60	59,354,880	
ジャックス	7,600	3,785.00	28,766,000	
オリエントコーポレーション	20,700	835.00	17,284,500	
オリックス	380,100	3,315.00	1,260,031,500	
三菱ＨＣキャピタル	317,700	1,022.00	324,689,400	
ジャフコ　グループ	18,900	2,033.00	38,423,700	
トモニホールディングス	60,600	443.00	26,845,800	
大和証券グループ本社	453,200	1,010.00	457,732,000	
野村ホールディングス	1,065,800	932.90	994,284,820	
岡三証券グループ	50,100	629.00	31,512,900	
丸三証券	21,100	979.00	20,656,900	
東洋証券	18,900	596.00	11,264,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	75,200	469.00	35,268,800	
光世証券	400	424.00	169,600	
水戸証券	17,400	549.00	9,552,600	
いちよし証券	12,800	859.00	10,995,200	
松井証券	43,700	831.00	36,314,700	
ＳＯＭＰＯホールディングス	309,900	3,971.00	1,230,612,900	
日本取引所グループ	377,100	1,810.00	682,551,000	
マネックスグループ	62,100	998.00	61,975,800	
極東証券	7,900	1,341.00	10,593,900	
岩井コスモホールディングス	7,300	2,257.00	16,476,100	
アイザワ証券グループ	9,100	1,695.00	15,424,500	
フィデアホールディングス	6,600	1,394.00	9,200,400	
池田泉州ホールディングス	88,000	358.00	31,504,000	
アニコム　ホールディングス	21,500	658.00	14,147,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	464,500	3,518.00	1,634,111,000	
スパークス・グループ	7,100	1,374.00	9,755,400	
第一生命ホールディングス	298,100	3,840.00	1,144,704,000	
東京海上ホールディングス	618,800	5,631.00	3,484,462,800	
イー・ギャランティ	10,300	1,574.00	16,212,200	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,100	3,730.00	11,563,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	170,200	2,427.50	413,160,500	
アドバンスクリエイト	4,000	710.00	2,840,000	
三井不動産	879,600	1,258.50	1,106,976,600	
三菱地所	367,100	2,105.00	772,745,500	
平和不動産	10,300	4,100.00	42,230,000	
東京建物	55,400	2,640.50	146,283,700	
京阪神ビルディング	10,700	1,559.00	16,681,300	
住友不動産	103,100	4,683.00	482,817,300	
テーオーシー	12,900	607.00	7,830,300	
レオパレス２１	55,500	515.00	28,582,500	
スターツコーポレーション	10,400	3,705.00	38,532,000	
フジ住宅	11,300	754.00	8,520,200	
空港施設	13,700	578.00	7,918,600	
ゴールドクレスト	4,300	2,900.00	12,470,000	
リログループ	36,800	1,693.50	62,320,800	
エスリード	3,000	4,395.00	13,185,000	

日神グループホールディングス	15,800	503.00	7,947,400	
日本エスコン	16,600	995.00	16,517,000	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	37,100	496.00	18,401,600	
イオンモール	38,300	1,992.00	76,293,600	
カチタス	17,000	2,068.00	35,156,000	
東祥	11,700	638.00	7,464,600	
トーセイ	10,500	2,343.00	24,601,500	
サンフロンティア不動産	10,600	1,880.00	19,928,000	
ＦＪネクストホールディングス	5,900	1,124.00	6,631,600	
グランディハウス	14,200	556.00	7,895,200	
東武鉄道	67,800	2,550.00	172,890,000	
相鉄ホールディングス	21,300	2,509.50	53,452,350	
東急	180,400	1,896.50	342,128,600	
京浜急行電鉄	79,600	1,229.50	97,868,200	
小田急電鉄	106,400	1,546.50	164,547,600	
京王電鉄	34,000	4,082.00	138,788,000	
京成電鉄	37,300	3,899.00	145,432,700	
富士急行	7,900	2,374.00	18,754,600	
東日本旅客鉄道	354,900	2,873.00	1,019,627,700	
西日本旅客鉄道	164,400	2,794.50	459,415,800	
東海旅客鉄道	247,900	3,176.00	787,330,400	
西武ホールディングス	70,100	3,424.00	240,022,400	
鴻池運輸	11,000	2,751.00	30,261,000	
西日本鉄道	18,600	2,360.50	43,905,300	
ハマキョウレックス	22,000	1,232.00	27,104,000	
サカイ引越センター	8,100	2,383.00	19,302,300	
近鉄グループホールディングス	68,800	3,286.00	226,076,800	
阪急阪神ホールディングス	85,700	3,985.00	341,514,500	
南海電気鉄道	28,700	2,460.50	70,616,350	
京阪ホールディングス	35,400	3,558.00	125,953,200	
神戸電鉄	2,700	2,319.00	6,261,300	
名古屋鉄道	71,000	1,740.50	123,575,500	
山陽電気鉄道	4,800	2,020.00	9,696,000	
トランコム	2,000	10,250.00	20,500,000	
ヤマトホールディングス	78,100	1,661.00	129,724,100	
山九	15,500	5,269.00	81,669,500	
日新	4,400	4,325.00	19,030,000	
丸全昭和運輸	4,000	6,230.00	24,920,000	
センコーグループホールディングス	37,800	1,495.00	56,511,000	
トナミホールディングス	1,400	5,430.00	7,602,000	
ニッコンホールディングス	36,500	1,947.00	71,065,500	
福山通運	6,900	3,470.00	23,943,000	
セイノーホールディングス	31,600	2,483.00	78,462,800	
神奈川中央交通	2,400	3,570.00	8,568,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	19,900	1,070.00	21,293,000	
日本郵船	133,100	5,028.00	669,226,800	
商船三井	122,100	5,480.00	669,108,000	
川崎汽船	146,200	2,175.50	318,058,100	
ＮＳユナイテッド海運	4,000	4,000.00	16,000,000	
明海グループ	600	698.00	418,800	

飯野海運	23,600	1,166.00	27,517,600	
共栄タンカー	600	1,160.00	696,000	
九州旅客鉄道	49,200	3,914.00	192,568,800	
ＳＧホールディングス	107,900	1,442.50	155,645,750	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	23,000	7,340.00	168,820,000	
ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス	4,000	4,680.00	18,720,000	
日本航空	147,300	2,402.50	353,888,250	
ＡＮＡホールディングス	174,800	2,848.00	497,830,400	
パスコ	200	2,130.00	426,000	
ＴＲＥホールディングス	15,200	1,654.00	25,140,800	
人・夢・技術グループ	4,700	1,676.00	7,877,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4,200	1,926.00	8,089,200	
シルバーライフ	10,600	764.00	8,098,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,000	3,095.00	18,570,000	
ＫＰＰグループホールディングス	14,100	683.00	9,630,300	
ギフトホールディングス	3,400	3,505.00	11,917,000	
三菱倉庫	67,000	1,054.50	70,651,500	
三井倉庫ホールディングス	6,600	7,500.00	49,500,000	
住友倉庫	19,100	2,750.00	52,525,000	
澁澤倉庫	2,900	3,045.00	8,830,500	
ヤマタネ	2,700	3,435.00	9,274,500	
乾汽船	8,200	1,529.00	12,537,800	
日本トランスシティ	12,900	981.00	12,654,900	
中央倉庫	4,800	1,513.00	7,262,400	
安田倉庫	1,700	1,621.00	2,755,700	
大栄環境	14,400	3,045.00	43,848,000	
日本管財ホールディングス	6,900	2,532.00	17,470,800	
上組	29,700	3,485.00	103,504,500	
キユーソー流通システム	4,300	2,067.00	8,888,100	
エーアイテイー	4,500	1,766.00	7,947,000	
内外トランスライン	2,800	2,785.00	7,798,000	
日本コンセプト	4,400	1,768.00	7,779,200	
ＴＢＳホールディングス	32,500	3,728.00	121,160,000	
日本テレビホールディングス	57,100	2,270.50	129,645,550	
朝日放送グループホールディングス	12,800	609.00	7,795,200	
テレビ朝日ホールディングス	15,700	2,069.00	32,483,300	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	50,100	839.00	42,033,900	
テレビ東京ホールディングス	4,000	3,045.00	12,180,000	
ビジョン	9,700	1,365.00	13,240,500	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,200	4,940.00	35,568,000	
日本通信	20,000	137.00	2,740,000	
日本電信電話	19,197,600	155.90	2,992,905,840	
ＫＤＤＩ	474,700	4,984.00	2,365,904,800	
ソフトバンク	10,326,300	193.70	2,000,204,310	
光通信	7,500	32,840.00	246,300,000	
GMOインターネットグループ	21,000	2,598.50	54,568,500	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	34,100	4,346.00	148,198,600	
学研ホールディングス	11,800	998.00	11,776,400	

ゼンリン	11,000	815.00	8,965,000	
東京電力ホールディングス	541,400	572.10	309,734,940	
中部電力	237,100	1,659.50	393,467,450	
関西電力	271,100	1,886.00	511,294,600	
中国電力	111,800	1,018.00	113,812,400	
北陸電力	65,800	924.30	60,818,940	
東北電力	169,400	1,266.50	214,545,100	
四国電力	59,900	1,272.50	76,222,750	
九州電力	148,300	1,473.00	218,445,900	
北海道電力	67,400	862.00	58,098,800	
沖縄電力	16,400	985.00	16,154,000	
電源開発	48,500	2,598.00	126,003,000	
イーレックス	12,600	646.00	8,139,600	
レノバ	17,600	815.00	14,344,000	
東京瓦斯	125,300	4,315.00	540,669,500	
大阪瓦斯	128,200	3,159.00	404,983,800	
東邦瓦斯	25,300	3,841.00	97,177,300	
北海道瓦斯	19,200	536.00	10,291,200	
広島ガス	20,700	374.00	7,741,800	
西部ガスホールディングス	6,700	1,757.00	11,771,900	
静岡ガス	14,700	1,017.00	14,949,900	
メタウォーター	8,800	1,777.00	15,637,600	
M&A総研ホールディングス	7,100	2,154.00	15,293,400	
アイネット	5,000	1,648.00	8,240,000	
松竹	3,700	10,730.00	39,701,000	
東宝	40,400	6,113.00	246,965,200	
エイチ・アイ・エス	21,100	1,780.00	37,558,000	
東映	10,700	5,980.00	63,986,000	
ＮＴＴデータグループ	168,700	2,832.00	477,758,400	
共立メンテナンス	20,800	2,539.00	52,811,200	
イチネンホールディングス	6,400	1,887.00	12,076,800	
建設技術研究所	3,400	4,715.00	16,031,000	
スペース	6,800	1,097.00	7,459,600	
アインホールディングス	9,400	5,003.00	47,028,200	
燦ホールディングス	7,200	1,052.00	7,574,400	
ピー・シー・エー	4,200	1,958.00	8,223,600	
スバル興業	2,600	2,998.00	7,794,800	
ビジネスブレイン太田昭和	4,200	2,014.00	8,458,800	
ナガワ	1,800	6,620.00	11,916,000	
東京都競馬	4,800	4,200.00	20,160,000	
カナモト	10,300	2,739.00	28,211,700	
ＤＴＳ	11,700	3,995.00	46,741,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,400	6,042.00	195,760,800	
シーイーシー	8,100	2,070.00	16,767,000	
カプコン	128,300	3,382.00	433,910,600	
ニシオホールディングス	5,500	3,615.00	19,882,500	
アイ・エス・ビー	5,400	1,368.00	7,387,200	
日本空港ビルデング	22,400	5,409.00	121,161,600	
トランス・コスモス	8,400	3,450.00	28,980,000	

乃村工藝社	28,900	770.00	22,253,000	
ＳＣＳＫ	52,700	2,877.50	151,644,250	
藤田観光	2,900	8,930.00	25,897,000	
トーカイ	5,900	2,232.00	13,168,800	
セコム	134,700	5,145.00	693,031,500	
ＮＳＷ	2,900	3,010.00	8,729,000	
セントラル警備保障	3,600	2,757.00	9,925,200	
アイネス	5,000	1,675.00	8,375,000	
丹青社	14,000	815.00	11,410,000	
メイテックグループホールディングス	24,400	2,867.00	69,954,800	
ＴＫＣ	11,500	3,835.00	44,102,500	
富士ソフト	17,800	9,550.00	169,990,000	
応用地質	6,200	2,464.00	15,276,800	
船井総研ホールディングス	13,200	2,346.00	30,967,200	
ＮＳＤ	24,800	3,377.00	83,749,600	
コナミグループ	24,200	14,500.00	350,900,000	
学究社	4,100	1,941.00	7,958,100	
イオンディライト	7,100	4,395.00	31,204,500	
ナック	14,000	564.00	7,896,000	
福井コンピュータホールディングス	4,500	2,845.00	12,802,500	
ダイセキ	16,000	3,790.00	60,640,000	
ステップ	3,900	2,001.00	7,803,900	
泉州電業	4,700	5,520.00	25,944,000	
ＧＥＮＫＩ　ＧＬＯＢＡＬ　ＤＩＮＩＮＧ　ＣＯＮＣＥＰＴＳ	3,800	3,830.00	14,554,000	
トラスコ中山	14,300	2,210.00	31,603,000	
ヤマダホールディングス	209,400	466.10	97,601,340	
オートバックスセブン	23,700	1,431.00	33,914,700	
モリト	5,600	1,511.00	8,461,600	
アークランズ	20,300	1,679.00	34,083,700	
ニトリホールディングス	24,800	17,400.00	431,520,000	
ケーユーホールディングス	7,400	1,102.00	8,154,800	
吉野家ホールディングス	26,600	3,157.00	83,976,200	
加藤産業	8,400	4,365.00	36,666,000	
イノテック	5,400	1,395.00	7,533,000	
イエローハット	12,000	2,512.00	30,144,000	
松屋フーズホールディングス	3,200	6,570.00	21,024,000	
ＪＢＣＣホールディングス	4,300	4,840.00	20,812,000	
ＪＫホールディングス	7,600	1,018.00	7,736,800	
サガミホールディングス	10,900	1,717.00	18,715,300	
日伝	3,900	2,995.00	11,680,500	
ミロク情報サービス	5,900	1,876.00	11,068,400	
杉本商事	6,000	1,355.00	8,130,000	
因幡電機産業	19,000	3,821.00	72,599,000	
王将フードサービス	13,400	3,015.00	40,401,000	
ミニストップ	5,700	1,809.00	10,311,300	
アークス	11,400	2,506.00	28,568,400	
バローホールディングス	13,000	2,111.00	27,443,000	
東テク	6,800	2,465.00	16,762,000	
ミスミグループ本社	102,900	2,504.50	257,713,050	

ベルク	3,400	6,690.00	22,746,000	
大　庄	7,600	1,040.00	7,904,000	
ファーストリテイリング	38,300	49,660.00	1,901,978,000	
ソフトバンクグループ	318,400	8,646.00	2,752,886,400	
スズケン	22,400	4,850.00	108,640,000	
サンドラッグ	23,000	3,445.00	79,235,000	
ジェコス	9,000	967.00	8,703,000	
ベルーナ	16,400	726.00	11,906,400	
合計	121,062,800		248,879,736,050	

（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。

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年11月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	14,571,231
コール・ローン	511,291,331
国債証券	51,735,991,940
地方債証券	3,116,535,408
特殊債券	4,542,932,644
社債券	4,229,700,000
未収利息	143,930,367
前払費用	9,923,372
流動資産合計	64,304,876,293
資産合計	64,304,876,293
負債の部	
流動負債	
未払解約金	31,196,565
流動負債合計	31,196,565
負債合計	31,196,565
純資産の部	
元本等	
元本	70,686,765,017
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△6,413,085,289
元本等合計	64,273,679,728
純資産合計	64,273,679,728
負債純資産合計	64,304,876,293

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2024年11月20日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	56,480,299,522円
	同期中追加設定元本額	23,917,356,808円
	同期中一部解約元本額	9,710,891,313円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ニッセイ国内債券パッシブＤＢ（適格機関投資家限定）	40,042,807,355円
	ＤＣニッセイ日本債券インデックス	5,883,076,213円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	459,837,693円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	10,633,911,189円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	852,786,054円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	4,479,927,758円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	1,206,690,426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）	450,431,556円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	45,406,557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）	185,547,951円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	104,566,399円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	278,635,782円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	326,623,617円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	1,102,103,544円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	4,498,734,770円
	ＦＷニッセイ国内債インデックス	40,202,884円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	93,735,070円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	1,740,199円
	計	70,686,765,017円
２．	受益権の総数	70,686,765,017口
３．	元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は6,413,085,289円であります。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月20日現在 当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△1,401,346,240
地方債証券	△68,952,092
特殊債券	△73,054,010
社債券	△38,185,400
合計	△1,581,537,742

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年3月12日から2024年11月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9093円 (9,093円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年11月20日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	第４５５回　利付国債（２年）	179,000,000	178,212,400	
	第４５６回　利付国債（２年）	199,000,000	198,227,880	
	第４５７回　利付国債（２年）	206,000,000	205,103,900	
	第４５８回　利付国債（２年）	208,000,000	207,261,600	
	第４５９回　利付国債（２年）	210,000,000	209,162,100	
	第４６０回　利付国債（２年）	217,000,000	216,362,020	
	第４６１回　利付国債（２年）	236,000,000	235,587,000	
	第４６２回　利付国債（２年）	234,000,000	233,532,000	
	第４６３回　利付国債（２年）	235,000,000	234,466,550	
	第４６４回　利付国債（２年）	237,000,000	236,414,610	
	第４６５回　利付国債（２年）	232,000,000	231,378,240	
	第１４６回　利付国債（５年）	380,000,000	378,590,200	
	第１４７回　利付国債（５年）	486,000,000	482,923,620	
	第１４８回　利付国債（５年）	505,000,000	500,924,650	
	第１４９回　利付国債（５年）	467,000,000	462,470,100	
	第１５０回　利付国債（５年）	403,000,000	398,522,670	
	第１５１回　利付国債（５年）	269,000,000	265,632,120	

第１５２回　利付国債（５年）	133,000,000	131,624,780	
第１５３回　利付国債（５年）	469,000,000	462,443,380	
第１５４回　利付国債（５年）	411,000,000	405,673,440	
第１５５回　利付国債（５年）	211,000,000	209,210,720	
第１５６回　利付国債（５年）	252,000,000	249,102,000	
第１５７回　利付国債（５年）	116,000,000	114,486,200	
第１５８回　利付国債（５年）	241,000,000	237,069,290	
第１５９回　利付国債（５年）	120,000,000	117,814,800	
第１６０回　利付国債（５年）	108,000,000	106,411,320	
第１６１回　利付国債（５年）	121,000,000	119,643,590	
第１６２回　利付国債（５年）	25,000,000	24,686,750	
第１６３回　利付国債（５年）	282,000,000	279,521,220	
第１６４回　利付国債（５年）	138,000,000	135,504,960	
第１６５回　利付国債（５年）	134,000,000	132,109,260	
第１６６回　利付国債（５年）	145,000,000	143,529,700	
第１６７回　利付国債（５年）	124,000,000	122,566,560	
第１６８回　利付国債（５年）	62,000,000	61,804,080	
第１回　利付国債（４０年）	81,000,000	86,290,110	
第２回　利付国債（４０年）	105,000,000	107,381,400	
第３回　利付国債（４０年）	97,000,000	98,521,930	
第４回　利付国債（４０年）	134,000,000	135,011,700	
第５回　利付国債（４０年）	128,000,000	122,896,640	
第６回　利付国債（４０年）	138,000,000	128,642,220	
第７回　利付国債（４０年）	143,000,000	126,532,120	
第８回　利付国債（４０年）	179,000,000	145,412,440	
第９回　利付国債（４０年）	203,000,000	117,953,150	
第１０回　利付国債（４０年）	182,000,000	124,167,680	
第１１回　利付国債（４０年）	153,000,000	99,390,330	
第１２回　利付国債（４０年）	106,000,000	60,217,540	
第１３回　利付国債（４０年）	170,000,000	94,280,300	
第１４回　利付国債（４０年）	231,000,000	135,811,830	
第１５回　利付国債（４０年）	220,000,000	142,271,800	
第１６回　利付国債（４０年）	258,000,000	182,243,460	
第１７回　利付国債（４０年）	167,000,000	153,117,290	
第１回　クライメート・トランジション利付国債（５年）	45,000,000	44,347,500	
第２回　クライメート・トランジション利付国債（１０年）	47,000,000	46,879,680	
第３４１回　利付国債（１０年）	465,000,000	464,274,600	
第３４２回　利付国債（１０年）	531,000,000	528,302,520	
第３４３回　利付国債（１０年）	555,000,000	551,348,100	
第３４４回　利付国債（１０年）	500,000,000	496,010,000	
第３４５回　利付国債（１０年）	499,000,000	494,434,150	
第３４６回　利付国債（１０年）	465,000,000	460,191,900	

第３４７回　利付国債（１０年）	440,000,000	434,909,200	
第３４８回　利付国債（１０年）	473,000,000	466,869,920	
第３４９回　利付国債（１０年）	337,000,000	332,103,390	
第３５０回　利付国債（１０年）	431,000,000	423,970,390	
第３５１回　利付国債（１０年）	396,000,000	388,788,840	
第３５２回　利付国債（１０年）	279,000,000	273,417,210	
第３５３回　利付国債（１０年）	358,000,000	350,102,520	
第３５４回　利付国債（１０年）	328,000,000	320,003,360	
第３５５回　利付国債（１０年）	284,000,000	276,439,920	
第３５６回　利付国債（１０年）	250,000,000	242,932,500	
第３５７回　利付国債（１０年）	284,000,000	275,437,400	
第３５８回　利付国債（１０年）	307,000,000	297,234,330	
第３５９回　利付国債（１０年）	327,000,000	316,042,230	
第３６０回　利付国債（１０年）	363,000,000	350,207,880	
第３６１回　利付国債（１０年）	373,000,000	359,109,480	
第３６２回　利付国債（１０年）	384,000,000	368,812,800	
第３６３回　利付国債（１０年）	384,000,000	367,776,000	
第３６４回　利付国債（１０年）	392,000,000	374,469,760	
第３６５回　利付国債（１０年）	398,000,000	379,206,440	
第３６６回　利付国債（１０年）	426,000,000	407,605,320	
第３６７回　利付国債（１０年）	136,000,000	129,705,920	
第３６８回　利付国債（１０年）	413,000,000	392,713,440	
第３６９回　利付国債（１０年）	475,000,000	461,206,000	
第３７０回　利付国債（１０年）	478,000,000	462,828,280	
第３７１回　利付国債（１０年）	509,000,000	487,179,170	

第３７２回　利付国債（１０年)	473,000,000	467,215,210	
第３７３回　利付国債（１０年)	474,000,000	458,789,340	
第３７４回　利付国債（１０年)	457,000,000	449,007,070	
第３７５回　利付国債（１０年)	369,000,000	371,413,260	
第４回　利付国債（３０年)	21,000,000	23,672,670	
第５回　利付国債（３０年)	15,000,000	16,371,900	
第６回　利付国債（３０年)	35,000,000	38,839,150	
第７回　利付国債（３０年)	45,000,000	49,806,900	
第８回　利付国債（３０年)	64,000,000	68,606,720	
第９回　利付国債（３０年)	64,000,000	66,635,520	
第１０回　利付国債（３０年)	78,000,000	79,269,060	
第１１回　利付国債（３０年)	93,000,000	98,964,090	
第１２回　利付国債（３０年)	92,000,000	100,989,320	
第１３回　利付国債（３０年)	94,000,000	102,420,520	
第１４回　利付国債（３０年)	120,000,000	134,964,000	
第１５回　利付国債（３０年)	138,000,000	156,503,040	
第１６回　利付国債（３０年)	116,000,000	131,573,000	
第１７回　利付国債（３０年)	107,000,000	120,440,270	
第１８回　利付国債（３０年)	116,000,000	129,446,720	
第１９回　利付国債（３０年)	99,000,000	110,466,180	
第２０回　利付国債（３０年)	105,000,000	119,283,150	
第２１回　利付国債（３０年)	41,000,000	45,768,300	
第２２回　利付国債（３０年)	54,000,000	61,397,460	
第２３回　利付国債（３０年)	57,000,000	64,795,890	
第２４回　利付国債（３０年)	27,000,000	30,683,610	
第２５回　利付国債（３０年)	34,000,000	37,865,800	
第２６回　利付国債（３０年)	91,000,000	102,340,420	
第２７回　利付国債（３０年)	123,000,000	139,536,120	
第２８回　利付国債（３０年)	155,000,000	175,726,600	
第２９回　利付国債（３０年)	174,000,000	194,836,500	
第３０回　利付国債（３０年)	189,000,000	208,797,750	
第３１回　利付国債（３０年)	182,000,000	198,056,040	
第３２回　利付国債（３０年)	213,000,000	234,087,000	
第３３回　利付国債（３０年)	243,000,000	255,922,740	
第３４回　利付国債（３０年)	217,000,000	233,852,220	
第３５回　利付国債（３０年)	244,000,000	255,248,400	
第３６回　利付国債（３０年)	244,000,000	254,306,560	
第３７回　利付国債（３０年)	256,000,000	261,749,760	
第３８回　利付国債（３０年)	173,000,000	173,596,850	
第３９回　利付国債（３０年)	164,000,000	166,630,560	
第４０回　利付国債（３０年)	139,000,000	138,609,410	
第４１回　利付国債（３０年)	126,000,000	123,420,780	
第４２回　利付国債（３０年)	137,000,000	133,788,720	
第４３回　利付国債（３０年)	141,000,000	137,367,840	
第４４回　利付国債（３０年)	150,000,000	145,678,500	
第４５回　利付国債（３０年)	162,000,000	151,479,720	

第４６回　利付国債（３０年）	194,000,000	180,895,300	
第４７回　利付国債（３０年）	181,000,000	171,318,310	
第４８回　利付国債（３０年）	185,000,000	168,305,600	
第４９回　利付国債（３０年）	186,000,000	168,700,140	
第５０回　利付国債（３０年）	186,000,000	148,740,480	
第５１回　利付国債（３０年）	196,000,000	138,768,000	
第５２回　利付国債（３０年）	196,000,000	144,832,240	
第５３回　利付国債（３０年）	184,000,000	138,397,440	
第５４回　利付国債（３０年）	189,000,000	148,162,770	
第５５回　利付国債（３０年）	176,000,000	137,378,560	
第５６回　利付国債（３０年）	180,000,000	139,896,000	
第５７回　利付国債（３０年）	182,000,000	140,840,700	
第５８回　利付国債（３０年）	226,000,000	174,006,440	
第５９回　利付国債（３０年）	171,000,000	127,901,160	
第６０回　利付国債（３０年）	155,000,000	121,222,400	
第６１回　利付国債（３０年）	150,000,000	111,169,500	
第６２回　利付国債（３０年）	148,000,000	103,537,840	
第６３回　利付国債（３０年）	159,000,000	107,593,710	
第６４回　利付国債（３０年）	118,000,000	79,367,980	
第６５回　利付国債（３０年）	114,000,000	76,215,840	
第６６回　利付国債（３０年）	108,000,000	71,716,320	
第６７回　利付国債（３０年）	190,000,000	132,848,000	
第６８回　利付国債（３０年）	193,000,000	134,181,320	
第６９回　利付国債（３０年）	188,000,000	133,731,920	
第７０回　利付国債（３０年）	180,000,000	127,344,600	
第７１回　利付国債（３０年）	184,000,000	129,458,720	
第７２回　利付国債（３０年）	186,000,000	130,248,360	
第７３回　利付国債（３０年）	188,000,000	131,028,480	
第７４回　利付国債（３０年）	183,000,000	138,208,920	
第７５回　利付国債（３０年）	189,000,000	153,861,120	
第７６回　利付国債（３０年）	180,000,000	149,841,000	
第７７回　利付国債（３０年）	174,000,000	151,667,100	
第７８回　利付国債（３０年）	180,000,000	149,018,400	
第７９回　利付国債（３０年）	182,000,000	142,799,020	
第８０回　利付国債（３０年）	170,000,000	154,460,300	
第８１回　利付国債（３０年）	184,000,000	159,060,640	
第８２回　利付国債（３０年）	183,000,000	165,812,640	
第８３回　利付国債（３０年）	175,000,000	173,292,000	
第８４回　利付国債（３０年）	59,000,000	57,063,620	
第８３回　利付国債（２０年）	104,000,000	105,848,080	
第８４回　利付国債（２０年）	128,000,000	130,137,600	
第８５回　利付国債（２０年）	118,000,000	120,518,120	
第８６回　利付国債（２０年）	126,000,000	129,021,480	
第８７回　利付国債（２０年）	106,000,000	108,401,960	
第８８回　利付国債（２０年）	165,000,000	169,610,100	
第８９回　利付国債（２０年）	112,000,000	114,953,440	
第９０回　利付国債（２０年）	180,000,000	185,430,600	
第９１回　利付国債（２０年）	119,000,000	122,805,620	
第９２回　利付国債（２０年）	157,000,000	162,052,260	
第９３回　利付国債（２０年）	61,000,000	63,045,330	

第９４回　利付国債（２０年）	100,000,000	103,583,000	
第９５回　利付国債（２０年）	112,000,000	116,996,320	
第９６回　利付国債（２０年）	42,000,000	43,660,260	
第９７回　利付国債（２０年）	80,000,000	83,666,400	
第９８回　利付国債（２０年）	48,000,000	50,065,920	
第９９回　利付国債（２０年）	207,000,000	216,617,220	
第１００回　利付国債（２０年）	148,000,000	155,798,120	
第１０１回　利付国債（２０年）	92,000,000	97,462,960	
第１０２回　利付国債（２０年）	107,000,000	113,746,350	
第１０３回　利付国債（２０年）	98,000,000	103,834,920	
第１０４回　利付国債（２０年）	35,000,000	36,832,250	
第１０５回　利付国債（２０年）	110,000,000	116,111,600	
第１０６回　利付国債（２０年）	89,000,000	94,278,590	
第１０７回　利付国債（２０年）	86,000,000	91,009,500	
第１０８回　利付国債（２０年）	135,000,000	141,790,500	
第１０９回　利付国債（２０年）	93,000,000	97,849,950	
第１１０回　利付国債（２０年）	126,000,000	133,658,280	
第１１１回　利付国債（２０年）	99,000,000	105,704,280	
第１１２回　利付国債（２０年）	156,000,000	165,871,680	
第１１３回　利付国債（２０年）	269,000,000	286,727,100	
第１１４回　利付国債（２０年）	125,000,000	133,681,250	
第１１５回　利付国債（２０年）	83,000,000	89,171,880	
第１１６回　利付国債（２０年）	51,000,000	54,969,840	
第１１７回　利付国債（２０年）	111,000,000	119,070,810	
第１１８回　利付国債（２０年）	28,000,000	29,970,080	
第１１９回　利付国債（２０年）	15,000,000	15,889,950	
第１２０回　利付国債（２０年）	34,000,000	35,642,540	
第１２１回　利付国債（２０年）	81,000,000	86,444,010	

第１２２回　利付国債（２０年）	39,000,000	41,402,790	
第１２３回　利付国債（２０年）	226,000,000	244,378,320	
第１２４回　利付国債（２０年）	102,000,000	109,699,980	
第１２５回　利付国債（２０年）	98,000,000	106,807,260	
第１２６回　利付国債（２０年）	86,000,000	92,659,840	
第１２７回　利付国債（２０年）	82,000,000	87,853,980	
第１２８回　利付国債（２０年）	149,000,000	159,891,900	
第１２９回　利付国債（２０年）	86,000,000	91,746,520	
第１３０回　利付国債（２０年）	127,000,000	135,663,940	
第１３１回　利付国債（２０年）	63,000,000	66,888,360	
第１３２回　利付国債（２０年）	88,000,000	93,525,520	
第１３３回　利付国債（２０年）	116,000,000	124,062,000	
第１３４回　利付国債（２０年）	98,000,000	104,890,380	
第１３５回　利付国債（２０年）	58,000,000	61,676,040	
第１３６回　利付国債（２０年）	60,000,000	63,365,400	
第１３７回　利付国債（２０年）	69,000,000	73,384,260	
第１３８回　利付国債（２０年）	75,000,000	78,666,750	
第１３９回　利付国債（２０年）	83,000,000	87,681,200	
第１４０回　利付国債（２０年）	225,000,000	239,478,750	
第１４１回　利付国債（２０年）	206,000,000	219,237,560	
第１４２回　利付国債（２０年）	148,000,000	158,688,560	
第１４３回　利付国債（２０年）	206,000,000	217,589,560	
第１４４回　利付国債（２０年）	153,000,000	160,357,770	
第１４５回　利付国債（２０年）	277,000,000	294,764,010	
第１４６回　利付国債（２０年）	277,000,000	294,644,900	

第１４７回　利付国債（２０年）	299,000,000	315,376,230	
第１４８回　利付国債（２０年）	266,000,000	277,938,080	
第１４９回　利付国債（２０年）	278,000,000	289,895,620	
第１５０回　利付国債（２０年）	330,000,000	340,593,000	
第１５１回　利付国債（２０年）	288,000,000	291,271,680	
第１５２回　利付国債（２０年）	268,000,000	270,358,400	
第１５３回　利付国債（２０年）	278,000,000	282,598,120	
第１５４回　利付国債（２０年）	298,000,000	299,290,340	
第１５５回　利付国債（２０年）	227,000,000	222,777,800	
第１５６回　利付国債（２０年）	133,000,000	121,722,930	
第１５７回　利付国債（２０年）	136,000,000	120,944,800	
第１５８回　利付国債（２０年）	234,000,000	214,585,020	
第１５９回　利付国債（２０年）	185,000,000	170,943,700	
第１６０回　利付国債（２０年）	173,000,000	161,116,630	
第１６１回　利付国債（２０年）	174,000,000	159,368,340	
第１６２回　利付国債（２０年）	231,000,000	210,556,500	
第１６３回　利付国債（２０年）	237,000,000	215,086,980	
第１６４回　利付国債（２０年）	297,000,000	264,748,770	
第１６５回　利付国債（２０年）	231,000,000	204,825,390	
第１６６回　利付国債（２０年）	235,000,000	213,220,200	
第１６７回　利付国債（２０年）	258,000,000	226,428,540	
第１６８回　利付国債（２０年）	240,000,000	206,433,600	
第１６９回　利付国債（２０年）	250,000,000	210,585,000	
第１７０回　利付国債（２０年）	226,000,000	189,195,900	
第１７１回　利付国債（２０年）	223,000,000	185,638,580	

	第１７２回　利付国債（２０年）	200,000,000	168,182,000	
	第１７３回　利付国債（２０年）	269,000,000	224,819,440	
	第１７４回　利付国債（２０年）	259,000,000	215,122,810	
	第１７５回　利付国債（２０年）	245,000,000	205,795,100	
	第１７６回　利付国債（２０年）	240,000,000	200,503,200	
	第１７７回　利付国債（２０年）	253,000,000	206,587,150	
	第１７８回　利付国債（２０年）	248,000,000	205,029,040	
	第１７９回　利付国債（２０年）	266,000,000	218,683,920	
	第１８０回　利付国債（２０年）	245,000,000	211,386,000	
	第１８１回　利付国債（２０年）	253,000,000	221,116,940	
	第１８２回　利付国債（２０年）	236,000,000	212,553,400	
	第１８３回　利付国債（２０年）	243,000,000	229,270,500	
	第１８４回　利付国債（２０年）	242,000,000	216,418,180	
	第１８５回　利付国債（２０年）	243,000,000	216,306,450	
	第１８６回　利付国債（２０年）	246,000,000	233,648,340	
	第１８７回　利付国債（２０年）	189,000,000	172,999,260	
	第１８８回　利付国債（２０年）	188,000,000	180,536,400	
	第１８９回　利付国債（２０年）	187,000,000	188,208,020	
	第１９０回　利付国債（２０年）	57,000,000	56,300,610	
国債証券　合計		54,322,000,000	51,735,991,940	
地方債証券	第７６４回　東京都公募公債	100,000,000	99,133,000	
	第１４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	105,316,900	
	第３４回　東京都公募公債（２０年）	100,000,000	91,118,900	
	第１８回　宮城県１号公募公債（５年）	100,000,000	98,463,100	
	第３０回　神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	98,896,000	
	第４４８回　大阪府公募公債	38,000,000	36,556,228	
	第４５５回　大阪府公募公債	180,000,000	173,367,180	

	第７回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	106,428,400	
	第１１回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	105,483,700	
	第１２回　大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	102,726,100	
	平成２９年度第５回　京都府公募公債（２０年）	100,000,000	90,294,200	
	第１５回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	105,181,700	
	第２１回　兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	103,816,600	
	平成２６年度第１１回　愛知県公募公債（１５年）	100,000,000	100,754,900	
	令和４年度第３回　愛知県公募公債	200,000,000	190,964,000	
	平成２０年度第１回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	105,658,300	
	平成２４年度第２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	105,149,100	
	令和４年度第１回　千葉県公募公債	300,000,000	286,479,600	
	第２２回　大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	89,409,600	
	第１回　名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	112,761,200	
	第２５回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	105,771,900	
	第２６回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	106,214,500	
	第３１回　横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	99,593,500	
	第９回　川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	107,171,400	
	第４回　川崎市公募公債（３０年）	100,000,000	104,482,900	
	平成３０年度第５回　広島市公募公債	200,000,000	195,526,800	
	平成２９年度第１回　仙台市公募公債	100,000,000	89,815,700	
地方債証券　合計		3,118,000,000	3,116,535,408	
特殊債券	第９回　新関西国際空港	300,000,000	304,233,300	
	第１６回　日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,528,100	
	第１７４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,354,500	
	第２０５回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,165,100	
	第２１２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,766,100	

第２３３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,483,400	
第２７８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	88,583,100	
第２９３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	89,497,300	
第３１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,253,000	
第３１９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,810,300	
第１７回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	212,187,400	
第３６回　地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	103,347,400	
第１回　地方公共団体金融機構債券（３０年）	100,000,000	96,843,800	
第１１６回　政保地方公共団体金融機構債券	138,000,000	134,375,430	
第１２０回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,494,200	
第１３６回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	191,530,800	
第７２回　日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,032,300	
第９７回　都市再生債券	100,000,000	100,686,400	
第３３回　政保中部国際空港債券	100,000,000	98,632,900	
第５９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	212,185,800	
第１４３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,480,300	
第１８３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,132,000	
第３７回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,413,000	16,838,096	
第４２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,080,000	42,833,232	
第４６回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,946,000	49,250,131	
第５４回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,282,000	40,999,019	
第５５回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,272,000	45,951,080	
第６０回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,620,000	47,193,426	
第６１回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,548,000	23,755,222	
第６２回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	214,384,000	215,370,166	
第６３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,375,000	130,401,075	

	第７３回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,648,000	94,294,171	
	第７８回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,099,000	81,115,219	
	第１０９回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,600,000	169,691,760	
	第１７５回　貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,328,000	158,499,017	
	い第８５４号　利付商工債券	200,000,000	198,004,000	
	い第８６２号　利付商工債券	100,000,000	98,743,200	
	第３９４回　利付信金中金債券	100,000,000	98,473,000	
	第４０２回　利付信金中金債券	200,000,000	196,886,200	
	第６６回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,031,700	
特殊債券　合計		4,574,595,000	4,542,932,644	
社債券	第３６回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０２１）	100,000,000	96,194,200	
	第３８回　成田国際空港	200,000,000	191,234,200	
	第８回　ビー・エヌ・ピー・パリバ	100,000,000	99,111,900	
	第６９回　西日本高速道路	100,000,000	98,703,400	
	第１３回　日本たばこ産業	100,000,000	97,961,400	
	第８回　クラレ	100,000,000	97,842,800	
	第１２回　旭化成	300,000,000	288,597,000	
	第５回　電通グループ	400,000,000	394,810,000	
	第２回　アステラス製薬	100,000,000	98,634,000	
	第１１回　ブリヂストン	100,000,000	98,741,900	
	第１９回　豊田通商	100,000,000	100,230,800	
	第２４回　りそなホールディングス	300,000,000	296,377,200	
	第２回　みずほリース	300,000,000	288,686,100	
	第１８回　ＮＴＴファイナンス	100,000,000	96,074,600	
	第７８回　トヨタファイナンス	100,000,000	98,551,800	
	第５５回　日立キャピタル	100,000,000	100,270,000	
	第１７回　三井住友ファイナンス＆リース	100,000,000	98,582,900	
	第２回　三菱ＨＣキャピタル	100,000,000	98,512,600	
	第１３２回　三菱地所	100,000,000	96,647,700	
	第７回　野村不動産オフィスファンド投資法人	200,000,000	211,715,800	
	第１１回　ジャパンエクセレント投資法人	100,000,000	99,022,500	
	第１０６回　東日本旅客鉄道	100,000,000	96,168,500	
	第３回　東日本旅客鉄道（サステナビリティボンド）	100,000,000	94,466,100	
	第３２回　東海旅客鉄道	200,000,000	208,474,400	
	第８回　東京地下鉄	100,000,000	104,557,800	
	第５１０回　関西電力	100,000,000	99,111,400	
	第５１８回　関西電力	100,000,000	98,394,000	
	第４９４回　東北電力	100,000,000	98,961,300	

	第４５１回　九州電力	100,000,000	99,073,100	
	第４７回　大阪瓦斯（トランジションボンド）	100,000,000	95,592,200	
	第８回　ファーストリテイリング	100,000,000	88,398,400	
社債券　合計		4,300,000,000	4,229,700,000	
合計			63,625,159,992	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年11月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	12,364,488
コール・ローン	433,858,701
投資証券	30,283,067,400
未収配当金	230,982,367
流動資産合計	30,960,272,956
資産合計	30,960,272,956
負債の部	
流動負債	
未払金	128,936,321
未払解約金	87,642,838
流動負債合計	216,579,159
負債合計	216,579,159
純資産の部	
元本等	
元本	17,100,771,249
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	13,642,922,548
元本等合計	30,743,693,797
純資産合計	30,743,693,797
負債純資産合計	30,960,272,956

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年11月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,718,367,652円
同期中追加設定元本額	6,631,216,692円
同期中一部解約元本額	6,248,813,095円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家限定）	54,802,320円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド	851,785,080円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＪリートインデックスファンド	8,989,399,814円
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド２０１３－０２（適格機関投資家限定）	1,576,284,735円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＡ	3,274,700,137円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＢ	2,007,365,902円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	230,977,595円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	28,070,052円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	9,273,016円
ニッセイ・インデックスパッケージ（国内・株式／リート／債券）	20,389,687円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	53,359,035円
ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（安定型）	112,362円
ニッセイ　国内３資産　高値参照型　バランスファンド（積極型）	250,401円
ＦＷニッセイ国内リートインデックス	4,001,113円
計	17,100,771,249円
２．　受益権の総数	17,100,771,249口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	61,584,579
合計	61,584,579

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年11月13日から2024年11月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7978円 (17,978円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年11月20日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	1,336	187,040,000	
	ＧＬＰ投資法人	10,425	1,345,867,500	
	ＫＤＸ不動産投資法人	8,683	1,289,425,500	

ＮＴＴ都市開発リート投資法人	3,154	353,563,400	
Ｏｎｅリート投資法人	541	124,862,800	
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	1,548	169,351,200	
いちごオフィスリート投資法人	2,264	180,440,800	
いちごホテルリート投資法人	514	72,988,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,509	494,952,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	3,050	915,000,000	
イオンリート投資法人	3,807	482,727,600	
インヴィンシブル投資法人	17,099	1,099,465,700	
エスコンジャパンリート投資法人	687	77,905,800	
オリックス不動産投資法人	6,184	1,021,596,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,248	227,947,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,571	467,843,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人	846	77,070,600	
サンケイリアルエステート投資法人	994	75,941,600	
ザイマックス・リート投資法人	531	58,994,100	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,402	770,775,200	
ジャパンエクセレント投資法人	2,665	317,934,500	
ジャパンリアルエステイト投資法人	3,188	1,791,656,000	
スターアジア不動産投資法人	5,719	287,665,700	
スターツプロシード投資法人	538	92,912,600	
タカラレーベン不動産投資法人	2,027	173,308,500	
トーセイ・リート投資法人	675	84,240,000	
ヒューリックリート投資法人	2,742	364,411,800	
フロンティア不動産投資法人	1,152	460,800,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	765	81,472,500	
マリモ地方創生リート投資法人	564	62,773,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,942	975,351,000	
ラサールロジポート投資法人	3,973	576,085,000	
阪急阪神リート投資法人	1,480	179,524,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	6,765	682,588,500	
三菱地所物流リート投資法人	1,072	374,128,000	
産業ファンド投資法人	5,682	656,271,000	
森トラストリート投資法人	5,982	369,687,600	
森ヒルズリート投資法人	3,650	459,535,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,313	299,495,300	
積水ハウス・リート投資法人	9,326	686,393,600	
大和ハウスリート投資法人	4,654	1,084,847,400	

	大和証券オフィス投資法人	1,286	390,944,000	
	大和証券リビング投資法人	4,584	423,103,200	
	投資法人みらい	4,274	173,524,400	
	東海道リート投資法人	530	56,286,000	
	東急リアル・エステート投資法人	2,081	330,254,700	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,072	635,696,000	
	日本ビルファンド投資法人	18,103	2,355,200,300	
	日本プライムリアルティ投資法人	2,122	708,748,000	
	日本プロロジスリート投資法人	5,406	1,345,553,400	
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	501	34,218,300	
	日本リート投資法人	1,008	319,536,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,085	560,656,500	
	日本都市ファンド投資法人	16,093	1,458,025,800	
	福岡リート投資法人	1,751	249,692,600	
	平和不動産リート投資法人	2,276	274,030,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9,935	1,412,757,000	
投資証券　合計		222,374	30,283,067,400	
合計			30,283,067,400	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年11月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,965,486,402
金銭信託	453,599,345
コール・ローン	15,916,391,311
株式	1,119,567,964,470
投資証券	21,523,581,574
派生商品評価勘定	877,909,993
未収入金	398,783,814
未収配当金	1,079,369,987
差入委託証拠金	14,984,069,753
流動資産合計	1,177,767,156,649
資産合計	1,177,767,156,649
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	240,522,599
未払金	4,211,003
未払解約金	1,745,237,722
流動負債合計	1,989,971,324
負債合計	1,989,971,324
純資産の部	
元本等	
元本	236,998,387,944
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	938,778,797,381
元本等合計	1,175,777,185,325
純資産合計	1,175,777,185,325
負債純資産合計	1,177,767,156,649

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年11月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	220,818,463,085円
同期中追加設定元本額	49,861,698,255円
同期中一部解約元本額	33,681,773,396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）	697,343,816円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,470,977,936円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,508,450,010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）	2,320,921,334円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	655,727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）	1,365,193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）	4,377,084円
ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ（適格機関投資家限定）	486,709,861円

＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国株式インデックスファンド	161,391,837,322円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	44,717,793,265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）	3,524,993,735円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	456,141,988円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	170,795,264円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	522,390,715円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	638,505,039円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	8,367,952円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	87,345,461円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	9,376,316円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	10,650,648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）	3,519,880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）	20,246,799円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	379,050,839円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	254,048,022円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	445,049,698円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	154,611,872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）	124,705,835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）	281,731,466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）	125,508,152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）	123,087,223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）	122,623,889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）	109,534,576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）	31,658,672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）	11,954,174,927円
ＦＷニッセイ先進国株インデックス	53,058,104円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	180,150,980円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンドⅡ２０２３－０５（適格機関投資家限定）	79,189,559円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	373,589,941円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド２０２４－０２（適格機関投資家限定）	77,396,875円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	3,322,527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）	73,129,442円
計	236,998,387,944円
２．　受益権の総数	236,998,387,944口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	87,964,475,944
投資証券	1,995,200,986
合計	89,959,676,930

（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5月21日から2024年11月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年11月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	11,838,626,381	－	11,838,321,990	△304,391
アメリカ・ドル	7,606,731,841	－	7,611,581,380	4,849,539
イギリス・ポンド	1,306,510,604	－	1,302,440,405	△4,070,199
ユーロ	2,925,383,936	－	2,924,300,205	△1,083,731
合計	11,838,626,381	－	11,838,321,990	△304,391

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2024年11月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	31,318,600,709	－	31,956,292,494	637,691,785
合計	31,318,600,709	－	31,956,292,494	637,691,785

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.9611円 (49,611円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2024年11月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	61,180	128.190	7,842,664.20	
	ABBOTT LABORATORIES	192,695	117.130	22,570,365.35	
	ABBVIE INC	195,594	166.570	32,580,092.58	
	ACCENTURE PLC	69,379	353.950	24,556,697.05	
	ADOBE INC	49,109	499.610	24,535,347.49	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	179,023	139.390	24,954,015.97	
	AECOM	15,074	108.830	1,640,503.42	
	AERCAP HOLDINGS NV	21,444	95.730	2,052,834.12	
	AES CORP	78,708	13.750	1,082,235.00	
	AFLAC INC	59,764	111.130	6,641,573.32	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	32,315	125.690	4,061,672.35	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,626	328.000	8,077,328.00	
	AIRBNB INC-CLASS A	48,897	131.440	6,427,021.68	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	16,865	87.360	1,473,326.40	
	ALBEMARLE CORP	13,031	106.450	1,387,149.95	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	41,708	19.270	803,713.16	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	7,920	222.580	1,762,833.60	
	ALLEGION PLC	9,684	138.120	1,337,554.08	
	ALLIANT ENERGY CORP	28,393	62.250	1,767,464.25	
	ALLSTATE CORP	29,230	196.600	5,746,618.00	
	ALLY FINANCIAL INC	30,299	35.570	1,077,735.43	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14,013	234.270	3,282,825.51	
	ALPHABET INC-CL A	650,464	178.120	115,860,647.68	
	ALPHABET INC-CL C	560,021	179.580	100,568,571.18	
	ALTRIA GROUP INC	190,290	55.860	10,629,599.40	
	AMAZON.COM INC	1,037,343	204.610	212,250,751.23	
	AMCOR PLC	160,379	9.890	1,586,148.31	
	AMEREN CORPORATION	29,546	92.120	2,721,777.52	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	58,383	96.700	5,645,636.10	
	AMERICAN EXPRESS CO	63,754	285.550	18,204,954.70	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,911	138.420	1,095,040.62	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	73,457	75.300	5,531,312.10	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,568	138.200	2,980,697.60	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,991	562.560	6,183,096.96	
AMETEK INC	25,639	193.460	4,960,120.94	
AMGEN INC	59,418	279.950	16,634,069.10	
AMPHENOL CORP-CL A	133,027	70.980	9,442,256.46	
ANALOG DEVICES INC	54,962	210.430	11,565,653.66	
ANSYS INC	9,668	339.520	3,282,479.36	
AON PLC	21,676	379.150	8,218,455.40	
APA CORP	40,953	21.920	897,689.76	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	44,114	168.250	7,422,180.50	
APPLE INC	1,613,432	228.280	368,314,256.96	
APPLIED MATERIALS INC	91,700	169.310	15,525,727.00	
APPLOVIN CORP-CLASS A	22,624	321.190	7,266,602.56	
APTIV PLC	30,138	52.110	1,570,491.18	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	41,567	95.690	3,977,546.23	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,773	52.990	2,902,421.27	
ARES MANAGEMENT CORP - A	20,587	170.350	3,506,995.45	
ARISTA NETWORKS INC	29,502	377.700	11,142,905.40	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,202	292.490	7,078,842.98	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,160	247.000	780,520.00	
ASSURANT INC	5,753	219.170	1,260,885.01	
AT&T INC	795,643	22.730	18,084,965.39	
ATLASSIAN CORP-CL A	17,644	247.730	4,370,948.12	
ATMOS ENERGY CORP	16,706	146.780	2,452,106.68	
AUTODESK INC	23,862	305.200	7,282,682.40	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	45,336	297.540	13,489,273.44	
AUTOZONE INC	1,892	3,106.910	5,878,273.72	
AVANTOR INC	75,243	19.720	1,483,791.96	
AVERY DENNISON CORP	8,920	197.000	1,757,240.00	
AXON ENTERPRISE INC	7,942	610.200	4,846,208.40	
BAKER HUGHES COMPANY	110,543	42.870	4,738,978.41	
BALL CORP	34,379	59.910	2,059,645.89	
BANK OF AMERICA CORP	779,513	46.410	36,177,198.33	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	81,699	77.610	6,340,659.39	
BATH & BODY WORKS INC	23,493	30.440	715,126.92	
BAXTER INTERNATIONAL INC	56,486	32.520	1,836,924.72	
BECTON DICKINSON & CO	32,015	222.640	7,127,819.60	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	17,582	46.760	822,134.32	

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	146,675	468.860	68,770,040.50	
BEST BUY CO INC	22,705	87.020	1,975,789.10	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,210	320.660	708,658.60	
BIO-TECHNE CORP	17,461	66.370	1,158,886.57	
BIOGEN INC	16,128	155.430	2,506,775.04	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21,043	61.970	1,304,034.71	
BLACKROCK INC	16,456	1,028.110	16,918,578.16	
BLACKSTONE INC	79,151	184.910	14,635,811.41	
BLOCK INC	61,663	92.420	5,698,894.46	
BOEING CO	64,763	145.600	9,429,492.80	
BOOKING HOLDINGS INC	3,757	4,976.990	18,698,551.43	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	14,338	137.920	1,977,496.96	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	162,791	90.330	14,704,911.03	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	224,585	58.230	13,077,584.55	
BROADCOM INC	489,779	165.350	80,984,957.65	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	13,090	224.840	2,943,155.60	
BROWN & BROWN INC	26,843	109.350	2,935,282.05	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	20,219	40.220	813,208.18	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	13,510	178.810	2,415,723.10	
BUNGE GLOBAL SA	15,680	89.490	1,403,203.20	
BURLINGTON STORES INC	7,070	274.000	1,937,180.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,978	109.080	1,415,640.24	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	30,139	299.630	9,030,548.57	
CAMPBELL SOUP CO	21,510	43.530	936,330.30	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,294	181.000	7,655,214.00	
CARDINAL HEALTH INC	26,972	118.330	3,191,596.76	
CARLISLE COS INC	5,269	435.090	2,292,489.21	
CARLYLE GROUP INC/THE	25,897	51.140	1,324,372.58	
CARMAX INC	17,283	75.300	1,301,409.90	
CARNIVAL CORP	111,846	25.130	2,810,689.98	
CARRIER GLOBAL CORP	89,799	74.330	6,674,759.67	
CATALENT INC	20,051	58.880	1,180,602.88	
CATERPILLAR INC	54,163	382.330	20,708,139.79	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,650	204.980	2,388,017.00	
CBRE GROUP INC	33,972	132.160	4,489,739.52	
CDW CORP/DE	14,885	174.050	2,590,734.25	
CELANESE CORP-SERIES A	12,089	72.200	872,825.80	
CELSIUS HOLDINGS INC	16,788	27.290	458,144.52	
CENCORA, INC.	19,878	240.980	4,790,200.44	
CENTENE CORP	59,106	57.810	3,416,917.86	
CENTERPOINT ENERGY INC	70,866	31.400	2,225,192.40	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,254	87.540	1,773,035.16	
CHARLES RIVER LABORATORIES	5,705	186.100	1,061,700.50	
CHARLES SCHWAB CORP	167,327	80.190	13,417,952.13	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	10,367	384.840	3,989,636.28	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,820	174.560	1,714,179.20	
CHENIERE ENERGY INC	25,328	220.040	5,573,173.12	
CHEVRON CORP	193,921	159.600	30,949,791.60	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	152,117	58.730	8,933,831.41	
CHORD ENERGY CORP	6,902	127.970	883,248.94	
CHUBB LTD	42,719	283.870	12,126,642.53	
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,090	110.920	3,004,822.80	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,336	150.580	2,610,454.88	
CINTAS CORP	40,448	217.970	8,816,450.56	
CISCO SYSTEMS INC	446,287	57.010	25,442,821.87	
CITIGROUP INC	211,257	68.600	14,492,230.20	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,385	46.050	2,320,229.25	
CLOROX CO	13,765	168.140	2,314,447.10	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	33,348	96.370	3,213,746.76	
CME GROUP INC	39,898	229.660	9,162,974.68	
CMS ENERGY CORP	33,059	68.570	2,266,855.63	
CNH INDUSTRIAL NV	97,589	11.070	1,080,310.23	
COCA-COLA CO	453,307	62.590	28,372,485.13	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,817	76.090	1,736,145.53	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	55,052	76.320	4,201,568.64	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	21,040	324.570	6,828,952.80	
COLGATE-PALMOLIVE CO	86,333	93.610	8,081,632.13	
COMCAST CORP	433,542	42.320	18,347,497.44	
CONAGRA BRANDS INC	53,032	26.480	1,404,287.36	
CONOCOPHILLIPS	128,938	113.090	14,581,598.42	
CONSOLIDATED EDISON INC	38,296	96.970	3,713,563.12	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18,160	240.440	4,366,390.40	
CONSTELLATION ENERGY	34,911	234.580	8,189,422.38	
COOPER COS INC/THE	22,045	99.050	2,183,557.25	
COPART INC	95,907	56.520	5,420,663.64	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	30,308	30.430	922,272.44	
CORNING INC	90,166	47.290	4,263,950.14	
CORTEVA INC	77,197	58.240	4,495,953.28	
COSTAR GROUP INC	45,254	72.090	3,262,360.86	
COSTCO WHOLESALE CORP	49,101	930.150	45,671,295.15	

COTERRA ENERGY INC	82,490	26.290	2,168,662.10	
CRH PLC	76,090	99.790	7,593,021.10	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	25,573	353.290	9,034,685.17	
CROWN HOLDINGS INC	13,372	89.540	1,197,328.88	
CSX CORP	216,471	34.600	7,489,896.60	
CUMMINS INC	15,152	361.860	5,482,902.72	
CVS HEALTH CORP	139,070	55.770	7,755,933.90	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,774	315.000	1,503,810.00	
DANAHER CORP	73,833	230.840	17,043,609.72	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,232	160.850	2,128,367.20	
DATADOG INC - CLASS A	30,749	133.410	4,102,224.09	
DAVITA INC	5,821	156.980	913,780.58	
DAYFORCE, INC.	17,493	74.760	1,307,776.68	
DECKERS OUTDOOR CORP	16,884	176.290	2,976,480.36	
DEERE & CO	28,996	400.090	11,601,009.64	
DELL TECHNOLOGIES -C	31,168	135.900	4,235,731.20	
DELTA AIR LINES INC	17,813	64.750	1,153,391.75	
DEVON ENERGY CORPORATION	69,451	37.910	2,632,887.41	
DEXCOM INC	44,065	74.880	3,299,587.20	
DIAMONDBACK ENERGY INC	19,730	180.120	3,553,767.60	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,414	199.570	1,280,041.98	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	27,753	172.500	4,787,392.50	
DOCUSIGN INC	22,679	79.520	1,803,434.08	
DOLLAR GENERAL CORP	24,364	76.500	1,863,846.00	
DOLLAR TREE INC	22,620	64.870	1,467,359.40	
DOMINION ENERGY INC	92,884	57.590	5,349,189.56	
DOMINO'S PIZZA INC	3,865	439.800	1,699,827.00	
DOORDASH INC - A	33,825	176.180	5,959,288.50	
DOVER CORP	15,211	198.730	3,022,882.03	
DOW INC	77,964	43.650	3,403,128.60	
DR HORTON INC	32,821	162.300	5,326,848.30	
DRAFTKINGS INC	48,310	43.210	2,087,475.10	
DTE ENERGY COMPANY	22,916	121.680	2,788,418.88	
DUKE ENERGY CORP	85,477	113.580	9,708,477.66	
DUPONT DE NEMOURS INC	46,295	81.360	3,766,561.20	
DYNATRACE INC	31,377	51.580	1,618,425.66	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	13,014	101.330	1,318,708.62	
EATON CORP PLC	44,279	363.690	16,103,829.51	
EBAY INC	55,583	61.100	3,396,121.30	
ECOLAB INC	28,467	244.300	6,954,488.10	
EDISON INTERNATIONAL	42,588	85.640	3,647,236.32	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	66,754	70.200	4,686,130.80	
ELECTRONIC ARTS INC	27,953	166.130	4,643,831.89	
ELEVANCE HEALTH, INC	25,742	394.200	10,147,496.40	

ELI LILLY & CO	89,475	729.730	65,292,591.75	
EMCOR GROUP INC	5,201	514.000	2,673,314.00	
EMERSON ELECTRIC CO	63,366	129.560	8,209,698.96	
ENPHASE ENERGY INC	15,076	61.360	925,063.36	
ENTEGRIS INC	16,709	99.430	1,661,375.87	
ENTERGY CORP	23,645	149.890	3,544,149.05	
EOG RESOURCES INC	63,624	135.180	8,600,692.32	
EPAM SYSTEMS INC	6,424	227.600	1,462,102.40	
EQT CORP	62,587	44.080	2,758,834.96	
EQUIFAX INC	13,689	245.030	3,354,215.67	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,957	46.600	1,675,596.20	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,814	416.450	1,171,890.30	
ESSENTIAL UTILITIES INC	28,817	38.950	1,122,422.15	
ESTEE LAUDER COS INC	25,832	64.790	1,673,655.28	
EVEREST GROUP LTD	4,808	370.440	1,781,075.52	
EVERGY INC	25,484	63.980	1,630,466.32	
EVERSOURCE ENERGY	39,047	61.670	2,408,028.49	
EXACT SCIENCES CORP	20,453	53.920	1,102,825.76	
EXELON CORP	110,763	39.100	4,330,833.30	
EXPAND ENERGY CORPORATION	12,329	95.710	1,180,008.59	
EXPEDIA GROUP INC	14,051	177.060	2,487,870.06	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	15,634	118.030	1,845,281.02	
EXXON MOBIL CORP	496,838	118.630	58,939,891.94	
F5 INC	6,488	239.670	1,554,978.96	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,215	481.400	2,029,101.00	
FAIR ISAAC CORP	2,736	2,284.430	6,250,200.48	
FASTENAL CO	63,437	81.590	5,175,824.83	
FEDEX CORP	25,702	293.060	7,532,228.12	
FERGUSON ENTERPRISES INC	22,365	201.870	4,514,822.55	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	28,751	60.940	1,752,085.94	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	61,609	86.080	5,303,302.72	
FIFTH THIRD BANCORP	75,728	46.440	3,516,808.32	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,124	2,217.730	2,492,728.52	
FIRST SOLAR INC	11,264	187.360	2,110,423.04	
FIRSTENERGY CORP	60,571	41.580	2,518,542.18	
FISERV INC	64,795	215.120	13,938,700.40	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,392	368.190	2,721,660.48	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	19,682	263.390	5,184,041.98	
FORD MOTOR CO	434,367	11.050	4,799,755.35	
FORTINET INC	71,916	90.790	6,529,253.64	

FORTIVE CORP	38,978	74.500	2,903,861.00	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	13,850	73.540	1,018,529.00	
FOX CORP - CLASS A	25,473	45.760	1,165,644.48	
FOX CORP- CLASS B	15,763	43.210	681,119.23	
FRANKLIN RESOURCES INC	32,163	21.480	690,861.24	
FREEPORT-MCMORAN INC	159,007	44.120	7,015,388.84	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,188	86.700	536,499.60	
GARMIN LTD	17,020	207.370	3,529,437.40	
GARTNER INC	8,594	517.730	4,449,371.62	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	48,016	82.520	3,962,280.32	
GE VERNOVA INC	30,360	340.000	10,322,400.00	
GEN DIGITAL INC	62,415	29.240	1,825,014.60	
GENERAL DYNAMICS CORP	25,834	280.960	7,258,320.64	
GENERAL ELECTRIC CO	121,227	177.560	21,525,066.12	
GENERAL MILLS INC	61,846	62.780	3,882,691.88	
GENERAL MOTORS CO	126,265	55.110	6,958,464.15	
GENUINE PARTS CO	15,443	121.260	1,872,618.18	
GILEAD SCIENCES INC	138,015	87.750	12,110,816.25	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,277	114.720	3,243,937.44	
GLOBAL-E ONLINE LTD	11,101	42.740	474,456.74	
GODADDY INC - CLASS A	15,597	187.400	2,922,877.80	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	35,709	581.380	20,760,498.42	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	233,953	5.460	1,277,383.38	
GRACO INC	18,749	87.830	1,646,724.67	
HALLIBURTON CO	98,044	30.470	2,987,400.68	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	32,758	116.820	3,826,789.56	
HCA HEALTHCARE INC	21,752	335.110	7,289,312.72	
HEICO CORP	4,836	272.780	1,319,164.08	
HEICO CORP-CLASS A	8,371	212.440	1,778,335.24	
HENRY SCHEIN INC	14,183	74.840	1,061,455.72	
HERSHEY CO/THE	16,358	170.240	2,784,785.92	
HESS CORP	30,695	146.230	4,488,529.85	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	143,918	21.530	3,098,554.54	
HF SINCLAIR CORP	17,934	42.290	758,428.86	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	27,678	249.760	6,912,857.28	
HOLOGIC INC	25,830	78.570	2,029,463.10	
HOME DEPOT INC	109,832	406.800	44,679,657.60	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	72,131	228.200	16,460,294.20	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	122,800	4.640	569,792.00	
HORMEL FOODS CORP	33,485	29.730	995,509.05	
HOWMET AEROSPACE INC	42,926	116.000	4,979,416.00	
HP INC	108,366	36.870	3,995,454.42	
HUBBELL INC	5,946	452.370	2,689,792.02	

HUBSPOT INC	5,363	682.530	3,660,408.39	
HUMANA INC	13,350	277.780	3,708,363.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	160,565	17.540	2,816,310.10	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,370	191.610	837,335.70	
HYATT HOTELS CORP - CL A	4,988	153.180	764,061.84	
IDEX CORP	8,397	223.610	1,877,653.17	
IDEXX LABORATORIES INC	9,145	416.340	3,807,429.30	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	33,055	266.460	8,807,835.30	
ILLUMINA INC	17,655	135.000	2,383,425.00	
INCYTE CORP	18,048	70.560	1,273,466.88	
INGERSOLL-RAND INC	44,670	102.380	4,573,314.60	
INSULET CORP	7,759	261.990	2,032,780.41	
INTEL CORP	471,551	24.200	11,411,534.20	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	63,519	157.930	10,031,555.67	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	101,742	210.250	21,391,255.50	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	28,296	88.930	2,516,363.28	
INTERNATIONAL PAPER CO	36,552	57.840	2,114,167.68	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	41,816	27.660	1,156,630.56	
INTUIT INC	30,961	644.170	19,944,147.37	
INTUITIVE SURGICAL INC	39,282	538.820	21,165,927.24	
IQVIA HOLDINGS INC	20,175	191.330	3,860,082.75	
JABIL CIRCUIT INC	12,555	127.550	1,601,390.25	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,083	171.630	1,387,285.29	
JACOBS SOLUTIONS INC	13,867	133.520	1,851,521.84	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	43.150	763,755.00	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,141	180.180	1,647,025.38	
JM SMUCKER CO	11,795	111.910	1,319,978.45	
JOHNSON & JOHNSON	266,575	153.000	40,785,975.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	74,612	83.530	6,232,340.36	
JPMORGAN CHASE & CO	318,041	243.090	77,312,586.69	
JUNIPER NETWORKS INC	36,055	35.080	1,264,809.40	
KELLANOVA	30,315	80.550	2,441,873.25	
KENVUE INC	212,172	23.690	5,026,354.68	
KEURIG DR PEPPER INC	120,131	31.520	3,786,529.12	
KEYCORP	104,481	19.000	1,985,139.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	19,330	152.130	2,940,672.90	
KIMBERLY-CLARK CORP	37,310	135.610	5,059,609.10	
KINDER MORGAN INC	221,247	28.080	6,212,615.76	
KKR & CO INC -A	68,785	152.780	10,508,972.30	

KLA CORPORATION	14,911	615.660	9,180,106.26	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	17,908	56.490	1,011,622.92	
KRAFT HEINZ CO/THE	100,926	30.580	3,086,317.08	
KROGER CO	75,937	58.100	4,411,939.70	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,018	243.580	5,119,564.44	
LABCORP HOLDINGS INC	9,337	236.230	2,205,679.51	
LAM RESEARCH CORP	144,800	70.170	10,160,616.00	
LAMB WESTON HOLDING INC	16,016	75.070	1,202,321.12	
LAS VEGAS SANDS CORP	41,268	49.180	2,029,560.24	
LEIDOS HOLDINGS INC	14,222	158.290	2,251,200.38	
LENNAR CORP-CL A	26,762	168.750	4,516,087.50	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,548	623.590	2,212,497.32	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	23,038	81.240	1,871,607.12	
LINDE PLC	53,239	444.060	23,641,310.34	
LIVE NATION INC	17,814	134.440	2,394,914.16	
LKQ CORP	29,584	37.600	1,112,358.40	
LOCKHEED MARTIN CORP	23,923	533.260	12,757,178.98	
LOEWS CORP	20,767	84.120	1,746,920.04	
LOWE'S COS INC	63,113	259.260	16,362,676.38	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	8,275	314.530	2,602,735.75	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,618	301.850	3,808,743.30	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	28,869	82.200	2,373,031.80	
M&T BANK CORP	18,483	213.710	3,950,001.93	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	6,815	270.740	1,845,093.10	
MARATHON OIL CORP	62,284	28.750	1,790,665.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	38,993	158.800	6,192,088.40	
MARKEL GROUP INC	1,438	1,670.330	2,401,934.54	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,201	267.810	1,125,069.81	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	26,878	279.270	7,506,219.06	
MARSH & MCLENNAN COS INC	54,659	220.730	12,064,881.07	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,824	582.700	3,976,344.80	
MARVELL TECHNOLOGY INC	95,880	89.340	8,565,919.20	
MASCO CORP	24,375	76.170	1,856,643.75	
MASTERCARD INC-CLASS A	91,956	519.460	47,767,463.76	
MATCH GROUP INC	27,970	30.290	847,211.30	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	27,924	75.310	2,102,956.44	
MCDONALD'S CORP	79,830	290.730	23,208,975.90	
MCKESSON CORP	14,364	615.650	8,843,196.60	
MEDTRONIC PLC	142,051	85.000	12,074,335.00	
MERCADOLIBRE INC	5,054	1,916.510	9,686,041.54	
MERCK & CO INC	280,553	96.540	27,084,586.62	
META PLATFORMS INC-A	242,715	561.090	136,184,959.35	
METLIFE INC	66,939	82.630	5,531,169.57	

METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,365	1,160.670	2,744,984.55	
MGM MIRAGE	25,998	37.270	968,945.46	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	59,420	64.880	3,855,169.60	
MICRON TECHNOLOGY INC	122,808	97.730	12,002,025.84	
MICROSOFT CORP	782,017	417.790	326,718,882.43	
MICROSTRATEGY INC-CL A	17,469	430.540	7,521,103.26	
MODERNA INC	36,099	37.290	1,346,131.71	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,491	282.500	1,833,707.50	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	20,590	60.800	1,251,872.00	
MONDAY.COM LTD	4,134	257.020	1,062,520.68	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	148,572	63.870	9,489,293.64	
MONGODB INC	8,126	289.150	2,349,632.90	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,391	585.870	3,158,425.17	
MONSTER BEVERAGE CORP	81,861	53.730	4,398,391.53	
MOODY'S CORP	18,198	468.780	8,530,858.44	
MORGAN STANLEY	134,992	132.240	17,851,342.08	
MOSAIC CO/THE	35,572	25.390	903,173.08	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,473	487.460	9,004,848.58	
MSCI INC	8,774	597.130	5,239,218.62	
NASDAQ INC	47,895	80.160	3,839,263.20	
NETAPP INC	22,788	122.200	2,784,693.60	
NETFLIX INC	47,724	871.320	41,582,875.68	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,151	119.130	1,328,418.63	
NEWMONT CORP	127,671	43.180	5,512,833.78	
NEWS CORP - CLASS A	41,920	28.800	1,207,296.00	
NEXTERA ENERGY INC	227,549	77.080	17,539,476.92	
NIKE INC	134,202	73.910	9,918,869.82	
NISOURCE INC	49,616	37.110	1,841,249.76	
NORDSON CORP	6,029	249.860	1,506,405.94	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,024	259.710	6,498,983.04	
NORTHERN TRUST CORP	22,652	107.840	2,442,791.68	
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,576	491.020	7,648,127.52	
NRG ENERGY INC	23,084	94.860	2,189,748.24	
NUCOR CORP	26,556	144.680	3,842,122.08	
NVIDIA CORP	2,724,610	147.010	400,544,916.10	
NVR INC	346	8,955.130	3,098,474.98	
NXP SEMICONDUCTORS NV	28,314	219.910	6,226,531.74	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,523	1,200.590	7,831,448.57	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	73,597	50.500	3,716,648.50	
OKTA INC	17,829	74.510	1,328,438.79	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	21,652	211.800	4,585,893.60	
OMNICOM GROUP	21,682	98.040	2,125,703.28	

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	47,641	66.650	3,175,272.65	
ONEOK INC	64,634	113.110	7,310,751.74	
ORACLE CORP	183,328	188.900	34,630,659.20	
OTIS WORLDWIDE CORP	44,785	100.280	4,491,039.80	
OVINTIV INC	29,461	44.600	1,313,960.60	
OWENS CORNING	9,580	194.090	1,859,382.20	
PACCAR INC	58,073	110.380	6,410,097.74	
PACKAGING CORP OF AMERICA	9,943	238.310	2,369,516.33	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	224,295	62.980	14,126,099.10	
PALO ALTO NETWORKS INC	35,861	388.060	13,916,219.66	
PARAMOUNT GLOBAL	66,001	10.330	681,790.33	
PARKER HANNIFIN CORP	14,235	689.760	9,818,733.60	
PAYCHEX INC	35,912	140.660	5,051,381.92	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,640	216.920	1,223,428.80	
PAYPAL HOLDINGS INC	110,073	84.090	9,256,038.57	
PENTAIR PLC	18,374	104.750	1,924,676.50	
PEPSICO INC	152,145	156.720	23,844,164.40	
PFIZER INC	627,777	25.100	15,757,202.70	
PG&E CORP	224,669	21.000	4,718,049.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	172,192	129.540	22,305,751.68	
PHILLIPS 66	46,939	130.940	6,146,192.66	
PINTEREST INC- CLASS A	66,389	29.690	1,971,089.41	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	44,085	204.860	9,031,253.10	
POOL CORP	4,248	362.710	1,540,792.08	
PPG INDUSTRIES INC	25,976	121.080	3,145,174.08	
PPL CORPORATION	81,634	34.140	2,786,984.76	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,954	84.180	2,184,807.72	
PROCTER & GAMBLE CO	261,429	170.760	44,641,616.04	
PROGRESSIVE CORP	64,872	254.510	16,510,572.72	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39,742	124.610	4,952,250.62	
PTC INC	13,248	189.270	2,507,448.96	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	55,131	90.090	4,966,751.79	
PULTE GROUP INC	23,273	128.510	2,990,813.23	
PURE STORAGE INC - CLASS A	34,222	49.900	1,707,677.80	
QORVO INC	10,518	66.280	697,133.04	
QUALCOMM INC	123,607	164.710	20,359,308.97	
QUANTA SERVICES INC	16,212	330.780	5,362,605.36	
QUEST DIAGNOSTICS	12,308	161.160	1,983,557.28	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,800	162.620	3,545,116.00	

REGENERON PHARMACEUTICALS	12,002	744.600	8,936,689.20	
REGIONS FINANCIAL CORP	101,419	26.260	2,663,262.94	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	6,357	309.030	1,964,503.71	
REPUBLIC SERVICES INC	24,416	210.910	5,149,578.56	
RESMED INC	16,271	238.120	3,874,450.52	
REVVITY INC	13,667	109.910	1,502,139.97	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	82,111	10.170	835,068.87	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	58,519	35.240	2,062,209.56	
ROBLOX CORP -CLASS A	52,406	52.240	2,737,689.44	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,627	278.140	3,512,073.78	
ROKU INC	14,073	73.610	1,035,913.53	
ROLLINS INC	32,194	49.510	1,593,924.94	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,854	547.960	6,495,517.84	
ROSS STORES INC	36,945	139.260	5,144,960.70	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,070	234.670	6,352,516.90	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	42,612	26.010	1,108,338.12	
RPM INTERNATIONAL INC	14,257	134.980	1,924,409.86	
RTX CORPORATION	147,269	118.960	17,519,120.24	
S&P GLOBAL INC	35,454	502.310	17,808,898.74	
SALESFORCE INC	107,323	323.430	34,711,477.89	
SAMSARA INC-CL A	22,975	52.230	1,199,984.25	
SCHLUMBERGER LTD	158,323	43.100	6,823,721.30	
SEA LTD-ADR	40,999	113.680	4,660,766.32	
SEAGATE TECHNOLOGY	22,090	97.800	2,160,402.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,326	79.460	979,423.96	
SEMPRA	70,078	93.380	6,543,883.64	
SERVICENOW INC	22,704	1,022.100	23,205,758.40	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26,675	373.500	9,963,112.50	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17,774	83.560	1,485,195.44	
SMITH (A.O.) CORP	13,384	71.410	955,751.44	
SMURFIT WESTROCK PLC	57,509	53.160	3,057,178.44	
SNAP INC - A	115,269	10.510	1,211,477.19	
SNAP-ON INC	5,838	354.740	2,070,972.12	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	33,380	130.240	4,347,411.20	
SOLVENTUM CORP	16,248	67.050	1,089,428.40	
SOUTHERN CO	121,092	88.290	10,691,212.68	
SOUTHWEST AIRLINES CO	16,659	32.360	539,085.24	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	24,618	72.900	1,794,652.20	
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,054	86.310	1,471,930.74	
STARBUCKS CORP	125,479	98.350	12,340,859.65	
STATE STREET CORP	33,124	94.710	3,137,174.04	
STEEL DYNAMICS INC	16,528	140.240	2,317,886.72	
STERIS PLC	10,949	212.000	2,321,188.00	

STRYKER CORP	37,972	388.680	14,758,956.96	
SUPER MICRO COMPUTER INC	58,360	28.270	1,649,837.20	
SYNCHRONY FINANCIAL	43,729	63.650	2,783,350.85	
SYNOPSYS INC	16,967	534.020	9,060,717.34	
SYSCO CORP	55,171	74.400	4,104,722.40	
T ROWE PRICE GROUP INC	24,735	117.950	2,917,493.25	
T-MOBILE US INC	58,772	233.200	13,705,630.40	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	18,419	186.010	3,426,118.19	
TARGA RESOURCES CORP	23,299	203.570	4,742,977.43	
TARGET CORP	51,244	156.000	7,994,064.00	
TE CONNECTIVITY PLC	33,824	146.950	4,970,436.80	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,256	464.820	2,443,093.92	
TELEFLEX INC	5,215	193.070	1,006,860.05	
TERADYNE INC	17,289	102.800	1,777,309.20	
TESLA, INC.	317,904	346.000	109,994,784.00	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	123,989	16.810	2,084,255.09	
TEXAS INSTRUMENTS INC	100,850	201.070	20,277,909.50	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,164	1,420.130	3,073,161.32	
TEXTRON INC	21,096	81.280	1,714,682.88	
THE CIGNA GROUP	31,463	322.500	10,146,817.50	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	42,277	509.120	21,524,066.24	
TJX COS INC	125,164	119.560	14,964,607.84	
TOAST INC-CLASS A	40,155	42.500	1,706,587.50	
TORO CO	11,518	80.820	930,884.76	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,943	272.850	3,258,647.55	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	49,309	119.420	5,888,480.78	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	12,863	134.460	1,729,558.98	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	25,067	413.030	10,353,423.01	
TRANSDIGM GROUP INC	6,197	1,250.620	7,750,092.14	
TRANSUNION	21,504	97.040	2,086,748.16	
TRAVELERS COS INC/THE	25,362	259.270	6,575,605.74	
TRIMBLE INC	27,046	69.670	1,884,294.82	
TRUIST FINANCIAL CORP	148,246	46.630	6,912,710.98	
TWILIO INC - A	18,020	96.350	1,736,227.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,702	599.680	2,819,695.36	
TYSON FOODS INC-CL A	31,713	62.920	1,995,381.96	
U-HAUL HOLDING CO	10,737	60.250	646,904.25	
UBER TECHNOLOGIES INC	208,285	69.130	14,398,742.05	
ULTA BEAUTY INC	5,286	342.170	1,808,710.62	
UNION PACIFIC CORP	67,575	233.290	15,764,571.75	
UNITED PARCEL SERVICE INC	80,807	133.200	10,763,492.40	
UNITED RENTALS INC	7,373	821.160	6,054,412.68	

UNITED THERAPEUTICS CORP	4,667	360.710	1,683,433.57	
UNITEDHEALTH GROUP INC	101,942	577.000	58,820,534.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,605	196.790	1,299,797.95	
US BANCORP	172,845	50.400	8,711,388.00	
VALERO ENERGY CORP	36,194	142.010	5,139,909.94	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17,010	209.890	3,570,228.90	
VERALTO CORP	27,330	103.980	2,841,773.40	
VERISIGN INC	9,929	178.250	1,769,844.25	
VERISK ANALYTICS INC	15,797	281.640	4,449,067.08	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	466,892	41.930	19,576,781.56	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,581	448.010	12,804,573.81	
VERTIV HOLDINGS CO	39,386	140.940	5,551,062.84	
VIATRIS INC	131,933	13.050	1,721,725.65	
VISA INC-CLASS A SHARES	174,353	311.850	54,371,983.05	
VISTRA CORP	38,471	154.860	5,957,619.06	
VULCAN MATERIALS CO	14,643	278.010	4,070,900.43	
WABTEC CORP	19,525	196.120	3,829,243.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	81,585	8.290	676,339.65	
WALMART INC	489,963	86.600	42,430,795.80	
WALT DISNEY CO	201,932	112.420	22,701,195.44	
WARNER BROS DISCOVERY INC	258,044	9.500	2,451,418.00	
WASTE CONNECTIONS INC	28,576	187.500	5,358,000.00	
WASTE MANAGEMENT INC	44,429	219.050	9,732,172.45	
WATERS CORP	6,569	344.710	2,264,399.99	
WATSCO INC	3,849	533.140	2,052,055.86	
WEC ENERGY GROUP INC	34,998	99.050	3,466,551.90	
WELLS FARGO & CO	386,118	73.430	28,352,644.74	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,070	304.100	2,454,087.00	
WESTERN DIGITAL CORP	36,158	65.290	2,360,755.82	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,270	126.950	542,076.50	
WEYERHAEUSER CO	80,759	30.680	2,477,686.12	
WILLIAMS COS INC	134,959	58.600	7,908,597.40	
WILLIAMS-SONOMA INC	14,241	137.240	1,954,434.84	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,322	307.590	3,482,533.98	
WIX.COM LTD	5,850	183.950	1,076,107.50	
WORKDAY INC-CLASS A	23,481	259.900	6,102,711.90	
WR BERKLEY CORP	33,994	60.190	2,046,098.86	
WW GRAINGER INC	4,891	1,172.070	5,732,594.37	
WYNN RESORTS LTD	11,163	91.250	1,018,623.75	
XCEL ENERGY INC	61,567	69.570	4,283,216.19	
XYLEM INC	26,858	122.230	3,282,853.34	
YUM! BRANDS INC	31,204	132.140	4,123,296.56	

	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,695	382.400	2,177,768.00	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	17,417	75.250	1,310,629.25	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,774	110.950	2,526,775.30	
	ZOETIS INC	50,541	175.560	8,872,977.96	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	27,751	77.750	2,157,640.25	
	ZSCALER INC	10,045	204.360	2,052,796.20	
アメリカ・ドル　小計		40,843,407		5,639,180,939.13 (873,565,519,281)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	107,666	34.670	3,732,780.22	
	ADMIRAL GROUP PLC	28,872	25.040	722,954.88	
	ANGLO AMERICAN PLC	140,715	23.045	3,242,777.17	
	ANTOFAGASTA PLC	43,565	16.750	729,713.75	
	ASHTEAD GROUP PLC	48,418	61.460	2,975,770.28	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	37,142	21.650	804,124.30	
	ASTRAZENECA PLC	171,703	100.240	17,211,508.72	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	98,996	8.022	794,145.91	
	AVIVA PLC	296,504	4.859	1,440,712.93	
	BAE SYSTEMS PLC	335,592	13.125	4,404,645.00	
	BARCLAYS PLC	1,634,273	2.558	4,180,470.33	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	152,790	4.079	623,230.41	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	11,272	43.700	492,586.40	
	BP PLC	1,830,756	3.828	7,008,133.96	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	221,326	29.060	6,431,733.56	
	BT GROUP PLC	722,278	1.498	1,081,972.44	
	BUNZL PLC	37,448	34.400	1,288,211.20	
	CENTRICA PLC	579,400	1.210	701,074.00	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	24,137	27.540	664,732.98	
	COMPASS GROUP PLC	188,338	26.290	4,951,406.02	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	14,720	35.130	517,113.60	
	DCC PLC	10,949	56.750	621,355.75	
	DIAGEO PLC	246,260	23.635	5,820,355.10	
	ENDEAVOUR MINING PLC	20,284	15.670	317,850.28	
	ENTAIN PLC	70,901	7.504	532,041.10	
	EXPERIAN PLC	101,716	36.750	3,738,063.00	
	GLENCORE PLC	1,148,264	3.794	4,356,513.61	
	GSK PLC	459,088	13.035	5,984,212.08	
	HALEON PLC	808,983	3.670	2,968,967.61	
	HALMA PLC	42,019	25.130	1,055,937.47	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	39,398	10.875	428,453.25	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,417	18.380	338,504.46	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,051,048	7.243	14,855,740.66	

IMPERIAL BRANDS PLC	89,901	24.750	2,225,049.75	
INFORMA PLC	147,456	8.444	1,245,118.46	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	17,845	94.820	1,692,062.90	
INTERTEK GROUP PLC	17,867	44.920	802,585.64	
JD SPORTS FASHION PLC	286,992	1.168	335,206.65	
KINGFISHER PLC	203,671	2.862	582,906.40	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	661,363	2.177	1,439,787.25	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,908,993	0.553	3,820,673.12	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	52,953	107.300	5,681,856.90	
M&G PLC	250,934	2.005	503,122.67	
MELROSE INDUSTRIES PLC	145,562	5.120	745,277.44	
MONDI PLC/WI	48,879	11.640	568,951.56	
NATIONAL GRID PLC	532,937	9.878	5,264,351.68	
NATWEST GROUP PLC	735,844	3.920	2,884,508.48	
NEXT PLC	13,265	94.780	1,257,256.70	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
PEARSON PLC	66,524	12.000	798,288.00	
PERSIMMON PLC	35,447	12.795	453,544.36	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	78,255	5.040	394,405.20	
PRUDENTIAL PLC	303,723	6.248	1,897,661.30	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	77,356	47.500	3,674,410.00	
RELX PLC	206,733	35.680	7,376,233.44	
RENTOKIL INITIAL PLC	279,703	4.042	1,130,559.52	
RIO TINTO PLC	124,847	48.935	6,109,387.94	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	941,715	5.276	4,968,488.34	
SAGE GROUP PLC	111,012	10.770	1,195,599.24	
SAINSBURY (J) PLC	183,068	2.484	454,740.91	
SCHRODERS PLC	89,602	3.110	278,662.22	
SEVERN TRENT PLC	29,911	26.890	804,306.79	
SHELL PLC-NEW	697,820	25.725	17,951,419.50	
SMITH & NEPHEW PLC	96,801	9.882	956,587.48	
SMITHS GROUP PLC	38,162	16.920	645,701.04	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,167	65.400	534,121.80	
SSE PLC	120,924	17.130	2,071,428.12	
STANDARD CHARTERED PLC	240,083	9.470	2,273,586.01	
TAYLOR WIMPEY PLC	392,525	1.300	510,282.50	
TESCO PLC	766,458	3.479	2,666,507.38	
UNILEVER PLC	276,303	45.570	12,591,127.71	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	75,532	10.965	828,208.38	
VODAFONE GROUP PLC	2,532,953	0.707	1,790,797.77	
WHITBREAD PLC	19,960	28.810	575,047.60	
WISE PLC - A	73,785	8.365	617,211.52	

	WPP PLC	119,486	8.156	974,527.81	
イギリス・ポンド　小計		29,849,313		208,589,354.66 (41,008,667,126)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	4,737	287.700	1,362,834.90	
	BANK HAPOALIM BM	140,730	41.870	5,892,365.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	168,008	40.600	6,821,124.80	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,958	927.600	2,743,840.80	
	ICL GROUP LTD	86,000	16.450	1,414,700.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	136,994	23.490	3,217,989.06	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,180	159.100	2,733,338.00	
	NICE LTD	7,027	654.000	4,595,658.00	
イスラエル・シュケル　小計		563,634		28,781,850.66 (1,191,214,601)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	26,392	29.240	771,702.08	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	333,292	32.340	10,778,663.28	
	APA GROUP	142,708	7.160	1,021,789.28	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	62,877	68.930	4,334,111.61	
	ASX LTD	21,498	66.910	1,438,431.18	
	BHP GROUP LIMITED	561,657	40.310	22,640,393.67	
	BLUESCOPE STEEL LTD	48,665	21.100	1,026,831.50	
	BRAMBLES LTD	154,255	19.600	3,023,398.00	
	CARSALES.COM LTD	39,699	41.840	1,661,006.16	
	COCHLEAR LTD	7,251	301.110	2,183,348.61	
	COLES GROUP LTD	148,267	18.340	2,719,216.78	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	185,323	155.610	28,838,112.03	
	COMPUTERSHARE LIMITED	58,926	30.900	1,820,813.40	
	CSL LIMITED	53,526	271.360	14,524,815.36	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	168,757	4.390	740,843.23	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	187,670	17.750	3,331,142.50	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	262,192	8.240	2,160,462.08	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	47,757	55.910	2,670,093.87	
	LOTTERY CORP LTD/THE	246,127	5.090	1,252,786.43	
	MACQUARIE GROUP LTD	40,184	231.050	9,284,513.20	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	305,164	3.800	1,159,623.20	
	MINERAL RESOURCES LTD	19,580	34.850	682,363.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	342,530	39.540	13,543,636.20	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	126,943	16.900	2,145,336.70	
	ORICA LTD	53,871	18.320	986,916.72	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	190,792	10.710	2,043,382.32	
	PILBARA MINERALS LTD	316,722	2.930	927,995.46	
	PRO MEDICUS LTD	6,352	212.590	1,350,371.68	

	QANTAS AIRWAYS LTD	87,753	8.970	787,144.41	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	166,332	19.580	3,256,780.56	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	20,394	38.600	787,208.40	
	REA GROUP LTD	5,842	249.110	1,455,300.62	
	REECE LTD	24,995	24.840	620,875.80	
	RIO TINTO LTD	41,088	115.700	4,753,881.60	
	SANTOS LTD	359,772	6.840	2,460,840.48	
	SEEK LTD	39,560	26.440	1,045,966.40	
	SGH LTD	22,523	47.710	1,074,572.33	
	SONIC HEALTHCARE LTD	50,604	27.990	1,416,405.96	
	SOUTH32 LTD	501,374	3.670	1,840,042.58	
	SUNCORP GROUP LTD	140,785	19.730	2,777,688.05	
	TELSTRA GROUP LTD	457,454	3.940	1,802,368.76	
	TRANSURBAN GROUP	343,082	12.610	4,326,264.02	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	89,942	11.130	1,001,054.46	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	25,963	34.730	901,694.99	
	WESFARMERS LIMITED	125,663	71.170	8,943,435.71	
	WESTPAC BANKING CORP	383,461	33.390	12,803,762.79	
	WISETECH GLOBAL LTD	18,462	138.840	2,563,264.08	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	210,489	24.560	5,169,609.84	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	135,271	30.200	4,085,184.20	
	XERO LTD	16,053	176.880	2,839,454.64	
オーストラリア・ドル　小計		7,425,839		205,774,900.21 (20,844,997,391)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	55,243	115.190	6,363,441.17	
	AIR CANADA	19,716	23.400	461,354.40	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	84,886	77.590	6,586,304.74	
	ALTAGAS LTD	33,262	34.620	1,151,530.44	
	ARC RESOURCES LTD	66,561	25.570	1,701,964.77	
	BANK OF MONTREAL	80,931	131.410	10,635,142.71	
	BANK OF NOVA SCOTIA	136,567	78.380	10,704,121.46	
	BARRICK GOLD CORP	194,574	24.760	4,817,652.24	
	BCE INC	9,932	38.140	378,806.48	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	39,549	77.750	3,074,934.75	
	BROOKFIELD CORPORATION-A	150,875	79.300	11,964,387.50	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	15,093	42.910	647,640.63	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,975	67.880	269,823.00	
	CAE INC	35,517	31.370	1,114,168.29	
	CAMECO CORP	48,192	80.220	3,865,962.24	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	104,719	89.850	9,409,002.15	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	59,647	149.080	8,892,174.76	

CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	235,929	47.040	11,098,100.16	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	103,417	103.070	10,659,190.19	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,852	152.140	890,323.28	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	15,350	35.460	544,311.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	16,770	76.110	1,276,364.70	
CENOVUS ENERGY INC	154,632	22.420	3,466,849.44	
CGI INC	22,661	153.300	3,473,931.30	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,232	4,436.100	9,901,375.20	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	9,532	158.690	1,512,633.08	
DOLLARAMA INC	31,510	148.750	4,687,112.50	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	45,018	28.840	1,298,319.12	
EMERA INC	32,387	51.920	1,681,533.04	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,319	40.560	621,338.64	
ENBRIDGE INC	241,677	59.950	14,488,536.15	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,297	1,922.730	4,416,510.81	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	78,675	18.370	1,445,259.75	
FIRSTSERVICE CORP	4,530	260.030	1,177,935.90	
FORTIS INC	55,044	62.500	3,440,250.00	
FRANCO-NEVADA CORP	21,347	169.420	3,616,608.74	
GEORGE WESTON LTD	6,670	215.100	1,434,717.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	24,321	63.650	1,548,031.65	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	16,595	68.300	1,133,438.50	
GREAT-WEST LIFECO INC	31,318	49.560	1,552,120.08	
HYDRO ONE LTD	36,883	45.010	1,660,103.83	
IA FINANCIAL CORP INC	10,600	133.090	1,410,754.00	
IGM FINANCIAL INC	9,575	46.360	443,897.00	
IMPERIAL OIL LTD	20,847	105.980	2,209,365.06	
INTACT FINANCIAL CORP	19,839	269.070	5,338,079.73	
IVANHOE MINES LTD-CL A	74,625	18.690	1,394,741.25	
KEYERA CORP	25,660	45.130	1,158,035.80	
KINROSS GOLD CORP	136,050	13.940	1,896,537.00	
LOBLAW COS LTD	17,028	175.200	2,983,305.60	
LUNDIN MINING CORP	73,441	14.240	1,045,799.84	
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,405	59.760	1,817,002.80	
MANULIFE FINANCIAL CORP	197,967	45.510	9,009,478.17	
MEG ENERGY CORP	30,071	25.360	762,600.56	
METRO INC	23,900	86.280	2,062,092.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	37,679	135.500	5,105,504.50	
NUTRIEN LTD	54,948	63.630	3,496,341.24	
ONEX CORPORATION	7,275	111.180	808,834.50	

	OPEN TEXT CORP	29,841	39.880	1,190,059.08	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	40,190	31.750	1,276,032.50	
	PARKLAND CORP	15,659	34.410	538,826.19	
	PEMBINA PIPELINE CORP	64,507	59.260	3,822,684.82	
	POWER CORP OF CANADA	62,891	46.130	2,901,161.83	
	QUEBECOR INC -CL B	18,288	31.760	580,826.88	
	RB GLOBAL INC	20,388	130.750	2,665,731.00	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	33,398	97.000	3,239,606.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	40,166	49.980	2,007,496.68	
	ROYAL BANK OF CANADA	156,861	171.690	26,931,465.09	
	SAPUTO INC	28,497	26.050	742,346.85	
	SHOPIFY INC - CLASS A	133,981	145.990	19,559,886.19	
	STANTEC INC	12,724	116.010	1,476,111.24	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	64,390	84.250	5,424,857.50	
	SUNCOR ENERGY INC	141,516	57.210	8,096,130.36	
	TC ENERGY CORP	115,137	69.600	8,013,535.20	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	51,012	65.820	3,357,609.84	
	TFI INTERNATIONAL INC	8,914	199.370	1,777,184.18	
	THOMSON REUTERS CORP	17,488	224.480	3,925,706.24	
	TMX GROUP LTD	30,959	43.470	1,345,787.73	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,200	116.000	1,067,200.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	193,815	77.980	15,113,693.70	
	TOURMALINE OIL CORP	37,153	62.650	2,327,635.45	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,166	129.100	796,030.60	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	50,225	87.400	4,389,665.00	
	WSP GLOBAL INC	13,882	239.440	3,323,906.08	
カナダ・ドル　小計		4,516,363		335,896,851.07 (37,277,832,532)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	259,900	2.810	730,319.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	220,620	42.570	9,391,793.40	
	GENTING SINGAPORE LTD	670,100	0.770	515,977.00	
	KEPPEL CORP LTD	161,200	6.720	1,083,264.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	374,800	16.480	6,176,704.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	98,300	5.190	510,177.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	164,800	6.350	1,046,480.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	94,900	12.090	1,147,341.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	172,900	4.580	791,882.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	830,800	3.230	2,683,484.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	140,000	36.430	5,100,200.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	213,200	3.100	660,920.00	
シンガポール・ドル　小計		3,401,520		29,838,541.40 (3,457,093,407)	

スイス・フラン	ABB LTD	175,081	49.010	8,580,719.81	
	ADECCO GROUP AG-REG	18,721	23.600	441,815.60	
	ALCON INC	55,322	75.600	4,182,343.20	
	AVOLTA AG	10,126	33.260	336,790.76	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	3,739	67.100	250,886.90	
	BALOISE HOLDING AG	4,822	166.600	803,345.20	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,360	87.300	293,328.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	396	1,316.000	521,136.00	
	BKW AG	2,329	148.400	345,623.60	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	108	10,010.000	1,081,080.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	12	98,600.000	1,183,200.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	59,538	118.900	7,079,068.20	
	CLARIANT AG	23,907	11.080	264,889.56	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	777	629.500	489,121.50	
	GALDERMA GROUP AG	5,261	85.940	452,130.34	
	GEBERIT AG-REG	3,700	518.200	1,917,340.00	
	GIVAUDAN-REG	1,022	3,870.000	3,955,140.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	4,112	150.700	619,678.40	
	HOLCIM LTD	57,665	88.460	5,101,045.90	
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,833	52.400	1,196,449.20	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,348	210.400	1,125,219.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	17,245	68.920	1,188,525.40	
	LONZA GROUP AG	7,999	513.600	4,108,286.40	
	NESTLE SA	290,194	76.660	22,246,272.04	
	NOVARTIS AG	218,282	91.060	19,876,758.92	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,512	1,209.000	3,037,008.00	
	ROCHE HOLDING AG	77,798	250.500	19,488,399.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	3,560	266.200	947,672.00	
	SANDOZ GROUP AG	45,334	39.730	1,801,119.82	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,616	245.500	642,228.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,491	252.800	1,135,324.80	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	17,048	86.920	1,481,812.16	
	SIG GROUP AG	33,924	17.800	603,847.20	
	SIKA AG-BEARER	16,880	231.500	3,907,720.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,609	300.400	1,684,943.60	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,358	110.950	1,371,120.10	
	SWATCH GROUP AG	3,199	162.900	521,117.10	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,179	716.800	2,278,707.20	

	SWISS PRIME SITE-REG	8,564	94.050	805,444.20	
	SWISS RE AG	33,408	125.250	4,184,352.00	
	SWISSCOM AG	2,913	508.500	1,481,260.50	
	TEMENOS GROUP AG-REG	6,663	59.200	394,449.60	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,895	32.300	190,408.50	
	UBS GROUP AG	364,164	28.130	10,243,933.32	
	VAT GROUP AG	2,990	341.800	1,021,982.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,211	530.800	8,604,798.80	
スイス・フラン　小計		1,661,215		153,467,842.03 (26,936,675,633)	
スウェーデン・クローナ	ADDTECH AB-B SHARES	28,748	289.400	8,319,671.20	
	ALFA LAVAL AB	32,006	467.600	14,966,005.60	
	ASSA ABLOY AB	110,946	324.900	36,046,355.40	
	ATLAS COPCO AB	172,984	151.650	26,233,023.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	297,355	173.000	51,442,415.00	
	BEIJER REF AB	39,980	160.250	6,406,795.00	
	BIOVITRUM	21,591	302.000	6,520,482.00	
	BOLIDEN AB	30,256	318.600	9,639,561.60	
	EPIROC AB-A	72,920	196.050	14,295,966.00	
	EPIROC AB-B	43,271	176.500	7,637,331.50	
	EQT AB	41,349	291.900	12,069,773.10	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	67,445	296.100	19,970,464.50	
	EVOLUTION AB	19,947	984.200	19,631,837.40	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	73,322	81.060	5,943,481.32	
	GETINGE AB-B SHS	25,318	171.100	4,331,909.80	
	HENNES & MAURITZ AB	62,784	152.850	9,596,534.40	
	HEXAGON AB-B SHS	229,974	93.040	21,396,780.96	
	HOLMEN AB-B SHARES	8,423	412.000	3,470,276.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,913	61.160	2,379,919.08	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	14,280	355.000	5,069,400.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,723	355.000	5,936,665.00	
	INDUTRADE AB	30,230	273.000	8,252,790.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	16,361	272.800	4,463,280.80	
	INVESTOR AB	191,404	295.900	56,636,443.60	
	LIFCO AB-B SHS	25,779	313.600	8,084,294.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	8,352	527.000	4,401,504.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	167,997	47.490	7,978,177.53	
	SAAB AB-B	35,452	248.700	8,816,912.40	
	SAGAX AB-B	24,319	240.800	5,856,015.20	
	SANDVIK AB	118,018	202.400	23,886,843.20	
	SECURITAS AB	54,438	132.800	7,229,366.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	175,629	149.850	26,318,005.65	
	SKANSKA AB-B SHS	37,639	219.400	8,257,996.60	
	SKF AB	37,753	203.300	7,675,184.90	

	SVENSKA CELLULOSA AB	67,069	142.000	9,523,798.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	161,633	110.500	17,860,446.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	94,024	214.300	20,149,343.20	
	TELE2 AB	61,141	112.350	6,869,191.35	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	307,384	88.600	27,234,222.40	
	TELIA CO AB	268,403	31.330	8,409,065.99	
	TRELLEBORG AB-B SHS	23,559	351.600	8,283,344.40	
	VOLVO AB	175,489	266.700	46,802,916.30	
	VOLVO AB-A SHS	22,609	268.400	6,068,255.60	
	VOLVO CAR AB-B	82,307	22.915	1,886,064.90	
スウェーデン・クローナ　小計		3,635,524		622,248,111.78 (8,842,145,668)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	499	12,135.000	6,055,365.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	330	11,660.000	3,847,800.00	
	CARLSBERG AS-B	10,572	714.800	7,556,865.60	
	COLOPLAST-B	13,972	893.200	12,479,790.40	
	DANSKE BANK A/S	76,399	204.500	15,623,595.50	
	DEMANT A/S	10,998	264.800	2,912,270.40	
	DSV A/S	18,952	1,495.000	28,333,240.00	
	GENMAB A/S	6,960	1,446.000	10,064,160.00	
	NOVO-NORDISK A/S	356,702	725.000	258,608,950.00	
	NOVOZYMES A/S	39,019	398.600	15,552,973.40	
	ORSTED A/S	20,942	379.700	7,951,677.40	
	PANDORA A/S	9,073	1,068.500	9,694,500.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,032	2,956.000	3,050,592.00	
	TRYGVESTA AS	37,704	157.800	5,949,691.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	111,857	98.640	11,033,574.48	
	ZEALAND PHARMA A/S	7,076	674.500	4,772,762.00	
デンマーク・クローネ　小計		722,087		403,487,807.88 (8,884,801,530)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	147,030	7.530	1,107,135.90	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	64,818	38.070	2,467,621.26	
	MERCURY NZ LTD	77,078	6.880	530,296.64	
	MERIDIAN ENERGY LTD	143,079	5.990	857,043.21	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	206,177	3.085	636,056.04	
ニュージーランド・ドル　小計		638,182		5,598,153.05 (513,294,653)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	35,036	227.200	7,960,179.20	
	DNB BANK ASA	99,012	228.600	22,634,143.20	
	EQUINOR ASA	92,721	263.300	24,413,439.30	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	22,115	192.200	4,250,503.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	9,721	1,242.000	12,073,482.00	
	MOWI ASA	51,433	198.700	10,219,737.10	

	NORSK HYDRO ASA	155,383	70.960	11,025,977.68	
	ORKLA ASA	77,157	96.350	7,434,076.95	
	SALMAR ASA	7,306	564.000	4,120,584.00	
	TELENOR ASA	69,889	131.000	9,155,459.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,247	315.900	5,764,227.30	
ノルウェー・クローネ　小計		638,020		119,051,808.73 (1,682,202,057)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	50,638	14.825	750,708.35	
	ACCIONA SA	2,734	114.600	313,316.40	
	ACCOR	21,532	43.090	927,813.88	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,281	41.480	841,255.88	
	ADIDAS AG	17,943	213.200	3,825,447.60	
	ADP	3,826	108.400	414,738.40	
	ADYEN NV	2,408	1,230.600	2,963,284.80	
	AEGON LTD	149,162	5.972	890,795.46	
	AENA SME SA	8,297	197.900	1,641,976.30	
	AGEAS	17,683	48.340	854,796.22	
	AIB GROUP PLC	201,067	5.360	1,077,719.12	
	AIR LIQUIDE	64,017	159.240	10,194,067.08	
	AIRBUS SE	65,812	137.260	9,033,355.12	
	AKZO NOBEL NV	18,900	56.000	1,058,400.00	
	ALLIANZ SE	43,380	285.200	12,371,976.00	
	ALSTOM RGPT	38,330	21.270	815,279.10	
	AMADEUS IT GROUP SA	49,856	65.700	3,275,539.20	
	AMPLIFON SPA	13,793	23.600	325,514.80	
	AMUNDI SA	6,791	67.200	456,355.20	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	99,467	53.000	5,271,751.00	
	ARCELORMITTAL	51,834	24.010	1,244,534.34	
	ARGENX SE	6,583	532.200	3,503,472.60	
	ARKEMA	6,233	76.300	475,577.90	
	ASM INTERNATIONAL NV	5,199	491.500	2,555,308.50	
	ASML HOLDING NV	44,256	624.700	27,646,723.20	
	ASR NEDERLAND NV	17,572	45.060	791,794.32	
	AXA SA	201,243	34.040	6,850,311.72	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	638,042	9.328	5,951,655.77	
	BANCO BPM SPA	142,705	6.724	959,548.42	
	BANCO DE SABADELL SA	601,959	1.825	1,098,575.17	
	BANCO SANTANDER SA	1,715,089	4.547	7,798,509.68	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	112,667	8.742	984,934.91	
	BASF SE	98,910	42.810	4,234,337.10	
	BAYER AG	108,785	20.155	2,192,561.67	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	35,287	69.060	2,436,920.22	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,544	64.750	423,724.00	

BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	8,539	107.750	920,077.25	
BECHTLE AG	9,071	32.940	298,798.74	
BEIERSDORF AG	10,976	121.400	1,332,486.40	
BIOMERIEUX	4,579	97.950	448,513.05	
BNP PARIBAS	112,715	59.310	6,685,126.65	
BOLLORE SE	78,796	5.805	457,410.78	
BOUYGUES	21,080	29.140	614,271.20	
BRENNTAG SE	14,396	58.300	839,286.80	
BUREAU VERITAS SA	35,165	28.040	986,026.60	
CAIXABANK	402,620	5.390	2,170,121.80	
CAPGEMINI SA	17,198	156.700	2,694,926.60	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,469	57.200	255,626.80	
CARREFOUR SA	60,108	14.670	881,784.36	
CELLNEX TELECOM SAU	59,070	32.100	1,896,147.00	
CIE DE SAINT-GOBAIN	50,180	88.780	4,454,980.40	
COMMERZBANK AG	111,429	16.045	1,787,878.30	
CONTINENTAL AG	12,183	61.620	750,716.46	
COVESTRO AG	20,927	57.300	1,199,117.10	
CREDIT AGRICOLE SA	117,277	13.355	1,566,234.33	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	6,907	90.600	625,774.20	
D'IETEREN GROUP	2,372	194.600	461,591.20	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	54,694	36.020	1,970,077.88	
DANONE	71,474	65.040	4,648,668.96	
DASSAULT AVIATION SA	2,187	195.400	427,339.80	
DASSAULT SYSTEMES SA	74,109	31.970	2,369,264.73	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	68,167	5.664	386,097.88	
DELIVERY HERO SE	20,510	36.210	742,667.10	
DEUTSCHE BANK AG	209,761	15.896	3,334,360.85	
DEUTSCHE BOERSE AG	21,036	211.500	4,449,114.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	66,268	6.262	414,970.21	
DEUTSCHE TELEKOM AG	388,105	28.720	11,146,375.60	
DHL GROUP	112,939	35.140	3,968,676.46	
DIASORIN ITALIA SPA	2,476	104.350	258,370.60	
DR ING HC F PORSCHE AG	12,627	61.100	771,509.70	
DSM-FIRMENICH AG	20,609	103.850	2,140,244.65	
E.ON SE	248,430	11.660	2,896,693.80	
EDENRED	27,693	28.620	792,573.66	
EDP RENOVAVEIS SA	34,580	10.790	373,118.20	
EDP SA	347,703	3.417	1,188,101.15	
EIFFAGE	8,134	84.720	689,112.48	
ELIA GROUP SA/NV	3,247	83.900	272,423.30	
ELISA OYJ	16,226	43.220	701,287.72	
ENDESA SA	35,147	19.950	701,182.65	
ENEL SPA	900,522	6.643	5,982,167.64	
ENGIE	202,272	15.440	3,123,079.68	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	254,470	13.734	3,494,890.98	

ERSTE GROUP BANK AG	37,276	52.300	1,949,534.80	
ESSILORLUXOTTICA	32,918	234.300	7,712,687.40	
EURAZEO	5,040	69.300	349,272.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,956	45.500	680,498.00	
EURONEXT NV	8,892	103.800	922,989.60	
EVONIK INDUSTRIES AG	28,520	17.515	499,527.80	
EXOR NV	10,929	94.050	1,027,872.45	
FERRARI NV	13,958	406.400	5,672,531.20	
FERROVIAL SE	57,699	36.820	2,124,477.18	
FINECOBANK SPA	67,643	14.470	978,794.21	
FORTUM OYJ	49,585	13.850	686,752.25	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	22,749	41.730	949,315.77	
FRESENIUS SE & CO KGAA	46,746	32.770	1,531,866.42	
GALP ENERGIA SGPS SA	51,407	15.640	804,005.48	
GEA GROUP AG	17,143	45.480	779,663.64	
GENERALI	112,836	26.870	3,031,903.32	
GETLINK SE - REGR	33,495	15.195	508,956.52	
GRIFOLS SA	33,028	10.340	341,509.52	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,211	64.800	596,872.80	
HANNOVER RUECK SE	6,674	238.500	1,591,749.00	
HEIDELBERG MATERIALS AG	15,077	118.300	1,783,609.10	
HEINEKEN HOLDING NV	14,350	61.100	876,785.00	
HEINEKEN NV	31,889	71.200	2,270,496.80	
HENKEL AG & CO KGAA	11,553	70.700	816,797.10	
HENKEL KGAA-VORZUG	18,696	78.600	1,469,505.60	
HERMES INTERNATIONAL	3,507	1,999.500	7,012,246.50	
IBERDROLA SA	675,879	13.400	9,056,778.60	
IMCD NV	6,316	139.000	877,924.00	
INDITEX SA	120,769	51.080	6,168,880.52	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	144,610	29.100	4,208,151.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	39,243	9.560	375,163.08	
ING GROEP NV-CVA	365,718	14.950	5,467,484.10	
INPOST SA	22,110	17.320	382,945.20	
INTESA SANPAOLO	1,620,005	3.714	6,016,698.57	
IPSEN	4,164	107.200	446,380.80	
JDE PEET'S BV	13,572	18.120	245,924.64	
JERONIMO MARTINS	31,431	17.410	547,213.71	
KBC GROEP NV	25,409	70.480	1,790,826.32	
KERING	8,251	215.200	1,775,615.20	
KERRY GROUP PLC-A	17,110	85.600	1,464,616.00	
KESKO OYJ-B SHS	30,250	19.130	578,682.50	
KINGSPAN GROUP PLC	17,111	72.300	1,237,125.30	
KNORR-BREMSE AG	8,027	72.600	582,760.20	
KONE OYJ	37,631	48.700	1,832,629.70	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	103,689	32.560	3,376,113.84	

KONINKLIJKE PHILIPS NV	88,477	24.510	2,168,571.27	
L'OREAL SA	26,646	321.950	8,578,679.70	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	11,312	39.340	445,014.08	
LEG IMMOBILIEN SE	8,251	83.260	686,978.26	
LEGRAND SA	29,027	96.040	2,787,753.08	
LEONARDO SPA	44,746	25.220	1,128,494.12	
LOTUS BAKERIES	45	11,420.000	513,900.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	30,467	577.300	17,588,599.10	
MEDIOBANCA SPA	55,342	14.080	779,215.36	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	82,940	52.870	4,385,037.80	
MERCK KGAA	14,309	139.700	1,998,967.30	
METSO CORPORATION	68,833	8.068	555,344.64	
MICHELIN (C.G.D.E.)	75,189	31.090	2,337,626.01	
MONCLER SPA	24,361	47.320	1,152,762.52	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	5,960	308.400	1,838,064.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	14,809	474.100	7,020,946.90	
NEMETSCHEK SE	6,392	98.950	632,488.40	
NESTE OYJ	46,889	13.660	640,503.74	
NEXI SPA	65,612	5.362	351,811.54	
NN GROUP NV	29,972	44.830	1,343,644.76	
NOKIA OYJ	590,522	3.970	2,344,372.34	
NORDEA BANK ABP	349,407	10.725	3,747,390.07	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	7,544	72.100	543,922.40	
OMV AG	16,366	38.280	626,490.48	
ORANGE S.A.	210,045	9.888	2,076,924.96	
ORION OYJ-CLASS B	11,949	44.550	532,327.95	
PERNOD-RICARD	22,454	108.950	2,446,363.30	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	16,944	34.850	590,498.40	
POSTE ITALIANE SPA	50,602	12.920	653,777.84	
PROSUS	156,971	37.990	5,963,328.29	
PRYSMIAN SPA	29,893	59.940	1,791,786.42	
PUBLICIS GROUPE	25,328	99.300	2,515,070.40	
PUMA AG	11,712	45.890	537,463.68	
QIAGEN NV	24,522	38.645	947,652.69	
RANDSTAD NV	12,030	41.360	497,560.80	
RATIONAL AG	567	870.500	493,573.50	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	11,576	49.900	577,642.40	
REDEIA CORPORACION SA	45,124	16.760	756,278.24	
RENAULT SA	21,268	41.560	883,898.08	
REPSOL SA	134,525	11.785	1,585,377.12	
REXEL SA	25,043	25.560	640,099.08	
RHEINMETALL AG	4,823	604.800	2,916,950.40	

	ROYAL KPN NV	443,354	3.572	1,583,660.48	
	RWE AG	69,968	31.420	2,198,394.56	
	SAFRAN SA	37,845	218.000	8,250,210.00	
	SAMPO OYJ	49,940	39.750	1,985,115.00	
	SANOFI	126,232	91.210	11,513,620.72	
	SAP SE	115,641	219.900	25,429,455.90	
	SARTORIUS AG-VORZUG	2,903	209.000	606,727.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,237	167.850	543,330.45	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	60,547	239.000	14,470,733.00	
	SCOUT24 SE	8,280	84.250	697,590.00	
	SEB SA	2,758	91.100	251,253.80	
	SIEMENS AG	84,164	177.840	14,967,725.76	
	SIEMENS ENERGY AG	70,775	45.700	3,234,417.50	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	31,230	49.340	1,540,888.20	
	SNAM SPA	223,434	4.331	967,692.65	
	SOCIETE GENERALE	79,952	26.160	2,091,544.32	
	SODEXO	9,795	80.700	790,456.50	
	SOFINA	1,710	216.200	369,702.00	
	STELLANTIS NV	234,463	12.388	2,904,527.64	
	STMICROELECTRONICS NV	74,949	23.235	1,741,440.01	
	STORA ENSO OYJ	64,369	9.544	614,337.73	
	SYENSQO SA	8,190	71.790	587,960.10	
	SYMRISE AG	14,702	104.500	1,536,359.00	
	TALANX AG	7,130	78.050	556,496.50	
	TELECOM ITALIA SPA	1,128,378	0.229	258,398.56	
	TELEFONICA SA	447,318	4.329	1,936,439.62	
	TELEPERFORMANCE	6,025	90.880	547,552.00	
	TENARIS SA	52,172	17.390	907,271.08	
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	155,504	7.748	1,204,844.99	
	THALES SA	10,480	153.950	1,613,396.00	
	TOTALENERGIES SE	238,918	57.470	13,730,617.46	
	UCB SA	13,997	164.350	2,300,406.95	
	UNICREDIT SPA	163,079	38.765	6,321,757.43	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	91,211	22.560	2,057,720.16	
	UPM-KYMMENE OYJ	59,115	25.610	1,513,935.15	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	76,354	28.180	2,151,655.72	
	VINCI SA	55,411	100.300	5,557,723.30	
	VIVENDI SA	79,748	8.750	697,795.00	
	VOESTALPINE AG	11,918	18.130	216,073.34	
	VOLKSWAGEN AG	22,860	82.980	1,896,922.80	
	VONOVIA SE	82,042	29.030	2,381,679.26	
	WARTSILA OYJ	55,589	17.745	986,426.80	
	WOLTERS KLUWER NV	27,503	153.300	4,216,209.90	
	ZALANDO SE	24,855	27.250	677,298.75	
ユーロ　小計		20,236,179		549,634,892.38 (90,288,523,771)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,233,875	57.200	70,577,650.00	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	409,539	25.400	10,402,290.60	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	212,909	31.800	6,770,506.20	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	296,909	40.300	11,965,432.70	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	69,500	54.150	3,763,425.00	
	CLP HOLDINGS LTD	181,643	66.550	12,088,341.65	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	241,810	32.750	7,919,277.50	
	HANG SENG BANK LTD	83,812	93.050	7,798,706.60	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	161,641	25.000	4,041,025.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	433,000	9.520	4,122,160.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,239,437	5.990	7,424,227.63	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	133,311	300.400	40,046,624.40	
	MTR CORP	172,755	27.300	4,716,211.50	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	153,087	50.650	7,753,856.55	
	SANDS CHINA LTD	268,180	19.520	5,234,873.60	
	SINO LAND CO	432,000	7.820	3,378,240.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	149,000	21.950	3,270,550.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	160,523	77.000	12,360,271.00	
	SWIRE PACIFIC LTD	45,866	65.550	3,006,516.30	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	152,000	104.900	15,944,800.00	
	WH GROUP LTD	921,000	6.340	5,839,140.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	118,000	22.750	2,684,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	184,733	21.200	3,916,339.60	
香港・ドル　小計		7,454,530		255,024,965.83 (5,074,996,820)	
合計		121,585,813		1,119,567,964,470 (1,119,567,964,470)	

（２）株式以外の有価証券

2024年11月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,454.00	1,823,768.46	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	36,451.00	1,369,828.58	
		AMERICAN TOWER REIT INC	51,724.00	10,404,282.60	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	55,606.00	1,098,218.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,743.00	3,611,129.34	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,536.00	1,313,289.12	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,807.00	1,432,071.03	

	CROWN CASTLE INC	48,147.00	5,029,917.09	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	35,941.00	6,730,671.07	
	EQUINIX INC	10,511.00	9,701,653.00	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,625.00	1,390,431.25	
	EQUITY RESIDENTIAL	37,771.00	2,813,939.50	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,109.00	2,145,354.02	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	23,458.00	3,882,533.58	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30,123.00	1,513,680.75	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	78,031.00	1,669,863.40	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	78,120.00	1,353,819.60	
	INVITATION HOMES INC	67,831.00	2,308,288.93	
	IRON MOUNTAIN INC	32,440.00	3,779,584.40	
	KIMCO REALTY CORP	74,664.00	1,870,333.20	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,943.00	2,046,676.59	
	PROLOGIS INC	102,547.00	11,806,236.11	
	PUBLIC STORAGE	17,515.00	5,857,891.75	
	REALTY INCOME CORP	96,546.00	5,520,500.28	
	REGENCY CENTERS CORP	19,419.00	1,441,860.75	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	11,904.00	2,612,570.88	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	36,095.00	6,540,774.95	
	SUN COMMUNITIES INC	13,816.00	1,749,243.76	
	UDR INC	34,682.00	1,543,349.00	
	VENTAS INC	44,800.00	2,878,400.00	
	VICI PROPERTIES INC	115,645.00	3,726,081.90	
	WELLTOWER INC	66,208.00	9,148,621.44	
	WP CAREY INC	24,288.00	1,371,786.24	
アメリカ・ドル　小計		1,345,500.00	121,486,651.07 (18,819,497,117)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	78,459.00	468,007.93	
	SEGRO PLC	142,183.00	1,085,709.38	
イギリス・ポンド　小計		220,642.00	1,553,717.31 (305,460,823)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	119,395.00	834,571.05	
	GOODMAN GROUP	189,184.00	7,100,075.52	
	GPT GROUP	211,952.00	989,815.84	
	MIRVAC GROUP	437,520.00	931,917.60	
	SCENTRE GROUP	574,249.00	2,032,841.46	
	STOCKLAND	263,766.00	1,358,394.90	
	VICINITY CENTRES	427,939.00	920,068.85	
オーストラリア・ドル　小計		2,224,005.00	14,167,685.22 (1,435,186,513)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,267.00	414,883.59	

	カナダ・ドル　小計		9,267.00	414,883.59 (46,043,781)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	413,900.00	1,059,584.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	596,190.00	1,162,570.50	
	シンガポール・ドル　小計		1,010,090.00	2,222,154.50 (257,458,820)	
	ユーロ	COVIVIO	6,210.00	318,883.50	
		GECINA SA	5,109.00	482,545.05	
		KLEPIERRE	23,763.00	688,651.74	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,092.00	973,259.28	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	19,813.00	406,166.50	
	ユーロ　小計		67,987.00	2,869,506.07 (471,373,762)	
	香港・ドル	LINK REIT	283,271.00	9,475,414.95	
	香港・ドル　小計		283,271.00	9,475,414.95 (188,560,758)	
投資証券　合計			5,160,762	21,523,581,574 (21,523,581,574)	
合計				21,523,581,574 (21,523,581,574)	

（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 573銘柄	74.30	－	78.20
	投資証券 33銘柄	－	1.60	
イギリス・ポンド	株式 76銘柄	3.49	－	3.62
	投資証券 2銘柄	－	0.03	
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	0.10	－	0.10
オーストラリア・ドル	株式 50銘柄	1.77	－	1.95
	投資証券 7銘柄	－	0.12	
カナダ・ドル	株式 83銘柄	3.17	－	3.27
	投資証券 1銘柄	－	0.00	
シンガポール・ドル	株式 12銘柄	0.29	－	0.33
	投資証券 2銘柄	－	0.02	
スイス・フラン	株式 46銘柄	2.29	－	2.36
スウェーデン・クローナ	株式 44銘柄	0.75	－	0.77
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.76	－	0.78
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.04	－	0.04
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.14	－	0.15
ユーロ	株式 213銘柄	7.68	－	7.95
	投資証券 5銘柄	－	0.04	
香港・ドル	株式 23銘柄	0.43	－	0.46
	投資証券 1銘柄	－	0.02	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年11月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	550,516,490
金銭信託	8,517,693
コール・ローン	298,878,154
国債証券	91,538,259,497
派生商品評価勘定	21,858
未収入金	10,901,320
未収利息	555,900,675
前払費用	58,052,373
流動資産合計	93,021,048,060
資産合計	93,021,048,060
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	226,973
未払金	196,541,042
未払解約金	274,348,060
流動負債合計	471,116,075
負債合計	471,116,075
純資産の部	
元本等	
元本	51,547,252,121
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	41,002,679,864
元本等合計	92,549,931,985
純資産合計	92,549,931,985
負債純資産合計	93,021,048,060

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2024年11月20日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,378,960,163円
	同期中追加設定元本額	18,750,344,267円
	同期中一部解約元本額	10,582,052,309円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	3,719,554,724円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	6,943,025,077円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,119,770,989円
	ニッセイ外国債券インデックスＳＡ（適格機関投資家限定）	948,516,964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）	1,748,607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）	1,820,511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）	4,169,717円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国債券インデックスファンド	16,419,568,826円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（４資産均等型）	9,407,607,078円
	ＤＣニッセイ外国債券インデックス	5,312,167,039円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	415,696,244円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	2,277,794,873円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	481,210,463円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	658,843,100円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	47,605,942円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	232,962,464円
	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	23,409,296円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	53,877,032円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	343,759,203円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	233,207,795円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	418,890,043円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	229,579,308円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス	87,499,591円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	161,963,647円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	3,003,588円
	計	51,547,252,121円
２．	受益権の総数	51,547,252,121口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,062,234,398
合計	1,062,234,398

（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5月21日から2024年11月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年11月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	9,310,971	－	9,342,326	△31,355
アメリカ・ドル	6,052,892	－	6,070,556	△17,664
ユーロ	3,258,079	－	3,271,770	△13,691
買建	37,283,469	－	37,109,709	△173,760
アメリカ・ドル	35,402,693	－	35,207,075	△195,618
オーストラリア・ドル	1,880,776	－	1,902,634	21,858
合計	46,594,440	－	46,452,035	△205,115

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年11月20日現在
1口当たり純資産額	1.7954円
（1万口当たり純資産額）	(17,954円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年11月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	126,421.20	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	124,434.00	
		US TREASURY BONDS	180,000.00	190,911.60	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	102,097.00	
		US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,088,953.40	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,096,615.00	
		US TREASURY N/B	520,000.00	399,100.00	
		US TREASURY N/B	890,000.00	805,725.90	
		US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,120,742.00	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,088,579.40	
		US TREASURY N/B	900,000.00	813,375.00	
		US TREASURY N/B	180,000.00	183,162.60	
		US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,390,472.00	
		US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,330,920.00	
		US TREASURY N/B	690,000.00	536,095.50	
		US TREASURY N/B	960,000.00	927,254.40	
		US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,643,632.40	
		US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,569,504.60	
		US TREASURY N/B	980,000.00	993,014.40	
		US TREASURY N/B	500,000.00	434,665.00	
		US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,679,352.80	
		US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,522,947.30	
		US TREASURY N/B	980,000.00	960,243.20	
		US TREASURY N/B	510,000.00	450,549.30	
		US TREASURY N/B	2,740,000.00	2,737,835.40	
		US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,591,597.20	
		US TREASURY N/B	980,000.00	975,707.60	
		US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,447,184.00	
		US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,250,079.60	
		US TREASURY N/B	630,000.00	586,189.80	
		US TREASURY N/B	670,000.00	534,606.40	
		US TREASURY N/B	450,000.00	365,026.50	
		US TREASURY N/B	530,000.00	458,693.80	
		US TREASURY N/B	490,000.00	408,057.30	
		US TREASURY N/B	560,000.00	436,710.40	
		US TREASURY N/B	740,000.00	527,560.80	
		US TREASURY N/B	340,000.00	264,030.40	
		US TREASURY N/B	480,000.00	364,046.40	
		US TREASURY N/B	8,610,000.00	8,433,495.00	
		US TREASURY N/B	300,000.00	232,065.00	
		US TREASURY N/B	14,490,000.00	14,019,075.00	

		US TREASURY N/B	600,000.00	422,292.00	
		US TREASURY N/B	11,270,000.00	10,837,232.00	
		US TREASURY N/B	600,000.00	420,936.00	
		US TREASURY N/B	15,180,000.00	14,477,317.80	
		US TREASURY N/B	750,000.00	498,952.50	
		US TREASURY N/B	8,190,000.00	7,839,959.40	
		US TREASURY N/B	340,000.00	254,415.20	
		US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,468,188.00	
		US TREASURY N/B	670,000.00	510,848.20	
		US TREASURY N/B	8,580,000.00	8,204,625.00	
		US TREASURY N/B	520,000.00	395,704.40	
		US TREASURY N/B	7,710,000.00	7,318,717.50	
		US TREASURY N/B	730,000.00	529,133.20	
		US TREASURY N/B	6,340,000.00	5,987,813.00	
		US TREASURY N/B	150,000.00	149,254.50	
		US TREASURY N/B	740,000.00	535,079.20	
		US TREASURY N/B	5,930,000.00	5,663,150.00	
		US TREASURY N/B	190,000.00	191,134.30	
		US TREASURY N/B	830,000.00	627,978.00	
		US TREASURY N/B	6,210,000.00	5,934,897.00	
		US TREASURY N/B	890,000.00	687,898.80	
		US TREASURY N/B	190,000.00	170,791.00	
		US TREASURY N/B	270,000.00	262,974.60	
		US TREASURY N/B	7,100,000.00	6,762,466.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	753,710.00	
		US TREASURY N/B	280,000.00	279,736.80	
		US TREASURY N/B	5,430,000.00	5,206,827.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	805,890.00	
		US TREASURY N/B	300,000.00	295,359.00	
		US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,383,449.70	
		US TREASURY N/B	9,370,000.00	8,781,376.60	
		US TREASURY N/B	1,080,000.00	811,047.60	
		US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,509,230.60	
		US TREASURY N/B	9,000,000.00	8,315,820.00	
		US TREASURY N/B	320,000.00	323,609.60	
		US TREASURY N/B	1,030,000.00	754,145.40	
		US TREASURY N/B	2,290,000.00	2,204,651.70	
		US TREASURY N/B	8,720,000.00	7,754,260.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	640,580.00	
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,077,070.80	
		US TREASURY N/B	3,300,000.00	2,936,604.00	
		US TREASURY N/B	290,000.00	268,429.80	
		US TREASURY N/B	940,000.00	618,050.00	
		US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,118,410.80	
		US TREASURY N/B	3,890,000.00	3,386,711.80	
		US TREASURY N/B	300,000.00	290,109.00	
		US TREASURY N/B	1,190,000.00	715,987.30	
		US TREASURY N/B	160,000.00	169,361.60	
		US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,903,427.10	

		US TREASURY N/B	920,000.00	568,670.40	
		US TREASURY N/B	320,000.00	327,712.00	
		US TREASURY N/B	3,820,000.00	3,468,712.80	
		US TREASURY N/B	5,110,000.00	4,165,007.70	
		US TREASURY N/B	1,540,000.00	780,518.20	
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	673,277.00	
		US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,309,094.40	
		US TREASURY N/B	5,440,000.00	4,473,964.80	
		US TREASURY N/B	1,530,000.00	828,586.80	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	800,339.40	
		US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,047,231.90	
		US TREASURY N/B	5,550,000.00	4,606,500.00	
		US TREASURY N/B	1,660,000.00	959,745.60	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,031,475.00	
		US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,185,641.70	
		US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,042,452.00	
		US TREASURY N/B	5,630,000.00	4,781,052.30	
		US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,121,354.00	
		US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,257,241.10	
		US TREASURY N/B	900,000.00	812,214.00	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	917,141.40	
		US TREASURY N/B	5,910,000.00	4,858,197.30	
		US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,015,911.00	
		US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,143,180.80	
		US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,277,964.80	
		US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,488,704.80	
		US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,099,746.50	
		US TREASURY N/B	1,580,000.00	906,398.60	
		US TREASURY N/B	300,000.00	248,376.00	
		US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,006,772.20	
		US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,738,647.40	
		US TREASURY N/B	1,820,000.00	1,635,725.00	
		US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,027,006.80	
		US TREASURY N/B	1,440,000.00	906,912.00	
		US TREASURY N/B	330,000.00	271,771.50	
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	825,465.00	
		US TREASURY N/B	290,000.00	233,209.30	
		US TREASURY N/B	1,340,000.00	972,223.60	
		US TREASURY N/B	2,290,000.00	2,076,823.90	
		US TREASURY N/B	1,040,000.00	867,339.20	
		US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,024,191.60	
		US TREASURY N/B	1,310,000.00	975,897.60	
		US TREASURY N/B	910,000.00	770,442.40	
		US TREASURY N/B	350,000.00	269,731.00	
		US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,247,304.80	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,174,771.00	
		US TREASURY N/B	890,000.00	821,852.70	
		US TREASURY NOTES	150,000.00	164,395.50	
		WI TREASURY SEC.	310,000.00	304,767.20	

	WI TREASURY SEC.	1,380,000.00	678,835.80	
	WI TREASURY SEC.	4,420,000.00	3,635,273.20	
	WI TREASURY SEC.	300,000.00	293,964.00	
	WI TREASURY SEC.	280,000.00	253,190.00	
アメリカ・ドル　小計		310,860,000.00 (48,155,322,600)	277,039,267.40 (42,916,152,913)	
イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	283,965.00	
	UNITED KINGDOM GILT	780,000.00	784,095.00	
	UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	409,989.00	
	UNITED KINGDOM GILT	750,000.00	760,927.50	
	UNITED KINGDOM GILT	580,000.00	574,606.00	
	UNITED KINGDOM GILT	850,000.00	837,870.50	
	UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	302,710.20	
	UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	415,890.00	
	UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	384,522.00	
	UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	441,288.00	
	UNITED KINGDOM GILT	660,000.00	654,838.80	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	482,909.70	
	UNITED KINGDOM GILT	190,000.00	183,160.00	
	UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	389,254.00	
	UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	249,960.00	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	222,333.00	
	UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	363,295.20	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	239,844.00	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	357,994.00	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	248,013.50	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	367,160.00	
	UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	370,684.50	
	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	379,873.20	
	UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	371,665.00	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	327,693.60	
	UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	191,840.00	
	UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	163,763.00	
	UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	362,221.20	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	295,895.00	
	UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	298,866.40	
	UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	524,356.50	
	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	164,868.00	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	268,274.00	
	UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	334,183.20	
	UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	331,415.00	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	478,779.00	
	UNITED KINGDOM GILT	460,000.00	444,498.00	
	UNITED KINGDOM GILT	590,000.00	354,531.00	
	UNITED KINGDOM GILT	430,000.00	345,496.40	
	UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	174,120.00	
	UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	372,641.10	
	UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	432,576.90	

	UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	182,689.00	
	UNITED KINGDOM GILT	550,000.00	372,570.00	
	UNITED KINGDOM GILT	660,000.00	509,355.00	
	UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	192,640.00	
	UNITED KINGDOM GILT	630,000.00	586,189.80	
	UNITED KINGDOM GILT	620,000.00	290,160.00	
	UNITED KINGDOM GILT	560,000.00	358,344.00	
	UNITED KINGDOM GILT	660,000.00	567,580.20	
	UNITED KINGDOM GILT	760,000.00	569,772.00	
	UNITED KINGDOM GILT	520,000.00	253,604.00	
	UNITED KINGDOM GILT	810,000.00	646,898.40	
	UNITED KINGDOM GILT	250,000.00	87,800.00	
	UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	282,782.00	
	UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	508,663.80	
	UNITED KINGDOM GILT	740,000.00	735,944.80	
	UNITED KINGDOM GILT	670,000.00	614,457.00	
	UNITED KINGDOM GILT	770,000.00	710,748.50	
	UNITED KINGDOM GILT	650,000.00	538,330.00	
イギリス・ポンド　小計		29,260,000.00 (5,752,516,000)	23,951,394.90 (4,708,844,237)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	800,000.00	799,520.00	
	ISRAEL FIXED BOND	390,000.00	377,695.50	
	ISRAEL FIXED BOND	420,000.00	414,414.00	
	ISRAEL FIXED BOND	740,000.00	685,610.00	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	342,622.50	
	ISRAEL FIXED BOND	580,000.00	556,771.00	
	ISRAEL FIXED BOND	880,000.00	740,740.00	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	576,940.00	
	ISRAEL FIXED BOND	600,000.00	512,010.00	
	ISRAEL FIXED BOND	740,000.00	517,963.00	
	ISRAEL FIXED BOND	660,000.00	631,950.00	
	ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	274,360.00	
	ISRAEL FIXED BOND	690,000.00	553,587.00	
イスラエル・シュケル　小計		7,750,000.00 (320,754,675)	6,984,183.00 (289,059,271)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	480,000.00	439,166.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	192,534.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	511,222.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	160,000.00	156,449.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	300,644.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	580,000.00	580,678.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	460,000.00	460,860.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	430,000.00	364,179.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	360,000.00	329,544.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	230,000.00	193,942.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	423,288.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	480,000.00	462,172.80	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	227,815.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	418,268.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	468,080.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	550,000.00	503,904.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	259,511.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	590,000.00	494,732.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	559,188.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	388,027.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	430,000.00	413,664.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	235,701.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	710,000.00	566,345.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	620,000.00	581,126.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	610,000.00	499,364.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	590,000.00	524,097.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	540,000.00	548,337.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	488,670.00	
オーストラリア・ドル　小計			13,040,000.00 (1,320,952,000)	11,591,517.20 (1,174,220,692)	
オフショア・人民元		CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,547,092.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,091,840.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,358,792.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,831,424.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,546,290.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	8,710,466.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	8,256,132.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	17,600,000.00	17,832,320.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	7,704,140.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	11,600,241.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,080,040.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,609,472.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	12,300,000.00	12,806,145.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	11,794,221.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	11,400,000.00	11,772,324.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,735,750.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,781,864.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,092,070.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	13,800,000.00	14,307,840.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	17,000,000.00	17,462,910.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	16,000,000.00	16,205,280.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,600,000.00	10,802,354.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,180,720.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,033,360.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,146,500.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	12,400,000.00	12,550,536.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,094,500.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	7,675,316.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	14,500,000.00	14,589,610.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,600,000.00	2,107,152.00	

		CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,282,314.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,022,000.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	2,102,373.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,900,000.00	6,317,766.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,500,000.00	6,802,510.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,541,052.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,920,000.00	11,451,258.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,226,808.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,604,773.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,486,080.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	17,400,000.00	17,785,758.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,655,042.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,140,000.00	4,397,259.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	4,524,394.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,262,496.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,265,650.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,761,388.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,861,604.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	6,474,006.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,700,970.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,318,325.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	9,800,000.00	10,041,864.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,660,604.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,164,440.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,514,650.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	700,000.00	842,079.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	10,563,371.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	6,734,438.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	5,700,000.00	6,020,568.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,900,000.00	7,243,758.00	
オフショア・人民元　小計			455,770,000.00 (9,760,633,589)	475,936,300.40 (10,192,509,028)	
カナダ・ドル		CANADIAN GOVERNMENT	430,000.00	413,070.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	530,010.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	240,000.00	239,138.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	234,694.30	
		CANADIAN GOVERNMENT	450,000.00	452,083.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	490,000.00	488,211.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	410,000.00	414,415.70	
		CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	620,898.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	520,000.00	527,259.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	760,437.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	590,000.00	596,012.10	
		CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	111,714.90	
		CANADIAN GOVERNMENT	680,000.00	690,771.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	485,884.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	224,647.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	140,131.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	460,000.00	457,424.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	450,000.00	450,396.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	80,000.00	78,418.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	132,552.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	185,322.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	211,376.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	190,118.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	173,559.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	224,084.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	194,607.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	910,000.00	689,397.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	135,347.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	740,000.00	668,057.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	640,000.00	546,156.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	404,325.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	840,000.00	755,193.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	410,000.00	394,702.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	710,000.00	499,911.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	623,854.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	380,000.00	364,245.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	550,000.00	503,772.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	130,000.00	124,720.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	366,266.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	453,844.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	333,864.30	
カナダ・ドル　小計		**17,000,000.00** **(1,886,660,000)**	**16,090,899.90** **(1,785,768,071)**	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	100,300.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	50,000.00	50,450.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	62,516.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	65,274.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	207,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	136,570.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	220,000.00	220,657.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	196,038.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	240,000.00	237,648.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	187,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	159,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	130,894.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	133,760.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	213,087.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	200,560.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	166,260.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	129,710.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	107,640.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	203,773.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	126,060.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	117,816.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	100,200.00	

シンガポール・ドル　小計		3,330,000.00 (385,813,800)	3,253,415.10 (376,940,673)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	600,000.00	606,336.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,020,000.00	1,988,528.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,070,000.00	1,086,199.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,740,000.00	1,675,498.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,750,000.00	1,653,610.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,010,000.00	1,159,772.90	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,154,049.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,360,000.00	1,324,109.60	
スウェーデン・クローナ　小計		10,850,000.00 (154,178,500)	10,648,103.90 (151,309,556)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,330,000.00	1,352,171.10	
	KINGDOM OF DENMARK	640,000.00	645,670.40	
	KINGDOM OF DENMARK	1,580,000.00	1,577,219.20	
	KINGDOM OF DENMARK	1,290,000.00	1,243,044.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,200,000.00	1,123,452.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,490,000.00	877,714.30	
	KINGDOM OF DENMARK	1,200,000.00	1,050,744.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,390,000.00	3,067,565.00	
デンマーク・クローネ　小計		11,120,000.00 (244,862,400)	10,937,580.00 (240,845,512)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	300,000.00	303,039.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	97,234.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	118,094.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	143,035.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	190,000.00	192,264.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	238,325.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	120,909.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	220,000.00	184,278.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	330,000.00	289,469.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	340,000.00	315,074.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	130,000.00	82,527.90	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	98,110.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	260,000.00	247,119.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	230,000.00	193,857.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	170,000.00	165,231.50	
ニュージーランド・ドル　小計		3,090,000.00 (283,322,100)	2,788,571.60 (255,684,130)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,269,717.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,010,000.00	1,002,223.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,360,000.00	1,319,336.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,240,000.00	1,186,171.60	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,003,184.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	970,000.00	890,304.80	

	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,280,000.00	1,131,200.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	908,155.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,070,000.00	963,652.70	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	470,000.00	461,309.70	
ノルウェー・クローネ　小計		10,860,000.00 (153,451,800)	10,135,253.80 (143,211,136)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,180,000.00	1,213,264.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,040,000.00	1,017,536.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	480,000.00	456,619.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,190,000.00	1,144,030.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	939,040.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	890,000.00	827,166.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,220,000.00	1,088,240.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,120,000.00	1,142,388.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,170,000.00	929,342.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND	930,000.00	851,470.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,100,000.00	851,983.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	770,000.00	748,547.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,030,000.00	1,111,050.70	
ポーランド・ズロチ　小計		13,120,000.00 (497,304,416)	12,320,679.50 (467,006,732)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVERNMENT	500,000.00	522,860.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	349,415.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	250,000.00	252,415.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	220,000.00	223,084.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	552,728.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	633,436.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	408,925.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	210,761.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	615,727.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	364,964.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	389,253.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	359,656.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	470,000.00	474,502.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	260,704.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	590,000.00	635,412.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	530,000.00	535,771.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	601,821.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	570,000.00	603,293.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	640,000.00	646,873.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	458,150.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	352,870.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	460,000.00	458,992.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	540,000.00	523,756.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	640,000.00	631,507.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	635,412.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	390,000.00	383,311.50	

	MALAYSIA GOVERNMENT	560,000.00	603,797.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	230,000.00	238,323.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	340,051.00	
マレーシア・リンギット　小計		12,970,000.00 (449,641,366)	13,267,780.90 (459,964,775)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,100,000.00	6,773,897.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	600,000.00	529,332.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,650,000.00	6,355,937.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,320,000.00	4,625,101.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,280,000.00	8,434,870.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,570,000.00	6,900,049.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,150,000.00	8,697,807.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,940,000.00	4,830,645.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,650,000.00	1,672,803.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,720,000.00	7,361,483.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,440,000.00	7,116,657.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,910,000.00	4,381,487.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,220,000.00	8,411,406.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,450,000.00	5,989,427.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,250,000.00	6,288,722.50	
メキシコ・ペソ　小計		98,250,000.00 (756,701,850)	88,369,627.80 (680,605,199)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	243,767.50	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	102,360.00	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	328,643.70	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	191,377.50	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	201,842.00	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	556,127.50	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	245,299.60	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	227,675.70	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	222,736.80	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	360,856.00	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	267,456.80	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	182,471.10	
	BELGIUM KINGDOM	380,000.00	372,441.80	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	182,427.50	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	149,138.00	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	375,449.10	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	146,364.60	
	BELGIUM KINGDOM	160,000.00	133,569.60	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	516,379.60	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	378,544.00	
	BELGIUM KINGDOM	280,000.00	249,356.80	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	438,467.70	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	179,230.00	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	288,680.70	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	131,978.00	
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	233,782.50	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	452,380.00	

		BELGIUM KINGDOM	320,000.00	266,787.20	
		BELGIUM KINGDOM	160,000.00	67,942.40	
		BELGIUM KINGDOM	370,000.00	309,764.00	
		BELGIUM KINGDOM	240,000.00	153,480.00	
		BELGIUM KINGDOM	170,000.00	162,999.40	
		BELGIUM KINGDOM	440,000.00	446,881.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	560,609.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	414,843.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	586,264.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	571,571.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	520,988.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	581,935.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	180,000.00	191,377.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	507,936.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	559,067.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	610,000.00	694,326.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	130,000.00	132,779.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	562,346.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	549,130.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	592,508.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	568,889.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	588,607.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	527,233.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	418,728.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	352,510.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	637,663.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	578,093.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	479,030.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	564,311.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	630,000.00	608,365.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	390,955.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	568,267.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	721,452.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	548,750.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	525,101.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	480,583.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	527,063.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	536,322.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	507,983.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	288,400.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	680,000.00	627,476.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	593,940.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	329,634.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	476,221.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	640,000.00	542,752.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	170,000.00	88,571.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	640,000.00	592,275.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	380,000.00	286,379.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	498,805.80	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	310,000.00	211,723.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	503,425.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	620,000.00	534,192.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	325,496.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	620,000.00	571,795.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	519,309.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	347,578.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	543,148.20	
		BUNDESOBLIGATION	670,000.00	677,510.70	
		BUNDESOBLIGATION	590,000.00	589,050.10	
		BUNDESOBLIGATION	90,000.00	89,888.40	
		BUNDESOBLIGATION	320,000.00	324,985.60	
		BUNDESOBLIGATION	640,000.00	621,516.80	
		BUNDESOBLIGATION	550,000.00	529,100.00	
		BUNDESOBLIGATION	510,000.00	485,642.40	
		BUNDESOBLIGATION	680,000.00	666,134.80	
		BUNDESOBLIGATION	220,000.00	215,558.20	
		BUNDESOBLIGATION	570,000.00	572,462.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	210,856.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	220,000.00	187,849.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	707,298.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	627,223.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	793,096.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	430,000.00	426,856.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	180,000.00	181,045.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	624,249.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	730,000.00	724,751.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	744,564.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	688,805.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	713,952.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	682,899.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	729,995.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	532,144.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	490,000.00	628,870.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	658,316.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	610,169.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	618,512.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	622,128.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	608,360.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	980,000.00	519,223.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	450,000.00	494,595.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	574,521.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	470,675.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	429,973.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	675,047.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	743,027.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	230,000.00	204,325.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	630,000.00	552,951.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	455,694.00	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	280,000.00	148,635.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	641,520.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	572,204.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	182,093.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	383,321.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	598,878.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	270,000.00	322,787.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	704,973.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	497,712.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	617,081.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	590,000.00	588,507.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000.00	579,645.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	880,000.00	883,124.00	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	310,000.00	312,492.40	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	420,000.00	421,432.20	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	430,000.00	434,605.30	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	410,000.00	413,915.50	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	20,000.00	19,949.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	343,568.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	376,190.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	274,570.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	382,957.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	527,318.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	414,836.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	450,014.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	499,572.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	388,740.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	430,729.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	393,131.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	398,583.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	352,474.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	522,715.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	352,352.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	428,773.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	464,706.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	356,293.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	218,542.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	316,612.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	716,743.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	211,858.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	298,294.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	170,664.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	257,257.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	219,370.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	760,000.00	793,098.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	378,777.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	650,000.00	669,773.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	630,000.00	569,028.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	654,316.50	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	477,441.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	740,000.00	867,642.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	353,064.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	503,517.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	349,316.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	478,318.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	169,754.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	412,002.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	466,404.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	406,551.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	444,136.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	349,353.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	539,951.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	778,078.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	512,070.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	425,579.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	401,713.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	524,253.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	293,907.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	681,324.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	479,403.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	623,887.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	288,891.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	281,921.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	640,000.00	722,451.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	384,084.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	553,132.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	498,652.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	309,431.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	429,488.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	533,689.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	250,524.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	295,180.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	416,411.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	214,566.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	487,784.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	108,694.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	351,454.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	396,952.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	421,999.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	444,231.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	464,083.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	416,047.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	407,474.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	630,000.00	699,558.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	326,955.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	408,806.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	429,896.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	154,114.40	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	377,438.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	426,807.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	369,433.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	285,567.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	420,659.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	314,871.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	404,048.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	529,925.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	553,049.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	429,710.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	320,016.00	
		DEUTSCHLAND REP	380,000.00	420,652.40	
		DEUTSCHLAND REP	300,000.00	333,444.00	
		DEUTSCHLAND REP	330,000.00	360,653.70	
		DEUTSCHLAND REP	480,000.00	570,240.00	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	88,109.10	
		FINNISH GOVERNMENT	190,000.00	194,041.30	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	142,566.20	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	108,732.80	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	122,168.40	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	120,078.00	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	121,801.20	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	133,326.20	
		FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	98,349.90	
		FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	165,884.30	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	133,455.00	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	112,509.80	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	103,849.20	
		FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	155,233.80	
		FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	88,141.20	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	59,423.40	
		FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	112,466.90	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	48,100.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	118,671.00	
		FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	158,518.20	
		FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	86,415.30	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	65,026.00	
		FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	128,497.60	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	97,936.00	
		FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	542,910.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,060,000.00	1,063,074.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,420,000.00	1,432,382.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,310,000.00	1,317,087.10	
		FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	973,084.60	
		FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	780,810.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,090,000.00	1,133,185.80	
		FRANCE (GOVT OF)	770,000.00	771,101.10	
		FRANCE (GOVT OF)	210,000.00	195,631.80	
		FRANCE (GOVT OF)	720,000.00	706,183.20	

		FRANCE (GOVT OF)	370,000.00	349,709.20	
		FRANCE (GOVT OF)	540,000.00	541,279.80	
		FRANCE (GOVT OF)	610,000.00	606,620.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,480,000.00	1,466,946.40	
		FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	808,438.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,480,000.00	1,370,731.60	
		FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	1,084,983.80	
		FRANCE (GOVT OF)	1,170,000.00	1,139,217.30	
		FRANCE (GOVT OF)	410,000.00	260,366.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,110,000.00	909,667.20	
		FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	873,217.80	
		FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	664,440.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,030,000.00	995,721.60	
		FRANCE (GOVT OF)	710,000.00	548,169.70	
		FRANCE (GOVT OF)	1,470,000.00	1,383,446.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,340,000.00	1,146,973.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,360,000.00	1,266,581.60	
		FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	651,198.00	
		FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	1,010,829.60	
		FRANCE (GOVT OF)	750,000.00	505,695.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,340,000.00	1,220,860.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	965,327.00	
		FRANCE (GOVT OF)	760,000.00	401,895.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,060,000.00	1,030,012.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	1,026,543.80	
		FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	546,510.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	1,106,352.00	
		FRANCE (GOVT OF)	670,000.00	444,350.70	
		FRANCE (GOVT OF)	310,000.00	114,049.00	
		FRANCE (GOVT OF)	510,000.00	304,067.10	
		FRANCE (GOVT OF)	1,310,000.00	1,079,073.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,080,000.00	1,024,488.00	
		FRANCE (GOVT OF)	770,000.00	397,173.70	
		FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	760,713.80	
		FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	532,623.60	
		FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	961,088.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,170,000.00	1,106,597.70	
		FRANCE (GOVT OF)	1,160,000.00	1,085,296.00	
		FRANCE (GOVT OF)	520,000.00	565,104.80	
		FRANCE (GOVT OF)	480,000.00	422,558.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	109,846.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	217,335.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	220,367.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	260,000.00	255,390.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	151,235.40	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	181,828.10	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	130,000.00	117,835.90	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	150,075.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	230,000.00	218,235.50	

		IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	160,542.90	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	120,000.00	95,254.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	181,159.30	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	158,626.80	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	169,030.00	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	90,000.00	63,439.20	
		IRELAND GOVERNMENT BOND	90,000.00	92,248.20	
		IRISH GOVERNMENT BOND	120,000.00	101,725.20	
		ITALIAN GOVT	240,000.00	261,648.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	279,538.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	282,318.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	210,000.00	226,438.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	268,339.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	460,000.00	463,887.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	360,514.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	379,805.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	395,297.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	430,000.00	407,893.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	465,973.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	255,054.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	262,083.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	280,736.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	430,000.00	490,135.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	344,030.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	223,614.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	299,222.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	224,784.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	329,874.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	370,000.00	337,044.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	263,260.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	268,320.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	268,053.90	
		OBRIGACOES DO TESOURO	210,000.00	181,824.30	
		OBRIGACOES DO TESOURO	70,000.00	73,488.10	
		OBRIGACOES DO TESOURO	370,000.00	355,547.80	
		OBRIGACOES DO TESOURO	130,000.00	131,095.90	
		OBRIGACOES DO TESOURO	110,000.00	115,824.50	
		OBRIGACOES DO TESOURO	150,000.00	169,498.50	
		OBRIGACOES DO TESOURO	150,000.00	90,249.00	
		OBRIGACOES DO TESOURO	260,000.00	233,643.80	
		OBRIGACOES DO TESOURO	160,000.00	131,075.20	
		OBRIGACOES DO TESOURO	120,000.00	88,174.80	
		OBRIGACOES DO TESOURO	170,000.00	183,074.70	
		OBRIGACOES DO TESOURO	370,000.00	369,278.50	
		OBRIGACOES DO TESOURO	200,000.00	192,634.00	
		OBRIGACOES DO TESOURO	160,000.00	150,336.00	
		OBRIGACOES DO TESOURO	260,000.00	262,938.00	
		OBRIGACOES DO TESOURO	300,000.00	296,031.00	
		OBRIGACOES DO TESOURO	240,000.00	268,252.80	

		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	122,109.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	122,398.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	167,908.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	283,043.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	92,695.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	100,195.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	203,870.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	117,325.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	214,305.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	380,000.00	369,546.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	175,439.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	350,000.00	335,737.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	49,592.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	101,348.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	231,178.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	310,000.00	294,844.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	350,000.00	395,195.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	340,000.00	314,112.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	196,140.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	310,000.00	272,527.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	240,000.00	143,714.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	100,736.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	54,283.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	370,000.00	315,635.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	65,513.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	147,132.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	260,000.00	237,216.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	265,839.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	121,266.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	129,454.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	405,712.00	
	ユーロ　小計		177,980,000.00 (29,236,774,600)	168,601,312.30 (27,696,137,572)	
国債証券　合計			99,358,889,696 (99,358,889,696)	91,538,259,497 (91,538,259,497)	
合計				91,538,259,497 (91,538,259,497)	

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券	143銘柄	46.37	46.88
イギリス・ポンド	国債証券	60銘柄	5.09	5.14
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	0.31	0.32
オーストラリア・ドル	国債証券	28銘柄	1.27	1.28

オフショア・人民元	国債証券	60銘柄	11.01	11.13
カナダ・ドル	国債証券	41銘柄	1.93	1.95
シンガポール・ドル	国債証券	22銘柄	0.41	0.41
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.16	0.17
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	0.26	0.26
ニュージーランド・ドル	国債証券	15銘柄	0.28	0.28
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.15	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.50	0.51
マレーシア・リンギット	国債証券	29銘柄	0.50	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.74	0.74
ユーロ	国債証券	401銘柄	29.93	30.26

（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。

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年11月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	72,902,082
金銭信託	15,224,292
コール・ローン	534,206,645
投資証券	16,137,324,279
派生商品評価勘定	2,035,719
未収入金	33,636,682
未収配当金	21,051,631
差入委託証拠金	371,940,742
流動資産合計	17,188,322,072
資産合計	17,188,322,072
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,838,959
未払金	12,113,042
未払解約金	84,617,492
流動負債合計	118,569,493
負債合計	118,569,493
純資産の部	
元本等	
元本	8,905,400,978
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	8,164,351,601
元本等合計	17,069,752,579
純資産合計	17,069,752,579
負債純資産合計	17,188,322,072

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2024年11月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,248,675,491円
同期中追加設定元本額	4,041,339,553円
同期中一部解約元本額	1,384,614,066円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ先進国リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,631,116,444円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	221,947,014円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	26,978,986円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	8,914,026円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	51,284,509円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	52,075,369円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	4,186,353,050円
ＦＷニッセイ先進国リートインデックス	25,035,157円
ＤＣニッセイ先進国リートインデックス	2,701,696,423円
計	8,905,400,978円
２．　受益権の総数	8,905,400,978口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2023年11月21日 至　2024年11月20日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年11月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年11月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	2,218,270,326
合計	2,218,270,326

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2024年11月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	459,494,879	－	460,007,212	512,333
アメリカ・ドル	394,794,781	－	395,288,556	493,775
ユーロ	64,700,098	－	64,718,656	18,558
合計	459,494,879	－	460,007,212	512,333

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2024年11月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	914,496,496	－	894,180,925	△20,315,571
合計	914,496,496	－	894,180,925	△20,315,571

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2024年11月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9168円 (19,168円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年11月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	7,013.00	175,184.74	
		AGREE REALTY CORP	6,952.00	538,919.04	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	5,256.00	102,334.32	
		ALEXANDER'S INC	183.00	40,455.81	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,770.00	1,125,357.30	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,078.00	19,080.60	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,953.00	82,211.52	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	9,231.00	259,391.10	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	21,688.00	815,035.04	
		AMERICOLD REALTY TRUST	18,172.00	402,509.80	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	9,834.00	86,735.88	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	15,598.00	240,833.12	

		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	4,748.00	52,417.92	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,787.00	2,244,942.06	
		BOSTON PROPERTIES INC	10,048.00	798,012.16	
		BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	2,552.00	8,549.20	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	13,016.00	69,505.44	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	20,894.00	620,342.86	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	12,982.00	221,343.10	
		BRT APARTMENTS CORP	970.00	19,118.70	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,394.00	896,818.26	
		CARETRUST REIT INC	10,663.00	331,406.04	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,399.00	39,493.77	
		CENTERSPACE	1,149.00	84,371.07	
		CHATHAM LODGING TRUST	3,016.00	26,239.20	
		CITY OFFICE REIT INC	1,913.00	9,411.96	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	1,940.00	36,258.60	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	7,676.00	233,427.16	
		COUSINS PROPERTIES INC	10,849.00	335,559.57	
		CTO REALTY GROWTH INC	1,397.00	27,437.08	
		CUBESMART	15,711.00	769,524.78	
		CURBLINE PROPERTIES CORP	6,217.00	149,208.00	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	14,614.00	130,795.30	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,293.00	3,987,540.11	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	13,133.00	32,307.18	
		DOUGLAS EMMETT INC	11,929.00	220,567.21	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,300.00	20.30	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	7,595.00	91,595.70	
		EASTGROUP PROPERTIES	3,312.00	576,652.32	
		ELME COMMUNITIES	6,042.00	95,584.44	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	9,395.00	102,405.50	
		EPR PROPERTIES	5,057.00	225,744.48	
		EQUINIX INC	6,567.00	6,061,341.00	
		EQUITY COMMONWEALTH	7,814.00	156,983.26	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,991.00	920,412.35	
		EQUITY RESIDENTIAL	23,490.00	1,750,005.00	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	12,170.00	415,605.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,421.00	1,334,169.38	

EXTRA SPACE STORAGE INC	14,679.00	2,429,521.29	
FARMLAND PARTNERS INC	2,740.00	34,167.80	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,171.00	585,564.04	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	9,230.00	489,097.70	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6,218.00	180,943.80	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	3,892.00	7,200.20	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,910.00	950,227.50	
GETTY REALTY CORP	3,418.00	112,144.58	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,038.00	52,162.46	
GLADSTONE LAND CORP	2,657.00	31,804.29	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,212.00	36,518.04	
GLOBAL NET LEASE INC	13,531.00	98,911.61	
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	25,275.00	446,356.50	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	48,869.00	1,045,796.60	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	7,447.00	234,282.62	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	49,305.00	854,455.65	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	9,161.00	30,506.13	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	15,677.00	334,860.72	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2,316.00	8,870.28	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,009.00	213,355.80	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	4,662.00	143,962.56	
INVITATION HOMES INC	39,256.00	1,335,881.68	
IRON MOUNTAIN INC	20,323.00	2,367,832.73	
JBG SMITH PROPERTIES	6,165.00	93,029.85	
KILROY REALTY CORP	7,555.00	290,640.85	
KIMCO REALTY CORP	46,448.00	1,163,522.40	
KITE REALTY GROUP TRUST	15,577.00	426,186.72	
LAMAR ADVERTISING CO-A	6,076.00	775,783.68	
LINEAGE INC	4,096.00	260,055.04	
LTC PROPERTIES INC	2,943.00	113,511.51	
LXP INDUSTRIAL TRUST	20,302.00	186,169.34	
MACERICH CO/THE	15,419.00	301,904.02	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	42,943.00	185,943.19	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,050.00	1,272,946.50	

MODIV INDUSTRIAL INC	808.00	13,097.68	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	4,910.00	217,218.40	
NATL HEALTH INVESTORS INC	2,972.00	231,399.92	
NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I	752.00	23,296.96	
NETSTREIT CORP	5,271.00	84,019.74	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	3,588.00	18,657.60	
NEXPOINT RESIDENTIAL	1,599.00	73,745.88	
NNN REIT INC	12,753.00	553,862.79	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,958.00	2,271.28	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	17,835.00	716,075.25	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,032.00	29,773.20	
ORION OFFICE REIT INC	2,625.00	10,263.75	
OUTFRONT MEDIA INC	9,623.00	180,335.02	
PARAMOUNT GROUP INC	11,822.00	56,272.72	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	14,714.00	210,410.20	
PEAKSTONE REALTY TRUST	2,085.00	27,146.70	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	7,922.00	98,153.58	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	8,438.00	331,191.50	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	9,270.00	87,230.70	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,539.00	47,149.23	
POSTAL REALTY TRUST INC-A	1,345.00	18,722.40	
PROLOGIS INC	64,064.00	7,375,688.32	
PUBLIC STORAGE	10,887.00	3,641,157.15	
REALTY INCOME CORP	60,243.00	3,444,694.74	
REGENCY CENTERS CORP	11,141.00	827,219.25	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	9,218.00	160,208.84	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	15,176.00	651,809.20	
RLJ LODGING TRUST	10,900.00	104,531.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	4,243.00	473,858.24	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	16,733.00	310,731.81	
SAFEHOLD INC	3,358.00	68,906.16	
SAUL CENTERS INC	924.00	37,024.68	
SERVICE PROPERTIES TRUST	10,255.00	26,560.45	
SIMON PROPERTY GROUP INC	21,179.00	3,837,846.59	

		SITE CENTERS CORP	3,109.00	50,241.44	
		SL GREEN REALTY CORP	4,447.00	345,087.20	
		STAG INDUSTRIAL INC	12,834.00	466,130.88	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	7,173.00	43,755.30	
		SUN COMMUNITIES INC	8,110.00	1,026,807.10	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	14,610.00	146,976.60	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	7,551.00	275,687.01	
		TERRENO REALTY CORP	6,785.00	410,628.20	
		UDR INC	20,653.00	919,058.50	
		UMH PROPERTIES INC	4,502.00	87,924.06	
		UNITI GROUP INC	17,873.00	101,339.91	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	956.00	38,727.56	
		URBAN EDGE PROPERTIES	7,659.00	179,756.73	
		VENTAS INC	28,497.00	1,830,932.25	
		VERIS RESIDENTIAL INC	5,201.00	95,230.31	
		VICI PROPERTIES INC	72,427.00	2,333,597.94	
		VORNADO REALTY TRUST	11,405.00	468,289.30	
		WELLTOWER INC	40,055.00	5,534,799.90	
		WHITESTONE REIT	3,471.00	50,641.89	
		WP CAREY INC	15,096.00	852,622.08	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	7,540.00	111,742.80	
	アメリカ・ドル　小計		1,582,878.00	83,417,789.80 (12,922,249,817)	
	イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	21,742.00	13,175.65	
		AEW UK REIT PLC	11,978.00	11,391.07	
		ASSURA PLC	211,796.00	81,965.05	
		BIG YELLOW GROUP PLC	14,197.00	155,883.06	
		BRITISH LAND CO PLC	63,897.00	245,747.86	
		CARE REIT PLC	26,277.00	21,547.14	
		CLS HOLDINGS PLC	9,187.00	7,717.08	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	26,699.00	21,092.21	
		DERWENT LONDON PLC	8,128.00	170,037.76	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	39,635.00	34,482.45	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	28,286.00	84,009.42	
		HAMMERSON PLC	31,892.00	90,190.57	
		HELICAL PLC	5,769.00	10,822.64	
		HOME REIT PLC	24,530.00	2.45	
		INTU PROPERTIES PLC	19,587.00	19.58	
		INVISTA FOUNDATION PROPERTY	31,607.00	15,740.28	

		LAND SECURITIES GROUP PLC	51,149.00	305,103.78	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	23,195.00	9,208.41	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	144,868.00	271,772.36	
		NEWRIVER REIT PLC	15,040.00	11,355.20	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	42,762.00	29,206.44	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	99,045.00	92,904.21	
		PRS REIT PLC/THE	41,116.00	42,349.48	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	15,791.00	120,485.33	
		SEGRO PLC	92,747.00	708,216.09	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	138,681.00	180,146.61	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	98,881.00	67,634.60	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	43,856.00	37,146.03	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	12,542.00	7,725.87	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	170,656.00	229,532.32	
		UNITE GROUP PLC	27,409.00	233,524.68	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	33,641.00	36,870.53	
		WAREHOUSE REIT PLC	18,502.00	15,615.68	
		WORKSPACE GROUP PLC	9,194.00	49,831.48	
イギリス・ポンド　小計			1,654,282.00	3,412,453.37 (670,888,333)	
イスラエル・シュケル		MENIVIM- THE NEW REIT LTD	63,397.00	124,638.50	
		REIT 1 LTD	14,649.00	267,344.25	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	11,416.00	97,412.72	
イスラエル・シュケル　小計			89,462.00	489,395.47 (20,254,953)	
オーストラリア・ドル		ABACUS GROUP	27,605.00	33,402.05	
		ABACUS STORAGE KING	31,498.00	38,427.56	
		ARENA REIT	27,883.00	114,320.30	
		BWP TRUST	36,928.00	128,140.16	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	58,640.00	110,536.40	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	35,909.00	108,804.27	
		CENTURIA OFFICE REIT	19,401.00	23,184.19	
		CHARTER HALL GROUP	32,764.00	514,067.16	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	47,968.00	188,993.92	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	36,034.00	124,677.64	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	20,636.00	55,510.84	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	113,250.00	45,300.00	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	11,662.00	31,254.16	

	DEXUS/AU	76,051.00	531,596.49	
	GOODMAN GROUP	120,707.00	4,530,133.71	
	GPT GROUP	136,815.00	638,926.05	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	22,067.00	56,491.52	
	HEALTHCO REIT	23,306.00	26,452.31	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	137,899.00	173,063.24	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	11,567.00	41,988.21	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	25,450.00	127,504.50	
	MIRVAC GROUP	283,889.00	604,683.57	
	NATIONAL STORAGE REIT	91,374.00	228,435.00	
	REGION RE LTD	88,797.00	192,689.49	
	RURAL FUNDS TRUST	26,543.00	50,298.98	
	SCENTRE GROUP	359,648.00	1,273,153.92	
	STOCKLAND	166,513.00	857,541.95	
	VICINITY CENTRES	270,976.00	582,598.40	
	WAYPOINT REIT LTD	53,516.00	134,860.32	
オーストラリア・ドル　小計		2,395,296.00	11,567,036.31 (1,171,740,778)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	4,473.00	80,782.38	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	5,423.00	42,516.32	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,744.00	122,376.48	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,979.00	267,679.83	
	CHOICE PROPERTIES REIT	12,954.00	179,671.98	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3,823.00	54,898.28	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	3,280.00	49,790.40	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	9,461.00	120,816.97	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	525.00	10,200.75	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	8,208.00	146,348.64	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	8,791.00	87,118.81	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	4,509.00	48,877.56	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,395.00	80,296.65	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,412.00	19,965.68	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,530.00	28,121.40	

	NEXUS INDUSTRIAL REIT	3,183.00	25,750.47	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	7,217.00	35,435.47	
	PRIMARIS REIT	3,747.00	60,326.70	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	10,588.00	200,536.72	
	SLATE GROCERY REIT	1,845.00	26,715.60	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,109.00	129,002.25	
カナダ・ドル　小計		108,196.00	1,817,229.34 (201,676,112)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	48,100.00	60,125.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	250,500.00	641,280.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	187,742.00	165,212.96	
	CAPITALAND CHINA TRUST	91,700.00	67,399.50	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	379,128.00	739,299.60	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	50,700.00	44,109.00	
	EC WORLD REIT	17,800.00	1.78	
	ESR-LOGOS REIT	482,133.00	125,354.58	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	71,600.00	44,034.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	79,500.00	168,540.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	215,111.00	204,355.45	
	KEPPEL DC REIT	100,000.00	219,000.00	
	KEPPEL REIT	171,000.00	147,060.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	138,700.00	76,978.50	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	152,000.00	345,040.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	243,800.00	307,188.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	166,900.00	205,287.00	
	OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	181,200.00	50,736.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	26,200.00	94,844.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	47,500.00	32,300.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	98,400.00	48,708.00	
	SUNTEC REIT	159,800.00	182,172.00	
シンガポール・ドル　小計		3,359,514.00	3,969,025.37 (459,851,279)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	74,630.00	159,708.20	
ニュージーランド・ドル　小計		74,630.00	159,708.20 (14,643,645)	

	ユーロ	AEDIFICA	3,272.00	186,340.40	
		ALTAREA	386.00	38,368.40	
		CARE PROPERTY INVEST	3,070.00	37,515.40	
		CARMILA	4,084.00	67,876.08	
		COFINIMMO	2,750.00	154,687.50	
		COVIVIO	3,521.00	180,803.35	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	3,014.00	68,719.20	
		GECINA SA	3,659.00	345,592.55	
		HAMBORNER REIT AG	5,083.00	32,124.56	
		ICADE	2,196.00	49,980.96	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,183.00	2,573.02	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	23,337.00	127,886.76	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	41,482.00	34,927.84	
		KLEPIERRE	15,029.00	435,540.42	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	3,998.00	32,543.72	
		MERCIALYS	6,710.00	71,394.40	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	27,312.00	274,485.60	
		MONTEA NV	1,282.00	82,817.20	
		NSI NV	1,203.00	23,699.10	
		RETAIL ESTATES	887.00	51,889.50	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	2,248.00	90,144.80	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,009.00	521,049.06	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,181.00	249,710.50	
		WERELDHAVE NV	1,903.00	26,718.12	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	2,279.00	68,825.80	
	ユーロ　小計		179,078.00	3,256,214.24 (534,898,313)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	160,000.00	270,400.00	
		FORTUNE REIT	121,000.00	481,580.00	
		LINK REIT	179,200.00	5,994,240.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	63,000.00	115,290.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	230,000.00	230,000.00	
	香港・ドル　小計		753,200.00	7,091,510.00 (141,121,049)	
投資証券　合計			10,196,536	16,137,324,279 (16,137,324,279)	
合計				16,137,324,279 (16,137,324,279)	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）

１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資証券	137銘柄	75.70	80.08
イギリス・ポンド	投資証券	34銘柄	3.93	4.16
イスラエル・シュケル	投資証券	3銘柄	0.12	0.13
オーストラリア・ドル	投資証券	29銘柄	6.86	7.26
カナダ・ドル	投資証券	21銘柄	1.18	1.25
シンガポール・ドル	投資証券	22銘柄	2.69	2.85
ニュージーランド・ドル	投資証券	1銘柄	0.09	0.09
ユーロ	投資証券	25銘柄	3.13	3.31
香港・ドル	投資証券	5銘柄	0.83	0.87

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

中間財務諸表

１）当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2024年11月21日から2025年5月20日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【＜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）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2024年11月20日現在	第8期中間計算期間 2025年5月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	57,805	35,299
コール・ローン	2,028,327	2,061,033
親投資信託受益証券	2,522,689,050	2,526,430,012
未収入金	3,490,723	4,358,636
流動資産合計	2,528,265,905	2,532,884,980
資産合計	2,528,265,905	2,532,884,980
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,430,104	4,297,874
未払受託者報酬	269,832	271,132
未払委託者報酬	1,875,618	1,884,657
その他未払費用	13,393	13,465
流動負債合計	5,588,947	6,467,128
負債合計	5,588,947	6,467,128
純資産の部		
元本等		
元本	1,511,839,423	1,537,180,278
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,010,837,535	989,237,574
（分配準備積立金）	469,918,096	430,702,911
元本等合計	2,522,676,958	2,526,417,852
純資産合計	2,522,676,958	2,526,417,852
負債純資産合計	2,528,265,905	2,532,884,980

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期中間計算期間 自　2023年11月21日 至　2024年5月20日	第8期中間計算期間 自　2024年11月21日 至　2025年5月20日
営業収益		
受取利息	117	2,006
有価証券売買等損益	210,225,702	△34,499,728
営業収益合計	210,225,819	△34,497,722
営業費用		
受託者報酬	237,761	271,132
委託者報酬	1,652,773	1,884,657
その他費用	11,790	13,465
営業費用合計	1,902,324	2,169,254
営業利益又は営業損失（△）	208,323,495	△36,666,976
経常利益又は経常損失（△）	208,323,495	△36,666,976
中間純利益又は中間純損失（△）	208,323,495	△36,666,976
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	7,996,961	△2,395,606
期首剰余金又は期首欠損金（△）	666,190,480	1,010,837,535
剰余金増加額又は欠損金減少額	142,435,458	100,751,634
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	－
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	142,435,458	100,751,634
剰余金減少額又は欠損金増加額	86,895,655	88,080,225
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	86,895,655	88,080,225
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	922,056,817	989,237,574

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第8期中間計算期間 自　2024年11月21日 至　2025年5月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第7期 2024年11月20日現在	第8期中間計算期間 2025年5月20日現在
１．　期首元本額	1,391,091,870円	1,511,839,423円
期中追加設定元本額	450,760,927円	157,187,454円
期中一部解約元本額	330,013,374円	131,846,599円
２．　受益権の総数	1,511,839,423口	1,537,180,278口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 2024年11月20日現在	第8期中間計算期間 2025年5月20日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第7期 2024年11月20日現在	第8期中間計算期間 2025年5月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.6686円 (16,686円)	1.6435円 (16,435円)

（参考）

当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド」受益証券、「ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
開示対象ファンドの開示対象期間末日（以下、「計算日」という。）における同親投資信託の状況は以下の通りでありますが、それらは監査意見の対象外であります。

ニッセイ国内株式インデックス　マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

	2025年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	98,777,730
コール・ローン	5,767,370,872
株式	289,277,686,510
派生商品評価勘定	509,748,100
未収配当金	3,456,614,835
差入委託証拠金	615,062,109
流動資産合計	299,725,260,156
資産合計	299,725,260,156
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	37,647,300
前受金	455,090,000
未払解約金	531,270,371
流動負債合計	1,024,007,671
負債合計	1,024,007,671
純資産の部	
元本等	
元本	89,019,302,430
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	209,681,950,055
元本等合計	298,701,252,485
純資産合計	298,701,252,485
負債純資産合計	299,725,260,156

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11月21日 至　2025年5月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2025年5月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	78,725,847,548円
同期中追加設定元本額	19,568,436,980円
同期中一部解約元本額	9,274,982,098円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイＴＯＰＩＸオープン	4,924,164,026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）	2,893,118,403円
ニッセイ日本バランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	1,702,806円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,083,080,356円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,741,844,446円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	7,019,617,143円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	1,758,782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）	4,763,888円
ニッセイインデックスバランス（成長型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	8,038,916円
ＤＣニッセイ国内株式インデックス	5,929,335,104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	25,998,097,525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）	5,783,470,309円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	501,750,028円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	271,307,015円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	584,562,493円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	679,282,853円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	20,748,827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）	127,311,019円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	15,847,478円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	16,509,447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）	5,336,550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）	12,270,868円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	30,359,501円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	420,028,847円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	298,356,944円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	511,213,545円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	185,829,198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）	22,528,269,908円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ世界株式ファンド（ＧＤＰ型バスケット）	29,715,200円
ＦＷニッセイ国内株インデックス	78,550,492円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	234,902,312円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	59,710,979円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	13,980,323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）	2,318,512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）	2,148,387円
計	89,019,302,430円
２．　受益権の総数	89,019,302,430口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2025年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	8,944,710,000	－	9,417,000,000	472,290,000
合計	8,944,710,000	－	9,417,000,000	472,290,000

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2025年5月20日現在
1口当たり純資産額	3.3555円
（1万口当たり純資産額）	(33,555円)

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2025年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	9,080,402
コール・ローン	530,180,715
国債証券	50,775,024,980
地方債証券	3,028,479,202
特殊債券	4,397,741,091
社債券	3,997,554,000
未収利息	158,743,777
前払費用	9,338,219
流動資産合計	62,906,142,386
資産合計	62,906,142,386
負債の部	
流動負債	
未払解約金	46,946,248
流動負債合計	46,946,248
負債合計	46,946,248
純資産の部	
元本等	
元本	71,639,537,757
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△8,780,341,619
元本等合計	62,859,196,138
純資産合計	62,859,196,138
負債純資産合計	62,906,142,386

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11月21日 至　2025年5月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2025年5月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	70,686,765,017円
同期中追加設定元本額	9,853,053,985円
同期中一部解約元本額	8,900,281,245円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券パッシブＤＢ（適格機関投資家限定）	36,733,844,024円
ＤＣニッセイ日本債券インデックス	6,248,666,629円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	532,672,517円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	11,967,964,915円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	991,733,199円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	5,688,091,659円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	554,351,543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）	465,514,751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）	49,067,138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）	210,543,743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）	111,666,993円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	329,533,681円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	411,757,006円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	1,393,560,714円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	5,767,806,781円
ＦＷニッセイ国内債インデックス	50,637,069円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	124,674,658円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	7,450,737円
計	71,639,537,757円
２．　受益権の総数	71,639,537,757口
３．　元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,780,341,619円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2025年5月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8774円 (8,774円)

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2025年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	13,754,190
コール・ローン	803,070,827
投資証券	31,552,979,450
未収配当金	320,095,635
前払金	1,432,500
差入委託証拠金	45,691,512
流動資産合計	32,737,024,114
資産合計	32,737,024,114
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,053,370
未払解約金	94,416,462
流動負債合計	101,469,832
負債合計	101,469,832
純資産の部	
元本等	
元本	17,355,487,932
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	15,280,066,350
元本等合計	32,635,554,282
純資産合計	32,635,554,282
負債純資産合計	32,737,024,114

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11月21日 至　2025年5月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
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5月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,100,771,249円
同期中追加設定元本額	3,257,832,534円
同期中一部解約元本額	3,003,115,851円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家限定）	53,714,252円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド	831,166,057円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイＪリートインデックスファンド	8,966,123,960円
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンド２０１３－０２（適格機関投資家限定）	1,543,917,162円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＡ	3,461,326,984円
ＤＣニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスファンドＢ	2,150,129,039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）	217,107,827円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	28,337,189円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	9,154,774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）	21,042,717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）	52,076,915円
ＦＷニッセイ国内リートインデックス	21,391,056円
計	17,355,487,932円
２．　受益権の総数	17,355,487,932口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2025年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	1,062,672,500	－	1,055,687,000	△6,985,500
合計	1,062,672,500	－	1,055,687,000	△6,985,500

（注）不動産投信指数先物取引

１．時価の算定方法

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2025年5月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8804円 (18,804円)

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2025年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	4,436,826,721
金銭信託	147,469,546
コール・ローン	8,610,357,478
株式	1,133,607,412,122
投資証券	20,466,483,027
派生商品評価勘定	1,652,897,232
未収入金	714,306,314
未収配当金	1,548,869,941
差入委託証拠金	12,228,653,392
流動資産合計	1,183,413,275,773
資産合計	1,183,413,275,773
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	27,381,514
未払金	427,604,231
未払解約金	1,711,106,622
流動負債合計	2,166,092,367
負債合計	2,166,092,367
純資産の部	
元本等	
元本	243,424,876,585
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	937,822,306,821
元本等合計	1,181,247,183,406
純資産合計	1,181,247,183,406
負債純資産合計	1,183,413,275,773

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11月21日 至　2025年5月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2025年5月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	236,998,387,944円
同期中追加設定元本額	21,828,211,783円
同期中一部解約元本額	15,401,723,142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）	745,442,042円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,694,049,611円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,768,111,055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）	2,395,599,621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）	629,362円
ニッセイインデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	2,273,232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）	4,354,347円
ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ（適格機関投資家限定）	487,112,301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	162,315,070,607円
ＤＣニッセイ外国株式インデックス	46,076,673,561円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（４資産均等型）	4,139,849,202円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	502,939,799円
ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	194,124,209円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	587,210,056円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	628,340,741円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	6,281,329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）	91,126,652円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	11,346,181円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	11,817,726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）	3,820,062円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（８資産均等型）	21,728,517円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	423,140,273円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	297,835,148円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	504,800,659円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	131,503,012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）	292,489,979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）	110,447,460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）	110,034,430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）	98,282,740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）	34,360,562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）	14,573,162,424円
ＦＷニッセイ先進国株インデックス	88,460,530円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	237,225,360円
ＤＣニッセイ全世界株式インデックスコレクト	724,340,296円
ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	14,068,712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）	68,010,448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）	2,213,072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）	26,601,267円
計	243,424,876,585円
２．　受益権の総数	243,424,876,585口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2025年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	84,253,216	－	84,700,783	△447,567
ユーロ	84,253,216	－	84,700,783	△447,567
買建	5,865,927,843	－	5,839,095,605	△26,832,238
アメリカ・ドル	3,968,637,770	－	3,944,463,080	△24,174,690
イギリス・ポンド	1,067,494,735	－	1,067,568,165	73,430
ユーロ	829,795,338	－	827,064,360	△2,730,978
合計	5,950,181,059	－	5,923,796,388	△27,279,805

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2025年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	22,309,758,933	－	23,962,554,458	1,652,795,525
合計	22,309,758,933	－	23,962,554,458	1,652,795,525

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2025年5月20日現在
1口当たり純資産額	4.8526円
（1万口当たり純資産額）	(48,526円)

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2025年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	512,247,333
金銭信託	4,225,361
コール・ローン	246,707,677
国債証券	93,717,286,238
派生商品評価勘定	926,566
未収利息	628,796,008
前払費用	56,725,213
流動資産合計	95,166,914,396
資産合計	95,166,914,396
負債の部	
流動負債	
未払金	192,322,072
未払解約金	116,173,387
流動負債合計	308,495,459
負債合計	308,495,459
純資産の部	
元本等	
元本	54,446,032,965
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	40,412,385,972
元本等合計	94,858,418,937
純資産合計	94,858,418,937
負債純資産合計	95,166,914,396

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11月21日 至　2025年5月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		2025年5月20日現在
１．	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	51,547,252,121円
	同期中追加設定元本額	8,389,242,582円
	同期中一部解約元本額	5,490,461,738円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	3,881,167,705円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,214,442,525円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,271,359,381円
	ニッセイ外国債券インデックスＳＡ（適格機関投資家限定）	1,023,124,200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）	1,638,383円
	ニッセイインデックスバランス（標準型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	2,959,518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）	4,049,853円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国債券インデックスファンド	16,396,736,038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）	10,781,276,437円
	ＤＣニッセイ外国債券インデックス	5,657,325,245円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５５	455,720,312円
	ＤＣニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	2,527,086,629円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４５	543,039,803円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３５	675,088,710円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０２５	35,671,992円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）	237,285,313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）	24,869,839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）	56,586,634円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６０	380,516,420円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０５０	272,621,394円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０４０	476,461,880円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０３０	234,599,769円
	ＦＷニッセイ外国債インデックス	65,952,169円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０６５	212,318,872円
	ＤＣニッセイターゲットデートファンド２０７０	12,693,121円
	ニッセイインデックスバランス（外国株式重視型）ＳＡ（適格機関投資家限定）	1,440,823円
	計	54,446,032,965円
２．	受益権の総数	54,446,032,965口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2025年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	124,209,021	－	125,135,587	926,566
アメリカ・ドル	88,047,868	－	88,783,849	735,981
イギリス・ポンド	3,928,060	－	3,952,077	24,017
カナダ・ドル	2,086,935	－	2,091,507	4,572
デンマーク・クローネ	1,059,831	－	1,065,874	6,043
ユーロ	29,086,327	－	29,242,280	155,953
合計	124,209,021	－	125,135,587	926,566

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2025年5月20日現在
1口当たり純資産額	1.7422円
（1万口当たり純資産額）	(17,422円)

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2025年5月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	109,311,400
金銭信託	2,664,984
コール・ローン	155,601,356
投資証券	17,558,019,929
派生商品評価勘定	8,391,634
未収入金	30,266,695
未収配当金	33,211,821
差入委託証拠金	476,983,729
流動資産合計	18,374,451,548
資産合計	18,374,451,548
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	504,343
未払金	18,244,265
未払解約金	12,669,128
流動負債合計	31,417,736
負債合計	31,417,736
純資産の部	
元本等	
元本	10,450,786,942
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,892,246,870
元本等合計	18,343,033,812
純資産合計	18,343,033,812
負債純資産合計	18,374,451,548

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2024年11月21日 至　2025年5月20日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2025年5月20日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,905,400,978円
同期中追加設定元本額	2,253,399,429円
同期中一部解約元本額	708,013,465円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ先進国リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	1,628,199,803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）	243,246,369円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	31,556,863円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）	10,198,123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）	58,009,674円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	55,013,093円
ニッセイ海外リートインデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	5,459,770,853円
ＦＷニッセイ先進国リートインデックス	29,240,492円
ＤＣニッセイ先進国リートインデックス	2,935,551,672円
計	10,450,786,942円
２．　受益権の総数	10,450,786,942口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年5月20日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2025年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	130,531,820	－	130,115,460	△416,360
アメリカ・ドル	109,825,706	－	109,434,780	△390,926
ユーロ	20,706,114	－	20,680,680	△25,434
合計	130,531,820	－	130,115,460	△416,360

（注）為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2025年5月20日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	763,957,340	－	772,260,991	8,303,651
合計	763,957,340	－	772,260,991	8,303,651

（注）株価指数先物取引

１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2025年5月20日現在
1口当たり純資産額	1.7552円
（1万口当たり純資産額）	(17,552円)

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2025年5月30日現在

Ⅰ　資産総額	2,540,703,632円
Ⅱ　負債総額	2,951,607円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,537,752,025円
Ⅳ　発行済数量	1,540,279,713口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6476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5月30日現在

Ⅰ　資産総額	309,234,745,973円
Ⅱ　負債総額	3,021,251,101円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	306,213,494,872円
Ⅳ　発行済数量	89,211,227,996口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.4325円

ニッセイ国内債券パッシブ　マザーファンド

2025年5月30日現在

Ⅰ　資産総額	65,918,385,226円
Ⅱ　負債総額	2,083,706,785円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	63,834,678,441円
Ⅳ　発行済数量	72,378,548,055口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8820円

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

Ⅰ　資産総額	33,803,424,127円
Ⅱ　負債総額	355,627,139円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	33,447,796,988円
Ⅳ　発行済数量	17,522,981,292口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9088円

ニッセイ外国株式インデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

Ⅰ　資産総額	1,170,324,655,420円
Ⅱ　負債総額	1,026,654,815円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,169,298,000,605円
Ⅳ　発行済数量	244,375,989,364口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.7848円

ニッセイ外国債券インデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

Ⅰ　資産総額	96,029,426,798円
Ⅱ　負債総額	621,372,157円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	95,408,054,641円
Ⅳ　発行済数量	54,828,478,105口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7401円

ニッセイ先進国リートインデックス　マザーファンド

2025年5月30日現在

Ⅰ　資産総額	**18,364,594,980円**
Ⅱ　負債総額	**16,075,454円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**18,348,519,526円**
Ⅳ　発行済数量	**10,579,946,264口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.7343円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

（２）受益者に対する特典

ありません。

（３）譲渡制限

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

（４）受益権の譲渡

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

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

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

（５）受益権の再分割

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

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2025年5月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。
委託会社が発行する株式の総数は13万1,560株で、うち発行済株式総数は10万8,448株です。
最近５年間における資本金の増減はありません。

（２）委託会社等の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

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

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

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

２【事業の内容及び営業の概況】

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

2025年5月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	403	73,580
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	120	18,673
単位型公社債投資信託	0	0
合計	523	92,254

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

３【委託会社等の経理状況】

１.財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

２.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第30期事業年度（自2024年4月1日　至2025年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

		前事業年度 (2024年3月31日)		当事業年度 (2025年3月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金		23,594,998		22,854,185
有価証券		4,958,109		8,572,194
前払費用		645,436		658,467
未収委託者報酬		7,068,985		7,296,469
未収運用受託報酬		7,149,867		7,995,592
未収投資助言報酬		308,690		283,590
その他		58,384		44,991
流動資産合計		43,784,472		47,705,492
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	※1	143,306	※1	150,025
車両	※1	0	※1	0
器具備品	※1	67,645	※1	66,448
有形固定資産合計		210,951		216,474
無形固定資産				
ソフトウェア		1,890,946		3,280,169
ソフトウェア仮勘定		1,968,913		849,779
その他		8,032		8,013
無形固定資産合計		3,867,892		4,137,963
投資その他の資産				
投資有価証券		47,543,934		45,045,217
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		27,817		10,950
差入保証金		360,305		355,422
繰延税金資産		1,809,123		1,773,861
その他		12,801		34,973
投資その他の資産合計		49,820,204		47,286,649
固定資産合計		53,899,049		51,641,087
資産合計		97,683,522		99,346,580

負債の部		
流動負債		
預り金	89,613	63,906
未払収益分配金	6,178	6,131
未払手数料	2,551,424	2,657,754
未払運用委託報酬	4,921,643	4,710,021
未払投資助言報酬	895,917	968,972
その他未払金	1,753,139	1,016,371
未払費用	181,100	196,870
未払法人税等	3,839,095	4,057,802
未払消費税等	937,421	701,846
賞与引当金	1,342,646	1,395,185
その他	34,063	24,296
流動負債合計	16,552,244	15,799,159
固定負債		
長期未払金	-	11,975
退職給付引当金	2,474,312	2,576,216
役員退職慰労引当金	21,250	-
固定負債合計	2,495,562	2,588,191
負債合計	19,047,806	18,387,350
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	60,488,508	62,659,698
利益剰余金合計	61,168,315	63,339,505
株主資本合計	79,450,155	81,621,345
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△ 484,519	△ 400,087
繰延ヘッジ損益	△ 329,920	△ 262,029
評価・換算差額等合計	△ 814,439	△ 662,116
純資産合計	78,635,715	80,959,229
負債・純資産合計	97,683,522	99,346,580

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）	当事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	29,505,710	31,456,939
運用受託報酬	24,242,291	26,331,034
投資助言報酬	1,181,976	1,238,881
その他営業収益	11,333	10,956
営業収益計	54,941,312	59,037,813
営業費用		
支払手数料	11,188,210	11,805,264
広告宣伝費	46,512	80,550
公告費	375	625
調査費	14,344,571	16,210,069
支払運用委託報酬	8,375,976	9,615,456
支払投資助言報酬	3,524,180	3,870,774
委託調査費	140,696	168,932
調査費	2,303,717	2,554,905
委託計算費	281,167	301,022
営業雑経費	980,132	1,216,684
通信費	72,591	68,975
印刷費	174,220	163,162
協会費	37,566	37,581
その他営業雑経費	695,754	946,964
営業費用計	26,840,969	29,614,216
一般管理費		
役員報酬	242,750	289,676
給料・手当	5,515,210	5,718,948
賞与引当金繰入額	1,325,993	1,394,643
賞与	329,794	339,838
福利厚生費	1,094,736	1,179,383
退職給付費用	446,711	476,160
役員退職慰労引当金繰入額	8,700	1,937
役員退職慰労金	821	575
その他人件費	192,956	191,598
不動産賃借料	805,677	800,728
その他不動産経費	37,672	33,242
交際費	28,219	29,941
旅費交通費	177,813	173,926
固定資産減価償却費	687,280	976,601
租税公課	393,138	390,131
業務委託費	414,081	461,373
器具備品費	1,022,398	998,175
保険料	49,463	45,554
寄付金	4,382	10,171
諸経費	352,612	428,756
一般管理費計	13,130,414	13,941,364
営業利益	14,969,928	15,482,231
営業外収益		

受取利息		825		4,078
有価証券利息		61,304		98,927
受取配当金	※1	61,395	※1	41,227
為替差益		182,640		-
その他営業外収益		8,780		38,594
営業外収益計		314,945		182,828
営業外費用				
為替差損		-		20,890
金融派生商品費用		185,184		136,943
控除対象外消費税		11,281		14,014
その他営業外費用		14,042		952
営業外費用計		210,509		172,801
経常利益		15,074,365		15,492,258
特別利益				
投資有価証券売却益		220,932		182,453
投資有価証券償還益		65,698		277
特別利益計		286,630		182,731
特別損失				
投資有価証券売却損		5,154		187,500
投資有価証券償還損		55,591		397,772
固定資産売却損		-		211
固定資産除却損	※2	8,209	※2	773
事故損失賠償金	※3	71		-
特別損失計		69,028		586,258
税引前当期純利益		15,291,967		15,088,731
法人税、住民税及び事業税		4,785,139		4,513,024
法人税等調整額		△ 114,620		△ 46,562
法人税等合計		4,670,518		4,466,462
当期純利益		10,621,448		10,622,269

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度(自2024年4月1日　至2025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	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
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	△ 8,497,226	△ 8,497,226	△ 8,497,226
当期純利益	-	-	-	-	-	-	-	10,622,269	10,622,269	10,622,269
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	2,125,043	2,125,043	2,125,043
当期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	62,659,698	63,339,505	81,621,345

	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
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△ 8,497,226
当期純利益	-	-	-	10,622,269
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	130,578	67,891	198,470	198,470
当期変動額合計	130,578	67,891	198,470	2,323,513
当期末残高	△ 400,087	△ 262,029	△ 662,116	80,959,229

注記事項

（重要な会計方針）

項目	当事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	①　満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 ②　その他有価証券 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 ③　関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
２．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
３．固定資産の減価償却の方法	①　有形固定資産 定率法(ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法)によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 ②　無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	①　賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。 ②　退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。

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

（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会計期間の期首より適用しております。この結果、当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。

（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、前期に計上していた「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11,975千円を固定負債の「長期未払金」として表示しております。

（未適用の会計基準等）

・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）
・「リースに関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会)

１．概要

2016年1月に国際会計基準審議会（IASB）より国際財務報告基準（IFRS）第16号「リース」（以下「IFRS第16号」という。）が公表され、同年2月に米国財務会計基準審議会（FASB）よりFASB Accounting Standards Codification（FASBによる会計基準のコード化体系）のTopic 842「リース」（以下「Topic 842」という。）が公表されました。IFRS第16号及びTopic 842では、借手の会計処理に関して、主に費用配分の方法が異なるものの、原資産の引渡しによりリースの借手に支配が移転した使用権部分に係る資産（使用権資産）と当該移転に伴う負債（リース負債）を計上する使用権モデルにより、オペレーティング・リースも含むすべてのリースについて資産及び負債を計上することとされています。IFRS第16号及びTopic 842の公表により、我が国の会計基準とは、特に負債の認識において違いが生じることとなり、国際的な比較において議論となる可能性がありました。

こうした状況への対応として、2024年9月13日に企業会計基準委員会により、リースに関する会計基準、企業会計基準適用指針、実務対応報告及び移管指針が公表されました。

２．適用予定日

2028年3月期の期首から適用します。

３．当該会計基準等の適用による影響

「リースに関する会計基準の適用指針」の運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 （2024年3月31日）	当事業年度 （2025年3月31日）
建物附属設備	350,825千円	363,224千円
車両	6,729	6,729
器具備品	463,698	472,611
計	821,253	842,565

（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 （2024年3月31日）	当事業年度 （2025年3月31日）
受取配当金	42,264千円	20,664千円

※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　2023年4月1日 至　2024年3月31日）	当事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）
器具備品	6,353	773
ソフトウェア	1,856	-
計	8,209	773

※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2023年4月1日　至2024年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

２．配当に関する事項

①配当金支払額

2023年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度（自2024年4月1日　至2025年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

２．配当に関する事項

①配当金支払額

2024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	8,497,226千円
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

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

2025年6月27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	10,622,373千円
配当の原資	利益剰余金
１株当たり配当額	97,949円
基準日	2025年3月31日
効力発生日	2025年6月27日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（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。

当事業年度（2025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	32,793,713	32,360,235	△433,478
その他有価証券	20,823,699	20,823,699	―
資産計	53,617,412	53,183,934	△433,478
デリバティブ取引（※）			
ヘッジ会計が適用されているもの	14,098	14,098	―
デリバティブ取引計	14,098	14,098	―

（※）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 (2024年3月31日)
関係会社株式	66,222

(単位：千円)

区分	当事業年度 (2025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（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	3,473,100	20,981,331	－	24,454,430

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

当事業年度（2025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	－	20,823,699	－	20,823,699
デリバティブ取引（※）				
為替予約	－	14,098	－	14,098
合計	－	20,837,797	－	20,837,797

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

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融商品

前事業年度（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

当事業年度（2025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	－	32,360,235	－	32,360,235
合計	－	32,360,235	－	32,360,235

（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

地方債は相場価格を用いて評価しております。当社が保有している地方債は、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(2024年3月31日)

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

（注）投資信託受益証券であります。

当事業年度(2025年3月31日)

	１年以内（千円）	１年超５年以内（千円）	５年超10年以内（千円）	10年超（千円）
①現金・預金	22,854,185	―	―	―
②有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	8,570,000	24,280,000	―	―
その他有価証券のうち満期があるもの				
国債・地方債等	―	―	―	―
その他（注）	2,735,734	16,137,863	1,020,217	―
合計	34,159,920	40,417,863	1,020,217	―

（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（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

当事業年度（2025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	497,111	498,590	1,478
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	497,111	498,590	1,478
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	32,296,601	31,861,645	△434,956
	(2)社債	―	―	―
	(3)その他	―	―	―
	小計	32,296,601	31,861,645	△434,956
合計		32,793,713	32,360,235	△433,478

２．その他有価証券

前事業年度（2024年3月31日）

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

（注１）投資信託受益証券等であります。

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

当事業年度（2025年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価または償却原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えるもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	6,931,654	6,388,965	592,688
	小計	6,931,654	6,388,965	592,688
貸借対照表計上額が取得原価または償却原価を超えないもの	(1)株式	―	―	―
	(2)債券	―	―	―
	①国債・地方債等	―	―	―
	②社債	―	―	―
	③その他	―	―	―
	(3)その他（注１）	13,892,045	15,089,000	△1,196,954
	小計	13,892,045	15,089,000	△1,196,954
合計		20,823,699	21,427,965	△604,265

（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

当事業年度（自2024年4月1日　至2025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	3,365,754	－	93,425
(3)その他	5,959,412	182,453	94,075
合計	9,325,167	182,453	187,500

（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（2024年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2025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（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。

当事業年度（2025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	668,354	-	14,098
合計			668,354	-	14,098

（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　2023年4月1日 至　2024年3月31日）	当事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,226,246 千円	2,284,401 千円
勤務費用	295,775	311,827
利息費用	14,661	19,553
数理計算上の差異の発生額	△16,051	△67,081
退職給付の支払額	△240,354	△251,223
その他	4,124	851
退職給付債務の期末残高	2,284,401	2,298,329

（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　2023年4月1日 至　2024年3月31日）	当事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）
退職給付引当金の期首残高	162,914千円	160,035千円
退職給付費用	16,453	17,740
退職給付の支払額	△15,208	△805
その他	△4,124	6,498
退職給付引当金の期末残高	160,035	183,469

（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 （2024年3月31日）	当事業年度 （2025年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,444,436千円	2,481,798千円
未認識数理計算上の差異	29,875	94,417
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,474,312	2,576,216
退職給付引当金	2,474,312	2,576,216
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,474,312	2,576,216

（４）退職給付費用

	前事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）	当事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）
簡便法で計算した退職給付費用	16,453千円	17,740千円
勤務費用	295,775	311,827
利息費用	14,661	19,553
数理計算上の差異の当期費用処理額	670	△2,539
確定給付制度に係る退職給付費用	327,560	346,581

（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　2023年4月1日 至　2024年3月31日）	当事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）
割引率	0.88 %	1.55%

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81,815千円、当事業年度において84,597千円であり、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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	411,118　千円	427,205　千円
未払事業税	154,657	138,469
退職給付引当金	757,634	810,802
税務上の繰延資産償却超過額	1,901	1,670
役員退職慰労引当金	6,506	-
投資有価証券評価差額	459,720	414,969
減価償却超過額	1,035	1,066
その他	203,947	179,936
小計	1,996,521	1,974,120
評価性引当額	△7,242	△7,558
繰延税金資産合計	1,989,278	1,966,562
繰延税金負債		
特別分配金否認	15,934	21,837
投資有価証券評価差額	164,220	170,863
繰延税金負債合計	180,154	192,701
繰延税金資産(△は負債)の純額	1,809,123	1,773,861

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。

４．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

税法の改正に伴い、2026年４月１日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等に係る繰延税金資産及び繰延税金負債については、法定実効税率を30.62%から31.52%に変更し計算しております。この変更による財務諸表への影響は軽微であります。

（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

当事業年度（自2024年4月1日　至2025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	6,804,755

[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 2023年4月1日 至2024年3月31日）	当事業年度 （自 2024年4月1日 至2025年3月31日）
営業収益		
投資信託委託業務	29,505,710	31,456,939
投資運用業務（注）	24,242,291	26,331,034
投資助言業務	1,181,976	1,238,881
その他営業収益	11,333	10,956
計	54,941,312	59,037,813

（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

当事業年度（自2024年4月1日　至2025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	50,000	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	6,751,148	未収運用受託報酬	1,728,378
								投資助言報酬の受取	117,115	未収投資助言報酬	10,644
								グループ通算に伴う支払	117,888	その他未払金	117,888

（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　2023年4月1日 至　2024年3月31日）	当事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）
１株当たり純資産額	725,100円65銭	746,525円79銭
１株当たり当期純利益金額	97,940円47銭	97,948円4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　2023年4月1日 至　2024年3月31日）	当事業年度 （自　2024年4月1日 至　2025年3月31日）
当期純利益	10,621,448千円	10,622,269千円
普通株主に帰属しない金額	－	－
普通株式に係る当期純利益	10,621,448千円	10,622,269千円
期中平均株式数	108千株	108千株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

① 定款の変更等

該当事項はありません。

② 訴訟その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

ａ．名称

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

2025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

2025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：2025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	
岡三証券株式会社	5,000	
Ｊトラストグローバル証券株式会社	3,000	
あかつき証券株式会社	3,067	
光世証券株式会社	12,000	
岩井コスモ証券株式会社	13,500	
大和コネクト証券株式会社	7,500	
ニュース証券株式会社	1,000	
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	5,869	
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	135,000	
マネックス証券株式会社	13,195	
松井証券株式会社	11,945	
三木証券株式会社	500	
株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958	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。
PayPay銀行株式会社	72,216	
日本生命保険相互会社※２	1,450,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。
ニッセイアセットマネジメント株式会社※３	10,000	金融商品取引法に定める第二種金融商品取引業を営んでいます。

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

（３）投資助言会社（参考情報）

ａ．名称
株式会社ニッセイ基礎研究所

ｂ．資本金の額
2025年3月末現在、450百万円

ｃ．事業の内容

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

2【関係業務の概要】

（1）受託会社

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

（2）販売会社

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

（3）投資助言会社（参考情報）

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

3【資本関係】

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

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

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

第３【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2025年5月30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

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2025年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の監査報告書

2025年2月18日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　百　瀬　和　政

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている＜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)の2023年11月21日から2024年11月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、＜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)の2024年11月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

2025年8月18日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　百　瀬　和　政

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞（旧ファンド名：＜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））の2024年11月21日から2025年5月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイ・インデックスバランスファンド（６資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞（旧ファンド名：＜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））の2025年5月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年11月21日から2025年5月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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