

## 【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11月21日提出
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 大関 洋
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	投資信託業務部 茶木 健
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券に 係るファンドの名称】	DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型） DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型） DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）
【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 各ファンドにつき以下を上限とします。 DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型） 1兆円 DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型） 1兆円 DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型） 1兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）  
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）  
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

以下、上記のそれぞれをまたは総称して「ファンド」、「ベビーファンド」または「DCニッセイワールドセレクトファンド」といいます。また、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）を「債券重視型」、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）を「標準型」、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）を「株式重視型」ということがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

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11月22日から2026年5月21日まで

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

**( 9 ) 【払込期日】**

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

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

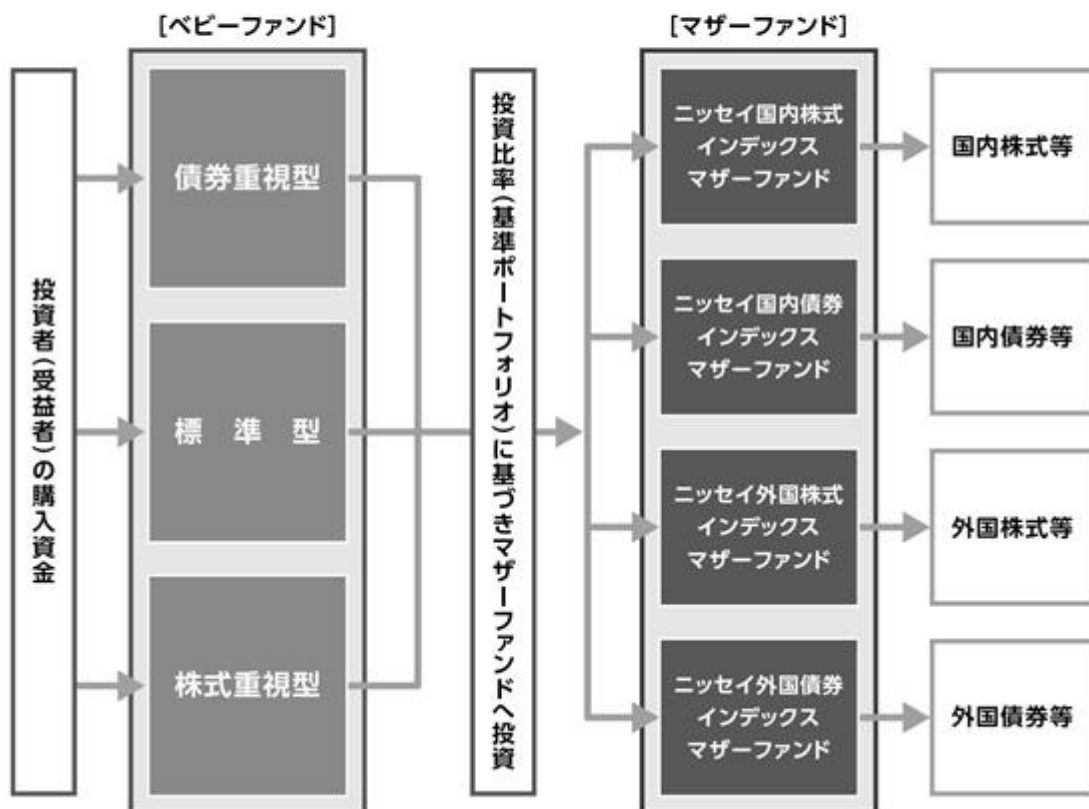
###### 基本方針

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」、「ニッセイ国内債券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」および「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標に運用を行います。

###### ファンドの特色

**■** マザーファンドを通じて、実質的に国内株式・国内債券・外国株式・外国債券に投資します。

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



**■** マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

## ②主要投資対象とする4つのマザーファンドを通じて、バランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることをめざします。

### ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド(以下「国内株式インデックス」ということがあります)

国内の証券取引所上場株式に投資することにより、TOPIX(東証株価指数)<sup>\*1</sup>(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド(以下「国内債券インデックス」ということがあります)

国内の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合<sup>\*2</sup>の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(以下「外国株式インデックス」ということがあります)

日本を除く世界の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)<sup>\*3</sup>の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド(以下「外国債券インデックス」ということがあります)

日本を除く世界の主要国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)<sup>\*4</sup>の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

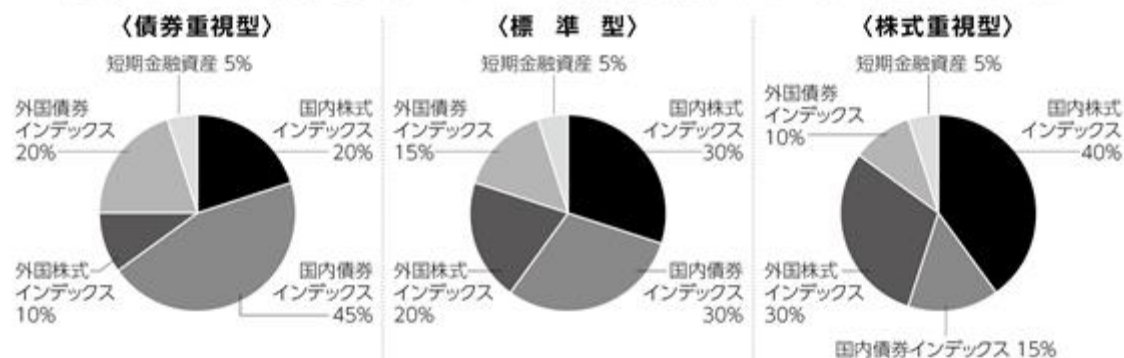
※1 TOPIX(東証株価指数)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により株式会社JPX総研が算出する株価指数です。  
TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標準または高標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または高標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、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。

※2 NOMURA-BPI総合とは、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。

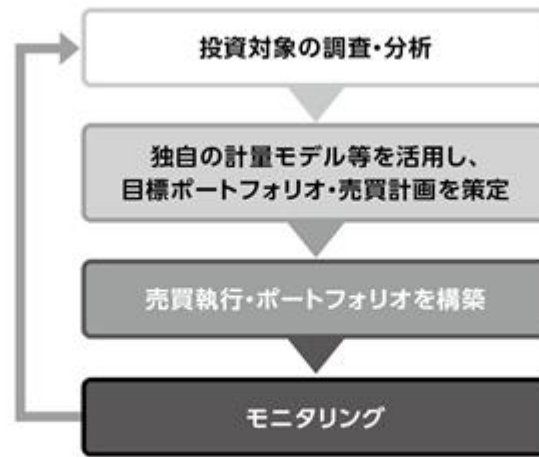
※3 MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く世界の主要先進国の株式市場の動きを捉える基準として広く認知されているものです。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。  
なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

※4 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。

●運用にあたっては、以下の各マザーファンドへの投資比率(基準ポートフォリオ)を基本とします。



## 〈各マザーファンドの運用プロセス〉



- 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、ファンドの購入または換金等にもなう資金フローの影響により、一時的に基準ポートフォリオの配分から乖離する場合があります。

**<MSCI 指数にかかる免責条項等>**

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

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

当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc. の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc. に問合せることなく、当ファンドを保証、推奨、売買または宣伝するためにいかなるMSCI Inc. のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc. の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc. との関係は一切主張することはできません。

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

## 信託金の上限

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

## ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 資産複合に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式 債券
追加型	海外	不動産投信 その他資産 ( )
	内外	資産複合

## 属性区分表

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

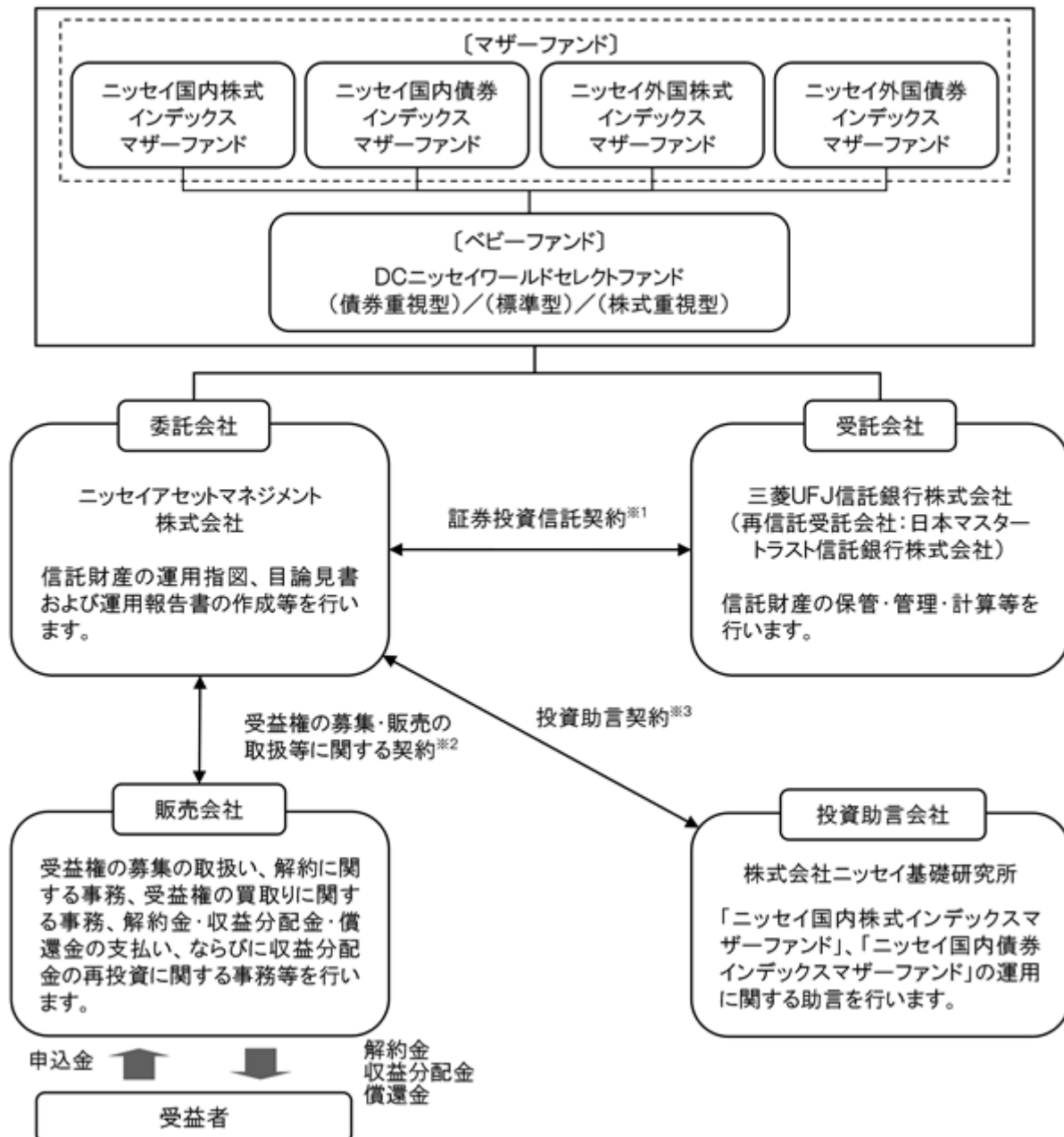
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

- 2003年1月10日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始  
 2014年3月7日 ファンドの仕組みをファンド・オブ・ファンズ方式から、ファミリーファンド方式へ変更し、購入・換金の際に適用される基準価額を購入・換金申込受付日の翌々営業日から翌営業日へ変更、換金代金の支払開始日を換金申込受付日から起算して、原則として6営業日目から5営業日目へと短縮する変更、および実質的な運用管理費用(信託報酬)の料率(年率)を引下げ

## (3) 【ファンドの仕組み】



- 1 委託会社と受託会社との間で結ばれ、運用の基本方針、収益分配方法、受益権の内容等、ファンドの運用・管理について定めた契約です。この信託は、信託財産に属する財産についての對抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。
- 2 委託会社と販売会社との間で結ばれ、委託会社が販売会社に受益権の募集の取扱い、解約に関する事務、解約金・収益分配金・償還金の支払い、ならびに収益分配金の再投資等の業務を委託し、販売会社がこれを引受けることを定めた契約です。
- 3 委託会社と投資助言会社との間で結ばれ、投資助言会社が委託会社に対して運用に関する助言を行うことを定めた契約です。

## 委託会社の概況（2025年8月末現在）

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

## ・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

下記の各マザーファンドを主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

ニッセイ国内債券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

各マザーファンドへの投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

	債券重視型	標準型	株式重視型
国内株式インデックス	20%	30%	40%
国内債券インデックス	45%	30%	15%
外国株式インデックス	10%	20%	30%
外国債券インデックス	20%	15%	10%
短期金融資産	5%	5%	5%

基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等にもなう資金フローの影響により、一時的に上記の配分から乖離する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （参考）マザーファンドの概要

## ニッセイ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。

## b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

## ニッセイ国内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、主に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

国内の公社債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

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

組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。

公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

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

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 基本方針

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

## (2) 運用方法

## a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

## b 投資態度

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

公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

## (2) 【投資対象】

## a 主な投資対象

下記の各マザーファンドを主要投資対象とします。また、各マザーファンドはそれぞれ下記の指数の動き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  
...TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド  
...NOMURA-BPI総合
- ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド  
...MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
- ニッセイ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)

なお、直接、株式、公社債等に投資を行う場合があります。

## b 約款に定める投資対象

## 投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

## イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権(イ. およびニ. に掲げるものに該当するものを除きます)

ニ. 約束手形(イ. に掲げるものを除きます)

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

## イ. 為替手形

## 有価証券

主にニッセイアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「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」および「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」(以下「マザーファンド」といいます)のほか、次の1. から22. までに掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます)に投資します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券(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。

#### 金融商品

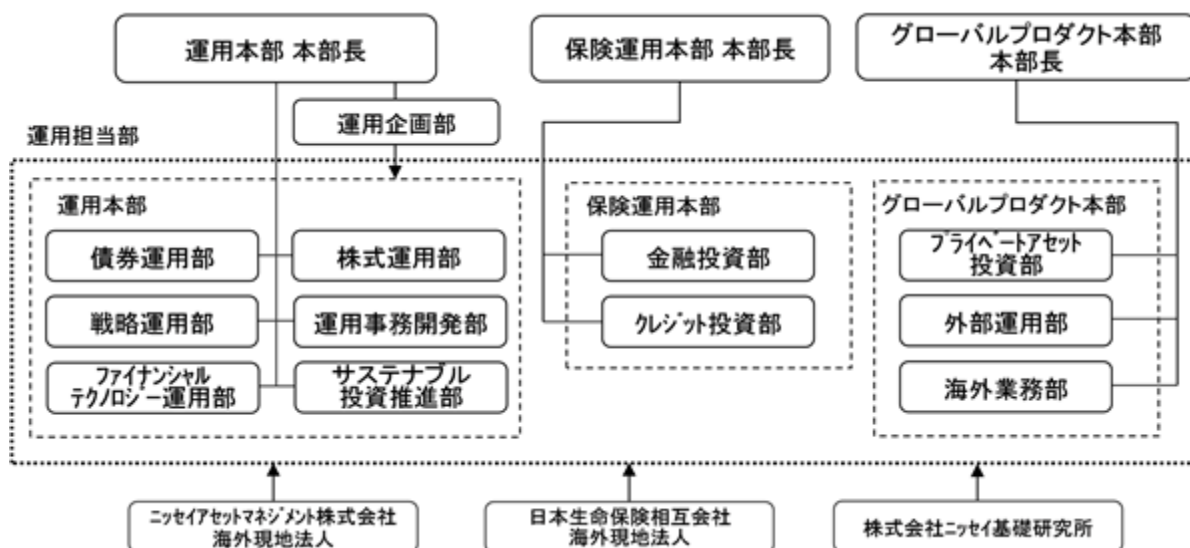
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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

前記 にかかわらず、このファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記 の1.から4.までに掲げる金融商品により運用することができます。

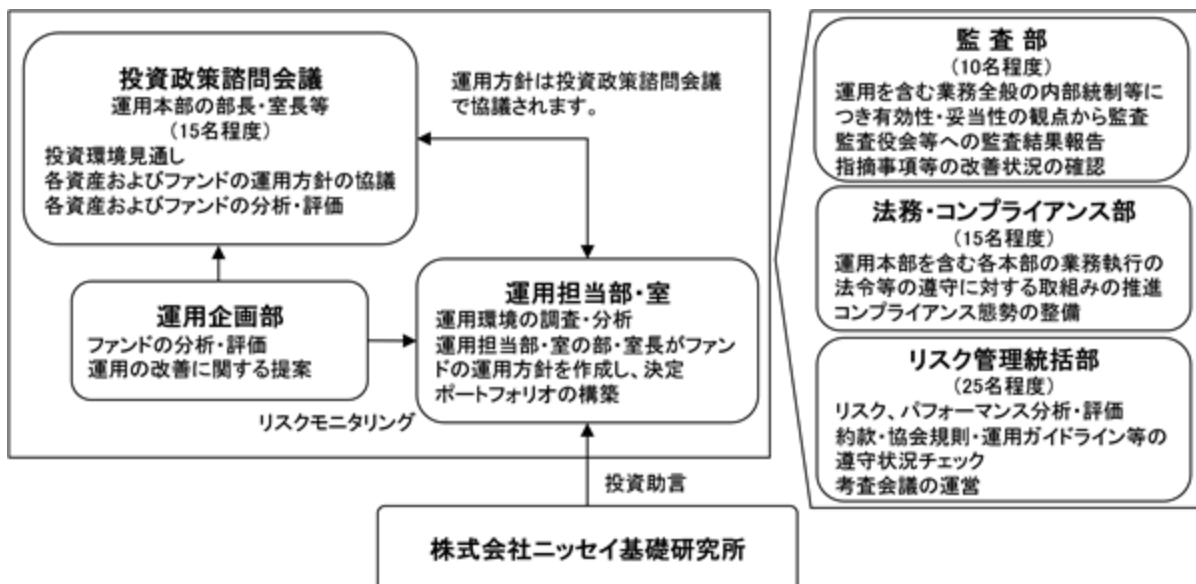
### （3）【運用体制】

#### 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



## &lt; 受託会社に対する管理体制等 &gt;

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲  
経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。
2. 分配対象額についての分配方針  
委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
3. 留保益の運用方針  
特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

## 分配時期

毎決算日とし、決算日は2月21日（年1回、該当日が休業日の場合は翌営業日）です。

## 支払方法

## &lt; 分配金受取コースの場合 &gt;

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。

## &lt; 分配金再投資コースの場合 &gt;

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

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

将来の分配金の支払いおよび水準について、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

## 株式への実質投資割合

債券重視型	信託財産の純資産総額の45%以下
標準型	信託財産の純資産総額の65%以下
株式重視型	信託財産の純資産総額の85%以下

## 外貨建資産への実質投資割合

債券重視型	信託財産の純資産総額の45%以下
標準型	信託財産の純資産総額の50%以下
株式重視型	信託財産の純資産総額の55%以下

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。

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

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。

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

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

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。

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

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

## b 約款に定めるその他の投資制限

## 投資する株式等の範囲

1. 投資する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券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、証券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、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

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

## 信用取引の範囲

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

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

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

## 先物取引等

1. 国内の証券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。以下同じ）、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。以下同じ）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号八に掲げるものをいいます。以下同じ)ならびに外国の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. 国内の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の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取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。

#### スワップ取引

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引

1. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れを行うものとします。

#### 有価証券の貸付けおよび範囲

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることができます。
  - ・株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - ・公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する契約の一部を解約するものとします。
3. 有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れを行うものとします。

#### 有価証券の空売り

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
2. 前記1.の売付けは、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

#### 有価証券の借入れ

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

#### 外国為替予約等

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

#### 資金の借入れ

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

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

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

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

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

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

### 3【投資リスク】

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

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

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

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

#### （1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

##### ・株式投資リスク

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

##### ・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。

##### ・短期金融資産の運用に関するリスク

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

##### ・為替変動リスク

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

##### ・流動性リスク

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

##### ・収益分配金に関する留意点

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

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

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

##### ・ファミリーファンド方式に関する留意点

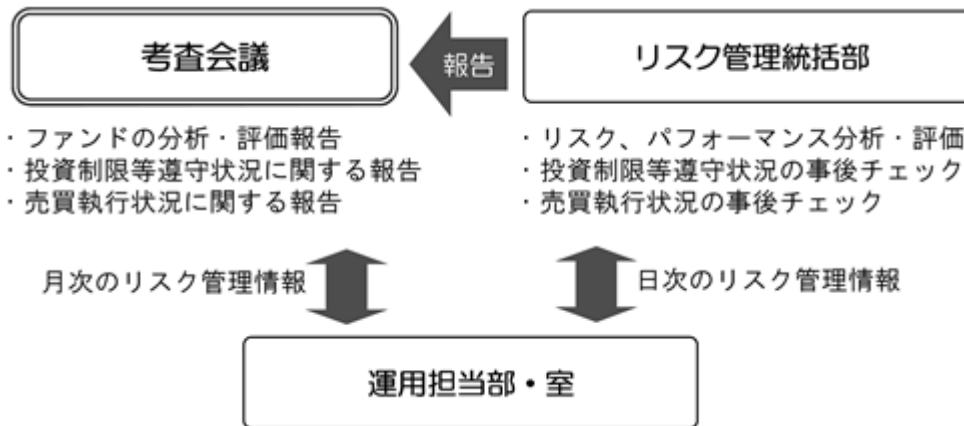
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

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

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

## （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。

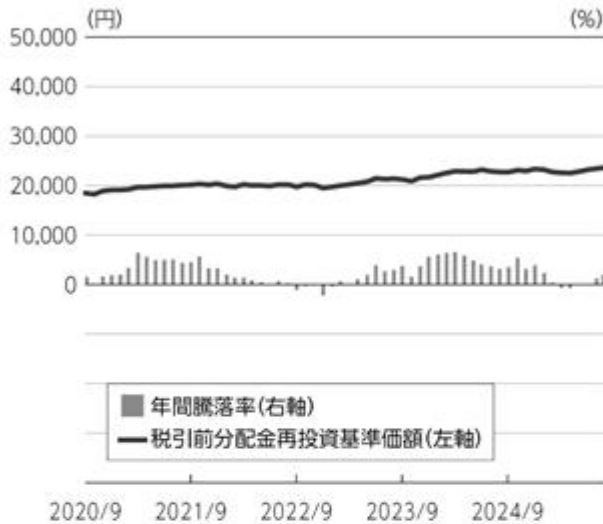
### <流動性リスクに関する管理体制>

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。

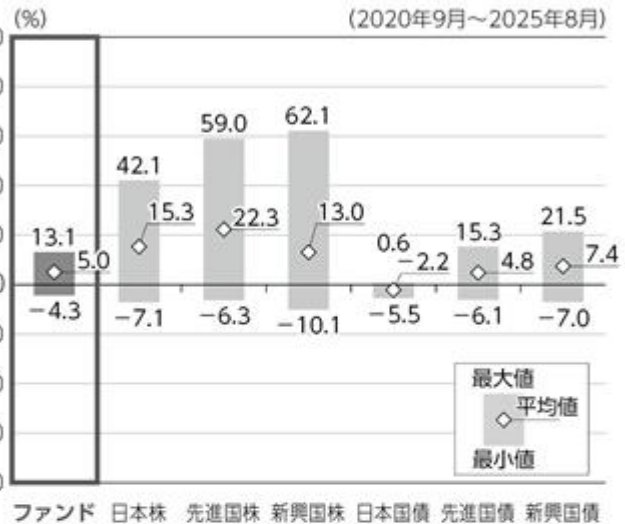
**(参考情報)** 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

### ●DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

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

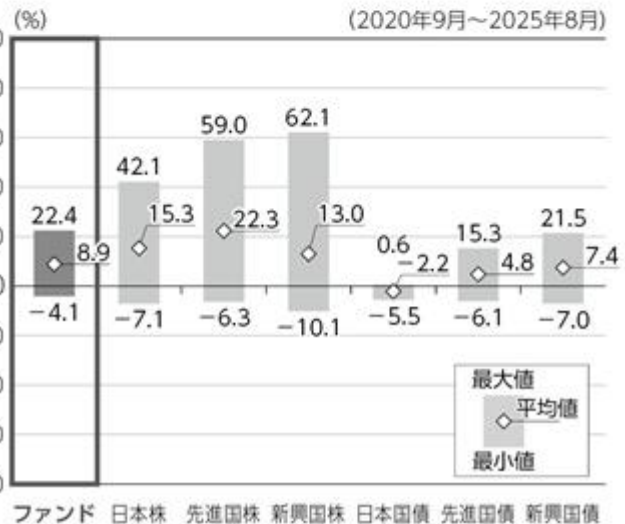


### ●DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

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

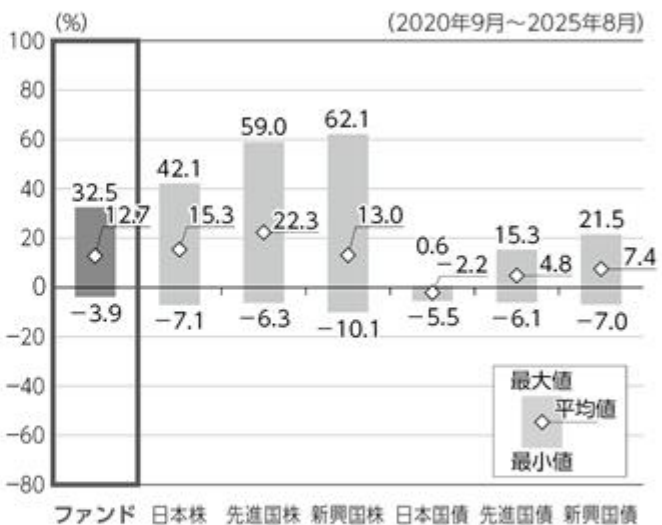


## ●DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

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】

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0.154%（税抜0.14%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

信託報酬の配分（年率・税抜）		
委託会社	販売会社	受託会社
0.06%	0.06%	0.02%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

## &lt;ご参考&gt;

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

### 確定拠出年金としてファンドを取得した場合

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

### 確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合

#### 課税対象

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

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

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

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

#### 個人の課税の取扱い

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

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

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

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

#### 税率（個人）

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

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

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

### < 少額投資非課税制度について >

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

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

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

詳しくは、販売会社にお問合せください。

### 法人の課税の取扱い（分配時・解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

#### 税率（法人）

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

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

### 個別元本

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

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

## 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

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

## 債券重視型

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.16%	0.15%	0.01%

## 標準型

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.16%	0.15%	0.01%

## 株式重視型

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.16%	0.15%	0.01%

- ・対象期間:2024年2月22日～2025年2月21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。
- ・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めています。
- ・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。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

2025年8月29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	34,354,678,724	95.05
内 日本	34,354,678,724	95.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,789,831,120	4.95
純資産総額	36,144,509,844	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。

## DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

2025年8月29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	88,029,885,878	95.09
内 日本	88,029,885,878	95.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,544,717,218	4.91
純資産総額	92,574,603,096	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。

## DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

2025年8月29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	61,846,892,616	95.13
内 日本	61,846,892,616	95.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,164,382,489	4.87
純資産総額	65,011,275,105	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8月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	329,294,715,800	98.17
内 日本	329,294,715,800	98.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,131,263,751	1.83
純資産総額	335,425,979,551	100.00

## その他資産の投資状況

2025年8月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	6,513,700,000	1.94
内 日本	6,513,700,000	1.94

（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。

## ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

2025年8月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	91,819,114,320	99.12
内 日本	91,819,114,320	99.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	810,886,867	0.88
純資産総額	92,630,001,187	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2025年8月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,265,065,718,435	96.32
内 アメリカ	947,932,452,744	72.18
内 イギリス	48,676,132,384	3.71
内 カナダ	44,769,794,712	3.41
内 スイス	34,903,331,135	2.66
内 ドイツ	33,381,081,157	2.54
内 フランス	32,679,359,609	2.49
内 オーストラリア	21,763,129,435	1.66
内 オランダ	19,715,311,552	1.50
内 アイルランド	15,110,204,119	1.15
内 スペイン	11,819,941,339	0.90
内 スウェーデン	10,293,860,724	0.78
内 イタリア	9,540,271,257	0.73
内 デンマーク	6,632,411,406	0.51
内 香港	5,890,005,699	0.45
内 シンガポール	4,298,497,418	0.33
内 ベルギー	3,538,423,894	0.27
内 フィンランド	3,501,487,164	0.27
内 イスラエル	2,873,914,260	0.22
内 ノルウェー	1,976,195,764	0.15
内 オランダ領キュラソー	948,158,116	0.07
内 バミューダ	888,423,147	0.07
内 ジャージー	798,213,975	0.06
内 オーストリア	735,512,907	0.06
内 ケイマン諸島	709,379,477	0.05
内 ポルトガル	691,263,317	0.05
内 ニューゼーランド	611,201,053	0.05
内 ルクセンブルグ	387,760,671	0.03
投資証券	20,997,975,717	1.60
内 アメリカ	18,327,357,534	1.40
内 オーストラリア	1,323,628,069	0.10
内 フランス	501,851,720	0.04
内 シンガポール	321,155,748	0.02
内 イギリス	283,528,910	0.02
内 香港	240,453,736	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	27,270,160,743	2.08
純資産総額	1,313,333,854,895	100.00

## その他資産の投資状況

2025年8月29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）	26,633,239,527	2.03
内 アメリカ	21,401,267,085	1.63
内 イギリス	3,155,950,858	0.24
内 ドイツ	2,076,021,584	0.16

（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8月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	101,795,962,079	98.44
内 アメリカ	46,913,448,922	45.37
内 中国	11,236,081,873	10.87
内 フランス	7,557,865,347	7.31
内 イタリア	7,124,862,905	6.89
内 ドイツ	6,014,318,653	5.82
内 イギリス	5,733,415,936	5.54
内 スペイン	4,544,775,322	4.39
内 カナダ	2,051,611,107	1.98
内 ベルギー	1,549,526,089	1.50
内 オーストラリア	1,303,743,588	1.26
内 オランダ	1,288,566,809	1.25
内 オーストリア	1,155,481,548	1.12
内 メキシコ	851,096,462	0.82
内 ポーランド	675,647,100	0.65
内 ポルトガル	599,236,062	0.58
内 フィンランド	527,105,452	0.51
内 マレーシア	519,099,224	0.50
内 アイルランド	439,648,713	0.43
内 シンガポール	417,494,411	0.40
内 イスラエル	395,264,042	0.38
内 ニュージーランド	302,614,210	0.29
内 デンマーク	232,889,303	0.23
内 スウェーデン	191,583,383	0.19
内 ノルウェー	170,585,618	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,612,970,664	1.56
純資産総額	103,408,932,743	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

2025年8月29日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	13,122,477,320	1.2429 16,310,759,841	1.2183 15,987,114,118	- -	44.23
2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,988,369,870	3.3047 6,571,114,057	3.7740 7,504,107,889	- -	20.76
3	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,962,025,609	1.7397 6,892,764,412	1.8112 7,176,020,783	- -	19.85
4	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	691,398,559	4.9366 3,413,204,040	5.3333 3,687,435,934	- -	10.20

(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8月29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		95.05
	小計		95.05
合計(対純資産総額比)			95.05

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

2025年8月29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	7,571,751,064	3.3095 25,059,289,995	3.7740 28,575,788,515	- -	30.87
2	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	22,214,153,343	1.2425 27,602,498,712	1.2183 27,063,503,017	- -	29.23
3	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	3,510,958,078	4.9549 17,396,797,221	5.3333 18,724,992,717	- -	20.23
4	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	7,545,053,903	1.7401 13,129,259,980	1.8112 13,665,601,629	- -	14.76

(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8月29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		95.09
	小計		95.09
合計(対純資産総額比)			95.09

(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。

## DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

2025年8月29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	7,028,677,484	3.3166 23,311,446,706	3.7740 26,526,228,824	- -	40.80
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	3,666,680,512	4.9675 18,214,428,089	5.3333 19,555,507,174	- -	30.08
3	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,733,678,348	1.2418 9,604,112,331	1.2183 9,421,940,331	- -	14.49
4	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	3,502,217,473	1.7416 6,099,718,516	1.8112 6,343,216,287	- -	9.76

(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8月29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		95.13
	小計		95.13
合計(対純資産総額比)			95.13

(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8月29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	4,012,900	2,711.42 10,880,660,300	2,873.00 11,529,061,700	- -	3.44
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	4,769,200	1,968.08 9,386,202,941	2,259.00 10,773,622,800	- -	3.21
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	2,604,000	3,727.66 9,706,837,850	4,083.00 10,632,132,000	- -	3.17
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	1,939,500	4,308.95 8,357,227,145	4,049.00 7,853,035,500	- -	2.34

5	任天堂 日本	株式 その他製 品	476,600	11,512.68 5,486,948,004	13,310.00 6,343,546,000	- -	1.89
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,535,200	3,904.75 5,994,584,413	4,048.00 6,214,489,600	- -	1.85
7	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	373,500	9,398.78 3,510,445,048	16,230.00 6,061,905,000	- -	1.81
8	三菱重工業 日本	株式 機械	1,333,300	2,200.99 2,934,585,535	3,753.00 5,003,874,900	- -	1.49
9	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,476,100	2,386.36 3,522,508,662	3,354.00 4,950,839,400	- -	1.48
10	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービ ス業	573,900	9,856.90 5,656,875,320	8,579.00 4,923,488,100	- -	1.47
11	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	993,500	4,342.85 4,314,624,860	4,895.00 4,863,182,500	- -	1.45
12	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	709,800	5,091.34 3,613,838,399	6,401.00 4,543,429,800	- -	1.35
13	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	536,900	6,158.31 3,306,396,986	8,397.00 4,508,349,300	- -	1.34
14	キーエンス 日本	株式 電気機器	75,500	62,669.90 4,731,577,615	56,780.00 4,286,890,000	- -	1.28
15	三井物産 日本	株式 卸売業	1,148,200	2,725.53 3,129,461,823	3,426.00 3,933,733,200	- -	1.17
16	NTT 日本	株式 情報・通 信業	22,520,300	146.17 3,292,006,440	155.80 3,508,662,740	- -	1.05
17	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	159,800	25,118.59 4,013,951,668	20,665.00 3,302,267,000	- -	0.98
18	信越化学工業 日本	株式 化学	672,400	4,619.77 3,106,338,500	4,557.00 3,064,126,800	- -	0.91
19	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	673,700	4,166.85 2,807,209,257	4,421.00 2,978,427,700	- -	0.89
20	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	1,788,600	1,370.60 2,451,463,787	1,642.00 2,936,881,200	- -	0.88
21	HOYA 日本	株式 精密機器	145,300	18,170.53 2,640,179,204	19,250.00 2,797,025,000	- -	0.83
22	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	237,900	9,481.65 2,255,686,031	11,675.00 2,777,482,500	- -	0.83
23	ソフトバンク 日本	株式 情報・通 信業	12,147,800	210.91 2,562,123,773	228.20 2,772,127,960	- -	0.83
24	三菱電機 日本	株式 電気機器	775,500	2,382.43 1,847,574,611	3,552.00 2,754,576,000	- -	0.82

25	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	1,064,000	2,438.49 2,594,557,406	2,550.50 2,713,732,000	- -	0.81
26	富士通 日本	株式 電気機器	701,600	2,985.95 2,094,945,107	3,576.00 2,508,921,600	- -	0.75
27	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	53,900	47,622.78 2,566,867,876	46,520.00 2,507,428,000	- -	0.75
28	第一三共 日本	株式 医薬品	695,200	3,420.79 2,378,138,783	3,529.00 2,453,360,800	- -	0.73
29	日本電気 日本	株式 電気機器	539,200	3,080.58 1,661,049,583	4,537.00 2,446,350,400	- -	0.73
30	丸紅 日本	株式 卸売業	656,300	2,280.56 1,496,731,744	3,382.00 2,219,606,600	- -	0.66

（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8月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	16.66
		銀行業	9.25
		情報・通信業	8.11
		卸売業	7.07
		輸送用機器	6.83
		機械	5.89
		化学	4.64
		小売業	4.51
		サービス業	4.23
		医薬品	3.62
		保険業	3.24
		その他製品	3.11
		食料品	2.85
		陸運業	2.41
		建設業	2.35
		精密機器	1.95
		不動産業	1.90
		電気・ガス業	1.34
		非鉄金属	1.19
		その他金融業	1.13
		証券、商品先物取引業	0.96
		鉄鋼	0.77
		ゴム製品	0.66
		ガラス・土石製品	0.62
		海運業	0.57
金属製品	0.48		
石油・石炭製品	0.46		
繊維製品	0.37		
空運業	0.34		
鉱業	0.31		
倉庫・運輸関連業	0.15		
パルプ・紙	0.14		
水産・農林業	0.08		
小計		98.17	
合計（対純資産総額比）		98.17	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

2025年8月29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354回 利付国債(10年) 日本	国債証券	7,135,000,000	96.52 6,887,254,120	96.80 6,906,680,000	0.1 2029/3/20	7.46
2	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	6,405,000,000	98.80 6,328,463,250	98.92 6,336,402,450	0.1 2027/3/20	6.84
3	第370回 利付国債(10年) 日本	国債証券	6,222,000,000	94.21 5,862,066,060	93.76 5,833,747,200	0.5 2033/3/20	6.30
4	第362回 利付国債(10年) 日本	国債証券	5,545,000,000	94.12 5,219,318,040	94.15 5,220,894,750	0.1 2031/3/20	5.64
5	第366回 利付国債(10年) 日本	国債証券	5,430,000,000	93.53 5,079,084,700	93.27 5,064,941,100	0.2 2032/3/20	5.47
6	第350回 利付国債(10年) 日本	国債証券	4,954,000,000	98.06 4,858,146,360	97.97 4,853,433,800	0.1 2028/3/20	5.24
7	第358回 利付国債(10年) 日本	国債証券	4,906,000,000	95.69 4,694,694,050	95.48 4,684,346,920	0.1 2030/3/20	5.06
8	第374回 利付国債(10年) 日本	国債証券	4,909,000,000	94.92 4,659,968,690	94.62 4,645,092,160	0.8 2034/3/20	5.01
9	第22回 利付国債(30年) 日本	国債証券	4,259,000,000	108.93 4,639,421,270	107.97 4,598,697,840	2.5 2036/3/20	4.96
10	第178回 利付国債(5年) 日本	国債証券	4,461,000,000	99.45 4,436,865,990	99.45 4,436,865,990	1 2030/3/20	4.79
11	第168回 利付国債(20年) 日本	国債証券	5,109,000,000	82.30 4,204,878,600	80.79 4,127,612,190	0.4 2039/3/20	4.46
12	第184回 利付国債(20年) 日本	国債証券	4,891,000,000	85.69 4,191,214,140	81.33 3,978,143,760	1.1 2043/3/20	4.29
13	第348回 利付国債(10年) 日本	国債証券	3,941,000,000	98.26 3,872,659,580	98.45 3,880,190,370	0.1 2027/9/20	4.19
14	第160回 利付国債(20年) 日本	国債証券	3,738,000,000	90.05 3,366,337,740	88.71 3,316,316,220	0.7 2037/3/20	3.58
15	第8回 利付国債(40年) 日本	国債証券	4,115,000,000	76.40 3,144,233,050	67.24 2,767,296,350	1.4 2055/3/20	2.99

16	第38回 利付国債(30年) 日本	国債証券	2,583,000,000	97.24 2,511,956,980	91.35 2,359,570,500	1.8 2043/3/20	2.55
17	第7回 利付国債(40年) 日本	国債証券	2,900,000,000	86.01 2,494,309,950	73.76 2,139,301,000	1.7 2054/3/20	2.31
18	第158回 利付国債(5年) 日本	国債証券	2,119,000,000	97.64 2,069,188,330	97.97 2,075,984,300	0.1 2028/3/20	2.24
19	第46回 利付国債(30年) 日本	国債証券	2,385,000,000	90.14 2,150,071,510	83.62 1,994,551,650	1.5 2045/3/20	2.15
20	第352回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,956,000,000	97.42 1,905,593,880	97.42 1,905,554,760	0.1 2028/9/20	2.06
21	第54回 利付国債(30年) 日本	国債証券	2,537,000,000	75.66 1,919,531,740	69.39 1,760,424,300	0.8 2047/3/20	1.90
22	第18回 利付国債(30年) 日本	国債証券	1,242,000,000	108.32 1,345,367,870	106.41 1,321,661,880	2.3 2035/3/20	1.43
23	第4回 利付国債(40年) 日本	国債証券	1,503,000,000	97.21 1,461,209,220	86.00 1,292,640,120	2.2 2051/3/20	1.40
24	第148回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,216,000,000	101.22 1,230,852,390	100.22 1,218,760,320	1.5 2034/3/20	1.32
25	第34回 利付国債(30年) 日本	国債証券	1,129,000,000	103.90 1,173,109,930	99.48 1,123,140,490	2.2 2041/3/20	1.21
26	第469回 利付国債(2年) 日本	国債証券	889,000,000	99.85 887,683,660	99.86 887,808,740	0.7 2027/2/1	0.96
27	第156回 利付国債(20年) 日本	国債証券	885,000,000	87.74 776,560,950	87.74 776,534,400	0.4 2036/3/20	0.84
28	第134回 利付国債(20年) 日本	国債証券	646,000,000	104.25 673,517,880	103.29 667,298,620	1.8 2032/3/20	0.72
29	第10回 利付国債(40年) 日本	国債証券	1,058,000,000	55.90 591,485,480	55.90 591,474,900	0.9 2057/3/20	0.64
30	第11回 利付国債(40年) 日本	国債証券	877,000,000	63.22 554,469,160	52.84 463,476,960	0.8 2058/3/20	0.50

(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8月29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	99.12
	小計		99.12
合計(対純資産総額比)			99.12

(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8月29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	2,876,527	19,984.07 57,484,742,297	26,470.57 76,143,327,720	- -	5.80
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	832,417	67,480.36 56,171,805,986	74,876.30 62,328,312,342	- -	4.75
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	1,760,797	30,675.60 54,013,517,952	34,167.71 60,162,410,421	- -	4.58
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	1,126,410	30,319.53 34,152,228,843	34,026.67 38,327,983,607	- -	2.92
5	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	255,958	94,124.36 24,091,884,763	110,353.08 28,245,753,957	- -	2.15
6	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	526,770	34,006.59 17,913,654,242	45,346.85 23,887,364,388	- -	1.82
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	686,017	24,524.42 16,824,172,349	31,094.14 21,331,114,677	- -	1.62
8	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	579,313	24,677.86 14,296,207,977	31,201.40 18,075,376,869	- -	1.38
9	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部 品	341,748	50,283.37 17,184,243,560	50,831.38 17,371,522,999	- -	1.32
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	327,617	38,934.25 12,755,523,788	44,233.20 14,491,549,725	- -	1.10

11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	159,757	75,197.65 12,013,351,537	73,439.43 11,732,463,210	- -	0.89
12	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サー ビス	201,714	54,042.67 10,901,163,939	51,401.43 10,368,388,293	- -	0.79
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	94,970	110,891.56 10,531,372,088	107,539.56 10,213,032,317	- -	0.78
14	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	50,171	175,124.65 8,786,179,305	180,924.63 9,077,169,812	- -	0.69
15	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 金融サー ビス	100,940	86,199.46 8,700,973,634	86,753.32 8,756,880,282	- -	0.67
16	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネル ギー	508,052	15,647.15 7,949,565,946	16,653.38 8,460,784,031	- -	0.64
17	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	283,675	22,437.32 6,364,907,326	25,777.11 7,312,322,813	- -	0.56
18	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	517,427	14,414.91 7,458,664,198	14,120.48 7,306,318,225	- -	0.56
19	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	52,279	151,846.04 7,938,359,550	138,833.52 7,258,077,759	- -	0.55
20	ORACLE CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	199,722	23,646.62 4,722,750,566	35,307.81 7,051,747,307	- -	0.54
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	117,301	55,765.77 6,541,381,189	59,862.55 7,021,937,446	- -	0.53

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	208,255	27,313.06 5,688,083,108	30,547.60 6,361,691,770	- -	0.48
23	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用 品・パー ソナル用 品	276,419	24,199.95 6,689,326,031	22,868.09 6,321,176,781	- -	0.48
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	843,493	6,572.01 5,543,449,674	7,417.99 6,257,023,313	- -	0.48
25	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	266,935	18,902.20 5,045,661,317	23,230.99 6,201,164,422	- -	0.47
26	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネル ギー	231,101	20,173.80 4,662,187,352	23,407.29 5,409,449,143	- -	0.41
27	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	46,428	113,547.21 5,271,769,986	112,192.82 5,208,888,293	- -	0.40
28	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 資本財	125,708	34,623.51 4,352,453,151	40,549.91 5,097,449,343	- -	0.39
29	SAP SE ドイツ	株式 ソフト ウェア・ サービス	123,100	45,461.07 5,596,258,773	40,526.93 4,988,865,636	- -	0.38
30	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲 料・タバ コ	482,108	10,563.48 5,092,739,379	10,043.45 4,842,028,171	- -	0.37

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 種類別及び業種別投資比率

2025年8月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	半導体・半導体製造装置	10.36
		ソフトウェア・サービス	10.23
		資本財	7.54
		金融サービス	7.24
		メディア・娯楽	7.18
		銀行	6.47
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.25
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.96
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.99
		エネルギー	3.58
		ヘルスケア機器・サービス	3.22
		素材	3.17
		保険	2.99
		食品・飲料・タバコ	2.67
		公益事業	2.60
		消費者サービス	1.88
		自動車・自動車部品	1.82
		生活必需品流通・小売り	1.67
		商業・専門サービス	1.40
		運輸	1.38
		家庭用品・パーソナル用品	1.23
電気通信サービス	1.19		
耐久消費財・アパレル	0.98		
不動産管理・開発	0.29		
エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.02		
	小計		96.32
投資証券	外国		1.60
	小計		1.60
合 計 (対純資産総額比)			97.92

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

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2025年8月29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	2,763,565,200	97.13 2,684,430,614	97.82 2,703,430,021	2.375 2027/5/15	2.61
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	2,206,738,400	97.05 2,141,712,533	97.84 2,159,139,052	2 2026/11/15	2.09
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	2,186,169,600	96.87 2,117,852,652	97.74 2,136,805,890	1.5 2026/8/15	2.07
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,823,277,200	97.06 1,769,701,651	97.88 1,784,660,188	2.25 2027/2/15	1.73
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,779,201,200	96.39 1,715,093,414	97.34 1,731,927,824	2.25 2027/8/15	1.67
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,674,888,000	95.94 1,607,019,197	97.06 1,625,813,781	2.25 2027/11/15	1.57
7	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,500,053,200	97.19 1,457,929,295	98.10 1,471,687,193	2.875 2028/5/15	1.42

8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,428,062,400	95.25 1,360,274,928	96.77 1,382,035,948	2.625 2029/2/15	1.34
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,379,578,800	93.95 1,296,210,454	95.66 1,319,801,650	2.375 2029/5/15	1.28
10	WI TREASURY SEC. アメリカ	国債証 券	1,483,892,000	84.98 1,261,070,439	86.86 1,288,953,107	0.625 2030/5/15	1.25
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,372,232,800	89.03 1,221,707,008	91.18 1,251,297,923	1.5 2030/2/15	1.21
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,254,696,800	96.92 1,216,121,543	97.97 1,229,351,924	2.75 2028/2/15	1.19
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,322,280,000	90.80 1,200,725,566	92.78 1,226,824,606	1.625 2029/8/15	1.19
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,303,180,400	90.74 1,182,552,170	92.75 1,208,791,043	1.75 2029/11/15	1.17
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,150,383,600	96.64 1,111,829,001	97.95 1,126,881,263	2.875 2028/8/15	1.09
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	865,358,800	97.18 840,970,799	98.51 852,508,221	3.125 2028/11/15	0.82
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	834,505,600	91.97 767,541,581	93.94 784,009,666	2.875 2032/5/15	0.76
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	899,150,400	83.80 753,547,302	86.39 776,811,996	1.25 2031/8/15	0.75
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	871,235,600	86.55 754,137,562	88.97 775,225,436	1.625 2031/5/15	0.75
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	866,828,000	86.08 746,215,570	88.60 768,052,949	1.875 2032/2/15	0.74
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	850,666,800	84.85 721,845,316	87.31 742,768,223	1.125 2031/2/15	0.72
22	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	825,690,400	84.13 694,693,325	86.62 715,254,309	0.875 2030/11/15	0.69
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	794,837,200	83.72 665,509,181	86.13 684,609,177	0.625 2030/8/15	0.66
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	664,078,400	91.74 609,238,805	93.33 619,797,652	0.625 2027/12/31	0.60
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	561,234,400	83.87 470,741,012	86.40 484,917,746	1.375 2031/11/15	0.47
26	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	424,598,800	101.25 429,916,880	103.54 439,655,073	4.625 2035/2/15	0.43
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	421,660,400	99.60 420,001,543	102.04 430,270,705	4.375 2034/5/15	0.42
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	418,722,000	98.35 411,832,095	100.76 421,941,972	4.25 2034/11/15	0.41
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	417,252,800	99.36 414,596,443	100.45 419,142,955	4.25 2035/5/15	0.41
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	402,560,800	100.79 405,770,739	103.20 415,483,001	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8月29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	98.44
	小計		98.44
合計（対純資産総額比）			98.44

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 【投資不動産物件】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

該当事項はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

該当事項はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

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。

## 【その他投資資産の主要なもの】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

該当事項はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

該当事項はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

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8月29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 709月	買建	212	6,071,146,600	6,513,700,000	1.94

（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

2025年8月29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 202509	買建	447	20,281,645,227	21,401,267,085	1.63
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE 202509	買建	172	3,060,918,658	3,155,950,858	0.24
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 202509	買建	224	2,056,760,015	2,076,021,584	0.16

(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。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

D C ニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

直近日（2025年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第13計算期間末 (2016年2月22日)	3,885,525,955	3,885,525,955	1.5825	1.5825
第14計算期間末 (2017年2月21日)	4,330,175,126	4,330,175,126	1.6728	1.6728
第15計算期間末 (2018年2月21日)	8,063,626,857	8,063,626,857	1.7587	1.7587
第16計算期間末 (2019年2月21日)	10,111,525,053	10,111,525,053	1.7614	1.7614
第17計算期間末 (2020年2月21日)	14,127,179,670	14,127,179,670	1.8561	1.8561
第18計算期間末 (2021年2月22日)	19,046,053,868	19,046,053,868	1.9431	1.9431
第19計算期間末 (2022年2月21日)	22,732,694,346	22,732,694,346	1.9791	1.9791
第20計算期間末 (2023年2月21日)	25,112,526,201	25,112,526,201	1.9943	1.9943
第21計算期間末 (2024年2月21日)	30,184,264,705	30,184,264,705	2.2416	2.2416
第22計算期間末 (2025年2月21日)	33,692,945,724	33,692,945,724	2.2856	2.2856
2024年8月末日	32,269,845,515	-	2.2754	-
9月末日	32,384,236,280	-	2.2730	-
10月末日	33,311,684,097	-	2.3124	-
11月末日	33,157,309,147	-	2.2945	-
12月末日	34,018,643,621	-	2.3351	-
2025年1月末日	34,096,992,001	-	2.3187	-
2月末日	33,546,032,744	-	2.2721	-
3月末日	33,591,222,953	-	2.2601	-
4月末日	33,704,322,629	-	2.2531	-
5月末日	34,448,682,255	-	2.2824	-
6月末日	35,068,046,009	-	2.3191	-
7月末日	35,739,287,995	-	2.3444	-
8月末日	36,144,509,844	-	2.3635	-

## DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

直近日（2025年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第13計算期間末 (2016年2月22日)	12,635,415,827	12,635,415,827	1.7401	1.7401
第14計算期間末 (2017年2月21日)	14,588,527,021	14,588,527,021	1.9186	1.9186
第15計算期間末 (2018年2月21日)	20,339,334,655	20,339,334,655	2.0634	2.0634
第16計算期間末 (2019年2月21日)	24,036,451,161	24,036,451,161	2.0548	2.0548
第17計算期間末 (2020年2月21日)	32,729,549,548	32,729,549,548	2.2096	2.2096
第18計算期間末 (2021年2月22日)	41,565,072,750	41,565,072,750	2.3873	2.3873
第19計算期間末 (2022年2月21日)	50,637,554,080	50,637,554,080	2.4790	2.4790
第20計算期間末 (2023年2月21日)	57,667,388,246	57,667,388,246	2.5589	2.5589
第21計算期間末 (2024年2月21日)	74,327,010,389	74,327,010,389	3.0332	3.0332
第22計算期間末 (2025年2月21日)	84,569,232,986	84,569,232,986	3.1913	3.1913
2024年8月末日	80,559,466,655	-	3.1227	-
9月末日	80,554,651,224	-	3.1166	-
10月末日	83,380,681,805	-	3.1962	-
11月末日	82,854,069,750	-	3.1786	-
12月末日	85,227,033,530	-	3.2559	-
2025年1月末日	85,852,180,898	-	3.2412	-
2月末日	83,673,304,960	-	3.1532	-
3月末日	83,709,456,073	-	3.1291	-
4月末日	83,212,892,457	-	3.1078	-
5月末日	86,503,962,338	-	3.1915	-
6月末日	88,406,062,863	-	3.2577	-
7月末日	90,989,793,696	-	3.3237	-
8月末日	92,574,603,096	-	3.3704	-

## DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

直近日（2025年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （円）	純資産総額 （分配付） （円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第13計算期間末 (2016年2月22日)	7,049,086,725	7,049,086,725	1.8772	1.8772
第14計算期間末 (2017年2月21日)	8,327,982,509	8,327,982,509	2.1564	2.1564
第15計算期間末 (2018年2月21日)	10,879,143,991	10,879,143,991	2.3709	2.3709
第16計算期間末 (2019年2月21日)	12,332,756,808	12,332,756,808	2.3458	2.3458
第17計算期間末 (2020年2月21日)	16,619,730,165	16,619,730,165	2.5721	2.5721
第18計算期間末 (2021年2月22日)	21,780,985,562	21,780,985,562	2.8551	2.8551
第19計算期間末 (2022年2月21日)	28,100,805,563	28,100,805,563	3.0209	3.0209
第20計算期間末 (2023年2月21日)	33,393,591,976	33,393,591,976	3.1923	3.1923
第21計算期間末 (2024年2月21日)	47,666,394,029	47,666,394,029	3.9860	3.9860
第22計算期間末 (2025年2月21日)	57,903,748,190	57,903,748,190	4.3225	4.3225
2024年8月末日	53,823,913,842	-	4.1574	-
9月末日	53,843,311,257	-	4.1461	-
10月末日	56,186,232,714	-	4.2859	-
11月末日	56,238,674,154	-	4.2716	-
12月末日	58,314,570,552	-	4.4039	-
2025年1月末日	58,710,145,395	-	4.3950	-
2月末日	56,981,785,863	-	4.2448	-
3月末日	57,088,971,225	-	4.2022	-
4月末日	56,500,869,921	-	4.1559	-
5月末日	59,611,321,775	-	4.3249	-
6月末日	61,332,700,859	-	4.4348	-
7月末日	63,617,599,142	-	4.5662	-
8月末日	65,011,275,105	-	4.6569	-

## 【分配の推移】

## DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

	1口当たりの分配金（円）
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
2025年2月22日～2025年8月21日	-

## DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

	1口当たりの分配金（円）
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
2025年2月22日～2025年8月21日	-

## DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

	1口当たりの分配金（円）
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
2025年2月22日～2025年8月21日	-

## 【収益率の推移】

## D C ニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

	収益率（％）
第13計算期間	3.2
第14計算期間	5.7
第15計算期間	5.1
第16計算期間	0.2
第17計算期間	5.4
第18計算期間	4.7
第19計算期間	1.9
第20計算期間	0.8
第21計算期間	12.4
第22計算期間	2.0
2025年2月22日～2025年8月21日	3.3

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

## D C ニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

	収益率（％）
第13計算期間	6.3
第14計算期間	10.3
第15計算期間	7.5
第16計算期間	0.4
第17計算期間	7.5
第18計算期間	8.0
第19計算期間	3.8
第20計算期間	3.2
第21計算期間	18.5
第22計算期間	5.2
2025年2月22日～2025年8月21日	5.4

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

## DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

	収益率（％）
第13計算期間	9.5
第14計算期間	14.9
第15計算期間	9.9
第16計算期間	1.1
第17計算期間	9.6
第18計算期間	11.0
第19計算期間	5.8
第20計算期間	5.7
第21計算期間	24.9
第22計算期間	8.4
2025年2月22日～2025年8月21日	7.5

（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】

## DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

	設定口数	解約口数	発行済数量
第13計算期間	470,047,100	450,270,647	2,455,327,588
第14計算期間	410,584,996	277,359,669	2,588,552,915
第15計算期間	2,361,820,149	365,488,159	4,584,884,905
第16計算期間	1,655,374,012	499,770,847	5,740,488,070
第17計算期間	2,521,627,930	650,916,773	7,611,199,227
第18計算期間	3,349,785,978	1,159,166,367	9,801,818,838
第19計算期間	2,931,115,272	1,246,490,259	11,486,443,851
第20計算期間	2,316,630,394	1,211,155,989	12,591,918,256
第21計算期間	2,552,719,943	1,679,168,996	13,465,469,203
第22計算期間	3,164,268,955	1,888,136,813	14,741,601,345
2025年2月22日～ 2025年8月21日	1,387,833,210	849,016,270	15,280,418,285

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

## DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

	設定口数	解約口数	発行済数量
第13計算期間	943,466,343	940,757,157	7,261,452,709
第14計算期間	928,099,553	585,769,447	7,603,782,815
第15計算期間	3,154,753,330	901,476,667	9,857,059,478
第16計算期間	2,639,726,677	799,319,778	11,697,466,377
第17計算期間	4,420,105,679	1,305,239,903	14,812,332,153
第18計算期間	4,457,846,329	1,859,533,952	17,410,644,530
第19計算期間	4,720,130,092	1,703,835,982	20,426,938,640
第20計算期間	3,940,594,899	1,831,397,366	22,536,136,173
第21計算期間	4,340,901,715	2,372,836,083	24,504,201,805
第22計算期間	4,592,514,119	2,596,463,111	26,500,252,813
2025年2月22日～ 2025年8月21日	2,127,395,659	1,207,055,765	27,420,592,707

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

## DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

	設定口数	解約口数	発行済数量
第13計算期間	684,049,192	692,168,947	3,755,175,716
第14計算期間	586,496,868	479,619,455	3,862,053,129
第15計算期間	1,365,271,724	638,735,089	4,588,589,764
第16計算期間	1,229,209,838	560,358,494	5,257,441,108
第17計算期間	1,961,765,805	757,768,658	6,461,438,255
第18計算期間	2,425,818,267	1,258,493,198	7,628,763,324
第19計算期間	2,886,289,935	1,212,865,927	9,302,187,332
第20計算期間	2,324,599,896	1,165,981,454	10,460,805,774
第21計算期間	3,040,409,875	1,542,620,953	11,958,594,696
第22計算期間	3,208,872,329	1,771,430,757	13,396,036,268
2025年2月22日～ 2025年8月21日	1,355,846,453	818,237,019	13,933,645,702

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

&lt; 参考情報 &gt;

# 3.運用実績

2025年8月末現在

## DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

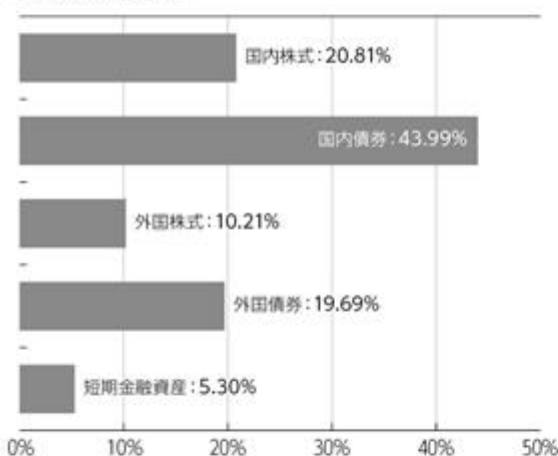
### ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

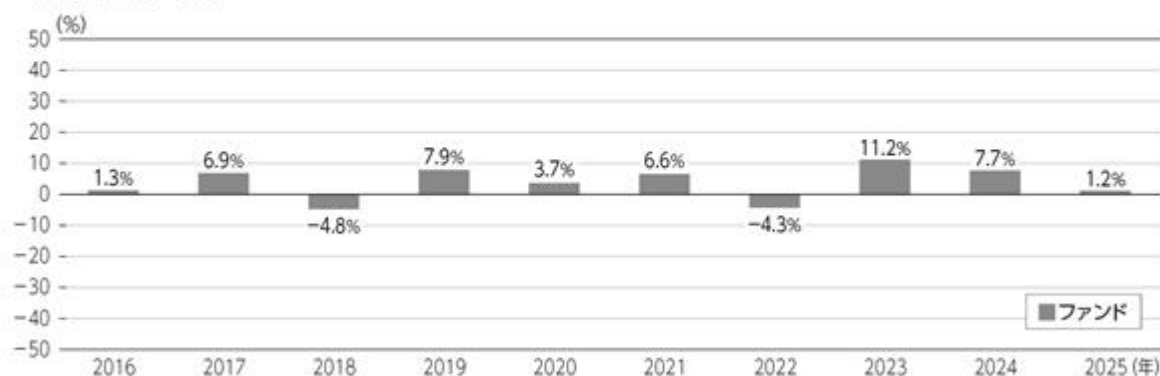
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

### ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

### ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2025年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

基準価額	23.635円
純資産総額	361億円

### ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
2025年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

2025年8月末現在

## 3.運用実績

## DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

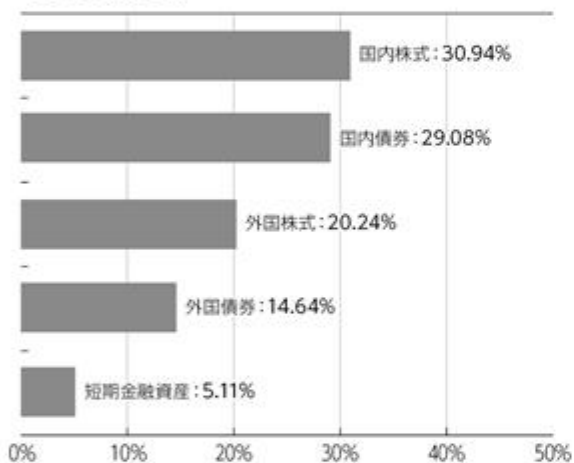
## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

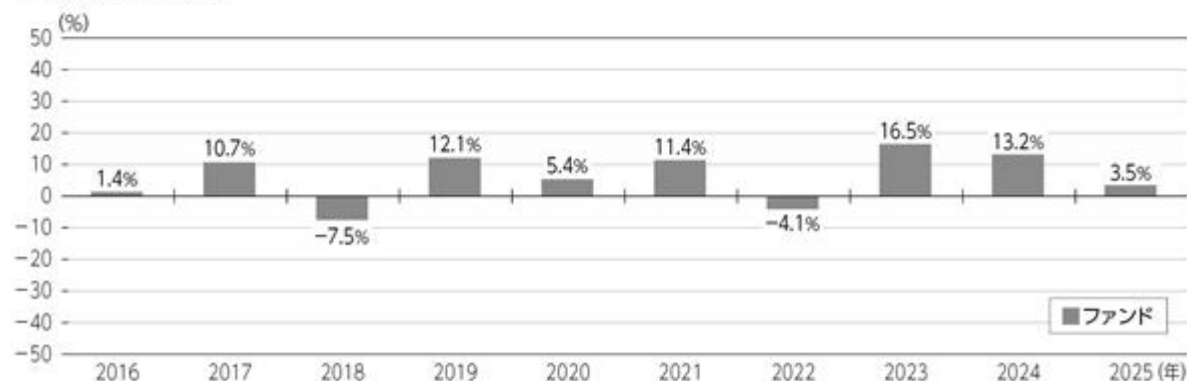
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2025年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

基準価額	33,704円
純資産総額	925億円

## ●分配の推移 1万口当り(税引前)

2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
2025年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## 3.運用実績

2025年8月末現在

## DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

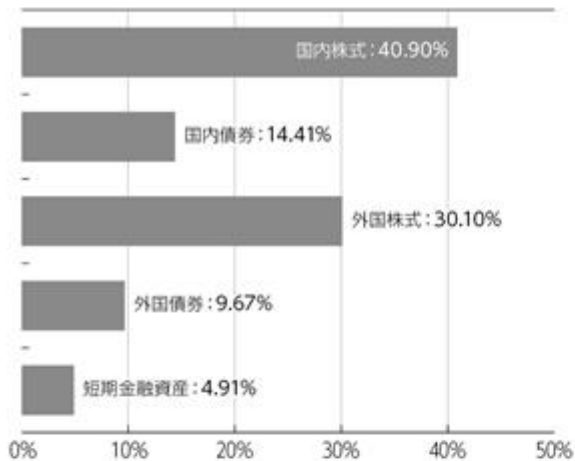
## ●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

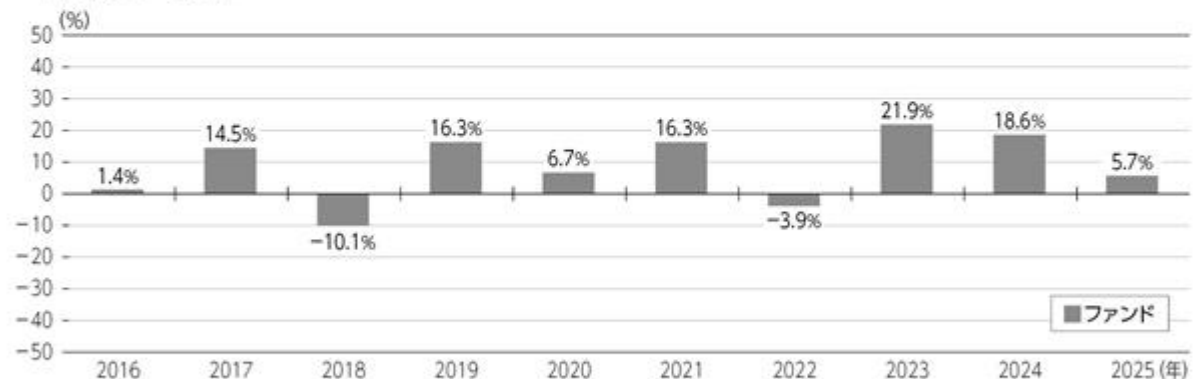
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

## ●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

## ●年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

・2025年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

基準価額	46,569円
純資産総額	650億円

## ●分配の推移 1万口当たり(税引前)

2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
2025年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### 申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付を行います。

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

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

#### 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まれます）を締結します。なお、販売会社によっては、定期引出契約を締結できる場合があります。

#### 申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

#### 申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

#### 販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### 申込手数料

ありません。

#### その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

## 2【換金（解約）手続等】

### 換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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。

証券取引所の取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、換金の受付けを中止することがあります。

### 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

### 換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

### 換金価額

#### < 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

#### < 買取請求の場合 >

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

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

換金手数料はありません。

### 信託財産留保額

ありません。

### 支払開始日

解約請求受付日または買取請求受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。

### その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	証券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。
外国株式	証券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。
国内株式先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。
国内債券先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限です。

#### (4)【計算期間】

毎年2月22日から翌年2月21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します。ただし、最終計算期間の終了日はファンドの償還日とします。

#### (5)【その他】

繰上償還

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

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

2. 委託会社は、前記1.により解約するときには、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

3. 前記2.の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前記3.から5.までの規定は、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3.の一定の期間を1ヵ月以上設けることが困難な場合には適用をしません。
7. 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。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「 約款の変更 4. 」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社の間において存続します。
9. 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「 約款の変更 」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、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。
10. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目(償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目)までにお支払いします。

#### 約款の変更

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ができます。この場合、あらかじめ変更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。
2. 委託会社は、前記1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
3. 前記2.の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1.の約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 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5.の規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

前記「 繰上償還 」に規定する信託契約の解約または前記「 約款の変更 」に規定する約款の変更を行う場合において、「 繰上償還 3. 」または「 約款の変更 3. 」の一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権の買取りを請求することができます。ただし、当該買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社および販売会社の協議により決定します。

#### 公告

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

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

#### 運用報告書の作成

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

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知られたる受益者に交付します。
- ・ 運用報告書(全体版)は、電磁的方法により提供します。ただし、受益者から書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行います。

#### 信託事務処理の再信託

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

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

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

### (3) 解約請求権

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

### (4) 帳簿閲覧権

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

### (5) 反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要 (5) その他 反対者の買取請求権」の項をご参照ください。

### 第3【ファンドの経理状況】

#### DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

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22期計算期間（2024年2月22日から2025年2月21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。

#### DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

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22期計算期間（2024年2月22日から2025年2月21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。

#### DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

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22期計算期間（2024年2月22日から2025年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1 【財務諸表】

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	15,278,530	109,741,085
コール・ローン	1,506,714,765	1,561,370,850
親投資信託受益証券	28,687,946,950	32,048,552,392
未収入金	66,234,743	21,335,084
流動資産合計	30,276,174,988	33,740,999,411
資産合計	30,276,174,988	33,740,999,411
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	69,198,482	22,170,509
未払受託者報酬	3,165,105	3,671,348
未払委託者報酬	18,990,776	22,028,352
その他未払費用	555,920	183,478
流動負債合計	91,910,283	48,053,687
負債合計	91,910,283	48,053,687
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	13,465,469,203	14,741,601,345
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	16,718,795,502	18,951,344,379
（分配準備積立金）	4,830,748,690	4,721,841,004
元本等合計	30,184,264,705	33,692,945,724
純資産合計	30,184,264,705	33,692,945,724
負債純資産合計	30,276,174,988	33,740,999,411

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期 自 2023年2月22日 至 2024年2月21日	第22期 自 2024年2月22日 至 2025年2月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	29,275	2,505,662
有価証券売買等損益	3,266,058,932	626,717,982
営業収益合計	3,266,088,207	629,223,644
<b>営業費用</b>		
支払利息	586,085	8,658
受託者報酬	6,056,092	7,117,863
委託者報酬	36,336,867	42,707,726
その他費用	1,104,705	559,038
営業費用合計	44,083,749	50,393,285
営業利益又は営業損失（ ）	3,222,004,458	578,830,359
経常利益又は経常損失（ ）	3,222,004,458	578,830,359
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,222,004,458	578,830,359
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（ ）	200,054,113	81,053,228
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	12,520,607,945	16,718,795,502
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,860,769,587	4,087,505,741
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,860,769,587	4,087,505,741
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,684,532,375	2,352,733,995
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,684,532,375	2,352,733,995
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（ ）	16,718,795,502	18,951,344,379

## ( 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22期	
	自 2024年2月22日	至 2025年2月21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21期	第22期
	2024年2月21日現在	2025年2月21日現在
1. 期首元本額	12,591,918,256円	13,465,469,203円
期中追加設定元本額	2,552,719,943円	3,164,268,955円
期中一部解約元本額	1,679,168,996円	1,888,136,813円
2. 受益権の総数	13,465,469,203口	14,741,601,345口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第21期	第22期
	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日	自 2024年2月22日 至 2025年2月21日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,021,976,323円)、収益調整金(11,888,564,172円)及び分配準備積立金(1,808,772,367円)より分配対象収益は16,719,312,862円(1万口当たり12,416.44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(2,208,878円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(495,115,824円)、収益調整金(14,229,503,375円)及び分配準備積立金(4,224,516,302円)より分配対象収益は18,951,344,379円(1万口当たり12,855.69円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

## (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21期	第22期
	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日	自 2024年2月22日 至 2025年2月21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21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21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21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21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	2,820,867,064	412,321,453
合計	2,820,867,064	412,321,453

## (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21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21日現在
1口当たり純資産額	2,2416円	2,2856円
(1万口当たり純資産額)	(22,416円)	(22,856円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2025年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	12,235,536,266	15,235,689,758	
	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	2,049,795,615	6,792,202,749	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	3,827,843,478	6,647,815,768	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	672,873,183	3,372,844,117	
親投資信託受益証券 合計		18,786,048,542	32,048,552,392	
合計			32,048,552,392	

(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。

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	37,412,505	275,289,572
コール・ローン	3,689,489,396	3,916,756,544
親投資信託受益証券	70,657,601,050	80,445,308,147
未収入金	83,952,135	78,264,873
流動資産合計	74,468,455,086	84,715,619,136
資産合計	74,468,455,086	84,715,619,136
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	87,092,095	81,660,716
未払受託者報酬	7,621,336	9,180,892
未払委託者報酬	45,728,276	55,085,579
その他未払費用	1,002,990	458,963
流動負債合計	141,444,697	146,386,150
負債合計	141,444,697	146,386,150
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	24,504,201,805	26,500,252,813
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	49,822,808,584	58,068,980,173
（分配準備積立金）	19,627,042,621	21,364,149,942
元本等合計	74,327,010,389	84,569,232,986
純資産合計	74,327,010,389	84,569,232,986
負債純資産合計	74,468,455,086	84,715,619,136

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期 自 2023年2月22日 至 2024年2月21日	第22期 自 2024年2月22日 至 2025年2月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	66,111	6,237,794
有価証券売買等損益	11,291,378,611	4,040,473,548
営業収益合計	11,291,444,722	4,046,711,342
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,320,446	21,258
受託者報酬	14,339,614	17,773,467
委託者報酬	86,038,188	106,641,245
その他費用	1,966,156	1,220,591
営業費用合計	103,664,404	125,656,561
営業利益又は営業損失（ ）	11,187,780,318	3,921,054,781
経常利益又は経常損失（ ）	11,187,780,318	3,921,054,781
当期純利益又は当期純損失（ ）	11,187,780,318	3,921,054,781
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（ ）	492,721,429	285,063,769
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	35,131,252,073	49,822,808,584
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,727,676,454	9,912,923,302
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	7,727,676,454	9,912,923,302
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,731,178,832	5,302,742,725
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,731,178,832	5,302,742,725
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（ ）	49,822,808,584	58,068,980,173

## ( 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22期	
	自 2024年2月22日	至 2025年2月21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21期	第22期
	2024年2月21日現在	2025年2月21日現在
1. 期首元本額	22,536,136,173円	24,504,201,805円
期中追加設定元本額	4,340,901,715円	4,592,514,119円
期中一部解約元本額	2,372,836,083円	2,596,463,111円
2. 受益権の総数	24,504,201,805口	26,500,252,813口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第21期	第22期
	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日	自 2024年2月22日 至 2025年2月21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(10,695,118,820円)、収益調整金(30,196,954,035円)及び分配準備積立金(8,931,923,801円)より分配対象収益は49,823,996,656円(1万口当たり20,332.84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(5,877,041円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,629,040,777円)、収益調整金(36,704,830,231円)及び分配準備積立金(17,729,232,124円)より分配対象収益は58,068,980,173円(1万口当たり21,912.61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21期	第22期
	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日	自 2024年2月22日 至 2025年2月21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21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21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21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21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	10,040,133,429	3,322,339,238
合計	10,040,133,429	3,322,339,238

## (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21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.0332円 (30,332円)	3.1913円 (31,913円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

2025年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	20,456,772,478	25,472,773,089	
	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	7,710,940,504	25,550,972,454	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	7,199,817,047	12,503,922,265	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	3,375,023,010	16,917,640,339	
親投資信託受益証券 合計		38,742,553,039	80,445,308,147	
合計			80,445,308,147	

(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。

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	23,920,821	188,289,907
コール・ローン	2,358,987,116	2,678,945,373
親投資信託受益証券	45,322,713,159	55,082,404,708
未収入金	119,805,316	49,491,466
流動資産合計	47,825,426,412	57,999,131,454
資産合計	47,825,426,412	57,999,131,454
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	125,288,730	51,600,103
未払受託者報酬	4,718,804	6,210,358
未払委託者報酬	28,313,073	37,262,380
その他未払費用	711,776	310,423
流動負債合計	159,032,383	95,383,264
負債合計	159,032,383	95,383,264
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	11,958,594,696	13,396,036,268
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	35,707,799,333	44,507,711,922
（分配準備積立金）	14,012,086,196	15,986,516,579
元本等合計	47,666,394,029	57,903,748,190
純資産合計	47,666,394,029	57,903,748,190
負債純資産合計	47,825,426,412	57,999,131,454

## （ 2 ）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期 自 2023年2月22日 至 2024年2月21日	第22期 自 2024年2月22日 至 2025年2月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	38,267	4,190,598
有価証券売買等損益	8,981,993,891	4,235,918,280
営業収益合計	8,982,032,158	4,240,108,878
<b>営業費用</b>		
支払利息	761,729	13,629
受託者報酬	8,679,407	11,878,964
委託者報酬	52,076,925	71,274,227
その他費用	1,375,214	850,696
営業費用合計	62,893,275	84,017,516
営業利益又は営業損失（ ）	8,919,138,883	4,156,091,362
経常利益又は経常損失（ ）	8,919,138,883	4,156,091,362
当期純利益又は当期純損失（ ）	8,919,138,883	4,156,091,362
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（ ）	512,580,349	362,917,987
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	22,932,786,202	35,707,799,333
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,797,496,096	10,339,045,616
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	7,797,496,096	10,339,045,616
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,429,041,499	5,332,306,402
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,429,041,499	5,332,306,402
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（ ）	35,707,799,333	44,507,711,922

## （ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第22期	
	自 2024年2月22日	至 2025年2月21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21期	第22期
	2024年2月21日現在	2025年2月21日現在
1. 期首元本額	10,460,805,774円	11,958,594,696円
期中追加設定元本額	3,040,409,875円	3,208,872,329円
期中一部解約元本額	1,542,620,953円	1,771,430,757円
2. 受益権の総数	11,958,594,696口	13,396,036,268口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第21期	第22期
	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日	自 2024年2月22日 至 2025年2月21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（8,406,628,465円）、収益調整金（21,696,385,160円）及び分配準備積立金（5,605,457,731円）より分配対象収益は35,708,471,356円（1万口当たり29,860.09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（3,959,211円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（3,788,629,337円）、収益調整金（28,521,195,343円）及び分配準備積立金（12,193,928,031円）より分配対象収益は44,507,711,922円（1万口当たり33,224.54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21期	第22期
	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日	自 2024年2月22日 至 2025年2月21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21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21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21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21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	8,037,345,249	3,600,039,306
合計	8,037,345,249	3,600,039,306

## (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21期 2024年2月21日現在	第22期 2025年2月21日現在
1口当たり純資産額	3.9860円	4.3225円
(1万口当たり純資産額)	(39,860円)	(43,225円)

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

## ( 1 ) 株式

該当事項はありません。

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

2025年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	6,997,372,760	8,713,128,560	
	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	7,033,453,221	23,306,050,593	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	3,283,701,649	5,702,804,653	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	3,463,356,522	17,360,420,902	
親投資信託受益証券 合計		20,777,884,152	55,082,404,708	
合計			55,082,404,708	

(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）

「DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）」、「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」、「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」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、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

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

#### ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）

2025年2月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	298,976,027
コール・ローン	4,253,761,953
株式	286,727,574,920
派生商品評価勘定	9,217,350
未収入金	39,410,341
未収配当金	371,970,044
前払金	9,586,000
差入委託証拠金	253,159,745
流動資産合計	291,963,656,380
資産合計	291,963,656,380
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,649,000
未払解約金	422,465,562
流動負債合計	444,114,562
負債合計	444,114,562
純資産の部	
元本等	
元本	87,977,940,495
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	203,541,601,323
元本等合計	291,519,541,818
純資産合計	291,519,541,818
負債純資産合計	291,963,656,380

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月22日 至 2025年2月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年2月21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	71,947,940,917円
同期中追加設定元本額	34,842,496,860円
同期中一部解約元本額	18,812,497,282円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,050,465,388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）	2,908,656,528円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	1,695,585円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	2,049,795,615円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,710,940,504円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	7,033,453,221円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	1,875,283円
ニッセイインデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	4,278,804円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	8,462,197円
DCニッセイ国内株式インデックス	5,467,185,361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	25,550,144,888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）	5,568,528,183円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	496,059,250円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	255,432,364円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	566,720,767円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	652,082,794円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	19,929,976円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）	126,912,703円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	15,158,098円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	16,155,413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）	5,137,485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)	11,293,831円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	31,006,981円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	412,248,327円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	280,759,287円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	485,102,183円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	170,647,650円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	22,690,704,976円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型パス ケット)	30,738,378円
FWニッセイ国内株インデックス	79,457,905円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	221,589,303円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	44,486,621円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	8,990,577円
ニッセイインデックスバランス(外国株式重視型)SA(適格機関投資 家限定)	1,314,710円
ニッセイ全世界株式インデックスコレクトSA(適格機関投資家限定)	529,359円
計	87,977,940,495円
2. 受益権の総数	87,977,940,495口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年2月22日 至 2025年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2025年2月21日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	203,416,420	
合計	203,416,420	

(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(2025年2月21日から2025年2月21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	2025年2月21日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	5,017,381,000	-		5,005,050,000	12,331,000
合計	5,017,381,000	-		5,005,050,000	12,331,000

## (注) 株価指数先物取引

## 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2025年2月21日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3136円 (33,136円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2025年2月21日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	4,300	4,120.00	17,716,000	
ニッセイ	102,900	851.80	87,650,220	
マルハニチロ	15,300	3,171.00	48,516,300	
雪国まいたけ	8,800	1,197.00	10,533,600	
カネコ種苗	2,900	1,415.00	4,103,500	
サカタのタネ	12,700	3,405.00	43,243,500	
ホクト	9,200	1,922.00	17,682,400	
ショーボンドホールディングス	13,500	4,707.00	63,544,500	
ミライト・ワン	33,700	2,275.00	76,667,500	
タマホーム	6,500	3,285.00	21,352,500	
robot home	42,900	178.00	7,636,200	
住石ホールディングス	12,900	783.00	10,100,700	
日鉄鉱業	4,100	5,650.00	23,165,000	
三井松島ホールディングス	5,000	4,145.00	20,725,000	
INPEX	311,100	1,915.00	595,756,500	
石油資源開発	56,500	1,129.00	63,788,500	
K&Oエナジーグループ	4,700	3,195.00	15,016,500	
リョーサン菱洋ホールディングス	11,900	2,560.00	30,464,000	
第一カッター興業	4,800	1,406.00	6,748,800	
安藤・間	59,600	1,320.00	78,672,000	
東急建設	32,200	766.00	24,665,200	
コムシスホールディングス	36,500	3,167.00	115,595,500	
ビーアールホールディングス	20,300	340.00	6,902,000	
高松コンストラクショングループ	7,600	2,730.00	20,748,000	
東建コーポレーション	2,200	12,510.00	27,522,000	
ヤマウラ	5,400	1,268.00	6,847,200	
オリエンタル白石	38,100	376.00	14,325,600	
大成建設	65,400	6,907.00	451,717,800	
大林組	237,700	2,001.50	475,756,550	
清水建設	196,800	1,404.00	276,307,200	
長谷工コーポレーション	66,100	1,965.50	129,919,550	
松井建設	4,800	901.00	4,324,800	
鹿島建設	159,700	3,134.00	500,499,800	
不動テトラ	4,500	2,267.00	10,201,500	
鉄建建設	4,700	2,548.00	11,975,600	
西松建設	11,500	4,840.00	55,660,000	
三井住友建設	58,100	408.00	23,704,800	
大豊建設	2,000	3,605.00	7,210,000	
奥村組	12,700	4,300.00	54,610,000	

東鉄工業	7,900	3,075.00	24,292,500
浅沼組	28,800	672.00	19,353,600
戸田建設	88,600	968.60	85,817,960
熊谷組	11,900	3,850.00	45,815,000
矢作建設工業	9,800	1,273.00	12,475,400
ピーエス・コンストラクション	5,200	1,510.00	7,852,000
日本ハウスホールディングス	21,500	325.00	6,987,500
大東建託	24,700	15,530.00	383,591,000
新日本建設	10,100	1,400.00	14,140,000
東亜道路工業	12,500	1,480.00	18,500,000
日本道路	7,200	1,864.00	13,420,800
東亜建設工業	21,700	1,345.00	29,186,500
日本国土開発	23,000	485.00	11,155,000
若築建設	2,100	3,505.00	7,360,500
東洋建設	20,700	1,310.00	27,117,000
五洋建設	94,200	653.10	61,522,020
世紀東急工業	10,300	1,533.00	15,789,900
福田組	2,700	5,010.00	13,527,000
住友林業	62,200	4,539.00	282,325,800
大和ハウス工業	217,300	4,985.00	1,083,240,500
ライト工業	14,600	2,593.00	37,857,800
積水ハウス	218,400	3,352.00	732,076,800
日特建設	6,900	1,050.00	7,245,000
ユアテック	13,300	1,587.00	21,107,100
日本リーテック	5,600	1,445.00	8,092,000
四電工	9,000	1,330.00	11,970,000
中電工	11,200	3,210.00	35,952,000
関電工	39,500	2,636.00	104,122,000
きんでん	50,100	3,220.00	161,322,000
東京エネシス	7,700	1,072.00	8,254,400
トーエネック	11,900	985.00	11,721,500
住友電設	5,900	4,645.00	27,405,500
日本電設工業	13,500	2,147.00	28,984,500
エクシオグループ	74,500	1,752.00	130,524,000
新日本空調	9,300	1,640.00	15,252,000
九電工	15,600	4,510.00	70,356,000
三機工業	15,000	3,355.00	50,325,000
日揮ホールディングス	71,300	1,132.00	80,711,600
中外炉工業	2,400	3,610.00	8,664,000
太平電業	4,600	4,835.00	22,241,000
高砂熱学工業	17,400	5,655.00	98,397,000
NEC ネットエスアイ	28,700	3,300.00	94,710,000
朝日工業社	6,700	1,972.00	13,212,400
明星工業	12,100	1,228.00	14,858,800
大気社	9,200	4,600.00	42,320,000
ダイダン	9,500	3,795.00	36,052,500
日比谷総合設備	5,900	3,315.00	19,558,500
ニッポン	23,800	2,117.00	50,384,600
日清製粉グループ本社	75,200	1,690.00	127,088,000
日東富士製粉	1,300	6,550.00	8,515,000

昭和産業	6,100	2,809.00	17,134,900
中部飼料	10,000	1,268.00	12,680,000
フィード・ワン	10,600	802.00	8,501,200
日本甜菜製糖	3,800	2,372.00	9,013,600
D M三井製糖ホールディングス	7,200	3,390.00	24,408,000
ウェルネオシュガー	4,100	2,257.00	9,253,700
L I F U L L	38,100	163.00	6,210,300
M I X I	14,200	3,645.00	51,759,000
ジェイエイシーリクルートメント	27,300	789.00	21,539,700
日本M&Aセンターホールディングス	111,000	607.10	67,388,100
U Tグループ	9,800	2,295.00	22,491,000
アイティメディア	4,000	1,672.00	6,688,000
ケアネット	15,400	721.00	11,103,400
E・Jホールディングス	4,400	1,608.00	7,075,200
オープンアップグループ	25,200	1,844.00	46,468,800
コシダカホールディングス	23,000	1,064.00	24,472,000
パソナグループ	9,200	2,017.00	18,556,400
リンクアンドモチベーション	18,000	582.00	10,476,000
エス・エム・エス	28,800	1,200.00	34,560,000
パーソルホールディングス	688,100	233.80	160,877,780
森永製菓	30,200	2,466.00	74,473,200
中村屋	2,200	3,190.00	7,018,000
江崎グリコ	20,700	4,595.00	95,116,500
名糖産業	3,400	1,983.00	6,742,200
井村屋グループ	4,000	2,441.00	9,764,000
不二家	5,000	2,241.00	11,205,000
山崎製パン	48,400	2,752.50	133,221,000
モロゾフ	7,000	1,655.00	11,585,000
亀田製菓	4,600	3,855.00	17,733,000
寿スピリッツ	42,700	2,397.00	102,351,900
カルビー	33,100	2,850.50	94,351,550
森永乳業	26,900	2,985.00	80,296,500
六甲バター	6,000	1,143.00	6,858,000
ヤクルト本社	103,300	2,939.50	303,650,350
明治ホールディングス	93,000	2,967.50	275,977,500
雪印メグミルク	19,400	2,550.00	49,470,000
プリマハム	9,700	2,144.00	20,796,800
日本ハム	31,100	4,481.00	139,359,100
丸大食品	7,300	1,652.00	12,059,600
S F o o d s	8,000	2,382.00	19,056,000
柿安本店	3,100	2,896.00	8,977,600
伊藤ハム米久ホールディングス	11,000	3,685.00	40,535,000
学情	3,800	2,051.00	7,793,800
スタジオアリス	3,800	2,086.00	7,926,800
クロスキャット	6,500	1,208.00	7,852,000
システナ	105,200	350.00	36,820,000
N J S	1,900	4,445.00	8,445,500
デジタルアーツ	4,700	6,360.00	29,892,000
日鉄ソリューションズ	25,100	4,115.00	103,286,500
総合警備保障	126,100	1,073.50	135,368,350

キューブシステム	6,800	1,006.00	6,840,800
いちご	61,200	352.00	21,542,400
日本駐車場開発	86,100	199.00	17,133,900
コア	3,700	1,848.00	6,837,600
カカクコム	54,400	2,307.00	125,500,800
アイロムグループ	3,000	2,794.00	8,382,000
セントケア・ホールディング	9,300	748.00	6,956,400
ディップ	13,200	2,205.00	29,106,000
SBSホールディングス	6,500	2,887.00	18,765,500
デジタルホールディングス	4,700	1,491.00	7,007,700
新日本科学	8,000	1,552.00	12,416,000
エムスリー	149,200	2,025.00	302,130,000
ワールドホールディングス	3,300	2,083.00	6,873,900
ディー・エヌ・エー	30,200	4,025.00	121,555,000
博報堂DYホールディングス	85,600	1,058.50	90,607,600
ぐるなび	20,500	329.00	6,744,500
ファンコミュニケーションズ	17,300	403.00	6,971,900
ライク	4,900	1,408.00	6,899,200
エスプール	23,900	298.00	7,122,200
WDBホールディングス	3,900	1,766.00	6,887,400
アドウェイズ	24,800	284.00	7,043,200
パリュコマース	9,200	836.00	7,691,200
インフォマート	71,200	410.00	29,192,000
サッポロホールディングス	23,800	7,548.00	179,642,400
アサヒグループホールディングス	542,900	1,761.50	956,318,350
麒麟ホールディングス	301,100	2,018.00	607,619,800
シマダヤ	4,400	1,534.00	6,749,600
宝ホールディングス	48,700	1,162.00	56,589,400
オエノンホールディングス	23,400	417.00	9,757,800
飛島ホールディングス	7,400	1,750.00	12,950,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	45,300	2,465.00	111,664,500
ライフドリンク カンパニー	15,800	1,816.00	28,692,800
サントリー食品インターナショナル	50,900	4,665.00	237,448,500
ダイドーグループホールディングス	8,200	2,906.00	23,829,200
伊藤園	24,200	3,288.00	79,569,600
キーコーヒー	8,100	2,054.00	16,637,400
日清オイリオグループ	10,200	4,735.00	48,297,000
不二製油グループ本社	14,400	2,573.50	37,058,400
J-オイルミルズ	8,300	1,963.00	16,292,900
インターメスティック	4,400	1,805.00	7,942,000
サンエー	13,200	2,961.00	39,085,200
カワチ薬品	6,100	2,629.00	16,036,900
エービーシー・マート	34,000	2,957.50	100,555,000
ハードオフコーポレーション	3,600	1,864.00	6,710,400
高千穂交易	3,100	4,005.00	12,415,500
アスクル	18,400	1,625.00	29,900,000
ゲオホールディングス	8,700	1,752.00	15,242,400
アダストリア	10,700	3,020.00	32,314,000
リガク・ホールディングス	37,100	1,103.00	40,921,300

伊藤忠食品	1,800	7,400.00	13,320,000
くら寿司	9,100	3,165.00	28,801,500
キャンドウ	2,800	3,320.00	9,296,000
パルグループホールディングス	17,800	3,220.00	57,316,000
エディオン	33,800	1,721.00	58,169,800
あらた	11,900	3,140.00	37,366,000
サーラコーポレーション	16,300	760.00	12,388,000
トーメンデバイス	1,100	6,080.00	6,688,000
ハローズ	3,100	3,940.00	12,214,000
J Pホールディングス	19,300	526.00	10,151,800
フジオフードグループ本社	9,700	1,165.00	11,300,500
あみやき亭	5,600	1,568.00	8,780,800
東京エレクトロン デバイス	7,700	3,265.00	25,140,500
円谷フィールズホールディングス	12,600	1,545.00	19,467,000
双日	86,500	3,240.00	280,260,000
アルフレッサ ホールディングス	72,400	1,972.00	142,772,800
大黒天物産	2,800	6,780.00	18,984,000
ハニーズホールディングス	6,900	1,629.00	11,240,100
キッコーマン	239,500	1,425.50	341,407,250
味の素	167,500	5,913.00	990,427,500
ブルドックソース	4,000	1,767.00	7,068,000
キュービー	38,800	2,796.00	108,484,800
ハウス食品グループ本社	24,300	2,749.50	66,812,850
カゴメ	30,900	2,839.00	87,725,100
アリアケジャパン	7,200	5,920.00	42,624,000
エバラ食品工業	2,400	2,837.00	6,808,800
キオクシアホールディングス	33,300	2,333.00	77,688,900
ニチレイ	28,200	3,483.00	98,220,600
横浜冷凍	19,500	876.00	17,082,000
東洋水産	33,500	9,063.00	303,610,500
イトアンドホールディングス	3,700	2,109.00	7,803,300
日清食品ホールディングス	91,400	2,928.00	267,619,200
フジッコ	7,400	1,612.00	11,928,800
ロック・フィールド	8,100	1,537.00	12,449,700
日本たばこ産業	439,300	3,727.00	1,637,271,100
ケンコーマヨネーズ	4,500	1,884.00	8,478,000
わらべや日洋ホールディングス	4,800	2,074.00	9,955,200
なとり	4,500	2,175.00	9,787,500
ファーマフーズ	9,600	915.00	8,784,000
北の達人コーポレーション	41,100	170.00	6,987,000
ユーグレナ	44,900	488.00	21,911,200
紀文食品	6,300	1,040.00	6,552,000
ピククルスホールディングス	6,800	1,001.00	6,806,800
S R Eホールディングス	2,700	3,365.00	9,085,500
片倉工業	6,800	1,976.00	13,436,800
グンゼ	5,200	5,030.00	26,156,000
ヒューリック	168,700	1,363.00	229,938,100
アルペン	7,500	2,180.00	16,350,000
ラクーンホールディングス	7,700	862.00	6,637,400
クオールホールディングス	9,600	1,558.00	14,956,800

アルコニックス	11,100	1,480.00	16,428,000
神戸物産	60,100	3,205.00	192,620,500
ジーンズホールディングス	5,900	7,040.00	41,536,000
ビックカメラ	46,500	1,636.50	76,097,250
DCMホールディングス	40,200	1,367.00	54,953,400
MonotaRO	110,100	2,570.50	283,012,050
あいホールディングス	14,000	1,960.00	27,440,000
J.フロントリテイリング	89,100	1,987.00	177,041,700
ドトール・日レスホールディングス	13,800	2,351.00	32,443,800
マツキヨココカラ&カンパニー	136,900	2,333.50	319,456,150
ブロンコビリー	4,600	3,485.00	16,031,000
ZOZO	57,700	4,768.00	275,113,600
トレジャー・ファクトリー	5,300	1,460.00	7,738,000
物語コーポレーション	15,100	3,150.00	47,565,000
三越伊勢丹ホールディングス	116,100	2,280.50	264,766,050
東洋紡	31,800	964.00	30,655,200
富士紡ホールディングス	2,900	4,875.00	14,137,500
日清紡ホールディングス	55,800	895.60	49,974,480
倉敷紡績	4,900	5,940.00	29,106,000
ダイワボウホールディングス	34,400	2,695.50	92,725,200
シキボウ	6,900	1,012.00	6,982,800
日東紡績	8,300	5,160.00	42,828,000
トヨタ紡織	30,900	1,976.50	61,073,850
マクニカホールディングス	60,200	1,868.00	112,453,600
Hamee	5,300	1,282.00	6,794,600
ラクト・ジャパン	3,300	2,851.00	9,408,300
ウエルシアホールディングス	40,300	2,244.00	90,433,200
クリエイトSDホールディングス	11,000	2,805.00	30,855,000
グリムス	3,300	2,171.00	7,164,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	10,700	1,136.00	12,155,200
八洲電機	6,300	1,715.00	10,804,500
レスター	6,600	2,383.00	15,727,800
TOKAIホールディングス	42,200	931.00	39,288,200
三洋貿易	8,000	1,422.00	11,376,000
シュッピン	7,600	1,003.00	7,622,800
ピューティガレージ	4,900	1,363.00	6,678,700
オイシックス・ラ・大地	12,500	1,327.00	16,587,500
ウイン・パートナーズ	5,700	1,260.00	7,182,000
ネクステージ	17,700	1,438.00	25,452,600
ジョイフル本田	21,600	1,921.00	41,493,600
エターナルホスピタリティグループ	2,900	2,501.00	7,252,900
ホットランド	5,900	2,070.00	12,213,000
すかいらーくホールディングス	106,200	2,480.50	263,429,100
SFPホールディングス	4,400	2,115.00	9,306,000
綿半ホールディングス	6,000	1,626.00	9,756,000
日本毛織	18,800	1,312.00	24,665,600
ヨシックスホールディングス	2,600	2,776.00	7,217,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	33,200	779.00	25,862,800

野村不動産ホールディングス	45,300	4,093.00	185,412,900
三重交通グループホールディングス	15,500	514.00	7,967,000
ディア・ライフ	12,300	1,059.00	13,025,700
地主	6,400	2,111.00	13,510,400
プレサンスコーポレーション	9,600	2,388.00	22,924,800
JPMC	6,200	1,131.00	7,012,200
フージャースホールディングス	11,100	1,062.00	11,788,200
オープンハウスグループ	26,600	5,295.00	140,847,000
東急不動産ホールディングス	217,400	975.00	211,965,000
飯田グループホールディングス	69,300	2,223.50	154,088,550
帝国繊維	8,300	2,446.00	20,301,800
日本コークス工業	74,800	91.00	6,806,800
BEENOS	4,900	3,975.00	19,477,500
あさひ	6,500	1,425.00	9,262,500
日本調剤	5,100	1,361.00	6,941,100
コスモス薬品	15,400	7,049.00	108,554,600
シップヘルスケアホールディングス	30,700	1,926.50	59,143,550
ソフトクリエイティブホールディングス	5,300	2,024.00	10,727,200
セブン&アイ・ホールディングス	858,100	2,380.50	2,042,707,050
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	58,400	1,259.00	73,525,600
明治電機工業	4,600	1,420.00	6,532,000
ツルハホールディングス	13,600	9,397.00	127,799,200
サンマルクホールディングス	6,300	2,242.00	14,124,600
トリドールホールディングス	21,800	3,832.00	83,537,600
帝人	70,700	1,304.00	92,192,800
東レ	537,500	992.40	533,415,000
クラレ	98,100	1,854.00	181,877,400
旭化成	497,500	1,012.00	503,470,000
TOKYO BASE	20,700	324.00	6,706,800
稲葉製作所	4,200	1,667.00	7,001,400
宮地エンジニアリンググループ	9,100	1,785.00	16,243,500
トーカロ	21,800	1,765.00	38,477,000
SUMCO	144,300	1,189.00	171,572,700
川田テクノロジーズ	4,900	3,020.00	14,798,000
RS Technologies	5,900	3,595.00	21,210,500
And Doホールディングス	5,700	1,171.00	6,674,700
シーアールイー	3,800	1,697.00	6,448,600
ケイアイスター不動産	3,900	4,430.00	17,277,000
ジェイ・エス・ビー	3,000	3,060.00	9,180,000
ロードスターキャピタル	4,100	2,450.00	10,045,000
霞ヶ関キャピタル	3,000	14,230.00	42,690,000
JMホールディングス	5,600	2,240.00	12,544,000
コメダホールディングス	20,300	2,684.00	54,485,200
アレンザホールディングス	6,300	1,082.00	6,816,600
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,327.00	6,900,400
パロックジャパンリミテッド	9,100	769.00	6,997,900
クスリのアオキホールディングス	20,200	3,138.00	63,387,600
力の源ホールディングス	5,800	1,336.00	7,748,800

FOOD & LIFE COMPANIES	41,400	4,280.00	177,192,000	
セーレン	14,200	2,667.00	37,871,400	
小松マテーレ	10,700	789.00	8,442,300	
ワコールホールディングス	15,200	5,150.00	78,280,000	
ホギメディカル	9,900	4,830.00	47,817,000	
T S Iホールディングス	23,200	1,228.00	28,489,600	
ワールド	11,300	2,337.00	26,408,100	
T I S	77,800	3,835.00	298,363,000	
グリーホールディングス	24,700	562.00	13,881,400	
GMOベパボ	4,900	1,431.00	7,011,900	
コーエーテックモホールディングス	55,400	2,030.00	112,462,000	
三菱総合研究所	3,500	4,665.00	16,327,500	
ファインデックス	8,500	716.00	6,086,000	
ブレインパッド	5,500	1,245.00	6,847,500	
ポルトゥウィンホールディングス	15,500	440.00	6,820,000	
ネクソン	161,900	2,107.50	341,204,250	
アイスタイル	22,400	481.00	10,774,400	
エムアップホールディングス	9,000	1,508.00	13,572,000	
エイチーム	7,400	921.00	6,815,400	
セルシス	10,500	1,244.00	13,062,000	
エニグモ	20,400	327.00	6,670,800	
コロブラ	25,000	499.00	12,475,000	
ブロードリーフ	29,600	657.00	19,447,200	
デジタルハーツホールディングス	6,200	1,052.00	6,522,400	
メディアドゥ	4,200	1,653.00	6,942,600	
じげん	18,400	460.00	8,464,000	
フィックスターズ	7,400	1,867.00	13,815,800	
CARTA HOLDINGS	4,600	1,442.00	6,633,200	
オブティム	10,000	717.00	7,170,000	
セレス	3,300	2,675.00	8,827,500	
S H I F T	73,400	1,373.00	100,778,200	
特種東海製紙	3,600	3,680.00	13,248,000	
テクマトリックス	15,900	2,167.00	34,455,300	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	18,300	3,055.00	55,906,500	
GMOペイメントゲートウェイ	16,800	8,080.00	135,744,000	
システムリサーチ	5,000	1,640.00	8,200,000	
インターネットイニシアティブ	40,200	2,538.00	102,027,600	
さくらインターネット	11,500	4,325.00	49,737,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,000	2,221.00	6,663,000	
S R Aホールディングス	4,200	4,380.00	18,396,000	
朝日ネット	10,300	662.00	6,818,600	
e B A S E	11,600	579.00	6,716,400	
アバントグループ	10,300	1,889.00	19,456,700	
アドソル日進	3,300	2,142.00	7,068,600	
コムチュア	9,700	1,896.00	18,391,200	
アステリア	11,400	580.00	6,612,000	
アイル	4,100	2,408.00	9,872,800	

王子ホールディングス	278,500	627.70	174,814,450
日本製紙	38,300	1,015.00	38,874,500
北越コーポレーション	41,300	1,357.00	56,044,100
大王製紙	37,100	815.00	30,236,500
マークラインズ	4,400	2,400.00	10,560,000
g u m i	13,600	575.00	7,820,000
テラスカイ	2,800	2,338.00	6,546,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4,300	2,545.00	10,943,500
ネオジャパン	4,100	1,642.00	6,732,200
P R T I M E S	3,000	2,246.00	6,738,000
ラクス	34,800	2,133.50	74,245,800
ダブルスタンダード	4,000	1,615.00	6,460,000
オープンドア	11,500	611.00	7,026,500
アカツキ	3,600	3,090.00	11,124,000
U b i c o mホールディングス	4,800	1,372.00	6,585,600
カナミックネットワーク	15,100	452.00	6,825,200
レンゴー	66,900	800.10	53,526,690
トーモク	4,200	2,369.00	9,949,800
ザ・パック	5,500	3,245.00	17,847,500
チェンジホールディングス	18,200	1,312.00	23,878,400
オークネット	3,400	2,328.00	7,915,200
マクロミル	14,500	1,248.00	18,096,000
オロ	3,100	2,573.00	7,976,300
ユーザーローカル	3,600	1,807.00	6,505,200
P K S H A T e c h n o l o g y	5,900	3,940.00	23,246,000
マネーフォワード	18,100	4,489.00	81,250,900
レゾナック・ホールディングス	66,000	3,527.00	232,782,000
住友化学	591,500	347.40	205,487,100
住友精化	3,500	4,980.00	17,430,000
日産化学	37,800	4,400.00	166,320,000
ラサ工業	2,800	2,664.00	7,459,200
クレハ	15,200	2,760.00	41,952,000
多木化学	2,900	3,520.00	10,208,000
テイカ	5,300	1,440.00	7,632,000
石原産業	12,200	1,698.00	20,715,600
日本曹達	15,600	2,922.00	45,583,200
東ソー	98,200	2,086.00	204,845,200
トクヤマ	23,800	2,688.00	63,974,400
セントラル硝子	9,300	3,220.00	29,946,000
東亜合成	34,100	1,396.50	47,620,650
大阪ソーダ	25,700	1,348.00	34,643,600
関東電化工業	15,800	890.00	14,062,000
デンカ	26,700	2,098.50	56,029,950
イビデン	42,500	3,830.00	162,775,000
信越化学工業	654,000	4,686.00	3,064,644,000
日本カーバイド工業	3,900	1,905.00	7,429,500
プラスアルファ・コンサルティング	9,300	1,464.00	13,615,200
電算システムホールディングス	3,300	2,412.00	7,959,600
堺化学工業	5,100	2,687.00	13,703,700

第一稀元素化学工業	9,700	694.00	6,731,800
エア・ウォーター	69,400	1,885.00	130,819,000
日本酸素ホールディングス	71,300	4,465.00	318,354,500
日本パーカライジング	32,800	1,274.00	41,787,200
高压ガス工業	10,700	859.00	9,191,300
四国化成ホールディングス	8,300	1,907.00	15,828,100
ステラ ケミファ	4,000	4,235.00	16,940,000
保土谷化学工業	2,300	3,125.00	7,187,500
日本触媒	47,100	1,829.50	86,169,450
大日精化工業	5,100	3,090.00	15,759,000
カネカ	18,200	3,724.00	67,776,800
協和キリン	86,600	2,064.00	178,742,400
A P P I E R G R O U P	22,500	1,725.00	38,812,500
三菱瓦斯化学	59,600	2,352.00	140,179,200
三井化学	66,200	3,397.00	224,881,400
東京応化工業	35,100	3,681.00	129,203,100
大阪有機化学工業	6,200	2,623.00	16,262,600
三菱ケミカルグループ	537,600	760.50	408,844,800
K H ネオケム	13,300	2,525.00	33,582,500
ピジヨナル	8,700	7,281.00	63,344,700
ダイセル	83,600	1,323.00	110,602,800
住友ベークライト	23,200	3,495.00	81,084,000
積水化学工業	146,400	2,510.00	367,464,000
日本ゼオン	56,700	1,490.50	84,511,350
アイカ工業	18,600	3,309.00	61,547,400
U B E	37,900	2,240.00	84,896,000
積水樹脂	9,600	1,844.00	17,702,400
旭有機材	4,900	3,875.00	18,987,500
ニチバン	4,600	2,020.00	9,292,000
リケンテクノス	13,200	999.00	13,186,800
大倉工業	3,400	3,505.00	11,917,000
積水化成品工業	19,400	351.00	6,809,400
群栄化学工業	2,500	2,704.00	6,760,000
ダイキョーニシカワ	16,200	607.00	9,833,400
森六ホールディングス	4,100	1,971.00	8,081,100
恵和	6,800	1,241.00	8,438,800
日本化薬	49,800	1,338.50	66,657,300
カーリット	7,300	1,083.00	7,905,900
プレステージ・インターナショナル	35,300	716.00	25,274,800
プロトコーポレーション	8,100	2,165.00	17,536,500
ハイマックス	5,100	1,353.00	6,900,300
アミューズ	4,600	1,514.00	6,964,400
野村総合研究所	159,600	5,232.00	835,027,200
ドリームインキュベータ	1,800	3,950.00	7,110,000
クイック	5,200	1,885.00	9,802,000
日本システム技術	6,800	2,044.00	13,899,200
電通グループ	80,300	3,106.00	249,411,800
インテージホールディングス	4,200	1,700.00	7,140,000
ぴあ	2,600	2,990.00	7,774,000
イオンファンタジー	3,300	2,930.00	9,669,000

ソースネクスト	37,600	213.00	8,008,800
シーティーエス	10,400	810.00	8,424,000
メディカルシステムネットワーク	16,800	404.00	6,787,200
日本精化	4,900	2,181.00	10,686,900
扶桑化学工業	6,800	3,505.00	23,834,000
トリケミカル研究所	8,000	3,820.00	30,560,000
シンプレクス・ホールディングス	14,500	2,798.00	40,571,000
ラクスル	17,800	1,235.00	21,983,000
メルカリ	40,600	2,299.50	93,359,700
A D E K A	25,600	2,790.00	71,424,000
日油	86,600	2,129.50	184,414,700
ハリマ化成グループ	8,100	860.00	6,966,000
ウイングアーク1st	7,700	3,540.00	27,258,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,300	925.00	3,052,500
S a n s a n	20,800	2,340.00	48,672,000
ギフトイ	6,500	1,515.00	9,847,500
花王	179,100	6,526.00	1,168,806,600
第一工業製薬	2,600	2,662.00	6,921,200
石原ケミカル	3,200	2,106.00	6,739,200
三洋化成工業	4,500	3,985.00	17,932,500
メドレー	8,100	2,896.00	23,457,600
ベース	3,600	3,235.00	11,646,000
J M D C	9,000	3,057.00	27,513,000
武田薬品工業	655,200	4,218.00	2,763,633,600
アステラス製薬	645,900	1,465.50	946,566,450
住友ファーマ	65,500	777.00	50,893,500
塩野義製薬	244,200	2,257.50	551,281,500
日本新薬	19,300	3,873.00	74,748,900
中外製薬	230,500	7,685.00	1,771,392,500
科研製薬	12,700	4,379.00	55,613,300
エーザイ	96,100	4,279.00	411,211,900
理研ビタミン	6,200	2,330.00	14,446,000
ロート製薬	77,900	2,286.00	178,079,400
小野薬品工業	150,600	1,558.00	234,634,800
久光製薬	16,400	4,284.00	70,257,600
持田製薬	9,300	3,055.00	28,411,500
参天製薬	133,400	1,434.00	191,295,600
扶桑薬品工業	2,900	2,410.00	6,989,000
ツムラ	25,300	4,316.00	109,194,800
テルモ	491,100	2,670.50	1,311,482,550
H . U . グループホールディングス	22,100	2,612.50	57,736,250
キッセイ薬品工業	11,900	3,590.00	42,721,000
生化学工業	14,000	764.00	10,696,000
栄研化学	11,600	2,146.00	24,893,600
鳥居薬品	4,000	4,210.00	16,840,000
J C R ファーマ	24,900	524.00	13,047,600
東和薬品	9,900	2,826.00	27,977,400
富士製薬工業	5,500	1,331.00	7,320,500
ゼリア新薬工業	11,700	1,989.00	23,271,300

ネクセラファーマ	34,600	840.00	29,064,000
第一三共	695,000	3,429.00	2,383,155,000
杏林製薬	16,000	1,343.00	21,488,000
ダイト	5,100	2,024.00	10,322,400
大塚ホールディングス	181,900	7,194.00	1,308,588,600
ペプチドリーム	35,700	2,116.00	75,541,200
大日本塗料	8,200	1,213.00	9,946,600
日本ペイントホールディングス	325,400	1,042.50	339,229,500
関西ペイント	61,600	2,194.50	135,181,200
中国塗料	16,600	2,104.00	34,926,400
藤倉化成	13,900	492.00	6,838,800
太陽ホールディングス	12,800	3,990.00	51,072,000
D I C	26,100	3,271.00	85,373,100
サカタインクス	16,400	1,767.00	28,978,800
a r t i e n c e	13,200	3,150.00	41,580,000
アルプス技研	6,600	2,480.00	16,368,000
日本空調サービス	8,100	1,002.00	8,116,200
オリエンタルランド	444,900	3,032.00	1,348,936,800
フォーカスシステムズ	6,300	1,062.00	6,690,600
ダスキン	16,500	3,651.00	60,241,500
パーク24	56,400	2,030.00	114,492,000
明光ネットワークジャパン	9,400	741.00	6,965,400
ファルコホールディングス	3,000	2,319.00	6,957,000
クレスコ	12,100	1,123.00	13,588,300
フジ・メディア・ホールディングス	70,700	2,676.00	189,193,200
ラウンドワン	71,300	1,171.00	83,492,300
リゾートトラスト	29,800	3,029.00	90,264,200
オービック	136,700	4,431.00	605,717,700
ジャストシステム	10,600	3,860.00	40,916,000
T D C ソフト	12,400	1,353.00	16,777,200
L I N E ヤフー	1,178,200	491.60	579,203,120
ビー・エム・エル	9,300	2,815.00	26,179,500
トレンドマイクロ	38,700	11,150.00	431,505,000
I D ホールディングス	5,000	1,851.00	9,255,000
リソー教育	47,200	268.00	12,649,600
日本オラクル	14,100	14,645.00	206,494,500
早稲田アカデミー	4,200	2,012.00	8,450,400
アルファシステムズ	2,300	3,305.00	7,601,500
フューチャー	18,300	1,784.00	32,647,200
C A C H o l d i n g s	4,500	1,976.00	8,892,000
ユー・エス・エス	155,200	1,399.00	217,124,800
オービックビジネスコンサルタント	12,400	7,450.00	92,380,000
アイティフォー	8,600	1,267.00	10,896,200
東京個別指導学院	19,600	350.00	6,860,000
東計電算	2,100	4,380.00	9,198,000
サイバーエージェント	166,800	1,162.50	193,905,000
楽天グループ	532,400	982.50	523,083,000
クリーク・アンド・リバー社	4,100	1,717.00	7,039,700
S B I グローバルアセットマネジメント	14,800	694.00	10,271,200

テー・オー・ダブリュー	21,700	310.00	6,727,000
大塚商会	83,500	3,501.00	292,333,500
サイボウズ	10,100	3,050.00	30,805,000
山田コンサルティンググループ	3,800	1,720.00	6,536,000
セントラルスポーツ	2,900	2,418.00	7,012,200
パラカ	3,800	1,810.00	6,878,000
電通総研	7,200	6,040.00	43,488,000
A C C E S S	7,700	1,034.00	7,961,800
デジタルガレージ	11,800	4,590.00	54,162,000
イーエムシステムズ	11,600	770.00	8,932,000
ウェザーニューズ	5,900	3,545.00	20,915,500
C I J	20,200	460.00	9,292,000
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,895.00	7,011,000
WOWOW	6,900	1,000.00	6,900,000
スカラ	17,400	413.00	7,186,200
フルキャストホールディングス	6,200	1,606.00	9,957,200
エン・ジャパン	12,300	1,674.00	20,590,200
セルソース	8,300	837.00	6,947,100
あすか製薬ホールディングス	6,700	1,926.00	12,904,200
サワイグループホールディングス	43,300	2,023.50	87,617,550
富士フイルムホールディングス	444,000	3,017.00	1,339,548,000
コニカミノルタ	165,600	534.10	88,446,960
資生堂	153,700	2,690.50	413,529,850
ライオン	93,700	1,863.50	174,609,950
高砂香料工業	5,000	6,610.00	33,050,000
マンダム	14,600	1,227.00	17,914,200
ミルボン	11,800	2,874.00	33,913,200
コーセー	15,000	6,234.00	93,510,000
コタ	7,500	1,472.00	11,040,000
ポーラ・オルビスホールディングス	37,700	1,206.50	45,485,050
ノエビアホールディングス	6,600	4,140.00	27,324,000
新日本製薬	4,200	2,141.00	8,992,200
エステー	6,000	1,470.00	8,820,000
コニシ	23,200	1,203.00	27,909,600
長谷川香料	14,100	2,729.00	38,478,900
小林製薬	19,300	5,562.00	107,346,600
荒川化学工業	6,800	1,140.00	7,752,000
メック	6,100	2,620.00	15,982,000
日本高純度化学	2,200	3,165.00	6,963,000
タカラバイオ	23,100	884.00	20,420,400
J C U	8,100	3,665.00	29,686,500
デクセリアルズ	64,500	2,270.00	146,415,000
アース製薬	6,800	4,985.00	33,898,000
北興化学工業	6,600	1,302.00	8,593,200
大成ラミック	2,700	2,482.00	6,701,400
クミアイ化学工業	29,300	755.00	22,121,500
日本農薬	11,300	749.00	8,463,700
ニチレキグループ	7,800	2,251.00	17,557,800
ユシロ化学工業	3,800	2,065.00	7,847,000
富士石油	18,800	319.00	5,997,200

出光興産	344,100	1,029.00	354,078,900
E N E O Sホールディングス	1,249,000	848.50	1,059,776,500
コスモエネルギーホールディングス	24,300	6,810.00	165,483,000
A N Y C O L O R	10,000	3,025.00	30,250,000
テスホールディングス	22,900	267.00	6,114,300
インフロニア・ホールディングス	75,500	1,132.50	85,503,750
横浜ゴム	37,200	3,392.00	126,182,400
T O Y O T I R E	42,300	2,530.50	107,040,150
ブリヂストン	215,600	5,950.00	1,282,820,000
住友ゴム工業	72,300	1,751.50	126,633,450
藤倉コンポジット	7,100	1,423.00	10,103,300
オカモト	3,900	5,000.00	19,500,000
アキレス	4,700	1,461.00	6,866,700
フコク	4,400	1,592.00	7,004,800
ニッタ	7,200	3,605.00	25,956,000
住友理工	14,300	1,661.00	23,752,300
三ツ星ベルト	10,200	3,745.00	38,199,000
バンドー化学	10,900	1,690.00	18,421,000
A G C	71,600	4,472.00	320,195,200
日本板硝子	37,700	387.00	14,589,900
有沢製作所	11,100	1,414.00	15,695,400
日本電気硝子	27,300	3,605.00	98,416,500
オハラ	6,300	1,051.00	6,621,300
住友大阪セメント	12,800	3,496.00	44,748,800
太平洋セメント	45,400	4,036.00	183,234,400
日本ヒューム	6,400	1,829.00	11,705,600
日本コンクリート工業	19,100	353.00	6,742,300
三谷セキサン	2,600	5,840.00	15,184,000
アジアパイルホールディングス	10,500	887.00	9,313,500
東海カーボン	67,900	920.10	62,474,790
日本カーボン	4,200	4,060.00	17,052,000
東洋炭素	5,200	3,900.00	20,280,000
ノリタケ	8,200	3,505.00	28,741,000
T O T O	53,400	4,029.00	215,148,600
日本碍子	81,800	1,870.50	153,006,900
日本特殊陶業	60,200	4,495.00	270,599,000
M A R U W A	3,100	36,540.00	113,274,000
品川リフラクトリーズ	9,100	1,740.00	15,834,000
黒崎播磨	5,000	2,557.00	12,785,000
ヨータイ	100	1,703.00	170,300
フジインコーポレーテッド	19,800	2,082.00	41,223,600
ニチアス	18,600	4,516.00	83,997,600
日本製鉄	383,600	3,364.00	1,290,430,400
神戸製鋼所	152,300	1,753.00	266,981,900
中山製鋼所	15,600	752.00	11,731,200
合同製鐵	4,200	3,845.00	16,149,000
J F Eホールディングス	228,200	1,802.00	411,216,400
東京製鐵	21,200	1,581.00	33,517,200
共英製鋼	7,400	1,960.00	14,504,000
大和工業	14,300	7,922.00	113,284,600

東京鐵鋼	3,300	5,690.00	18,777,000
大阪製鐵	3,500	2,749.00	9,621,500
淀川製鋼所	7,000	5,860.00	41,020,000
中部鋼鈹	5,000	2,182.00	10,910,000
丸一鋼管	23,100	3,452.00	79,741,200
モリ工業	1,900	4,555.00	8,654,500
大同特殊鋼	47,700	1,186.00	56,572,200
日本冶金工業	5,100	4,110.00	20,961,000
山陽特殊製鋼	7,500	2,744.00	20,580,000
愛知製鋼	4,400	7,240.00	31,856,000
大平洋金属	7,000	1,530.00	10,710,000
新日本電工	45,200	277.00	12,520,400
栗本鐵工所	3,500	4,820.00	16,870,000
日本製鋼所	22,500	5,280.00	118,800,000
三菱製鋼	5,600	1,634.00	9,150,400
日本精線	6,000	1,301.00	7,806,000
エンビプロ・ホールディングス	7,100	415.00	2,946,500
大紀アルミニウム工業所	10,800	995.00	10,746,000
日本輕金属ホールディングス	22,200	1,553.00	34,476,600
三井金属鈹業	19,000	4,288.00	81,472,000
三菱マテリアル	54,200	2,347.50	127,234,500
住友金属鈹山	95,900	3,354.00	321,648,600
D O W Aホールディングス	20,500	4,586.00	94,013,000
古河機械金属	10,000	2,163.00	21,630,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,100	1,905.00	24,955,500
東邦チタニウム	15,700	976.00	15,323,200
U A C J	10,700	5,000.00	53,500,000
C Kサンエツ	1,900	3,850.00	7,315,000
古河電気工業	25,300	6,918.00	175,025,400
住友電気工業	261,600	2,734.50	715,345,200
フジクラ	81,300	6,613.00	537,636,900
S W C C	10,200	6,190.00	63,138,000
平河ヒューテック	4,800	1,467.00	7,041,600
いよぎんホールディングス	94,700	1,631.00	154,455,700
しずおかフィナンシャルグループ	159,300	1,602.00	255,198,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	60,900	1,635.50	99,601,950
楽天銀行	33,500	5,827.00	195,204,500
京都フィナンシャルグループ	91,000	2,157.50	196,332,500
リョービ	8,100	2,190.00	17,739,000
A R Eホールディングス	30,600	1,843.00	56,395,800
東洋製罐グループホールディングス	48,300	2,325.00	112,297,500
ホッカンホールディングス	4,100	1,674.00	6,863,400
コロナ	7,400	937.00	6,933,800
横河ブリッジホールディングス	13,000	2,551.00	33,163,000
三和ホールディングス	74,800	4,999.00	373,925,200
文化シャッター	19,800	1,846.00	36,550,800
三協立山	11,500	593.00	6,819,500
アルインコ	6,600	1,029.00	6,791,400
L I X I L	110,400	1,726.00	190,550,400
ノーリツ	10,700	1,687.00	18,050,900

長府製作所	8,500	1,842.00	15,657,000
リンナイ	40,300	3,415.00	137,624,500
ユニプレス	13,200	1,042.00	13,754,400
日東精工	12,000	585.00	7,020,000
岡部	13,500	818.00	11,043,000
ジーテクト	8,400	1,618.00	13,591,200
東プレ	13,300	1,792.00	23,833,600
高周波熱錬	11,200	994.00	11,132,800
サンコール	26,500	385.00	10,202,500
パイオラックス	10,200	2,349.00	23,959,800
エイチワン	7,800	1,059.00	8,260,200
日本発条	67,000	1,749.50	117,216,500
中央発條	4,900	1,545.00	7,570,500
三浦工業	34,400	3,248.00	111,731,200
タクマ	25,100	1,824.00	45,782,400
テクノプロ・ホールディングス	45,900	3,012.00	138,250,800
アイ・アールジャパンホールディングス	9,200	721.00	6,633,200
Keeper 技研	4,700	3,915.00	18,400,500
イー・ガーディアン	3,600	2,137.00	7,693,200
ジャパンマテリアル	23,100	1,478.00	34,141,800
ベクトル	10,300	969.00	9,980,700
チャーム・ケア・コーポレーション	6,300	1,239.00	7,805,700
キャリアリンク	2,800	2,292.00	6,417,600
IBJ	10,400	682.00	7,092,800
アサンテ	4,200	1,635.00	6,867,000
バリューHR	6,800	1,410.00	9,588,000
M&Aキャピタルパートナーズ	6,100	2,880.00	17,568,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,041.00	7,078,800
シグマクシス・ホールディングス	22,000	960.00	21,120,000
ウィルグループ	6,900	993.00	6,851,700
リクルートホールディングス	588,900	9,669.00	5,694,074,100
エラン	10,000	767.00	7,670,000
ツガミ	15,800	1,725.00	27,255,000
オークマ	13,000	3,355.00	43,615,000
芝浦機械	9,500	3,570.00	33,915,000
アマダ	103,000	1,451.50	149,504,500
アイダエンジニアリング	16,600	814.00	13,512,400
FUJI	32,200	2,212.50	71,242,500
牧野フライス製作所	8,300	11,820.00	98,106,000
オーエスジー	32,700	1,718.00	56,178,600
旭ダイヤモンド工業	18,500	836.00	15,466,000
DMG森精機	46,800	2,665.50	124,745,400
ソディック	19,600	932.00	18,267,200
ディスコ	35,700	45,840.00	1,636,488,000
日東工器	3,200	2,089.00	6,684,800
日進工具	9,200	754.00	6,936,800
日本郵政	845,300	1,593.00	1,346,562,900
ベルシステム24ホールディングス	8,100	1,262.00	10,222,200

鎌倉新書	13,300	496.00	6,596,800
エアトリ	5,500	1,098.00	6,039,000
アトラエ	8,700	740.00	6,438,000
ストライク	3,700	3,195.00	11,821,500
ソラスト	20,800	469.00	9,755,200
インソース	16,400	923.00	15,137,200
豊田自動織機	62,700	12,810.00	803,187,000
リケンNPR	9,300	2,548.00	23,696,400
島精機製作所	11,800	927.00	10,938,600
オプトラン	12,200	1,706.00	20,813,200
イワキ	4,900	2,396.00	11,740,400
フリーー	7,000	1,039.00	7,273,000
ヤマシンフィルタ	15,700	623.00	9,781,100
日阪製作所	9,000	1,023.00	9,207,000
やまびこ	12,100	2,436.00	29,475,600
野村マイクロ・サイエンス	12,300	2,526.00	31,069,800
平田機工	3,500	4,840.00	16,940,000
P E G A S U S	14,000	495.00	6,930,000
タツモ	5,300	2,248.00	11,914,400
ナブテスコ	46,500	2,480.00	115,320,000
三井海洋開発	9,400	4,260.00	40,044,000
レオン自動機	7,800	1,276.00	9,952,800
S M C	22,200	56,170.00	1,246,974,000
ホソカワミクロン	5,200	3,920.00	20,384,000
ユニオンツール	3,300	4,495.00	14,833,500
オイレス工業	10,100	2,243.00	22,654,300
日精エー・エス・ビー機械	2,500	5,270.00	13,175,000
サトーホールディングス	9,200	2,097.00	19,292,400
技研製作所	7,000	1,422.00	9,954,000
日本エアーテック	6,300	1,066.00	6,715,800
日精樹脂工業	7,300	923.00	6,737,900
ワイエイシーホールディングス	7,600	996.00	7,569,600
小松製作所	365,500	4,640.00	1,695,920,000
住友重機械工業	43,900	2,989.50	131,239,050
日立建機	29,500	3,902.00	115,109,000
日工	11,000	692.00	7,612,000
巴工業	2,900	3,605.00	10,454,500
井関農機	7,400	1,009.00	7,466,600
T O W A	22,700	1,602.00	36,365,400
北川鉄工所	5,600	1,213.00	6,792,800
ローツェ	38,700	1,937.00	74,961,900
クボタ	379,200	1,955.50	741,525,600
荏原実業	3,500	4,075.00	14,262,500
東洋エンジニアリング	10,600	710.00	7,526,000
三菱化工機	2,600	3,775.00	9,815,000
月島ホールディングス	10,000	1,550.00	15,500,000
帝国電機製作所	5,100	2,900.00	14,790,000
新東工業	16,500	896.00	14,784,000
澁谷工業	7,000	3,300.00	23,100,000
アイチコーポレーション	12,300	1,488.00	18,302,400

小森コーポレーション	18,300	1,272.00	23,277,600
鶴見製作所	5,700	3,160.00	18,012,000
酒井重工業	2,900	2,250.00	6,525,000
荏原製作所	152,200	2,630.00	400,286,000
西島製作所	6,400	2,366.00	15,142,400
北越工業	7,500	2,033.00	15,247,500
ダイキン工業	96,600	15,970.00	1,542,702,000
オルガノ	11,500	7,110.00	81,765,000
トーヨーカネツ	2,600	3,815.00	9,919,000
栗田工業	41,500	4,890.00	202,935,000
椿本チエイン	33,600	1,888.00	63,436,800
日機装	19,000	1,202.00	22,838,000
木村化工機	8,500	798.00	6,783,000
レイズネクスト	10,400	1,571.00	16,338,400
アネスト岩田	12,600	1,241.00	15,636,600
ダイフク	125,200	3,945.00	493,914,000
タダノ	42,700	1,085.50	46,350,850
フジテック	23,800	5,872.00	139,753,600
C K D	20,500	2,334.00	47,847,000
平和	24,700	2,265.00	55,945,500
理想科学工業	11,900	1,434.00	17,064,600
S A N K Y O	85,700	2,162.50	185,326,250
日本金銭機械	9,000	1,138.00	10,242,000
マースグループホールディングス	5,000	3,125.00	15,625,000
フクシマガリレイ	10,900	2,692.00	29,342,800
ダイコク電機	3,200	2,611.00	8,355,200
竹内製作所	13,500	5,450.00	73,575,000
アマノ	21,000	3,798.00	79,758,000
ジャノメ	7,000	1,013.00	7,091,000
ブラザー工業	99,100	2,748.50	272,376,350
マックス	8,900	4,105.00	36,534,500
モリタホールディングス	11,600	2,077.00	24,093,200
グローリー	19,400	2,583.00	50,110,200
新晃工業	21,200	1,261.00	26,733,200
大和冷機工業	11,400	1,610.00	18,354,000
セガサミーホールディングス	66,200	2,885.50	191,020,100
T P R	9,400	2,316.00	21,770,400
ツバキ・ナカシマ	18,300	484.00	8,857,200
ホシザキ	47,700	5,867.00	279,855,900
大豊工業	11,000	621.00	6,831,000
日本精工	137,300	639.80	87,844,540
N T N	175,500	239.20	41,979,600
ジェイテクト	66,000	1,152.00	76,032,000
不二越	5,500	3,265.00	17,957,500
ミネベアミツミ	129,000	2,330.00	300,570,000
日本トムソン	20,200	484.00	9,776,800
T H K	42,800	3,812.00	163,153,600
ユースン精機	10,500	641.00	6,730,500
前澤給装工業	5,300	1,321.00	7,001,300
イーグル工業	8,200	1,999.00	16,391,800

P I L L A R	6,900	3,720.00	25,668,000	
キット	24,000	1,164.00	27,936,000	
日立製作所	1,909,500	4,193.00	8,006,533,500	
三菱電機	754,200	2,364.00	1,782,928,800	
富士電機	45,100	6,750.00	304,425,000	
安川電機	80,500	4,411.00	355,085,500	
シンフォニア テクノロジー	7,400	6,070.00	44,918,000	
明電舎	12,500	4,565.00	57,062,500	
山洋電気	3,200	9,240.00	29,568,000	
デンヨー	5,600	2,596.00	14,537,600	
PHCホールディングス	13,900	1,063.00	14,775,700	
KOKUSAI ELECTRIC	52,000	3,629.00	188,708,000	
ソシオネクスト	73,900	2,069.00	152,899,100	
ベイカレント	55,500	6,607.00	366,688,500	
Orchestra Holdings	8,700	767.00	6,672,900	
アイモバイル	14,100	481.00	6,782,100	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	29,300	2,868.00	84,032,400	
ミダックホールディングス	4,600	1,897.00	8,726,200	
キュービーネットホールディングス	6,600	1,020.00	6,732,000	
三櫻工業	10,500	639.00	6,709,500	
マキタ	92,300	4,827.00	445,532,100	
東芝テック	11,100	3,015.00	33,466,500	
芝浦メカトロニクス	5,400	9,160.00	49,464,000	
マブチモーター	32,200	2,299.00	74,027,800	
ニデック	327,400	2,821.50	923,759,100	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	23,100	299.00	6,906,900	
トレックス・セミコンダクター	5,800	1,266.00	7,342,800	
東光高岳	4,000	2,030.00	8,120,000	
ダイヘン	7,000	7,180.00	50,260,000	
ヤーマン	14,500	767.00	11,121,500	
JVCケンウッド	58,500	1,411.50	82,572,750	
ミマキエンジニアリング	6,200	1,526.00	9,461,200	
大崎電気工業	15,900	763.00	12,131,700	
オムロン	67,900	4,644.00	315,327,600	
日東工業	10,000	2,933.00	29,330,000	
I D E C	10,900	2,524.00	27,511,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	33,100	2,475.00	81,922,500	
メルコホールディングス	1,100	2,351.00	2,586,100	
テクノメディカ	3,900	1,759.00	6,860,100	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	12,400	564.00	6,993,600	
日本電気	104,900	15,115.00	1,585,563,500	
富士通	682,300	2,959.50	2,019,266,850	
沖電気工業	35,900	916.00	32,884,400	
電気興業	4,100	1,592.00	6,527,200	
サンケン電気	7,600	6,445.00	48,982,000	
アイホン	4,500	2,611.00	11,749,500	
ルネサスエレクトロニクス	564,900	2,743.50	1,549,803,150	

セイコーエプソン	95,100	2,455.50	233,518,050
ワコム	52,100	636.00	33,135,600
アルバック	16,300	5,683.00	92,632,900
E I Z O	9,700	2,124.00	20,602,800
日本信号	16,900	896.00	15,142,400
京三製作所	17,300	491.00	8,494,300
能美防災	10,000	3,025.00	30,250,000
ホーチキ	4,700	2,439.00	11,463,300
エレコム	17,700	1,632.00	28,886,400
パナソニック ホールディングス	876,000	1,833.00	1,605,708,000
シャープ	107,100	960.00	102,816,000
アンリツ	52,200	1,417.00	73,967,400
富士通ゼネラル	21,000	2,754.00	57,834,000
ソニーグループ	2,532,700	3,813.00	9,657,185,100
T D K	640,400	1,675.50	1,072,990,200
帝国通信工業	3,200	2,363.00	7,561,600
タムラ製作所	29,500	554.00	16,343,000
アルプスアルパイン	60,200	1,547.50	93,159,500
鈴木	4,000	1,643.00	6,572,000
メイコー	7,400	7,830.00	57,942,000
フォスター電機	7,500	1,465.00	10,987,500
S M K	2,400	2,645.00	6,348,000
ヨコオ	6,500	1,511.00	9,821,500
ホシデン	18,200	2,139.00	38,929,800
ヒロセ電機	10,800	18,470.00	199,476,000
日本航空電子工業	19,300	2,679.00	51,704,700
T O A	7,500	938.00	7,035,000
マクセル	14,200	1,865.00	26,483,000
古野電気	8,800	2,274.00	20,011,200
スミダコーポレーション	10,000	947.00	9,470,000
アイコム	2,900	2,740.00	7,946,000
リオン	3,000	2,456.00	7,368,000
横河電機	81,100	2,864.00	232,270,400
新電元工業	2,800	2,550.00	7,140,000
アズビル	200,100	1,169.00	233,916,900
日本光電工業	65,700	2,208.00	145,065,600
チノー	3,100	2,078.00	6,441,800
日本電子材料	4,500	2,335.00	10,507,500
堀場製作所	13,900	10,050.00	139,695,000
アドバンテスト	231,400	9,630.00	2,228,382,000
エスベック	6,500	2,323.00	15,099,500
キーエンス	73,500	62,700.00	4,608,450,000
日置電機	3,900	7,130.00	27,807,000
シスメックス	190,100	2,738.00	520,493,800
日本マイクロニクス	12,100	5,090.00	61,589,000
メガチップス	5,700	5,020.00	28,614,000
O B A R A G R O U P	4,600	3,405.00	15,663,000
I M A G I C A G R O U P	13,400	493.00	6,606,200
デンソー	719,300	1,953.00	1,404,792,900
コーセル	9,000	1,017.00	9,153,000

イリソ電子工業	7,400	2,692.00	19,920,800
オブテックグループ	13,500	1,651.00	22,288,500
千代田インテグレ	2,600	3,090.00	8,034,000
レーザーテック	28,500	15,085.00	429,922,500
スタンレー電気	46,000	2,507.00	115,322,000
ウシオ電機	32,500	2,089.00	67,892,500
日本セラミック	6,700	2,704.00	18,116,800
古河電池	5,400	1,383.00	7,468,200
山一電機	6,000	2,155.00	12,930,000
図研	6,700	4,755.00	31,858,500
日本電子	17,000	5,192.00	88,264,000
カシオ計算機	58,700	1,243.50	72,993,450
ファナック	355,300	4,467.00	1,587,125,100
日本シイエムケイ	21,500	492.00	10,578,000
エンプラス	2,100	4,980.00	10,458,000
大真空	11,300	588.00	6,644,400
ローム	133,000	1,636.50	217,654,500
浜松ホトニクス	117,800	1,678.50	197,727,300
三井ハイテック	32,500	932.00	30,290,000
新光電気工業	26,000	5,903.00	153,478,000
京セラ	456,200	1,742.00	794,700,400
太陽誘電	32,200	2,663.00	85,748,600
村田製作所	646,700	2,718.50	1,758,053,950
双葉電子工業	14,000	516.00	7,224,000
日東電工	232,800	2,977.00	693,045,600
東海理化電機製作所	20,700	2,189.00	45,312,300
ニチコン	19,300	1,242.00	23,970,600
日本ケミコン	9,000	909.00	8,181,000
K O A	12,200	991.00	12,090,200
三井E & S	39,600	1,663.00	65,854,800
カナデビア	60,800	925.00	56,240,000
三菱重工業	1,296,700	2,104.00	2,728,256,800
川崎重工業	55,300	7,862.00	434,768,600
I H I	59,500	9,150.00	544,425,000
名村造船所	21,000	1,930.00	40,530,000
プロレド・パートナーズ	16,000	430.00	6,880,000
アンビスホールディングス	16,200	705.00	11,421,000
カーブスホールディングス	20,600	667.00	13,740,200
フォーラムエンジニアリング	8,800	1,043.00	9,178,400
Mac bee Planet	2,100	3,310.00	6,951,000
日本車輛製造	3,300	2,027.00	6,689,100
三菱ロジスネクスト	11,700	2,000.00	23,400,000
フルサト・マルカホールディングス	6,200	2,255.00	13,981,000
ヤマエグループホールディングス	8,400	2,193.00	18,421,200
F P G	25,600	2,422.00	62,003,200
全国保証	18,900	5,468.00	103,345,200
めぶきフィナンシャルグループ	363,000	631.20	229,125,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,700	1,815.00	21,235,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,300	5,200.00	48,360,000

九州フィナンシャルグループ	127,200	755.90	96,150,480
かんぽ生命保険	84,200	2,872.00	241,822,400
ゆうちょ銀行	595,900	1,533.00	913,514,700
富山第一銀行	23,000	1,010.00	23,230,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	384,700	935.70	359,963,790
ジェイリース	5,400	1,317.00	7,111,800
西日本フィナンシャルホールディングス	44,500	2,039.00	90,735,500
SBIアルヒ	7,100	839.00	5,956,900
プレミアグループ	12,200	2,200.00	26,840,000
日産自動車	917,700	458.80	421,040,760
いすゞ自動車	226,800	1,987.50	450,765,000
トヨタ自動車	3,902,900	2,706.00	10,561,247,400
日野自動車	110,400	486.80	53,742,720
三菱自動車工業	280,700	420.20	117,950,140
武蔵精密工業	18,000	2,702.00	48,636,000
日産車体	11,200	1,072.00	12,006,400
新明和工業	21,200	1,357.00	28,768,400
極東開発工業	9,900	2,475.00	24,502,500
トビー工業	5,900	2,091.00	12,336,900
ティラド	1,900	3,585.00	6,811,500
タチエス	13,500	1,765.00	23,827,500
NOK	28,500	2,304.50	65,678,250
フタバ産業	22,100	754.00	16,663,400
カヤバ	12,500	2,909.00	36,362,500
市光工業	16,900	406.00	6,861,400
大同メタル工業	14,400	498.00	7,171,200
プレス工業	28,700	567.00	16,272,900
太平洋工業	16,800	1,373.00	23,066,400
アイシン	155,500	1,750.00	272,125,000
マツダ	225,500	1,014.50	228,769,750
本田技研工業	1,739,600	1,380.00	2,400,648,000
スズキ	593,300	1,880.00	1,115,404,000
SUBARU	221,400	2,738.00	606,193,200
ヤマハ発動機	310,000	1,238.00	383,780,000
小糸製作所	76,100	1,926.50	146,606,650
エクセディ	12,000	4,715.00	56,580,000
ミツバ	13,800	787.00	10,860,600
豊田合成	21,000	2,675.00	56,175,000
愛三工業	13,900	1,921.00	26,701,900
ヨロズ	7,600	1,017.00	7,729,200
エフ・シー・シー	12,900	3,065.00	39,538,500
シマノ	31,900	20,180.00	643,742,000
テイ・エス テック	29,900	1,720.00	51,428,000
三十三フィナンシャルグループ	6,500	2,348.00	15,262,000
第四北越フィナンシャルグループ	22,700	2,780.00	63,106,000
ひろぎんホールディングス	101,700	1,201.50	122,192,550
おきなわフィナンシャルグループ	5,700	2,515.00	14,335,500
ダイレクトマーケティングミックス	25,400	298.00	7,569,200

LITALICO	6,900	1,116.00	7,700,400
十六フィナンシャルグループ	10,200	4,570.00	46,614,000
北國フィナンシャルホールディングス	7,100	5,380.00	38,198,000
ネットプロテクションズホールディングス	24,100	446.00	10,748,600
プロクレアホールディングス	8,300	1,755.00	14,566,500
F Pパートナー	3,200	2,372.00	7,590,400
あいちフィナンシャルグループ	13,500	2,769.00	37,381,500
ジャムコ	4,400	1,781.00	7,836,400
小野建	8,500	1,467.00	12,469,500
ノジマ	25,300	2,270.00	57,431,000
佐鳥電機	4,900	1,632.00	7,996,800
カッパ・クリエイト	12,200	1,449.00	17,677,800
伯東	4,400	4,455.00	19,602,000
コンドーテック	6,000	1,314.00	7,884,000
ナガイレーベン	9,800	1,778.00	17,424,400
三菱食品	7,200	4,700.00	33,840,000
良品計画	92,500	4,138.00	382,765,000
松田産業	5,900	3,080.00	18,172,000
第一興商	30,100	1,580.50	47,573,050
メディバルホールディングス	84,300	2,224.00	187,483,200
アドヴァングループ	7,300	917.00	6,694,100
S P K	3,300	2,084.00	6,877,200
萩原電気ホールディングス	3,300	3,340.00	11,022,000
アルビス	2,700	2,624.00	7,084,800
アズワン	24,100	2,410.00	58,081,000
スズデン	3,600	1,930.00	6,948,000
シモジマ	5,300	1,285.00	6,810,500
ドウシシャ	7,200	2,050.00	14,760,000
高速	4,600	2,096.00	9,641,600
G - 7ホールディングス	8,500	1,252.00	10,642,000
イオン北海道	19,100	851.00	16,254,100
コジマ	15,000	999.00	14,985,000
コーナン商事	8,600	3,585.00	30,831,000
エコス	3,500	1,994.00	6,979,000
ワタミ	9,400	986.00	9,268,400
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	156,900	4,055.00	636,229,500
丸文	6,900	1,019.00	7,031,100
西松屋チェーン	17,200	2,171.00	37,341,200
ゼンショーホールディングス	44,100	7,687.00	338,996,700
ハビネット	5,900	4,860.00	28,674,000
幸楽苑	6,700	1,078.00	7,222,600
橋本総業ホールディングス	5,800	1,203.00	6,977,400
日本ライフライン	20,800	1,547.00	32,177,600
サイゼリヤ	11,500	4,400.00	50,600,000
タカショー	17,200	392.00	6,742,400
V Tホールディングス	30,300	492.00	14,907,600
アルゴグラフィックス	6,800	5,150.00	35,020,000
魚力	2,900	2,402.00	6,965,800

I D O M	26,400	1,137.00	30,016,800
フジ・コーポレーション	3,600	1,913.00	6,886,800
ユナイテッドアローズ	8,300	2,172.00	18,027,600
進和	4,700	2,770.00	13,019,000
ダイトロン	3,400	3,260.00	11,084,000
ハイデイ日高	12,600	2,684.00	33,818,400
シークス	11,100	1,049.00	11,643,900
コロワイド	43,800	1,705.50	74,700,900
オーハシテクニカ	3,600	1,887.00	6,793,200
壱番屋	30,700	950.00	29,165,000
白銅	3,000	2,286.00	6,858,000
スギホールディングス	41,700	2,731.50	113,903,550
薬王堂ホールディングス	3,800	1,840.00	6,992,000
島津製作所	105,700	3,957.00	418,254,900
J M S	14,600	478.00	6,978,800
長野計器	4,800	1,974.00	9,475,200
ブイ・テクノロジー	3,600	2,318.00	8,344,800
スター精密	12,500	1,917.00	23,962,500
東京計器	5,200	3,240.00	16,848,000
愛知時計電機	2,700	1,777.00	4,797,900
インターアクション	6,100	1,185.00	7,228,500
東京精密	15,000	9,109.00	136,635,000
マニー	29,400	1,383.00	40,660,200
ニコン	115,800	1,534.00	177,637,200
トプコン	41,700	2,848.00	118,761,600
オリンパス	420,300	2,049.00	861,194,700
理研計器	10,400	2,848.00	29,619,200
S C R E E Nホールディングス	30,700	11,740.00	360,418,000
キヤノン電子	7,000	2,446.00	17,122,000
タムロン	10,100	3,855.00	38,935,500
H O Y A	143,400	17,710.00	2,539,614,000
ノーリツ鋼機	7,000	4,430.00	31,010,000
A & Dホロンホールディングス	9,200	2,017.00	18,556,400
朝日インテック	89,500	2,633.50	235,698,250
キヤノン	366,200	5,127.00	1,877,507,400
リコー	193,400	1,541.50	298,126,100
シチズン時計	67,500	887.00	59,872,500
メニコン	27,400	1,343.00	36,798,200
パラマウントベッドホールディングス	15,800	2,625.00	41,475,000
トランザクション	4,800	2,100.00	10,080,000
ニホンフラッシュ	8,600	798.00	6,862,800
前田工織	15,000	1,758.00	26,370,000
アートネイチャー	9,100	753.00	6,852,300
フルヤ金属	6,300	2,910.00	18,333,000
バンダイナムコホールディングス	199,300	4,983.00	993,111,900
S H O E I	20,600	1,885.00	38,831,000
フランスベッドホールディングス	10,500	1,273.00	13,366,500
マーベラス	13,700	512.00	7,014,400
パイロットコーポレーション	11,200	4,198.00	47,017,600
萩原工業	4,900	1,490.00	7,301,000

エイベックス	13,800	1,251.00	17,263,800
フジシールインターナショナル	16,500	2,688.00	44,352,000
タカラトミー	30,800	3,828.00	117,902,400
広済堂ホールディングス	27,700	489.00	13,545,300
レック	9,400	1,227.00	11,533,800
三光合成	10,200	641.00	6,538,200
プロネクサス	7,600	1,257.00	9,553,200
TOPPANホールディングス	96,300	4,575.00	440,572,500
大日本印刷	152,200	2,203.00	335,296,600
共同印刷	2,100	4,335.00	9,103,500
NISSHA	12,600	1,382.00	17,413,200
ZACROS	5,800	4,125.00	23,925,000
TAKARA & COMPANY	4,000	3,070.00	12,280,000
前澤化成工業	5,200	1,783.00	9,271,600
未来工業	2,600	3,460.00	8,996,000
アシックス	271,100	3,530.00	956,983,000
JSP	6,000	2,042.00	12,252,000
ニチハ	9,200	3,000.00	27,600,000
ローランド	5,400	3,695.00	19,953,000
エフピコ	16,300	2,938.00	47,889,400
小松ウオール工業	4,900	1,476.00	7,232,400
ヤマハ	131,200	1,089.00	142,876,800
河合楽器製作所	2,200	3,065.00	6,743,000
クリナップ	10,500	650.00	6,825,000
ピジョン	46,800	1,670.50	78,179,400
天馬	6,100	2,677.00	16,329,700
キングジム	8,100	854.00	6,917,400
象印マホービン	21,900	1,518.00	33,244,200
リンテック	13,900	2,882.00	40,059,800
信越ポリマー	15,900	1,549.00	24,629,100
イトーキ	14,700	1,698.00	24,960,600
任天堂	463,500	11,455.00	5,309,392,500
三菱鉛筆	10,100	2,624.00	26,502,400
松風	7,400	2,156.00	15,954,400
タカラスタンダード	16,900	1,720.00	29,068,000
コクヨ	35,000	2,904.00	101,640,000
ナカバヤシ	3,300	530.00	1,749,000
ニフコ	27,500	3,677.00	101,117,500
グローブライド	7,200	1,878.00	13,521,600
オカムラ	22,100	1,941.00	42,896,100
バルカー	5,600	3,300.00	18,480,000
伊藤忠商事	522,200	6,141.00	3,206,830,200
丸紅	638,300	2,289.50	1,461,387,850
スクロール	11,600	1,032.00	11,971,200
ヨンドシーホールディングス	7,300	1,831.00	13,366,300
三陽商会	3,900	2,794.00	10,896,600
長瀬産業	34,700	2,740.50	95,095,350
蝶理	4,200	3,030.00	12,726,000
豊田通商	233,300	2,423.50	565,402,550
オンワードホールディングス	47,700	552.00	26,330,400

三共生興	11,500	634.00	7,291,000
兼松	32,500	2,511.50	81,623,750
美津濃	7,300	8,100.00	59,130,000
ルックホールディングス	3,100	2,231.00	6,916,100
三井物産	1,141,300	2,716.50	3,100,341,450
日本紙パルプ商事	37,100	591.00	21,926,100
東京エレクトロン	155,400	25,455.00	3,955,707,000
カメイ	8,300	1,934.00	16,052,200
スターゼン	5,400	2,801.00	15,125,400
セイコーグループ	11,400	4,760.00	54,264,000
山善	26,200	1,277.00	33,457,400
椿本興業	4,300	2,113.00	9,085,900
住友商事	465,500	3,244.00	1,510,082,000
B I P R O G Y	24,900	4,327.00	107,742,300
内田洋行	3,100	6,830.00	21,173,000
三菱商事	1,435,700	2,380.50	3,417,683,850
第一実業	7,300	2,345.00	17,118,500
キヤノンマーケティングジャパン	15,200	5,021.00	76,319,200
西華産業	3,700	4,370.00	16,169,000
佐藤商事	5,400	1,455.00	7,857,000
東京産業	9,400	723.00	6,796,200
ユアサ商事	6,700	4,490.00	30,083,000
神鋼商事	1,700	5,850.00	9,945,000
阪和興業	12,800	4,840.00	61,952,000
正栄食品工業	5,200	3,775.00	19,630,000
カナデン	5,800	1,460.00	8,468,000
R Y O D E N	6,300	2,344.00	14,767,200
ニプロ	61,200	1,311.50	80,263,800
岩谷産業	77,200	1,563.00	120,663,600
極東貿易	4,600	1,638.00	7,534,800
アステナホールディングス	15,600	435.00	6,786,000
三愛オブリ	18,200	1,768.00	32,177,600
稲畑産業	21,000	3,095.00	64,995,000
G S I クレオス	4,200	2,080.00	8,736,000
明和産業	11,100	714.00	7,925,400
ゴールドウイン	13,100	7,205.00	94,385,500
ユニ・チャーム	460,200	1,116.00	513,583,200
ワキタ	11,400	1,696.00	19,334,400
東邦ホールディングス	21,000	4,167.00	87,507,000
サンゲツ	19,500	2,892.00	56,394,000
ミツウロコグループホールディングス	9,900	1,842.00	18,235,800
シナネンホールディングス	2,100	5,780.00	12,138,000
伊藤忠エネクス	19,300	1,579.00	30,474,700
サンリオ	63,100	7,047.00	444,665,700
サンワテクノス	3,500	2,125.00	7,437,500
新光商事	10,400	971.00	10,098,400
トーヨー	3,300	2,614.00	8,626,200
三信電気	3,300	1,986.00	6,553,800
東陽テクニカ	7,200	1,416.00	10,195,200
モスフードサービス	11,400	3,535.00	40,299,000

加賀電子	15,800	2,667.00	42,138,600
都築電気	4,400	2,395.00	10,538,000
ソーダニッカ	7,600	1,105.00	8,398,000
立花エレテック	4,600	2,421.00	11,136,600
木曽路	11,800	2,136.00	25,204,800
S R S ホールディングス	12,800	1,233.00	15,782,400
リテールパートナーズ	11,500	1,215.00	13,972,500
上新電機	7,700	2,165.00	16,670,500
日本瓦斯	37,200	2,213.00	82,323,600
ロイヤルホールディングス	13,700	2,382.00	32,633,400
チヨダ	7,400	1,104.00	8,169,600
ライフコーポレーション	8,100	3,580.00	28,998,000
リンガーハット	10,000	2,248.00	22,480,000
MrMaxHD	10,200	682.00	6,956,400
AOKIホールディングス	16,700	1,258.00	21,008,600
オークワ	12,400	770.00	9,548,000
コメリ	10,500	2,827.00	29,683,500
青山商事	16,600	2,067.00	34,312,200
しまむら	18,200	8,896.00	161,907,200
高島屋	107,900	1,230.50	132,770,950
松屋	13,200	1,025.00	13,530,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	37,800	2,282.00	86,259,600
近鉄百貨店	4,400	2,118.00	9,319,200
丸井グループ	51,600	2,586.50	133,463,400
クレディセゾン	45,800	3,577.00	163,826,600
アクシアル リテイリング	21,200	947.00	20,076,400
イオン	287,300	3,646.00	1,047,495,800
イズミ	11,800	3,007.00	35,482,600
平和堂	12,700	2,381.00	30,238,700
フジ	14,300	2,037.00	29,129,100
ヤオコー	9,200	9,094.00	83,664,800
ゼビオホールディングス	10,500	1,216.00	12,768,000
ケーズホールディングス	52,200	1,403.00	73,236,600
PALTAC	12,100	3,921.00	47,444,100
三谷産業	20,700	330.00	6,831,000
あおぞら銀行	49,900	2,203.00	109,929,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,638,500	1,949.50	9,042,755,750
りそなホールディングス	893,100	1,232.50	1,100,745,750
三井住友トラストグループ	257,500	3,902.00	1,004,765,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,508,500	3,885.00	5,860,522,500
千葉銀行	223,900	1,380.00	308,982,000
群馬銀行	125,600	1,109.50	139,353,200
武蔵野銀行	11,000	3,200.00	35,200,000
千葉興業銀行	17,100	1,529.00	26,145,900
筑波銀行	31,700	250.00	7,925,000
七十七銀行	23,200	4,602.00	106,766,400
秋田銀行	4,800	2,247.00	10,785,600
山形銀行	8,000	1,397.00	11,176,000
岩手銀行	4,600	3,070.00	14,122,000
東邦銀行	62,400	313.00	19,531,200

ふくおかフィナンシャルグループ	63,000	4,057.00	255,591,000	
スルガ銀行	48,700	1,321.00	64,332,700	
八十二銀行	169,300	1,006.50	170,400,450	
山梨中央銀行	8,100	2,049.00	16,596,900	
大垣共立銀行	13,800	2,215.00	30,567,000	
福井銀行	6,500	1,838.00	11,947,000	
清水銀行	2,100	1,503.00	3,156,300	
滋賀銀行	10,900	4,825.00	52,592,500	
南都銀行	10,900	3,535.00	38,531,500	
百五銀行	68,000	715.00	48,620,000	
紀陽銀行	25,900	2,212.00	57,290,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	40,700	2,187.00	89,010,900	
山陰合同銀行	45,300	1,256.00	56,896,800	
百十四銀行	7,100	3,330.00	23,643,000	
四国銀行	10,600	1,182.00	12,529,200	
阿波銀行	10,100	2,767.00	27,946,700	
大分銀行	4,300	3,295.00	14,168,500	
宮崎銀行	4,700	3,250.00	15,275,000	
佐賀銀行	4,200	2,245.00	9,429,000	
琉球銀行	16,600	1,126.00	18,691,600	
セブン銀行	259,000	300.10	77,725,900	
みずほフィナンシャルグループ	976,000	4,252.00	4,149,952,000	
山口フィナンシャルグループ	70,900	1,664.00	117,977,600	
芙蓉総合リース	6,700	11,025.00	73,867,500	
みずほリース	54,300	1,020.00	55,386,000	
東京センチュリー	54,000	1,400.00	75,600,000	
SBIホールディングス	116,400	4,532.00	527,524,800	
日本証券金融	26,600	1,785.00	47,481,000	
アイフル	119,700	347.00	41,535,900	
名古屋銀行	4,500	7,440.00	33,480,000	
北洋銀行	98,600	511.00	50,384,600	
愛媛銀行	10,600	1,095.00	11,607,000	
京葉銀行	32,500	822.00	26,715,000	
栃木銀行	33,100	300.00	9,930,000	
北日本銀行	2,500	3,390.00	8,475,000	
東和銀行	13,300	653.00	8,684,900	
リコーリース	6,900	5,240.00	36,156,000	
イオンフィナンシャルサービス	41,500	1,230.00	51,045,000	
アコム	172,000	383.70	65,996,400	
ジャックス	8,700	3,775.00	32,842,500	
オリエントコーポレーション	23,600	801.00	18,903,600	
オリックス	433,600	3,047.00	1,321,179,200	
三菱HCキャピタル	362,500	1,004.50	364,131,250	
ジャフコグループ	21,500	2,318.50	49,847,750	
トモニホールディングス	69,000	496.00	34,224,000	
大和証券グループ本社	517,000	1,047.50	541,557,500	
野村ホールディングス	1,216,000	997.60	1,213,081,600	
岡三証券グループ	57,200	610.00	34,892,000	
丸三証券	24,100	975.00	23,497,500	
東洋証券	21,600	566.00	12,225,600	

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	85,900	496.00	42,606,400	
水戸証券	19,800	542.00	10,731,600	
いちよし証券	14,600	759.00	11,081,400	
松井証券	49,800	800.00	39,840,000	
S O M P Oホールディングス	353,500	4,401.00	1,555,753,500	
日本取引所グループ	430,200	1,557.00	669,821,400	
マネックスグループ	70,800	824.00	58,339,200	
極東証券	9,000	1,619.00	14,571,000	
岩井コスモホールディングス	8,200	2,495.00	20,459,000	
アイザワ証券グループ	10,400	1,754.00	18,241,600	
フィデアホールディングス	7,500	1,518.00	11,385,000	
池田泉州ホールディングス	100,300	422.00	42,326,600	
アニコム ホールディングス	24,600	528.00	12,988,800	
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	529,900	3,030.00	1,605,597,000	
スパークス・グループ	8,100	1,561.00	12,644,100	
第一生命ホールディングス	340,000	4,520.00	1,536,800,000	
東京海上ホールディングス	706,000	5,112.00	3,609,072,000	
イー・ギャランティ	11,800	1,741.00	20,543,800	
N E Cキャピタルソリューション	3,500	3,820.00	13,370,000	
T & Dホールディングス	194,200	3,205.00	622,411,000	
アドバンスクリエイト	5,400	549.00	2,964,600	
三井不動産	993,000	1,258.50	1,249,690,500	
三菱地所	412,100	2,173.00	895,493,300	
平和不動産	11,800	4,675.00	55,165,000	
東京建物	63,200	2,393.50	151,269,200	
京阪神ビルディング	12,200	1,465.00	17,873,000	
住友不動産	117,600	5,066.00	595,761,600	
テーオーシー	12,900	653.00	8,423,700	
レオパレス 2 1	63,300	594.00	37,600,200	
スターツコーポレーション	11,900	3,965.00	47,183,500	
フジ住宅	9,300	720.00	6,696,000	
空港施設	11,600	592.00	6,867,200	
明和地所	6,600	1,050.00	6,930,000	
ゴールドクレスト	4,900	3,090.00	15,141,000	
リログループ	42,000	1,901.50	79,863,000	
エスリード	3,400	4,370.00	14,858,000	
日神グループホールディングス	12,800	529.00	6,771,200	
日本エスコン	18,900	1,018.00	19,240,200	
M I R A R T Hホールディングス	42,400	502.00	21,284,800	
イオンモール	43,700	1,932.50	84,450,250	
カチタス	19,400	2,078.00	40,313,200	
東祥	9,700	675.00	6,547,500	
トーセイ	12,000	2,422.00	29,064,000	
サンフロンティア不動産	12,000	1,937.00	23,244,000	
F Jネクストホールディングス	7,600	1,151.00	8,747,600	
グランディハウス	11,800	588.00	6,938,400	
東武鉄道	77,300	2,548.00	196,960,400	
相鉄ホールディングス	24,300	2,280.00	55,404,000	

東急	205,900	1,675.00	344,882,500	
京浜急行電鉄	90,900	1,438.00	130,714,200	
小田急電鉄	121,400	1,450.00	176,030,000	
京王電鉄	38,800	3,827.00	148,487,600	
京成電鉄	127,800	1,472.00	188,121,600	
富士急行	9,000	2,300.00	20,700,000	
東日本旅客鉄道	404,900	2,866.00	1,160,443,400	
西日本旅客鉄道	181,000	2,957.50	535,307,500	
東海旅客鉄道	282,800	2,876.00	813,332,800	
東京地下鉄	122,800	1,778.50	218,399,800	
西武ホールディングス	79,900	3,059.00	244,414,100	
鴻池運輸	12,500	2,909.00	36,362,500	
西日本鉄道	21,200	2,156.00	45,707,200	
ハマキョウレックス	25,100	1,250.00	31,375,000	
サカイ引越センター	9,300	2,312.00	21,501,600	
近鉄グループホールディングス	78,500	3,300.00	259,050,000	
阪急阪神ホールディングス	97,200	3,649.00	354,682,800	
南海電気鉄道	32,700	2,446.50	80,000,550	
京阪ホールディングス	40,400	3,283.00	132,633,200	
神戸電鉄	2,300	2,424.00	5,575,200	
名古屋鉄道	81,000	1,800.00	145,800,000	
山陽電気鉄道	5,500	2,005.00	11,027,500	
ヤマトホールディングス	89,100	1,987.00	177,041,700	
山九	17,700	5,885.00	104,164,500	
日新	5,000	4,260.00	21,300,000	
丸全昭和運輸	4,500	5,840.00	26,280,000	
センコーグループホールディングス	48,200	1,416.00	68,251,200	
トナミホールディングス	1,600	5,890.00	9,424,000	
ニッコンホールディングス	41,700	2,299.50	95,889,150	
福山通運	7,800	3,590.00	28,002,000	
セイノーホールディングス	36,100	2,219.50	80,123,950	
神奈川中央交通	2,100	3,930.00	8,253,000	
A Z - C O M 丸和ホールディングス	22,700	1,202.00	27,285,400	
日本郵船	151,900	5,185.00	787,601,500	
商船三井	139,400	5,426.00	756,384,400	
川崎汽船	166,800	2,104.00	350,947,200	
N S ユナイテッド海運	4,600	4,055.00	18,653,000	
飯野海運	26,900	1,025.00	27,572,500	
九州旅客鉄道	56,100	3,583.00	201,006,300	
S G ホールディングス	123,100	1,466.00	180,464,600	
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	78,800	2,657.00	209,371,600	
I D & E ホールディングス	5,000	6,480.00	32,400,000	
日本航空	168,000	2,646.50	444,612,000	
A N A ホールディングス	199,400	2,922.00	582,646,800	
サンウェルズ	12,500	722.00	9,025,000	
T R E ホールディングス	17,300	1,507.00	26,071,100	
人・夢・技術グループ	4,300	1,522.00	6,544,600	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	3,300	1,922.00	6,342,600	

シルバーライフ	4,000	780.00	3,120,000	
Genky DrugStores	6,800	2,835.00	19,278,000	
コア商事ホールディングス	9,500	710.00	6,745,000	
KPPグループホールディングス	16,100	678.00	10,915,800	
ブックオフグループホールディングス	5,600	1,319.00	7,386,400	
ギフトホールディングス	3,800	3,750.00	14,250,000	
三菱倉庫	74,600	1,037.00	77,360,200	
三井倉庫ホールディングス	7,500	7,370.00	55,275,000	
住友倉庫	21,800	2,736.00	59,644,800	
澁澤倉庫	3,300	3,120.00	10,296,000	
ヤマタネ	3,100	3,820.00	11,842,000	
乾汽船	9,100	1,461.00	13,295,100	
日本トランスシティ	14,700	922.00	13,553,400	
中央倉庫	3,400	1,403.00	4,770,200	
安田倉庫	5,000	1,746.00	8,730,000	
大栄環境	16,500	2,663.00	43,939,500	
日本管財ホールディングス	7,900	2,551.00	20,152,900	
上組	33,800	3,291.00	111,235,800	
キューソー流通システム	4,900	1,848.00	9,055,200	
エーアイティー	4,600	1,654.00	7,608,400	
内外トランスライン	2,900	2,451.00	7,107,900	
日本コンセプト	3,800	1,809.00	6,874,200	
TBSホールディングス	36,400	4,245.00	154,518,000	
日本テレビホールディングス	65,200	2,823.50	184,092,200	
朝日放送グループホールディングス	100	686.00	68,600	
テレビ朝日ホールディングス	17,900	2,541.00	45,483,900	
スカパーJ S A Tホールディングス	57,200	1,094.00	62,576,800	
テレビ東京ホールディングス	4,500	3,505.00	15,772,500	
ビジョン	11,100	1,148.00	12,742,800	
U - N E X T H O L D I N G S	24,800	1,799.00	44,615,200	
日本通信	59,200	157.00	9,294,400	
日本電信電話	21,902,800	147.30	3,226,282,440	
K D D I	541,600	4,817.00	2,608,887,200	
ソフトバンク	11,787,000	210.00	2,475,270,000	
光通信	8,500	36,840.00	313,140,000	
GMOインターネットグループ	24,000	2,868.00	68,832,000	
K A D O K A W A	38,900	3,657.00	142,257,300	
学研ホールディングス	13,500	972.00	13,122,000	
ゼンリン	12,600	990.00	12,474,000	
東京電力ホールディングス	617,700	396.30	244,794,510	
中部電力	270,500	1,566.50	423,738,250	
関西電力	358,100	1,710.00	612,351,000	
中国電力	127,600	832.70	106,252,520	
北陸電力	75,100	774.50	58,164,950	
東北電力	193,300	1,045.50	202,095,150	
四国電力	68,400	1,120.00	76,608,000	
九州電力	169,200	1,267.00	214,376,400	
北海道電力	76,800	730.70	56,117,760	
沖縄電力	18,800	905.00	17,014,000	
電源開発	55,300	2,477.00	136,978,100	

イーレックス	14,300	764.00	10,925,200
レノバ	20,000	727.00	14,540,000
東京瓦斯	138,900	4,713.00	654,635,700
大阪瓦斯	144,200	3,416.00	492,587,200
東邦瓦斯	28,900	4,097.00	118,403,300
北海道瓦斯	22,000	503.00	11,066,000
広島ガス	19,800	347.00	6,870,600
西部ガスホールディングス	7,700	1,635.00	12,589,500
静岡ガス	16,700	1,006.00	16,800,200
メタウォーター	10,100	1,946.00	19,654,600
M & A 総研ホールディングス	8,100	1,430.00	11,583,000
アイネット	4,500	1,939.00	8,725,500
松竹	4,200	11,560.00	48,552,000
東宝	46,100	7,170.00	330,537,000
エイチ・アイ・エス	24,100	1,518.00	36,583,800
東映	12,200	5,240.00	63,928,000
NTTデータグループ	192,500	2,978.00	573,265,000
共立メンテナンス	23,700	2,906.50	68,884,050
イチネンホールディングス	7,300	1,673.00	12,212,900
建設技術研究所	7,800	2,378.00	18,548,400
スペース	6,400	1,063.00	6,803,200
アインホールディングス	7,800	4,475.00	34,905,000
燦ホールディングス	6,300	1,208.00	7,610,400
ピー・シー・エー	4,800	1,913.00	9,182,400
スバル興業	2,900	3,330.00	9,657,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,100	2,565.00	7,951,500
ナガワ	2,000	6,630.00	13,260,000
東京都競馬	5,500	4,535.00	24,942,500
カナモト	11,700	3,035.00	35,509,500
D T S	12,900	4,190.00	54,051,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	37,000	7,100.00	262,700,000
シーイーシー	9,300	1,822.00	16,944,600
カブコン	146,300	4,081.00	597,050,300
ニシオホールディングス	6,200	4,230.00	26,226,000
アイ・エス・ビー	5,100	1,282.00	6,538,200
日本空港ビルデング	25,600	4,597.00	117,683,200
トランス・コスモス	9,600	3,070.00	29,472,000
乃村工藝社	32,900	883.00	29,050,700
S C S K	60,100	3,763.00	226,156,300
藤田観光	3,400	9,290.00	31,586,000
トーカイ	6,700	1,990.00	13,333,000
セコム	153,700	5,083.00	781,257,100
N S W	3,300	2,778.00	9,167,400
セントラル警備保障	4,100	2,908.00	11,922,800
アイネス	5,700	1,732.00	9,872,400
丹青社	16,000	873.00	13,968,000
メイテックグループホールディングス	27,800	2,984.00	82,955,200
T K C	13,100	3,810.00	49,911,000
富士ソフト	20,400	9,803.00	199,981,200

応用地質	6,800	2,920.00	19,856,000
船井総研ホールディングス	15,100	2,315.00	34,956,500
NSD	28,300	3,448.00	97,578,400
コナミグループ	27,600	18,780.00	518,328,000
学究社	3,400	2,011.00	6,837,400
イオンディライト	8,100	4,490.00	36,369,000
ナック	10,400	688.00	7,155,200
福井コンピュータホールディングス	5,100	3,045.00	15,529,500
ダイセキ	18,200	3,640.00	66,248,000
ステップ	3,200	2,168.00	6,937,600
泉州電業	5,100	4,880.00	24,888,000
GENKI GLOBAL DINI NG CONCEPTS	4,400	3,190.00	14,036,000
トラスコ中山	16,300	1,951.00	31,801,300
ヤマダホールディングス	238,900	430.60	102,870,340
オートバックスセブン	27,000	1,464.00	39,528,000
モリト	6,200	1,493.00	9,256,600
アーケランズ	23,100	1,612.00	37,237,200
ニトリホールディングス	28,300	15,930.00	450,819,000
ケーユーホールディングス	6,200	1,102.00	6,832,400
吉野家ホールディングス	30,400	2,932.00	89,132,800
加藤産業	9,600	4,420.00	42,432,000
イノテック	5,300	1,374.00	7,282,200
イエローハット	13,700	2,878.00	39,428,600
松屋フーズホールディングス	3,700	5,750.00	21,275,000
JBC Cホールディングス	4,900	4,735.00	23,201,500
J Kホールディングス	6,800	1,008.00	6,854,400
サガミホールディングス	12,500	1,755.00	21,937,500
日伝	4,500	2,866.00	12,897,000
ミロク情報サービス	6,700	1,810.00	12,127,000
杉本商事	6,900	1,215.00	8,383,500
因幡電機産業	21,700	3,876.00	84,109,200
王将フードサービス	15,300	3,035.00	46,435,500
ミニストップ	6,500	1,712.00	11,128,000
アークス	13,100	2,694.00	35,291,400
バローホールディングス	14,800	2,229.00	32,989,200
東テク	7,800	2,453.00	19,133,400
ミスミグループ本社	117,400	2,882.00	338,346,800
ベルク	3,900	6,370.00	24,843,000
大 庄	6,300	1,083.00	6,822,900
ファーストリテイリング	43,700	46,980.00	2,053,026,000
ソフトバンクグループ	363,200	9,390.00	3,410,448,000
スズケン	25,600	4,974.00	127,334,400
サンドラッグ	26,200	4,295.00	112,529,000
ジェコス	6,800	1,023.00	6,956,400
ベルーナ	18,700	885.00	16,549,500
合計	138,128,000		286,727,574,920

(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。

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2025年2月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	40,687,143
コール・ローン	578,887,291
国債証券	86,067,799,690
未収利息	256,733,429
前払費用	40,307,952
流動資産合計	86,984,415,505
資産合計	
86,984,415,505	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	125,370,220
流動負債合計	125,370,220
負債合計	
125,370,220	
純資産の部	
元本等	
元本	69,756,276,829
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,102,768,456
元本等合計	86,859,045,285
純資産合計	
86,859,045,285	
負債純資産合計	
86,984,415,505	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月22日 至 2025年2月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	2025年2月21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	57,048,145,189円
同期中追加設定元本額	29,371,879,045円
同期中一部解約元本額	16,663,747,405円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）	1,671,595,754円
DCニッセイ国内債券インデックス	7,973,574,262円
ニッセイ日本バランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	2,453,867円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	12,235,536,266円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	20,456,772,478円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	6,997,372,760円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）S A（適格機関投資家限定）	13,681,298円
ニッセイインデックスバランス（標準型）S A（適格機関投資家限定）	13,243,333円
ニッセイインデックスバランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	12,134,973円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	5,604,581,017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）	14,773,586,415円
ニッセイインデックスバランス（外国株式重視型）S A（適格機関投資家限定）	1,744,406円
計	69,756,276,829円
2. 受益権の総数	69,756,276,829口

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年2月22日 至 2025年2月21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	2025年2月21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	2025年2月21日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	27,335,290
合計	27,335,290

(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(2025年2月21日から2025年2月21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)

	2025年2月21日現在
1口当たり純資産額	1.2452円
(1万口当たり純資産額)	(12,452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

2025年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	第463回 利付国債(2年)	5,336,000,000	5,309,906,960	
	第464回 利付国債(2年)	1,739,000,000	1,729,609,400	
	第154回 利付国債(5年)	2,744,000,000	2,692,275,600	
	第158回 利付国債(5年)	3,024,000,000	2,952,300,960	

第167回 利付国債(5年)	1,258,000,000	1,228,525,060	
第168回 利付国債(5年)	6,641,000,000	6,538,529,370	
第4回 利付国債(40年)	2,109,000,000	2,083,101,480	
第7回 利付国債(40年)	2,670,000,000	2,320,203,300	
第8回 利付国債(40年)	2,242,000,000	1,791,044,120	
第11回 利付国債(40年)	1,304,000,000	835,433,680	
第15回 利付国債(40年)	1,351,000,000	869,935,920	
第16回 利付国債(40年)	13,000,000	9,170,330	
第344回 利付国債(10年)	3,191,000,000	3,158,611,350	
第346回 利付国債(10年)	1,987,000,000	1,958,764,730	
第348回 利付国債(10年)	1,744,000,000	1,711,125,600	
第354回 利付国債(10年)	4,251,000,000	4,100,812,170	
第358回 利付国債(10年)	1,840,000,000	1,753,428,000	
第362回 利付国債(10年)	6,892,000,000	6,492,815,360	
第366回 利付国債(10年)	473,000,000	442,775,300	
第370回 利付国債(10年)	6,830,000,000	6,440,621,700	
第26回 利付国債(30年)	337,000,000	366,669,480	
第34回 利付国債(30年)	2,617,000,000	2,735,497,760	
第38回 利付国債(30年)	5,000,000	4,867,300	
第46回 利付国債(30年)	3,515,000,000	3,194,748,350	
第54回 利付国債(30年)	1,435,000,000	1,099,827,050	
第90回 利付国債(20年)	390,000,000	398,786,700	
第97回 利付国債(20年)	1,136,000,000	1,174,964,800	
第125回 利付国債(20年)	1,790,000,000	1,906,242,600	
第134回 利付国債(20年)	1,169,000,000	1,221,020,500	
第143回 利付国債(20年)	2,417,000,000	2,482,597,380	
第148回 利付国債(20年)	2,532,000,000	2,566,789,680	
第152回 利付国債(20年)	3,876,000,000	3,790,883,040	
第160回 利付国債(20年)	5,422,000,000	4,891,457,300	
第168回 利付国債(20年)	2,016,000,000	1,681,323,840	
第176回 利付国債(20年)	938,000,000	760,474,120	
第184回 利付国債(20年)	3,886,000,000	3,372,659,400	
国債証券 合計	91,120,000,000	86,067,799,690	
合計		86,067,799,690	

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)

2025年2月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,070,926,043
金銭信託	1,012,165,049
コール・ローン	14,400,850,866
株式	1,140,961,292,719
投資証券	20,471,962,101
派生商品評価勘定	186,366,252
未収入金	43,005,435
未収配当金	1,001,123,066
差入委託証拠金	14,102,770,305
流動資産合計	1,197,250,461,836
資産合計	1,197,250,461,836
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	235,255,550
未払解約金	1,288,799,454
流動負債合計	1,524,055,004
負債合計	1,524,055,004
純資産の部	
元本等	
元本	238,543,985,695
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	957,182,421,137
元本等合計	1,195,726,406,832
純資産合計	1,195,726,406,832
負債純資産合計	1,197,250,461,836

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月22日 至 2025年2月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年2月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	223,769,394,697円
同期中追加設定元本額	46,415,047,403円
同期中一部解約元本額	31,640,456,405円
元本の内訳	
ファンド名	
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	672,873,183円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,375,023,010円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,463,356,522円
ニッセイ外国株式インデックスSA（適格機関投資家限定）	2,388,934,579円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	615,599円
ニッセイインデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	1,872,793円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	4,204,357円
ニッセイ外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	490,890,035円

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	160,686,228,310円
DCニッセイ外国株式インデックス	45,713,602,215円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	3,655,709,187円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	456,170,310円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	167,699,830円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	522,171,640円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	553,256,031円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	5,536,432円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)	83,328,794円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	9,916,362円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	10,570,947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)	3,361,329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 (8資産均等型)	20,289,425円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	380,958,158円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	257,096,978円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	439,383,493円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	110,793,809円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適 格機関投資家限定)	124,639,135円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バス ケット)	276,507,112円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適 格機関投資家限定)	125,441,041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)	123,021,380円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05(適 格機関投資家限定)	122,558,292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)	109,475,962円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)	31,568,143円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	13,240,928,875円
FWニッセイ先進国株インデックス	79,328,388円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	205,298,934円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	542,360,185円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	8,327,254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)	73,088,880円
ニッセイインデックスバランス(外国株式重視型)SA(適格機関投資 家限定)	1,150,159円
ニッセイ全世界株式インデックスコレクトSA(適格機関投資家限定)	6,448,627円
計	238,543,985,695円
2. 受益権の総数	238,543,985,695口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年2月22日 至 2025年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

項目	2025年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2025年2月21日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	48,704,783,503	
投資証券	468,014,764	
合計	48,236,768,739	

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年11月21日から2025年2月21日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2025年2月21日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	13,096,257,870	-	12,933,470,095	162,787,775	
アメリカ・ドル	8,531,028,610	-	8,394,604,213	136,424,397	
イギリス・ポンド	2,195,612,499	-	2,188,239,389	7,373,110	
ユーロ	2,369,616,761	-	2,350,626,493	18,990,268	
合計	13,096,257,870	-	12,933,470,095	162,787,775	

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## 株式関連

種類	2025年2月21日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	32,915,844,210	-	33,029,742,687	113,898,477	
合計	32,915,844,210	-	33,029,742,687	113,898,477	

## （注）株価指数先物取引

## 1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2025年2月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.0126円 (50,126円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2025年2月21日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	61,288	149.080	9,136,815.04	
	ABBOTT LABORATORIES	194,126	133.170	25,851,759.42	
	ABBVIE INC	197,069	200.880	39,587,220.72	
	ACCENTURE PLC	69,714	384.840	26,828,735.76	
	ADOBE INC	49,111	454.690	22,330,280.59	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	180,569	114.170	20,615,562.73	
	AECOM	14,948	99.700	1,490,315.60	
	AERCAP HOLDINGS NV	21,626	105.780	2,287,598.28	
	AES CORP	79,324	10.670	846,387.08	
	AFLAC INC	59,333	104.280	6,187,245.24	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	32,056	136.790	4,384,940.24	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,805	314.280	7,795,715.40	
	AIRBNB INC-CLASS A	49,089	155.310	7,624,012.59	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	16,898	98.030	1,656,510.94	
	ALBEMARLE CORP	13,125	82.510	1,082,943.75	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	42,025	20.560	864,034.00	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	7,916	198.060	1,567,842.96	
	ALLEGION PLC	9,719	127.110	1,235,382.09	
	ALLIANT ENERGY CORP	28,611	61.620	1,763,009.82	
	ALLSTATE CORP	29,459	189.180	5,573,053.62	
	ALLY FINANCIAL INC	30,595	38.920	1,190,757.40	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14,325	251.000	3,595,575.00	
	ALPHABET INC-CL A	653,572	184.560	120,623,248.32	
	ALPHABET INC-CL C	560,841	186.640	104,675,364.24	
	ALTRIA GROUP INC	190,400	54.330	10,344,432.00	
	AMAZON.COM INC	1,053,825	222.880	234,876,516.00	
	AMCOR PLC	161,516	10.390	1,678,151.24	
	AMEREN CORPORATION	29,770	97.210	2,893,941.70	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	59,369	104.350	6,195,155.15	
	AMERICAN EXPRESS CO	63,445	303.860	19,278,397.70	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,964	120.790	961,971.56	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	71,816	76.250	5,475,970.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,743	128.670	2,797,671.81	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,946	541.010	5,921,895.46	
AMETEK INC	25,839	188.780	4,877,886.42	
AMGEN INC	59,952	297.930	17,861,499.36	
AMPHENOL CORP-CL A	134,338	69.370	9,319,027.06	
ANALOG DEVICES INC	55,395	243.820	13,506,408.90	
ANSYS INC	9,749	340.460	3,319,144.54	
AON PLC	21,814	393.070	8,574,428.98	
APA CORP	41,132	23.620	971,537.84	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	44,475	156.790	6,973,235.25	
APPLE INC	1,696,218	245.830	416,981,270.94	
APPLIED MATERIALS INC	91,962	176.010	16,186,231.62	
APPROVIN CORP-CLASS A	23,198	450.010	10,439,331.98	
APTIVE PLC	29,651	67.620	2,005,000.62	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	41,936	89.050	3,734,400.80	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	53,370	46.550	2,484,373.50	
ARES MANAGEMENT CORP - A	21,016	179.690	3,776,365.04	
ARISTA NETWORKS INC	119,168	103.400	12,321,971.20	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,450	325.130	7,949,428.50	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,177	264.000	838,728.00	
ASSURANT INC	5,772	200.980	1,160,056.56	
AT&T INC	801,308	26.150	20,954,204.20	
ATLASSIAN CORP-CL A	17,853	298.490	5,328,941.97	
ATMOS ENERGY CORP	17,307	147.620	2,554,859.34	
AUTODESK INC	23,978	291.020	6,978,077.56	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	45,500	311.970	14,194,635.00	
AUTOZONE INC	1,905	3,406.660	6,489,687.30	
AVANTOR INC	75,856	17.490	1,326,721.44	
AVERY DENNISON CORP	8,984	184.270	1,655,481.68	
AXON ENTERPRISE INC	8,010	541.810	4,339,898.10	
BAKER HUGHES COMPANY	110,822	46.910	5,198,660.02	
BALL CORP	33,863	50.450	1,708,388.35	
BANK OF AMERICA CORP	779,088	45.300	35,292,686.40	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	82,282	87.160	7,171,699.12	
BAXTER INTERNATIONAL INC	56,970	33.440	1,905,076.80	
BECTON DICKINSON & CO	32,252	227.930	7,351,198.36	
BENTLEY SYSTEMS INC- CLASS B	17,847	46.530	830,420.91	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	147,834	481.800	71,226,421.20	

BEST BUY CO INC	22,770	90.940	2,070,703.80	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,163	285.630	617,817.69	
BIO-TECHNE CORP	17,708	65.490	1,159,696.92	
BIOGEN INC	16,251	137.080	2,227,687.08	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21,261	68.730	1,461,268.53	
BLACKROCK INC	16,523	989.380	16,347,525.74	
BLACKSTONE INC	80,331	163.900	13,166,250.90	
BLOCK INC	61,958	83.040	5,144,992.32	
BOEING CO	81,305	180.880	14,706,448.40	
BOOKING HOLDINGS INC	3,740	5,018.230	18,768,180.20	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	14,411	113.620	1,637,377.82	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	164,249	105.360	17,305,274.64	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	226,216	55.790	12,620,590.64	
BROADCOM INC	495,006	226.740	112,237,660.44	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	13,041	236.300	3,081,588.30	
BROWN & BROWN INC	27,043	111.650	3,019,350.95	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	20,361	30.980	630,783.78	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	12,986	144.390	1,875,048.54	
BUNGE GLOBAL SA	15,809	71.260	1,126,549.34	
BURLINGTON STORES INC	7,104	241.990	1,719,096.96	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13,088	100.420	1,314,296.96	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	30,549	270.230	8,255,256.27	
CAMPBELL SOUP CO	21,614	39.340	850,294.76	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,600	205.370	8,748,762.00	
CARDINAL HEALTH INC	26,989	127.380	3,437,858.82	
CARLISLE COS INC	5,156	343.120	1,769,126.72	
CARLYLE GROUP INC/THE	25,826	52.010	1,343,210.26	
CARMAX INC	17,280	85.600	1,479,168.00	
CARNIVAL CORP	115,829	24.560	2,844,760.24	
CARRIER GLOBAL CORP	90,634	67.110	6,082,447.74	
CARVANA CO	12,712	247.720	3,149,016.64	
CATERPILLAR INC	54,093	349.150	18,886,570.95	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,678	208.910	2,439,650.98	
CBRE GROUP INC	34,178	141.670	4,841,997.26	
CDW CORP/DE	14,905	192.800	2,873,684.00	
CELANESE CORP-SERIES A	12,183	52.610	640,947.63	
CENCORA, INC.	19,782	243.460	4,816,125.72	
CENTENE CORP	58,686	58.480	3,431,957.28	
CENTERPOINT ENERGY INC	72,696	33.730	2,452,036.08	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,126	80.260	1,615,312.76	

CHARLES RIVER LABORATORIES	5,760	162.250	934,560.00	
CHARLES SCHWAB CORP	178,575	81.830	14,612,792.25	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	10,351	363.010	3,757,516.51	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,806	219.050	2,148,004.30	
CHENIERE ENERGY INC	25,226	226.920	5,724,283.92	
CHEVRON CORP	193,841	158.790	30,780,012.39	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	152,789	53.050	8,105,456.45	
CHUBB LTD	42,827	267.490	11,455,794.23	
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,324	104.430	2,853,445.32	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,428	135.770	2,366,199.56	
CINTAS CORP	40,482	205.930	8,336,458.26	
CISCO SYSTEMS INC	445,271	64.670	28,795,675.57	
CITIGROUP INC	212,830	81.340	17,311,592.20	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	50,012	46.180	2,309,554.16	
CLOROX CO	13,804	153.070	2,112,978.28	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	33,950	156.380	5,309,101.00	
CME GROUP INC	40,190	248.320	9,979,980.80	
CMS ENERGY CORP	33,291	70.700	2,353,673.70	
CNH INDUSTRIAL NV	98,025	13.310	1,304,712.75	
COCA-COLA CO	456,824	70.040	31,995,952.96	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	23,063	86.550	1,996,102.65	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	55,289	87.540	4,839,999.06	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	21,512	256.590	5,519,764.08	
COLGATE-PALMOLIVE CO	86,621	87.870	7,611,387.27	
COMCAST CORP	431,004	36.410	15,692,855.64	
CONAGRA BRANDS INC	53,319	24.840	1,324,443.96	
CONOCOPHILLIPS	145,419	102.000	14,832,738.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	38,610	95.760	3,697,293.60	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18,232	172.330	3,141,920.56	
CONSTELLATION ENERGY	34,881	309.420	10,792,879.02	
COOPER COS INC/THE	22,212	88.690	1,969,982.28	
COPART INC	96,715	58.220	5,630,747.30	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	29,712	33.490	995,054.88	
CORNING INC	90,701	51.870	4,704,660.87	
CORTEVA INC	77,231	63.830	4,929,654.73	
COSTAR GROUP INC	45,742	78.330	3,582,970.86	
COSTCO WHOLESALE CORP	49,428	1,034.830	51,149,577.24	
COTERRA ENERGY INC	82,494	28.780	2,374,177.32	
CRH PLC	76,155	102.580	7,811,979.90	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	25,962	436.140	11,323,066.68	
CROWN HOLDINGS INC	13,451	88.670	1,192,700.17	
CSX CORP	216,268	32.460	7,020,059.28	
CUMMINS INC	15,290	384.390	5,877,323.10	
CVS HEALTH CORP	140,370	65.090	9,136,683.30	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,811	400.970	1,929,066.67	
DANAHER CORP	72,518	207.950	15,080,118.10	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,121	195.100	2,559,907.10	
DATADOG INC - CLASS A	31,310	126.240	3,952,574.40	
DAVITA INC	5,140	145.920	750,028.80	
DAYFORCE, INC.	17,635	67.280	1,186,482.80	
DECKERS OUTDOOR CORP	17,008	150.020	2,551,540.16	
DEERE & CO	28,998	495.790	14,376,918.42	
DELL TECHNOLOGIES -C	35,384	119.890	4,242,187.76	
DELTA AIR LINES INC	17,968	63.750	1,145,460.00	
DEVON ENERGY CORPORATION	69,738	38.550	2,688,399.90	
DEXCOM INC	44,725	89.340	3,995,731.50	
DIAMONDBACK ENERGY INC	21,208	162.090	3,437,604.72	
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,453	231.500	1,493,869.50	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	28,014	199.900	5,599,998.60	
DOCUSIGN INC	22,639	86.200	1,951,481.80	
DOLLAR GENERAL CORP	24,561	76.130	1,869,828.93	
DOLLAR TREE INC	22,810	76.290	1,740,174.90	
DOMINION ENERGY INC	93,630	56.320	5,273,241.60	
DOMINO'S PIZZA INC	3,854	471.760	1,818,163.04	
DOORDASH INC - A	34,329	202.250	6,943,040.25	
DOVER CORP	15,328	206.430	3,164,159.04	
DOW INC	78,312	39.590	3,100,372.08	
DR HORTON INC	32,732	128.680	4,211,953.76	
DRAFTKINGS INC	48,758	49.440	2,410,595.52	
DTE ENERGY COMPANY	23,085	131.180	3,028,290.30	
DUKE ENERGY CORP	86,144	113.160	9,748,055.04	
DUPONT DE NEMOURS INC	46,558	82.850	3,857,330.30	
DYNATRACE INC	33,232	61.240	2,035,127.68	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	13,021	100.560	1,309,391.76	
EATON CORP PLC	44,410	308.820	13,714,696.20	
EBAY INC	54,535	69.460	3,788,001.10	
ECOLAB INC	28,567	267.340	7,637,101.78	
EDISON INTERNATIONAL	43,054	51.900	2,234,502.60	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	67,208	74.710	5,021,109.68	
ELECTRONIC ARTS INC	27,999	129.990	3,639,590.01	
ELEVANCE HEALTH, INC	25,874	390.500	10,103,797.00	
ELI LILLY & CO	90,128	873.120	78,692,559.36	
EMCOR GROUP INC	5,203	424.640	2,209,401.92	

EMERSON ELECTRIC CO	63,898	124.750	7,971,275.50	
ENPHASE ENERGY INC	15,123	66.170	1,000,688.91	
ENTEGRIS INC	16,850	107.260	1,807,331.00	
ENTERGY CORP	47,686	85.860	4,094,319.96	
EOG RESOURCES INC	63,404	135.670	8,602,020.68	
EPAM SYSTEMS INC	6,355	225.070	1,430,319.85	
EQT CORP	63,022	52.560	3,312,436.32	
EQUIFAX INC	13,802	241.220	3,329,318.44	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,297	53.960	1,904,626.12	
ERIE INDEMNITY COMPANY- CL A	2,835	387.400	1,098,279.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	29,064	35.960	1,045,141.44	
ESTEE LAUDER COS INC	26,074	71.340	1,860,119.16	
EVEREST GROUP LTD	4,823	338.210	1,631,186.83	
EVERGY INC	25,661	67.250	1,725,702.25	
EVERSOURCE ENERGY	39,908	63.380	2,529,369.04	
EXACT SCIENCES CORP	20,629	49.510	1,021,341.79	
EXELON CORP	111,607	43.170	4,818,074.19	
EXPAND ENERGY CORPORATION	22,771	106.150	2,417,141.65	
EXPEDIA GROUP INC	13,895	205.140	2,850,420.30	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	15,736	117.260	1,845,203.36	
EXXON MOBIL CORP	495,639	112.000	55,511,568.00	
F5 INC	6,497	304.600	1,978,986.20	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,245	466.130	1,978,721.85	
FAIR ISAAC CORP	2,734	1,725.540	4,717,626.36	
FASTENAL CO	63,905	75.140	4,801,821.70	
FEDEX CORP	25,893	268.460	6,951,234.78	
FERGUSON ENTERPRISES INC	22,397	179.500	4,020,261.50	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	28,974	57.570	1,668,033.18	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	60,862	69.850	4,251,210.70	
FIFTH THIRD BANCORP	75,462	43.610	3,290,897.82	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,126	2,117.110	2,383,865.86	
FIRST SOLAR INC	11,349	164.090	1,862,257.41	
FIRSTENERGY CORP	61,055	41.380	2,526,455.90	
FISERV INC	64,216	234.430	15,054,156.88	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,356	368.990	2,714,290.44	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	19,845	287.740	5,710,200.30	
FORD MOTOR CO	435,620	9.390	4,090,471.80	
FORTINET INC	72,533	114.210	8,283,993.93	
FORTIVE CORP	39,070	81.840	3,197,488.80	

FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	13,841	66.640	922,364.24	
FOX CORP - CLASS A	24,655	57.380	1,414,703.90	
FOX CORP- CLASS B	15,926	53.370	849,970.62	
FRANKLIN RESOURCES INC	32,286	20.730	669,288.78	
FREEMPORT-MCMORAN INC	160,216	38.960	6,242,015.36	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,248	120.590	753,446.32	
GARMIN LTD	17,160	229.010	3,929,811.60	
GARTNER INC	8,593	503.160	4,323,653.88	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	50,930	92.090	4,690,143.70	
GE VERNOVA INC	30,658	359.680	11,027,069.44	
GEN DIGITAL INC	61,791	27.320	1,688,130.12	
GENERAL DYNAMICS CORP	26,060	246.200	6,415,972.00	
GENERAL ELECTRIC CO	120,963	208.740	25,249,816.62	
GENERAL MILLS INC	61,963	59.190	3,667,589.97	
GENERAL MOTORS CO	125,339	47.890	6,002,484.71	
GENUINE PARTS CO	15,580	123.270	1,920,546.60	
GILEAD SCIENCES INC	138,907	110.030	15,283,937.21	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,395	105.580	2,997,944.10	
GLOBAL -E ONLINE LTD	11,180	46.630	521,323.40	
GODADDY INC - CLASS A	15,716	176.570	2,774,974.12	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	35,229	642.260	22,626,177.54	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	235,727	4.785	1,127,953.69	
GRACO INC	18,872	87.250	1,646,582.00	
HALLIBURTON CO	98,483	26.990	2,658,056.17	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	32,659	112.370	3,669,891.83	
HCA HEALTHCARE INC	21,589	321.500	6,940,863.50	
HEICO CORP	4,887	225.540	1,102,213.98	
HEICO CORP-CLASS A	8,424	182.380	1,536,369.12	
HENRY SCHEIN INC	14,139	78.050	1,103,548.95	
HERSHEY CO/THE	16,494	166.100	2,739,653.40	
HESS CORP	30,922	150.960	4,667,985.12	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	144,863	21.740	3,149,321.62	
HF SINCLAIR CORP	18,092	37.430	677,183.56	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	27,474	267.810	7,357,811.94	
HOLOGIC INC	25,896	64.320	1,665,630.72	
HOME DEPOT INC	110,817	394.640	43,732,820.88	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	72,486	211.350	15,319,916.10	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	123,300	4.400	542,520.00	
HORMEL FOODS CORP	33,745	28.850	973,543.25	
HOWMET AEROSPACE INC	43,240	138.440	5,986,145.60	
HP INC	107,496	34.720	3,732,261.12	
HUBBELL INC	5,987	389.420	2,331,457.54	
HUBSPOT INC	5,442	748.000	4,070,616.00	

HUMANA INC	13,437	271.300	3,645,458.10	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	162,042	16.420	2,660,729.64	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,386	177.890	780,225.54	
HYATT HOTELS CORP - CL A	5,002	145.760	729,091.52	
IDEX CORP	8,458	196.070	1,658,360.06	
IDEXX LABORATORIES INC	9,183	452.860	4,158,613.38	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	33,130	265.540	8,797,340.20	
ILLUMINA INC	17,733	97.200	1,723,647.60	
INCYTE CORP	18,266	71.380	1,303,827.08	
INGERSOLL-RAND INC	45,005	86.770	3,905,083.85	
INSULET CORP	7,823	288.290	2,255,292.67	
INTEL CORP	477,092	26.090	12,447,330.28	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	64,049	166.790	10,682,732.71	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	102,765	264.740	27,206,006.10	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	28,537	80.140	2,286,955.18	
INTERNATIONAL PAPER CO	36,821	56.060	2,064,185.26	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	41,963	27.560	1,156,500.28	
INTUIT INC	31,271	579.080	18,108,410.68	
INTUITIVE SURGICAL INC	39,642	606.570	24,045,647.94	
IQVIA HOLDINGS INC	20,333	194.010	3,944,805.33	
JABIL CIRCUIT INC	12,644	166.120	2,100,421.28	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,140	168.700	1,373,218.00	
JACOBS SOLUTIONS INC	13,853	130.130	1,802,690.89	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,900	41.490	742,671.00	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,099	168.540	1,533,545.46	
JM SMUCKER CO	11,882	107.300	1,274,938.60	
JOHNSON & JOHNSON	268,588	159.680	42,888,131.84	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	74,520	88.830	6,619,611.60	
JPMORGAN CHASE & CO	317,407	266.800	84,684,187.60	
JUNIPER NETWORKS INC	36,788	36.070	1,326,943.16	
KELLANOVA	30,764	82.450	2,536,491.80	
KENVUE INC	213,726	22.390	4,785,325.14	
KEURIG DR PEPPER INC	128,626	33.140	4,262,665.64	
KEYCORP	105,266	17.580	1,850,576.28	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	19,357	184.900	3,579,109.30	
KIMBERLY-CLARK CORP	37,596	138.970	5,224,716.12	
KINDER MORGAN INC	223,125	26.590	5,932,893.75	
KKR & CO INC -A	69,289	134.550	9,322,834.95	
KLA CORPORATION	14,944	777.630	11,620,902.72	

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	18,066	53.420	965,085.72	
KRAFT HEINZ CO/THE	101,236	30.160	3,053,277.76	
KROGER CO	76,666	64.390	4,936,523.74	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,169	197.230	4,175,161.87	
LABCORP HOLDINGS INC	9,367	249.170	2,333,975.39	
LAM RESEARCH CORP	144,584	89.020	12,870,867.68	
LAMB WESTON HOLDING INC	15,912	56.810	903,960.72	
LAS VEGAS SANDS CORP	41,079	44.970	1,847,322.63	
LEIDOS HOLDINGS INC	14,269	130.050	1,855,683.45	
LENNAR CORP-CL A	26,633	122.690	3,267,602.77	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,575	641.380	2,292,933.50	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	23,546	97.850	2,303,976.10	
LINDE PLC	53,268	461.900	24,604,489.20	
LIVE NATION INC	17,985	152.320	2,739,475.20	
LKQ CORP	29,441	41.750	1,229,161.75	
LOCKHEED MARTIN CORP	23,937	436.290	10,443,473.73	
LOEWS CORP	20,739	82.980	1,720,922.22	
LOWE'S COS INC	63,287	246.420	15,595,182.54	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	8,340	379.460	3,164,696.40	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,473	365.820	4,562,872.86	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	29,063	77.610	2,255,579.43	
M&T BANK CORP	18,630	197.450	3,678,493.50	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	6,829	185.980	1,270,057.42	
MARATHON PETROLEUM CORP	37,312	158.270	5,905,370.24	
MARKEL GROUP INC	1,442	1,853.800	2,673,179.60	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,214	189.810	799,859.34	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	26,686	287.200	7,664,219.20	
MARSH & MCLENNAN COS INC	54,864	230.570	12,649,992.48	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,817	506.040	3,449,674.68	
MARVELL TECHNOLOGY INC	96,636	108.710	10,505,299.56	
MASCO CORP	24,321	76.280	1,855,205.88	
MASTERCARD INC-CLASS A	92,046	563.280	51,847,670.88	
MATCH GROUP INC	27,342	33.870	926,073.54	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	28,148	79.210	2,229,603.08	
MCDONALD'S CORP	80,038	303.050	24,255,515.90	
MCKESSON CORP	14,467	603.510	8,730,979.17	
MEDTRONIC PLC	143,094	87.940	12,583,686.36	
MERCADOLIBRE INC	5,090	2,110.470	10,742,292.30	
MERCK & CO INC	282,835	87.680	24,798,972.80	
META PLATFORMS INC-A	243,816	694.840	169,413,109.44	
METLIFE INC	66,398	82.740	5,493,770.52	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,382	1,303.130	3,104,055.66	

MGM MIRAGE	25,377	38.300	971,939.10	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	59,873	64.300	3,849,833.90	
MICRON TECHNOLOGY INC	123,687	103.180	12,762,024.66	
MICROSOFT CORP	787,790	416.130	327,823,052.70	
MICROSTRATEGY INC-CL A	20,415	323.920	6,612,826.80	
MODERNA INC	36,501	33.730	1,231,178.73	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,538	291.460	1,905,565.48	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	20,277	60.400	1,224,730.80	
MONDAY.COM LTD	4,177	308.010	1,286,557.77	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	149,043	62.170	9,266,003.31	
MONGODB INC	8,243	290.000	2,390,470.00	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,439	689.810	3,751,876.59	
MONSTER BEVERAGE CORP	81,968	51.210	4,197,581.28	
MOODY'S CORP	18,283	511.620	9,353,948.46	
MORGAN STANLEY	135,364	134.340	18,184,799.76	
MOSAIC CO/THE	35,576	26.620	947,033.12	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,614	434.510	8,087,969.14	
MSCI INC	8,775	574.350	5,039,921.25	
NASDAQ INC	48,093	82.540	3,969,596.22	
NETAPP INC	22,841	124.550	2,844,846.55	
NETFLIX INC	47,879	1,024.540	49,053,950.66	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,272	116.110	1,308,791.92	
NEWMONT CORP	127,560	48.090	6,134,360.40	
NEWS CORP - CLASS A	42,307	28.850	1,220,556.95	
NEXTERA ENERGY INC	229,296	70.140	16,082,821.44	
NIKE INC	132,850	77.230	10,260,005.50	
NISOURCE INC	49,977	39.980	1,998,080.46	
NORDSON CORP	6,065	218.450	1,324,899.25	
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,226	249.410	6,291,616.66	
NORTHERN TRUST CORP	22,483	113.530	2,552,494.99	
NORTHROP GRUMMAN CORP	15,503	438.110	6,792,019.33	
NRG ENERGY INC	23,013	111.070	2,556,053.91	
NUCOR CORP	26,487	139.950	3,706,855.65	
NUTANIX INC - A	28,108	72.090	2,026,305.72	
NVIDIA CORP	2,736,637	140.110	383,430,210.07	
NVR INC	343	7,258.000	2,489,494.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	28,417	245.860	6,986,603.62	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,471	1,312.440	8,492,799.24	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	70,651	52.090	3,680,210.59	
OKTA INC	18,125	95.190	1,725,318.75	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	21,514	197.250	4,243,636.50	
OMNICOM GROUP	21,820	83.600	1,824,152.00	

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	47,784	55.740	2,663,480.16	
ONEOK INC	65,144	98.630	6,425,152.72	
ORACLE CORP	185,482	176.000	32,644,832.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	44,688	99.030	4,425,452.64	
OVINTIV INC	29,302	45.540	1,334,413.08	
OWENS CORNING	9,683	172.100	1,666,444.30	
PACCAR INC	58,502	106.460	6,228,122.92	
PACKAGING CORP OF AMERICA	10,013	209.680	2,099,525.84	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	227,054	106.270	24,129,028.58	
PALO ALTO NETWORKS INC	72,646	198.810	14,442,751.26	
PARKER HANNIFIN CORP	14,352	695.460	9,981,241.92	
PAYCHEX INC	36,147	150.260	5,431,448.22	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,767	214.400	1,236,444.80	
PAYPAL HOLDINGS INC	108,350	77.630	8,411,210.50	
PENTAIR PLC	18,447	95.250	1,757,076.75	
PEPSICO INC	153,085	149.100	22,824,973.50	
PFIZER INC	632,401	25.900	16,379,185.90	
PG&E CORP	226,337	15.690	3,551,227.53	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	173,471	151.570	26,292,999.47	
PHILLIPS 66	46,677	131.550	6,140,359.35	
PINTEREST INC- CLASS A	67,345	39.560	2,664,168.20	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	44,347	191.890	8,509,745.83	
POOL CORP	4,273	344.320	1,471,279.36	
PPG INDUSTRIES INC	26,032	117.890	3,068,912.48	
PPL CORPORATION	82,214	34.150	2,807,608.10	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,839	86.560	2,236,623.84	
PROCTER & GAMBLE CO	262,157	167.210	43,835,271.97	
PROGRESSIVE CORP	65,340	267.670	17,489,557.80	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39,810	111.130	4,424,085.30	
PTC INC	13,391	165.760	2,219,692.16	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	55,546	84.670	4,703,079.82	
PULTE GROUP INC	23,129	105.840	2,447,973.36	
PURE STORAGE INC - CLASS A	34,731	67.800	2,354,761.80	
QORVO INC	10,585	77.100	816,103.50	
QUALCOMM INC	124,281	173.700	21,587,609.70	
QUANTA SERVICES INC	16,433	281.160	4,620,302.28	
QUEST DIAGNOSTICS	12,421	172.140	2,138,150.94	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,820	155.070	3,383,627.40	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,096	696.020	8,419,057.92	

REGIONS FINANCIAL CORP	102,038	24.060	2,455,034.28	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	6,137	302.660	1,857,424.42	
REPUBLIC SERVICES INC	24,526	230.860	5,662,072.36	
RESMED INC	16,373	232.790	3,811,470.67	
REVVITY INC	13,759	114.720	1,578,432.48	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	83,845	13.610	1,141,130.45	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	59,571	56.060	3,339,550.26	
ROBLOX CORP -CLASS A	53,426	62.820	3,356,221.32	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,663	303.180	3,839,168.34	
ROKU INC	14,217	92.790	1,319,195.43	
ROLLINS INC	32,441	51.330	1,665,196.53	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,960	581.420	6,953,783.20	
ROSS STORES INC	37,016	139.090	5,148,555.44	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,276	243.890	6,652,343.64	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	42,519	33.330	1,417,158.27	
RPM INTERNATIONAL INC	14,355	123.150	1,767,818.25	
RTX CORPORATION	148,417	125.110	18,568,450.87	
S&P GLOBAL INC	35,726	535.430	19,128,772.18	
SALESFORCE INC	106,652	318.430	33,961,196.36	
SAMSARA INC-CL A	24,371	54.650	1,331,875.15	
SCHLUMBERGER LTD	158,432	42.600	6,749,203.20	
SEA LTD-ADR	41,293	132.830	5,484,949.19	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,471	102.640	2,409,063.44	
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,285	82.240	1,010,318.40	
SEMPRA	70,633	86.010	6,075,144.33	
SERVICENOW INC	22,981	967.980	22,245,148.38	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26,733	350.020	9,357,084.66	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17,829	67.320	1,200,248.28	
SMITH (A.O.) CORP	13,398	66.790	894,852.42	
SMURFIT WESTROCK PLC	58,008	54.100	3,138,232.80	
SNAP INC - A	117,624	10.680	1,256,224.32	
SNAP-ON INC	5,877	338.490	1,989,305.73	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	33,665	184.960	6,226,678.40	
SOLVENTUM CORP	16,371	74.500	1,219,639.50	
SOUTHERN CO	122,094	87.820	10,722,295.08	
SOUTHWEST AIRLINES CO	16,777	30.610	513,543.97	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	17,089	636.770	10,881,762.53	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	24,607	89.130	2,193,221.91	
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,189	89.930	1,545,806.77	
STARBUCKS CORP	126,444	113.340	14,331,162.96	
STATE STREET CORP	32,803	99.640	3,268,490.92	
STEEL DYNAMICS INC	16,350	135.070	2,208,394.50	
STERIS PLC	11,006	220.790	2,430,014.74	
STRYKER CORP	38,261	386.410	14,784,433.01	

SUPER MICRO COMPUTER INC	58,799	59.270	3,485,016.73	
SYNCHRONY FINANCIAL	44,076	63.850	2,814,252.60	
SYNOPSYS INC	17,137	493.970	8,465,163.89	
SYSCO CORP	54,828	71.220	3,904,850.16	
T ROWE PRICE GROUP INC	24,846	108.490	2,695,542.54	
T-MOBILE US INC	58,718	265.400	15,583,757.20	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	19,559	215.240	4,209,879.16	
TARGA RESOURCES CORP	23,196	204.700	4,748,221.20	
TARGET CORP	51,398	128.130	6,585,625.74	
TE CONNECTIVITY PLC	33,899	155.780	5,280,786.22	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,222	500.990	2,616,169.78	
TELEFLEX INC	5,256	175.130	920,483.28	
TERADYNE INC	18,200	118.550	2,157,610.00	
TESLA, INC.	320,764	354.400	113,678,761.60	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	126,268	17.000	2,146,556.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	101,871	203.960	20,777,609.16	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,178	1,431.010	3,116,739.78	
TEXTRON INC	20,878	72.430	1,512,193.54	
THE CIGNA GROUP	31,188	299.680	9,346,419.84	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	42,618	537.830	22,921,238.94	
TJX COS INC	125,833	122.980	15,474,942.34	
TOAST INC-CLASS A	43,724	40.260	1,760,328.24	
TORO CO	11,466	81.400	933,332.40	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	60,185	57.740	3,475,081.90	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	50,087	75.730	3,793,088.51	
TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A	12,970	129.880	1,684,543.60	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	25,173	366.640	9,229,428.72	
TRANSDIGM GROUP INC	6,261	1,312.540	8,217,812.94	
TRANSUNION	21,662	94.460	2,046,192.52	
TRAVELERS COS INC/THE	25,427	241.240	6,134,009.48	
TRIMBLE INC	27,238	73.210	1,994,093.98	
TRUIST FINANCIAL CORP	149,441	46.650	6,971,422.65	
TWILIO INC - A	17,026	118.000	2,009,068.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,760	630.090	2,999,228.40	
TYSON FOODS INC-CL A	31,906	59.110	1,885,963.66	
U-HAUL HOLDING CO	10,807	65.860	711,749.02	
UBER TECHNOLOGIES INC	210,943	81.260	17,141,228.18	
ULTA BEAUTY INC	5,257	366.680	1,927,636.76	
UNION PACIFIC CORP	67,966	247.650	16,831,779.90	
UNITED PARCEL SERVICE INC	81,740	116.600	9,530,884.00	
UNITED RENTALS INC	7,376	694.770	5,124,623.52	
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,714	367.360	1,731,735.04	

UNITEDHEALTH GROUP INC	103,022	502.420	51,760,313.24	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,629	184.170	1,220,862.93	
US BANCORP	174,102	46.760	8,141,009.52	
VALERO ENERGY CORP	35,725	139.140	4,970,776.50	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17,163	228.740	3,925,864.62	
VERALTO CORP	27,559	97.720	2,693,065.48	
VERISIGN INC	9,800	233.880	2,292,024.00	
VERISK ANALYTICS INC	15,886	292.700	4,649,832.20	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	470,323	42.490	19,984,024.27	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,794	480.330	13,830,622.02	
VERTIV HOLDINGS CO	39,756	104.830	4,167,621.48	
VIATRIS INC	133,191	11.060	1,473,092.46	
VISA INC-CLASS A SHARES	186,365	350.490	65,319,068.85	
VISTRA CORP	38,321	163.180	6,253,220.78	
VULCAN MATERIALS CO	14,731	258.590	3,809,289.29	
WABTEC CORP	19,525	192.110	3,750,947.75	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	82,214	10.510	864,069.14	
WALMART INC	493,197	97.210	47,943,680.37	
WALT DISNEY CO	202,343	110.550	22,369,018.65	
WARNER BROS DISCOVERY INC	260,056	11.040	2,871,018.24	
WASTE CONNECTIONS INC	28,787	187.850	5,407,637.95	
WASTE MANAGEMENT INC	44,776	229.120	10,259,077.12	
WATERS CORP	6,623	380.810	2,522,104.63	
WATSCO INC	3,883	515.210	2,000,560.43	
WEC ENERGY GROUP INC	35,266	103.530	3,651,088.98	
WELLS FARGO & CO	379,723	78.630	29,857,619.49	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,096	203.650	1,648,750.40	
WESTERN DIGITAL CORP	38,540	71.290	2,747,516.60	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4,301	111.400	479,131.40	
WEYERHAEUSER CO	81,173	29.970	2,432,754.81	
WILLIAMS COS INC	135,940	58.450	7,945,693.00	
WILLIAMS-SONOMA INC	14,094	209.330	2,950,297.02	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,330	324.730	3,679,190.90	
WIX.COM LTD	5,895	203.650	1,200,516.75	
WORKDAY INC-CLASS A	23,765	261.630	6,217,636.95	
WR BERKLEY CORP	33,957	60.400	2,051,002.80	
WW GRAINGER INC	4,902	1,024.300	5,021,118.60	
WYNN RESORTS LTD	11,142	93.470	1,041,442.74	
XCEL ENERGY INC	62,213	69.320	4,312,605.16	
XYLEM INC	27,109	129.730	3,516,850.57	
YUM! BRANDS INC	31,384	150.960	4,737,728.64	

	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5,752	320.980	1,846,276.96	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	17,144	78.340	1,343,060.96	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,718	103.630	2,354,266.34	
	ZOETIS INC	50,548	157.420	7,957,266.16	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	27,786	83.450	2,318,741.70	
	ZSCALER INC	10,207	206.970	2,112,542.79	
アメリカ・ドル	小計	41,265,845		5,910,815,785.60 (885,794,853,625)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	108,464	40.940	4,440,516.16	
	ADMIRAL GROUP PLC	29,120	27.740	807,788.80	
	ANGLO AMERICAN PLC	141,725	24.290	3,442,500.25	
	ANTOFAGASTA PLC	43,886	18.470	810,574.42	
	ASHTED GROUP PLC	48,768	49.340	2,406,213.12	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	37,194	18.825	700,177.05	
	ASTRAZENECA PLC	172,963	115.900	20,046,411.70	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	99,735	7.658	763,770.63	
	AVIVA PLC	298,911	4.960	1,482,598.56	
	BAE SYSTEMS PLC	337,121	12.840	4,328,633.64	
	BARCLAYS PLC	1,620,222	2.984	4,834,742.44	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	153,876	4.285	659,358.66	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	11,385	37.520	427,165.20	
	BP PLC	1,804,508	4.520	8,156,376.16	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	222,387	30.350	6,749,445.45	
	BT GROUP PLC	727,889	1.470	1,069,996.83	
	BUNZL PLC	37,458	33.660	1,260,836.28	
	CENTRICA PLC	573,884	1.435	823,523.54	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	24,175	32.860	794,390.50	
	COMPASS GROUP PLC	189,276	28.080	5,314,870.08	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	14,840	31.480	467,163.20	
	DCC PLC	11,035	53.650	592,027.75	
	DIAGEO PLC	248,247	21.235	5,271,525.04	
	ENDEAVOUR MINING PLC	20,354	18.050	367,389.70	
	ENTAIN PLC	67,834	7.456	505,770.30	
	EXPERIAN PLC	102,504	38.430	3,939,228.72	
	GLENORE PLC	1,156,359	3.255	3,763,948.54	
	GSK PLC	462,434	14.470	6,691,419.98	
	HALEON PLC	858,090	3.859	3,311,369.31	
	HALMA PLC	42,318	29.340	1,241,610.12	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	39,673	10.990	436,006.27	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,534	22.800	422,575.20	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,031,015	8.798	17,868,869.97	

IMPERIAL BRANDS PLC	89,456	27.410	2,451,988.96	
INFORMA PLC	148,232	8.842	1,310,667.34	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	17,742	99.200	1,760,006.40	
INTERTEK GROUP PLC	17,999	52.800	950,347.20	
JD SPORTS FASHION PLC	288,971	0.813	234,933.42	
KINGFISHER PLC	203,428	2.461	500,636.30	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	659,874	2.382	1,571,819.86	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,840,965	0.659	4,508,195.93	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	53,337	117.000	6,240,429.00	
M&G PLC	252,787	2.088	527,819.25	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	228,178	3.436	784,019.60	
MELROSE INDUSTRIES PLC	143,840	6.256	899,863.04	
MONDI PLC/WI	49,286	12.650	623,467.90	
NATIONAL GRID PLC	545,092	9.528	5,193,636.57	
NATWEST GROUP PLC	787,159	4.361	3,432,800.39	
NEXT PLC	13,276	100.400	1,332,910.40	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
PEARSON PLC	66,809	13.600	908,602.40	
PERSIMMON PLC	35,719	12.170	434,700.23	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	78,979	5.015	396,079.68	
PRUDENTIAL PLC	300,677	7.138	2,146,232.42	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	77,132	52.860	4,077,197.52	
RELX PLC	207,778	39.840	8,277,875.52	
RENTOKIL INITIAL PLC	281,837	4.066	1,145,949.24	
RIO TINTO PLC	125,767	50.620	6,366,325.54	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	948,492	6.184	5,865,474.52	
SAGE GROUP PLC	112,063	13.040	1,461,301.52	
SAINSBURY (J) PLC	197,217	2.486	490,281.46	
SCHRODERS PLC	90,611	3.822	346,315.24	
SEVERN TRENT PLC	30,174	24.250	731,719.50	
SHELL PLC-NEW	691,993	26.840	18,573,092.12	
SMITH & NEPHEW PLC	97,598	10.175	993,059.65	
SMITHS GROUP PLC	38,445	20.700	795,811.50	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,250	76.100	627,825.00	
SSE PLC	123,014	14.755	1,815,071.57	
STANDARD CHARTERED PLC	234,205	11.400	2,669,937.00	
TAYLOR WIMPEY PLC	395,598	1.150	454,937.70	
TESCO PLC	763,577	3.748	2,861,886.59	
UNILEVER PLC	276,929	43.800	12,129,490.20	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	76,129	9.652	734,797.10	
VODAFONE GROUP PLC	2,514,355	0.651	1,636,845.10	

	WHITBREAD PLC	20,016	26.230	525,019.68	
	WISE PLC - A	74,343	10.750	799,187.25	
	WPP PLC	120,276	7.530	905,678.28	
イギリス・ポンド 小計		30,088,547		224,693,033.41 (42,633,256,159)	
イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	4,766	281.100	1,339,722.60	
	BANK HAPOALIM BM	140,995	49.090	6,921,444.55	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	168,107	48.020	8,072,498.14	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,978	1,068.300	3,181,397.40	
	ICL GROUP LTD	86,564	22.710	1,965,868.44	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	137,966	28.450	3,925,132.70	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,313	173.300	3,000,342.90	
	NICE LTD	7,014	533.800	3,744,073.20	
イスラエル・シュケル 小計		565,703		32,150,479.93 (1,357,746,918)	
オーストラリ ア・ドル	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	332,270	29.210	9,705,606.70	
	APA GROUP	145,457	6.560	954,197.92	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	63,159	75.130	4,745,135.67	
	ASX LTD	21,642	68.300	1,478,148.60	
	BHP GROUP LIMITED	566,004	40.150	22,725,060.60	
	BLUESCOPE STEEL LTD	48,860	24.550	1,199,513.00	
	BRAMBLES LTD	155,306	19.930	3,095,248.58	
	CARSALES.COM LTD	42,108	37.030	1,559,259.24	
	COCHLEAR LTD	7,302	271.920	1,985,559.84	
	COLES GROUP LTD	149,485	19.630	2,934,390.55	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	186,694	155.730	29,073,856.62	
	COMPUTERSHARE LIMITED	59,168	43.120	2,551,324.16	
	CSL LIMITED	54,022	258.890	13,985,755.58	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	170,334	4.430	754,579.62	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	188,992	18.240	3,447,214.08	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	264,326	7.890	2,085,532.14	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES- CDI	47,896	51.430	2,463,291.28	
	LOTTERY CORP LTD/THE	248,040	5.130	1,272,445.20	
	MACQUARIE GROUP LTD	40,383	232.000	9,368,856.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	307,846	3.950	1,215,991.70	
	MINERAL RESOURCES LTD	19,764	25.830	510,504.12	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	342,902	35.110	12,039,289.22	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	127,994	17.890	2,289,812.66	
	ORICA LTD	54,257	16.960	920,198.72	
ORIGIN ENERGY LIMITED	192,256	10.550	2,028,300.80		
PRO MEDICUS LTD	6,401	286.090	1,831,262.09		

	QANTAS AIRWAYS LTD	85,081	9.220	784,446.82	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	167,959	20.070	3,370,937.13	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	20,584	34.490	709,942.16	
	REA GROUP LTD	5,887	266.440	1,568,532.28	
	REECE LTD	25,215	22.010	554,982.15	
	RIO TINTO LTD	41,379	120.090	4,969,204.11	
	SANTOS LTD	362,523	6.720	2,436,154.56	
	SEEK LTD	39,813	25.620	1,020,009.06	
	SGH LTD	22,679	53.800	1,220,130.20	
	SONIC HEALTHCARE LTD	50,959	28.050	1,429,399.95	
	SOUTH32 LTD	504,463	3.710	1,871,557.73	
	SUNCORP GROUP LTD	120,746	19.630	2,370,243.98	
	TELSTRA GROUP LTD	462,387	4.140	1,914,282.18	
	TRANSURBAN GROUP	346,917	13.320	4,620,934.44	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	90,607	10.760	974,931.32	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	26,632	34.760	925,728.32	
	WESFARMERS LIMITED	126,589	77.620	9,825,838.18	
	WESTPAC BANKING CORP	383,520	31.220	11,973,494.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	20,522	121.700	2,497,527.40	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	212,061	23.260	4,932,538.86	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	136,306	30.500	4,157,333.00	
	XERO LTD	16,179	184.320	2,982,113.28	
	オーストラリア・ドル 小計	7,111,876		203,330,596.20 (19,489,237,646)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	56,016	138.920	7,781,742.72	
	AIR CANADA	19,743	17.220	339,974.46	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	84,743	71.040	6,020,142.72	
	ALTAGAS LTD	33,596	34.730	1,166,789.08	
	ARC RESOURCES LTD	66,446	27.510	1,827,929.46	
	BANK OF MONTREAL	81,524	142.990	11,657,116.76	
	BANK OF NOVA SCOTIA	138,329	72.480	10,026,085.92	
	BARRICK GOLD CORP	195,658	26.670	5,218,198.86	
	BCE INC	10,084	33.410	336,906.44	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	39,795	85.500	3,402,472.50	
	BROOKFIELD CORPORATION-A	152,607	85.040	12,977,699.28	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	15,179	41.600	631,446.40	
	CAE INC	35,735	36.120	1,290,748.20	
	CAMECO CORP	48,589	65.920	3,202,986.88	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	105,387	87.370	9,207,662.19	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	59,807	147.220	8,804,786.54	

CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	236,057	43.500	10,268,479.50	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	104,225	110.560	11,523,116.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,906	144.920	855,897.52	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	15,460	34.190	528,577.40	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	16,801	73.960	1,242,601.96	
CENOVUS ENERGY INC	153,592	21.650	3,325,266.80	
CGI INC	22,810	166.460	3,796,952.60	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,249	4,870.330	10,953,372.17	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	9,601	161.070	1,546,433.07	
DOLLARAMA INC	31,434	143.770	4,519,266.18	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	45,463	29.380	1,335,702.94	
EMERA INC	32,610	56.610	1,846,052.10	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,038	42.800	643,626.40	
ENBRIDGE INC	243,323	59.460	14,467,985.58	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,310	2,046.970	4,728,500.70	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	79,241	18.940	1,500,824.54	
FIRSTSERVICE CORP	4,570	247.990	1,133,314.30	
FORTIS INC	55,631	62.050	3,451,903.55	
FRANCO-NEVADA CORP	21,513	200.910	4,322,176.83	
GEORGE WESTON LTD	6,630	219.330	1,454,157.90	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	25,618	65.490	1,677,722.82	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,832	78.090	1,236,320.88	
GREAT-WEST LIFECO INC	31,518	52.070	1,641,142.26	
HYDRO ONE LTD	37,154	43.980	1,634,032.92	
IA FINANCIAL CORP INC	10,528	129.250	1,360,744.00	
IGM FINANCIAL INC	9,544	46.040	439,405.76	
IMPERIAL OIL LTD	20,505	103.280	2,117,756.40	
INTACT FINANCIAL CORP	19,980	277.120	5,536,857.60	
IVANHOE MINES LTD-CL A	83,062	16.870	1,401,255.94	
KEYERA CORP	25,823	42.840	1,106,257.32	
KINROSS GOLD CORP	137,026	16.370	2,243,115.62	
LOBLAW COS LTD	17,016	174.750	2,973,546.00	
LUNDIN MINING CORP	74,021	12.800	947,468.80	
MAGNA INTERNATIONAL INC	30,624	54.910	1,681,563.84	
MANULIFE FINANCIAL CORP	196,483	45.140	8,869,242.62	
MEG ENERGY CORP	29,875	24.040	718,195.00	
METRO INC	23,800	92.710	2,206,498.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	38,090	123.480	4,703,353.20	
NUTRIEN LTD	55,394	75.300	4,171,168.20	
ONEX CORPORATION	7,048	110.120	776,125.76	

OPEN TEXT CORP	29,779	38.900	1,158,403.10	
PAN AMERICAN SILVER CORP	40,439	36.150	1,461,869.85	
PARKLAND CORP	15,837	38.430	608,615.91	
PEMBINA PIPELINE CORP	65,043	51.610	3,356,869.23	
POWER CORP OF CANADA	63,036	48.070	3,030,140.52	
QUEBECOR INC -CL B	18,251	32.610	595,165.11	
RB GLOBAL INC	20,598	146.760	3,022,962.48	
RESTAURANT BRANDS INTERN	34,446	89.570	3,085,328.22	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	40,731	39.710	1,617,428.01	
ROYAL BANK OF CANADA	157,986	169.400	26,762,828.40	
SAPUTO INC	28,834	25.590	737,862.06	
SHOPIFY INC - CLASS A	135,284	174.970	23,670,641.48	
STANTEC INC	12,821	108.930	1,396,591.53	
SUN LIFE FINANCIAL INC	64,689	78.190	5,058,032.91	
SUNCOR ENERGY INC	141,001	56.950	8,030,006.95	
TC ENERGY CORP	115,918	64.480	7,474,392.64	
TECK RESOURCES LTD-CL B	50,875	61.460	3,126,777.50	
TFI INTERNATIONAL INC	8,986	143.780	1,292,007.08	
THOMSON REUTERS CORP	17,630	250.320	4,413,141.60	
TMX GROUP LTD	31,257	50.170	1,568,163.69	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,261	122.690	1,136,232.09	
TORONTO-DOMINION BANK	195,213	85.590	16,708,280.67	
TOURMALINE OIL CORP	39,476	69.300	2,735,686.80	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,149	113.800	699,756.20	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	50,638	99.120	5,019,238.56	
WSP GLOBAL INC	14,606	253.490	3,702,474.94	
カナダ・ドル 小計	4,545,427		346,247,566.92 (36,587,980,396)	
シンガポール・ ドル				
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	261,700	2.440	638,548.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	222,220	46.080	10,239,897.60	
GENTING SINGAPORE LTD	676,300	0.775	524,132.50	
KEPPEL CORP LTD	162,500	6.810	1,106,625.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	377,600	17.720	6,691,072.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	99,100	5.540	549,014.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	166,200	6.420	1,067,004.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	95,400	12.670	1,208,718.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	173,900	5.070	881,673.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	838,100	3.370	2,824,397.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	141,100	38.430	5,422,473.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	214,500	3.210	688,545.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	287,900	3.300	950,070.00	
シンガポール・ドル 小計	3,716,520		32,792,169.10	

(3,683,216,433)

スイス・フラン	ABB LTD	176,333	52.360	9,232,795.88	
	ADECCO GROUP AG-REG	18,899	22.500	425,227.50	
	ALCON INC	55,715	80.560	4,488,400.40	
	AVOLTA AG	10,180	40.640	413,715.20	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	3,770	58.050	218,848.50	
	BALOISE HOLDING AG	4,856	168.200	816,779.20	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,391	93.350	316,549.85	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	398	1,026.000	408,348.00	
	BKW AG	2,346	152.400	357,530.40	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	110	10,800.000	1,188,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	12	104,800.000	1,257,600.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON- REG	59,972	180.100	10,800,957.20	
	CLARIANT AG	24,078	10.990	264,617.22	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG- REG	783	638.000	499,554.00	
	GALDERMA GROUP AG	9,275	113.760	1,055,124.00	
	GEBERIT AG-REG	3,728	525.000	1,957,200.00	
	GIVAUDAN-REG	1,030	3,888.000	4,004,640.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	4,141	161.100	667,115.10	
	HOLCIM LTD	58,087	94.820	5,507,809.34	
	JULIUS BAER GROUP LTD	22,986	58.760	1,350,657.36	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG- REG	5,394	213.200	1,150,000.80	
	LOGITECH INTERNATIONAL- REG	16,957	92.940	1,575,983.58	
	LONZA GROUP AG	8,056	584.200	4,706,315.20	
	NESTLE SA	292,312	82.340	24,068,970.08	
	NOVARTIS AG	219,869	96.660	21,252,537.54	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,531	1,393.500	3,526,948.50	
	ROCHE HOLDING AG	78,367	295.300	23,141,775.10	
	ROCHE HOLDING AG-BR	3,582	315.000	1,128,330.00	
	SANDOZ GROUP AG	45,664	41.970	1,916,518.08	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,623	266.000	697,718.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,532	276.400	1,252,644.80	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	16,921	96.380	1,630,845.98	
	SIG GROUP AG	34,145	20.640	704,752.80	
	SIKA AG-BEARER	17,002	235.800	4,009,071.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,646	290.600	1,640,727.60	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,446	132.500	1,649,095.00	
	SWATCH GROUP AG	3,233	171.500	554,459.50	

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,201	763.000	2,442,363.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	8,627	108.700	937,754.90	
	SWISS RE AG	33,655	138.350	4,656,169.25	
	SWISSCOM AG	2,943	495.400	1,457,962.20	
	TEMENOS GROUP AG-REG	6,285	75.200	472,632.00	
	UBS GROUP AG	366,802	30.070	11,029,736.14	
	VAT GROUP AG	3,013	360.100	1,084,981.30	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,327	575.200	9,391,290.40	
スイス・フラン	小計	1,670,223		171,311,052.50 (28,557,552,452)	
スウェーデン・クローナ	ADDTECH AB-B SHARES	28,961	341.600	9,893,077.60	
	ALFA LAVAL AB	32,240	470.800	15,178,592.00	
	ASSA ABLOY AB	111,731	329.000	36,759,499.00	
	ATLAS COPCO AB	174,149	162.900	28,368,872.10	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	299,626	187.400	56,149,912.40	
	BEIJER REF AB	42,962	169.250	7,271,318.50	
	BIOVITRUM	21,821	315.800	6,891,071.80	
	BOLIDEN AB	30,453	385.700	11,745,722.10	
	EPIROC AB-A	73,483	218.900	16,085,428.70	
	EPIROC AB-B	43,538	194.800	8,481,202.40	
	EQT AB	41,526	353.500	14,679,441.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	67,988	285.700	19,424,171.60	
	EVOLUTION AB	18,926	833.800	15,780,498.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	73,791	75.580	5,577,123.78	
	GETINGE AB-B SHS	25,505	216.200	5,514,181.00	
	HENNES & MAURITZ AB	63,241	141.700	8,961,249.70	
	HEXAGON AB-B SHS	231,671	128.300	29,723,389.30	
	HOLMEN AB-B SHARES	8,472	423.600	3,588,739.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	14,236	400.800	5,705,788.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,903	400.500	6,769,651.50	
	INDUTRADE AB	30,438	321.800	9,794,948.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	16,476	300.200	4,946,095.20	
	INVESTOR AB	192,737	321.650	61,993,856.05	
	LIFCO AB-B SHS	25,951	387.400	10,053,417.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	8,391	533.000	4,472,403.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	169,260	40.680	6,885,496.80	
	SAAB AB-B	35,722	294.050	10,504,054.10	
	SAGAX AB-B	24,504	222.000	5,439,888.00	
	SANDVIK AB	118,916	237.100	28,194,983.60	
	SECURITAS AB	54,718	157.150	8,598,933.70	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	176,977	167.650	29,670,194.05	
	SKANSKA AB-B SHS	37,866	253.500	9,599,031.00	
	SKF AB	38,022	232.300	8,832,510.60	

	SVENSKA CELLULOSA AB	67,677	151.550	10,256,449.35	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	162,837	131.550	21,421,207.35	
	SWEDBANK AB - A SHARES	94,762	252.800	23,955,833.60	
	TELE2 AB	63,215	124.000	7,838,660.00	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	309,814	85.640	26,532,470.96	
	TELIA CO AB	271,652	33.940	9,219,868.88	
	TRELLEBORG AB-B SHS	23,732	425.800	10,105,085.60	
	VOLVO AB	176,898	329.700	58,323,270.60	
	VOLVO AB-A SHS	22,669	329.800	7,476,236.20	
スウェーデン・クローナ 小計		3,544,457		686,663,825.72 (9,668,226,666)	
デンマーク・クローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	502	12,485.000	6,267,470.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	333	12,250.000	4,079,250.00	
	CARLSBERG AS-B	10,653	855.800	9,116,837.40	
	COLOPLAST-B	14,078	795.000	11,192,010.00	
	DANSKE BANK A/S	76,984	235.900	18,160,525.60	
	DEMANT A/S	9,842	266.400	2,621,908.80	
	DSV A/S	22,794	1,458.000	33,233,652.00	
	GENMAB A/S	7,018	1,587.500	11,141,075.00	
	NOVO-NORDISK A/S	359,309	595.300	213,896,647.70	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	39,297	398.000	15,640,206.00	
	ORSTED A/S	18,739	302.400	5,666,673.60	
	PANDORA A/S	9,139	1,239.500	11,327,790.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,043	2,756.000	2,874,508.00	
	TRYGVESTA AS	37,932	148.100	5,617,729.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	112,756	97.780	11,025,281.68	
ZEALAND PHARMA A/S	7,129	754.000	5,375,266.00		
デンマーク・クローネ 小計		727,548		367,236,831.48 (7,737,680,039)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	168,922	8.150	1,376,714.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	65,342	35.050	2,290,237.10	
	INFRATIL LTD	102,452	10.940	1,120,824.88	
	MERCURY NZ LTD	78,155	6.380	498,628.90	
	MERIDIAN ENERGY LTD	145,616	5.885	856,950.16	
ニュージーランド・ドル 小計		560,487		6,143,355.34 (530,355,867)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	35,326	240.700	8,502,968.20	
	DNB BANK ASA	99,779	249.400	24,884,882.60	
	EQUINOR ASA	93,435	259.400	24,237,039.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	22,225	225.000	5,000,625.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	9,797	1,285.000	12,589,145.00	
	MOWI ASA	51,743	216.200	11,186,836.60	
	NORSK HYDRO ASA	156,474	67.760	10,602,678.24	

	ORKLA ASA	77,627	105.800	8,212,936.60	
	SALMAR ASA	7,362	577.000	4,247,874.00	
	TELENOR ASA	70,594	140.000	9,883,160.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	18,362	317.800	5,835,443.60	
	ノルウェー・クローネ 小計	642,724		125,183,588.84 (1,687,474,778)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	51,035	17.555	895,919.42	
	ACCIONA SA	2,757	109.000	300,513.00	
	ACCOR	21,669	46.870	1,015,626.03	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,616	51.800	1,016,108.80	
	ADIDAS AG	18,071	246.800	4,459,922.80	
	ADP	3,858	105.100	405,475.80	
	ADYEN NV	2,426	1,804.800	4,378,444.80	
	AEGON LTD	150,252	5.862	880,777.22	
	AENA SME SA	8,351	211.000	1,762,061.00	
	AGEAS	17,796	51.250	912,045.00	
	AIB GROUP PLC	207,851	6.235	1,295,950.98	
	AIR LIQUIDE	64,494	172.780	11,143,273.32	
	AIRBUS SE	66,287	165.080	10,942,657.96	
	AKZO NOBEL NV	19,052	57.500	1,095,490.00	
	ALLIANZ SE	43,691	319.500	13,959,274.50	
	ALSTOM RGPT	38,586	20.320	784,067.52	
	AMADEUS IT GROUP SA	50,209	70.080	3,518,646.72	
	AMPLIFON SPA	13,899	25.110	349,003.89	
	AMUNDI SA	6,840	68.500	468,540.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	100,184	50.620	5,071,314.08	
	ARCELORMITTAL	52,205	26.820	1,400,138.10	
	ARGENX SE	6,672	615.800	4,108,617.60	
	ARKEMA	6,271	80.450	504,501.95	
	ASM INTERNATIONAL NV	5,237	566.400	2,966,236.80	
	ASML HOLDING NV	44,579	709.900	31,646,632.10	
	ASR NEDERLAND NV	17,716	48.660	862,060.56	
	AXA SA	196,431	36.840	7,236,518.04	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	642,826	12.170	7,823,192.42	
	BANCO BPM SPA	143,876	9.036	1,300,063.53	
	BANCO DE SABADELL SA	606,535	2.504	1,518,763.64	
	BANCO SANTANDER SA	1,727,211	5.819	10,050,640.80	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	112,119	10.090	1,131,280.71	
	BASF SE	99,605	47.950	4,776,059.75	
	BAYER AG	109,581	21.675	2,375,168.17	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32,337	82.500	2,667,802.50	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,264	77.000	482,328.00	

BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	8,603	117.000	1,006,551.00	
BECHTLE AG	9,156	33.400	305,810.40	
BEIERSDORF AG	11,051	127.200	1,405,687.20	
BIOMERIEUX	4,608	114.600	528,076.80	
BNP PARIBAS	113,541	70.870	8,046,650.67	
BOLLORE SE	79,043	5.785	457,263.75	
BOUYGUES	21,269	32.200	684,861.80	
BPER BANCA SPA	110,834	6.798	753,449.53	
BRENTAG SE	14,517	63.040	915,151.68	
BUREAU VERITAS SA	35,412	30.900	1,094,230.80	
CAIXABANK	446,017	6.476	2,888,406.09	
CAPGEMINI SA	17,327	159.900	2,770,587.30	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4,503	54.950	247,439.85	
CARREFOUR SA	60,495	12.495	755,885.02	
CELLNEX TELECOM SAU	59,617	30.910	1,842,761.47	
CIE DE SAINT-GOBAIN	50,550	94.440	4,773,942.00	
COMMERZBANK AG	105,660	19.650	2,076,219.00	
CONTINENTAL AG	12,267	68.840	844,460.28	
COVESTRO AG-TEND	20,007	59.400	1,188,415.80	
CREDIT AGRICOLE SA	118,757	15.520	1,843,108.64	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	6,957	103.500	720,049.50	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	23,675	23.000	544,525.00	
D'IETEREN GROUP	2,394	161.100	385,673.40	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	55,080	41.790	2,301,793.20	
DANONE	71,973	68.200	4,908,558.60	
DASSAULT AVIATION SA	2,192	234.200	513,366.40	
DASSAULT SYSTEMES SA	74,670	39.750	2,968,132.50	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	68,856	5.364	369,343.58	
DELIVERY HERO SE	20,834	28.520	594,185.68	
DEUTSCHE BANK AG	211,240	19.370	4,091,718.80	
DEUTSCHE BOERSE AG	20,999	247.300	5,193,052.70	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	66,896	6.398	428,000.60	
DEUTSCHE TELEKOM AG	390,841	34.250	13,386,304.25	
DHL GROUP	113,789	36.560	4,160,125.84	
DIASORIN ITALIA SPA	2,491	99.920	248,900.72	
DR ING HC F PORSCHE AG	12,727	57.160	727,475.32	
DSM-FIRMENICH AG	20,764	100.700	2,090,934.80	
E.ON SE	250,306	11.680	2,923,574.08	
EDENRED	27,442	30.810	845,488.02	
EDP RENOVAVEIS SA	34,998	8.850	309,732.30	
EDP SA	350,597	3.013	1,056,348.76	
EIFFAGE	8,199	90.240	739,877.76	
ELIA GROUP SA/NV	3,277	64.050	209,891.85	
ELISA OYJ	16,403	42.720	700,736.16	
ENDESA SA	35,411	21.510	761,690.61	
ENEL SPA	907,046	6.795	6,163,377.57	
ENGIE	203,756	15.920	3,243,795.52	

ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	256,289	14.056	3,602,398.18	
ERSTE GROUP BANK AG	37,541	65.940	2,475,453.54	
ESSILORLUXOTTICA	33,158	292.500	9,698,715.00	
EURAZEO	4,638	79.400	368,257.20	
EUROFINS SCIENTIFIC	15,071	49.440	745,110.24	
EURONEXT NV	8,715	119.900	1,044,928.50	
EVONIK INDUSTRIES AG	28,719	18.725	537,763.27	
EXOR NV	10,992	93.000	1,022,256.00	
FERRARI NV	14,058	482.900	6,788,608.20	
FERROVIAL SE	53,018	43.020	2,280,834.36	
FINCOBANK SPA	68,163	17.665	1,204,099.39	
FORTUM OYJ	49,921	14.895	743,573.29	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	22,905	43.900	1,005,529.50	
FRESENIUS SE & CO KGAA	47,045	36.420	1,713,378.90	
GALP ENERGIA SGPS SA	51,731	15.245	788,639.09	
GEA GROUP AG	17,257	53.600	924,975.20	
GENERALI	104,952	31.500	3,305,988.00	
GETLINK SE - REGR	33,738	15.715	530,192.67	
GRIFOLS SA	33,242	9.478	315,067.67	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,277	67.600	627,125.20	
HANNOVER RUECK SE	6,721	245.300	1,648,661.30	
HEIDELBERG MATERIALS AG	15,206	137.250	2,087,023.50	
HEINEKEN HOLDING NV	14,448	67.700	978,129.60	
HEINEKEN NV	32,123	77.560	2,491,459.88	
HENKEL AG & CO KGAA	11,613	73.750	856,458.75	
HENKEL KGAA-VORZUG	18,843	83.480	1,573,013.64	
HERMES INTERNATIONAL	3,533	2,732.000	9,652,156.00	
IBERDROLA SA	673,946	13.435	9,054,464.51	
IMCD NV	6,361	146.900	934,430.90	
INDITEX SA	121,627	53.840	6,548,397.68	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	145,676	38.660	5,631,834.16	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	40,086	9.350	374,804.10	
ING GROEP NV-CVA	368,487	16.440	6,057,926.28	
INPOST SA	25,048	17.310	433,580.88	
INTESA SANPAOLO	1,631,804	4.489	7,325,168.15	
IPSEN	4,184	109.100	456,474.40	
JDE PEET'S BV	13,670	16.920	231,296.40	
JERONIMO MARTINS	31,630	20.140	637,028.20	
KBC GROEP NV	25,603	81.040	2,074,867.12	
KERING	8,315	270.250	2,247,128.75	
KERRY GROUP PLC-A	17,067	96.950	1,654,645.65	
KESKO OYJ-B SHS	30,412	18.065	549,392.78	
KINGSPAN GROUP PLC	17,233	66.800	1,151,164.40	
KNORR-BREMSE AG	8,077	81.250	656,256.25	
KONE OYJ	37,888	54.500	2,064,896.00	

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	103,606	33.510	3,471,837.06	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	89,110	24.000	2,138,640.00	
L'OREAL SA	26,792	337.900	9,053,016.80	
LA FRANCAISE DES JEUX SACA	11,391	36.700	418,049.70	
LEG IMMOBILIEN SE	8,311	75.880	630,638.68	
LEGRAND SA	29,237	110.700	3,236,535.90	
LEONARDO SPA	45,066	34.800	1,568,296.80	
LOTUS BAKERIES	45	9,000.000	405,000.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	30,690	695.500	21,344,895.00	
MEDIOBANCA SPA	55,793	16.505	920,863.46	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	83,566	59.630	4,983,040.58	
MERCK KGAA	14,414	136.450	1,966,790.30	
METSO CORPORATION	69,323	11.030	764,632.69	
MICHELIN (C.G.D.E.)	74,513	33.450	2,492,459.85	
MONCLER SPA	26,078	66.360	1,730,536.08	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,000	313.600	1,881,600.00	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	14,916	515.000	7,681,740.00	
NEMETSCHKE SE	6,430	117.500	755,525.00	
NESTE OYJ	47,248	8.970	423,814.56	
NEXI SPA	57,613	4.610	265,595.93	
NN GROUP NV	30,192	47.270	1,427,175.84	
NOKIA OYJ	594,641	4.787	2,846,546.46	
NORDEA BANK ABP	351,961	12.185	4,288,644.78	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS- A	7,599	70.000	531,930.00	
OMV AG	16,482	39.700	654,335.40	
ORANGE S.A.	212,376	10.955	2,326,579.08	
ORION OYJ-CLASS B	12,057	52.560	633,715.92	
PERNOD-RICARD	22,623	97.000	2,194,431.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	17,072	36.530	623,640.16	
POSTE ITALIANE SPA	50,921	14.560	741,409.76	
PROSUS	152,578	45.090	6,879,742.02	
PRYSMIAN SPA	31,291	67.920	2,125,284.72	
PUBLICIS GROUPE	25,512	102.600	2,617,531.20	
PUMA AG	11,788	28.200	332,421.60	
QIAGEN NV	24,018	37.500	900,675.00	
RANDSTAD NV	12,139	38.390	466,016.21	
RATIONAL AG	570	856.500	488,205.00	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	11,638	54.850	638,344.30	
REDEIA CORPORACION SA	45,523	16.800	764,786.40	
RENAULT SA	21,425	49.130	1,052,610.25	
REPSOL SA	131,106	13.130	1,721,421.78	

REXEL SA	24,919	26.290	655,120.51	
RHEINMETALL AG	4,859	889.600	4,322,566.40	
ROYAL KPN NV	441,032	3.483	1,536,114.45	
RWE AG	70,513	28.810	2,031,479.53	
SAFRAN SA	40,501	247.900	10,040,197.90	
SAMPO OYJ	275,655	8.058	2,221,227.99	
SANOFI	127,401	103.580	13,196,195.58	
SAP SE	116,482	274.950	32,026,725.90	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,925	249.000	728,325.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,260	208.600	680,036.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	60,993	254.600	15,528,817.80	
SCOUT24 SE	8,340	93.100	776,454.00	
SEB SA	2,768	89.800	248,566.40	
SIEMENS AG	84,774	221.250	18,756,247.50	
SIEMENS ENERGY AG	71,305	59.860	4,268,317.30	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	31,459	55.140	1,734,649.26	
SNAM SPA	225,261	4.425	996,779.92	
SOCIETE GENERALE	80,285	37.470	3,008,278.95	
SODEXO	9,868	72.800	718,390.40	
SOFINA	1,721	230.000	395,830.00	
STELLANTIS NV	219,324	13.334	2,924,466.21	
STMICROELECTRONICS NV	76,222	26.375	2,010,355.25	
STORA ENSO OYJ	64,803	10.670	691,448.01	
SYENQO SA	8,253	79.100	652,812.30	
SYMRISE AG	14,807	97.280	1,440,424.96	
TALANX AG	7,184	83.550	600,223.20	
TELECOM ITALIA SPA	1,139,036	0.271	308,678.75	
TELEFONICA SA	450,563	4.122	1,857,220.68	
TELEPERFORMANCE	6,098	98.200	598,823.60	
TENARIS SA	45,289	18.185	823,580.46	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	156,642	7.818	1,224,627.15	
THALES SA	10,336	183.050	1,892,004.80	
TOTALENERGIES SE	240,643	58.820	14,154,621.26	
UCB SA	14,093	179.500	2,529,693.50	
UNICREDIT SPA	164,277	47.790	7,850,797.83	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	43,650	13.830	603,679.50	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	91,867	28.150	2,586,056.05	
UPM-KYMMENE OYJ	59,566	29.250	1,742,305.50	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	78,415	27.180	2,131,319.70	
VINCI SA	55,822	108.200	6,039,940.40	
VOLKSWAGEN AG	23,036	97.320	2,241,863.52	
VONOVIA SE	82,643	28.360	2,343,755.48	
WARTSILA OYJ	55,950	18.120	1,013,814.00	
WOLTERS KLUWER NV	26,587	175.500	4,666,018.50	
ZALANDO SE	25,026	37.100	928,464.60	
ユーロ 小計	20,661,574		625,730,554.06 (98,358,585,793)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,219,275	55.050	67,121,088.75

BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	412,539	27.200	11,221,060.80	
CK ASSET HOLDINGS LTD	214,409	33.850	7,257,744.65	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	298,909	39.650	11,851,741.85	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	70,000	52.150	3,650,500.00	
CLP HOLDINGS LTD	183,143	64.300	11,776,094.90	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	243,810	29.850	7,277,728.50	
HANG SENG BANK LTD	84,012	104.200	8,754,050.40	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	162,641	21.100	3,431,725.10	
HKT TRUST AND HKT LTD	437,000	9.690	4,234,530.00	
HONG KONG & CHINA GAS	1,249,437	6.060	7,571,588.22	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	134,311	327.600	44,000,283.60	
MTR CORP	173,255	24.950	4,322,712.25	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	154,587	50.050	7,737,079.35	
SANDS CHINA LTD	269,780	17.500	4,721,150.00	
SINO LAND CO	436,000	7.630	3,326,680.00	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	150,000	17.420	2,613,000.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	161,523	70.650	11,411,599.95	
SWIRE PACIFIC LTD	45,366	63.500	2,880,741.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	153,500	106.900	16,409,150.00	
WH GROUP LTD	927,500	6.060	5,620,650.00	
WHARF HOLDINGS LTD	119,000	17.760	2,113,440.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	186,733	19.740	3,686,109.42	
香港・ドル 小計	7,486,730		252,990,448.74 (4,875,125,947)	
合計	122,587,661		1,140,961,292,719 (1,140,961,292,719)	

## (2) 株式以外の有価証券

2025年2月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,599.00	1,681,056.48	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	36,757.00	1,312,592.47	
		AMERICAN TOWER REIT INC	52,118.00	10,026,460.84	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	60,292.00	1,310,145.16	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,855.00	3,478,269.90	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,726.00	1,163,627.82	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,893.00	1,437,150.12	

CROWN CASTLE INC		48,513.00	4,425,840.99	
DIGITAL REALTY TRUST INC		36,524.00	6,282,128.00	
EQUINIX INC		10,592.00	9,959,128.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		19,781.00	1,309,106.58	
EQUITY RESIDENTIAL		38,063.00	2,727,594.58	
ESSEX PROPERTY TRUST INC		7,160.00	2,107,975.60	
EXTRA SPACE STORAGE INC		23,653.00	3,688,448.82	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		30,674.00	1,514,988.86	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		78,012.00	1,542,297.24	
HOST HOTELS AND RESORTS INC		78,399.00	1,313,967.24	
INVITATION HOMES INC		64,960.00	2,094,310.40	
IRON MOUNTAIN INC		32,700.00	3,057,450.00	
KIMCO REALTY CORP		75,205.00	1,625,932.10	
MID-AMERICA APARTMENT COMM		13,043.00	2,087,923.44	
PROLOGIS INC		103,316.00	12,490,904.40	
PUBLIC STORAGE		17,573.00	5,343,246.38	
REALTY INCOME CORP		97,276.00	5,498,039.52	
REGENCY CENTERS CORP		19,224.00	1,408,734.72	
SBA COMMUNICATIONS CORP		11,991.00	2,518,469.73	
SIMON PROPERTY GROUP INC		36,366.00	6,789,895.86	
SUN COMMUNITIES INC		13,924.00	1,764,449.28	
UDR INC		34,983.00	1,504,618.83	
VENTAS INC		46,218.00	3,089,673.30	
VICI PROPERTIES INC		116,964.00	3,597,812.64	
WELLTOWER INC		68,995.00	10,371,328.40	
WP CAREY INC		24,490.00	1,498,788.00	
アメリカ・ドル 小計		1,359,839.00	120,022,355.70 (17,986,550,226)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	79,118.00	453,346.14	
	SEGRO PLC	143,377.00	1,014,822.40	
イギリス・ポンド 小計		222,495.00	1,468,168.54 (278,570,299)	
オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	191,799.00	6,559,525.80	
	GPT GROUP	213,545.00	1,016,474.20	
	MIRVAC GROUP	440,599.00	934,069.88	
	SCENTRE GROUP	578,996.00	2,101,755.48	
	STOCKLAND	265,529.00	1,364,819.06	
VICINITY CENTRES	430,961.00	978,281.47		
オーストラリア・ドル 小計		2,121,429.00	12,954,925.89 (1,241,729,647)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,366.00	376,513.20	
カナダ・ドル 小計		9,366.00	376,513.20	

			(39,786,150)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	417,500.00	1,056,275.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	650,390.00	1,261,756.60	
シンガポール・ドル 小計		1,067,890.00	2,318,031.60 (260,361,309)	
ユーロ	COVIVIO	6,238.00	320,633.20	
	GECINA SA	5,142.00	468,950.40	
	KLEPIERRE	23,910.00	714,909.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,175.00	1,072,445.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	20,208.00	428,813.76	
ユーロ 小計		68,673.00	3,005,751.36 (472,474,056)	
香港・ドル	LINK REIT	287,871.00	9,989,123.70	
香港・ドル 小計		287,871.00	9,989,123.70 (192,490,414)	
投資証券 合計		5,137,563	20,471,962,101 (20,471,962,101)	
合計			20,471,962,101 (20,471,962,101)	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 570銘柄	74.08	-	77.82
	投資証券 33銘柄	-	1.50	
イギリス・ポンド	株式 77銘柄	3.57	-	3.69
	投資証券 2銘柄	-	0.02	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.11	-	0.12
オーストラリア・ドル	株式 48銘柄	1.63	-	1.78
	投資証券 6銘柄	-	0.10	
カナダ・ドル	株式 82銘柄	3.06	-	3.15
	投資証券 1銘柄	-	0.00	
シンガポール・ドル	株式 13銘柄	0.31	-	0.34
	投資証券 2銘柄	-	0.02	
スイス・フラン	株式 45銘柄	2.39	-	2.46
スウェーデン・クローナ	株式 42銘柄	0.81	-	0.83
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.65	-	0.67
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.04	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.14	-	0.15
ユーロ	株式 214銘柄	8.23	-	8.51
	投資証券 5銘柄	-	0.04	
香港・ドル	株式 23銘柄	0.41	-	0.44
	投資証券 1銘柄	-	0.02	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ニッセイ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2月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	426,609,497
金銭信託	18,413,106
コール・ローン	261,977,419
国債証券	91,706,964,432
未収利息	611,759,250
前払費用	56,091,935
流動資産合計	93,081,815,639
資産合計	
93,081,815,639	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	988,654
未払金	90,186,772
未払解約金	202,741,618
流動負債合計	293,917,044
負債合計	
293,917,044	
純資産の部	
元本等	
元本	53,426,797,421
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	39,361,101,174
元本等合計	92,787,898,595
純資産合計	
92,787,898,595	
負債純資産合計	
93,081,815,639	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月22日 至 2025年2月21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2月21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	45,245,373,230円
同期中追加設定元本額	18,852,918,143円
同期中一部解約元本額	10,671,493,952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)	3,827,843,478円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,199,817,047円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,283,701,649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)	983,621,314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)	1,751,002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)	2,663,499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)	4,271,018円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	16,342,716,683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)	10,400,037,885円
DCニッセイ外国債券インデックス	5,439,848,810円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	451,301,546円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	2,385,194,217円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	527,376,501円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	649,435,170円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	34,355,828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)	237,015,663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)	23,803,111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)	57,474,627円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	374,093,861円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	256,996,849円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	452,994,105円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	215,987,912円
FWニッセイ外国債インデックス	64,933,035円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	200,598,561円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	8,146,217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)	817,833円
計	53,426,797,421円
2. 受益権の総数	53,426,797,421口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2024年2月22日 至 2025年2月21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	2025年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2025年2月21日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		253,368,454
合計		253,368,454

（注）「当期間の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年11月21日から2025年2月21日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	2025年2月21日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	35,048,477	-	34,059,823	988,654
	35,048,477	-	34,059,823	988,654
合計	35,048,477	-	34,059,823	988,654

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	2025年2月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7367円 (17,367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

2025年2月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	125,853.60	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	123,838.80	
		US TREASURY BONDS	180,000.00	189,329.40	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,153,283.00	

US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,067,573.00	
US TREASURY N/B	520,000.00	393,775.20	
US TREASURY N/B	900,000.00	803,349.00	
US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,110,231.20	
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,083,574.80	
US TREASURY N/B	900,000.00	801,378.00	
US TREASURY N/B	180,000.00	181,350.00	
US TREASURY N/B	2,490,000.00	2,385,619.20	
US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,321,677.00	
US TREASURY N/B	690,000.00	529,354.20	
US TREASURY N/B	960,000.00	913,305.60	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,644,224.00	
US TREASURY N/B	1,510,000.00	1,505,681.40	
US TREASURY N/B	980,000.00	977,736.20	
US TREASURY N/B	500,000.00	428,650.00	
US TREASURY N/B	2,770,000.00	2,670,557.00	
US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,461,369.00	
US TREASURY N/B	980,000.00	945,161.00	
US TREASURY N/B	510,000.00	444,337.50	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,775,052.00	
US TREASURY N/B	1,660,000.00	1,625,040.40	
US TREASURY N/B	980,000.00	959,861.00	
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,647,060.40	
US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,454,326.80	
US TREASURY N/B	970,000.00	887,394.80	
US TREASURY N/B	640,000.00	503,347.20	
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,724,817.00	
US TREASURY N/B	1,590,000.00	1,527,640.20	
US TREASURY N/B	950,000.00	929,508.50	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,123,042.40	
US TREASURY N/B	450,000.00	359,820.00	
US TREASURY N/B	530,000.00	452,651.80	
US TREASURY N/B	510,000.00	418,536.60	
US TREASURY N/B	560,000.00	430,432.80	
US TREASURY N/B	770,000.00	541,194.50	
US TREASURY N/B	340,000.00	260,059.20	
US TREASURY N/B	480,000.00	358,536.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	228,408.00	
US TREASURY N/B	12,880,000.00	12,550,787.20	
US TREASURY N/B	600,000.00	415,872.00	
US TREASURY N/B	12,490,000.00	12,095,191.10	
US TREASURY N/B	620,000.00	427,942.60	
US TREASURY N/B	14,310,000.00	13,745,327.40	
US TREASURY N/B	760,000.00	497,556.80	
US TREASURY N/B	12,890,000.00	12,401,984.60	
US TREASURY N/B	340,000.00	250,202.60	
US TREASURY N/B	9,790,000.00	9,415,924.10	
US TREASURY N/B	670,000.00	503,176.70	
US TREASURY N/B	10,580,000.00	10,154,684.00	

US TREASURY N/B	520,000.00	389,448.80	
US TREASURY N/B	10,850,000.00	10,337,988.50	
US TREASURY N/B	760,000.00	541,705.20	
US TREASURY N/B	8,030,000.00	7,612,761.20	
US TREASURY N/B	150,000.00	147,357.00	
US TREASURY N/B	740,000.00	526,117.80	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,743,560.00	
US TREASURY N/B	190,000.00	188,937.90	
US TREASURY N/B	860,000.00	639,281.00	
US TREASURY N/B	6,510,000.00	6,233,064.60	
US TREASURY N/B	930,000.00	705,814.20	
US TREASURY N/B	190,000.00	168,735.20	
US TREASURY N/B	270,000.00	259,283.70	
US TREASURY N/B	7,280,000.00	6,945,848.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	739,880.00	
US TREASURY N/B	280,000.00	275,744.00	
US TREASURY N/B	5,580,000.00	5,352,001.20	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	806,871.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,021.00	
US TREASURY N/B	9,490,000.00	8,904,277.20	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	810,733.00	
US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,523,652.80	
US TREASURY N/B	9,260,000.00	8,566,889.00	
US TREASURY N/B	320,000.00	318,534.40	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	753,984.00	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,150,536.20	
US TREASURY N/B	8,780,000.00	7,829,213.80	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	640,203.00	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,084,268.90	
US TREASURY N/B	8,570,000.00	7,638,012.50	
US TREASURY N/B	290,000.00	264,137.80	
US TREASURY N/B	940,000.00	605,087.40	
US TREASURY N/B	3,960,000.00	3,457,555.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	285,162.00	
US TREASURY N/B	1,190,000.00	700,136.50	
US TREASURY N/B	160,000.00	167,336.00	
US TREASURY N/B	920,000.00	563,638.00	
US TREASURY N/B	320,000.00	321,824.00	
US TREASURY N/B	5,210,000.00	4,265,687.50	
US TREASURY N/B	1,540,000.00	761,206.60	
US TREASURY N/B	1,110,000.00	673,581.30	
US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,429,520.80	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	4,557,660.10	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	808,559.10	
US TREASURY N/B	1,260,000.00	792,363.60	
US TREASURY N/B	4,520,000.00	4,079,119.20	
US TREASURY N/B	5,630,000.00	4,678,586.30	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	963,533.70	
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,048,570.60	

US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,193,829.20	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,049,455.50	
US TREASURY N/B	5,780,000.00	4,911,612.80	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,094,350.00	
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,264,997.30	
US TREASURY N/B	900,000.00	817,029.00	
US TREASURY N/B	1,240,000.00	892,601.60	
US TREASURY N/B	6,020,000.00	4,953,316.20	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	989,662.50	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,130,624.80	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,289,756.00	
US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,497,639.30	
US TREASURY N/B	3,570,000.00	2,940,644.70	
US TREASURY N/B	1,590,000.00	888,412.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	244,371.00	
US TREASURY N/B	1,460,000.00	995,705.40	
US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,747,202.80	
US TREASURY N/B	1,820,000.00	1,643,114.20	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,059,497.90	
US TREASURY N/B	1,470,000.00	901,683.30	
US TREASURY N/B	330,000.00	267,930.30	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	830,196.50	
US TREASURY N/B	310,000.00	246,171.00	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	968,357.10	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,124,635.00	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	856,492.00	
US TREASURY N/B	2,290,000.00	2,045,061.60	
US TREASURY N/B	1,310,000.00	950,051.30	
US TREASURY N/B	910,000.00	760,559.80	
US TREASURY N/B	350,000.00	266,273.00	
US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,234,400.00	
US TREASURY N/B	1,320,000.00	1,160,412.00	
US TREASURY N/B	890,000.00	809,686.40	
US TREASURY NOTES	150,000.00	163,159.50	
WI TREASURY SEC.	310,000.00	299,875.40	
WI TREASURY SEC.	1,380,000.00	663,628.20	
WI TREASURY SEC.	4,470,000.00	3,693,650.40	
WI TREASURY SEC.	300,000.00	288,702.00	
WI TREASURY SEC.	280,000.00	249,079.60	
アメリカ・ドル 小計	325,530,000.00 (48,783,925,800)	289,859,404.70 (43,438,330,387)	
イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	267,663.00
	UNITED KINGDOM GILT	800,000.00	805,816.00
	UNITED KINGDOM GILT	530,000.00	410,962.00
	UNITED KINGDOM GILT	750,000.00	752,272.50
	UNITED KINGDOM GILT	650,000.00	622,115.00
	UNITED KINGDOM GILT	860,000.00	851,425.80
	UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	284,388.00

UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	525,600.00	
UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	375,478.00	
UNITED KINGDOM GILT	560,000.00	546,380.80	
UNITED KINGDOM GILT	870,000.00	863,997.00	
UNITED KINGDOM GILT	820,000.00	797,614.00	
UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	338,220.00	
UNITED KINGDOM GILT	220,000.00	220,534.60	
UNITED KINGDOM GILT	90,000.00	90,103.50	
UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	391,069.00	
UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	253,184.00	
UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	208,902.00	
UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	250,923.40	
UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	229,900.00	
UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	365,874.00	
UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	233,583.00	
UNITED KINGDOM GILT	420,000.00	370,272.00	
UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	371,842.60	
UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	411,888.40	
UNITED KINGDOM GILT	410,000.00	351,821.00	
UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	339,364.00	
UNITED KINGDOM GILT	460,000.00	190,716.00	
UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	156,542.00	
UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	357,465.60	
UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	288,610.00	
UNITED KINGDOM GILT	280,000.00	298,594.80	
UNITED KINGDOM GILT	530,000.00	542,810.10	
UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	155,826.00	
UNITED KINGDOM GILT	330,000.00	269,610.00	
UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	336,909.30	
UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	340,511.00	
UNITED KINGDOM GILT	520,000.00	499,408.00	
UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	439,262.00	
UNITED KINGDOM GILT	590,000.00	343,734.00	
UNITED KINGDOM GILT	430,000.00	348,110.80	
UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	168,540.00	
UNITED KINGDOM GILT	530,000.00	474,254.60	
UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	175,075.00	
UNITED KINGDOM GILT	550,000.00	369,270.00	
UNITED KINGDOM GILT	660,000.00	512,516.40	
UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	185,080.00	
UNITED KINGDOM GILT	650,000.00	612,456.00	
UNITED KINGDOM GILT	640,000.00	284,032.00	
UNITED KINGDOM GILT	580,000.00	362,964.00	
UNITED KINGDOM GILT	660,000.00	573,962.40	
UNITED KINGDOM GILT	760,000.00	567,910.00	
UNITED KINGDOM GILT	560,000.00	258,272.00	
UNITED KINGDOM GILT	850,000.00	679,532.50	
UNITED KINGDOM GILT	250,000.00	85,300.00	
UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	270,289.00	

	UNITED KINGDOM GILT	510,000.00	505,614.00	
	UNITED KINGDOM GILT	750,000.00	748,207.50	
	UNITED KINGDOM GILT	770,000.00	691,075.00	
	UNITED KINGDOM GILT	790,000.00	724,200.90	
	UNITED KINGDOM GILT	650,000.00	510,315.00	
イギリス・ボンド 小計		30,700,000.00 (5,825,018,000)	24,858,169.50 (4,716,589,081)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND	840,000.00	827,156.40	
	ISRAEL FIXED BOND	580,000.00	586,490.20	
	ISRAEL FIXED BOND	560,000.00	562,604.00	
	ISRAEL FIXED BOND	100,000.00	103,811.00	
	ISRAEL FIXED BOND	790,000.00	747,624.40	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	347,483.40	
	ISRAEL FIXED BOND	630,000.00	614,281.50	
	ISRAEL FIXED BOND	880,000.00	762,264.80	
	ISRAEL FIXED BOND	570,000.00	638,257.50	
	ISRAEL FIXED BOND	600,000.00	548,922.00	
	ISRAEL FIXED BOND	740,000.00	547,126.40	
	ISRAEL FIXED BOND	660,000.00	636,319.20	
	ISRAEL FIXED BOND	510,000.00	363,278.10	
	ISRAEL FIXED BOND	820,000.00	682,617.20	
イスラエル・シュケル 小計		8,610,000.00 (363,608,910)	7,968,236.10 (336,506,579)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	487,313.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	191,562.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	550,000.00	534,253.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	180,000.00	176,713.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	330,000.00	321,195.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	580,000.00	583,491.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	460,000.00	461,522.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	426,325.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	349,197.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	250,000.00	211,855.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	445,964.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	513,819.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	235,120.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	450,264.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	500,410.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	570,000.00	527,153.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	260,926.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	620,000.00	526,361.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	680,000.00	550,222.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	418,395.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	245,269.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	730,000.00	590,372.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	620,000.00	587,871.60	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	640,000.00	529,856.00		

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	590,000.00	527,878.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	570,000.00	579,638.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	560,000.00	528,847.20	
オーストラリア・ドル	小計	13,170,000.00 (1,262,344,500)	11,761,800.10 (1,127,368,540)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,618,816.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,030,180.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,470,435.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,894,676.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,553,022.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	9,345,238.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	8,486,812.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,600,000.00	17,796,416.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	7,782,062.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	11,626,344.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,068,700.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,806,784.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,300,000.00	12,940,092.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	12,704,123.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,400,000.00	11,812,908.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,706,875.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	9,050,580.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,800,000.00	14,489,724.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,500,000.00	15,993,055.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	16,000,000.00	16,195,200.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,600,000.00	11,158,302.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,330,660.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,024,560.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,206,300.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,400,000.00	13,026,696.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,091,200.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	7,821,464.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,500,000.00	14,549,010.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,300,000.00	4,632,837.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,368,708.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,025,650.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	6,116,471.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,026,460.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,034,150.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	2,159,325.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	3,997,480.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,960,220.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	2,469,225.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,900,000.00	6,721,134.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,227,730.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,500,000.00	6,866,535.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,656,672.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,052,830.00	

	CHINA GOVERNMENT BOND	9,420,000.00	9,884,500.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,222,392.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,710,286.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,589,540.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,400,000.00	17,740,170.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	7,768,224.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,140,000.00	4,467,432.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	4,828,001.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,258,144.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,365,050.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,778,884.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,847,266.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	6,930,684.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,725,405.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,600,000.00	4,942,286.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,800,000.00	10,028,242.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,785,128.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,257,200.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,550,266.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	700,000.00	897,295.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	10,556,161.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	7,222,450.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,700,000.00	6,157,995.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,900,000.00	7,291,989.00	
	オフショア・人民元 小計	475,370,000.00 (9,829,130,416)	503,700,652.00 (10,414,917,641)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT	450,000.00	437,449.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	670,000.00	589,553.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	240,000.00	240,316.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	235,170.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	470,000.00	476,335.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	490,000.00	493,376.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	630,000.00	656,926.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	520,000.00	527,732.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	768,323.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	607,890.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	153,772.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	680,000.00	697,251.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	508,070.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	224,802.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	141,007.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	690,000.00	692,539.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	490,000.00	493,317.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	490,000.00	486,045.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	510,000.00	511,723.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	150,202.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	50,000.00	50,833.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	132,558.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	186,942.90	

	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	212,351.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	192,272.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	160,000.00	156,017.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	225,499.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	195,260.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	930,000.00	704,233.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	136,859.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	740,000.00	678,927.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	660,000.00	573,942.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	389,456.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	850,000.00	776,500.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	410,000.00	399,114.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	730,000.00	512,744.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	633,640.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	380,000.00	368,524.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	550,000.00	511,038.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	106,833.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	370,000.00	369,452.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	459,724.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	356,846.00	
カナダ・ドル 小計		18,220,000.00 (1,925,307,400)	17,421,378.80 (1,840,917,098)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	100,380.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	70,000.00	70,630.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	62,467.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	64,804.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	207,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	157,120.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	220,000.00	221,005.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	196,386.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	240,000.00	238,099.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	169,290.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	159,440.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	131,770.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	132,320.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	213,200.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	200,900.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	130,270.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	106,340.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	204,905.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	166,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	118,140.00	
SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	100,360.00		
シンガポール・ドル 小計		3,220,000.00 (361,670,400)	3,151,429.80 (353,968,595)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	890,000.00	878,029.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,120,000.00	2,084,808.00	

	SWEDISH GOVERNMENT	1,170,000.00	1,167,894.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,860,000.00	1,784,763.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,820,000.00	1,707,342.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,010,000.00	1,123,736.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,143,467.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,360,000.00	1,297,521.60	
スウェーデン・クローナ 小計		11,530,000.00 (162,342,400)	11,187,561.20 (157,520,862)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,780,000.00	1,778,059.80	
	KINGDOM OF DENMARK	670,000.00	674,187.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,300,000.00	1,251,484.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,200,000.00	1,117,320.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,550,000.00	866,062.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,200,000.00	1,040,196.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,360,000.00	2,942,754.80	
デンマーク・クローネ 小計		10,060,000.00 (211,964,200)	9,670,064.60 (203,748,261)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	300,000.00	304,761.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	96,942.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	140,000.00	138,070.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	143,521.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	190,000.00	192,988.70	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	290,000.00	278,858.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	170,000.00	137,652.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	220,000.00	186,733.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	330,000.00	294,053.10	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	340,000.00	317,165.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	130,000.00	82,981.60	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	97,630.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	260,000.00	250,374.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	230,000.00	196,012.90	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	210,000.00	204,880.20	
ニュージーランド・ドル 小計		3,210,000.00 (277,119,300)	2,922,627.10 (252,310,398)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,247,875.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,160,000.00	1,129,573.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,440,000.00	1,405,238.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,350,000.00	1,298,551.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,004,392.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	931,566.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,290,000.00	1,132,220.10	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	898,424.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,130,000.00	1,002,276.10	
ノルウェー・クローネ 小計		11,320,000.00 (152,593,600)	10,495,991.80 (141,485,969)	

ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,180,000.00	1,193,888.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,160,000.00	1,124,214.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	730,000.00	683,973.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	600,000.00	584,394.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,280,000.00	1,233,075.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,180,000.00	1,106,073.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	890,000.00	824,424.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,270,000.00	1,127,975.90	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,271,075.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	951,828.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	980,000.00	903,373.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,160,000.00	893,397.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	774,312.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,060,000.00	1,127,596.20	
ポーランド・ズロチ 小計		14,750,000.00 (557,072,100)	13,799,601.60 (521,177,833)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA GOVERNMENT	500,000.00	522,965.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	350,248.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	353,430.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	220,000.00	223,267.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	553,294.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	633,582.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	411,225.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	211,361.70	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	615,587.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	364,428.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	390,115.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	414,368.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	470,000.00	474,624.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	261,348.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	590,000.00	637,312.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT	530,000.00	535,835.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	603,245.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	570,000.00	605,784.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	640,000.00	647,417.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	459,253.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	350,000.00	352,677.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	580,000.00	581,583.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	590,000.00	575,120.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	672,003.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	810,000.00	760,841.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT	390,000.00	385,479.90	
MALAYSIA GOVERNMENT	560,000.00	606,765.60		
MALAYSIA GOVERNMENT	230,000.00	238,238.60		
MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	340,421.60		
マレーシア・リングgit 小計		13,460,000.00 (456,292,654)	13,781,826.70 (467,202,547)	

メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,400,000.00	7,196,722.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	600,000.00	530,520.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,450,000.00	8,155,771.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,120,000.00	7,047,023.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,180,000.00	8,370,507.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,170,000.00	7,208,995.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,700,000.00	1,653,811.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,050,000.00	7,796,264.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,940,000.00	4,695,510.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,150,000.00	2,167,286.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,420,000.00	8,150,560.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,540,000.00	8,248,615.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,910,000.00	4,309,212.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,620,000.00	8,991,814.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,950,000.00	6,196,230.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,450,000.00	6,468,462.50	
	メキシコ・ペソ	小計	107,650,000.00 (794,553,885)	97,187,305.00 (717,329,779)
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	233,260.00	
	BELGIUM KINGDOM	120,000.00	119,348.40	
	BELGIUM KINGDOM	380,000.00	373,699.60	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	182,977.60	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	221,375.00	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	547,897.80	
	BELGIUM KINGDOM	170,000.00	169,816.40	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	237,668.20	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	225,955.80	
	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	240,067.20	
	BELGIUM KINGDOM	420,000.00	378,869.40	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	266,312.80	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	178,678.50	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	393,852.00	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	189,572.40	
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	137,834.00	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	377,071.50	
	BELGIUM KINGDOM	190,000.00	138,751.30	
	BELGIUM KINGDOM	170,000.00	139,320.10	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	513,108.40	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	379,804.00	
	BELGIUM KINGDOM	280,000.00	247,973.60	
	BELGIUM KINGDOM	470,000.00	439,388.90	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	185,387.40	
	BELGIUM KINGDOM	330,000.00	289,317.60	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	141,915.40	
	BELGIUM KINGDOM	270,000.00	254,032.20	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	440,444.00	
BELGIUM KINGDOM	320,000.00	267,257.60		
BELGIUM KINGDOM	160,000.00	60,411.20		
BELGIUM KINGDOM	370,000.00	309,900.90		

BELGIUM KINGDOM	240,000.00	146,344.80	
BELGIUM KINGDOM	180,000.00	168,552.00	
BELGIUM KINGDOM	450,000.00	452,493.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	565,952.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	390,000.00	407,550.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	590,947.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	580,092.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	561,652.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	576,173.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	240,000.00	246,163.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	410,000.00	495,681.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	614,598.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	620,000.00	700,296.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	260,000.00	264,108.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	170,000.00	170,219.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	586,866.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	60,000.00	59,851.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	340,000.00	338,558.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	567,491.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	588,347.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	568,111.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	548,108.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	425,347.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	336,977.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	680,000.00	669,670.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	580,158.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	494,390.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	566,178.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	629,674.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	396,139.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	480,000.00	557,092.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	713,460.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	549,970.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	545,113.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	493,746.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	528,722.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	537,666.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	510,708.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	300,553.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	680,000.00	627,408.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	592,966.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	338,381.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	450,459.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	660,000.00	560,742.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	170,000.00	83,548.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	660,000.00	615,146.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	335,632.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	515,880.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	350,000.00	234,062.50	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	507,231.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	640,000.00	550,374.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	313,085.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	630,000.00	582,680.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	535,370.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	370,000.00	359,188.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	550,000.00	553,514.50	
BUNDESobligation	680,000.00	684,678.40	
BUNDESobligation	580,000.00	576,897.00	
BUNDESobligation	140,000.00	139,269.20	
BUNDESobligation	550,000.00	555,368.00	
BUNDESobligation	110,000.00	110,514.80	
BUNDESobligation	640,000.00	625,171.20	
BUNDESobligation	570,000.00	551,081.70	
BUNDESobligation	510,000.00	487,672.20	
BUNDESobligation	700,000.00	685,727.00	
BUNDESobligation	220,000.00	215,527.40	
BUNDESobligation	580,000.00	580,649.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	250,000.00	247,907.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	220,000.00	178,248.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	717,810.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	642,867.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	781,880.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	480,000.00	451,852.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	240,000.00	234,775.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	820,000.00	826,133.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	717,345.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	120,000.00	119,628.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	770,000.00	758,034.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	676,960.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	717,814.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	684,908.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	711,872.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	450,000.00	531,076.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	490,000.00	612,612.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	870,000.00	644,887.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	629,554.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	618,928.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	690,000.00	640,416.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000.00	617,011.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	980,000.00	492,126.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	460,000.00	490,502.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	582,419.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	481,628.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	550,000.00	424,704.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	780,000.00	690,385.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	660,000.00	751,225.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	230,000.00	203,662.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	559,385.60	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	456,548.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	150,879.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	638,442.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	572,911.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	181,227.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	760,000.00	361,858.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	612,165.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	270,000.00	318,575.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	710,348.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	504,177.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	640,000.00	610,720.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	590,000.00	585,457.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	606,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	890,000.00	882,319.30	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	440,000.00	441,469.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	460,000.00	464,227.40	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	490,000.00	493,983.70	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	340,000.00	339,095.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	355,031.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	375,864.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	273,886.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	403,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	523,643.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	414,888.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	449,697.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	496,324.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	387,985.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	430,270.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	414,067.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	459,319.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	389,739.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	513,921.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	448,949.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	461,871.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	416,486.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	216,316.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	327,107.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	711,455.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	363,751.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	439,571.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	301,359.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	270,000.00	271,765.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	358,311.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	825,688.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	261,092.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	290,000.00	290,287.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	110,000.00	110,536.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	388,735.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	670,000.00	689,899.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	640,000.00	578,265.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	653,236.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	760,000.00	885,483.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	345,397.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	525,516.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	347,272.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	481,042.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	250,000.00	184,435.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	475,610.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	468,054.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	406,647.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	446,035.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	345,948.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	561,820.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	774,970.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	522,865.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	481,625.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	411,381.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	554,911.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	308,988.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	620,000.00	696,098.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	481,686.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	638,730.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	281,078.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	280,875.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	670,000.00	750,580.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	386,333.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	551,410.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	500,472.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	306,233.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	413,007.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	610,000.00	536,147.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	255,229.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	301,280.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	418,303.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	210,825.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	491,191.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	103,966.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	354,323.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	406,836.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	425,906.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	466,891.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	448,674.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	419,814.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	408,979.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	650,000.00	717,301.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	366,136.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	409,564.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	149,450.40	

BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	379,774.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	473,020.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	390,179.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	283,002.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	471,847.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	312,552.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	490,000.00	526,191.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	560,000.00	584,001.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	429,987.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	335,894.40	
DEUTSCHLAND REP	380,000.00	416,301.40	
DEUTSCHLAND REP	300,000.00	329,868.00	
DEUTSCHLAND REP	330,000.00	357,498.90	
DEUTSCHLAND REP	500,000.00	586,305.00	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	86,614.20	
FINNISH GOVERNMENT	190,000.00	192,266.70	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	142,258.20	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	103,947.80	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	141,061.20	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	119,796.00	
FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	69,939.10	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	121,570.80	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	130,278.40	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	98,329.00	
FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	166,810.80	
FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	153,136.00	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	111,689.50	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	100,270.80	
FINNISH GOVERNMENT	190,000.00	173,874.70	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	87,381.60	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	58,149.90	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	112,778.90	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	45,571.00	
FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	135,748.80	
FINNISH GOVERNMENT	170,000.00	159,181.20	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	87,046.20	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	63,479.00	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	127,988.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	98,202.00	
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	516,780.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,104,114.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,440,000.00	1,453,449.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,350,000.00	1,357,290.00	
FRANCE (GOVT OF)	980,000.00	973,590.80	
FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	836,066.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,090,000.00	1,119,887.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,020,000.00	1,022,886.60	
FRANCE (GOVT OF)	230,000.00	204,833.40	
FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	700,454.40	

FRANCE (GOVT OF)	530,000.00	476,973.50	
FRANCE (GOVT OF)	870,000.00	870,426.30	
FRANCE (GOVT OF)	1,020,000.00	1,001,293.20	
FRANCE (GOVT OF)	230,000.00	230,006.90	
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,482,615.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,385,580.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,030,000.00	1,145,957.40	
FRANCE (GOVT OF)	890,000.00	871,479.10	
FRANCE (GOVT OF)	430,000.00	253,588.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,170,000.00	944,763.30	
FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	878,832.50	
FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	663,609.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,050,000.00	1,019,749.50	
FRANCE (GOVT OF)	710,000.00	525,946.70	
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,419,750.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,400,000.00	1,187,116.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,430,000.00	1,338,251.20	
FRANCE (GOVT OF)	640,000.00	677,939.20	
FRANCE (GOVT OF)	890,000.00	993,444.70	
FRANCE (GOVT OF)	790,000.00	506,611.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,360,000.00	1,244,712.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	969,540.00	
FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	388,939.20	
FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	802,099.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	1,024,675.30	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	517,000.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,360,000.00	1,160,596.80	
FRANCE (GOVT OF)	750,000.00	485,122.50	
FRANCE (GOVT OF)	330,000.00	107,368.80	
FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	322,179.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,350,000.00	1,112,454.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,060,000.00	1,012,925.40	
FRANCE (GOVT OF)	770,000.00	374,512.60	
FRANCE (GOVT OF)	940,000.00	759,905.40	
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	537,628.00	
FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	972,725.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,190,000.00	1,132,213.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,170,000.00	1,087,362.90	
FRANCE (GOVT OF)	520,000.00	538,512.00	
FRANCE (GOVT OF)	530,000.00	451,719.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	110,000.00	107,932.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	70,000.00	69,428.80	
IRELAND GOVERNMENT BOND	260,000.00	218,712.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	220,000.00	218,893.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	260,000.00	256,258.60	
IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	165,294.30	
IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	182,020.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	130,000.00	116,829.70	
IRELAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	149,374.40	

IRELAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	237,000.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	150,796.80	
IRELAND GOVERNMENT BOND	120,000.00	93,897.60	
IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	181,698.90	
IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	158,135.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	168,386.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	100,000.00	68,474.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	90,000.00	88,957.80	
IRISH GOVERNMENT BOND	120,000.00	100,843.20	
ITALIAN GOVT	240,000.00	259,454.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	276,662.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	280,949.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	210,000.00	219,620.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	304,330.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	470,000.00	457,864.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	357,181.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	381,225.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	396,228.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	430,000.00	408,439.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	457,888.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	319,294.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	360,000.00	257,040.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	320,000.00	280,928.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	440,000.00	487,801.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	335,993.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	470,000.00	221,468.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	298,907.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	340,000.00	235,303.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	326,856.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	356,307.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	267,167.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT	380,000.00	312,968.00	
OBRIGACOES DO TESOURO	230,000.00	197,843.70	
OBRIGACOES DO TESOURO	70,000.00	69,466.60	
OBRIGACOES DO TESOURO	390,000.00	375,846.90	
OBRIGACOES DO TESOURO	150,000.00	148,858.50	
OBRIGACOES DO TESOURO	110,000.00	112,648.80	
OBRIGACOES DO TESOURO	160,000.00	172,876.80	
OBRIGACOES DO TESOURO	150,000.00	84,013.50	
OBRIGACOES DO TESOURO	260,000.00	232,572.60	
OBRIGACOES DO TESOURO	180,000.00	144,986.40	
OBRIGACOES DO TESOURO	120,000.00	84,801.60	
OBRIGACOES DO TESOURO	170,000.00	181,282.90	
OBRIGACOES DO TESOURO	370,000.00	367,898.40	
OBRIGACOES DO TESOURO	220,000.00	208,832.80	
OBRIGACOES DO TESOURO	160,000.00	148,564.80	
OBRIGACOES DO TESOURO	90,000.00	89,635.50	
OBRIGACOES DO TESOURO	240,000.00	242,508.00	
OBRIGACOES DO TESOURO	300,000.00	294,897.00	

	OBRIGACOES DO TESOURO	240,000.00	262,101.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	136,873.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	121,995.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	167,123.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	330,722.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	90,726.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	119,912.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	221,234.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	111,531.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	228,557.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	410,000.00	400,164.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	250,000.00	184,455.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	370,000.00	356,450.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	45,868.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	108,037.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	229,017.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	320,000.00	305,539.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	350,000.00	388,871.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	360,000.00	333,914.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	195,095.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	291,040.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	240,000.00	137,649.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	160,000.00	98,691.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	46,926.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	370,000.00	316,383.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	59,764.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	145,890.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	260,000.00	238,521.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	265,431.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	116,854.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	129,697.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	410,000.00	413,029.90	
	ユーロ 小計	183,080,000.00 (28,778,345,200)	171,878,560.10 (27,017,590,862)	
国債証券 合計		99,741,288,765 (99,741,288,765)	91,706,964,432 (91,706,964,432)	
合計			91,706,964,432 (91,706,964,432)	

(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 141銘柄	46.81	47.37
イギリス・ポンド	国債証券 61銘柄	5.08	5.14
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	0.36	0.37

オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	1.21	1.23
オフショア・人民元	国債証券	67銘柄	11.22	11.36
カナダ・ドル	国債証券	43銘柄	1.98	2.01
シンガポール・ドル	国債証券	21銘柄	0.38	0.39
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.17	0.17
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.22	0.22
ニュージーランド・ドル	国債証券	15銘柄	0.27	0.28
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.15	0.15
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	0.56	0.57
マレーシア・リンギット	国債証券	29銘柄	0.50	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	0.77	0.78
ユーロ	国債証券	406銘柄	29.12	29.46

(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

## DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

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（2025年2月22日から2025年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

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（2025年2月22日から2025年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

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（2025年2月22日から2025年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 2025年2月21日現在	第23期中間計算期間 2025年8月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	109,741,085	36,013,448
コール・ローン	1,561,370,850	1,781,507,370
親投資信託受益証券	32,048,552,392	34,278,929,982
未収入金	21,335,084	56,490,810
流動資産合計	33,740,999,411	36,152,941,610
資産合計	33,740,999,411	36,152,941,610
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	22,170,509	59,155,969
未払受託者報酬	3,671,348	3,750,278
未払委託者報酬	22,028,352	22,501,891
その他未払費用	183,478	187,412
流動負債合計	48,053,687	85,595,550
負債合計	48,053,687	85,595,550
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,741,601,345	15,280,418,285
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	18,951,344,379	20,786,927,775
（分配準備積立金）	4,721,841,004	4,462,719,323
元本等合計	33,692,945,724	36,067,346,060
純資産合計	33,692,945,724	36,067,346,060
負債純資産合計	33,740,999,411	36,152,941,610

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第22期中間計算期間 自 2024年2月22日 至 2024年8月21日	第23期中間計算期間 自 2025年2月22日 至 2025年8月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	530,267	3,669,956
有価証券売買等損益	407,722,054	1,166,392,249
営業収益合計	408,252,321	1,170,062,205
<b>営業費用</b>		
支払利息	8,658	-
受託者報酬	3,446,515	3,750,278
委託者報酬	20,679,374	22,501,891
その他費用	375,560	187,412
営業費用合計	24,510,107	26,439,581
営業利益又は営業損失（ ）	383,742,214	1,143,622,624
経常利益又は経常損失（ ）	383,742,214	1,143,622,624
中間純利益又は中間純損失（ ）	383,742,214	1,143,622,624
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（ ）	38,171,783	2,489,975
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	16,718,795,502	18,951,344,379
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,184,334,146	1,785,263,551
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	2,184,334,146	1,785,263,551
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,329,052,211	1,090,812,804
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,329,052,211	1,090,812,804
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（ ）	17,919,647,868	20,786,927,775

## ( 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23期中間計算期間	
	自 2025年2月22日	至 2025年8月21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22期	第23期中間計算期間
	2025年2月21日現在	2025年8月21日現在
1. 期首元本額	13,465,469,203円	14,741,601,345円
期中追加設定元本額	3,164,268,955円	1,387,833,210円
期中一部解約元本額	1,888,136,813円	849,016,270円
2. 受益権の総数	14,741,601,345口	15,280,418,285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22期	第23期中間計算期間
	2025年2月21日現在	2025年8月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第22期 2025年2月21日現在	第23期中間計算期間 2025年8月21日現在
1口当たり純資産額	2,2856円	2,3604円
（1万口当たり純資産額）	（22,856円）	（23,604円）

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 2025年2月21日現在	第23期中間計算期間 2025年8月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	275,289,572	91,282,985
コール・ローン	3,916,756,544	4,515,571,816
親投資信託受益証券	80,445,308,147	87,712,488,967
未収入金	78,264,873	83,800,677
流動資産合計	84,715,619,136	92,403,144,445
資産合計	84,715,619,136	92,403,144,445
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	81,660,716	87,422,576
未払受託者報酬	9,180,892	9,393,306
未払委託者報酬	55,085,579	56,360,062
その他未払費用	458,963	469,580
流動負債合計	146,386,150	153,645,524
負債合計	146,386,150	153,645,524
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	26,500,252,813	27,420,592,707
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	58,068,980,173	64,828,906,214
（分配準備積立金）	21,364,149,942	20,429,848,575
元本等合計	84,569,232,986	92,249,498,921
純資産合計	84,569,232,986	92,249,498,921
負債純資産合計	84,715,619,136	92,403,144,445

## （ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第22期中間計算期間 自 2024年2月22日 至 2024年8月21日	第23期中間計算期間 自 2025年2月22日 至 2025年8月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1,311,963	9,151,538
有価証券売買等損益	1,893,348,493	4,779,992,891
その他収益	-	594
<b>営業収益合計</b>	<b>1,894,660,456</b>	<b>4,789,145,023</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	21,258	-
受託者報酬	8,592,575	9,393,306
委託者報酬	51,555,666	56,360,062
その他費用	761,628	469,580
<b>営業費用合計</b>	<b>60,931,127</b>	<b>66,222,948</b>
営業利益又は営業損失（ ）	1,833,729,329	4,722,922,075
経常利益又は経常損失（ ）	1,833,729,329	4,722,922,075
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,833,729,329	4,722,922,075
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（ ）	124,790,644	1,345,205
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	49,822,808,584	58,068,980,173
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,406,149,583	4,679,280,413
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	5,406,149,583	4,679,280,413
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,869,097,449	2,643,621,652
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,869,097,449	2,643,621,652
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（ ）	54,068,799,403	64,828,906,214

## ( 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23期中間計算期間	
	自 2025年2月22日	至 2025年8月21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22期	第23期中間計算期間
	2025年2月21日現在	2025年8月21日現在
1. 期首元本額	24,504,201,805円	26,500,252,813円
期中追加設定元本額	4,592,514,119円	2,127,395,659円
期中一部解約元本額	2,596,463,111円	1,207,055,765円
2. 受益権の総数	26,500,252,813口	27,420,592,707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22期	第23期中間計算期間
	2025年2月21日現在	2025年8月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第22期 2025年2月21日現在	第23期中間計算期間 2025年8月21日現在
1口当たり純資産額	3,1913円	3,3642円
(1万口当たり純資産額)	(31,913円)	(33,642円)

## 【DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 2025年2月21日現在	第23期中間計算期間 2025年8月21日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	188,289,907	63,544,391
コール・ローン	2,678,945,373	3,143,403,558
親投資信託受益証券	55,082,404,708	61,579,030,876
未収入金	49,491,466	70,182,343
流動資産合計	57,999,131,454	64,856,161,168
資産合計	57,999,131,454	64,856,161,168
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	51,600,103	73,321,859
未払受託者報酬	6,210,358	6,458,340
未払委託者報酬	37,262,380	38,750,284
その他未払費用	310,423	322,828
流動負債合計	95,383,264	118,853,311
負債合計	95,383,264	118,853,311
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	13,396,036,268	13,933,645,702
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	44,507,711,922	50,803,662,155
（分配準備積立金）	15,986,516,579	15,061,402,704
元本等合計	57,903,748,190	64,737,307,857
純資産合計	57,903,748,190	64,737,307,857
負債純資産合計	57,999,131,454	64,856,161,168

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第22期中間計算期間 自 2024年2月22日 至 2024年8月21日	第23期中間計算期間 自 2025年2月22日 至 2025年8月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	863,474	6,267,654
有価証券売買等損益	1,715,840,417	4,544,405,403
営業収益合計	1,716,703,891	4,550,673,057
<b>営業費用</b>		
支払利息	13,629	-
受託者報酬	5,668,606	6,458,340
委託者報酬	34,011,847	38,750,284
その他費用	540,273	322,828
営業費用合計	40,234,355	45,531,452
営業利益又は営業損失（ ）	1,676,469,536	4,505,141,605
経常利益又は経常損失（ ）	1,676,469,536	4,505,141,605
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,676,469,536	4,505,141,605
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（ ）	154,022,960	1,238,021
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	35,707,799,333	44,507,711,922
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,866,260,576	4,507,969,901
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	5,866,260,576	4,507,969,901
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,898,838,197	2,715,923,252
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,898,838,197	2,715,923,252
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（ ）	40,197,668,288	50,803,662,155

## ( 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23期中間計算期間	
	自 2025年2月22日	至 2025年8月21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22期	第23期中間計算期間
	2025年2月21日現在	2025年8月21日現在
1. 期首元本額	11,958,594,696円	13,396,036,268円
期中追加設定元本額	3,208,872,329円	1,355,846,453円
期中一部解約元本額	1,771,430,757円	818,237,019円
2. 受益権の総数	13,396,036,268口	13,933,645,702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22期	第23期中間計算期間
	2025年2月21日現在	2025年8月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第22期 2025年2月21日現在	第23期中間計算期間 2025年8月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4,3225円 (43,225円)	4,6461円 (46,461円)

（参考）

「DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）」、「DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）」、「DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）」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、「ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド」受益証券、「ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド」受益証券及び「ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド  
貸借対照表

（単位：円）

2025年8月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	108,689,891
コール・ローン	5,376,653,811
株式	330,127,121,790
派生商品評価勘定	463,283,250
未収配当金	405,544,767
差入委託証拠金	314,384,745
流動資産合計	336,795,678,254
資産合計	336,795,678,254
負債の部	
流動負債	
前受金	502,235,000
未払解約金	749,726,357
流動負債合計	1,251,961,357
負債合計	1,251,961,357
純資産の部	
元本等	
元本	88,705,093,216
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	246,838,623,681
元本等合計	335,543,716,897
純資産合計	335,543,716,897
負債純資産合計	336,795,678,254

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年2月22日 至 2025年8月21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8月21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	87,977,940,495円
同期中追加設定元本額	10,939,192,612円
同期中一部解約元本額	10,212,039,891円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	4,763,130,041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）	2,761,235,247円
ニッセイ日本バランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	1,623,893円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,986,861,282円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	7,559,511,324円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	7,015,707,211円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）SA（適格機関投資家限定）	1,635,226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）	5,293,759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）	7,772,950円
DCニッセイ国内株式インデックス	6,123,220,477円
ニッセイTOPIXインデックスファンド＜購入・換金手数料なし＞	25,747,122,053円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）＜購入・換金手数料なし＞	5,863,336,969円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	524,113,082円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	263,311,486円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	618,812,392円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	694,342,291円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	19,262,362円
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＞	125,085,423円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	17,038,121円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	16,927,565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）	5,280,342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)	11,569,342円
ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型) <購入・換金手数料なし>	29,712,262円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	442,705,043円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	322,297,217円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	546,565,519円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	186,674,302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)	22,552,481,777円
ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット) <購入・換金手数料なし>	30,998,607円
FWニッセイ国内株インデックス	80,527,120円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	262,630,677円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	79,812,728円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	29,253,144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)	4,117,037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)	5,124,945円
計	88,705,093,216円
2. 受益権の総数	88,705,093,216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8月21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8月21日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	5,241,090,000	-	5,704,475,000	463,385,000
合計	5,241,090,000	-	5,704,475,000	463,385,000

(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8月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.7827円 (37,827円)

## ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2025年8月21日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	11,601,324
コール・ローン	573,892,427
国債証券	91,514,003,120
未収利息	271,725,367
前払費用	49,728,757
流動資産合計	92,420,950,995
資産合計	92,420,950,995
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	168,718,103
流動負債合計	168,718,103
負債合計	168,718,103
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	75,832,521,229
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	16,419,711,663
元本等合計	92,252,232,892
純資産合計	92,252,232,892
負債純資産合計	92,420,950,995

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年2月22日 至 2025年8月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年8月21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	69,756,276,829円
同期中追加設定元本額	14,149,949,627円
同期中一部解約元本額	8,073,705,227円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券インデックスS A（適格機関投資家限定）	1,721,963,202円
DCニッセイ国内債券インデックス	8,347,359,659円
ニッセイ日本バランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	2,588,744円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	13,111,988,360円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	22,176,094,521円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	7,718,603,472円
ニッセイインデックスバランス（債券重視型）S A（適格機関投資家限定）	13,187,766円
ニッセイインデックスバランス（標準型）S A（適格機関投資家限定）	18,117,120円
ニッセイインデックスバランス（成長型）S A（適格機関投資家限定）	12,349,657円
ニッセイ国内債券インデックスファンド<購入・換金手数料なし>	5,497,390,413円
ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）<購入・換金手数料なし>	17,206,838,355円
ニッセイインデックスバランス（外国株式重視型）S A（適格機関投資家限定）	6,039,960円
計	75,832,521,229円
2. 受益権の総数	75,832,521,229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8月21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8月21日現在
1口当たり純資産額	1,2165円
（1万口当たり純資産額）	（12,165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8月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,601,032,525
金銭信託	343,010,372
コール・ローン	16,967,981,131
株式	1,239,587,911,077
投資証券	20,754,524,698
派生商品評価勘定	1,630,109,091
未収入金	6,056,446
未収配当金	1,201,135,264
差入委託証拠金	14,179,043,649
流動資産合計	1,300,270,804,253
資産合計	
1,300,270,804,253	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	104,191,314
未払解約金	1,525,687,867
流動負債合計	1,629,879,181
負債合計	
1,629,879,181	
純資産の部	
元本等	
元本	245,935,370,448
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,052,705,554,624
元本等合計	1,298,640,925,072
純資産合計	1,298,640,925,072
負債純資産合計	1,300,270,804,253

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年2月22日 至 2025年8月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2025年8月21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	238,543,985,695円
同期中追加設定元本額	20,787,312,893円
同期中一部解約元本額	13,395,928,140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）	690,870,373円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,505,169,822円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,659,812,012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）	2,399,893,370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）	568,547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）	2,454,539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）	4,093,181円
ニッセイ外国株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	489,884,432円

ニッセイ外国株式インデックスファンド<購入・換金手数料なし>	162,831,638,404円
DCニッセイ外国株式インデックス	46,970,444,046円
ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)<購入・換金手数料なし>	4,078,878,590円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	510,598,752円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	183,105,555円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	604,050,620円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	624,035,169円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	5,665,341円
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>	87,014,866円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	11,873,885円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	11,799,390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)	3,681,031円
ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)<購入・換金手数料なし>	20,710,097円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	433,468,755円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	312,700,575円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	524,505,099円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	128,358,362円
ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット)<購入・換金手数料なし>	297,088,170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)	110,382,437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)	109,969,655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)	98,224,859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)	31,875,976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)	15,705,914,455円
FWニッセイ先進国株インデックス	104,136,259円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	257,834,261円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	962,396,014円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	28,742,556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)	67,970,370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)	3,818,528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)	61,742,095円
計	245,935,370,448円
2. 受益権の総数	245,935,370,448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8月21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）は短時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8月21日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	13,198,965,220	-	13,143,952,250	55,012,970
イギリス・ポンド	9,070,209,465	-	9,028,540,460	41,669,005
ユーロ	2,619,389,943	-	2,611,025,790	8,364,153
ユーロ	1,509,365,812	-	1,504,386,000	4,979,812
合計	13,198,965,220	-	13,143,952,250	55,012,970

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## 株式関連

種類	2025年8月21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	36,148,327,479	-	37,729,258,227	1,580,930,748
合計	36,148,327,479	-	37,729,258,227	1,580,930,748

## （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8月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.2804円 (52,804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8月21日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	636,041,954
金銭信託	4,520,446
コール・ローン	223,616,708
国債証券	101,630,995,577
派生商品評価勘定	23,631
未収入金	19,399,435
未収利息	629,362,029
前払費用	60,357,124
流動資産合計	103,204,316,904
資産合計	103,204,316,904
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	3,214,038
未払解約金	186,895,936
流動負債合計	190,109,974
負債合計	190,109,974
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	56,923,368,477
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	46,090,838,453
元本等合計	103,014,206,930
純資産合計	103,014,206,930
負債純資産合計	103,204,316,904

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2025年2月22日 至 2025年8月21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8月21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	53,426,797,421円
同期中追加設定元本額	8,445,293,660円
同期中一部解約元本額	4,948,722,604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)	3,958,901,506円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,532,302,465円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,495,475,901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)	1,040,407,965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)	1,628,927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)	3,516,319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)	4,197,114円
ニッセイ外国債券インデックスファンド<購入・換金手数料なし>	16,369,110,191円
ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)<購入・換金手数料なし>	11,687,783,034円
DCニッセイ外国債券インデックス	6,078,289,193円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	508,896,503円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	2,623,270,730円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	614,573,084円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	737,898,327円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	35,410,984円
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>	249,344,565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)	26,090,984円
ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)<購入・換金手数料なし>	58,722,933円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	428,802,026円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	314,883,730円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	544,706,712円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	252,063,167円
FWニッセイ外国債インデックス	72,249,667円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	253,806,462円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	28,300,723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)	2,735,265円
計	56,923,368,477円
2. 受益権の総数	56,923,368,477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8月21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8月21日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	33,546,986	-	-	33,570,617	23,631
合計	33,546,986	-	-	33,570,617	23,631

## （注）為替予約取引

## 時価の算定方法

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

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

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

## （1口当たり情報に関する注記）

	2025年8月21日現在
1口当たり純資産額	1.8097円
（1万口当たり純資産額）	（18,097円）

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

2025年8月29日現在

資産総額	36,177,438,609円
負債総額	32,928,765円
純資産総額（ - ）	36,144,509,844円
発行済数量	15,292,864,972口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3635円

## DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

2025年8月29日現在

資産総額	92,636,727,881円
負債総額	62,124,785円
純資産総額（ - ）	92,574,603,096円
発行済数量	27,467,154,929口
1口当たり純資産額（ / ）	3.3704円

## DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

2025年8月29日現在

資産総額	65,089,362,451円
負債総額	78,087,346円
純資産総額（ - ）	65,011,275,105円
発行済数量	13,960,308,287口
1口当たり純資産額（ / ）	4.6569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8月29日現在

資産総額	336,302,019,682円
負債総額	876,040,131円
純資産総額（ - ）	335,425,979,551円
発行済数量	88,878,041,605口
1口当たり純資産額（ / ）	3.7740円

## ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

2025年8月29日現在

資産総額	109,750,802,526円
負債総額	17,120,801,339円
純資産総額（ - ）	92,630,001,187円
発行済数量	76,029,427,168口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2183円

## ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2025年8月29日現在

資産総額	1,314,903,336,072円
負債総額	1,569,481,177円
純資産総額( - )	1,313,333,854,895円
発行済数量	246,250,781,347口
1口当たり純資産額( / )	5.3333円

## ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2025年8月29日現在

資産総額	103,880,123,110円
負債総額	471,190,367円
純資産総額( - )	103,408,932,743円
発行済数量	57,093,727,151口
1口当たり純資産額( / )	1.8112円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

### （2）受益者に対する特典

ありません。

### （3）譲渡制限

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

### （4）受益権の譲渡

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

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

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

### （5）受益権の再分割

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

### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

2025年8月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間における資本金の増減はありません。

##### (2) 委託会社等の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

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

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2025年8月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	404	77,559
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	128	19,183
単位型公社債投資信託	0	0
合計	532	96,742

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### 1.財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### 2.監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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

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

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									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備 金	利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備 金	資本剰余 金合計		その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	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									株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					利益剰余金 合計	
		資本準備 金	資本剰余 金合計	利益準備 金	その他利益剰余金					
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	60,488,508	61,168,315	79,450,155
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-	-	46,146	46,146	46,146
遡及処理後当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	60,534,655	61,214,462	79,496,302
当期変動額										
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	満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。 その他有価証券 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。 関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法(ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法)によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。 無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
4．引当金の計上基準	賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。 退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 年俸制非適用者は、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。

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

## （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す。

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

## 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

## 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

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
其他有価証券	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 其他有価証券	3,473,100	20,992,267	-	24,465,367
デリバティブ取引（ ） 為替予約	-	10,936	-	10,936
合計	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 其他有価証券	-	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)
現金・預金	23,594,998	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券				
国債・地方債等	4,950,000	23,050,000	-	-
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)
現金・預金	22,854,185	-	-	-
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	-	-	-
	国債・地方債等	3,473,100	3,459,180	13,920
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	6,089,659	5,473,000	616,659
	小計	9,562,759	8,932,180	630,579
貸借対照表計上 額が取得原価ま たは償却原価を 超えないもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他（注1）	14,902,608	16,307,000	1,404,391
	小計	14,902,608	16,307,000	1,404,391
	合計	24,465,367	25,239,180	773,812

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

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	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	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	-	-	-
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	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 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 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		当事業年度	
	（自	2023年4月1日	（自	2024年4月1日
	至	2024年3月31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		当事業年度	
	（自	2023年4月1日	（自	2024年4月1日
	至	2024年3月31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。

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

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	
光世証券株式会社	12,000	
株式会社スマートプラス <sup>1</sup>	100	
大山日ノ丸証券株式会社 <sup>5</sup>	215	
楽天証券株式会社	19,495	
東海東京証券株式会社	6,000	
moomoo証券株式会社	5,869	
SMB C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	
PayPay証券株式会社 <sup>2</sup>	100	

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。
株式会社北海道銀行 <sup>6</sup>	93,524	
株式会社千葉銀行	145,069	
株式会社八十二銀行	52,243	
スルガ銀行株式会社 <sup>3</sup>	30,043	
日本生命保険相互会社	1,450,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。
ニッセイアセットマネジメント株式会社 <sup>4</sup>	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 標準型、株式重視型のみを取扱いとなります。
- 3 債券重視型、株式重視型のみを取扱いとなります。
- 4 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）。
- 5 債券重視型、標準型のみを取扱いとなります。
- 6 標準型のみを取扱いとなります。

### （3）投資助言会社（参考情報）

#### a. 名称

株式会社ニッセイ基礎研究所

#### b. 資本金の額

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「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」の運用に関する投資助言を行います。

### 3【資本関係】

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。

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

### 第3【その他】

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

投資信託説明書(請求目論見書)は、販売会社にご請求いただければ、当該販売会社を通じて交付いたします。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、届出書本文「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 目論見書の巻末に用語集を掲載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

# 独立監査人の監査報告書

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. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

2025年5月19日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の2024年2月22日から2025年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の2025年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2025年5月19日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の2024年2月22日から2025年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の2025年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の監査報告書

2025年5月19日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の2024年2月22日から2025年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の2025年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2025年11月19日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の2025年2月22日から2025年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の2025年8月21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（2025年2月22日から2025年8月21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な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. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2025年11月19日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の2025年2月22日から2025年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の2025年8月21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（2025年2月22日から2025年8月21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. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2025年11月19日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の2025年2月22日から2025年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の2025年8月21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（2025年2月22日から2025年8月21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. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。