

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2026年5月20日提出
【計算期間】	第3期（自 2025年2月21日 至 2026年2月20日）
【ファンド名】	DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト
【発行者名】	ニッセイアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 大関 洋
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【事務連絡者氏名】	茶木 健
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目6番6号
【電話番号】	03 - 5533 - 4608
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

基本方針

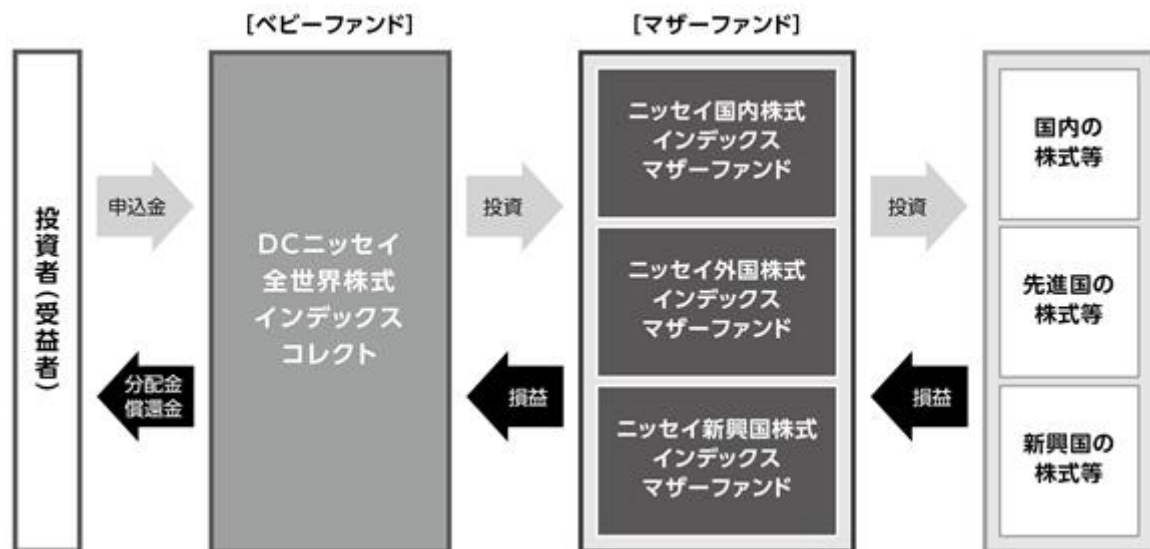
ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行うことを基本方針とします。

運用の形態

ファンドは「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

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

<イメージ図>



ファンドの特色

1 全世界の株式に分散投資を行います。

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

【投資対象とするマザーファンド】

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

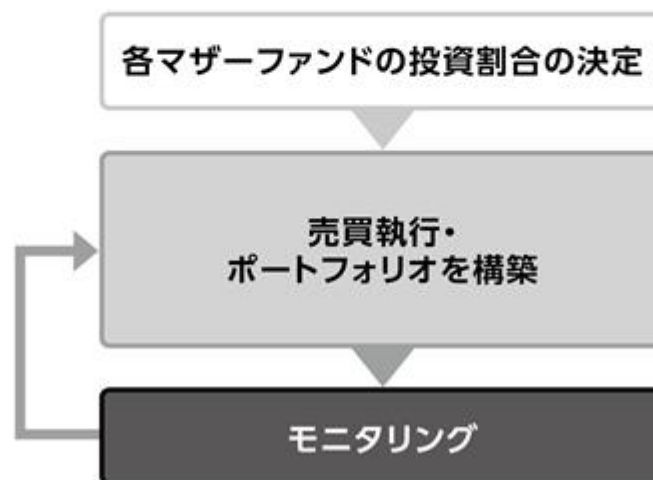
※投資対象には、DR(預託証券)もしくは株式等と同等の投資効果が得られる証券および証書等を含みます。DR(預託証券)とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し海外で発行される証券をいい、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。

- 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジ*を行いません。

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

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

<当ファンドの運用プロセス>



<各指数について>

●TOPIX(東証株価指数)

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

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

●MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

●MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

●MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス

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

<MSCI指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

信託金の上限

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せん。

ファンドの分類

追加型投信 / 内外 / 株式に属します。

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

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

属性区分表

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

商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
株式	目論見書または約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 （投資信託証券 （株式（一般）））	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券（マザーファンド）とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 目論見書または約款において、主として株式に投資する旨の記載があるものをいう。
年1回	目論見書または約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本含む）	目論見書または約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または約款において、マザーファンド（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

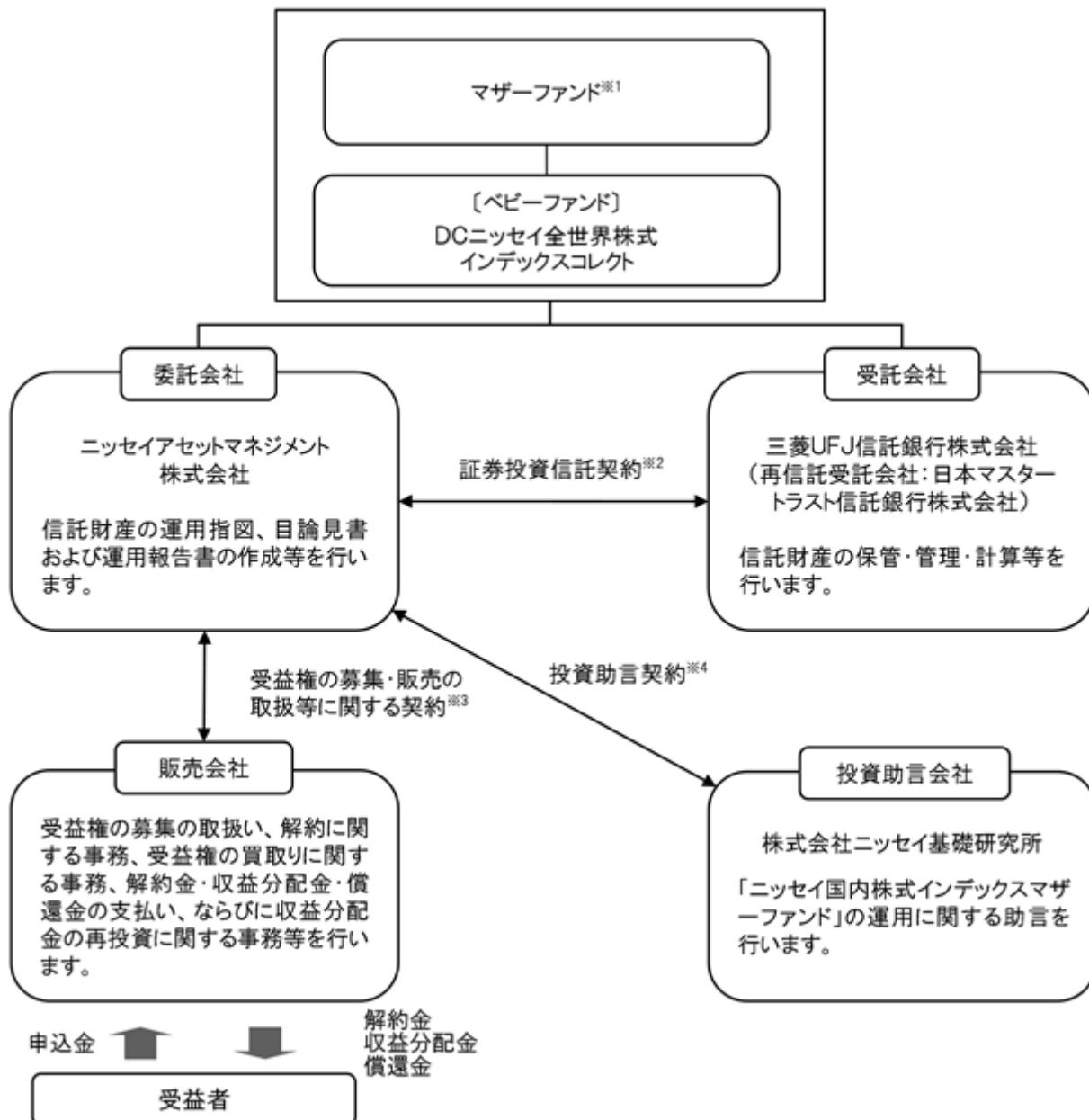
前記以外の商品分類および属性区分の定義については、

一般社団法人 資産運用業協会ホームページ（<https://www.imaj.or.jp/>）をご参照ください。

（2）【ファンドの沿革】

2023年9月15日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



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

委託会社の概況（2026年2月末現在）

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

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

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

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

各マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（参考）マザーファンドの概要

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

（１）基本方針

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

（２）運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所 上場株式を主要投資対象とします。

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

b 投資態度

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

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

株式以外の資産の組入比率は50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

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

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

b 約款に定める投資対象

投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

ニ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます)

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

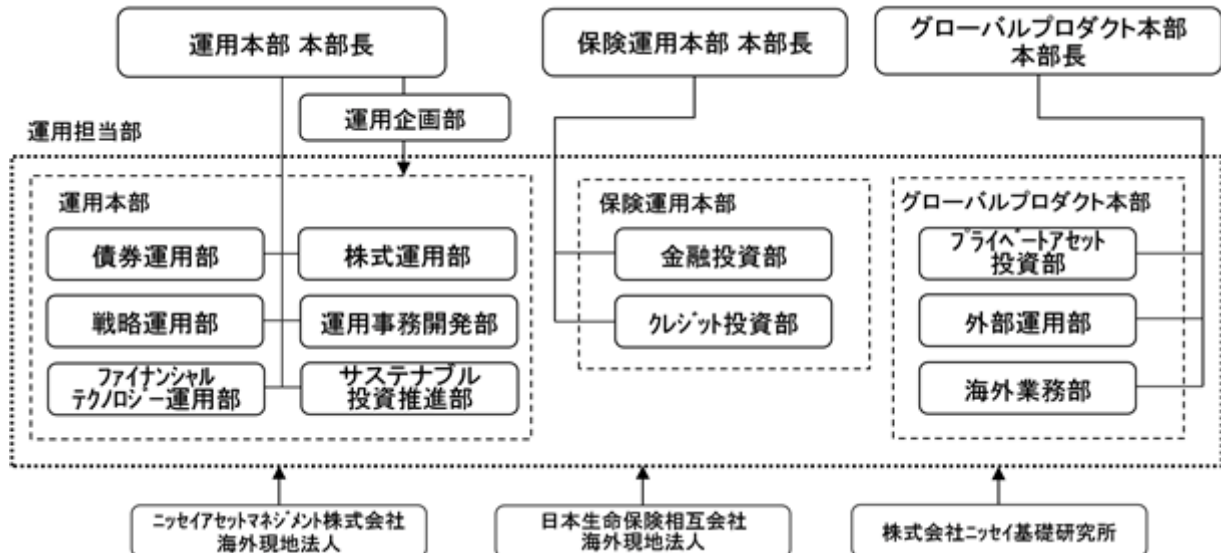
信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下 において同じ）により運用することができます。

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 に掲げる金融商品により運用することができます。

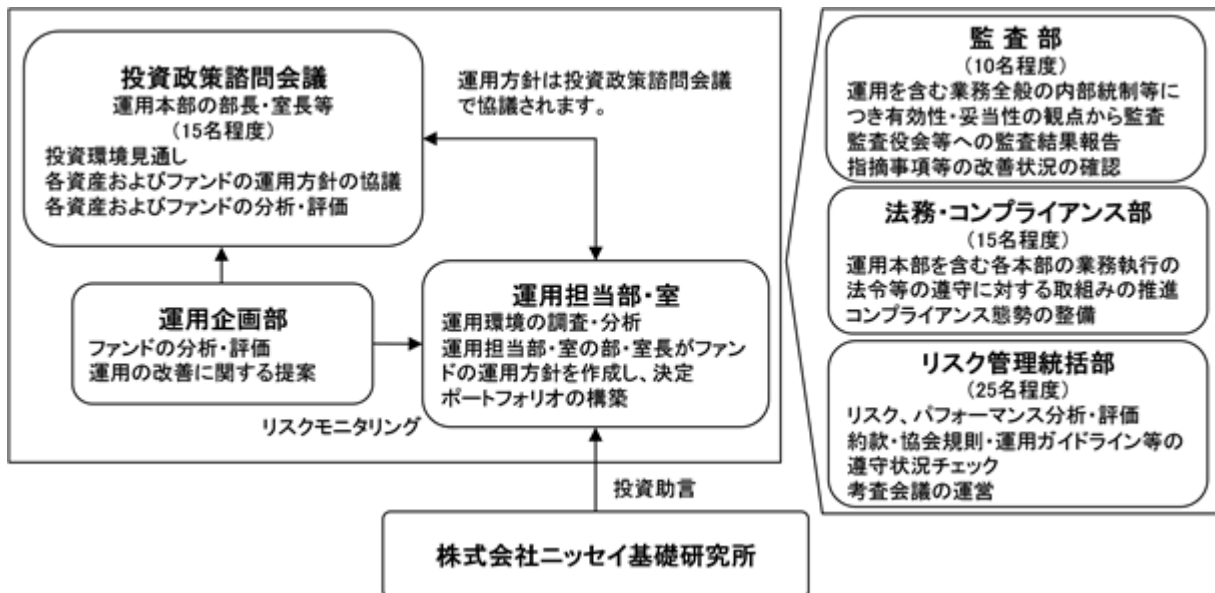
（3）【運用体制】

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・マネージャー/アナリスト服務規程を定めています。また、各投資対象の適切な利用、リスク管理の推進を目的として、各投資対象の取扱いに関して規程を設けています。

内部管理体制および意思決定を監督する組織



< 受託会社に対する管理体制等 >

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

上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

2. 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

3. 留保益の運用方針

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

分配時期

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

支払方法

< 分配金受取コースの場合 >

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

< 分配金再投資コースの場合 >

税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

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

将来の分配金の支払いおよびその金額について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業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。

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

b 約款に定めるその他の投資制限

投資する株式等の範囲

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

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

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

信用取引の範囲

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

先物取引等

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

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

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

4.前記1.の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

外国為替予約等

1.外国為替の売買の予約取引を行うことができます。

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

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

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

資金の借入れ

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

c 法令に定める投資制限

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

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

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

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

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

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

3【投資リスク】

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

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

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

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・為替変動リスク

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

・カントリーリスク

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

・流動性リスク

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

・新興国の株式投資に関する留意点

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

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

・ストックコネクトを通じた取引に関する留意点

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

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

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

・短期金融資産の運用に関する留意点

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

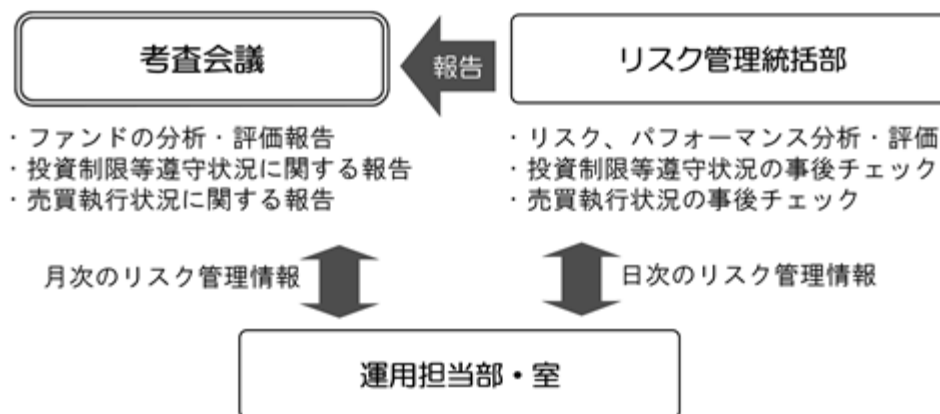
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・流動性に関する留意点

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

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

(2) 投資リスク管理体制



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

上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

< 流動性リスクに関する管理体制 >

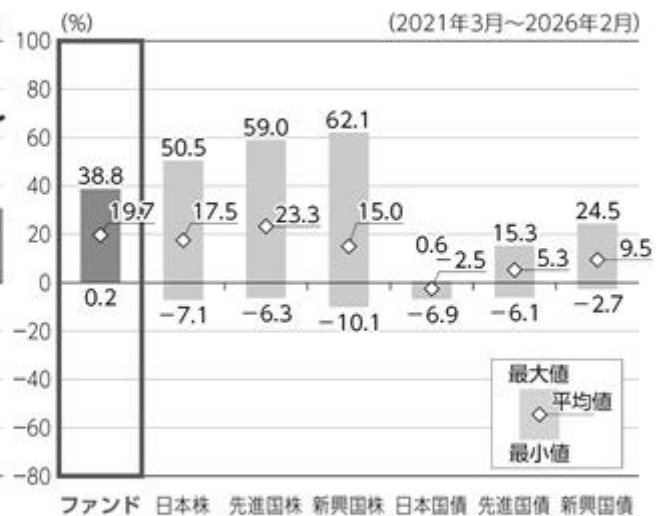
委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行っています。そして取締役会等においては、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢などを監督しています。

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

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



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

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

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

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

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

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

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0.077%（税抜0.07%）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
0.025%	0.025%	0.020%

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

(4)【その他の手数料等】

証券取引の手数料等

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

監査費用

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

信託事務の諸費用

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

借入金の利息

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

信託財産留保額

ありません。

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

<ご参考>

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

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

（５）【課税上の取扱い】

確定拠出年金としてファンドを取得した場合

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

確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合

課税対象

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

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

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

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

申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額も含まれます。

個人の課税の取扱い

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

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

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

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

税率（個人）

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

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

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

< 少額投資非課税制度について >

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

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

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

詳しくは、販売会社にお問合せください。

法人の課税の取扱い（分配時・解約請求・償還時）

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

以下の税率により源泉徴収 されます。

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

個別元本

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

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

投資者によっては非課税扱いとなる場合があります。

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

(参考情報) ファンドの総経費率

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
0.12%	0.10%	0.02%

- ・対象期間:2025年2月21日～2026年2月20日
- ・対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。
- ・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】

2026年2月27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	12,099,645,205	100.00
内 日本	12,099,645,205	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,845	0.00
純資産総額	12,099,629,360	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

2026年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	432,104,521,840	97.86
内 日本	432,104,521,840	97.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,450,614,881	2.14
純資産総額	441,555,136,721	100.00

その他資産の投資状況

2026年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	9,925,795,000	2.25
内 日本	9,925,795,000	2.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2026年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	1,463,708,653,049	95.33
内 アメリカ	1,070,288,261,566	69.71
内 イギリス	60,836,026,913	3.96
内 カナダ	57,154,044,203	3.72
内 スイス	43,474,349,976	2.83
内 フランス	39,016,860,108	2.54
内 ドイツ	38,038,797,392	2.48
内 オランダ	26,609,112,185	1.73
内 オーストラリア	26,198,164,814	1.71
内 アイルランド	17,466,064,297	1.14
内 スペイン	15,862,267,443	1.03
内 スウェーデン	13,977,814,453	0.91
内 イタリア	12,078,380,450	0.79
内 香港	6,948,878,974	0.45
内 デンマーク	6,444,506,732	0.42
内 シンガポール	5,830,203,119	0.38
内 フィンランド	4,741,203,456	0.31
内 ベルギー	4,542,382,115	0.30
内 イスラエル	3,595,586,541	0.23
内 ノルウェー	2,583,432,440	0.17
内 オランダ領キュラソー	1,426,645,008	0.09
内 ジャージー	1,321,126,625	0.09
内 オーストリア	1,087,608,642	0.07
内 バミューダ	1,048,868,571	0.07
内 ポルトガル	848,832,999	0.06
内 ケイマン諸島	809,887,524	0.05
内 ルクセンブルグ	760,012,943	0.05
内 ニュージーランド	719,333,560	0.05
投資証券	23,930,624,145	1.56
内 アメリカ	21,010,561,329	1.37
内 オーストラリア	1,323,885,972	0.09
内 フランス	595,504,211	0.04
内 イギリス	385,440,731	0.03
内 シンガポール	378,186,796	0.02
内 香港	237,045,106	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	47,716,792,582	3.11
純資産総額	1,535,356,069,776	100.00

その他資産の投資状況

2026年2月27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)	47,388,109,396	3.09
内 アメリカ	37,898,912,780	2.47
内 イギリス	5,236,061,366	0.34
内 ドイツ	4,253,135,250	0.28

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

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2026年2月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	26,152,351,632	85.40
内 台湾	6,148,000,344	20.08
内 韓国	5,053,360,433	16.50
内 インド	3,602,817,071	11.76
内 香港	2,615,871,522	8.54
内 中国	2,377,820,431	7.76
内 ケイマン諸島	1,191,110,152	3.89
内 ブラジル	1,094,771,210	3.57
内 南アフリカ	1,052,347,095	3.44
内 メキシコ	526,719,946	1.72
内 アメリカ	474,837,992	1.55
内 マレーシア	316,281,741	1.03
内 タイ	310,454,302	1.01
内 ポーランド	287,884,976	0.94
内 インドネシア	266,064,453	0.87
内 チリ	150,793,001	0.49
内 ギリシャ	143,160,359	0.47
内 トルコ	123,095,990	0.40
内 フィリピン	99,072,024	0.32
内 ハンガリー	88,529,268	0.29
内 バミューダ	80,155,712	0.26
内 スイス	50,316,552	0.16
内 コロンビア	40,570,992	0.13
内 チェコ	32,622,790	0.11
内 ペルー	14,310,103	0.05
内 オランダ	11,381,477	0.04
内 ロシア	1,650	0.00
内 カザフスタン	29	0.00
内 イギリス	13	0.00
内 イギリス領バージン諸島	4	0.00
投資信託受益証券	1,423,140,236	4.65
内 アメリカ	1,423,140,236	4.65
投資証券	11,742,840	0.04
内 メキシコ	11,742,840	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,036,916,914	9.92
純資産総額	30,624,151,622	100.00

その他資産の投資状況

2026年2月27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）	3,018,849,132	9.86
内 アメリカ	3,018,849,132	9.86

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2) 【投資資産】
【投資有価証券の主要銘柄】

2026年2月27日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は額 面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,628,426,588	6.0680 9,881,293,339	6.1469 10,009,775,393	- -	82.73
2	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	622,909,234	2.2585 1,406,864,062	2.3443 1,460,286,117	- -	12.07
3	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	128,817,714	4.7255 608,729,157	4.8874 629,583,695	- -	5.20

(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

2026年2月27日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2026年2月27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	4,121,200	3,635.00 14,980,562,000	3,825.00 15,763,590,000	- -	3.57
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	4,816,800	2,942.00 14,171,025,600	2,968.50 14,298,670,800	- -	3.24
3	日立製作所 日本	株式 電気機器	1,992,300	4,930.00 9,822,039,000	5,226.00 10,411,759,800	- -	2.36
4	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,677,400	5,963.00 10,002,336,200	5,997.00 10,059,367,800	- -	2.28
5	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	2,674,300	3,336.00 8,921,464,800	3,643.00 9,742,474,900	- -	2.21
6	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,635,200	4,991.00 8,161,283,200	5,290.00 8,650,208,000	- -	1.96
7	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,082,700	7,175.00 7,768,372,500	7,151.00 7,742,387,700	- -	1.75
8	三菱重工業 日本	株式 機械	1,467,100	4,965.00 7,284,151,500	5,014.00 7,356,039,400	- -	1.67

9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	164,100	43,960.00 7,213,836,000	44,010.00 7,222,041,000	- -	1.64
10	三井物産 日本	株式 卸売業	1,179,400	5,505.00 6,492,597,000	5,872.00 6,925,436,800	- -	1.57
11	アドバンテスト 日本	株式 電気機器	244,300	25,475.00 6,223,542,500	26,850.00 6,559,455,000	- -	1.49
12	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	2,756,800	2,192.50 6,044,284,000	2,270.00 6,257,936,000	- -	1.42
13	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	1,490,300	4,329.00 6,451,508,700	4,089.00 6,093,836,700	- -	1.38
14	三菱電機 日本	株式 電気機器	857,700	5,850.00 5,017,545,000	5,991.00 5,138,480,700	- -	1.16
15	キーエンス 日本	株式 電気機器	77,600	61,430.00 4,766,968,000	66,060.00 5,126,256,000	- -	1.16
16	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	785,000	6,475.00 5,082,875,000	6,527.00 5,123,695,000	- -	1.16
17	任天堂 日本	株式 その他製 品	489,500	8,587.00 4,203,336,500	8,995.00 4,403,052,500	- -	1.00
18	信越化学工業 日本	株式 化学	690,600	5,750.00 3,970,950,000	6,168.00 4,259,620,800	- -	0.96
19	HOYA 日本	株式 精密機器	149,200	27,545.00 4,109,714,000	28,265.00 4,217,138,000	- -	0.96
20	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービ ス業	589,400	6,284.00 3,703,789,600	6,866.00 4,046,820,400	- -	0.92
21	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	691,900	5,790.00 4,006,101,000	5,819.00 4,026,166,100	- -	0.91
22	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	55,400	66,960.00 3,709,584,000	69,030.00 3,824,262,000	- -	0.87
23	丸紅 日本	株式 卸売業	625,900	5,710.00 3,573,889,000	6,008.00 3,760,407,200	- -	0.85
24	住友商事 日本	株式 卸売業	491,700	6,382.00 3,138,029,400	6,663.00 3,276,197,100	- -	0.74
25	NTT 日本	株式 情報・通 信業	21,348,800	151.00 3,223,668,800	153.30 3,272,771,040	- -	0.74
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	739,800	3,675.00 2,718,765,000	4,108.00 3,039,098,400	- -	0.69
27	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	1,092,700	2,616.00 2,858,503,200	2,671.00 2,918,601,700	- -	0.66
28	住友電気工業 日本	株式 非鉄金属	276,200	9,748.00 2,692,397,600	10,375.00 2,865,575,000	- -	0.65
29	ディスコ 日本	株式 機械	37,700	74,060.00 2,792,062,000	75,500.00 2,846,350,000	- -	0.64
30	小松製作所 日本	株式 機械	377,600	7,541.00 2,847,481,600	7,533.00 2,844,460,800	- -	0.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2026年2月27日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	17.74
		銀行業	10.60
		卸売業	8.34
		機械	6.62
		輸送用機器	6.60
		情報・通信業	5.61
		化学	4.56
		小売業	4.02
		医薬品	3.66
		保険業	3.11
		サービス業	2.88
		食料品	2.66
		建設業	2.59
		非鉄金属	2.43
		不動産業	2.10
		その他製品	2.08
		陸運業	1.99
		精密機器	1.83
		電気・ガス業	1.37
		その他金融業	1.19
		証券、商品先物取引業	0.95
		ガラス・土石製品	0.75
		鉄鋼	0.72
		ゴム製品	0.61
		石油・石炭製品	0.54
		海運業	0.51
	金属製品	0.42	
鉱業	0.38		
繊維製品	0.35		
空運業	0.29		
パルプ・紙	0.14		
倉庫・運輸関連業	0.13		
水産・農林業	0.08		
	小計		97.86
合 計（対純資産総額比）			97.86

（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

2026年2月27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	2,892,321	29,058.30 84,045,950,187	28,807.71 83,321,147,197	- -	5.43
2	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	1,766,391	41,847.96 73,919,874,066	42,528.33 75,121,676,137	- -	4.89

3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	840,504	75,878.51 63,776,193,403	62,591.99 52,608,820,652	- -	3.43
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	1,142,458	34,705.19 39,649,228,872	32,396.01 37,011,086,733	- -	2.41
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	692,442	45,659.99 31,616,895,897	47,892.87 33,163,040,089	- -	2.16
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	581,611	45,666.46 26,560,116,525	47,857.04 27,834,181,763	- -	1.81
7	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	533,979	55,271.71 29,513,933,986	50,124.07 26,765,204,512	- -	1.74
8	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	258,263	92,009.38 23,762,619,726	102,368.72 26,438,054,825	- -	1.72
9	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部 品	336,411	62,945.68 21,175,619,793	63,660.84 21,416,210,142	- -	1.39
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	327,282	47,252.49 15,464,892,279	47,698.11 15,610,734,571	- -	1.02
11	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	95,754	163,564.43 15,661,948,626	159,240.93 15,247,956,604	- -	0.99
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	164,075	78,128.22 12,818,887,768	78,321.01 12,850,520,158	- -	0.84
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネル ギー	507,417	18,284.30 9,277,766,429	23,144.01 11,743,667,877	- -	0.76
14	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	286,665	31,558.84 9,046,815,672	37,935.06 10,874,654,175	- -	0.71

15	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	46,198	162,974.81 7,529,110,364	226,539.76 10,465,684,202	- -	0.68
16	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	521,902	15,680.65 8,183,765,730	19,385.88 10,117,529,648	- -	0.66
17	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サー ビス	202,193	50,503.05 10,211,363,523	49,345.02 9,977,219,044	- -	0.65
18	MICRON TECHNOLOGY INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	133,600	35,196.71 4,702,281,643	64,748.40 8,650,386,720	- -	0.56
19	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 金融サー ビス	101,463	82,641.41 8,385,045,964	80,206.31 8,137,973,206	- -	0.53
20	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	52,748	138,758.20 7,319,217,752	153,743.95 8,109,686,370	- -	0.53
21	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	210,273	36,284.62 7,629,677,980	35,008.94 7,361,436,712	- -	0.48
22	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用 品・パー ソナル用 品	278,600	22,902.50 6,380,637,415	25,513.88 7,108,169,057	- -	0.46
23	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	118,485	52,121.69 6,175,638,914	58,442.77 6,924,591,947	- -	0.45
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	837,494	8,105.23 6,788,086,686	8,148.86 6,824,623,869	- -	0.44
25	GENERAL ELECTRIC CO アメリカ	株式 資本財	126,211	46,866.56 5,915,075,900	53,106.28 6,702,596,755	- -	0.44
26	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディ ア・娯楽	505,767	17,135.31 8,666,477,214	13,179.96 6,665,992,824	- -	0.43
27	CHEVRON CORP アメリカ	株式 エネル ギー	229,465	23,636.37 5,423,721,248	28,693.96 6,584,261,734	- -	0.43

28	CATERPILLAR INC アメリカ	株式 資本財	55,758	86,185.80 4,805,548,385	117,314.02 6,541,195,311	- -	0.43
29	ADVANCED MICRO DEVICES INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	193,161	34,817.55 6,725,392,998	31,735.38 6,130,037,890	- -	0.40
30	ROCHE HOLDING AG スイス	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	83,639	62,494.30 5,226,961,081	73,250.85 6,126,628,344	- -	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

2026年2月27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	11.35
		資本財	8.46
		ソフトウェア・サービス	7.26
		メディア・娯楽	7.00
		銀行	6.89
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.86
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.69
		金融サービス	6.29
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.31
		エネルギー	3.96
		素材	3.65
		ヘルスケア機器・サービス	2.91
		公益事業	2.82
		保険	2.77
		食品・飲料・タバコ	2.69
		自動車・自動車部品	1.89
		生活必需品流通・小売り	1.77
		消費者サービス	1.59
		運輸	1.44
		電気通信サービス	1.27
		家庭用品・パーソナル用品	1.18
		商業・専門サービス	1.08
		耐久消費財・アパレル	0.92
不動産管理・開発	0.26		
エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.02		
	小計		95.33
投資証券	外国		1.56
	小計		1.56
合計（対純資産総額比）			96.89

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2026年2月27日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	372,000	6,964.09 2,590,644,356	9,950.66 3,701,645,892	- -	12.09
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	71,364	10,521.79 750,877,084	23,718.39 1,692,639,897	- -	5.53
3	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	8,255	61,091.31 504,308,798	119,571.20 987,060,256	- -	3.22
4	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 メディア ・娯楽	96,800	12,395.91 1,199,924,242	10,193.92 986,771,456	- -	3.22
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 香港	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	259,300	3,112.63 807,106,529	2,847.13 738,260,809	- -	2.41
6	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	119,349	5,986.23 714,450,773	5,785.22 690,460,854	- -	2.25
7	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	123,822	2,939.05 363,919,159	3,356.14 415,564,883	- -	1.36
8	HDFC BANK LTD インド	株式 銀行	173,491	1,721.52 298,669,776	1,554.57 269,705,291	- -	0.88
9	CHINA CONSTRUCTION BANK-H 中国	株式 銀行	1,480,000	161.94 239,673,266	159.28 235,734,400	- -	0.77
10	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	191,200	1,141.38 218,232,819	1,212.03 231,741,168	- -	0.76
11	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED インド	株式 エネル ギー	93,071	2,628.94 244,678,288	2,433.76 226,512,849	- -	0.74

12	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	23,000	5,789.17 133,151,016	9,701.27 223,129,233	- -	0.73
13	DELTA ELECTRONICS INC 台湾	株式 テクノ ロジー・ ハード ウェアお よび機器	30,000	4,465.49 133,964,970	7,132.55 213,976,620	- -	0.70
14	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 テクノ ロジー・ ハード ウェアお よび機器	12,505	7,942.40 99,319,712	16,178.55 202,312,892	- -	0.66
15	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	81,015	2,391.35 193,735,636	2,430.47 196,905,094	- -	0.64
16	XIAOMI CORP-CLASS B 香港	株式 テクノ ロジー・ ハード ウェアお よび機器	261,000	772.80 201,701,903	700.43 182,813,221	- -	0.60
17	PDD HOLDINGS INC(ADR) アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	10,741	18,362.42 197,230,799	16,420.81 176,375,983	- -	0.58
18	ISHARES MSCI QATAR CP ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	53,967	2,952.53 159,339,336	3,041.41 164,135,838	- -	0.54
19	ISHARES MSCI KUWAIT ETF アメリカ	投資信 託受益 証券 -	26,579	6,126.91 162,847,316	5,755.62 152,978,661	- -	0.50
20	VALE SA ブラジル	株式 素材	54,954	1,969.63 108,239,267	2,704.98 148,650,016	- -	0.49
21	ANGLOGOLD ASHANTI PLC 南アフリカ	株式 素材	7,556	14,008.07 105,845,048	18,934.06 143,065,792	- -	0.47
22	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	105,000	1,157.70 121,559,385	1,350.89 141,843,817	- -	0.46
23	BHARTI AIRTEL LTD インド	株式 電気通信 サービス	39,455	3,736.10 147,408,038	3,338.20 131,708,996	- -	0.43
24	HYUNDAI MOTOR CO 韓国	株式 自動車・ 自動車部 品	1,959	28,723.19 56,268,748	66,259.19 129,801,772	- -	0.42

25	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	964,000	128.41 123,796,398	127.82 123,220,600	- -	0.40
26	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	84,897	1,173.13 99,595,426	1,445.43 122,712,727	- -	0.40
27	MEITUAN-B 香港	株式 消費者 サービス	76,060	1,951.38 148,422,199	1,601.75 121,829,827	- -	0.40
28	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A アメリカ	株式 銀行	51,800	2,441.70 126,480,434	2,346.49 121,548,627	- -	0.40
29	GOLD FIELDS LTD 南アフリカ	株式 素材	13,614	7,022.67 95,606,711	8,704.77 118,506,832	- -	0.39
30	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD インド	株式 ソフト ウェア・ サービス	50,982	2,666.48 135,942,589	2,230.14 113,697,150	- -	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

2026年2月27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	17.42
		銀行	11.78
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	11.40
		素材	6.28
		資本財	4.92
		メディア・娯楽	4.64
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.20
		自動車・自動車部品	2.95
		エネルギー	2.86
		金融サービス	2.45
		保険	2.44
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.03
		公益事業	1.84
		食品・飲料・タバコ	1.79
		電気通信サービス	1.65
		消費者サービス	1.24
		運輸	1.23
		ソフトウェア・サービス	1.14
		耐久消費財・アパレル	0.78
		生活必需品流通・小売り	0.77
不動産管理・開発	0.63		
ヘルスケア機器・サービス	0.49		
家庭用品・パーソナル用品	0.38		
商業・専門サービス	0.06		
	小計		85.40
投資信託受益証券	外国		4.65
	小計		4.65
投資証券	外国		0.04
	小計		0.04
合計（対純資産総額比）			90.08

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2026年2月27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 803月	買建	251	9,579,788,150	9,925,795,000	2.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2026年2月27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 202603	買建	703	37,808,882,256	37,898,912,780	2.47
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE 202603	買建	230	4,842,652,828	5,236,061,366	0.34
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 202603	買建	375	4,056,952,435	4,253,135,250	0.28

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2026年2月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	N Y S E L I F F E U S	MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202603	買建	241	2,709,617,622	3,018,849,132	9.86

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2026年2月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2024年2月20日)	95,473,855	95,473,855	1.1326	1.1326
第2計算期間末 (2025年2月20日)	3,188,970,700	3,188,970,700	1.3652	1.3652
第3計算期間末 (2026年2月20日)	11,467,577,874	11,467,577,874	1.6793	1.6793
2025年2月末日	3,152,585,039	-	1.3062	-
3月末日	3,424,474,490	-	1.2664	-
4月末日	3,579,859,812	-	1.2141	-
5月末日	4,525,859,374	-	1.2998	-
6月末日	5,116,608,724	-	1.3609	-
7月末日	5,814,775,125	-	1.4343	-
8月末日	6,183,641,749	-	1.4465	-
9月末日	6,851,794,535	-	1.5048	-
10月末日	7,933,680,725	-	1.5976	-
11月末日	8,550,496,959	-	1.6177	-
12月末日	9,538,629,827	-	1.6501	-
2026年1月末日	10,950,720,402	-	1.6680	-
2月末日	12,099,629,360	-	1.7081	-

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.3
第2計算期間	20.5
第3計算期間	23.0

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

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済数量
第1計算期間	89,499,860	5,204,039	84,295,821
第2計算期間	2,636,085,774	384,435,384	2,335,946,211
第3計算期間	5,442,969,206	950,039,167	6,828,876,250

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

< 参考情報 >

3. 運用実績

2026年2月末現在

● 基準価額・純資産の推移



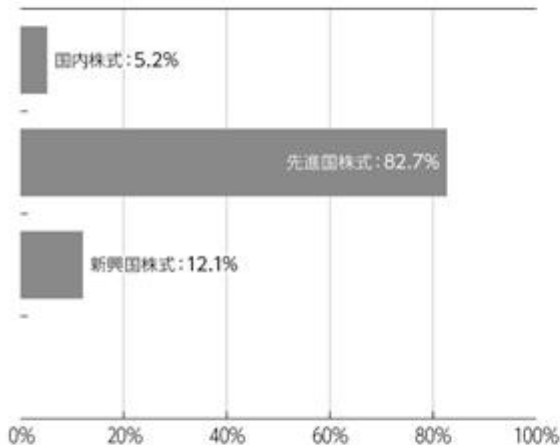
基準価額	17,081円
純資産総額	120億円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2024年2月	0円
2025年2月	0円
2026年2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

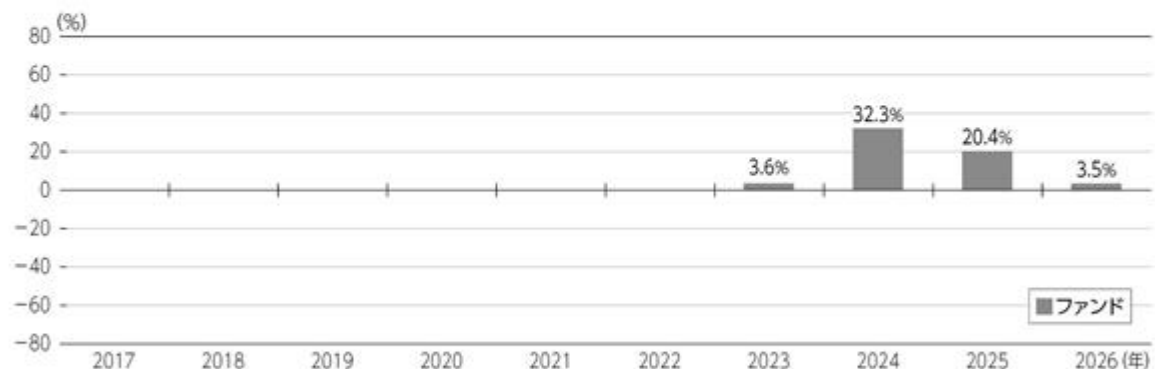
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもものとして計算しております。

● 資産別組入比率



- ・比率は対組入マザーファンド評価額比です。

● 年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したもものとして計算しております。
- ・2023年はファンド設定時から年末まで、2026年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

3.運用実績

2026年2月末現在

●マザーファンドの状況

1. ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.6%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3.3%
3	日立製作所	2.4%
4	三井住友フィナンシャルグループ	2.3%
5	ソニーグループ	2.3%

・比率は対組入株式評価額比です。

2. ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	エヌビディア	情報技術	5.6%
2	アップル	情報技術	5.0%
3	マイクロソフト	情報技術	3.5%
4	アマゾン・ドット・コム	一般消費財・サービス	2.5%
5	アルファベット(A)	コミュニケーション・サービス	2.2%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

3. ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

組入上位銘柄

	銘柄	業種	比率
1	台湾セミコンダクター(TSMC)	情報技術	13.4%
2	サムスン電子	情報技術	6.1%
3	SKハイニックス	情報技術	3.6%
4	騰訊控股[テンセント・ホールディングス]	コミュニケーション・サービス	3.6%
5	アリババ・グループ・ホールディング	一般消費財・サービス	2.7%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

組入上位業種

	業種	比率
1	電気機器	18.1%
2	銀行業	10.8%
3	卸売業	8.5%
4	機械	6.8%
5	輸送用機器	6.7%

・比率は対組入株式評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	アメリカ	74.8%
2	イギリス	4.2%
3	カナダ	3.8%
4	フランス	2.9%
5	スイス	2.6%

・国・地域はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

・比率は対組入株式等評価額比です。

組入上位国・地域

	国・地域	比率
1	中国	23.5%
2	台湾	22.3%
3	韓国	18.3%
4	インド	13.1%
5	その他	5.2%

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

・比率は対組入株式等評価額比です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込受付

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

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

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

取扱コース

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

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

申込単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込手数料

ありません。

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

2【換金（解約）手続等】

換金受付

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

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

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

換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

換金単位

各販売会社が定める単位とします。

販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

換金価額

< 解約請求の場合 >

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

< 買取請求の場合 >

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

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

換金手数料はありません。

信託財産留保額

ありません。

支払開始日

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

その他

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

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

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

基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。

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

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

（9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く）

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限です。

(4)【計算期間】

毎年2月21日から翌年2月20日までとします。

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

(5)【その他】

繰上償還

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

・受益権の口数が30億口または純資産総額が30億円を下回っている場合

・この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

反対者の買取請求の不適用

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

公告

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

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

運用報告書の作成

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

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 書面決議における議決権

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

(6) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

他の受益者の氏名または名称および住所

他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2025年2月21日から2026年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1 【財務諸表】

【DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2025年2月20日現在	第3期 2026年2月20日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	16,206	43,881
コール・ローン	1,027,235	3,602,197
親投資信託受益証券	3,188,969,917	11,467,592,417
未収入金	22,792,501	27,289,916
流動資産合計	3,212,805,859	11,498,528,411
資産合計		
	3,212,805,859	11,498,528,411
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,728,578	27,121,917
未払受託者報酬	230,526	939,937
未払委託者報酬	864,618	2,841,785
その他未払費用	11,437	46,898
流動負債合計	23,835,159	30,950,537
負債合計		
	23,835,159	30,950,537
純資産の部		
元本等		
元本	2,335,946,211	6,828,876,250
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	853,024,489	4,638,701,624
（分配準備積立金）	181,541,904	1,652,353,759
元本等合計	3,188,970,700	11,467,577,874
純資産合計		
	3,188,970,700	11,467,577,874
負債純資産合計		
	3,212,805,859	11,498,528,411

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期 自 2024年2月21日 至 2025年2月20日	第3期 自 2025年2月21日 至 2026年2月20日
営業収益		
受取利息	495	6,630
有価証券売買等損益	203,832,301	1,622,688,458
営業収益合計	203,832,796	1,622,695,088
営業費用		
受託者報酬	281,881	1,412,075
委託者報酬	1,057,381	4,612,431
その他費用	20,468	70,412
営業費用合計	1,359,730	6,094,918
営業利益又は営業損失（ ）	202,473,066	1,616,600,170
経常利益又は経常損失（ ）	202,473,066	1,616,600,170
当期純利益又は当期純損失（ ）	202,473,066	1,616,600,170
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（ ）	22,107,694	109,717,797
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,178,034	853,024,489
剰余金増加額又は欠損金減少額	752,945,503	2,631,475,856
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	752,945,503	2,631,475,856
剰余金減少額又は欠損金増加額	91,464,420	352,681,094
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	91,464,420	352,681,094
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（ ）	853,024,489	4,638,701,624

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期	
	自 2025年2月21日	至 2026年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	2025年2月20日現在	2026年2月20日現在
1. 期首元本額	84,295,821円	2,335,946,211円
期中追加設定元本額	2,636,085,774円	5,442,969,206円
期中一部解約元本額	384,435,384円	950,039,167円
2. 受益権の総数	2,335,946,211口	6,828,876,250口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2024年2月21日 至 2025年2月20日	自 2025年2月21日 至 2026年2月20日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(485円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(180,364,887円)、収益調整金(671,482,585円)及び分配準備積立金(1,176,532円)より分配対象収益は853,024,489円(1万口当たり3,651.73円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,381円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,506,875,992円)、収益調整金(2,986,347,865円)及び分配準備積立金(145,471,386円)より分配対象収益は4,638,701,624円(1万口当たり6,792.77円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第2期	第3期
	自 2024年2月21日 至 2025年2月20日	自 2025年2月21日 至 2026年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期
	2025年2月20日現在	2026年2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	2025年2月20日現在	2026年2月20日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	181,654,025	1,506,780,549
合計	181,654,025	1,506,780,549

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第2期	第3期
	2025年2月20日現在	2026年2月20日現在
1口当たり純資産額	1.3652円	1.6793円
(1万口当たり純資産額)	(13,652円)	(16,793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

2026年2月20日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	124,393,824	587,686,182	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	1,569,334,222	9,522,092,325	
	ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	601,601,201	1,357,813,910	
親投資信託受益証券 合計		2,295,329,247	11,467,592,417	
合計			11,467,592,417	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2026年2月20日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	93,212,531
コール・ローン	7,651,908,434
株式	417,871,231,660
派生商品評価勘定	544,543,850
未収配当金	510,051,171
差入委託証拠金	483,158,084
流動資産合計	427,154,105,730
資産合計	427,154,105,730
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,498,750
前受金	647,815,000
未払解約金	445,059,931
流動負債合計	1,094,373,681
負債合計	1,094,373,681
純資産の部	
元本等	
元本	90,182,149,526
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	335,877,582,523
元本等合計	426,059,732,049
純資産合計	426,059,732,049
負債純資産合計	427,154,105,730

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21日 至 2026年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2026年2月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	87,962,939,470円
同期中追加設定元本額	22,715,096,808円
同期中一部解約元本額	20,495,886,752円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	4,643,807,461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）	2,788,170,048円
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	1,742,498,789円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	6,881,779,056円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	6,717,226,738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）	1,356,900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）	6,772,319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）	5,166,170円
DCニッセイ国内株式インデックス	8,356,796,281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>	26,051,429,802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>	5,903,404,324円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	539,883,891円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	228,875,749円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	632,916,453円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	616,385,364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>	115,690,286円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	18,768,521円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	16,857,428円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート/債券）	4,903,249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）	10,379,810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>	28,605,093円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	461,397,960円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	348,779,100円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	568,709,872円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	150,648,362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)	22,715,107,336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>	31,909,396円
FWニッセイ国内株インデックス	82,463,041円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	317,328,167円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	124,393,824円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	47,779,834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)	8,865,697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)	12,878,911円
ニッセイ国内株式インデックス(特金専用)(適格機関投資家限定)	214,294円
計	90,182,149,526円
2. 受益権の総数	90,182,149,526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 2025年2月21日 至 2026年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2026年2月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	114,629,971,681
合計	114,629,971,681

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2026年2月20日現在			評価損益(円)
	契約額等(円)	うち		
		1年超	時価(円)	
市場取引 先物取引 買建	7,750,645,000	-	8,293,810,000	543,165,000
合計	7,750,645,000	-	8,293,810,000	543,165,000

(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)

2026年2月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.7244円 (47,244円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2026年2月20日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	4,600	5,240.00	24,104,000	
ニッセイ	99,600	1,471.50	146,561,400	
マルハニチロ	52,800	1,492.00	78,777,600	
ユキグニファクトリー	9,300	1,095.00	10,183,500	
カネコ種苗	2,800	1,512.00	4,233,600	
サカタのタネ	13,200	4,245.00	56,034,000	
ホクト	9,700	1,981.00	19,215,700	
ショーボンドホールディングス	63,500	1,406.00	89,281,000	
ミライト・ワン	37,100	3,888.00	144,244,800	
タマホーム	6,800	3,895.00	26,486,000	
robot home	56,700	201.00	11,396,700	
住石ホールディングス	9,800	870.00	8,526,000	
日鉄鉱業	20,900	3,665.00	76,598,500	
三井松島ホールディングス	13,300	1,487.00	19,777,100	
I N P E X	365,000	3,677.00	1,342,105,000	
石油資源開発	67,100	2,357.00	158,154,700	
K & O エナジーグループ	4,900	5,170.00	25,333,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	15,700	3,230.00	50,711,000	
第一カッター興業	6,800	1,584.00	10,771,200	
安藤・間	57,700	2,112.00	121,862,400	
東急建設	34,000	1,554.00	52,836,000	
コムシスホールディングス	38,600	5,528.00	213,380,800	
ビーアールホールディングス	26,600	528.00	14,044,800	
高松コンストラクショングループ	8,100	3,935.00	31,873,500	
東建コーポレーション	2,300	14,850.00	34,155,000	
ヤマウラ	6,400	1,616.00	10,342,400	
オリエンタル白石	40,200	420.00	16,884,000	
大成建設	56,800	18,795.00	1,067,556,000	
大林組	245,900	4,153.00	1,021,222,700	
清水建設	207,800	3,452.00	717,325,600	
長谷工コーポレーション	67,800	3,273.00	221,909,400	
松井建設	6,200	1,848.00	11,457,600	
鹿島建設	168,600	7,085.00	1,194,531,000	
不動テトラ	4,300	3,790.00	16,297,000	
鉄建建設	4,800	4,710.00	22,608,000	
西松建設	12,100	6,612.00	80,005,200	
奥村組	12,300	7,050.00	86,715,000	
東鉄工業	8,400	5,120.00	43,008,000	
浅沼組	30,400	1,135.00	34,504,000	

戸田建設	93,500	1,528.50	142,914,750
熊谷組	45,200	1,980.00	89,496,000
矢作建設工業	14,200	2,472.00	35,102,400
ピーエス・コンストラクション	6,900	3,365.00	23,218,500
日本ハウスホールディングス	29,100	323.00	9,399,300
大東建託	129,900	3,470.00	450,753,000
新日本建設	10,700	2,060.00	22,042,000
東亜道路工業	11,700	1,872.00	21,902,400
東亜建設工業	28,100	4,070.00	114,367,000
日本国土開発	23,300	671.00	15,634,300
若築建設	2,300	4,830.00	11,109,000
五洋建設	107,800	2,042.50	220,181,500
世紀東急工業	11,900	1,681.00	20,003,900
福田組	2,600	7,360.00	19,136,000
住友林業	197,300	1,766.50	348,530,450
大和ハウス工業	210,400	5,515.00	1,160,356,000
ライト工業	14,500	4,080.00	59,160,000
積水ハウス	230,700	3,753.00	865,817,100
日特建設	7,300	1,392.00	10,161,600
ユアテック	16,000	3,095.00	49,520,000
日本リーテック	5,900	3,095.00	18,260,500
四電工	9,500	2,011.00	19,104,500
中電工	10,100	4,920.00	49,692,000
関電工	41,700	6,688.00	278,889,600
きんでん	52,200	8,084.00	421,984,800
東京エネシス	7,100	1,921.00	13,639,100
トーエネック	14,700	2,241.00	32,942,700
日本電設工業	14,300	4,960.00	70,928,000
エクシオグループ	72,600	2,876.50	208,833,900
新日本空調	9,900	3,890.00	38,511,000
クラフティア	16,400	9,865.00	161,786,000
三機工業	15,600	7,520.00	117,312,000
日揮ホールディングス	82,800	2,386.00	197,560,800
中外炉工業	2,100	4,970.00	10,437,000
太平電業	15,100	2,727.00	41,177,700
高砂熱学工業	40,700	4,994.00	203,255,800
朝日工業社	7,900	4,575.00	36,142,500
明星工業	12,800	1,940.00	24,832,000
大気社	19,500	3,770.00	73,515,000
ダイダン	44,000	3,305.00	145,420,000
日比谷総合設備	5,500	6,370.00	35,035,000
ニッポン	27,000	2,820.00	76,140,000
日清製粉グループ本社	75,800	2,127.50	161,264,500
日東富士製粉	1,400	7,160.00	10,024,000
昭和産業	6,500	3,385.00	22,002,500
中部飼料	9,700	1,933.00	18,750,100
フィード・ワン	10,000	1,256.00	12,560,000
日本甜菜製糖	3,300	4,315.00	14,239,500
D M三井製糖	6,400	3,460.00	22,144,000
ウェルネオシュガー	4,300	3,005.00	12,921,500

MIXI	14,500	2,615.00	37,917,500
ジェイエシーリクルートメント	28,800	876.00	25,228,800
日本M&Aセンターホールディングス	127,000	695.60	88,341,200
メンバーズ	6,700	1,160.00	7,772,000
UTグループ	156,300	202.00	31,572,600
E・Jホールディングス	5,900	1,853.00	10,932,700
オープンアップグループ	24,000	1,849.00	44,376,000
コシダカホールディングス	21,900	1,160.00	25,404,000
パソナグループ	8,200	1,995.00	16,359,000
リンクアンドモチベーション	19,000	516.00	9,804,000
エス・エム・エス	30,500	1,703.00	51,941,500
パーソルホールディングス	726,600	240.50	174,747,300
森永製菓	30,000	2,807.50	84,225,000
中村屋	3,000	3,235.00	9,705,000
江崎グリコ	21,800	5,868.00	127,922,400
井村屋グループ	4,200	2,508.00	10,533,600
不二家	5,200	2,460.00	12,792,000
山崎製パン	51,100	3,384.00	172,922,400
モロゾフ	7,400	1,500.00	11,100,000
亀田製菓	4,900	4,295.00	21,045,500
寿スピリッツ	40,600	1,978.00	80,306,800
カルビー	34,900	3,028.00	105,677,200
森永乳業	28,400	4,628.00	131,435,200
六甲バター	8,000	1,196.00	9,568,000
ヤクルト本社	105,900	2,583.00	273,539,700
明治ホールディングス	106,400	3,858.00	410,491,200
雪印メグミルク	20,500	3,475.00	71,237,500
プリマハム	10,300	2,829.00	29,138,700
日本ハム	28,700	6,906.00	198,202,200
丸大食品	7,700	2,364.00	18,202,800
S Foods	8,400	3,180.00	26,712,000
柿安本店	3,400	2,884.00	9,805,600
伊藤ハム米久ホールディングス	13,300	6,210.00	82,593,000
学情	5,300	1,853.00	9,820,900
スタジオアリス	4,700	2,000.00	9,400,000
クロスキャット	9,100	999.00	9,090,900
システナ	111,100	432.00	47,995,200
NJS	1,900	4,575.00	8,692,500
デジタルアーツ	4,100	5,520.00	22,632,000
日鉄ソリューションズ	21,200	3,660.00	77,592,000
ALSOX	133,100	1,183.00	157,457,300
キューブシステム	8,700	1,093.00	9,509,100
いちご	64,600	427.00	27,584,200
日本駐車場開発	90,900	281.00	25,542,900
コア	4,500	2,207.00	9,931,500
カカクコム	51,700	1,673.50	86,519,950
セントケア・ホールディング	2,300	1,210.00	2,783,000
ディップ	13,900	2,015.00	28,008,500
SBSホールディングス	6,900	4,155.00	28,669,500
デジタルホールディングス	4,100	2,006.00	8,224,600

新日本科学	8,400	1,708.00	14,347,200	
エムスリー	157,500	1,598.00	251,685,000	
ワールドホールディングス	3,700	2,808.00	10,389,600	
ディー・エヌ・エー	31,900	2,664.50	84,997,550	
博報堂DYホールディングス	101,600	1,125.00	114,300,000	
ぐるなび	58,600	150.00	8,790,000	
ファンコミュニケーションズ	19,400	470.00	9,118,000	
ライク	6,100	1,573.00	9,595,300	
エスプール	36,800	255.00	9,384,000	
WDBホールディングス	5,900	1,569.00	9,257,100	
アドウェイズ	35,700	282.00	10,067,400	
バリューコマース	14,300	439.00	6,277,700	
インフォマート	75,200	369.00	27,748,800	
サッポロホールディングス	114,200	1,734.50	198,079,900	
アサヒグループホールディングス	573,200	1,708.50	979,312,200	
麒麟ホールディングス	318,000	2,638.50	839,043,000	
シマダヤ	2,300	1,923.00	4,422,900	
宝ホールディングス	62,900	1,547.50	97,337,750	
オエノンホールディングス	22,800	464.00	10,579,200	
養命酒製造	2,500	4,480.00	11,200,000	
飛島ホールディングス	7,800	2,511.00	19,585,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	49,700	4,073.00	202,428,100	
ライフドリンク カンパニー	13,700	1,301.00	17,823,700	
サントリー食品インターナショナル	53,700	4,866.00	261,304,200	
ダイドーグループホールディングス	8,600	2,535.00	21,801,000	
伊藤園	24,700	2,992.00	73,902,400	
キーコーヒー	8,600	1,988.00	17,096,800	
日清オイリオグループ	10,800	5,910.00	63,828,000	
不二製油	15,200	3,919.00	59,568,800	
J・オイルミルズ	8,700	2,039.00	17,739,300	
インターメスティック	5,300	1,909.00	10,117,700	
サンエー	13,900	3,095.00	43,020,500	
カワチ薬品	6,400	3,130.00	20,032,000	
エービーシー・マート	43,100	2,559.00	110,292,900	
高千穂交易	6,500	2,098.00	13,637,000	
アスクル	15,600	1,307.00	20,389,200	
ゲオホールディングス	9,200	1,729.00	15,906,800	
アンドエスティHD	11,300	2,963.00	33,481,900	
リガク・ホールディングス	46,800	1,783.00	83,444,400	
伊藤忠食品	1,800	11,920.00	21,456,000	
くら寿司	9,600	3,620.00	34,752,000	
キャンドウ	2,900	3,520.00	10,208,000	
パルグループホールディングス	32,200	1,671.00	53,806,200	
エディオン	39,000	2,225.00	86,775,000	
あらた	12,500	3,005.00	37,562,500	
サーラコーポレーション	17,200	1,176.00	20,227,200	
トーマンデバイス	1,200	13,450.00	16,140,000	
ハローズ	3,700	4,740.00	17,538,000	
J Pホールディングス	20,400	748.00	15,259,200	

フジオフードグループ本社	13,400	1,058.00	14,177,200
あみやき亭	6,700	1,427.00	9,560,900
東京エレクトロン デバイス	8,200	3,655.00	29,971,000
円谷フィールズホールディングス	15,200	1,526.00	23,195,200
双日	79,100	6,766.00	535,190,600
アルフレッサ ホールディングス	77,600	2,532.50	196,522,000
大黒天物産	2,900	5,550.00	16,095,000
ハニーズホールディングス	7,300	1,516.00	11,066,800
キッコーマン	252,900	1,483.00	375,050,700
味の素	379,000	4,602.00	1,744,158,000
ブルドックソース	5,000	1,906.00	9,530,000
キューピー	41,000	4,462.00	182,942,000
ハウス食品グループ本社	28,600	3,055.00	87,373,000
カゴメ	39,600	2,815.50	111,493,800
アリアケジャパン	8,600	6,000.00	51,600,000
エバラ食品工業	3,600	2,701.00	9,723,600
キオクシアホールディングス	47,400	20,560.00	974,544,000
ニチレイ	67,100	2,079.00	139,500,900
横浜冷凍	20,600	1,418.00	29,210,800
東洋水産	35,400	12,000.00	424,800,000
イトアンドホールディングス	4,600	2,080.00	9,568,000
日清食品ホールディングス	86,300	3,229.00	278,662,700
フジッコ	8,700	1,623.00	14,120,100
ロック・フィールド	8,500	1,408.00	11,968,000
日本たばこ産業	463,900	5,893.00	2,733,762,700
ケンコーマヨネーズ	4,800	2,245.00	10,776,000
わらべや日洋ホールディングス	5,100	3,450.00	17,595,000
なとり	5,000	1,934.00	9,670,000
ファーマフーズ	13,900	630.00	8,757,000
北の達人コーポレーション	65,100	137.00	8,918,700
ユーグレナ	51,500	385.00	19,827,500
紀文食品	8,600	1,085.00	9,331,000
スター・マイカ・ホールディングス	8,100	1,596.00	12,927,600
S R Eホールディングス	3,800	2,789.00	10,598,200
片倉工業	8,200	3,095.00	25,379,000
ゲンゼ	12,000	4,635.00	55,620,000
ヒューリック	222,600	2,038.50	453,770,100
アルペン	7,900	2,205.00	17,419,500
ラクーンホールディングス	14,500	646.00	9,367,000
クオールホールディングス	10,200	1,896.00	19,339,200
アルコニックス	12,600	3,070.00	38,682,000
神戸物産	71,400	3,736.00	266,750,400
ジンズホールディングス	5,600	5,230.00	29,288,000
ビックカメラ	43,600	1,780.50	77,629,800
D C Mホールディングス	42,500	1,701.00	72,292,500
MonotaRO	116,300	2,075.00	241,322,500
あい ホールディングス	16,400	2,813.00	46,133,200
J . フロント リテイリング	94,100	2,609.00	245,506,900
ドトール・日レスホールディングス	14,500	2,975.00	43,137,500
マツキヨココカラ&カンパニー	142,700	2,595.00	370,306,500

ブロンコビリー	4,800	3,940.00	18,912,000
Z O Z O	129,300	1,080.50	139,708,650
トレジャー・ファクトリー	5,600	1,796.00	10,057,600
物語コーポレーション	15,900	5,010.00	79,659,000
三越伊勢丹ホールディングス	127,800	2,984.50	381,419,100
東洋紡	33,600	1,595.00	53,592,000
ユニチカ	26,800	1,236.00	33,124,800
富士紡ホールディングス	3,600	10,410.00	37,476,000
日清紡ホールディングス	58,900	1,711.50	100,807,350
倉敷紡績	5,400	9,760.00	52,704,000
ダイワボウホールディングス	30,800	3,027.00	93,231,600
シキボウ	8,700	1,112.00	9,674,400
日東紡績	9,800	21,200.00	207,760,000
トヨタ紡織	38,100	3,224.00	122,834,400
マクニカホールディングス	57,100	2,629.00	150,115,900
H a m e e	19,600	469.00	9,192,400
ラクト・ジャパン	3,500	3,665.00	12,827,500
クリエイトSDホールディングス	11,600	3,300.00	38,280,000
グリムス	3,900	2,661.00	10,377,900
パイタルケーエスケー・ホールディングス	11,300	1,398.00	15,797,400
八洲電機	6,200	3,395.00	21,049,000
レスター	7,000	3,090.00	21,630,000
T O K A Iホールディングス	44,500	1,205.00	53,622,500
三洋貿易	10,100	1,845.00	18,634,500
シュッピン	8,700	1,331.00	11,579,700
ビューティガレージ	6,600	1,457.00	9,616,200
オイシックス・ラ・大地	12,100	1,385.00	16,758,500
ウイン・パートナーズ	7,000	1,433.00	10,031,000
ネクステージ	18,800	3,660.00	68,808,000
ジョイフル本田	24,000	2,165.00	51,960,000
エターナルホスピタリティグループ	3,400	3,690.00	12,546,000
ホットランドホールディングス	6,300	1,901.00	11,976,300
すかいらーくホールディングス	112,100	3,605.00	404,120,500
S F Pホールディングス	4,600	2,300.00	10,580,000
綿半ホールディングス	6,600	1,476.00	9,741,600
日本毛織	19,400	2,008.00	38,955,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	40,400	968.00	39,107,200
野村不動産ホールディングス	212,900	1,118.00	238,022,200
三重交通グループホールディングス	18,700	586.00	10,958,200
ディア・ライフ	13,000	1,100.00	14,300,000
地主	6,300	3,365.00	21,199,500
J P M C	7,300	1,352.00	9,869,600
フージャースホールディングス	13,300	1,294.00	17,210,200
オープンハウスグループ	23,700	11,640.00	275,868,000
東急不動産ホールディングス	208,700	1,554.00	324,319,800
飯田グループホールディングス	65,000	2,714.50	176,442,500
帝国繊維	8,000	2,936.00	23,488,000
日本コークス工業	76,900	124.00	9,535,600

あさひ	7,300	1,289.00	9,409,700
コスモス薬品	13,900	7,107.00	98,787,300
シップヘルスケアホールディングス	30,100	2,659.00	80,035,900
ソフトクリエイティブホールディングス	6,400	2,034.00	13,017,600
セブン&アイ・ホールディングス	906,100	2,191.00	1,985,265,100
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	123,400	766.00	94,524,400
明治電機工業	4,100	2,450.00	10,045,000
ツルハホールディングス	128,200	2,656.00	340,499,200
サンマルクホールディングス	7,300	3,020.00	22,046,000
トリドールホールディングス	23,100	4,248.00	98,128,800
帝人	68,900	1,642.50	113,168,250
東レ	523,400	1,279.00	669,428,600
クラレ	98,200	1,792.50	176,023,500
旭化成	514,700	1,740.00	895,578,000
稲葉製作所	5,200	1,665.00	8,658,000
宮地エンジニアリンググループ	10,400	1,880.00	19,552,000
トーカロ	23,100	2,991.00	69,092,100
SUMCO	152,300	1,614.00	245,812,200
川田テクノロジーズ	6,100	5,270.00	32,147,000
RS Technologies	5,400	3,780.00	20,412,000
ケイアイスター不動産	3,200	8,140.00	26,048,000
グッドコムアセット	8,000	1,416.00	11,328,000
ジェイ・エス・ビー	3,200	3,400.00	10,880,000
ロードスターキャピタル	4,400	3,560.00	15,664,000
霞ヶ関キャピタル	7,600	7,350.00	55,860,000
JMホールディングス	11,800	1,686.00	19,894,800
コメダホールディングス	20,100	2,905.00	58,390,500
アレンザホールディングス	8,500	1,461.00	12,418,500
串カツ田中ホールディングス	5,200	2,019.00	10,498,800
バロックジャパンリミテッド	11,900	808.00	9,615,200
クスリのアオキホールディングス	19,400	4,021.00	78,007,400
力の源ホールディングス	6,600	1,520.00	10,032,000
FOOD & LIFE COMPANIES	47,100	9,314.00	438,689,400
セーレン	16,900	3,590.00	60,671,000
小松マテーレ	2,300	884.00	2,033,200
ワコールホールディングス	15,200	4,497.00	68,354,400
ホギメディカル	8,500	6,690.00	56,865,000
TSIホールディングス	23,600	1,123.00	26,502,800
ワールド	12,800	3,300.00	42,240,000
TIS	82,200	3,109.00	255,559,800
グリーンホールディングス	26,100	385.00	10,048,500
コーエーテクモホールディングス	48,700	1,691.50	82,376,050
三菱総合研究所	3,700	4,995.00	18,481,500
ブレインパッド	3,200	2,691.00	8,611,200
ポルトゥウィンホールディングス	28,600	309.00	8,837,400
ネクソン	191,800	3,216.00	616,828,800
アイスタイル	29,700	459.00	13,632,300
エムアップホールディングス	19,000	676.00	12,844,000

エイチームホールディングス	7,600	1,009.00	7,668,400
セルシス	10,500	1,284.00	13,482,000
コロプラ	26,400	425.00	11,220,000
ブロードリーフ	28,400	680.00	19,312,000
デジタルハーツホールディングス	10,100	833.00	8,413,300
メディアドゥ	5,700	1,639.00	9,342,300
じげん	22,300	427.00	9,522,100
フィックスターズ	10,700	1,440.00	15,408,000
北里コーポレーション	6,200	1,453.00	9,008,600
オブティム	18,700	458.00	8,564,600
セレス	5,100	1,594.00	8,129,400
S H I F T	69,800	657.10	45,865,580
特種東海製紙	13,600	1,668.00	22,684,800
テクマトリックス	15,500	1,889.00	29,279,500
プロシップ	6,300	1,428.00	8,996,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	18,000	2,483.00	44,694,000
GMOペイメントゲートウェイ	15,500	7,444.00	115,382,000
システムリサーチ	5,800	1,798.00	10,428,400
インターネットイニシアティブ	42,500	2,238.00	95,115,000
さくらインターネット	10,900	2,887.00	31,468,300
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,200	2,058.00	8,643,600
S R Aホールディングス	4,400	4,975.00	21,890,000
朝日ネット	13,300	677.00	9,004,100
e B A S E	20,700	414.00	8,569,800
アバントグループ	8,700	1,384.00	12,040,800
アドソル日進	6,200	1,811.00	11,228,200
フリービット	5,700	1,548.00	8,823,600
コムチュア	10,300	1,447.00	14,904,100
アイル	4,400	2,336.00	10,278,400
王子ホールディングス	294,100	971.60	285,747,560
日本製紙	43,800	1,246.00	54,574,800
北越コーポレーション	43,600	913.00	39,806,800
大王製紙	39,200	1,119.00	43,864,800
マークライNZ	6,100	1,542.00	9,406,200
g u m i	26,400	329.00	8,685,600
テラスカイ	4,200	1,892.00	7,946,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,100	1,012.00	8,197,200
P R T I M E S	3,600	2,379.00	8,564,400
ラクス	73,200	766.10	56,078,520
ダブルスタンダード	5,600	1,442.00	8,075,200
オーブンドア	28,500	358.00	10,203,000
アカツキ	3,800	3,055.00	11,609,000
レンゴー	78,500	1,526.50	119,830,250
トーモク	4,500	3,625.00	16,312,500
ザ・バック	15,600	1,292.00	20,155,200
チェンジホールディングス	15,000	939.00	14,085,000
オークネット	7,000	2,223.00	15,561,000

オロ	4,400	1,955.00	8,602,000
ユーザーローカル	4,900	1,591.00	7,795,900
PKSHA Technology	9,300	2,758.00	25,649,400
マネーフォワード	17,700	3,052.00	54,020,400
レゾナック・ホールディングス	75,000	11,220.00	841,500,000
住友化学	624,800	568.00	354,886,400
住友精化	3,200	6,870.00	21,984,000
日産化学	39,400	6,597.00	259,921,800
ラサ工業	2,500	9,850.00	24,625,000
クレハ	11,600	4,765.00	55,274,000
多木化学	3,000	3,830.00	11,490,000
テイカ	6,300	1,704.00	10,735,200
石原産業	12,900	3,950.00	50,955,000
日本曹達	16,500	4,115.00	67,897,500
東ソー	113,100	2,640.00	298,584,000
トクヤマ	27,200	4,169.00	113,396,800
セントラル硝子	9,800	4,215.00	41,307,000
東亜合成	31,300	1,831.50	57,325,950
大阪ソーダ	27,100	2,385.00	64,633,500
関東電化工業	15,000	1,658.00	24,870,000
デンカ	30,800	3,264.00	100,531,200
イビデン	98,000	9,157.00	897,386,000
信越化学工業	690,600	5,750.00	3,970,950,000
日本カーバイド工業	3,800	3,000.00	11,400,000
プラスアルファ・コンサルティング	9,800	2,038.00	19,972,400
電算システムホールディングス	3,400	3,050.00	10,370,000
堺化学工業	6,400	3,735.00	23,904,000
第一稀元素化学工業	7,800	2,500.00	19,500,000
エア・ウォーター	73,300	2,101.50	154,039,950
日本酸素ホールディングス	87,900	5,818.00	511,402,200
日本化学工業	3,100	3,405.00	10,555,500
日本パーカライジング	38,400	1,561.00	59,942,400
高圧ガス工業	11,300	1,110.00	12,543,000
四国化成ホールディングス	8,800	5,160.00	45,408,000
オリオンビール	12,500	1,334.00	16,675,000
ステラ ケミファ	4,100	5,290.00	21,689,000
保土谷化学工業	4,900	2,315.00	11,343,500
日本触媒	47,800	2,451.50	117,181,700
大日精化工業	5,300	4,885.00	25,890,500
カネカ	19,100	5,102.00	97,448,200
協和キリン	91,400	2,778.50	253,954,900
ブルーゾーンホールディングス	9,700	9,450.00	91,665,000
APPIER GROUP	29,700	700.00	20,790,000
三菱瓦斯化学	55,200	4,405.00	243,156,000
三井化学	139,700	2,313.50	323,195,950
東京応化工業	37,100	9,237.00	342,692,700
大阪有機化学工業	6,500	4,525.00	29,412,500
三菱ケミカルグループ	543,300	1,117.50	607,137,750
KHネオケム	12,900	2,987.00	38,532,300
ビジョナル	9,300	6,878.00	63,965,400

ダイセル	85,100	1,629.00	138,627,900
住友ベークライト	27,200	5,787.00	157,406,400
積水化学工業	162,200	2,985.00	484,167,000
日本ゼオン	56,200	2,032.00	114,198,400
アイカ工業	19,600	3,833.00	75,126,800
UBE	40,000	2,802.00	112,080,000
積水樹脂	9,200	2,258.00	20,773,600
旭有機材	5,200	4,995.00	25,974,000
ニチバン	4,800	1,946.00	9,340,800
リケンテクノス	13,400	1,731.00	23,195,400
大倉工業	4,000	4,985.00	19,940,000
積水化成成品工業	22,200	497.00	11,033,400
ダイキョーニシカワ	16,500	910.00	15,015,000
森六	4,200	2,527.00	10,613,400
恵和	7,000	1,323.00	9,261,000
日本化薬	55,700	1,925.00	107,222,500
カーリット	6,700	2,669.00	17,882,300
プレステージ・インターナショナル	29,500	670.00	19,765,000
ハイマックス	7,200	1,268.00	9,129,600
テクセンドフォトマスク	21,600	2,946.00	63,633,600
野村総合研究所	151,700	3,833.00	581,466,100
クイック	19,700	856.00	16,863,200
日本システム技術	7,200	2,000.00	14,400,000
電通グループ	77,100	2,831.00	218,270,100
インテージホールディングス	5,900	1,650.00	9,735,000
ぴあ	3,600	2,864.00	10,310,400
イオンファンタジー	3,400	2,781.00	9,455,400
ソースネクスト	67,000	131.00	8,777,000
シーティーエス	9,700	977.00	9,476,900
メディカルシステムネットワーク	18,300	515.00	9,424,500
日本精化	4,800	2,698.00	12,950,400
扶桑化学工業	8,200	9,200.00	75,440,000
トリケミカル研究所	9,400	3,470.00	32,618,000
シンプレクス・ホールディングス	61,600	834.00	51,374,400
ラクスル	15,500	1,899.00	29,434,500
メルカリ	33,500	3,585.00	120,097,500
システムサポートホールディングス	6,600	1,211.00	7,992,600
ADEKA	30,100	4,542.00	136,714,200
日油	89,100	2,970.00	264,627,000
ハリマ化成グループ	10,200	1,018.00	10,383,600
ボードルア	4,500	1,712.00	7,704,000
NE	13,200	656.00	8,659,200
ウイングアーク1st	8,100	2,697.00	21,845,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	9,700	942.00	9,137,400
Sansan	25,700	1,105.00	28,398,500
花王	184,100	6,524.00	1,201,068,400
第一工業製薬	3,100	11,310.00	35,061,000
石原ケミカル	4,000	2,771.00	11,084,000
三洋化成工業	4,800	5,880.00	28,224,000

メドレー	9,500	2,045.00	19,427,500
ベース	3,300	3,210.00	10,593,000
J M D C	11,400	3,960.00	45,144,000
武田薬品工業	691,900	5,790.00	4,006,101,000
アステラス製薬	682,000	2,476.50	1,688,973,000
住友ファーマ	69,200	2,475.50	171,304,600
塩野義製薬	283,700	3,645.00	1,034,086,500
日本新薬	20,400	5,015.00	102,306,000
中外製薬	243,400	9,930.00	2,416,962,000
科研製薬	11,500	4,270.00	49,105,000
エーザイ	101,500	5,114.00	519,071,000
理研ビタミン	6,700	3,000.00	20,100,000
ロート製薬	82,200	2,377.00	195,389,400
小野薬品工業	173,500	2,617.50	454,136,250
久光製薬	17,400	6,031.00	104,939,400
持田製薬	9,500	3,780.00	35,910,000
参天製薬	130,800	1,716.00	224,452,800
扶桑薬品工業	4,100	2,387.00	9,786,700
ツムラ	26,700	4,051.00	108,161,700
テルモ	515,100	1,962.00	1,010,626,200
H . U . グループホールディングス	25,000	3,190.00	79,750,000
キッセイ薬品工業	12,100	4,750.00	57,475,000
生化学工業	4,600	723.00	3,325,800
栄研化学	11,000	3,050.00	33,550,000
J C R ファーマ	33,800	678.00	22,916,400
東和薬品	10,500	4,310.00	45,255,000
富士製薬工業	5,800	2,400.00	13,920,000
ゼリア新薬工業	10,400	2,208.00	22,963,200
ネクセラファーマ	34,100	897.00	30,587,700
第一三共	713,900	2,918.50	2,083,517,150
杏林製薬	15,600	1,687.00	26,317,200
ダイト	9,600	1,410.00	13,536,000
大塚ホールディングス	173,200	10,620.00	1,839,384,000
ペプチドリーム	37,700	1,358.50	51,215,450
大日本塗料	8,600	1,461.00	12,564,600
日本ペイントホールディングス	412,400	1,158.00	477,559,200
関西ペイント	61,900	2,728.50	168,894,150
中国塗料	15,900	4,595.00	73,060,500
藤倉化成	12,100	1,047.00	12,668,700
太陽ホールディングス	37,300	5,990.00	223,427,000
D I C	27,600	4,314.00	119,066,400
サカタインクス	17,300	2,701.00	46,727,300
a r t i e n c e	14,600	4,160.00	60,736,000
アルプス技研	6,600	2,618.00	17,278,800
日本空調サービス	8,600	1,554.00	13,364,400
オリエンタルランド	469,800	2,710.50	1,273,392,900
フォーカスシステムズ	5,200	1,673.00	8,699,600
ダスキン	18,100	4,227.00	76,508,700
パーク24	54,500	2,145.00	116,902,500
明光ネットワークジャパン	13,100	718.00	9,405,800

ファルコホールディングス	3,500	2,680.00	9,380,000
クレスコ	13,400	1,535.00	20,569,000
フジ・メディア・ホールディングス	61,100	3,374.00	206,151,400
ラウンドワン	75,400	988.30	74,517,820
リゾートトラスト	75,500	1,880.00	141,940,000
オービック	144,400	3,883.00	560,705,200
ジャストシステム	11,200	4,000.00	44,800,000
TDCソフト	14,600	1,038.00	15,154,800
LINEヤフー	1,197,300	374.30	448,149,390
ビー・エム・エル	10,600	4,145.00	43,937,000
トレンドマイクロ	44,900	5,688.00	255,391,200
IDホールディングス	5,000	1,948.00	9,740,000
日本オラクル	14,900	9,411.00	140,223,900
早稲田アカデミー	4,400	2,011.00	8,848,400
アルファシステムズ	2,500	3,660.00	9,150,000
NSグループ	10,200	1,705.00	17,391,000
フューチャー	16,600	1,796.00	29,813,600
CAC Holdings	4,800	1,906.00	9,148,800
ユー・エス・エス	151,200	1,849.00	279,568,800
オービックビジネスコンサルタント	13,100	5,837.00	76,464,700
アイティフォー	8,100	1,691.00	13,697,100
東計電算	2,200	4,250.00	9,350,000
サイバーエージェント	161,600	1,309.00	211,534,400
楽天グループ	629,100	822.40	517,371,840
クリーク・アンド・リバー社	6,200	1,456.00	9,027,200
SBIグローバルアセットマネジメント	14,900	608.00	9,059,200
大塚商会	88,100	3,040.00	267,824,000
サイボウズ	10,700	2,164.00	23,154,800
山田コンサルティンググループ	5,400	1,674.00	9,039,600
セントラルスポーツ	3,800	2,480.00	9,424,000
パラカ	4,700	2,007.00	9,432,900
電通総研	28,300	1,814.00	51,336,200
デジタルガレージ	11,100	2,042.00	22,666,200
イーエムシステムズ	12,700	697.00	8,851,900
ウェザーニューズ	5,500	4,145.00	22,797,500
CIJ	18,800	503.00	9,456,400
ビジネスエンジニアリング	9,100	1,407.00	12,803,700
WOWOW	6,600	1,311.00	8,652,600
スカラ	24,800	368.00	9,126,400
フルキャストホールディングス	6,100	1,635.00	9,973,500
エン	13,000	1,205.00	15,665,000
セルソース	23,500	402.00	9,447,000
あすか製薬ホールディングス	7,500	2,487.00	18,652,500
サワイグループホールディングス	40,200	2,365.50	95,093,100
富士フイルムホールディングス	468,800	3,000.00	1,406,400,000
コニカミノルタ	174,900	591.50	103,453,350
資生堂	150,800	3,074.00	463,559,200
ライオン	89,200	1,744.00	155,564,800
高砂香料工業	29,200	1,385.00	40,442,000

マンダム	16,800	3,095.00	51,996,000
ミルボン	12,200	2,716.00	33,135,200
コーセーホールディングス	17,600	6,064.00	106,726,400
コタ	8,600	1,287.00	11,068,200
ポーラ・オルビスホールディングス	39,900	1,357.50	54,164,250
ノエビアホールディングス	6,900	4,610.00	31,809,000
新日本製薬	4,600	2,088.00	9,604,800
エステー	7,300	1,540.00	11,242,000
コニシ	24,500	1,343.00	32,903,500
長谷川香料	14,900	2,850.00	42,465,000
小林製薬	20,400	5,635.00	114,954,000
荒川化学工業	7,200	1,468.00	10,569,600
メック	5,700	6,980.00	39,786,000
日本高純度化学	1,700	5,280.00	8,976,000
タカラバイオ	20,900	1,148.00	23,993,200
JCU	8,500	6,660.00	56,610,000
デクセリアルズ	66,500	2,372.50	157,771,250
アース製薬	7,100	4,920.00	34,932,000
北興化学工業	5,600	1,823.00	10,208,800
大成ラミックグループ	3,600	2,677.00	9,637,200
クミアイ化学工業	34,700	711.00	24,671,700
日本農薬	11,900	1,017.00	12,102,300
ニチレキグループ	8,300	2,414.00	20,036,200
ユシロ	4,000	3,095.00	12,380,000
JX金属	222,100	3,389.00	752,696,900
出光興産	336,300	1,416.50	476,368,950
ENEOSホールディングス	1,098,600	1,456.00	1,599,561,600
コスモエネルギーホールディングス	43,100	4,793.00	206,578,300
ANYCOLOR	12,400	4,020.00	49,848,000
テスホールディングス	23,600	532.00	12,555,200
インフロニア・ホールディングス	79,700	2,566.50	204,550,050
横浜ゴム	43,400	7,982.00	346,418,800
TOYO TIRE	49,100	4,735.00	232,488,500
ブリヂストン	455,200	3,620.00	1,647,824,000
住友ゴム工業	83,900	2,715.00	227,788,500
藤倉コンポジット	6,400	2,605.00	16,672,000
オカモト	4,100	5,580.00	22,878,000
アキレス	6,600	1,655.00	10,923,000
フコク	4,400	2,005.00	8,822,000
ニッタ	7,600	4,440.00	33,744,000
三ツ星ベルト	9,900	4,180.00	41,382,000
バンドー化学	11,500	2,328.00	26,772,000
AGC	75,600	6,294.00	475,826,400
日本板硝子	43,300	599.00	25,936,700
有沢製作所	13,600	2,550.00	34,680,000
日本電気硝子	26,000	6,180.00	160,680,000
オハラ	8,900	1,154.00	10,270,600
住友大阪セメント	13,000	4,409.00	57,317,000
太平洋セメント	48,000	4,647.00	223,056,000
日本ヒューム	13,600	1,587.00	21,583,200

日本コンクリート工業	27,900	349.00	9,737,100
三谷セキサン	3,200	7,270.00	23,264,000
アジアパイルホールディングス	12,100	1,508.00	18,246,800
東海カーボン	78,300	1,042.00	81,588,600
日本カーボン	4,500	4,870.00	21,915,000
東洋炭素	6,700	5,980.00	40,066,000
ノリタケ	8,100	6,920.00	56,052,000
TOTO	48,200	6,195.00	298,599,000
日本碍子	86,400	4,321.00	373,334,400
日本特殊陶業	63,500	7,793.00	494,855,500
MARUWA	3,200	55,080.00	176,256,000
品川リフラ	9,600	2,388.00	22,924,800
黒崎播磨	6,300	4,205.00	26,491,500
フジインコーポレーテッド	23,300	3,200.00	74,560,000
ニチアス	21,600	8,689.00	187,682,400
日本製鉄	2,181,000	673.90	1,469,775,900
神戸製鋼所	160,900	2,287.00	367,978,300
中山製鋼所	16,500	620.00	10,230,000
合同製鐵	4,500	4,025.00	18,112,500
JFEホールディングス	259,500	2,249.50	583,745,250
東京製鐵	22,300	1,581.00	35,256,300
共英製鋼	9,100	2,565.00	23,341,500
大和工業	14,400	12,755.00	183,672,000
東京鐵鋼	3,300	6,270.00	20,691,000
大阪製鐵	3,700	2,546.00	9,420,200
ヨドコウ	46,100	1,406.00	64,816,600
中部鋼鈹	7,300	2,574.00	18,790,200
丸一鋼管	80,400	1,587.00	127,594,800
モリ工業	9,300	1,003.00	9,327,900
大同特殊鋼	56,700	2,160.00	122,472,000
日本冶金工業	5,400	5,060.00	27,324,000
愛知製鋼	15,000	3,300.00	49,500,000
大平洋金属	6,800	3,090.00	21,012,000
新日本電工	43,800	427.00	18,702,600
栗本鐵工所	18,600	1,711.00	31,824,600
日本製鋼所	23,700	10,020.00	237,474,000
三菱製鋼	5,500	2,024.00	11,132,000
日本精線	7,900	1,315.00	10,388,500
エンビプロ・ホールディングス	3,400	940.00	3,196,000
大紀アルミニウム工業所	11,400	1,423.00	16,222,200
日本輕金属ホールディングス	23,400	2,968.00	69,451,200
三井金属	20,000	31,290.00	625,800,000
東邦亜鉛	6,600	1,547.00	10,210,200
三菱マテリアル	53,400	5,237.00	279,655,800
住友金属鉱山	109,600	10,010.00	1,097,096,000
DOWAホールディングス	21,600	10,140.00	219,024,000
古河機械金属	9,500	5,750.00	54,625,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,900	2,686.00	37,335,400
東邦チタニウム	14,500	1,895.00	27,477,500
UACJ	48,400	2,480.00	120,032,000

C Kサンエツ	1,900	4,330.00	8,227,000	
古河電気工業	26,600	23,335.00	620,711,000	
住友電気工業	276,200	9,748.00	2,692,397,600	
フジクラ	102,900	22,900.00	2,356,410,000	
S W C C	11,600	14,310.00	165,996,000	
平河ビューテック	4,600	4,255.00	19,573,000	
いよぎんホールディングス	99,900	3,492.00	348,850,800	
しずおかフィナンシャルグループ	168,200	3,119.00	524,615,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	64,300	3,348.00	215,276,400	
楽天銀行	40,500	8,962.00	362,961,000	
京都フィナンシャルグループ	104,800	3,698.00	387,550,400	
リョービ	9,200	2,960.00	27,232,000	
A R E ホールディングス	32,400	4,245.00	137,538,000	
東洋製罐グループホールディングス	40,000	3,915.00	156,600,000	
ホッカンホールディングス	4,300	2,363.00	10,160,900	
コロナ	9,800	1,041.00	10,201,800	
横河ブリッジホールディングス	13,800	3,200.00	44,160,000	
三和ホールディングス	76,900	3,969.00	305,216,100	
文化シャッター	25,100	2,056.00	51,605,600	
三協立山	14,500	687.00	9,961,500	
アルインコ	8,400	1,150.00	9,660,000	
L I X I L	125,000	1,825.00	228,125,000	
ノーリツ	14,100	2,345.00	33,064,500	
長府製作所	7,900	2,069.00	16,345,100	
リンナイ	40,900	4,037.00	165,113,300	
ユニプレス	14,400	1,471.00	21,182,400	
日東精工	13,000	767.00	9,971,000	
岡部	13,700	1,000.00	13,700,000	
ジーテクト	10,200	2,020.00	20,604,000	
東プレ	14,100	2,829.00	39,888,900	
高周波熱錬	12,000	1,450.00	17,400,000	
サンコール	9,800	1,142.00	11,191,600	
パイオラックス	8,600	1,780.00	15,308,000	
エイチワン	8,200	1,428.00	11,709,600	
日本発条	60,300	3,019.00	182,045,700	
中央発條	5,200	3,365.00	17,498,000	
三浦工業	36,300	2,940.50	106,740,150	
タクマ	23,300	2,897.00	67,500,100	
アイ・アールジャパンホールディングス	11,800	803.00	9,475,400	
K e e P e r 技研	4,900	3,380.00	16,562,000	
イー・ガーディアン	5,500	1,643.00	9,036,500	
ジャパンマテリアル	24,400	2,039.00	49,751,600	
ベクトル	10,900	1,354.00	14,758,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	7,300	1,401.00	10,227,300	
キャリアリンク	3,500	2,764.00	9,674,000	
I B J	12,900	737.00	9,507,300	
アサンテ	5,800	1,610.00	9,338,000	
バリューHR	7,100	1,407.00	9,989,700	
M & A キャピタルパートナーズ	6,400	3,495.00	22,368,000	

ライドオンエクスプレスホールディングス	9,000	1,032.00	9,288,000	
シグママックス・ホールディングス	22,400	679.00	15,209,600	
ウィルグループ	8,000	1,281.00	10,248,000	
リクルートホールディングス	589,400	6,284.00	3,703,789,600	
エラン	13,900	742.00	10,313,800	
ツガミ	16,700	3,875.00	64,712,500	
オークマ	13,700	4,515.00	61,855,500	
芝浦機械	9,400	4,510.00	42,394,000	
アマダ	114,200	2,514.00	287,098,800	
アイダエンジニアリング	14,800	1,159.00	17,153,200	
F U J I	31,200	5,601.00	174,751,200	
牧野フライス製作所	8,000	11,680.00	93,440,000	
オーエスジー	27,900	2,828.50	78,915,150	
旭ダイヤモンド工業	18,800	1,147.00	21,563,600	
D M G 森精機	53,600	2,967.50	159,058,000	
ソディック	19,100	1,348.00	25,746,800	
ディスコ	37,700	74,060.00	2,792,062,000	
日東工器	4,900	1,852.00	9,074,800	
日進工具	10,800	911.00	9,838,800	
日本郵政	717,700	2,012.00	1,444,012,400	
ベルシステム24ホールディングス	10,800	1,464.00	15,811,200	
鎌倉新書	15,800	556.00	8,784,800	
エアトリ	12,900	721.00	9,300,900	
アトラエ	13,400	696.00	9,326,400	
ストライク	3,900	4,360.00	17,004,000	
ソラスト	19,200	920.00	17,664,000	
インソース	17,300	708.00	12,248,400	
豊田自動織機	66,100	20,200.00	1,335,220,000	
リケンNPR	9,000	4,120.00	37,080,000	
島精機製作所	12,100	967.00	11,700,700	
オプトラン	12,900	2,820.00	36,378,000	
イワキ	5,200	2,841.00	14,773,200	
フリー	9,200	1,180.00	10,856,000	
ヤマシンフィルタ	16,200	595.00	9,639,000	
日阪製作所	9,200	1,652.00	15,198,400	
やまびこ	12,800	3,760.00	48,128,000	
野村マイクロ・サイエンス	14,100	3,465.00	48,856,500	
平田機工	11,200	2,848.00	31,897,600	
P E G A S U S	12,400	780.00	9,672,000	
タツモ	5,200	2,550.00	13,260,000	
ナブテスコ	44,500	4,718.00	209,951,000	
三井海洋開発	19,900	14,710.00	292,729,000	
レオン自動機	9,100	1,592.00	14,487,200	
S M C	22,200	72,880.00	1,617,936,000	
ホソカワミクロン	5,900	6,640.00	39,176,000	
ユニオンツール	3,500	14,000.00	49,000,000	
瑞光	9,400	985.00	9,259,000	
オイレス工業	9,700	2,595.00	25,171,500	
日精エー・エス・ピー機械	3,000	8,560.00	25,680,000	

サトー	10,700	2,425.00	25,947,500
技研製作所	7,100	2,387.00	16,947,700
日本エアータック	7,700	1,266.00	9,748,200
日精樹脂工業	10,800	895.00	9,666,000
小松製作所	377,600	7,541.00	2,847,481,600
住友重機械工業	46,300	5,754.00	266,410,200
日立建機	31,200	6,549.00	204,328,800
日工	15,100	856.00	12,925,600
巴工業	8,700	2,146.00	18,670,200
井関農機	7,300	1,906.00	13,913,800
T O W A	28,300	2,909.00	82,324,700
北川鉄工所	5,300	1,791.00	9,492,300
ローツェ	46,000	3,464.00	159,344,000
クボタ	396,100	3,046.00	1,206,520,600
荏原実業	8,200	2,892.00	23,714,400
東洋エンジニアリング	11,200	3,060.00	34,272,000
三菱化工機	8,300	3,920.00	32,536,000
月島ホールディングス	10,500	3,330.00	34,965,000
帝国電機製作所	5,400	3,160.00	17,064,000
新東工業	15,900	1,168.00	18,571,200
澁谷工業	7,300	3,540.00	25,842,000
アイチコーポレーション	13,000	1,404.00	18,252,000
小森コーポレーション	18,600	1,735.00	32,271,000
鶴見製作所	11,100	2,203.00	24,453,300
酒井重工業	4,300	2,227.00	9,576,100
荏原製作所	160,800	5,638.00	906,590,400
西島製作所	5,900	2,553.00	15,062,700
A I R M A N	7,900	2,114.00	16,700,600
ダイキン工業	102,000	19,730.00	2,012,460,000
オルガノ	10,800	16,620.00	179,496,000
トーヨーカネツ	6,500	3,090.00	20,085,000
栗田工業	47,200	8,307.00	392,090,400
椿本チエイン	33,900	2,610.00	88,479,000
日機装	18,000	2,350.00	42,300,000
木村化工機	7,500	1,508.00	11,310,000
レイズネクスト	11,000	2,578.00	28,358,000
アネスト岩田	14,500	1,754.00	25,433,000
ダイフク	132,100	6,325.00	835,532,500
サムコ	2,100	6,310.00	13,251,000
タダノ	41,300	1,395.00	57,613,500
フジテック	6,900	5,679.00	39,185,100
C K D	23,600	5,400.00	127,440,000
平和	23,100	1,993.00	46,038,300
理想科学工業	12,500	1,252.00	15,650,000
S A N K Y O	82,900	2,172.50	180,100,250
日本金銭機械	9,500	1,207.00	11,466,500
マースグループホールディングス	6,600	3,160.00	20,856,000
ガリレイ	11,500	3,720.00	42,780,000
ダイコク電機	3,900	2,634.00	10,272,600
竹内製作所	14,200	7,560.00	107,352,000

アマノ	20,600	4,031.00	83,038,600
ジャノメ	7,800	1,426.00	11,122,800
ブラザー工業	97,100	3,098.00	300,815,800
マックス	10,800	6,700.00	72,360,000
モリタホールディングス	12,200	2,929.00	35,733,800
グローリー	20,500	3,980.00	81,590,000
新晃工業	21,000	1,437.00	30,177,000
大和冷機工業	12,000	1,686.00	20,232,000
セガサミーホールディングス	64,100	2,441.00	156,468,100
T P R	17,900	1,374.00	24,594,600
ツバキ・ナカシマ	27,200	352.00	9,574,400
ホシザキ	50,400	5,290.00	266,616,000
日本精工	145,000	1,322.50	191,762,500
NTN	207,900	411.80	85,613,220
ジェイテクト	73,900	2,046.00	151,199,400
不二越	5,800	5,180.00	30,044,000
ミネベアミツミ	136,200	3,310.00	450,822,000
日本トムソン	21,300	1,056.00	22,492,800
THK	41,400	5,055.00	209,277,000
Y U S H I N	12,300	718.00	8,831,400
イーグル工業	8,700	3,420.00	29,754,000
P I L L A R	7,300	8,110.00	59,203,000
キッツ	27,900	2,201.00	61,407,900
日立製作所	1,992,300	4,930.00	9,822,039,000
三菱電機	857,700	5,850.00	5,017,545,000
富士電機	56,300	12,575.00	707,972,500
安川電機	85,000	5,198.00	441,830,000
シンフォニア テクノロジー	8,600	12,020.00	103,372,000
明電舎	14,500	7,660.00	111,070,000
山洋電気	9,000	4,910.00	44,190,000
デンヨー	5,700	3,840.00	21,888,000
PHCホールディングス	14,700	1,044.00	15,346,800
K O K U S A I E L E C T R I C	89,700	6,371.00	571,478,700
ソシオネクスト	67,800	1,946.50	131,972,700
ベikalレント	58,600	4,480.00	262,528,000
アイモバイル	18,100	523.00	9,466,300
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	67,400	1,630.50	109,895,700
ミダックホールディングス	4,600	1,998.00	9,190,800
キュービーネットホールディングス	6,800	1,345.00	9,146,000
三櫻工業	11,800	838.00	9,888,400
マキタ	97,400	5,961.00	580,601,400
東芝テック	10,000	3,165.00	31,650,000
芝浦メカトロニクス	4,900	27,930.00	136,857,000
マブチモーター	75,600	1,765.00	133,434,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	27,600	336.00	9,273,600
トレックス・セミコンダクター	6,300	1,740.00	10,962,000
東光高岳	4,200	5,430.00	22,806,000
ダイヘン	7,300	14,450.00	105,485,000
ヤーマン	15,200	705.00	10,716,000

JVCケンウッド	61,800	1,334.50	82,472,100
ミマキエンジニアリング	6,500	1,839.00	11,953,500
大崎電気工業	15,000	1,692.00	25,380,000
オムロン	65,800	5,169.00	340,120,200
日東工業	9,400	4,550.00	42,770,000
I D E C	10,000	3,245.00	32,450,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	32,000	5,208.00	166,656,000
B U F F A L O	2,100	5,020.00	10,542,000
テクノメディカ	4,200	2,456.00	10,315,200
日本電気	514,200	3,916.00	2,013,607,200
富士通	720,500	3,630.00	2,615,415,000
沖電気工業	37,900	3,070.00	116,353,000
サンケン電気	8,000	7,765.00	62,120,000
アイホン	4,100	2,877.00	11,795,700
ルネサスエレクトロニクス	759,200	2,908.00	2,207,753,600
セイコーエプソン	97,500	2,073.50	202,166,250
ワコム	47,000	849.00	39,903,000
アルバック	20,000	10,410.00	208,200,000
E I Z O	11,000	2,263.00	24,893,000
ジャパンディスプレイ	449,900	23.00	10,347,700
日本信号	19,800	1,691.00	33,481,800
京三製作所	18,200	783.00	14,250,600
能美防災	10,600	4,280.00	45,368,000
ホーチキ	6,100	5,920.00	36,112,000
エレコム	18,700	1,784.00	33,360,800
パナソニック ホールディングス	925,100	2,510.50	2,322,463,550
シャープ	94,300	651.00	61,389,300
アンリツ	51,200	2,611.00	133,683,200
ソニーグループ	2,674,300	3,336.00	8,921,464,800
T D K	676,200	2,380.00	1,609,356,000
帝国通信工業	3,500	2,725.00	9,537,500
タムラ製作所	31,200	686.00	21,403,200
アルプスアルパイン	60,300	2,330.50	140,529,150
日本電波工業	9,400	1,182.00	11,110,800
鈴木	4,600	2,986.00	13,735,600
メイコー	7,000	21,510.00	150,570,000
日本トリム	2,000	5,090.00	10,180,000
フォスター電機	7,200	2,993.00	21,549,600
ヨコオ	6,900	3,005.00	20,734,500
ホシデン	15,700	2,795.00	43,881,500
ヒロセ電機	11,400	21,400.00	243,960,000
日本航空電子工業	18,300	2,619.00	47,927,700
T O A	7,900	1,786.00	14,109,400
マクセル	16,300	2,226.00	36,283,800
古野電気	10,200	8,280.00	84,456,000
スミダコーポレーション	13,400	1,213.00	16,254,200
アイコム	3,200	3,145.00	10,064,000
横河電機	85,700	5,398.00	462,608,600
新電元工業	3,300	3,915.00	12,919,500
アズビル	188,300	1,347.00	253,640,100

日本光電工業	64,400	1,646.50	106,034,600
チノー	6,600	1,641.00	10,830,600
日本電子材料	4,800	8,330.00	39,984,000
堀場製作所	14,700	19,250.00	282,975,000
アドバンテスト	244,300	25,475.00	6,223,542,500
エスベック	7,600	3,905.00	29,678,000
キーエンス	77,600	61,430.00	4,766,968,000
日置電機	4,100	7,160.00	29,356,000
シスメックス	200,700	1,338.50	268,636,950
日本マイクロニクス	12,800	11,900.00	152,320,000
メガチップス	5,000	9,050.00	45,250,000
OBARA GROUP	4,200	5,200.00	21,840,000
デンソー	759,500	2,215.00	1,682,292,500
コーセル	9,600	1,266.00	12,153,600
イリソ電子工業	6,400	3,645.00	23,328,000
オブテックスグループ	13,100	2,904.00	38,042,400
千代田インテグレ	2,900	3,315.00	9,613,500
レーザーテック	32,800	30,640.00	1,004,992,000
スタンレー電気	39,700	3,186.00	126,484,200
ウシオ電機	32,200	3,084.00	99,304,800
日本セラミック	6,300	3,740.00	23,562,000
山一電機	7,600	8,380.00	63,688,000
図研	6,500	4,560.00	29,640,000
日本電子	17,900	6,493.00	116,224,700
カシオ計算機	62,000	1,604.50	99,479,000
ファナック	370,200	6,421.00	2,377,054,200
日本シイエムケイ	24,800	597.00	14,805,600
エンプラス	2,300	14,390.00	33,097,000
大真空	15,800	655.00	10,349,000
ローム	152,200	2,650.00	403,330,000
浜松ホトニクス	129,600	1,864.00	241,574,400
三井ハイテック	40,000	801.00	32,040,000
京セラ	481,700	2,656.50	1,279,636,050
太陽誘電	41,500	4,634.00	192,311,000
村田製作所	739,800	3,675.00	2,718,765,000
双葉電子工業	16,000	718.00	11,488,000
日東電工	236,100	3,624.00	855,626,400
東海理化電機製作所	20,700	3,265.00	67,585,500
ニチコン	20,300	2,088.00	42,386,400
日本ケミコン	10,700	1,675.00	17,922,500
KOA	14,100	1,663.00	23,448,300
三井E&S	38,900	8,090.00	314,701,000
カナデビア	64,200	1,080.00	69,336,000
三菱重工業	1,467,100	4,965.00	7,284,151,500
川崎重工業	58,400	17,915.00	1,046,236,000
IHI	408,100	4,384.00	1,789,110,400
名村造船所	24,200	5,630.00	136,246,000
マネジメントソリューションズ	7,100	1,382.00	9,812,200
プロレド・パートナーズ	17,500	492.00	8,610,000
カーブスホールディングス	21,800	769.00	16,764,200

Mac bee Planet	6,400	1,461.00	9,350,400
日本車輛製造	3,000	4,275.00	12,825,000
三菱ロジスネクスト	12,400	1,531.00	18,984,400
ユニソルホールディングス	7,000	2,281.00	15,967,000
ヤマエグループホールディングス	8,000	3,045.00	24,360,000
F P G	24,300	2,043.00	49,644,900
ライフネット生命保険	12,200	2,091.00	25,510,200
全国保証	43,900	3,166.00	138,987,400
めぶきフィナンシャルグループ	357,000	1,320.00	471,240,000
ジャパンインベストメントアドバイザ	12,400	1,963.00	24,341,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,800	11,390.00	111,622,000
九州フィナンシャルグループ	147,800	1,318.00	194,800,400
かんぽ生命保険	86,200	4,959.00	427,465,800
ゆうちょ銀行	829,300	3,054.00	2,532,682,200
富山第一銀行	24,200	2,591.00	62,702,200
横浜フィナンシャルグループ	398,200	1,698.50	676,342,700
ジェイリース	6,600	1,420.00	9,372,000
西日本フィナンシャルホールディングス	46,700	4,419.00	206,367,300
S B Iアルヒ	7,000	926.00	6,482,000
プレミアグループ	13,000	1,814.00	23,582,000
日産自動車	1,184,400	445.00	527,058,000
いすゞ自動車	206,900	2,755.00	570,009,500
トヨタ自動車	4,121,200	3,635.00	14,980,562,000
日野自動車	116,600	444.00	51,770,400
三菱自動車工業	296,400	434.70	128,845,080
武蔵精密工業	17,100	2,370.00	40,527,000
日産車体	11,800	1,046.00	12,342,800
新明和工業	22,300	2,663.00	59,384,900
極東開発工業	12,800	3,470.00	44,416,000
トピー工業	5,600	3,535.00	19,796,000
ティラド	1,400	10,940.00	15,316,000
曙ブレーキ工業	30,000	142.00	4,260,000
タチエス	14,300	2,287.00	32,704,100
N O K	28,800	3,237.00	93,225,600
フタバ産業	20,800	1,120.00	23,296,000
カヤバ	13,200	5,140.00	67,848,000
市光工業	18,500	563.00	10,415,500
大同メタル工業	15,200	1,119.00	17,008,800
プレス工業	31,900	965.00	30,783,500
太平洋工業	17,800	3,010.00	53,578,000
アイシン	198,000	2,682.00	531,036,000
マツダ	256,400	1,342.00	344,088,800
本田技研工業	1,683,800	1,543.00	2,598,103,400
スズキ	569,500	2,294.00	1,306,433,000
S U B A R U	233,800	3,021.00	706,309,800
ヤマハ発動機	383,700	1,233.00	473,102,100
小糸製作所	80,300	2,725.00	218,817,500
エクセディ	12,700	6,020.00	76,454,000

ミツバ	14,700	1,390.00	20,433,000
豊田合成	25,900	4,884.00	126,495,600
愛三工業	12,900	2,230.00	28,767,000
ヨロズ	9,200	1,053.00	9,687,600
エフ・シー・シー	15,100	3,760.00	56,776,000
シマノ	32,600	16,880.00	550,288,000
テイ・エス テック	28,800	1,984.50	57,153,600
三十三フィナンシャルグループ	7,400	6,120.00	45,288,000
第四北越フィナンシャルグループ	71,900	1,998.00	143,656,200
ひろぎんホールディングス	106,200	1,924.50	204,381,900
おきなわフィナンシャルグループ	6,500	5,900.00	38,350,000
ダイレクトマーケティングミックス	7,500	345.00	2,587,500
LITALICO	7,600	1,343.00	10,206,800
十六フィナンシャルグループ	10,700	9,880.00	105,716,000
CCIグループ	79,700	1,013.00	80,736,100
ネットプロテクションズホールディングス	23,100	511.00	11,804,100
プロクレアホールディングス	9,300	2,860.00	26,598,000
FPパートナー	3,800	2,281.00	8,667,800
あいちフィナンシャルグループ	15,700	6,250.00	98,125,000
小野建	8,700	1,480.00	12,876,000
ノジマ	80,300	1,145.00	91,943,500
佐島電機	5,200	1,966.00	10,223,200
カッパ・クリエイト	12,900	1,544.00	19,917,600
伯東	4,900	4,320.00	21,168,000
コンドーテック	6,900	1,511.00	10,425,900
ナガイレーベン	8,900	1,754.00	15,610,600
良品計画	179,100	3,620.00	648,342,000
松田産業	6,200	7,330.00	45,446,000
第一興商	27,100	1,666.50	45,162,150
メディカルホールディングス	87,700	2,920.00	256,084,000
アドヴァングループ	1,500	1,000.00	1,500,000
SPK	4,000	2,654.00	10,616,000
萩原電気ホールディングス	3,500	3,870.00	13,545,000
アルピス	3,500	2,710.00	9,485,000
アズワン	26,200	2,190.00	57,378,000
スズデン	5,500	1,750.00	9,625,000
シモジマ	6,800	1,447.00	9,839,600
ドウシシャ	9,800	3,565.00	34,937,000
高速	5,500	3,280.00	18,040,000
G-7ホールディングス	8,900	1,495.00	13,305,500
イオン北海道	24,300	935.00	22,720,500
コジマ	13,600	1,338.00	18,196,800
コーナン商事	9,000	4,190.00	37,710,000
エコス	3,100	3,200.00	9,920,000
ワタミ	10,000	968.00	9,680,000
リックス	2,500	3,810.00	9,525,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	829,000	1,005.00	833,145,000
丸文	7,300	1,243.00	9,073,900

西松屋チェーン	18,200	2,153.00	39,184,600	
ゼンショーホールディングス	41,900	9,862.00	413,217,800	
ハピネット	11,200	2,880.00	32,256,000	
橋本総業ホールディングス	7,100	1,395.00	9,904,500	
日本ライフライン	20,700	1,450.00	30,015,000	
サイゼリヤ	10,600	6,930.00	73,458,000	
タカショー	23,200	397.00	9,210,400	
V Tホールディングス	32,000	558.00	17,856,000	
アルゴグラフィックス	27,800	1,527.00	42,450,600	
魚力	4,000	2,326.00	9,304,000	
I D O M	24,800	1,490.00	36,952,000	
ユナイテッドアローズ	8,800	2,511.00	22,096,800	
進和	4,800	3,305.00	15,864,000	
ダイトロン	6,800	2,880.00	19,584,000	
ハイデイ日高	13,300	3,210.00	42,693,000	
シークス	13,100	1,385.00	18,143,500	
コロワイド	46,300	1,824.00	84,451,200	
オーハシテクニカ	8,100	1,243.00	10,068,300	
壱番屋	32,400	922.00	29,872,800	
白銅	4,000	2,664.00	10,656,000	
スギホールディングス	44,100	3,493.00	154,041,300	
薬王堂ホールディングス	4,600	2,079.00	9,563,400	
島津製作所	103,000	4,177.00	430,231,000	
J M S	6,600	440.00	2,904,000	
長野計器	5,100	2,992.00	15,259,200	
ブイ・テクノロジー	3,800	4,150.00	15,770,000	
スター精密	4,200	2,198.00	9,231,600	
東京計器	6,400	8,780.00	56,192,000	
愛知時計電機	3,700	3,145.00	11,636,500	
インターアクション	6,500	1,455.00	9,457,500	
東京精密	14,700	16,895.00	248,356,500	
マニー	31,000	1,607.00	49,817,000	
ニコン	96,700	1,964.00	189,918,800	
オリンパス	420,000	1,480.00	621,600,000	
理研計器	11,000	3,390.00	37,290,000	
S C R E E Nホールディングス	27,700	21,980.00	608,846,000	
キヤノン電子	8,600	3,630.00	31,218,000	
タムロン	39,600	1,025.00	40,590,000	
H O Y A	149,200	27,545.00	4,109,714,000	
ノーリツ鋼機	22,100	2,183.00	48,244,300	
A & Dホロンホールディングス	10,500	2,792.00	29,316,000	
朝日インテック	92,300	2,980.50	275,100,150	
キヤノン	348,000	4,685.00	1,630,380,000	
リコー	181,700	1,449.00	263,283,300	
シチズン時計	64,200	1,727.00	110,873,400	
メニコン	28,900	1,819.00	52,569,100	
トランザクション	8,300	1,295.00	10,748,500	
ニホンフラッシュ	11,400	845.00	9,633,000	
前田工織	15,800	2,118.00	33,464,400	
アートネイチャー	1,300	810.00	1,053,000	

フルヤ金属	7,400	7,390.00	54,686,000
バンダイナムコホールディングス	207,300	4,030.00	835,419,000
SHOEI	20,200	1,704.00	34,420,800
フランスベッドホールディングス	11,100	1,333.00	14,796,300
マーベラス	19,400	499.00	9,680,600
パイロットコーポレーション	11,900	4,845.00	57,655,500
萩原工業	5,500	1,780.00	9,790,000
エイベックス	13,300	1,222.00	16,252,600
フジシルインターナショナル	15,700	2,785.00	43,724,500
タカラトミー	38,000	2,722.50	103,455,000
広済堂ホールディングス	25,100	478.00	11,997,800
三光合成	9,800	1,018.00	9,976,400
プロネクサス	8,200	1,159.00	9,503,800
TOPPANホールディングス	94,000	4,606.00	432,964,000
大日本印刷	167,300	3,092.00	517,291,600
共同印刷	7,800	1,668.00	13,010,400
NISSHA	13,900	1,315.00	18,278,500
ZACROS	24,600	1,403.00	34,513,800
TAKARA & COMPANY	4,600	3,950.00	18,170,000
前澤化成工業	5,000	2,320.00	11,600,000
未来工業	3,700	3,415.00	12,635,500
アシックス	298,100	4,810.00	1,433,861,000
JSP	5,500	2,784.00	15,312,000
ニチハ	9,000	3,650.00	32,850,000
ローランド	6,200	3,980.00	24,676,000
エフピコ	14,700	2,774.00	40,777,800
小松ウオール工業	5,700	2,901.00	16,535,700
ヤマハ	131,200	1,195.50	156,849,600
クリナップ	10,900	1,021.00	11,128,900
ピジョン	45,800	1,644.00	75,295,200
キングジム	11,600	814.00	9,442,400
象印マホービン	21,000	1,588.00	33,348,000
リンテック	16,800	5,160.00	86,688,000
信越ポリマー	16,800	2,147.00	36,069,600
イトーキ	17,000	3,205.00	54,485,000
任天堂	489,500	8,587.00	4,203,336,500
三菱鉛筆	10,400	2,277.00	23,680,800
松風	7,000	1,802.00	12,614,000
タカラスタンダード	17,500	3,000.00	52,500,000
コクヨ	153,400	895.50	137,369,700
ナカバヤシ	16,000	614.00	9,824,000
ニフコ	29,100	5,193.00	151,116,300
グローブライド	7,300	2,310.00	16,863,000
オカムラ	23,300	2,590.00	60,347,000
バルカー	6,500	5,000.00	32,500,000
伊藤忠商事	2,756,800	2,192.50	6,044,284,000
丸紅	625,900	5,710.00	3,573,889,000
スクロール	14,100	1,348.00	19,006,800
ヨンドシーホールディングス	7,800	1,883.00	14,687,400
三陽商会	3,700	4,400.00	16,280,000

長瀬産業	35,000	4,701.00	164,535,000
蝶理	4,400	4,500.00	19,800,000
豊田通商	246,300	6,735.00	1,658,830,500
オンワードホールディングス	45,300	801.00	36,285,300
三共生興	10,700	883.00	9,448,100
兼松	68,600	2,315.50	158,843,300
美津濃	20,800	3,985.00	82,888,000
ルックホールディングス	3,800	2,489.00	9,458,200
三井物産	1,179,400	5,505.00	6,492,597,000
日本紙パルプ商事	43,500	1,088.00	47,328,000
東京エレクトロン	164,100	43,960.00	7,213,836,000
カメイ	7,700	3,275.00	25,217,500
スターゼン	18,700	1,343.00	25,114,100
セイコーグループ	10,800	11,470.00	123,876,000
山善	24,900	1,508.00	37,549,200
椿本興業	5,700	3,000.00	17,100,000
住友商事	491,700	6,382.00	3,138,029,400
B I P R O G Y	26,300	4,658.00	122,505,400
内田洋行	15,100	2,063.00	31,151,300
三菱商事	1,635,200	4,991.00	8,161,283,200
第一実業	7,600	3,475.00	26,410,000
キヤノンマーケティングジャパン	19,300	6,853.00	132,262,900
西華産業	11,800	2,862.00	33,771,600
佐藤商事	5,700	2,432.00	13,862,400
東京産業	9,700	999.00	9,690,300
ユアサ商事	7,000	6,220.00	43,540,000
神鋼商事	6,200	2,713.00	16,820,600
阪和興業	13,500	8,800.00	118,800,000
正栄食品工業	5,500	4,045.00	22,247,500
カナデン	6,500	2,264.00	14,716,000
R Y O D E N	6,300	3,550.00	22,365,000
ニプロ	64,600	1,536.50	99,257,900
岩谷産業	81,500	1,931.00	157,376,500
極東貿易	4,900	2,131.00	10,441,900
アステナホールディングス	19,600	499.00	9,780,400
三愛オブリ	19,100	2,419.00	46,202,900
稲畑産業	18,700	4,210.00	78,727,000
G S I クレオス	4,800	2,719.00	13,051,200
明和産業	11,700	943.00	11,033,100
ゴールドウイン	45,400	2,420.00	109,868,000
ユニ・チャーム	486,000	1,065.00	517,590,000
ワキタ	13,600	2,112.00	28,723,200
東邦ホールディングス	23,300	4,644.00	108,205,200
サンゲツ	20,600	3,275.00	67,465,000
ミツウロコグループホールディングス	9,900	2,295.00	22,720,500
シナネンホールディングス	1,600	6,890.00	11,024,000
伊藤忠エネクス	20,300	1,963.00	39,848,900
サンリオ	81,400	5,295.00	431,013,000
サンワ テクノス	4,700	3,310.00	15,557,000
新光商事	9,900	1,065.00	10,543,500

トーヨー	9,600	1,314.00	12,614,400
三信電気	4,700	3,130.00	14,711,000
東陽テクニカ	7,600	1,850.00	14,060,000
モスフードサービス	12,100	4,235.00	51,243,500
加賀電子	15,200	4,180.00	63,536,000
都築電気	5,000	3,985.00	19,925,000
ソーダニッカ	8,100	1,184.00	9,590,400
立花エレテック	4,900	3,385.00	16,586,500
木曽路	12,400	2,568.00	31,843,200
S R S ホールディングス	13,500	1,251.00	16,888,500
リテールパートナーズ	12,200	1,398.00	17,055,600
上新電機	8,900	2,800.00	24,920,000
日本瓦斯	39,300	3,028.00	119,000,400
ロイヤルホールディングス	31,800	1,514.00	48,145,200
チヨダ	8,600	1,115.00	9,589,000
ライフコーポレーション	15,700	2,713.00	42,594,100
リンガーハット	11,300	2,272.00	25,673,600
M r M a x H D	11,800	813.00	9,593,400
A O K I ホールディングス	17,600	1,778.00	31,292,800
オークワ	10,900	885.00	9,646,500
コメリ	10,900	3,605.00	39,294,500
青山商事	17,500	2,587.00	45,272,500
しまむら	57,900	3,537.00	204,792,300
高島屋	118,900	2,297.00	273,113,300
松屋	15,400	2,645.00	40,733,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	39,900	2,488.00	99,271,200
近鉄百貨店	5,200	1,815.00	9,438,000
丸井グループ	47,900	3,130.00	149,927,000
クレディセゾン	43,000	4,643.00	199,649,000
アクシアル リテイリング	22,400	1,275.00	28,560,000
イオン	968,400	2,295.00	2,222,478,000
イズミ	14,500	3,110.00	45,095,000
平和堂	13,400	3,000.00	40,200,000
フジ	12,600	2,146.00	27,039,600
ゼビオホールディングス	9,700	1,111.00	10,776,700
ケーズホールディングス	55,800	1,675.50	93,492,900
P A L T A C	12,600	4,915.00	61,929,000
S B I 新生銀行	97,400	1,919.50	186,959,300
あおぞら銀行	48,600	2,877.50	139,846,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,816,800	2,942.00	14,171,025,600
りそなホールディングス	936,400	1,980.50	1,854,540,200
三井住友トラストグループ	265,800	5,484.00	1,457,647,200
三井住友フィナンシャルグループ	1,677,400	5,963.00	10,002,336,200
千葉銀行	233,500	2,383.50	556,547,250
群馬銀行	137,700	2,205.50	303,697,350
武蔵野銀行	10,700	6,340.00	67,838,000
千葉興業銀行	14,400	2,386.00	34,358,400
筑波銀行	33,500	715.00	23,952,500
七十七銀行	24,400	9,828.00	239,803,200
秋田銀行	5,100	5,550.00	28,305,000

山形銀行	9,800	2,688.00	26,342,400
岩手銀行	4,800	6,860.00	32,928,000
東邦銀行	87,800	714.00	62,689,200
ふくおかフィナンシャルグループ	61,000	6,807.00	415,227,000
スルガ銀行	51,400	2,148.00	110,407,200
八十二長野銀行	157,500	2,091.50	329,411,250
山梨中央銀行	9,300	5,420.00	50,406,000
大垣共立銀行	15,800	6,490.00	102,542,000
福井銀行	7,300	3,420.00	24,966,000
清水銀行	3,100	2,850.00	8,835,000
滋賀銀行	11,500	8,790.00	101,085,000
南都銀行	11,500	7,490.00	86,135,000
百五銀行	71,800	1,557.00	111,792,600
紀陽銀行	25,400	4,270.00	108,458,000
ほくほくフィナンシャルグループ	46,100	6,231.00	287,249,100
山陰合同銀行	47,800	1,764.00	84,319,200
百十四銀行	7,500	9,500.00	71,250,000
四国銀行	12,000	2,408.00	28,896,000
阿波銀行	11,300	5,810.00	65,653,000
大分銀行	4,800	9,670.00	46,416,000
宮崎銀行	4,500	9,480.00	42,660,000
佐賀銀行	4,800	5,080.00	24,384,000
琉球銀行	16,200	2,462.00	39,884,400
セブン銀行	239,300	295.70	70,761,010
みずほフィナンシャルグループ	1,082,700	7,175.00	7,768,372,500
山口フィナンシャルグループ	74,900	2,730.00	204,477,000
芙蓉総合リース	21,100	4,583.00	96,701,300
みずほリース	57,400	1,509.00	86,616,600
東京センチュリー	57,100	2,237.50	127,761,250
SBIホールディングス	268,200	3,355.00	899,811,000
日本証券金融	28,100	2,269.00	63,758,900
アイフル	126,400	503.00	63,579,200
名古屋銀行	14,300	5,510.00	78,793,000
北洋銀行	98,600	1,048.00	103,332,800
愛媛銀行	11,100	1,908.00	21,178,800
京葉銀行	33,000	2,151.00	70,983,000
栃木銀行	41,300	1,002.00	41,382,600
北日本銀行	2,400	5,210.00	12,504,000
東和銀行	15,100	1,234.00	18,633,400
リコーリース	7,200	6,160.00	44,352,000
イオンフィナンシャルサービス	43,800	1,785.00	78,183,000
アコム	136,300	508.00	69,240,400
ジャックス	9,100	4,290.00	39,039,000
オリエン트コーポレーション	29,900	1,135.00	33,936,500
オリックス	472,000	5,410.00	2,553,520,000
三菱HCキャピタル	382,700	1,503.50	575,389,450
ジャフコグループ	20,400	2,435.00	49,674,000
トモニホールディングス	72,900	976.00	71,150,400
大和証券グループ本社	546,000	1,592.50	869,505,000
野村ホールディングス	1,284,000	1,404.50	1,803,378,000

岡三証券グループ	60,300	956.00	57,646,800
丸三証券	25,400	1,081.00	27,457,400
東洋証券	23,600	767.00	18,101,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	90,700	773.00	70,111,100
水戸証券	20,900	630.00	13,167,000
いちよし証券	14,300	1,317.00	18,833,100
松井証券	52,600	936.00	49,233,600
SOMPOホールディングス	379,200	5,904.00	2,238,796,800
日本取引所グループ	418,800	1,877.00	786,087,600
マネックスグループ	80,900	718.00	58,086,200
極東証券	10,500	1,797.00	18,868,500
岩井コスモホールディングス	8,000	3,945.00	31,560,000
アイザワ証券グループ	7,900	1,479.00	11,684,100
フィデアホールディングス	7,900	2,184.00	17,253,600
池田泉州ホールディングス	105,900	937.00	99,228,300
アニコムホールディングス	23,900	1,178.00	28,154,200
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	476,000	4,320.00	2,056,320,000
ソニーフィナンシャルグループ	2,674,100	159.30	425,984,130
スパークス・グループ	8,400	2,062.00	17,320,800
第一生命ホールディングス	1,501,900	1,562.00	2,345,967,800
東京海上ホールディングス	785,000	6,475.00	5,082,875,000
イー・ギャランティ	12,500	1,740.00	21,750,000
NECキャピタルソリューション	3,700	4,250.00	15,725,000
T&Dホールディングス	189,300	4,012.00	759,471,600
三井不動産	1,129,200	2,086.00	2,355,511,200
三菱地所	458,800	5,089.00	2,334,833,200
平和不動産	15,800	2,506.00	39,594,800
東京建物	72,400	4,145.00	300,098,000
京阪神ビルディング	11,300	2,014.00	22,758,200
住友不動産	217,100	5,044.00	1,095,052,400
テーオーシー	13,600	888.00	12,076,800
レオパレス21	67,900	720.00	48,888,000
スターツコーポレーション	14,100	5,120.00	72,192,000
フジ住宅	11,600	881.00	10,219,600
空港施設	10,800	1,032.00	11,145,600
明和地所	8,200	1,154.00	9,462,800
ゴールドクレスト	4,100	3,260.00	13,366,000
リログループ	35,500	1,850.50	65,692,750
エスリード	3,600	7,220.00	25,992,000
日神グループホールディングス	12,200	798.00	9,735,600
エスコン	17,100	1,127.00	19,271,700
MIRARTHホールディングス	48,800	411.00	20,056,800
カチタス	20,500	3,515.00	72,057,500
東祥	12,400	936.00	11,606,400
トーセイ	22,600	1,632.00	36,883,200
サンフロンティア不動産	11,300	2,553.00	28,848,900
FJネクストホールディングス	7,000	1,873.00	13,111,000
グランディハウス	3,700	649.00	2,401,300

東武鉄道	80,100	3,058.00	244,945,800
相鉄ホールディングス	29,900	2,909.50	86,994,050
東急	199,300	1,930.50	384,748,650
京浜急行電鉄	87,900	1,540.00	135,366,000
小田急電鉄	117,500	1,744.00	204,920,000
京王電鉄	34,700	4,122.00	143,033,400
京成電鉄	135,000	1,331.00	179,685,000
富士急行	9,500	2,258.00	21,451,000
東日本旅客鉄道	427,500	3,814.00	1,630,485,000
西日本旅客鉄道	184,900	3,279.00	606,287,100
東海旅客鉄道	328,500	4,623.00	1,518,655,500
東京地下鉄	123,500	1,660.00	205,010,000
西武ホールディングス	84,400	4,629.00	390,687,600
鴻池運輸	13,200	3,535.00	46,662,000
西日本鉄道	22,400	3,134.00	70,201,600
ハマキョウレックス	24,300	1,911.00	46,437,300
サカイ引越センター	9,800	2,895.00	28,371,000
近鉄グループホールディングス	82,900	3,300.00	273,570,000
阪急阪神ホールディングス	102,100	4,557.00	465,269,700
南海電気鉄道	37,000	3,025.00	111,925,000
京阪ホールディングス	40,300	3,468.00	139,760,400
神戸電鉄	1,300	2,555.00	3,321,500
名古屋鉄道	85,500	1,804.50	154,284,750
山陽電気鉄道	5,800	2,018.00	11,704,400
ヤマトホールディングス	94,100	1,853.00	174,367,300
山九	17,700	9,783.00	173,159,100
丸全昭和運輸	4,800	9,370.00	44,976,000
センコーグループホールディングス	56,000	1,926.50	107,884,000
ニッコンホールディングス	33,000	3,885.00	128,205,000
福山通運	8,300	5,450.00	45,235,000
セイノーホールディングス	38,100	2,606.50	99,307,650
神奈川中央交通	2,500	3,645.00	9,112,500
A Z - C O M 丸和ホールディングス	24,000	942.00	22,608,000
日本郵船	163,600	5,215.00	853,174,000
商船三井	147,300	5,441.00	801,459,300
川崎汽船	166,800	2,405.50	401,237,400
N S ユナイテッド海運	4,900	7,650.00	37,485,000
飯野海運	28,400	1,602.00	45,496,800
九州旅客鉄道	58,300	3,893.00	226,961,900
S G ホールディングス	130,000	1,518.00	197,340,000
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	77,500	3,670.00	284,425,000
日本航空	177,400	3,053.00	541,602,200
A N A ホールディングス	210,600	3,304.00	695,822,400
T R E ホールディングス	18,300	1,805.00	33,031,500
人・夢・技術グループ	6,000	1,615.00	9,690,000
シルバーライフ	11,700	811.00	9,488,700
Genky Drug Stores	7,200	4,385.00	31,572,000
コア商事ホールディングス	11,100	847.00	9,401,700
K P P グループホールディングス	21,400	907.00	19,409,800

ブックオフグループホールディングス	6,000	1,878.00	11,268,000
ギフトホールディングス	4,600	3,920.00	18,032,000
三菱倉庫	87,900	1,370.00	120,423,000
三井倉庫ホールディングス	23,900	3,464.00	82,789,600
住友倉庫	22,500	3,850.00	86,625,000
澁澤倉庫	12,400	1,389.00	17,223,600
ヤマタネ	6,600	2,279.00	15,041,400
乾汽船	9,600	1,546.00	14,841,600
日本トランスシティ	19,500	1,324.00	25,818,000
中央倉庫	4,100	1,675.00	6,867,500
安田倉庫	5,300	2,537.00	13,446,100
大栄環境	17,400	3,850.00	66,990,000
日本管財ホールディングス	8,400	2,834.00	23,805,600
上組	34,000	5,601.00	190,434,000
キューソー流通システム	4,400	3,155.00	13,882,000
エーアイティー	4,900	2,281.00	11,176,900
TBSホールディングス	38,400	5,714.00	219,417,600
日本テレビホールディングス	68,800	3,248.00	223,462,400
朝日放送グループホールディングス	11,500	826.00	9,499,000
テレビ朝日ホールディングス	18,900	3,210.00	60,669,000
スカパーJ S A Tホールディングス	51,800	2,800.00	145,040,000
テレビ東京ホールディングス	4,800	4,375.00	21,000,000
ビジョン	16,200	1,291.00	20,914,200
U-NEXT HOLDINGS	26,100	1,839.00	47,997,900
日本通信	64,600	136.00	8,785,600
NTT	21,348,800	151.00	3,223,668,800
KDDI	1,092,700	2,616.00	2,858,503,200
ソフトバンク	12,506,900	210.00	2,626,449,000
光通信	7,700	41,910.00	322,707,000
GMOインターネットグループ	25,100	2,930.00	73,543,000
KADOKAWA	43,200	2,788.50	120,463,200
学研ホールディングス	14,200	1,039.00	14,753,800
ゼンリン	11,600	1,014.00	11,762,400
東京電力ホールディングス	698,800	703.30	491,466,040
中部電力	285,700	2,573.50	735,248,950
関西電力	420,200	2,682.00	1,126,976,400
中国電力	134,700	1,078.00	145,206,600
北陸電力	79,300	1,076.50	85,366,450
東北電力	204,100	1,301.00	265,534,100
四国電力	72,200	1,758.50	126,963,700
九州電力	178,700	1,945.00	347,571,500
北海道電力	87,400	1,191.00	104,093,400
沖縄電力	19,800	1,186.00	23,482,800
電源開発	58,400	3,572.00	208,604,800
イーレックス	15,900	673.00	10,700,700
レノバ	21,200	721.00	15,285,200
東京瓦斯	139,900	7,575.00	1,059,742,500
大阪瓦斯	138,400	6,388.00	884,099,200
東邦瓦斯	28,500	5,450.00	155,325,000
北海道瓦斯	23,100	870.00	20,097,000

広島ガス	12,700	384.00	4,876,800
西部ガスホールディングス	8,900	2,517.00	22,401,300
静岡ガス	17,700	1,459.00	25,824,300
メタウォーター	10,300	4,025.00	41,457,500
クオッツ総研ホールディングス	9,400	783.00	7,360,200
松竹	4,400	11,590.00	50,996,000
東宝	40,800	7,745.00	315,996,000
エイチ・アイ・エス	23,200	1,262.00	29,278,400
東映	12,800	5,400.00	69,120,000
共立メンテナンス	30,600	2,614.50	80,003,700
イチネンホールディングス	7,600	2,159.00	16,408,400
建設技術研究所	8,200	3,425.00	28,085,000
スペース	6,000	1,648.00	9,888,000
アインホールディングス	9,200	6,223.00	57,251,600
燦ホールディングス	6,700	1,484.00	9,942,800
ピー・シー・エー	5,100	1,939.00	9,888,900
スバル興業	3,000	3,525.00	10,575,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,800	3,050.00	8,540,000
ナガワ	2,100	5,990.00	12,579,000
東京都競馬	5,800	5,600.00	32,480,000
カナモト	11,200	4,145.00	46,424,000
D T S	61,800	1,119.00	69,154,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	127,900	2,514.00	321,540,600
シーイーシー	9,400	1,956.00	18,386,400
カプコン	154,500	3,148.00	486,366,000
ニシオホールディングス	6,600	4,515.00	29,799,000
日本空港ビルデング	27,000	5,334.00	144,018,000
トランス・コスモス	10,200	4,005.00	40,851,000
乃村工藝社	34,800	1,433.00	49,868,400
藤田観光	15,900	2,321.00	36,903,900
トーカイ	5,800	2,583.00	14,981,400
セコム	148,800	5,985.00	890,568,000
N S W	3,800	2,381.00	9,047,800
セントラル警備保障	3,900	2,919.00	11,384,100
アイネス	6,100	2,012.00	12,273,200
丹青社	16,800	1,561.00	26,224,800
メイテックグループホールディングス	29,400	3,370.00	99,078,000
T K C	12,000	4,000.00	48,000,000
応用地質	7,100	2,913.00	20,682,300
船井総研ホールディングス	31,900	1,134.00	36,174,600
N S D	27,400	2,840.00	77,816,000
コナミグループ	33,300	18,795.00	625,873,500
学究社	3,900	2,440.00	9,516,000
ナック	17,300	536.00	9,272,800
福井コンピュータホールディングス	4,200	3,330.00	13,986,000
ダイセキ	15,300	3,700.00	56,610,000
ステップ	3,700	2,487.00	9,201,900
泉州電業	5,200	6,460.00	33,592,000

GENKI GLOBAL DINI NG CONCEPTS	4,600	2,904.00	13,358,400	
トラスコ中山	17,200	2,451.00	42,157,200	
ヤマダホールディングス	252,300	569.90	143,785,770	
オートバックスセブン	28,500	1,745.00	49,732,500	
モリト	5,800	2,025.00	11,745,000	
アークランズ	24,400	2,013.00	49,117,200	
ニトリホールディングス	132,700	3,237.00	429,549,900	
ケユーホールディングス	7,500	1,294.00	9,705,000	
吉野家ホールディングス	30,200	3,138.00	94,767,600	
加藤産業	10,100	6,790.00	68,579,000	
イノテック	5,200	2,722.00	14,154,400	
イエローハット	20,700	1,717.00	35,541,900	
松屋フーズホールディングス	3,900	6,110.00	23,829,000	
J B C Cホールディングス	20,600	1,343.00	27,665,800	
J Kホールディングス	6,500	1,537.00	9,990,500	
サガミホールディングス	13,200	1,881.00	24,829,200	
日伝	4,600	2,495.00	11,477,000	
ミロク情報サービス	6,600	1,744.00	11,510,400	
杉本商事	6,700	1,413.00	9,467,100	
因幡電機産業	42,800	2,787.00	119,283,600	
王将フードサービス	16,900	3,190.00	53,911,000	
ミニストップ	6,000	2,016.00	12,096,000	
アークス	13,800	3,890.00	53,682,000	
バローホールディングス	15,700	3,710.00	58,247,000	
東テク	9,100	4,330.00	39,403,000	
ミスミグループ本社	115,700	3,047.00	352,537,900	
ベルク	3,600	7,730.00	27,828,000	
大 庄	8,200	1,206.00	9,889,200	
ファーストリテイリング	55,400	66,960.00	3,709,584,000	
ソフトバンクグループ	1,490,300	4,329.00	6,451,508,700	
スズケン	27,200	6,278.00	170,761,600	
サンドラッグ	24,200	4,160.00	100,672,000	
サックスパー ホールディングス	11,500	820.00	9,430,000	
ジェコス	6,200	1,833.00	11,364,600	
ベルーナ	19,700	975.00	19,207,500	
合計	158,937,300		417,871,231,660	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2026年2月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,311,722,288
金銭信託	229,488,406
コール・ローン	18,838,929,229
株式	1,445,177,639,016
投資証券	23,533,830,623
派生商品評価勘定	635,084,186
未収入金	44,407,185
未収配当金	1,143,238,936
差入委託証拠金	18,548,438,853
流動資産合計	1,515,462,778,722
資産合計	
1,515,462,778,722	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	166,713,864
未払金	256,654,959
未払解約金	1,294,157,137
流動負債合計	1,717,525,960
負債合計	
1,717,525,960	
純資産の部	
元本等	
元本	249,481,062,803
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,264,264,189,959
元本等合計	1,513,745,252,762
純資産合計	
1,513,745,252,762	
負債純資産合計	
1,515,462,778,722	

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21日 至 2026年2月20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	2026年2月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	238,531,602,918円
同期中追加設定元本額	40,057,563,694円
同期中一部解約元本額	29,108,103,809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）	643,709,206円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,391,427,620円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,726,315,784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）	2,500,438,125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）	501,224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）	3,337,957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）	2,891,110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）	488,893,717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>	162,043,952,624円
DCニッセイ外国株式インデックス	48,240,019,759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>	4,366,631,783円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	537,465,338円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	169,058,517円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	623,089,944円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	514,275,073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>	85,545,166円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	13,289,843円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	12,143,061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)	3,603,523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>	20,916,558円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	463,900,688円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	345,735,073円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	550,735,287円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	54,972,548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>	325,486,663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)	109,187,474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)	108,821,992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)	97,319,222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)	30,918,696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)	17,705,732,224円
FWニッセイ先進国株インデックス	123,571,099円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	321,069,690円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	1,569,334,222円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	48,586,853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)	67,026,549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)	8,742,518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)	162,248,470円
ニッセイ外国株式インデックス(特金専用)(適格機関投資家限定)	167,603円
計	249,481,062,803円
2. 受益権の総数	249,481,062,803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 2025年2月21日 至 2026年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2026年2月20日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	64,305,002,120	
投資証券	1,602,438,207	
合計	65,907,440,327	

（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11月21日から2026年2月20日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2026年2月20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	17,101,349,094	-	17,307,822,972	206,473,878	
イギリス・ポンド	12,065,954,109	-	12,248,637,667	182,683,558	
ユーロ	2,768,522,926	-	2,777,585,821	9,062,895	
ユーロ	2,266,872,059	-	2,281,599,484	14,727,425	
合計	17,101,349,094	-	17,307,822,972	206,473,878	

（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	2026年2月20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					
先物取引	44,458,109,128	-	44,720,005,573	261,896,445	
合計	44,458,109,128	-	44,720,005,573	261,896,445	

(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)

2026年2月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	6.0676円 (60,676円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2026年2月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	63,395	165.050	10,463,344.75	
	ABBOTT LABORATORIES	207,168	112.190	23,242,177.92	
	ABBVIE INC	210,273	224.350	47,174,747.55	
	ACCENTURE PLC	73,824	214.950	15,868,468.80	
	ADOBE INC	49,827	259.210	12,915,656.67	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	193,161	203.370	39,283,152.57	
	AECOM	15,749	96.580	1,521,038.42	
	AERCAP HOLDINGS NV	20,975	151.320	3,173,937.00	
	AFFIRM HOLDINGS INC	32,222	51.820	1,669,744.04	
	AFLAC INC	60,442	112.760	6,815,439.92	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	33,742	126.340	4,262,964.28	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26,493	280.720	7,437,114.96	
	AIRBNB INC-CLASS A	51,070	125.810	6,425,116.70	
	ALLEGION PLC	10,217	161.230	1,647,286.91	
	ALLIANT ENERGY CORP	30,593	70.010	2,141,815.93	
	ALLSTATE CORP	31,348	203.220	6,370,540.56	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	15,602	339.370	5,294,850.74	
	ALPHABET INC-CL A	692,442	302.850	209,706,059.70	
	ALPHABET INC-CL C	581,611	303.560	176,553,835.16	
	ALTRIA GROUP INC	200,016	67.990	13,599,087.84	
	AMAZON.COM INC	1,142,458	204.860	234,043,945.88	
	AMCOR PLC	55,118	49.530	2,729,994.54	
	AMEREN CORPORATION	32,192	109.800	3,534,681.60	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	63,653	128.420	8,174,318.26	
AMERICAN EXPRESS CO	66,259	342.650	22,703,646.35		

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,968	130.370	1,038,788.16	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	65,908	79.540	5,242,322.32	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	23,233	131.360	3,051,886.88	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,208	472.430	5,294,995.44	
AMETEK INC	27,490	232.750	6,398,297.50	
AMGEN INC	64,088	375.500	24,065,044.00	
AMPHENOL CORP-CL A	145,309	151.200	21,970,720.80	
AMRIZE LTD	59,204	63.920	3,784,319.68	
ANALOG DEVICES INC	58,563	345.300	20,221,803.90	
AON PLC	24,383	324.300	7,907,406.90	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	51,911	118.340	6,143,147.74	
APPLE INC	1,766,391	260.580	460,286,166.78	
APPLIED MATERIALS INC	94,820	369.830	35,067,280.60	
APPROVIN CORP-CLASS A	27,461	412.000	11,313,932.00	
APTIVE PLC	25,898	80.460	2,083,753.08	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	44,362	98.340	4,362,559.08	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	57,202	68.860	3,938,929.72	
ARES MANAGEMENT CORP - A	25,705	129.850	3,337,794.25	
ARISTA NETWORKS INC	127,159	137.230	17,450,029.57	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	30,521	218.370	6,664,870.77	
ASTERA LABS INC	15,828	132.620	2,099,109.36	
AT&T INC	851,962	27.880	23,752,700.56	
ATLISSIAN CORP-CL A	19,798	80.260	1,588,987.48	
ATMOS ENERGY CORP	19,097	178.970	3,417,790.09	
AUTODESK INC	25,354	229.100	5,808,601.40	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	48,218	215.970	10,413,641.46	
AUTOZONE INC	1,991	3,745.490	7,457,270.59	
AVERY DENNISON CORP	9,291	193.600	1,798,737.60	
AXON ENTERPRISE INC	8,877	441.120	3,915,822.24	
BAKER HUGHES COMPANY	117,317	62.560	7,339,351.52	
BALL CORP	30,775	66.030	2,032,073.25	
BANK OF AMERICA CORP	837,494	52.770	44,194,558.38	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	83,899	118.160	9,913,505.84	
BAXTER INTERNATIONAL INC	61,197	21.340	1,305,943.98	
BECTON DICKINSON & CO	34,127	182.470	6,227,153.69	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	19,149	34.170	654,321.33	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	164,075	496.940	81,535,430.50	
BEST BUY CO INC	23,774	66.300	1,576,216.20	
BIOGEN INC	17,455	192.080	3,352,756.40	
BLACKROCK INC	17,516	1,081.280	18,939,700.48	

BLACKSTONE INC	87,731	125.760	11,033,050.56	
BLOCK INC	65,423	52.890	3,460,222.47	
BLOOM ENERGY CORP- A	26,459	159.000	4,206,981.00	
BOEING CO	90,006	233.710	21,035,302.26	
BOOKING HOLDINGS INC	3,858	4,007.450	15,460,742.10	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	14,669	79.940	1,172,639.86	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	176,337	75.720	13,352,237.64	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	242,351	60.300	14,613,765.30	
BROADCOM INC	533,979	333.990	178,343,646.21	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	13,893	176.210	2,448,085.53	
BROWN & BROWN INC	34,465	69.420	2,392,560.30	
BROWN-FORMAN CORP -CL B	21,731	29.420	639,326.02	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	13,148	111.420	1,464,950.16	
BUNGE GLOBAL SA	16,673	123.490	2,058,948.77	
BURLINGTON STORES INC	7,502	312.800	2,346,625.60	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,050	185.190	2,601,919.50	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	32,434	296.590	9,619,600.06	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	76,119	205.060	15,608,962.14	
CARDINAL HEALTH INC	28,276	222.760	6,298,761.76	
CARLISLE COS INC	5,085	407.650	2,072,900.25	
CARLYLE GROUP INC/THE	27,949	52.980	1,480,738.02	
CARNIVAL CORP	124,903	31.550	3,940,689.65	
CARRIER GLOBAL CORP	91,171	62.920	5,736,479.32	
CARVANA CO	15,613	332.790	5,195,850.27	
CATERPILLAR INC	55,758	760.530	42,405,631.74	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,446	286.170	3,561,671.82	
CBRE GROUP INC	35,405	149.190	5,282,071.95	
CDW CORP/DE	15,608	124.170	1,938,045.36	
CENCORA, INC.	21,919	359.110	7,871,332.09	
CENTENE CORP	58,472	43.680	2,554,056.96	
CENTERPOINT ENERGY INC	77,709	42.640	3,313,511.76	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,275	99.460	1,917,091.50	
CHARLES SCHWAB CORP	205,234	93.870	19,265,315.58	
CHARTER COMMUNICATIONS- CL A	10,567	231.540	2,446,683.18	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,213	159.050	1,624,377.65	
CHENIERE ENERGY INC	26,146	226.190	5,913,963.74	
CHEVRON CORP	229,465	184.780	42,400,542.70	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	159,592	37.970	6,059,708.24	
CHUBB LTD	45,071	329.160	14,835,570.36	
CHURCH & DWIGHT CO INC	29,008	103.250	2,995,076.00	

CIENA CORP	16,789	318.410	5,345,785.49	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	18,601	162.400	3,020,802.40	
CINTAS CORP	43,043	197.970	8,521,222.71	
CISCO SYSTEMS INC	470,574	78.560	36,968,293.44	
CITIGROUP INC	219,099	115.550	25,316,889.45	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	51,322	64.590	3,314,887.98	
CLOROX CO	14,529	122.220	1,775,734.38	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	37,241	192.640	7,174,106.24	
CME GROUP INC	42,905	303.910	13,039,258.55	
CMS ENERGY CORP	35,626	75.850	2,702,232.10	
CNH INDUSTRIAL NV	104,296	12.980	1,353,762.08	
COCA-COLA CO	486,687	78.910	38,404,471.17	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	24,717	104.700	2,587,869.90	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	58,153	64.990	3,779,363.47	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	24,355	165.940	4,041,468.70	
COLGATE-PALMOLIVE CO	91,440	93.980	8,593,531.20	
COMCAST CORP	438,517	31.380	13,760,663.46	
COMFORT SYSTEMS USA INC	4,198	1,373.520	5,766,036.96	
CONOCOPHILLIPS	148,619	111.590	16,584,394.21	
CONSOLIDATED EDISON INC	42,930	111.920	4,804,725.60	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	17,719	154.640	2,740,066.16	
CONSTELLATION ENERGY	37,179	291.660	10,843,627.14	
COOPER COS INC/THE	23,658	83.680	1,979,701.44	
COPART INC	109,403	37.650	4,119,022.95	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	34,041	30.070	1,023,612.87	
COREWEAVE INC-CL A	20,480	97.140	1,989,427.20	
CORNING INC	96,850	129.990	12,589,531.50	
CORTEVA INC	80,833	77.020	6,225,757.66	
COSTAR GROUP INC	50,439	49.070	2,475,041.73	
COSTCO WHOLESALE CORP	52,748	987.820	52,105,529.36	
COTERRA ENERGY INC	90,803	31.710	2,879,363.13	
CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDI	18,528	130.660	2,420,868.48	
CRH PLC	80,042	125.490	10,044,470.58	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	29,870	422.140	12,609,321.80	
CSX CORP	221,865	41.680	9,247,333.20	
CUMMINS INC	16,397	596.910	9,787,533.27	
CVS HEALTH CORP	150,978	77.320	11,673,618.96	
DANAHER CORP	76,706	211.250	16,204,142.50	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,855	212.980	2,950,837.90	
DATADOG INC - CLASS A	36,557	120.600	4,408,774.20	
DECKERS OUTDOOR CORP	17,648	118.070	2,083,699.36	
DEERE & CO	30,569	662.000	20,236,678.00	

DELL TECHNOLOGIES -C	38,619	119.060	4,597,978.14	
DELTA AIR LINES INC	19,429	67.440	1,310,291.76	
DEVON ENERGY CORPORATION	71,650	44.660	3,199,889.00	
DEXCOM INC	46,680	72.270	3,373,563.60	
DIAMONDBACK ENERGY INC	22,362	174.720	3,907,088.64	
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,866	202.740	1,594,752.84	
DOCUSIGN INC	23,943	44.120	1,056,365.16	
DOLLAR GENERAL CORP	26,206	151.790	3,977,808.74	
DOLLAR TREE INC	23,062	133.570	3,080,391.34	
DOMINION ENERGY INC	101,587	65.460	6,649,885.02	
DOMINO'S PIZZA INC	3,823	385.130	1,472,351.99	
DOORDASH INC - A	45,494	176.190	8,015,587.86	
DOVER CORP	16,314	232.520	3,793,331.28	
DOW INC	84,518	31.390	2,653,020.02	
DR HORTON INC	31,925	163.780	5,228,676.50	
DRAFTKINGS INC	53,196	22.490	1,196,378.04	
DTE ENERGY COMPANY	24,714	145.030	3,584,271.42	
DUKE ENERGY CORP	92,558	126.370	11,696,554.46	
DUPONT DE NEMOURS INC	49,789	50.240	2,501,399.36	
DYNATRACE INC	35,901	36.280	1,302,488.28	
EATON CORP PLC	46,332	377.320	17,481,990.24	
EBAY INC	54,385	84.750	4,609,128.75	
ECHOSTAR CORP	16,755	114.840	1,924,144.20	
ECOLAB INC	30,379	301.000	9,144,079.00	
EDISON INTERNATIONAL	45,825	72.660	3,329,644.50	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	69,873	78.920	5,514,377.16	
ELECTRONIC ARTS INC	28,291	199.880	5,654,805.08	
ELEVANCE HEALTH, INC	26,807	348.180	9,333,661.26	
ELI LILLY & CO	95,754	1,023.220	97,977,407.88	
EMCOR GROUP INC	5,322	803.550	4,276,493.10	
EMERSON ELECTRIC CO	66,993	151.300	10,136,040.90	
ENTEGRIS INC	18,053	132.670	2,395,091.51	
ENERGY CORP	53,108	103.330	5,487,649.64	
EOG RESOURCES INC	64,946	123.870	8,044,861.02	
EQT CORP	74,260	59.770	4,438,520.20	
EQUIFAX INC	14,733	195.300	2,877,354.90	
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,609	44.350	1,579,259.15	
ERIE INDEMNITY COMPANY- CL A	3,024	274.630	830,481.12	
ESSENTIAL UTILITIES INC	33,434	39.090	1,306,935.06	
ESTEE LAUDER COS INC	27,955	111.740	3,123,691.70	
EVEREST GROUP LTD	4,992	342.930	1,711,906.56	
EVERGY INC	27,405	79.530	2,179,519.65	
EVERSOURCE ENERGY	44,189	73.670	3,255,403.63	
EXELON CORP	120,213	47.360	5,693,287.68	
EXPAND ENERGY CORPORATION	28,343	103.850	2,943,420.55	

EXPEDIA GROUP INC	14,064	199.760	2,809,424.64	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	16,142	150.700	2,432,599.40	
EXXON MOBIL CORP	507,417	150.970	76,604,744.49	
F5 INC	6,837	279.190	1,908,822.03	
FAIR ISAAC CORP	2,856	1,352.730	3,863,396.88	
FASTENAL CO	136,624	46.210	6,313,395.04	
FEDEX CORP	26,678	383.140	10,221,408.92	
FERGUSON ENTERPRISES INC	23,326	257.840	6,014,375.84	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30,731	54.210	1,665,927.51	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	62,191	49.000	3,047,359.00	
FIFTH THIRD BANCORP	78,803	52.900	4,168,678.70	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,064	2,045.300	2,176,199.20	
FIRST SOLAR INC	12,126	233.300	2,828,995.80	
FIRSTENERGY CORP	65,336	49.570	3,238,705.52	
FISERV INC	64,680	61.530	3,979,760.40	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,983	347.200	2,771,697.60	
FLEX LTD	44,468	65.110	2,895,311.48	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	19,893	122.160	2,430,128.88	
FORD MOTOR CO	465,383	13.780	6,412,977.74	
FORTINET INC	77,523	81.670	6,331,303.41	
FORTIVE CORP	40,269	57.860	2,329,964.34	
FOX CORP - CLASS A	25,043	56.160	1,406,414.88	
FOX CORP- CLASS B	18,132	51.470	933,254.04	
FREEMONT-MCMORAN INC	170,871	62.570	10,691,398.47	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,761	153.500	1,037,813.50	
GARMIN LTD	19,474	239.800	4,669,865.20	
GARTNER INC	9,015	156.940	1,414,814.10	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	54,322	83.010	4,509,269.22	
GE VERNOVA INC	32,400	834.610	27,041,364.00	
GEN DIGITAL INC	62,366	22.340	1,393,256.44	
GENERAL DYNAMICS CORP	27,217	354.340	9,644,071.78	
GENERAL ELECTRIC CO	126,211	334.740	42,247,870.14	
GENERAL MILLS INC	63,606	44.800	2,849,548.80	
GENERAL MOTORS CO	113,282	81.470	9,229,084.54	
GENUINE PARTS CO	16,581	119.370	1,979,273.97	
GILEAD SCIENCES INC	147,700	151.120	22,320,424.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,883	80.250	2,317,860.75	
GODADDY INC - CLASS A	16,473	88.670	1,460,660.91	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	36,026	916.650	33,023,232.90	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	282,101	4.400	1,241,244.40	
GRACO INC	19,752	93.020	1,837,331.04	
HALLIBURTON CO	101,491	35.370	3,589,736.67	

HARTFORD INSURANCE GROUP INC	33,421	140.310	4,689,300.51	
HCA HEALTHCARE INC	19,493	528.660	10,305,169.38	
HEICO CORP	5,245	345.990	1,814,717.55	
HEICO CORP-CLASS A	9,013	260.200	2,345,182.60	
HERSHEY CO/THE	17,636	219.910	3,878,332.76	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	157,051	21.390	3,359,320.89	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	27,985	312.730	8,751,749.05	
HOLOGIC INC	26,463	75.140	1,988,429.82	
HOME DEPOT INC	118,485	378.580	44,856,051.30	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	75,582	240.770	18,197,878.14	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	129,200	8.550	1,104,660.00	
HORMEL FOODS CORP	36,209	24.550	888,930.95	
HOWMET AEROSPACE INC	45,574	251.300	11,452,746.20	
HP INC	111,303	18.340	2,041,297.02	
HUBBELL INC	6,322	526.560	3,328,912.32	
HUBSPOT INC	5,960	239.370	1,426,645.20	
HUMANA INC	14,318	190.500	2,727,579.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	187,111	17.850	3,339,931.35	
HYATT HOTELS CORP - CL A	5,031	167.960	845,006.76	
IDEX CORP	8,977	207.860	1,865,959.22	
IDEXX LABORATORIES INC	9,523	630.730	6,006,441.79	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	32,978	293.820	9,689,595.96	
ILLUMINA INC	18,296	120.000	2,195,520.00	
INCYTE CORP	19,754	101.730	2,009,574.42	
INGERSOLL-RAND INC	47,284	96.200	4,548,720.80	
INSMED INC	25,161	161.000	4,050,921.00	
INSULET CORP	8,378	249.100	2,086,959.80	
INTEL CORP	537,924	44.620	24,002,168.88	
INTERACTIVE BROKERS GRO- CL A	52,959	73.990	3,918,436.41	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	68,129	154.110	10,499,360.19	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	17,216	142.300	2,449,836.80	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	110,875	256.280	28,415,045.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	30,522	81.620	2,491,205.64	
INTERNATIONAL PAPER CO	59,736	46.860	2,799,228.96	
INTUIT INC	33,187	381.540	12,662,167.98	
INTUITIVE SURGICAL INC	42,667	499.530	21,313,446.51	
IONQ INC	35,153	33.430	1,175,164.79	
IQVIA HOLDINGS INC	20,232	169.360	3,426,491.52	

JABIL CIRCUIT INC	12,769	262.440	3,351,096.36	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,664	161.140	1,396,116.96	
JACOBS SOLUTIONS INC	14,213	139.310	1,980,013.03	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	19,300	78.210	1,509,453.00	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,213	225.720	2,079,558.36	
JM SMUCKER CO	12,729	109.570	1,394,716.53	
JOHNSON & JOHNSON	286,665	246.910	70,780,455.15	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	77,882	142.700	11,113,761.40	
JPMORGAN CHASE & CO	327,282	308.050	100,819,220.10	
KENVUE INC	228,545	18.660	4,264,649.70	
KEURIG DR PEPPER INC	153,648	29.100	4,471,156.80	
KEYCORP	111,095	21.790	2,420,760.05	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	20,456	239.540	4,900,030.24	
KIMBERLY-CLARK CORP	39,525	108.680	4,295,577.00	
KINDER MORGAN INC	238,046	32.540	7,746,016.84	
KKR & CO INC -A	74,218	101.640	7,543,517.52	
KLA CORPORATION	15,706	1,469.900	23,086,249.40	
KRAFT HEINZ CO/THE	105,957	23.990	2,541,908.43	
KROGER CO	74,921	67.630	5,066,907.23	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	22,278	358.700	7,991,118.60	
LABCORP HOLDINGS INC	9,890	282.480	2,793,727.20	
LAM RESEARCH CORP	150,090	237.390	35,629,865.10	
LAS VEGAS SANDS CORP	36,767	58.090	2,135,795.03	
LEIDOS HOLDINGS INC	14,496	176.270	2,555,209.92	
LENNAR CORP-CL A	25,297	116.120	2,937,487.64	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,762	550.320	2,070,303.84	
LIBERTY MEDIA CORP- FORMULA-C	25,283	90.110	2,278,251.13	
LINDE PLC	55,810	490.110	27,353,039.10	
LIVE NATION INC	19,289	157.460	3,037,245.94	
LOCKHEED MARTIN CORP	25,015	666.510	16,672,747.65	
LOEWS CORP	20,914	108.350	2,266,031.90	
LOWE'S COS INC	66,755	278.180	18,569,905.90	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9,520	327.920	3,121,798.40	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,832	182.880	2,346,716.16	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	30,746	55.330	1,701,176.18	
M&T BANK CORP	18,599	229.110	4,261,216.89	
MARATHON PETROLEUM CORP	36,160	196.470	7,104,355.20	
MARKEL GROUP INC	1,505	2,067.690	3,111,873.45	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	27,461	349.890	9,608,329.29	
MARSH & MCLENNAN COS INC	58,574	178.870	10,477,131.38	

MARTIN MARIETTA MATERIALS	7,175	675.400	4,845,995.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	102,613	79.610	8,169,020.93	
MASCO CORP	24,909	75.070	1,869,918.63	
MASTERCARD INC-CLASS A	101,463	520.260	52,787,140.38	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	30,174	68.490	2,066,617.26	
MCDONALD'S CORP	84,947	327.110	27,787,013.17	
MCKESSON CORP	14,804	937.140	13,873,420.56	
MEDTRONIC PLC	152,693	97.580	14,899,782.94	
MERCADOLIBRE INC	5,431	1,996.550	10,843,263.05	
MERCK & CO INC	297,321	121.860	36,231,537.06	
META PLATFORMS INC-A	258,263	644.780	166,522,817.14	
METLIFE INC	67,259	78.100	5,252,927.90	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,451	1,376.530	3,373,875.03	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	64,269	77.160	4,958,996.04	
MICRON TECHNOLOGY INC	133,600	417.350	55,757,960.00	
MICROSOFT CORP	840,504	398.460	334,907,223.84	
MICROSTRATEGY INC-CL A	31,071	129.450	4,022,140.95	
MONDAY.COM LTD	5,137	76.000	390,412.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	154,050	58.640	9,033,492.00	
MONGODB INC	9,686	355.890	3,447,150.54	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,700	1,175.220	6,698,754.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	87,143	81.990	7,144,854.57	
MOODY'S CORP	19,215	449.290	8,633,107.35	
MORGAN STANLEY	142,483	174.370	24,844,760.71	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19,836	453.680	8,999,196.48	
MSCI INC	9,209	541.120	4,983,174.08	
NASDAQ INC	54,624	81.410	4,446,939.84	
NATERA INC	15,519	216.360	3,357,690.84	
NEBIUS GROUP NV	25,252	107.610	2,717,367.72	
NETAPP INC	23,761	101.600	2,414,117.60	
NETFLIX INC	505,767	77.000	38,944,059.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,805	130.100	1,535,830.50	
NEWMONT CORP	130,714	125.400	16,391,535.60	
NEWS CORP - CLASS A	44,745	23.360	1,045,243.20	
NEXTERA ENERGY INC	245,104	91.640	22,461,330.56	
NIKE INC	141,583	65.610	9,289,260.63	
NISOURCE INC	56,025	45.820	2,567,065.50	
NORDSON CORP	6,358	293.930	1,868,806.94	
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,706	314.050	8,387,019.30	
NORTHERN TRUST CORP	22,743	145.020	3,298,189.86	
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,193	736.870	11,932,135.91	
NRG ENERGY INC	23,011	175.010	4,027,155.11	
NUCOR CORP	27,324	180.040	4,919,412.96	

NUTANIX INC - A	30,405	41.320	1,256,334.60	
NVIDIA CORP	2,892,321	187.900	543,467,115.90	
NVR INC	324	7,526.140	2,438,469.36	
NXP SEMICONDUCTORS NV	30,011	232.110	6,965,853.21	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	100,982	94.170	9,509,474.94	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	87,849	51.530	4,526,858.97	
OKLO INC	13,174	67.640	891,089.36	
OKTA INC	20,060	81.800	1,640,908.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	22,505	195.170	4,392,300.85	
OMNICOM GROUP	23,073	80.940	1,867,528.62	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	48,681	68.090	3,314,689.29	
ONEOK INC	74,988	86.880	6,514,957.44	
ORACLE CORP	203,590	156.540	31,869,978.60	
OTIS WORLDWIDE CORP	46,729	93.040	4,347,666.16	
PACCAR INC	62,527	124.900	7,809,622.30	
PACKAGING CORP OF AMERICA	10,709	238.950	2,558,915.55	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	270,860	134.890	36,536,305.40	
PALO ALTO NETWORKS INC	93,780	150.990	14,159,842.20	
PARKER HANNIFIN CORP	15,061	1,012.440	15,248,358.84	
PAYCHEX INC	38,592	92.340	3,563,585.28	
PAYCOM SOFTWARE INC	6,025	120.720	727,338.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	108,026	41.730	4,507,924.98	
PENTAIR PLC	19,494	100.480	1,958,757.12	
PEPSICO INC	162,774	164.590	26,790,972.66	
PFIZER INC	676,982	26.860	18,183,736.52	
PG&E CORP	261,515	18.100	4,733,421.50	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	185,287	183.500	34,000,164.50	
PHILLIPS 66	48,092	155.410	7,473,977.72	
PINTEREST INC- CLASS A	71,408	16.770	1,197,512.16	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	46,881	230.300	10,796,694.30	
PPG INDUSTRIES INC	26,882	124.250	3,340,088.50	
PPL CORPORATION	87,984	36.970	3,252,768.48	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,516	92.150	2,443,449.40	
PROCTER & GAMBLE CO	278,600	158.560	44,174,816.00	
PROGRESSIVE CORP	69,765	201.770	14,076,484.05	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	41,919	102.710	4,305,500.49	
PTC INC	14,257	154.395	2,201,209.51	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	59,385	85.680	5,088,106.80	
PULTE GROUP INC	23,456	139.610	3,274,692.16	

PURE STORAGE INC - CLASS A	37,155	73.590	2,734,236.45	
QNTY ELECTRONICS INC	24,901	112.860	2,810,326.86	
QUALCOMM INC	127,761	141.270	18,048,796.47	
QUANTA SERVICES INC	17,731	554.000	9,822,974.00	
QUEST DIAGNOSTICS	13,311	202.440	2,694,678.84	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	22,527	158.030	3,559,941.81	
REDDIT INC-CL A	12,027	146.130	1,757,505.51	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,400	782.380	9,701,512.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	106,197	29.720	3,156,174.84	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	6,263	327.280	2,049,754.64	
REPUBLIC SERVICES INC	26,008	221.630	5,764,153.04	
RESMED INC	17,370	256.290	4,451,757.30	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	93,606	15.590	1,459,317.54	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	87,501	75.650	6,619,450.65	
ROBLOX CORP -CLASS A	69,221	64.440	4,460,601.24	
ROCKET COS INC-CLASS A	109,253	18.350	2,004,792.55	
ROCKET LAB CORP	52,041	76.580	3,985,299.78	
ROCKWELL AUTOMATION INC	13,385	395.380	5,292,161.30	
ROLLINS INC	34,618	60.920	2,108,928.56	
ROPER TECHNOLOGIES INC	12,813	332.000	4,253,916.00	
ROSS STORES INC	38,709	200.380	7,756,509.42	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	30,708	310.350	9,530,227.80	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	48,892	45.110	2,205,518.12	
RPM INTERNATIONAL INC	15,258	114.460	1,746,430.68	
RTX CORPORATION	159,321	205.410	32,726,126.61	
S&P GLOBAL INC	37,193	416.670	15,497,207.31	
SALESFORCE INC	113,318	185.290	20,996,692.22	
SAMSARA INC-CL A	41,396	26.800	1,109,412.80	
SEA LTD-ADR	45,529	114.600	5,217,623.40	
SEAGATE TECHNOLOGY	25,345	408.970	10,365,344.65	
SEMPRA	77,656	92.970	7,219,678.32	
SERVICENOW INC	123,790	107.370	13,291,332.30	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	28,193	357.610	10,082,098.73	
SLB LTD	177,827	51.540	9,165,203.58	
SMURFIT WESTROCK PLC	62,213	49.780	3,096,963.14	
SNAP INC - A	128,221	5.000	641,105.00	
SNAP-ON INC	6,210	383.870	2,383,832.70	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	38,313	179.200	6,865,689.60	
SOFI TECHNOLOGIES INC	142,526	19.300	2,750,751.80	
SOLVENTUM CORP	18,521	73.610	1,363,330.81	
SOUTHERN CO	130,924	95.050	12,444,326.20	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	18,609	485.290	9,030,761.61	

SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	26,147	71.370	1,866,111.39	
STARBUCKS CORP	135,322	95.800	12,963,847.60	
STATE STREET CORP	33,741	127.870	4,314,461.67	
STEEL DYNAMICS INC	16,636	190.580	3,170,488.88	
STERIS PLC	11,727	251.180	2,945,587.86	
STRYKER CORP	40,954	372.660	15,261,917.64	
SUPER MICRO COMPUTER INC	63,655	32.160	2,047,144.80	
SYNCHRONY FINANCIAL	44,237	72.260	3,196,565.62	
SYNOPSYS INC	22,109	442.440	9,781,905.96	
SYSCO CORP	56,989	89.670	5,110,203.63	
T ROWE PRICE GROUP INC	26,193	94.360	2,471,571.48	
T-MOBILE US INC	60,351	215.300	12,993,570.30	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	21,963	201.370	4,422,689.31	
TAPESTRY INC	24,878	152.300	3,788,919.40	
TARGA RESOURCES CORP	25,605	224.160	5,739,616.80	
TARGET CORP	54,111	115.660	6,258,478.26	
TE CONNECTIVITY PLC	35,169	232.400	8,173,275.60	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,582	666.350	3,719,565.70	
TERADYNE INC	18,932	315.900	5,980,618.80	
TESLA, INC.	336,411	411.710	138,503,772.81	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	136,458	34.330	4,684,603.14	
TEXAS INSTRUMENTS INC	108,225	218.050	23,598,461.25	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	6,972	486.560	3,392,296.32	
TEXTRON INC	21,191	99.030	2,098,544.73	
THE CIGNA GROUP	31,773	285.920	9,084,536.16	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	44,944	515.120	23,151,553.28	
TJX COS INC	132,468	156.510	20,732,566.68	
TOAST INC-CLASS A	54,650	27.640	1,510,526.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	63,092	51.960	3,278,260.32	
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	53,042	25.240	1,338,780.08	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	13,855	118.950	1,648,052.25	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26,481	463.690	12,278,974.89	
TRANSDIGM GROUP INC	6,688	1,330.130	8,895,909.44	
TRANSUNION	23,170	76.120	1,763,700.40	
TRAVELERS COS INC/THE	26,785	299.900	8,032,821.50	
TRIMBLE INC	28,304	67.390	1,907,406.56	
TRUIST FINANCIAL CORP	153,502	51.780	7,948,333.56	
TWILIO INC - A	18,261	110.960	2,026,240.56	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,150	319.550	1,645,682.50	
TYSON FOODS INC-CL A	34,060	64.330	2,191,079.80	
UBER TECHNOLOGIES INC	235,789	72.940	17,198,449.66	
ULTA BEAUTY INC	5,336	692.790	3,696,727.44	

UNION PACIFIC CORP	70,602	262.970	18,566,207.94	
UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC.	9,627	110.050	1,059,451.35	
UNITED PARCEL SERVICE INC	87,644	115.540	10,126,387.76	
UNITED RENTALS INC	7,657	888.980	6,806,919.86	
UNITED THERAPEUTICS CORP	5,113	480.520	2,456,898.76	
UNITEDHEALTH GROUP INC	107,802	289.930	31,255,033.86	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,704	230.000	1,541,920.00	
US BANCORP	185,293	57.890	10,726,611.77	
VALERO ENERGY CORP	36,956	199.240	7,363,113.44	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	18,534	182.570	3,383,752.38	
VERALTO CORP	29,518	93.980	2,774,101.64	
VERISIGN INC	10,012	216.620	2,168,799.44	
VERISK ANALYTICS INC	16,626	183.890	3,057,355.14	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	502,499	48.640	24,441,551.36	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	30,519	469.270	14,321,651.13	
VERTIV HOLDINGS CO	43,169	243.060	10,492,657.14	
VISA INC-CLASS A SHARES	202,193	318.930	64,485,413.49	
VISTRA CORP	40,317	172.500	6,954,682.50	
VULCAN MATERIALS CO	15,724	302.850	4,762,013.40	
WABTEC CORP	20,334	261.880	5,325,067.92	
WALMART INC	521,902	124.870	65,169,902.74	
WALT DISNEY CO	214,005	106.000	22,684,530.00	
WARNER BROS DISCOVERY INC	279,966	28.530	7,987,429.98	
WASTE CONNECTIONS INC	30,645	166.060	5,088,908.70	
WASTE MANAGEMENT INC	47,949	233.420	11,192,255.58	
WATERS CORP	11,702	328.660	3,845,979.32	
WATSCO INC	4,159	409.560	1,703,360.04	
WEC ENERGY GROUP INC	38,310	114.220	4,375,768.20	
WELLS FARGO & CO	381,267	87.570	33,387,551.19	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,559	243.830	2,086,940.97	
WESTERN DIGITAL CORP	41,287	284.670	11,753,170.29	
WEYERHAEUSER CO	85,934	25.550	2,195,613.70	
WILLIAMS COS INC	145,341	72.170	10,489,259.97	
WILLIAMS-SONOMA INC	14,492	210.820	3,055,203.44	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,606	301.010	3,493,522.06	
WIX.COM LTD	6,625	66.720	442,020.00	
WORKDAY INC-CLASS A	25,833	140.020	3,617,136.66	
WR BERKLEY CORP	36,098	70.340	2,539,133.32	
WW GRAINGER INC	5,408	1,127.730	6,098,763.84	
XCEL ENERGY INC	70,396	80.820	5,689,404.72	
XYLEM INC	28,983	129.210	3,744,893.43	

	YUM! BRANDS INC	33,048	163.480	5,402,687.04	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP- CL A	6,049	251.740	1,522,775.26	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	19,916	45.550	907,173.80	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	23,577	99.250	2,340,017.25	
	ZOETIS INC	52,759	127.280	6,715,165.52	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	30,230	90.960	2,749,720.80	
	ZSCALER INC	12,249	168.990	2,069,958.51	
アメリカ・ドル	小計	43,894,213		7,001,429,838.98 (1,086,271,839,520)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	118,147	33.880	4,002,820.36	
	ADMIRAL GROUP PLC	31,063	28.300	879,082.90	
	ANGLO AMERICAN PLC	130,603	35.780	4,672,975.34	
	ANTOFAGASTA PLC	46,847	38.750	1,815,321.25	
	ASHTREAD GROUP PLC	50,164	51.060	2,561,373.84	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	38,311	19.765	757,216.91	
	ASTRAZENECA PLC	184,570	152.900	28,220,753.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	102,948	4.733	487,252.88	
	AVIVA PLC	364,101	6.428	2,340,441.22	
	BAE SYSTEMS PLC	357,693	21.630	7,736,899.59	
	BARCLAYS PLC	1,660,789	4.679	7,770,831.73	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	162,300	3.770	611,871.00	
	BP PLC	1,872,465	4.790	8,969,107.35	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	260,215	44.730	11,639,416.95	
	BT GROUP PLC	717,213	2.031	1,456,659.60	
	BUNZL PLC	38,676	21.180	819,157.68	
	CENTRICA PLC	560,809	1.859	1,042,543.93	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	25,929	47.220	1,224,367.38	
	COMPASS GROUP PLC	202,021	21.950	4,434,360.95	
	DCC PLC	11,575	52.000	601,900.00	
	DIAGEO PLC	265,053	17.815	4,721,919.19	
	ENDEAVOUR MINING PLC	22,926	47.140	1,080,731.64	
	ENTAIN PLC	72,410	5.824	421,715.84	
	EXPERIAN PLC	109,173	25.760	2,812,296.48	
	FRESNILLO PLC	26,179	38.660	1,012,080.14	
	GLENCORE PLC	1,196,420	5.050	6,041,921.00	
	GSK PLC	483,797	22.260	10,769,321.22	
	HALEON PLC	1,059,948	4.071	4,315,048.30	
	HALMA PLC	45,164	39.240	1,772,235.36	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	19,807	16.400	324,834.80	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,048,912	12.816	26,258,856.19	
	IMPERIAL BRANDS PLC	91,091	32.000	2,914,912.00	
	INFORMA PLC	153,969	8.224	1,266,241.05	

INTERTEK GROUP PLC	18,387	44.900	825,576.30	
JD SPORTS FASHION PLC	299,367	0.784	234,703.72	
KINGFISHER PLC	207,048	3.571	739,368.40	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	681,336	2.724	1,855,959.26	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,045,470	1.020	7,186,379.40	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	55,608	77.780	4,325,190.24	
M&G PLC	273,505	3.187	871,660.43	
MAGNUM ICE CREAM CO BV/THE	58,367	11.965	698,361.15	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	244,465	3.968	970,037.12	
MELROSE INDUSTRIES PLC	150,119	6.654	998,891.82	
NATIONAL GRID PLC	590,468	13.425	7,927,032.90	
NATWEST GROUP PLC	956,154	6.172	5,901,382.48	
NEXT PLC	13,837	129.900	1,797,426.30	
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75	
PEARSON PLC	68,512	9.234	632,639.80	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	84,440	7.610	642,588.40	
PRUDENTIAL PLC	304,891	11.140	3,396,485.74	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	77,143	64.560	4,980,352.08	
RELX PLC	217,196	22.930	4,980,304.28	
RENTOKIL INITIAL PLC	300,762	4.624	1,390,723.48	
RIO TINTO PLC	134,361	71.180	9,563,815.98	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,001,579	13.240	13,260,905.96	
SAGE GROUP PLC	114,724	8.066	925,363.78	
SAINSBURY (J) PLC	204,775	3.546	726,132.15	
SCHRODERS PLC	86,594	5.860	507,440.84	
SEVERN TRENT PLC	32,275	31.290	1,009,884.75	
SHELL PLC-NEW	689,273	29.440	20,292,197.12	
SMITH & NEPHEW PLC	95,930	13.175	1,263,877.75	
SMITHS GROUP PLC	38,798	26.560	1,030,474.88	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,777	78.050	685,044.85	
SSE PLC	143,445	25.500	3,657,847.50	
STANDARD CHARTERED PLC	231,488	17.840	4,129,745.92	
TESCO PLC	773,363	4.968	3,842,067.38	
UNILEVER PLC	259,410	53.200	13,800,612.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	81,148	13.355	1,083,731.54	
VALTERRA PLATINUM LIMITED	15,173	68.000	1,031,764.00	
VODAFONE GROUP PLC	2,295,336	1.154	2,648,817.74	
WHITBREAD PLC	20,609	27.370	564,068.33	
WISE PLC - A	79,288	8.565	679,101.72	
イギリス・ボンド 小計	30,489,467		286,814,429.31	

				(59,909,797,994)	
イスラエル・シュケル	AZRIELI GROUP	5,065	461.300	2,336,484.50	
	BANK HAPOALIM BM	148,865	81.160	12,081,883.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	177,228	77.490	13,733,397.72	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,311	2,251.000	7,453,061.00	
	ICL GROUP LTD	92,372	16.920	1,562,934.24	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	145,649	39.430	5,742,940.07	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	18,585	248.900	4,625,806.50	
	NICE LTD	7,348	342.000	2,513,016.00	
	NOVA LTD	3,502	1,403.000	4,913,306.00	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	27,218	167.000	4,545,406.00	
イスラエル・シュケル 小計	629,143		59,508,235.43 (2,942,003,848)		
オーストラリア・ドル	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	355,178	40.070	14,231,982.46	
	APA GROUP	157,383	9.010	1,418,020.83	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	66,047	50.330	3,324,145.51	
	ASX LTD	23,163	54.920	1,272,111.96	
	BHP GROUP LIMITED	604,533	53.230	32,179,291.59	
	BRAMBLES LTD	162,124	24.380	3,952,583.12	
	CARSALES.COM LTD	45,106	25.660	1,157,419.96	
	COCHLEAR LTD	7,783	199.940	1,556,133.02	
	COLES GROUP LTD	159,806	21.870	3,494,957.22	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	199,180	178.190	35,491,884.20	
	COMPUTERSHARE LIMITED	61,938	31.220	1,933,704.36	
	CSL LIMITED	57,758	154.190	8,905,706.02	
	EVOLUTION MINING LTD	241,308	14.940	3,605,141.52	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	201,669	20.310	4,095,897.39	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	281,540	6.960	1,959,518.40	
	LOTTERY CORP LTD/THE	265,149	5.580	1,479,531.42	
	LYNAS RARE EARTHS LTD	107,743	15.610	1,681,868.23	
	MACQUARIE GROUP LTD	43,097	223.000	9,610,631.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	328,128	4.520	1,483,138.56	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	364,594	48.280	17,602,598.32	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	161,642	28.360	4,584,167.12	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	205,072	12.140	2,489,574.08	
	PRO MEDICUS LTD	6,833	129.160	882,550.28	
	QANTAS AIRWAYS LTD	88,283	10.740	948,159.42	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	179,781	20.060	3,606,406.86	
	REA GROUP LTD	6,289	163.020	1,025,232.78	
RIO TINTO LTD	44,185	168.550	7,447,381.75		
SANTOS LTD	386,565	7.000	2,705,955.00		
SGH LTD	24,169	47.810	1,155,519.89		

	SIGMA HEALTHCARE LTD	617,990	2.980	1,841,610.20	
	SONIC HEALTHCARE LTD	56,158	23.340	1,310,727.72	
	SOUTH32 LTD	535,229	4.410	2,360,359.89	
	SUNCORP GROUP LTD	128,859	15.250	1,965,099.75	
	TELSTRA GROUP LTD	478,838	5.140	2,461,227.32	
	TRANSURBAN GROUP	371,065	13.880	5,150,382.20	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON	40,739	38.010	1,548,489.39	
	WESFARMERS LIMITED	135,057	84.240	11,377,201.68	
	WESTPAC BANKING CORP	407,112	41.890	17,053,921.68	
	WISETECH GLOBAL LTD	23,994	48.960	1,174,746.24	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	226,310	27.100	6,133,001.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	145,484	31.960	4,649,668.64	
	XERO LTD	19,690	80.550	1,586,029.50	
	オーストラリア・ドル 小計	8,022,571		233,893,677.48 (25,602,001,937)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	59,876	307.510	18,412,468.76	
	ALAMOS GOLD INC-CLASS A	50,066	62.800	3,144,144.80	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	89,099	84.140	7,496,789.86	
	ALTAGAS LTD	35,877	45.100	1,618,052.70	
	ARC RESOURCES LTD	69,359	24.950	1,730,507.05	
	ATKINSREALIS GROUP INC	19,749	95.450	1,885,042.05	
	BANK OF MONTREAL	85,202	196.750	16,763,493.50	
	BANK OF NOVA SCOTIA	147,926	104.340	15,434,598.84	
	BARRICK MINING CORPORATION	202,744	66.560	13,494,640.64	
	BCE INC	9,971	35.010	349,084.71	
	BOMBARDIER INC-B	10,482	275.840	2,891,354.88	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	48,869	68.570	3,350,947.33	
	BROOKFIELD CORPORATION-A	245,368	63.250	15,519,526.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,471	58.170	958,118.07	
	CAE INC	36,419	40.670	1,481,160.73	
	CAMECO CORP	51,832	163.110	8,454,317.52	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	110,773	134.470	14,895,645.31	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	62,722	149.930	9,403,909.46	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	248,846	58.230	14,490,302.58	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	108,053	116.000	12,534,148.00	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	6,034	182.530	1,101,386.02	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	16,428	46.840	769,487.52	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	17,534	87.890	1,541,063.26	
	CELESTICA INC	13,693	399.590	5,471,585.87	

CENOVUS ENERGY INC	168,922	31.680	5,351,448.96	
CGI INC	23,433	101.010	2,366,967.33	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,399	2,415.330	5,794,376.67	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	10,293	90.440	930,898.92	
DOLLARAMA INC	32,696	193.440	6,324,714.24	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	48,074	33.760	1,622,978.24	
EMERA INC	35,966	70.140	2,522,655.24	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,096	49.570	748,308.72	
ENBRIDGE INC	259,902	70.650	18,362,076.30	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,483	2,325.980	5,775,408.34	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	84,480	36.410	3,075,916.80	
FIRSTSERVICE CORP	4,923	213.720	1,052,143.56	
FORTIS INC	60,353	77.380	4,670,115.14	
FRANCO-NEVADA CORP	22,964	349.380	8,023,162.32	
GEORGE WESTON LTD	20,781	102.050	2,120,701.05	
GFL ENVIRONMENTAL INC- SUB VT	29,155	59.560	1,736,471.80	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	16,911	97.330	1,645,947.63	
GREAT-WEST LIFECO INC	33,249	63.760	2,119,956.24	
HYDRO ONE LTD	39,595	56.840	2,250,579.80	
IA FINANCIAL CORP INC	11,036	149.850	1,653,744.60	
IGM FINANCIAL INC	10,121	65.800	665,961.80	
IMPERIAL OIL LTD	20,718	167.970	3,480,002.46	
INTACT FINANCIAL CORP	21,212	263.300	5,585,119.60	
IVANHOE MINES LTD-CL A	93,090	15.600	1,452,204.00	
KEYERA CORP	27,536	51.570	1,420,031.52	
KINROSS GOLD CORP	144,289	45.820	6,611,321.98	
LOBLAW COS LTD	71,179	68.580	4,881,455.82	
LUNDIN GOLD INC	12,925	109.000	1,408,825.00	
LUNDIN MINING CORP	81,618	35.660	2,910,497.88	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,002	91.390	2,924,662.78	
MANULIFE FINANCIAL CORP	201,990	49.570	10,012,644.30	
METRO INC	24,471	98.430	2,408,680.53	
NATIONAL BANK OF CANADA	46,772	176.530	8,256,661.16	
NUTRIEN LTD	57,897	98.290	5,690,696.13	
OPEN TEXT CORP	30,264	33.890	1,025,646.96	
PAN AMERICAN SILVER CORP	50,287	83.850	4,216,564.95	
PEMBINA PIPELINE CORP	69,416	59.510	4,130,946.16	
POWER CORP OF CANADA	66,329	65.920	4,372,407.68	
RB GLOBAL INC	22,149	142.010	3,145,379.49	
RESTAURANT BRANDS INTERN	37,201	93.860	3,491,685.86	
ROGERS COMMUNICATIONS INC	43,807	52.320	2,291,982.24	
ROYAL BANK OF CANADA	167,362	233.960	39,156,013.52	

	SAPUTO INC	29,621	42.130	1,247,932.73	
	SHOPIFY INC - CLASS A	145,468	169.610	24,672,827.48	
	STANTEC INC	13,643	122.450	1,670,585.35	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	66,952	89.470	5,990,195.44	
	SUNCOR ENERGY INC	144,131	77.770	11,209,067.87	
	TC ENERGY CORP	123,949	85.630	10,613,752.87	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	54,471	81.280	4,427,402.88	
	TFI INTERNATIONAL INC	9,340	162.430	1,517,096.20	
	THOMSON REUTERS CORP	18,741	116.670	2,186,512.47	
	TMX GROUP LTD	33,317	46.330	1,543,576.61	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,750	204.540	1,994,265.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	202,594	131.270	26,594,514.38	
	TOURMALINE OIL CORP	43,911	63.090	2,770,344.99	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	54,055	199.100	10,762,350.50	
	WHITECAP RESOURCES INC	145,538	13.770	2,004,058.26	
	WSP GLOBAL INC	15,600	227.020	3,541,512.00	
カナダ・ドル 小計		5,129,820		483,625,734.21 (54,814,140,715)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	280,200	3.150	882,630.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	253,320	57.620	14,596,298.40	
	KEPPEL CORP LTD	173,400	12.860	2,229,924.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	403,100	21.590	8,702,929.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	106,200	6.340	673,308.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	186,800	6.980	1,303,864.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	101,900	18.120	1,846,428.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	185,900	10.220	1,899,898.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	887,600	4.980	4,420,248.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	149,200	38.660	5,768,072.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	229,500	3.570	819,315.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	307,200	3.640	1,118,208.00	
シンガポール・ドル 小計		3,264,320		44,261,122.40 (5,414,020,492)	
スイス・フラン	ABB LTD	186,486	69.920	13,039,101.12	
	ALCON INC	59,455	63.920	3,800,363.60	
	AVOLTA AG	10,478	52.000	544,856.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,624	112.100	406,250.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	424	1,460.000	619,040.00	
	BELIMO HOLDING AG-REG	1,170	894.500	1,046,565.00	
	BKW AG	2,498	146.500	365,957.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	112	12,780.000	1,431,360.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	13	128,000.000	1,664,000.00	

	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	63,984	158.700	10,154,260.80	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	835	625.000	521,875.00	
	GALDERMA GROUP AG	18,396	154.600	2,844,021.60	
	GEBERIT AG-REG	4,039	639.000	2,580,921.00	
	GIVAUDAN-REG	1,099	2,990.000	3,286,010.00	
	HELVETIA BALOISE HOLDING AG	9,375	193.900	1,817,812.50	
	HOLCIM LTD	60,672	73.220	4,442,403.84	
	JULIUS BAER GROUP LTD	24,518	65.460	1,604,948.28	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5,757	176.300	1,014,959.10	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	18,167	69.520	1,262,969.84	
	LONZA GROUP AG	8,357	538.200	4,497,737.40	
	NESTLE SA	306,691	81.430	24,973,848.13	
	NOVARTIS AG	226,285	126.480	28,620,526.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,703	910.800	2,461,892.40	
	ROCHE HOLDING AG	83,639	368.200	30,795,879.80	
	ROCHE HOLDING AG-BR	3,799	374.800	1,423,865.20	
	SANDOZ GROUP AG	49,731	67.220	3,342,917.82	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,796	281.500	787,074.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,843	293.000	1,418,999.00	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	19,717	93.780	1,849,060.26	
	SIKA AG-BEARER	18,148	152.750	2,772,107.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	6,030	196.200	1,183,086.00	
	STRAUMANN HOLDING AG	13,284	94.880	1,260,385.92	
	SWATCH GROUP AG	3,449	195.600	674,624.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3,396	855.000	2,903,580.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	9,560	137.800	1,317,368.00	
	SWISS RE AG	35,556	127.800	4,544,056.80	
	SWISSCOM AG	3,123	706.500	2,206,399.50	
	UBS GROUP AG	377,760	32.710	12,356,529.60	
	VAT GROUP AG	3,213	526.200	1,690,680.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	17,424	558.800	9,736,531.20	
スイス・フラン	小計	1,670,606		193,264,824.91 (38,664,560,871)	
スウェーデン・クローナ	ADDTECH AB-B SHARES	30,898	324.800	10,035,670.40	
	ALFA LAVAL AB	34,399	521.000	17,921,879.00	
	ASSA ABLOY AB	119,245	377.500	45,014,987.50	
	ATLAS COPCO AB	185,735	168.250	31,249,913.75	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	319,709	194.850	62,295,298.65	
	BEIJER REF AB	48,658	135.250	6,580,994.50	

BIOVITRUM	23,364	401.600	9,382,982.40	
BOLIDEN AB	33,718	650.400	21,930,187.20	
EPIROC AB-A	78,383	258.700	20,277,682.10	
EPIROC AB-B	46,453	223.600	10,386,890.80	
EQT AB	58,753	294.000	17,273,382.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	71,723	282.100	20,233,058.30	
EVOLUTION AB	15,833	538.200	8,521,320.60	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	85,190	63.600	5,418,084.00	
HENNES & MAURITZ AB	58,777	184.500	10,844,356.50	
HEXAGON AB-B SHS	247,142	98.800	24,417,629.60	
HOLMEN AB-B SHARES	8,389	357.200	2,996,550.80	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	14,374	485.000	6,971,390.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	18,189	484.200	8,807,113.80	
INDUTRADE AB	32,489	228.200	7,413,989.80	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	17,533	225.200	3,948,431.60	
INVESTOR AB	216,638	365.550	79,192,020.90	
LIFCO AB-B SHS	27,687	321.600	8,904,139.20	
LUNDBERGS AB-B SHS	8,961	550.500	4,933,030.50	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	180,557	39.380	7,110,334.66	
SAAB AB-B	38,118	672.900	25,649,602.20	
SAGAX AB-B	26,153	174.800	4,571,544.40	
SANDVIK AB	126,848	377.500	47,885,120.00	
SECURITAS AB	58,511	156.700	9,168,673.70	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	180,164	193.000	34,771,652.00	
SKANSKA AB-B SHS	40,481	270.500	10,950,110.50	
SKF AB	40,566	254.700	10,332,160.20	
SVENSKA CELLULOSA AB	72,341	121.000	8,753,261.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN	173,957	141.450	24,606,217.65	
SWEDBANK AB - A SHARES	101,178	347.300	35,139,119.40	
TELE2 AB	66,492	189.100	12,573,637.20	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	333,095	101.650	33,859,106.75	
TELIA CO AB	286,817	44.700	12,820,719.90	
TRELLEBORG AB-B SHS	24,085	395.900	9,535,251.50	
VOLVO AB	189,244	347.200	65,705,516.80	
スウェーデン・クローナ 小計	3,740,847		798,383,011.76 (13,660,333,331)	
デンマーク・ク ローネ				
A P MOLLER - MAERSK A/S	469	15,800.000	7,410,200.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S	350	15,720.000	5,502,000.00	
CARLSBERG AS-B	11,189	995.400	11,137,530.60	
COLOPLAST-B	15,040	479.700	7,214,688.00	
DANSKE BANK A/S	79,543	336.000	26,726,448.00	
DEMANT A/S	11,408	181.000	2,064,848.00	
DSV A/S	24,319	1,669.500	40,600,570.50	
GENMAB A/S	7,259	1,791.500	13,004,498.50	

	NOVO-NORDISK A/S	383,358	307.400	117,844,249.20	
	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	41,955	386.000	16,194,630.00	
	ORSTED A/S	62,861	152.400	9,580,016.40	
	PANDORA A/S	9,400	526.000	4,944,400.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	11,488	221.250	2,541,720.00	
	TRYGVESTA AS	40,187	154.600	6,212,910.20	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	120,210	159.750	19,203,547.50	
デンマーク・クローネ 小計		819,036		290,182,256.90 (7,092,054,359)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	201,603	8.730	1,759,994.19	
	CONTACT ENERGY LTD	100,668	9.390	945,272.52	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	69,810	37.600	2,624,856.00	
	INFRATIL LTD	110,735	11.080	1,226,943.80	
	MERIDIAN ENERGY LTD	157,168	5.760	905,287.68	
ニュージーランド・ドル 小計		639,984		7,462,354.19 (690,491,633)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	37,646	286.200	10,774,285.20	
	DNB BANK ASA	105,489	298.600	31,499,015.40	
	EQUINOR ASA	91,214	279.200	25,466,948.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	23,736	266.400	6,323,270.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	52,314	392.950	20,556,786.30	
	MOWI ASA	55,260	229.600	12,687,696.00	
	NORSK HYDRO ASA	164,507	83.700	13,769,235.90	
	ORKLA ASA	82,980	127.300	10,563,354.00	
	SALMAR ASA	8,042	580.000	4,664,360.00	
	TELENOR ASA	74,634	176.000	13,135,584.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,649	460.000	9,038,540.00	
ノルウェー・クローネ 小計		715,471		158,479,076.00 (2,576,869,776)	
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	69,365	28.820	1,999,099.30	
	ACCIONA SA	2,936	196.800	577,804.80	
	ACCOR	23,301	48.330	1,126,137.33	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,991	104.600	2,195,658.60	
	ADIDAS AG	20,354	155.250	3,159,958.50	
	ADP	4,116	120.400	495,566.40	
	ADYEN NV	3,001	997.700	2,994,097.70	
	AEGON LTD	157,243	6.236	980,567.34	
	AENA SME SA	89,265	27.060	2,415,510.90	
	AGEAS	17,782	62.600	1,113,153.20	
	AIB GROUP PLC	254,190	8.845	2,248,310.55	
	AIR LIQUIDE	68,843	167.520	11,532,579.36	
	AIRBUS SE	70,722	187.100	13,232,086.20	
	AKZO NOBEL NV	20,346	60.500	1,230,933.00	
	ALLIANZ SE	45,964	373.400	17,162,957.60	

ALSTOM RGPT	41,193	29.560	1,217,665.08	
AMADEUS IT GROUP SA	53,615	47.940	2,570,303.10	
AMUNDI SA	7,339	77.750	570,607.25	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	117,629	66.660	7,841,149.14	
ARCELORMITTAL	55,758	54.480	3,037,695.84	
ARGENX SE	7,328	717.600	5,258,572.80	
ASM INTERNATIONAL NV	5,575	701.800	3,912,535.00	
ASML HOLDING NV	46,198	1,238.200	57,202,363.60	
ASR NEDERLAND NV	18,722	61.640	1,154,024.08	
ASSICURAZIONI GENERALI	101,415	35.460	3,596,175.90	
AXA SA	206,472	39.120	8,077,184.64	
BANCA MEDIOLANUM SPA	26,603	17.710	471,139.13	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	235,247	8.524	2,005,245.42	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	685,906	19.810	13,587,797.86	
BANCO BPM SPA	135,353	12.400	1,678,377.20	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	897,406	0.898	805,870.58	
BANCO DE SABADELL SA	598,147	3.221	1,926,631.48	
BANCO SANTANDER SA	1,771,237	10.584	18,746,772.40	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	113,531	16.250	1,844,878.75	
BANKINTER SA	80,198	14.005	1,123,172.99	
BASF SE	106,282	48.690	5,174,870.58	
BAYER AG	116,908	45.575	5,328,082.10	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	33,379	90.080	3,006,780.32	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,531	90.000	587,790.00	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	8,692	173.000	1,503,716.00	
BEIERSDORF AG	11,534	106.550	1,228,947.70	
BIOMERIEUX	4,914	94.300	463,390.20	
BNP PARIBAS	119,651	93.840	11,228,049.84	
BOLLÖRE SE	83,210	4.848	403,402.08	
BOUYGUES	22,890	50.940	1,166,016.60	
BPER BANCA SPA	175,309	11.925	2,090,559.82	
BRENTAG SE	14,652	54.140	793,259.28	
BUREAU VERITAS SA	40,483	27.540	1,114,901.82	
BUZZI UNICEM SPA	9,134	48.740	445,191.16	
CAIXABANK	463,724	10.700	4,961,846.80	
CAPGEMINI SA	18,357	103.950	1,908,210.15	
CARREFOUR SA	70,270	15.165	1,065,644.55	
CELLNEX TELECOM SAU	59,360	30.000	1,780,800.00	
CIE DE SAINT-GOBAIN	53,434	87.540	4,677,612.36	
COMMERZBANK AG	87,198	34.110	2,974,323.78	
CONTINENTAL AG	13,077	73.080	955,667.16	

CREDIT AGRICOLE SA	127,106	18.255	2,320,320.03	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	7,426	65.450	486,031.70	
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	25,267	12.450	314,574.15	
D' IETEREN GROUP	2,551	188.100	479,843.10	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	56,586	42.040	2,378,875.44	
DANONE	77,018	74.120	5,708,574.16	
DASSAULT AVIATION SA	2,332	349.800	815,733.60	
DASSAULT SYSTEMES SA	79,847	17.540	1,400,516.38	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	73,184	6.510	476,427.84	
DELIVERY HERO SE	23,085	20.530	473,935.05	
DEUTSCHE BANK AG	220,229	30.410	6,697,163.89	
DEUTSCHE BOERSE AG	22,405	216.400	4,848,442.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	71,565	9.102	651,384.63	
DEUTSCHE TELEKOM AG	438,453	32.630	14,306,721.39	
DHL GROUP	114,291	49.920	5,705,406.72	
DR ING HC F PORSCHE AG	13,569	41.700	565,827.30	
DSM-FIRMENICH AG	20,578	60.680	1,248,673.04	
E.ON SE	267,065	18.600	4,967,409.00	
EDENRED	28,603	17.810	509,419.43	
EDP RENOVAVEIS SA	37,550	13.160	494,158.00	
EDP SA	373,997	4.286	1,602,951.14	
EIFFAGE	8,170	141.400	1,155,238.00	
ELIA GROUP SA/NV	5,183	134.900	699,186.70	
ELISA OYJ	17,405	42.400	737,972.00	
ENDESA SA	37,747	31.430	1,186,388.21	
ENEL SPA	967,865	8.957	8,669,166.80	
ENGIE	217,407	26.420	5,743,892.94	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	243,387	18.638	4,536,246.90	
ERSTE GROUP BANK AG	36,633	106.900	3,916,067.70	
ESSILORLUXOTTICA	35,825	233.000	8,347,225.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,073	67.420	948,801.66	
EURONEXT NV	9,058	122.500	1,109,605.00	
EVONIK INDUSTRIES AG	30,795	15.290	470,855.55	
EXOR NV	11,075	72.700	805,152.50	
FDJ UNITED	13,339	24.720	329,740.08	
FERRARI NV	14,999	311.100	4,666,188.90	
FERROVIAL SE	61,075	60.900	3,719,467.50	
FINANCIERE DE TUBIZE	2,373	247.500	587,317.50	
FINCOBANK SPA	72,765	19.615	1,427,285.47	
FORTUM OYJ	53,225	19.650	1,045,871.25	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	26,197	40.690	1,065,955.93	
FRESENIUS SE & CO KGAA	50,232	52.080	2,616,082.56	
GALP ENERGIA SGPS SA	49,569	18.695	926,692.45	
GEA GROUP AG	17,403	65.150	1,133,805.45	
GETLINK SE - REGR	36,035	17.810	641,783.35	
GRIFOLS SA	35,490	11.155	395,890.95	

GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,633	83.800	807,245.40	
HANNOVER RUECK SE	7,174	249.000	1,786,326.00	
HEIDELBERG MATERIALS AG	15,916	205.500	3,270,738.00	
HEINEKEN HOLDING NV	15,426	70.900	1,093,703.40	
HEINEKEN NV	34,268	76.900	2,635,209.20	
HENKEL AG & CO KGAA	12,380	76.150	942,737.00	
HENKEL KGAA-VORZUG	19,060	82.180	1,566,350.80	
HENSOLDT AG	7,564	83.600	632,350.40	
HERMES INTERNATIONAL	3,769	2,039.000	7,684,991.00	
HOCHTIEF AG	1,848	393.000	726,264.00	
IBERDROLA SA	755,285	19.520	14,743,163.20	
IMCD NV	7,038	84.780	596,681.64	
INDITEX SA	129,846	57.920	7,520,680.32	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	155,444	45.835	7,124,775.74	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	35,094	8.775	307,949.85	
ING GROEP NV-CVA	359,605	24.600	8,846,283.00	
INPOST SA	29,609	15.230	450,945.07	
INTESA SANPAOLO	1,695,288	5.748	9,744,515.42	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	140,403	4.967	697,381.70	
IPSEN	4,469	158.200	706,995.80	
JDE PEET'S BV	20,317	31.700	644,048.90	
JERONIMO MARTINS	33,726	21.100	711,618.60	
KBC GROEP NV	27,333	116.500	3,184,294.50	
KERING	8,861	275.500	2,441,205.50	
KERRY GROUP PLC-A	19,295	73.700	1,422,041.50	
KESKO OYJ-B SHS	32,587	21.040	685,630.48	
KINGSPAN GROUP PLC	18,289	79.650	1,456,718.85	
KNORR-BREMSE AG	8,633	111.000	958,263.00	
KONE OYJ	40,450	62.780	2,539,451.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	106,720	40.000	4,268,800.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	91,643	26.250	2,405,628.75	
L'OREAL SA	28,584	395.000	11,290,680.00	
LEG IMMOBILIE SE	9,006	68.050	612,858.30	
LEGRAND SA	31,198	151.350	4,721,817.30	
LEONARDO SPA	48,145	59.200	2,850,184.00	
LOTUS BAKERIES	49	10,380.000	508,620.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	29,765	531.500	15,820,097.50	
MAPFRE SA	109,417	3.904	427,163.96	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	85,998	58.750	5,052,382.50	
MERCK KGAA	15,380	127.900	1,967,102.00	
METSO CORPORATION	78,864	16.795	1,324,520.88	
MICHELIN (C.G.D.E.)	79,802	33.500	2,673,367.00	
MONCLER SPA	27,811	50.260	1,397,780.86	

MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,404	398.600	2,552,634.40	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	15,546	535.800	8,329,546.80	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,116	25.620	592,231.92	
NEMETSCHKE SE	6,874	65.900	452,996.60	
NESTE OYJ	50,321	21.450	1,079,385.45	
NEXI SPA	63,419	3.172	201,165.06	
NN GROUP NV	32,017	69.000	2,209,173.00	
NOKIA OYJ	630,380	6.350	4,002,913.00	
NORDEA BANK ABP	369,648	16.540	6,113,977.92	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS- A	8,090	59.200	478,928.00	
OMV AG	17,606	55.850	983,295.10	
ORANGE S.A.	224,404	18.140	4,070,688.56	
ORION OYJ-CLASS B	12,985	69.550	903,106.75	
PERNOD-RICARD	24,040	83.940	2,017,917.60	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	18,287	35.970	657,783.39	
POSTE ITALIANE SPA	54,412	22.960	1,249,299.52	
PROSUS	155,686	43.820	6,822,160.52	
PRYSMIAN SPA	33,480	98.080	3,283,718.40	
PUBLICIS GROUPE	27,239	72.880	1,985,178.32	
QIAGEN NV	24,461	41.325	1,010,850.82	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	15,661	42.720	669,037.92	
RANDSTAD NV	12,944	27.980	362,173.12	
RATIONAL AG	609	734.500	447,310.50	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	13,683	47.620	651,584.46	
REDEIA CORPORACION SA	48,489	15.910	771,459.99	
RENAULT SA	22,920	32.160	737,107.20	
REPSOL SA	134,238	18.140	2,435,077.32	
REXEL SA	26,674	36.620	976,801.88	
RHEINMETALL AG	5,475	1,743.500	9,545,662.50	
ROYAL KPN NV	468,823	4.645	2,177,682.83	
RWE AG	75,217	51.460	3,870,666.82	
RYANAIR HOLDINGS PLC	100,439	26.610	2,672,681.79	
SAFRAN SA	42,853	342.100	14,660,011.30	
SAMPO OYJ	287,914	9.158	2,636,716.41	
SANOFI	131,490	79.000	10,387,710.00	
SAP SE	124,286	170.740	21,220,591.64	
SARTORIUS AG-VORZUG	3,119	231.500	722,048.50	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,473	175.950	611,074.35	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	65,248	259.350	16,922,068.80	
SCOUT24 SE	8,909	69.600	620,066.40	
SIEMENS AG	90,454	240.550	21,758,709.70	
SIEMENS ENERGY AG	92,227	164.200	15,143,673.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	40,279	41.450	1,669,564.55	

SNAM SPA	240,107	6.314	1,516,035.59	
SOCIETE GENERALE	84,068	72.340	6,081,479.12	
SODEXO	10,540	47.520	500,860.80	
SOFINA	1,959	246.000	481,914.00	
STELLANTIS NV	240,165	6.421	1,542,099.46	
STMICROELECTRONICS NV	80,598	28.300	2,280,923.40	
STORA ENSO OYJ	69,325	11.285	782,332.62	
SYENSCO SA	8,653	78.320	677,702.96	
SYMRISE AG	15,795	74.940	1,183,677.30	
TALANX AG	7,660	107.100	820,386.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,379,705	0.647	892,669.13	
TELEFONICA SA	444,581	3.594	1,597,824.11	
TENARIS SA	44,596	23.100	1,030,167.60	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	167,221	9.804	1,639,434.68	
THALES SA	11,031	263.300	2,904,462.30	
TOTALENERGIES SE	236,336	66.530	15,723,434.08	
UCB SA	15,040	283.200	4,259,328.00	
UNICREDIT SPA	166,794	72.850	12,150,942.90	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	42,559	19.445	827,559.75	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	130,977	19.420	2,543,573.34	
UPM-KYMMENE OYJ	62,934	26.890	1,692,295.26	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	75,046	34.170	2,564,321.82	
VINCI SA	59,390	139.450	8,281,935.50	
VOLKSWAGEN AG	24,566	102.600	2,520,471.60	
VONOVIA SE	90,115	27.350	2,464,645.25	
WARTSILA OYJ	59,770	36.450	2,178,616.50	
WOLTERS KLUWER NV	27,668	62.320	1,724,269.76	
ZALANDO SE	26,713	21.030	561,774.39	
ユーロ 小計	23,571,055		768,627,045.71 (140,335,926,006)	
香港・ドル				
AIA GROUP LTD	1,250,075	82.350	102,943,676.25	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	440,039	43.400	19,097,692.60	
CK ASSET HOLDINGS LTD	228,909	47.240	10,813,661.16	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	319,409	63.600	20,314,412.40	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	75,000	65.000	4,875,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	195,143	76.500	14,928,439.50	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	233,810	43.080	10,072,534.80	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	173,641	32.700	5,678,060.70	
HKT TRUST AND HKT LTD	464,000	12.150	5,637,600.00	
HONG KONG & CHINA GAS	1,332,437	7.750	10,326,386.75	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	143,311	408.800	58,585,536.80	
MTR CORP	185,255	36.660	6,791,448.30	

POWER ASSETS HOLDINGS LTD	164,587	62.250	10,245,540.75	
SANDS CHINA LTD	288,580	19.000	5,483,020.00	
SINO LAND CO	438,000	12.590	5,514,420.00	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	160,000	30.240	4,838,400.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	172,523	134.700	23,238,848.10	
SWIRE PACIFIC LTD	41,866	79.700	3,336,720.20	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	174,000	122.800	21,367,200.00	
WH GROUP LTD	991,500	9.900	9,815,850.00	
WHARF HOLDINGS LTD	127,000	25.840	3,281,680.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	198,733	28.760	5,715,561.08	
香港・ドル 小計	7,797,818		362,901,689.39 (7,203,598,534)	
合計	130,384,351		1,445,177,639,016 (1,445,177,639,016)	

(2) 株式以外の有価証券

2026年2月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,605.00	993,507.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	39,718.00	1,226,094.66	
		AMERICAN TOWER REIT INC	55,734.00	10,299,085.86	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	76,826.00	1,765,461.48	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,948.00	3,009,456.36	
		BOSTON PROPERTIES INC	17,903.00	1,113,924.66	
		CROWN CASTLE INC	51,861.00	4,484,420.67	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	40,589.00	7,180,194.10	
		EQUINIX INC	11,648.00	10,693,213.44	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	21,927.00	1,472,398.05	
		EQUITY RESIDENTIAL	43,204.00	2,724,012.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,664.00	1,949,951.52	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	25,283.00	3,693,593.47	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	33,873.00	1,603,886.55	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,998.00	1,415,945.88	
		INVITATION HOMES INC	69,393.00	1,782,012.24	
		IRON MOUNTAIN INC	35,136.00	3,799,958.40	
		KIMCO REALTY CORP	80,716.00	1,821,760.12	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,952.00	1,884,496.64	
		PROLOGIS INC	110,533.00	15,368,508.32	
PUBLIC STORAGE	18,796.00	5,610,606.00			

	REALTY INCOME CORP	108,949.00	7,136,159.50	
	REGENCY CENTERS CORP	20,543.00	1,557,364.83	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,779.00	2,533,947.91	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	38,863.00	7,761,718.36	
	SUN COMMUNITIES INC	14,900.00	1,926,272.00	
	UDR INC	37,570.00	1,417,516.10	
	VENTAS INC	54,059.00	4,620,963.32	
	VICI PROPERTIES INC	127,098.00	3,796,417.26	
	WELLTOWER INC	79,590.00	16,555,515.90	
	WP CAREY INC	26,120.00	1,875,416.00	
アメリカ・ドル 小計		1,393,778.00	133,073,778.80 (20,646,396,780)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	84,408.00	557,514.84	
	SEGRO PLC	152,946.00	1,220,814.97	
イギリス・ポンド 小計		237,354.00	1,778,329.81 (371,457,531)	
オーストラリア・ドル	GOODMAN GROUP	243,153.00	7,250,822.46	
	SCENTRE GROUP	620,018.00	2,349,868.22	
	STOCKLAND	287,424.00	1,445,742.72	
	VICINITY CENTRES	464,020.00	1,192,531.40	
オーストラリア・ドル 小計		1,614,615.00	12,238,964.80 (1,339,677,087)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	466,600.00	1,255,154.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	724,350.00	1,752,927.00	
シンガポール・ドル 小計		1,190,950.00	3,008,081.00 (367,948,468)	
ユーロ	COVIVIO	6,626.00	389,277.50	
	GECINA SA	5,485.00	412,472.00	
	KLEPIERRE	25,503.00	886,484.28	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	14,461.00	1,486,590.80	
ユーロ 小計		52,075.00	3,174,824.58 (579,659,472)	
香港・ドル	LINK REIT	310,371.00	11,520,971.52	
香港・ドル 小計		310,371.00	11,520,971.52 (228,691,285)	
投資証券 合計		4,799,143	23,533,830,623 (23,533,830,623)	
合計			23,533,830,623 (23,533,830,623)	

(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 526銘柄	71.76	-	75.37
	投資証券 31銘柄	-	1.36	
イギリス・ポンド	株式 72銘柄	3.96	-	4.10
	投資証券 2銘柄	-	0.02	
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	0.19	-	0.20
オーストラリア・ドル	株式 42銘柄	1.69	-	1.83
	投資証券 4銘柄	-	0.09	
カナダ・ドル	株式 82銘柄	3.62	-	3.73
シンガポール・ドル	株式 12銘柄	0.36	-	0.39
	投資証券 2銘柄	-	0.02	
スイス・フラン	株式 40銘柄	2.55	-	2.63
スウェーデン・クローナ	株式 40銘柄	0.90	-	0.93
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.47	-	0.48
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.05	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.17	-	0.18
ユーロ	株式 216銘柄	9.27	-	9.59
	投資証券 4銘柄	-	0.04	
香港・ドル	株式 22銘柄	0.48	-	0.51
	投資証券 1銘柄	-	0.02	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2026年2月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	288,921,557
金銭信託	16,576,907
コール・ローン	1,360,814,623
株式	25,089,578,182
投資信託受益証券	1,442,000,048
投資証券	11,593,532
派生商品評価勘定	255,698,595
未収入金	6,976,444
未収配当金	25,418,484
差入委託証拠金	801,466,119
流動資産合計	29,299,044,491
資産合計	29,299,044,491
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,254
未払金	36,604,573
未払解約金	42,569,278
流動負債合計	79,182,105
負債合計	79,182,105
純資産の部	
元本等	
元本	12,946,272,876
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,273,589,510
元本等合計	29,219,862,386
純資産合計	29,219,862,386
負債純資産合計	29,299,044,491

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21日 至 2026年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	2026年2月20日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	10,532,947,501円
同期中追加設定元本額	4,731,598,331円
同期中一部解約元本額	2,318,272,956円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ新興国株式インデックスファンド<購入・換金手数料なし>	3,193,547,767円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式）	38,198,574円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート）	34,286,695円
ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式/リート/債券）	9,964,473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>	58,140,415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>	662,784,256円
ニッセイ新興国株式インデックス（ラップ専用）	5,706,600,396円
FWニッセイ新興国株インデックス	33,284,851円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	601,601,201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）	62,265,279円
DCニッセイ新興国株式インデックス	2,545,598,969円
計	12,946,272,876円
2. 受益権の総数	12,946,272,876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 2025年2月21日 至 2026年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2026年2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2026年2月20日現在
	当期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	3,275,077,189
投資信託受益証券	47,376,120
投資証券	1,232,525
合計	3,323,685,834

(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11月21日から2026年2月20日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2026年2月20日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	471,942	-	478,644	6,702	
オフショア・人民元	116,135	-	117,633	1,498	
香港・ドル	355,807	-	361,011	5,204	
買建	1,293,831,078	-	1,313,645,043	19,813,965	
アメリカ・ドル	1,293,831,078	-	1,313,645,043	19,813,965	
合計	1,294,303,020	-	1,314,123,687	19,807,263	

(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	2026年2月20日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	2,414,971,034	-	2,650,854,112	235,883,078
合計	2,414,971,034	-	2,650,854,112	235,883,078

(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)

2026年2月20日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2570円 (22,570円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2026年2月20日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AUTOHOME INC-ADR	534	20.990	11,208.66	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,233	38.260	85,434.58	
	CREDICORP LTD	975	349.400	340,665.00	
	H WORLD GROUP LIMITED (ADR)	2,993	54.130	162,011.09	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	9,900	2.000	19,800.00	
	JBS NV-A	5,600	16.180	90,608.00	
	KANZHUN LTD	5,800	17.210	99,818.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	1,267	18.360	23,262.12	

LUKOIL PJSC-SPON ADR	1,892	0.000	0.18	
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	2,982	0.000	0.29	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	468	0.000	0.04	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	729	0.000	0.07	
NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	51,800	17.320	897,176.00	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	300	0.000	0.03	
PDD HOLDINGS INC(ADR)	10,741	101.950	1,095,044.95	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	552	0.000	0.05	
PJSC GAZPROM ADR	27,971	0.000	2.79	
PJSC MMC NORILSK NICKEL- ADR	2,732	0.000	0.27	
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	1,915	0.000	0.19	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	460	0.000	0.04	
QFIN HOLDINGS INC(ADR)	1,800	15.100	27,180.00	
ROSNEFT OJSC-GDR	5,479	0.000	0.54	
SBERBANK OF RUSSIA	49,840	0.000	4.98	
SEVERSTAL PAO - GDR REG S	1,314	0.000	0.13	
SOUTHERN COPPER CORP	1,491	194.070	289,358.37	
STONECO LTD-A	3,400	16.990	57,766.00	
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	5,163	0.000	0.51	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	6,524	10.910	71,176.84	
TATNEFT-SPONSORED ADR	1,225	0.000	0.12	
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	568	0.000	0.05	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	8,573	15.230	130,566.79	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	4,325	17.480	75,601.00	
VK COMPANY LTD-GDR	380	0.000	0.03	
VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	6,620	0.000	0.66	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	422	0.000	0.04	
XP INC - CLASS A	6,500	21.480	139,620.00	
アメリカ・ドル 小計	235,468		3,616,308.41 (561,070,250)	
インド・ル ピー				
ABB INDIA LTD	868	5,719.500	4,964,526.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	2,767	2,156.700	5,967,588.90	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	8,467	1,513.300	12,813,111.10	
ADANI POWER LTD	45,660	140.450	6,412,947.00	
ALKEM LABORATORIES LTD	517	5,377.000	2,779,909.00	
AMBUJA CEMENTS LTD	8,774	512.150	4,493,604.10	

APL APOLLO TUBES LTD	1,926	2,203.000	4,242,978.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,540	7,592.500	11,692,450.00	
ASHOK LEYLAND LTD	39,354	203.490	8,008,145.46	
ASIAN PAINTS LTD	5,839	2,400.800	14,018,271.20	
ASTRAL LTD	1,023	1,621.000	1,658,283.00	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	4,770	1,017.050	4,851,328.50	
AUROBINDO PHARMA LTD	3,962	1,171.400	4,641,086.80	
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,371	3,834.100	9,090,651.10	
AXIS BANK LTD	34,298	1,356.600	46,528,666.80	
BAJAJ AUTO LTD	1,020	9,729.000	9,923,580.00	
BAJAJ FINANCE LTD	41,684	1,017.050	42,394,712.20	
BAJAJ FINSERV LTD	6,237	2,033.200	12,681,068.40	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	409	11,188.000	4,575,892.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,012	2,534.100	2,564,509.20	
BANK OF BARODA	17,616	304.450	5,363,191.20	
BHARAT ELECTRONICS LTD	57,728	435.350	25,131,884.80	
BHARAT FORGE LTD	3,156	1,758.200	5,548,879.20	
BHARAT HEAVY ELECTROCAL	19,566	253.800	4,965,850.80	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	22,783	367.650	8,376,169.95	
BHARTI AIRTEL LTD	39,455	1,988.600	78,460,213.00	
BOSCH LTD	100	35,015.000	3,501,500.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,379	6,108.500	8,423,621.50	
BSE LTD	3,125	2,741.400	8,566,875.00	
CADILA HEALTHCARE LTD	3,563	902.400	3,215,251.20	
CANARA BANK	25,567	149.420	3,820,221.14	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LIMITED	11,176	696.550	7,784,642.80	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	6,706	1,676.600	11,243,279.60	
CIPLA LIMITED	8,170	1,328.900	10,857,113.00	
COAL INDIA LTD	28,978	416.150	12,059,194.70	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,470	2,167.200	3,185,784.00	
COROMANDEL INTERNATIONAL LTD	1,787	2,311.100	4,129,935.70	
CUMMINS INDIA LTD	2,177	4,646.000	10,114,342.00	
DABUR INDIA LTD	7,985	501.650	4,005,675.25	
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,715	6,297.500	10,800,212.50	
DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	547	11,237.000	6,146,639.00	
DLF LTD	11,768	620.500	7,302,044.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	8,173	1,282.300	10,480,237.90	
EICHER MOTORS LTD	2,039	7,897.000	16,101,983.00	
ETERNAL LTD	36,502	271.750	9,919,418.50	

FORTIS HEALTHCARE LTD	7,311	906.600	6,628,152.60	
FSN E-COMMERCE VENTURES LTD	17,896	267.460	4,786,464.16	
GAIL INDIA LTD	36,210	166.880	6,042,724.80	
GE VERNOVA T&D INDIA LTD	2,040	3,545.700	7,233,228.00	
GMR INFRASTRUCTURE LTD	26,931	99.060	2,667,784.86	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,223	1,188.600	7,396,657.80	
GODREJ PROPERTIES LTD	2,458	1,824.200	4,483,883.60	
GRASIM INDUSTRIES LTD	4,019	2,864.300	11,511,621.70	
HAVELLS INDIA LTD	2,949	1,396.100	4,117,098.90	
HCL TECHNOLOGIES LTD	14,233	1,450.400	20,643,543.20	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,578	2,732.200	7,043,611.60	
HDFC BANK LTD	173,491	915.600	158,848,359.60	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	14,771	733.150	10,829,358.65	
HERO MOTOCORP LTD	1,855	5,414.500	10,043,897.50	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	19,305	905.650	17,483,573.25	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	2,955	4,132.600	12,211,833.00	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	14,325	434.350	6,222,063.75	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	12,784	2,279.300	29,138,571.20	
HITACHI ENERGY INDIA LTD	216	22,851.000	4,935,816.00	
HYUNDAI MOTOR INDIA LTD	2,575	2,181.000	5,616,075.00	
ICICI BANK LTD	81,015	1,388.800	112,513,632.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	3,978	1,936.000	7,701,408.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	5,758	648.650	3,734,926.70	
IDFC BANK LTD	56,848	82.980	4,717,247.04	
INDIAN HOTELS CO LTD	13,600	672.100	9,140,560.00	
INDIAN OIL CORPORATION LTD	37,833	174.300	6,594,291.90	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,327	629.100	2,722,115.70	
INDUS TOWERS LTD	20,652	472.900	9,766,330.80	
INDUSIND BANK LTD	8,515	927.350	7,896,385.25	
INFO EDGE INDIA LTD	4,570	1,094.400	5,001,408.00	
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	50,982	1,370.500	69,870,831.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	2,700	4,815.100	13,000,770.00	
ITC LTD	47,239	326.000	15,399,914.00	
JINDAL STAINLESS LTD	4,346	745.950	3,241,898.70	
JINDAL STEEL LTD	5,534	1,211.100	6,702,227.40	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	42,136	258.600	10,896,369.60	
JSW ENERGY LTD	4,815	480.100	2,311,681.50	
JSW STEEL LTD	10,021	1,228.400	12,309,796.40	
JUBILANT FOODWORKS LTD	5,275	524.750	2,768,056.25	

KALYAN JEWELLERS INDIA LTD	4,819	404.750	1,950,490.25	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	85,110	416.400	35,439,804.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	10,011	4,280.500	42,852,085.50	
LTIMINDTREE LIMITED	1,293	4,959.500	6,412,633.50	
LUPIN LTD	3,372	2,228.700	7,515,176.40	
MACROTECH DEVELOPERS LTD	4,428	1,067.050	4,724,897.40	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	14,204	3,431.800	48,745,287.20	
MANKIND PHARMA LTD	1,387	2,039.500	2,828,786.50	
MARICO LTD	7,603	780.150	5,931,480.45	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,895	14,903.000	28,241,185.00	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	11,086	1,081.450	11,988,954.70	
MPHASIS LTD	1,316	2,376.700	3,127,737.20	
MRF LTD	40	145,605.000	5,824,200.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	1,734	3,410.900	5,914,500.60	
NESTLE INDIA LTD	10,773	1,278.500	13,773,280.50	
NHPC LTD	38,515	74.360	2,863,975.40	
NMDC LTD	35,043	79.220	2,776,106.46	
NTPC LTD	69,921	363.200	25,395,307.20	
OBEROI REALTY LTD	1,611	1,502.700	2,420,849.70	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	50,559	274.650	13,886,029.35	
OIL INDIA LTD	6,297	476.700	3,001,779.90	
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	5,873	1,145.600	6,728,108.80	
ORACLE FINANCIAL SERVICES	277	6,652.000	1,842,604.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	100	32,595.000	3,259,500.00	
PB FINTECH LTD	4,866	1,465.400	7,130,636.40	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	1,543	5,266.000	8,125,438.00	
PETRONET LNG LTD	12,598	301.800	3,802,076.40	
PHOENIX MILLS LTD	2,512	1,742.500	4,377,160.00	
PI INDUSTRIES LTD	1,271	3,016.400	3,833,844.40	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,164	1,464.900	6,099,843.60	
POLYCAB INDIA LTD	845	7,778.000	6,572,410.00	
POWER FINANCE CORPORATION	21,386	409.550	8,758,636.30	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	74,260	294.650	21,880,709.00	
PRESTIGE ESTATES PROJECTS	1,809	1,492.000	2,699,028.00	
PUNJAB NATIONAL BANK	45,738	126.100	5,767,561.80	
RAIL VIKAS NIGAM LTD	6,549	306.850	2,009,560.65	
REC LTD	19,119	353.550	6,759,522.45	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	93,071	1,409.500	131,183,574.50	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	59,587	129.880	7,739,159.56	

SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	2,791	798.200	2,227,776.20	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	6,555	2,043.000	13,391,865.00	
SHREE CEMENT LTD	145	26,215.000	3,801,175.00	
SHRIRAM FINANCE LIMITED	20,155	1,054.700	21,257,478.50	
SIEMENS ENERGY INDIA LTD	1,465	2,757.700	4,040,030.50	
SIEMENS LTD	1,037	3,107.100	3,222,062.70	
SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	350	13,370.000	4,679,500.00	
SRF LTD	1,989	2,678.700	5,327,934.30	
STATE BANK OF INDIA	29,937	1,205.700	36,095,040.90	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	15,196	1,713.400	26,036,826.40	
SUNDARAM FINANCE LTD	868	5,175.000	4,491,900.00	
SUPREME INDUSTRIES LTD	839	3,873.200	3,249,614.80	
SUZLON ENERGY LTD	166,323	45.250	7,526,115.75	
SWIGGY LTD	13,282	326.650	4,338,565.30	
TATA COMMUNICATIONS LTD	1,415	1,656.500	2,343,947.50	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	14,265	2,677.900	38,200,243.50	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	8,443	1,160.500	9,798,101.50	
TATA MOTORS LTD /NEW	29,436	474.500	13,967,382.00	
TATA MOTORS PASSENGER VEHICLES	29,436	375.700	11,059,105.20	
TATA POWER CO LTD	27,315	369.300	10,087,429.50	
TATA STEEL LTD	108,451	205.410	22,276,919.91	
TECH MAHINDRA LTD	7,685	1,479.300	11,368,420.50	
TITAN CO LTD	5,579	4,198.200	23,421,757.80	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	1,961	4,226.400	8,287,970.40	
TORRENT POWER LTD	2,238	1,492.600	3,340,438.80	
TRENT LTD	2,580	4,067.900	10,495,182.00	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	1,349	2,488.300	3,356,716.70	
TVS MOTOR CO LTD	3,786	3,830.100	14,500,758.60	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,858	12,688.000	23,574,304.00	
UNION BANK OF INDIA	30,800	189.520	5,837,216.00	
UNITED SPIRITS LTD	3,724	1,397.100	5,202,800.40	
UPL LTD	7,829	765.050	5,989,576.45	
VARUN BEVERAGES LTD	19,226	453.500	8,718,991.00	
VEDANTA LTD	18,194	676.150	12,301,873.10	
VISHAL MEGA MART LTD	31,492	118.620	3,735,581.04	
VODAFONE IDEA LTD	301,243	11.260	3,391,996.18	
VOLTAS LTD	2,560	1,512.700	3,872,512.00	
WAAREE ENERGIES LTD	1,420	2,874.300	4,081,506.00	
WIPRO LTD	41,097	211.210	8,680,097.37	
YES BANK LTD	275,674	20.960	5,778,127.04	
インド・ルピー 小計	3,267,571		2,065,520,398.82	

				(3,552,695,086)	
インドネシア・ルピア	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	229,400	7,675.000	1,760,645,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	289,000	6,600.000	1,907,400,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	900,600	7,175.000	6,461,805,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	542,700	5,075.000	2,754,202,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	185,200	4,450.000	824,140,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	1,025,900	3,770.000	3,867,643,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	272,946	2,100.000	573,186,600.00	
	BARITO RENEWABLES ENERGY TBK	128,900	8,100.000	1,044,090,000.00	
	BUMI RESOURCES MINERALS TBK	911,400	1,055.000	961,527,000.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	125,900	6,775.000	852,972,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	45,500	4,270.000	194,285,000.00	
	DIAN SWASTATIKA SENTOSA TBK	15,400	88,800.000	1,367,520,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	11,203,400	61.000	683,407,400.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	64,300	6,725.000	432,417,500.00	
	PETRINDO JAYA KREASI TBK PT	370,600	1,755.000	650,403,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	221,600	1,900.000	421,040,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	776,100	3,480.000	2,700,828,000.00	
UNITED TRACTORS TBK PT	31,100	30,275.000	941,552,500.00		
インドネシア・ルピア 小計	17,339,946		28,399,065,000.00 (261,271,398)		
オフショア・人民元	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,500	12.900	58,050.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	528	344.500	181,896.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	3,100	57.170	177,227.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	97,800	6.510	636,678.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	21,337	10.330	220,411.21	
	AIR CHINA LTD-A	10,100	8.540	86,254.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	14,800	12.690	187,812.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,000	24.660	24,660.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	129.110	38,733.00	

ANHUI JIANGHUAI AUTO GROUP-A	3,800	57.160	217,208.00	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	3,100	54.660	169,446.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	8,600	5.410	46,526.00	
BANK OF CHINA LTD-A	69,000	5.310	366,390.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	51,100	6.650	339,815.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	7,800	10.390	81,042.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,800	11.310	99,528.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	4,300	31.200	134,160.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	22,100	9.970	220,337.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	33,200	6.920	229,744.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	774	307.280	237,834.72	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2,000	30.600	61,200.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	560	40.160	22,489.60	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	51,100	4.910	250,901.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	45,400	4.180	189,772.00	
BYD CO LTD -A	5,700	90.270	514,539.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	7,500	8.660	64,950.00	
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	366	1,120.680	410,168.88	
CGN POWER CO LTD-A	17,400	3.830	66,642.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	87.380	8,738.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	12,300	7.800	95,940.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	5,800	56.770	329,266.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	23,100	7.340	169,554.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,600	8.700	83,520.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	6,800	5.930	40,324.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	37,000	3.290	121,730.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	6,900	14.830	102,327.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	16,200	9.680	156,816.00	

CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	2,400	34.690	83,256.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO- A	4,100	47.390	194,299.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	17,500	38.710	677,425.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	10,500	16.810	176,505.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	1,900	10.330	19,627.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	21,200	3.930	83,316.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	10,600	8.520	90,312.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5,100	54.740	279,174.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,000	42.890	171,560.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	62,500	6.370	398,125.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD- A	39,200	5.500	215,600.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	10,871	5.470	59,464.37	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	1,473	59.770	88,041.21	
CHINA SHENHUA ENERGY CO- A	8,400	41.450	348,180.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	4,700	7.600	35,720.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	22,900	5.000	114,500.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	57,100	4.080	232,968.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	2,800	94.640	264,992.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	22,600	26.000	587,600.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	24,600	2.960	72,816.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	5,850	11.040	64,584.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	3,200	16.900	54,080.00	
CITI PACIFIC SPECIAL STEE-A	13,400	15.480	207,432.00	
CITIC SECURITIES CO-A	12,500	27.620	345,250.00	
CMOC GROUP LTD-A	22,000	21.980	483,560.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	1,820	54.810	99,754.20	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	4,280	365.340	1,563,655.20	

COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	20,370	14.310	291,494.70	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	6,600	24.020	158,532.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	24,500	5.040	123,480.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	4,200	31.860	133,812.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	13,113	22.370	293,337.81	
EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A	700	264.800	185,360.00	
EOPTOLINK TECHNOLOGY INC L-A	1,100	366.110	402,721.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	900	63.780	57,402.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	7,800	16.700	130,260.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	5,900	7.280	42,952.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	7,354	35.640	262,096.56	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	11,600	7.640	88,624.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	11,900	54.750	651,525.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	2,800	59.380	166,264.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	2,800	66.320	185,696.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	13,200	4.630	61,116.00	
GEM CO LTD-A	13,300	9.300	123,690.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	13,600	21.130	287,368.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	196	308.700	60,505.20	
GOERTEK INC -A	1,000	26.160	26,160.00	
GOLDWIND SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A	3,900	24.900	97,110.00	
GONGNIU GROUP CO LTD-A	1,421	42.770	60,776.17	
GOTION HIGH-TECH CO LTD- A	1,800	36.910	66,438.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD- A	16,300	20.670	336,921.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	3,200	38.370	122,784.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO- A	1,000	53.280	53,280.00	
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	5,400	5.410	29,214.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	8,700	7.820	68,034.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,300	25.110	32,643.00	

GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,000	43.250	43,250.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	11,200	12.380	138,656.00	
GUOTAI HAITONG SECURITIES CO LTD-A	14,412	19.610	282,619.32	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,500	25.700	141,350.00	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,646	18.040	29,693.84	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	3,900	31.760	123,864.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	800	26.410	21,128.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	7,900	24.570	194,103.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2,800	38.500	107,800.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	700	337.430	236,201.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	400	47.980	19,192.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,300	36.000	46,800.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	7,700	6.970	53,669.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	8,500	22.180	188,530.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	6,200	6.730	41,726.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	19.050	26,670.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	122.630	61,315.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	1,183	30.400	35,963.20	
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	1,886	259.060	488,587.16	
IEIT SYSTEMS CO LTD-A	3,700	65.330	241,721.00	
IFLYTEK CO LTD - A	5,300	57.120	302,736.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	140	145.240	20,333.60	
IND & COMM BK OF CHINA-A	87,000	7.110	618,570.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD - A	22,600	18.490	417,874.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	21,900	6.850	150,015.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	32,400	2.620	84,888.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	2,100	5.690	11,949.00	

INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	9,300	26.480	246,264.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,372	11.870	16,285.64	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	2,900	12.560	36,424.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,000	118.540	118,540.00	
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS CO LTD-A	6,484	58.230	377,563.32	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,300	32.390	42,107.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY - A	900	54.070	48,663.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,200	24.420	53,724.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	9,300	55.030	511,779.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	6,076	7.590	46,116.84	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	46.810	102,982.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,300	1,485.300	1,930,890.00	
LB GROUP CO LTD-A	2,900	21.400	62,060.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	2,400	34.290	82,296.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	13,900	15.390	213,921.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,480	18.130	117,482.40	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	6,689	50.800	339,801.20	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	2,400	116.250	279,000.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,300	26.250	34,125.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	480	73.950	35,496.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	20,500	3.000	61,500.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	3,300	79.050	260,865.00	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	974	164.600	160,320.40	
MUYUAN FOODS CO LTD-A	5,790	45.350	262,576.50	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	12,210	26.130	319,047.30	
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	5,776	20.580	118,870.08	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	810	486.120	393,757.20	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	77.700	69,930.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	1,800	8.580	15,444.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	1,015	72.010	73,090.15	

NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	4,400	23.030	101,332.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	22,400	10.180	228,032.00	
PETROCHINA CO LTD-A	29,700	10.540	313,038.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	675	29.900	20,182.50	
PICC HOLDING CO-A	14,900	8.880	132,312.00	
PING AN BANK CO LTD-A	23,300	10.910	254,203.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	9,900	65.290	646,371.00	
PIOTECH INC-A	572	325.000	185,900.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	2,700	6.740	18,198.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	48,100	5.070	243,867.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10,000	5.440	54,400.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	11,400	33.660	383,724.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	17,500	14.590	255,325.00	
S F HOLDING CO LTD-A	7,300	37.840	276,232.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	8,000	14.320	114,560.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	5,100	15.910	81,141.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	15,300	23.120	353,736.00	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	4,600	22.240	102,304.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	13,700	7.580	103,846.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	12,900	12.780	164,862.00	
SERES GROUP CO L-A	1,400	109.220	152,908.00	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	14,300	22.770	325,611.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	6,360	45.400	288,744.00	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,900	35.630	67,697.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	30,200	6.700	202,340.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,872	23.910	44,759.52	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	6,300	8.720	54,936.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	3,600	26.570	95,652.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	5,500	17.160	94,380.00	

SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	35,100	9.890	347,139.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	1,160	28.280	32,804.80	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	28,500	6.240	177,840.00	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	14,800	8.480	125,504.00	
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	1,296	126.000	163,296.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,280	165.840	212,275.20	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	3,700	64.250	237,725.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD- A	182	235.000	42,770.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	58,800	5.020	295,176.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,500	75.120	112,680.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDIC-A	1,300	185.770	241,501.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	470	58.630	27,556.10	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	2,500	149.160	372,900.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	2,600	77.980	202,748.00	
TBEA CO LTD-A	2,860	28.750	82,225.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	4,400	4.560	20,064.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	1,875	10.320	19,350.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	1,300	51.240	66,612.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	47,800	7.050	336,990.00	
TONGWEI CO LTD-A	3,900	18.010	70,239.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	1,092	19.760	21,577.92	
TSINGTAO BREWERY CO LTD- A	600	61.540	36,924.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	419	77.490	32,468.31	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	980	25.500	24,990.00	
VICTORY GIANT TECHNOLOGY -A	1,000	259.880	259,880.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	4,400	84.960	373,824.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	17,600	26.790	471,504.00	

WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	1,800	15.400	27,720.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	9,700	7.800	75,660.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	1,705	115.820	197,473.10	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	200	33.180	6,636.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	5,200	16.840	87,568.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,100	106.060	434,846.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	3,000	69.170	207,510.00	
WUXI APPTec CO LTD-A	1,872	101.910	190,775.52	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	2,600	11.790	30,654.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	4,700	59.500	279,650.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	6,760	17.350	117,286.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,690	14.600	24,674.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	2,500	17.860	44,650.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	4,200	56.500	237,300.00	
ZANGGE MINING CO LTD-A	3,400	82.820	281,588.00	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	900	167.540	150,786.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	1,100	31.350	34,485.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	3,000	18.920	56,760.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	650	72.500	47,125.00	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	800	51.110	40,888.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,008	29.430	29,665.44	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	2,000	10.550	21,100.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	1,000	531.000	531,000.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	12,400	6.320	78,368.00	
ZHUZHOU CRRc TIMES ELECTRI-A	3,813	57.800	220,391.40	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	21,100	37.780	797,158.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9,400	9.600	90,240.00	
ZTE CORP-A	9,200	37.160	341,872.00	
オフショア・人民元 小計	2,300,427		43,067,132.79	

				(967,998,410)	
コロンビア・ペソ	GRUPO CIBEST SA	5,993	73,280.000	439,167,040.00	
	GRUPO CIBEST SA	4,780	83,100.000	397,218,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,691	28,400.000	190,024,400.00	
コロンビア・ペソ 小計		17,464		1,026,409,440.00 (43,011,688)	
タイ・パーツ	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	14,700	390.000	5,733,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	59,400	56.250	3,341,250.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	183,500	22.300	4,092,050.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	7,700	194.000	1,493,800.00	
	CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	31,900	64.500	2,057,550.00	
	CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	57,600	21.800	1,255,680.00	
	CP ALL PCL-FOREIGN	88,000	54.500	4,796,000.00	
	CP AXTRA PCL-FOREIGN	19,613	17.900	351,072.70	
	DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN	45,100	236.000	10,643,600.00	
	GULF DEVELOPMENT PCL-FOREIGN	75,665	60.250	4,558,816.25	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	10,600	205.000	2,173,000.00	
	KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	59,200	32.750	1,938,800.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	53,400	26.750	1,428,450.00	
	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	15,800	140.000	2,212,000.00	
	PTT PCL/FOREIGN	158,900	37.500	5,958,750.00	
	SCB X PCL-FOREIGN	15,500	148.500	2,301,750.00	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	12,700	222.000	2,819,400.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	428,400	2.260	968,184.00	
TRUE CORP PCL/NEW-FOREIGN	122,498	13.700	1,678,222.60		
タイ・パーツ 小計		1,460,176		59,801,375.55 (297,810,850)	
チェコ・コルナ	CEZ AS	2,199	1,150.000	2,528,850.00	
	KOMERCNI BANKA AS	1,294	1,180.000	1,526,920.00	
	MONETA MONEY BANK AS	1,124	205.000	230,420.00	
チェコ・コルナ 小計		4,617		4,286,190.00 (32,275,011)	
チリ・ペソ	BANCO DE CHILE	716,132	183.180	131,181,059.76	

	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,450	60,700.000	88,015,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,088,852	76.900	83,732,718.80	
	CENCOSUD SA	16,106	2,890.000	46,546,340.00	
	EMPRESAS CMPC SA	10,124	1,320.000	13,363,680.00	
	EMPRESAS COPEC SA	7,046	7,260.000	51,153,960.00	
	ENEL CHILE SA	481,347	70.000	33,694,290.00	
	ENERSIS SA	205,266	76.800	15,764,428.80	
	FALABELLA SA	7,564	6,205.000	46,934,620.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	4,808,083	25.500	122,606,116.50	
	PLAZA SA Y FILIALES	11,037	3,820.000	42,161,340.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,301	62,699.000	144,270,399.00	
チリ・ペソ 小計		7,355,308		819,423,952.86 (146,757,191)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	49,905	87.000	4,341,735.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	21,822	307.000	6,699,354.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	7,143	690.000	4,928,670.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	72,553	29.420	2,134,509.26	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,930	120.800	716,344.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	15,178	104.100	1,580,029.80	
	KOC HOLDING AS	9,876	214.200	2,115,439.20	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	17,645	221.500	3,908,367.50	
	TURK HAVA YOLLARI AO	6,115	312.500	1,910,937.50	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,833	120.200	1,422,326.60	
	TURKIYE IS BANKASI-C	170,462	16.470	2,807,509.14	
YAPI VE KREDI BANKASI	39,247	41.160	1,615,406.52		
トルコ・リラ 小計		427,709		34,180,628.52 (121,184,000)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	4,259	3,570.000	15,204,630.00	
	OTP BANK RT	3,627	39,690.000	143,955,630.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,879	11,820.000	22,209,780.00	
ハンガリー・フォリント 小計		9,765		181,370,040.00 (87,310,268)	
フィリピン・ペソ	AYALA CORPORATION	3,625	568.500	2,060,812.50	
	AYALA LAND INC	107,600	20.700	2,227,320.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	25,735	117.600	3,026,436.00	
	BDO UNIBANK INC	33,034	136.200	4,499,230.80	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	15,670	670.000	10,498,900.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	7,320	204.600	1,497,672.00	

	MANILA ELECTRIC COMPANY	6,050	610.000	3,690,500.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	15,127	73.300	1,108,809.10	
	PLDT INC	585	1,407.000	823,095.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,195	691.500	2,209,342.50	
	SM PRIME HOLDINGS INC	170,100	21.000	3,572,100.00	
フィリピン・ペソ 小計		388,041		35,214,217.90 (94,162,819)	
ブラジル・レアル	AMBEV SA	71,700	16.170	1,159,389.00	
	AXIA ENERGIA	2,600	66.540	173,004.00	
	AXIA ENERGIA	19,200	61.180	1,174,656.00	
	AXIA ENERGIA-PR C	5,729	59.190	339,099.51	
	BANCO BRADESCO S.A.	53,403	18.360	980,479.08	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	61,779	21.330	1,317,746.07	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	18,800	61.850	1,162,780.00	
	BANCO DO BRASIL SA	23,900	26.460	632,394.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	12,400	33.580	416,392.00	
	BM&FBOVESPA SA	82,300	17.750	1,460,825.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	9,100	17.800	161,980.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	23,917	11.870	283,894.79	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	13,900	14.280	198,492.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	7,104	153.530	1,090,677.12	
	CPFL ENERGIA SA	3,000	50.020	150,060.00	
	EMBRAER SA	10,300	94.630	974,689.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,530	52.470	132,749.10	
	ENEVA SA	16,000	21.900	350,400.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,405	33.720	215,976.60	
	EQUATORIAL SA - ORD	18,700	41.270	771,749.00	
	GERDAU SA-PREF	12,024	21.520	258,756.48	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	84,897	48.550	4,121,749.35	
	ITAUSA SA	96,894	14.800	1,434,031.20	
	KLABIN SA - UNIT	10,807	20.170	217,977.19	
	LOCALIZA RENT A CAR	13,695	52.430	718,028.85	
	MBRF GLOBAL FOODS COMPANY SA	6,475	18.760	121,471.00	
	MOTIVA INFRAESTRUTURA DE MOBILIDADE S.A.	17,700	16.200	286,740.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	59,800	41.190	2,463,162.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	67,800	37.810	2,563,518.00	
	PORTO SEGURO SA	3,100	51.920	160,952.00	
PRIO S.A.	10,000	54.930	549,300.00		

	RAIA DROGASIL SA	16,560	26.410	437,349.60	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	10,500	44.640	468,720.00	
	RUMO SA	20,500	16.450	337,225.00	
	SUZANO S.A.	10,122	57.130	578,269.86	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	11,360	40.890	464,510.40	
	TIM SA	10,500	27.020	283,710.00	
	TOTVS SA	7,900	38.950	307,705.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	11,300	27.500	310,750.00	
	VALE SA	54,954	84.090	4,621,081.86	
	VIBRA ENERGIA SA	13,174	31.570	415,903.18	
	WEG SA	26,320	51.370	1,352,058.40	
	ブラジル・リアル 小計	1,039,149		35,620,401.64 (1,058,264,323)	
ポーランド・ズロチ	ALLEGRO.EU SA	10,348	28.650	296,470.20	
	BANK MILLENNIUM SA	10,020	17.420	174,548.40	
	BANK PEKAO SA	2,985	232.200	693,117.00	
	BUDIMEX	219	747.000	163,593.00	
	CD PROJEKT SA	929	242.000	224,818.00	
	DINO POLSKA SA	6,840	39.310	268,880.40	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,067	299.000	618,033.00	
	LPP SA	16	20,110.000	321,760.00	
	MBANK SA	250	1,044.500	261,125.00	
	MODIVO SA	756	125.000	94,500.00	
	ORLEN SA	9,094	111.500	1,013,981.00	
	PGE SA	8,858	10.170	90,085.86	
	PKO BANK POLSKI SA	13,055	90.680	1,183,827.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	8,080	69.000	557,520.00	
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	693	601.600	416,908.80	
ZABKA GROUP SA	5,082	21.850	111,041.70		
	ポーランド・ズロチ 小計	79,292		6,490,209.76 (280,586,695)	
マレーシア・リンギット	AMBank HOLDINGS BHD	35,600	6.460	229,976.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	20,500	2.300	47,150.00	
	CELCOMDIGI BERHAD	51,800	3.180	164,724.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	132,200	8.470	1,119,734.00	
	GAMUDA BHD	68,600	4.210	288,806.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	10,000	24.180	241,800.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	35,800	8.910	318,978.00	
	IOI CORPORATION BHD	19,700	3.970	78,209.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	9,100	20.020	182,182.00	
	MALAYAN BANKING BHD	103,800	12.060	1,251,828.00	
	MAXIS BHD	53,100	3.860	204,966.00	
	MISC BHD	21,000	8.200	172,200.00	
MR DIY GROUP M BHD	16,300	1.870	30,481.00		

	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	600	109.500	65,700.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	49,600	3.450	171,120.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	3,300	21.000	69,300.00	
	PETRONAS GAS BHD	11,300	18.560	209,728.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	54,800	7.680	420,864.00	
	PUBLIC BANK BHD	242,600	5.060	1,227,556.00	
	QL RESOURCES BHD	26,700	4.010	107,067.00	
	RHB BANK BHD	17,000	8.170	138,890.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	19,000	5.850	111,150.00	
	SUNWAY BHD	34,300	5.830	199,969.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	12,500	7.980	99,750.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	42,900	14.260	611,754.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	42,800	2.050	87,740.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	30,900	3.120	96,408.00	
	マレーシア・リンギット 小計	1,165,800		7,948,030.00 (315,493,077)	
メキシコ・ペソ	AMERICA MOVIL SAB DE CV	292,800	20.560	6,019,968.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	6,700	209.960	1,406,732.00	
	CEMEX SAB-CPO	232,400	21.860	5,080,264.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	6,475	192.780	1,248,250.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	27,300	193.250	5,275,725.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,665	315.280	840,221.20	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	2,515	642.680	1,616,340.20	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	3,800	280.030	1,064,114.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	5,350	496.180	2,654,563.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	16,400	64.890	1,064,196.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	8,700	127.450	1,108,815.00	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	3,700	113.630	420,431.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	39,100	200.340	7,833,294.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	27,600	44.630	1,231,788.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	49,800	201.830	10,051,134.00	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	2,960	1,011.300	2,993,448.00		

	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	27,700	41.830	1,158,691.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,765	289.830	511,549.95	
	SIGMA FOODS, S.A.B. DE C.V.	51,200	18.260	934,912.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	83,100	57.760	4,799,856.00	
メキシコ・ペソ	小計	892,030		57,314,292.85 (515,307,076)	
ユーロ	ALPHA BANK SA	32,573	3.720	121,171.56	
	EUROBANK SA	40,337	3.980	160,541.26	
	FF GROUP	129	0.000	0.01	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	2,977	17.030	50,698.31	
	JUMBO SA	1,127	24.700	27,836.90	
	NATIONAL BANK OF GREECE	12,752	14.395	183,565.04	
	OPAP SA	2,062	16.100	33,198.20	
	PIRAEUS BANK SA	16,130	8.180	131,943.40	
	PUBLIC POWER CORP	3,678	18.260	67,160.28	
ユーロ	小計	111,765		776,114.96 (141,703,069)	
韓国・ウォン	ALTEOGEN INC	568	411,500.000	233,732,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP	353	161,400.000	56,974,200.00	
	APR CORP/KOREA	378	285,500.000	107,919,000.00	
	CELLTRION INC	2,466	244,500.000	602,937,000.00	
	COWAY CO LTD	824	88,400.000	72,841,600.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,113	140,600.000	297,087,800.00	
	DAUM COMMUNICATIONS CORP	4,783	57,600.000	275,500,800.00	
	DB INSURANCE CO LTD	708	183,400.000	129,847,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	272	64,300.000	17,489,600.00	
	DOOSAN CO LTD	115	990,000.000	113,850,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	6,824	98,400.000	671,481,600.00	
	ECOPRO BM CO LTD	636	214,000.000	136,104,000.00	
	ECOPRO CO LTD	1,609	172,300.000	277,230,700.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	4,107	126,300.000	518,714,100.00	
	HANJIN KAL CORP	365	145,900.000	53,253,500.00	
	HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	1,170	74,300.000	86,931,000.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	736	201,500.000	148,304,000.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	483	1,149,000.000	554,967,000.00	
	HANWHA SYSTEMS CO LTD	1,134	106,400.000	120,657,600.00	
	HD HYUNDAI	742	270,500.000	200,711,000.00	
	HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	352	967,000.000	340,384,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	409	574,000.000	234,766,000.00	

HD HYUNDAI MARINE SOLUTION C	251	173,300.000	43,498,300.00	
HD KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	648	422,500.000	273,780,000.00	
HLB INC	1,871	54,000.000	101,034,000.00	
HMM CO LTD	3,612	22,700.000	81,992,400.00	
HYBE CO LTD	300	404,500.000	121,350,000.00	
HYOSUNG HEAVY INDUSTRIES COR	85	2,453,000.000	208,505,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	476	262,500.000	124,950,000.00	
HYUNDAI MOBIS	921	440,500.000	405,700,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,959	513,000.000	1,004,967,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	573	277,500.000	159,007,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	403	275,000.000	110,825,000.00	
HYUNDAI ROTEM COMPANY	1,160	210,000.000	243,600,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5,116	26,600.000	136,085,600.00	
KAKAObANK CORP	3,015	28,100.000	84,721,500.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	5,330	166,500.000	887,445,000.00	
KIA CORPORATION	3,620	170,000.000	615,400,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	932	175,400.000	163,472,800.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,977	62,100.000	246,971,700.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	481	283,500.000	136,363,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,631	25,400.000	66,827,400.00	
KRAFTON INC	369	262,000.000	96,678,000.00	
KT&G CORP	1,424	175,100.000	249,342,400.00	
LG CHEM LTD	798	334,500.000	266,931,000.00	
LG CORP	1,400	95,800.000	134,120,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	4,203	12,280.000	51,612,840.00	
LG ELECTRONICS INC	1,662	121,100.000	201,268,200.00	
LG ENERGY SOLUTION	730	403,500.000	294,555,000.00	
LG H AND H CO LTD	100	278,500.000	27,850,000.00	
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	1,340	36,750.000	49,245,000.00	
LG UPLUS CORP	3,408	17,260.000	58,822,080.00	
LIG NEX1 CO LTD	204	463,000.000	94,452,000.00	
LS ELECTRIC CO LTD	229	676,000.000	154,804,000.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	1,199	136,200.000	163,303,800.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	3,767	70,500.000	265,573,500.00	
NAVER CORP	2,055	253,000.000	519,915,000.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	431	234,500.000	101,069,500.00	
POSCO HOLDINGS INC	1,099	389,000.000	427,511,000.00	

	POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	426	69,200.000	29,479,200.00	
	S-OIL CORPORATION	988	110,900.000	109,569,200.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	174	1,720,000.000	299,280,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	1,181	319,500.000	377,329,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	807	358,000.000	288,906,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	71,364	190,000.000	13,559,160,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	12,505	133,500.000	1,669,417,500.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	430	570,000.000	245,100,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	10,669	28,900.000	308,334,100.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	1,216	209,000.000	254,144,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,001	408,000.000	408,408,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	623	171,600.000	106,906,800.00	
	SAMYANG FOODS CO LTD	61	1,171,000.000	71,431,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	6,706	100,300.000	672,611,800.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	470	111,500.000	52,405,000.00	
	SK HYNIX INC	8,255	894,000.000	7,379,970,000.00	
	SK INC	528	355,500.000	187,704,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,044	118,600.000	123,818,400.00	
	SK SQUARE CO LTD	1,418	566,000.000	802,588,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	1,503	81,500.000	122,494,500.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	9,543	39,400.000	375,994,200.00	
	YUHAN CORP	684	112,900.000	77,223,600.00	
韓国・ウォン 小計		224,522		41,147,509,020.00 (4,411,012,967)	
香港・ドル	3SBIO INC	28,000	23.620	661,360.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	10,000	36.740	367,400.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	399,000	5.390	2,150,610.00	
	AKESO INC	9,000	105.200	946,800.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	259,300	154.700	40,113,710.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	90,000	6.170	555,300.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	70,000	13.170	921,900.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	23,000	25.060	576,380.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,000	79.380	158,760.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	18,800	84.100	1,581,080.00	

AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	41,000	4.200	172,200.00	
BAIDU INC-CLASS A	34,450	137.600	4,740,320.00	
BANK OF CHINA LTD - H	1,088,000	4.660	5,070,080.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	143,000	6.900	986,700.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	4,500	35.500	159,750.00	
BEONE MEDICINES LTD	13,000	205.800	2,675,400.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	4,120	242.400	998,688.00	
BOC AVIATION LTD	1,900	88.250	167,675.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	58,000	4.800	278,400.00	
BYD CO LTD	55,800	97.800	5,457,240.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	11,000	32.740	360,140.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	20,000	15.260	305,200.00	
CGN POWER CO LTD-H	137,000	3.120	427,440.00	
CHINA CITIC BANK	117,000	7.280	851,760.00	
CHINA COAL ENERGY CO - H	20,000	12.180	243,600.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	4.540	36,320.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,480,000	8.010	11,854,800.00	
CHINA COSCO HOLDINGS-H	30,150	14.050	423,607.50	
CHINA FEIHE LTD	32,000	3.920	125,440.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	51,500	10.300	530,450.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	53,800	8.020	431,476.00	
CHINA GOLD INTERNATIONAL RES	3,600	194.000	698,400.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	44,500	36.600	1,628,700.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	251,000	0.830	208,330.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	27,600	21.220	585,672.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	111,000	33.720	3,742,920.00	
CHINA LITERATURE LTD	3,600	38.760	139,536.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	7.080	226,560.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	51,000	16.950	864,450.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	62,500	48.900	3,056,250.00	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	10,000	16.240	162,400.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	107,400	4.130	443,562.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	42,000	6.200	260,400.00	
CHINA NONFERROUS MINING CORP	22,000	15.220	334,840.00	

CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	9.700	116,400.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	56,500	14.290	807,385.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	42,800	37.320	1,597,296.00	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	332,000	5.440	1,806,080.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	106,880	10.250	1,095,520.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	33,000	3.140	103,620.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	28,000	4.480	125,440.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	27,000	26.560	717,120.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	16,400	21.580	353,912.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	53,500	30.940	1,655,290.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	10,000	48.120	481,200.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	26,000	18.080	470,080.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	136,000	2.160	293,760.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	49,500	43.560	2,156,220.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	26,000	9.420	244,920.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	30,000	24.500	735,000.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	70,300	11.030	775,409.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	38,000	6.050	229,900.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	29,800	14.180	422,564.00	
CITIC LTD	72,000	12.380	891,360.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	24,500	28.940	709,030.00	
CMOC GROUP LIMITED-H	54,000	23.100	1,247,400.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-H	1,100	531.500	584,650.00	
CRRC CORP LTD H	79,000	5.810	458,990.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	36,000	9.810	353,160.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	11,900	69.800	830,620.00	
FAR EAST HORIZON LTD	36,000	7.910	284,760.00	
FOSUN INTERNATIONAL	55,000	3.880	213,400.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	8,000	63.500	508,000.00	

GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	6,400	63.300	405,120.00	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	282,000	1.210	341,220.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	18,000	45.780	824,040.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	94,000	17.050	1,602,700.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	20,000	12.000	240,000.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	12,400	17.430	216,132.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	4,000	34.240	136,960.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	29,000	13.210	383,090.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	30,000	7.590	227,700.00	
GUOTAI HAITONG SECURITIES CO LTD-H	31,600	17.450	551,420.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	30,000	17.020	510,600.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	34,600	27.560	953,576.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	5,000	24.720	123,600.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	24,000	36.900	885,600.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	4,500	29.380	132,210.00	
HORIZON ROBOTICS INC	65,400	9.040	591,216.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10,000	99.900	999,000.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	50,000	5.560	278,000.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	15,800	17.680	279,344.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	964,000	6.400	6,169,600.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	22,000	89.100	1,960,200.00	
J&T GLOBAL EXPRESS LTD	36,800	10.760	395,968.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	18,000	60.650	1,091,700.00	
JD LOGISTICS INC	37,700	11.270	424,879.00	
JD.COM INC - CL A	36,257	105.900	3,839,616.30	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	22,000	10.260	225,720.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	9,000	44.280	398,520.00	
KE HOLDINGS INC-CL A	30,800	45.300	1,395,240.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	44,000	11.160	491,040.00	
KINGSOFT CORP LTD	13,600	27.840	378,624.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	39,000	68.400	2,667,600.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	64,000	8.190	524,160.00	
LAOPU GOLD CO L-H	500	787.500	393,750.00	
LEGEND GROUP LTD	128,000	9.300	1,190,400.00	
LI AUTO INC-CLASS A	19,900	72.100	1,434,790.00	

LI NING CO LTD	30,000	21.500	645,000.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	36,500	9.990	364,635.00	
MEITU INC	55,500	6.280	348,540.00	
MEITUAN-B	76,060	82.050	6,240,723.00	
MIDEA GROUP CO LTD	7,000	91.700	641,900.00	
MINISO GROUP HOLDING LTD	8,200	39.000	319,800.00	
MMG LTD	56,000	9.980	558,880.00	
NETEASE CLOUD MUSIC INC	1,550	162.800	252,340.00	
NETEASE INC	26,700	187.300	5,000,910.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	18,800	59.400	1,116,720.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	18,100	46.340	838,754.00	
NIO INC-CLASS A	29,100	39.560	1,151,196.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	31,800	48.240	1,534,032.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	1,000	138.800	138,800.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	139,000	6.740	936,860.00	
PETROCHINA CO LTD-H	316,000	9.180	2,900,880.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	101,000	16.660	1,682,660.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	105,000	70.650	7,418,250.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	7,600	251.200	1,909,120.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	149,000	5.110	761,390.00	
REMEGEN CO LTD-H	3,000	80.750	242,250.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	11,750	39.780	467,415.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	46,400	5.110	237,104.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	12,600	63.550	800,730.00	
SICHUAN KELUN-BIOTECH BIOP-H	900	412.600	371,340.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	163,000	6.530	1,064,390.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	18,000	21.480	386,640.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	6,000	41.600	249,600.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	29,000	12.170	352,930.00	
SUNNY OPTICAL TECH	9,300	57.850	538,005.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	96,800	533.000	51,594,400.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	28,000	13.140	367,920.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	16,000	22.400	358,400.00	
TRIP.COM GROUP LTD	9,450	419.800	3,967,110.00	

	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	51.500	412,000.00	
	UBTECH ROBOTICS CORP LTD-H	3,200	138.000	441,600.00	
	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	66,000	4.980	328,680.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	24,000	31.120	746,880.00	
	WUXI APTEC CO LTD-H	5,840	126.000	735,840.00	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	54,500	40.500	2,207,250.00	
	WUXI XDC CAYMAN INC	5,000	65.000	325,000.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	261,000	36.660	9,568,260.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	44,000	3.540	155,760.00	
	XPENG INC - CLASS A SHARES	18,000	69.650	1,253,700.00	
	XTALPI HOLDINGS LTD	28,000	11.250	315,000.00	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	10,000	11.330	113,300.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	41,500	13.510	560,665.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	5,400	417.000	2,251,800.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	25,500	32.140	819,570.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	30,000	7.220	216,600.00	
	ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	5,900	43.940	259,246.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	3,900	43.320	168,948.00	
	ZIJIN GOLD INTERNATIONAL CO	3,700	211.800	783,660.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	90,000	43.520	3,916,800.00	
	ZTE CORP-H	6,200	27.320	169,384.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC	5,650	193.400	1,092,710.00	
	香港・ドル 小計	11,244,357		272,216,104.80 (5,403,489,680)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	8,000	1,450.000	11,600,000.00	
	ADVANTECH CO LTD	7,408	305.000	2,259,440.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	1,200.000	2,400,000.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	1,000	3,380.000	3,380,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	51,000	354.500	18,079,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	16,000	35.650	570,400.00	
	ASIA VITAL COMPONENTS	5,000	1,605.000	8,025,000.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	10,000	523.000	5,230,000.00	
	BIZLINK HOLDING INC	3,000	1,365.000	4,095,000.00	
	CALIWAY BIOPHARMACEUTICALS C	15,000	160.000	2,400,000.00	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	192.500	1,732,500.00	

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	149,000	78.800	11,741,200.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	17,756	107.000	1,899,892.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	77,422	20.750	1,606,506.50	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	27,000	30.850	832,950.00	
CHINA AIRLINES LTD	20,000	22.700	454,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	210,163	19.250	4,045,637.75	
CHINA STEEL CORP	180,000	20.900	3,762,000.00	
CHROMA ATE INC	6,000	1,050.000	6,300,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	59,000	133.000	7,847,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	52,000	30.600	1,591,200.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	249,000	52.200	12,997,800.00	
DELTA ELECTRONICS INC	30,000	1,260.000	37,800,000.00	
E INK HOLDINGS INC	13,000	189.500	2,463,500.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	233,460	34.150	7,972,659.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,000	426.000	1,278,000.00	
ELITE MATERIAL CO LTD	5,000	2,195.000	10,975,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	1,985.000	1,985,000.00	
EVA AIRWAYS CORP	32,000	38.850	1,243,200.00	
EVERGREEN MARINE	14,660	186.000	2,726,760.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	42,000	28.400	1,192,800.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	26,000	91.900	2,389,400.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,718	92.300	343,171.40	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	179,798	29.450	5,295,051.10	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	39,000	42.250	1,647,750.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	66,000	46.500	3,069,000.00	
FORTUNE ELECTRIC CO LTD	2,210	967.000	2,137,070.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	125,359	95.200	11,934,176.80	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	7,000	229.500	1,606,500.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	1,000	2,475.000	2,475,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	445.500	1,782,000.00	
GOLD CIRCUIT ELECTRONICS LTD	5,000	829.000	4,145,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	191,200	227.000	43,402,400.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	5,040	549.000	2,766,960.00	

HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	136,710	34.600	4,730,166.00	
INNOLUX CORPORATION	66,491	21.950	1,459,477.45	
INTERNATIONAL GAMES SYSTEM C	3,000	682.000	2,046,000.00	
INVENTEC CO LTD	42,000	45.350	1,904,700.00	
JENTECH PRECISION INDUSTRIAL	1,000	3,205.000	3,205,000.00	
KING SLIDE WORKS CO LTD	1,000	3,030.000	3,030,000.00	
KING YUAN ELECTRONICS CO LTD	17,000	313.500	5,329,500.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,000	2,290.000	4,580,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	31,000	179.500	5,564,500.00	
LOTES CO LTD	1,000	1,645.000	1,645,000.00	
MEDIATEK INC	23,000	1,855.000	42,665,000.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	172,802	40.050	6,920,720.10	
NAN YA PLASTICS CORP	77,000	78.800	6,067,600.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	400.000	1,200,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	8,000	375.000	3,000,000.00	
PEGATRON CORP	24,000	70.500	1,692,000.00	
PHARMAESSENTIA CORP	3,329	725.000	2,413,525.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	8,000	223.000	1,784,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	40,000	286.000	11,440,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	8,000	476.000	3,808,000.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	179,961	31.100	5,596,787.10	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	333,707	24.000	8,008,968.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	127,751	15.800	2,018,465.80	
TAIWAN CEMENT	99,090	25.800	2,556,522.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	171,916	23.900	4,108,792.40	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	27.150	162,900.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	23,000	106.500	2,449,500.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	372,000	1,915.000	712,380,000.00	
TECO ELECTRIC & MACHINERY	18,000	79.800	1,436,400.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	60,000	40.150	2,409,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	69,000	73.400	5,064,600.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	22,000	369.000	8,118,000.00	

	UNITED MICROELECTRONICS CORP	177,000	62.800	11,115,600.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	16,000	126.000	2,016,000.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	10,795	75.000	809,625.00	
	WISTRON CORP	46,000	131.500	6,049,000.00	
	WIWYNN CORP	2,000	3,740.000	7,480,000.00	
	YAGEO CORPORATION	24,184	256.000	6,191,104.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	20,000	53.300	1,066,000.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	165,668	44.750	7,413,643.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	11,000	178.000	1,958,000.00	
台湾・ドル 小計		4,827,598		1,176,374,520.40 (5,804,231,881)	
南アフリカ・ランド	ABSA GROUP LTD	13,095	269.950	3,534,995.25	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	7,556	1,711.550	12,932,471.80	
	BID CORP LTD	5,024	434.850	2,184,686.40	
	BIDVEST GROUP LTD	4,492	246.150	1,105,705.80	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,382	4,750.130	6,564,679.66	
	CLICKS GROUP LTD	3,602	329.000	1,185,058.00	
	DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	7,097	240.230	1,704,912.31	
	FIRSTRAND LTD	78,956	97.730	7,716,369.88	
	GOLD FIELDS LTD	13,614	842.150	11,465,030.10	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	9,328	326.000	3,040,928.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	14,170	278.220	3,942,377.40	
	MTN GROUP LTD	24,346	194.580	4,737,244.68	
	NASPERS LTD-N SHS	11,810	905.000	10,688,050.00	
	NEDBANK GROUP LTD	8,814	284.260	2,505,467.64	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	7,914	150.680	1,192,481.52	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	5,661	370.070	2,094,966.27	
	OUTSURANCE GROUP LTD	13,976	74.940	1,047,361.44	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	35,649	26.020	927,586.98	
	REINET INVESTMENTS SCA	1,873	548.010	1,026,422.73	
	REMGRO LTD	6,411	188.240	1,206,806.64	
	SANLAM LIMITED	29,257	105.810	3,095,683.17	
	SASOL LTD	7,508	142.420	1,069,289.36	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	7,468	271.000	2,023,828.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	44,242	61.940	2,740,349.48	
	STANDARD BANK GROUP LTD	20,191	324.500	6,551,979.50	
VALTERRA PLATINUM LIMITED	3,733	1,467.210	5,477,094.93		
VODACOM GROUP LTD	10,555	157.850	1,666,106.75		

南アフリカ・ランド 小計	397,724		103,427,933.69 (993,942,443)	
合計	52,788,729		25,089,578,182 (25,089,578,182)	

(2) 株式以外の有価証券

2026年2月20日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	26,579.00	986,240.37	
		ISHARES MSCI QATAR CP ETF	53,967.00	1,071,514.78	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	119,349.00	4,550,777.37	
		ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	123,822.00	2,685,699.18	
	アメリカ・ドル	小計	323,717.00	9,294,231.70 (1,442,000,048)	
投資信託受益証券 合計			323,717	1,442,000,048 (1,442,000,048)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	43,300.00	1,289,474.00	
	メキシコ・ペソ	小計	43,300.00	1,289,474.00 (11,593,532)	
投資証券 合計			43,300	11,593,532 (11,593,532)	
合計				1,453,593,580 (1,453,593,580)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 36銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	1.92 -	- 4.93	- -	7.55
インド・ルピー	株式 163銘柄	12.16	-	-	13.38
インドネシア・ルピア	株式 18銘柄	0.89	-	-	0.98
オフショア・人民元	株式 234銘柄	3.31	-	-	3.65
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.15	-	-	0.16
タイ・バーツ	株式 19銘柄	1.02	-	-	1.12
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.11	-	-	0.12
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.50	-	-	0.55
トルコ・リラ	株式 12銘柄	0.41	-	-	0.46
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.30	-	-	0.33
フィリピン・ペソ	株式 11銘柄	0.32	-	-	0.35
ブラジル・レアル	株式 42銘柄	3.62	-	-	3.99
ポーランド・ズロチ	株式 16銘柄	0.96	-	-	1.06
マレーシア・リンギット	株式 27銘柄	1.08	-	-	1.19
メキシコ・ペソ	株式 20銘柄 投資証券 1銘柄	1.76 -	- -	- 0.04	1.99
ユーロ	株式 9銘柄	0.48	-	-	0.53
韓国・ウォン	株式 81銘柄	15.10	-	-	16.62
香港・ドル	株式 164銘柄	18.49	-	-	20.36
台湾・ドル	株式 85銘柄	19.86	-	-	21.87
南アフリカ・ランド	株式 27銘柄	3.40	-	-	3.74

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2026年2月27日現在

資産総額	12,178,441,717円
負債総額	78,812,357円
純資産総額（ - ）	12,099,629,360円
発行済数量	7,083,551,058口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7081円

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2026年2月27日現在

資産総額	443,205,757,843円
負債総額	1,650,621,122円
純資産総額（ - ）	441,555,136,721円
発行済数量	90,345,183,802口
1口当たり純資産額（ / ）	4.8874円

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2026年2月27日現在

資産総額	1,537,044,674,145円
負債総額	1,688,604,369円
純資産総額（ - ）	1,535,356,069,776円
発行済数量	249,776,187,385口
1口当たり純資産額（ / ）	6.1469円

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

2026年2月27日現在

資産総額	30,697,606,622円
負債総額	73,455,000円
純資産総額（ - ）	30,624,151,622円
発行済数量	13,063,263,391口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3443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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

2026年2月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間に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。

2026年2月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	409	89,796
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	136	19,864
単位型公社債投資信託	0	0
合計	545	109,661

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

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 当社の中間財務諸表は、財務諸表等規則第282条及び第306条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第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。

また、第31期事業年度に係る中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (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	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	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>投資信託委託業務 投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。 委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に收受しております。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>投資運用業務 投資運用業務においては、投資一任契約に基づき、顧客資産を一任して運用指図等を行っております。 運用受託報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に收受しております。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>投資助言業務 投資助言業務においては、投資助言契約に基づき、運用に関する投資判断の助言等を行っております。 投資助言報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に收受しております。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>ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ会計を適用したヘッジ手段とヘッジ対象は以下の通りであります。 ヘッジ手段・・・為替予約 ヘッジ対象・・・自己資金を投資している投資有価証券</p> <p>ヘッジ方針 ヘッジ指定は、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>ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジの有効性の判定については、リスク管理方針に基づき、主にヘッジ対象とヘッジ手段の時価変動を比較する比率分析によっております。</p>
8. グループ通算制度の適用	<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 至 2024年3月31日）	（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）
退職給付債務の期首残高	2,226,246 千円	2,284,401 千円
勤務費用	295,775	311,827
利息費用	14,661	19,553
数理計算上の差異の発生額	16,051	67,081
退職給付の支払額	240,354	251,223
その他	4,124	851
退職給付債務の期末残高	2,284,401	2,298,329

（2）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

(3) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

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

(4) 退職給付費用

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

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表しております。)

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度において81,815千円、当事業年度において84,597千円であり、退職給付費用に計上しております。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、日本生命保険相互会社を通算親会社として、グループ通算制度を適用しております。

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

4. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2023年4月1日 至2024年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	6,138,470

当事業年度（自2024年4月1日 至2025年3月31日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	6,804,755

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

(単位：千円)

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

(注) 成功報酬は、損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

（関連当事者との取引）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自2023年4月1日 至2024年3月31日）

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

当事業年度（自2024年4月1日 至2025年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	日本生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区	50,000	生命保険業	(被所有)直接 100.00%	兼任有 出向有 転籍有	営業取引	運用受託報酬の受取	6,751,148	未収運用受託報酬	1,728,378
								投資助言報酬の受取	117,115	未収投資助言報酬	10,644
								グループ通算に伴う支払	117,888	その他未払金	117,888

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2．親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
1 株当たり純資産額	725,100円65銭	746,525円79銭
1 株当たり当期純利益金額	97,940円47銭	97,948円4銭

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

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
当期純利益	10,621,448千円	10,622,269千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	10,621,448千円	10,622,269千円
期中平均株式数	108千株	108千株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第31期中間会計期間末

(2025年9月30日現在)

資産の部	
流動資産	
現金・預金	14,129,455
有価証券	9,351,176
前払費用	907,956
未収委託者報酬	7,465,518
未収運用受託報酬	7,076,249
未収投資助言報酬	292,177
その他	44,455
流動資産合計	39,266,989
固定資産	
有形固定資産	1 206,972
無形固定資産	4,074,588
投資その他の資産	
投資有価証券	43,178,554
関係会社株式	66,222
長期前払費用	4,036
差入保証金	351,738
繰延税金資産	1,458,945
その他	25,022
投資その他の資産合計	45,084,520
固定資産合計	49,366,081
資産合計	88,633,070

負債の部

流動負債

預り金		62,344
未払収益分配金		5,003
未払償還金		111
未払手数料		2,750,581
未払運用委託報酬		2,635,690
未払投資助言報酬		1,059,485
その他未払金		497,600
未払費用		376,525
未払法人税等		2,060,554
未払消費税等	2	350,797
前受投資助言報酬		42,288
賞与引当金		711,406
その他		24,243
流動負債合計		<u>10,576,633</u>

固定負債

長期未払金		14,171
退職給付引当金		2,644,529
固定負債合計		<u>2,658,701</u>

負債合計

		<u>13,235,335</u>
--	--	-------------------

純資産の部

株主資本

資本金		10,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,281,840
資本剰余金合計		<u>8,281,840</u>

利益剰余金

利益準備金		139,807
その他利益剰余金		
配当準備積立金		120,000
研究開発積立金		70,000
別途積立金		350,000
繰越利益剰余金		56,905,495
利益剰余金合計		<u>57,585,302</u>

株主資本合計

		<u>75,867,142</u>
--	--	-------------------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		249,152
繰延ヘッジ損益		220,254
評価・換算差額等合計		<u>469,407</u>

純資産合計

		<u>75,397,735</u>
--	--	-------------------

負債・純資産合計

		<u>88,633,070</u>
--	--	-------------------

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第31期中間会計期間	
(自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	15,048,337
運用受託報酬	12,476,176
投資助言報酬	599,598
その他営業収益	22,190
営業収益計	<u>28,146,302</u>
営業費用	14,006,345
一般管理費	1 7,126,448
営業利益	<u>7,013,508</u>
営業外収益	2 119,573
営業外費用	3 93,659
経常利益	<u>7,039,422</u>
特別利益	4 39,701
特別損失	5 85,619
税引前中間純利益	<u>6,993,504</u>
法人税、住民税及び事業税	1,914,639
法人税等調整額	210,695
法人税等合計	<u>2,125,334</u>
中間純利益	<u>4,868,169</u>

(3)中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間(自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益剰余金						株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備 金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
					配当準備 積立金	研究開発 積立金	別途積立 金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	62,659,698	63,339,505	81,621,345
当中間期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	-	-	10,622,373	10,622,373	10,622,373
中間純利益	-	-	-	-	-	-	-	4,868,169	4,868,169	4,868,169
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	5,754,203	5,754,203	5,754,203
当中間期末残高	10,000,000	8,281,840	8,281,840	139,807	120,000	70,000	350,000	56,905,495	57,585,302	75,867,142

	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	400,087	262,029	662,116	80,959,229
当中間期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	10,622,373
中間純利益	-	-	-	4,868,169
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	150,934	41,774	192,708	192,708
当中間期変動額合計	150,934	41,774	192,708	5,561,494
当中間期末残高	249,152	220,254	469,407	75,397,735

注記事項

（重要な会計方針）

項目	第31期中間会計期間 （自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）
1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>その他有価証券 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2．デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引の評価は時価法によっております。
3．固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4．引当金の計上基準	<p>賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当中間会計期間末在籍者に対する支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。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平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>なお、受入出向者については、退職給付負担金を出向元に支払っているため、退職給付引当金は計上しておりません。</p>

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

（未適用の会計基準等）

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

1．概要

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

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

2．適用予定日

2028年3月期の期首から適用します。

3．当該会計基準等の適用による影響

「リースに関する会計基準の適用指針」の運用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

(中間貸借対照表関係)

第31期中間会計期間末 (2025年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	816,268千円
2.消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債の「未払消費税等」として表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第31期中間会計期間 (自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)	
1.減価償却の実施額	
有形固定資産	17,960千円
無形固定資産	557,478千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
有価証券利息	55,107千円
受取配当金	46,172千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	18,299千円
金融派生商品費用	71,687千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	39,580千円
5.特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	11,610千円
投資有価証券償還損	64,287千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間
(自 2025年4月1日
至 2025年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数

	当事業年度期首 株式数(千株)	当中間会計期間増加 株式数(千株)	当中間会計期間減少 株式数(千株)	当中間会計期間末 株式数(千株)
発行済株式				
普通株式	108	-	-	108
合計	108	-	-	108

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2025年6月27日 定時株主総会	普通株式	10,622,373	97,949	2025年3月31日	2025年6月27日

（金融商品関係）

第31期中間会計期間末（2025年9月30日現在）

1．金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、以下のとおりであります。

なお、市場価格のない株式等（注1）は次表に含まれておりません。また、短期間で決済されるため時価が簿価に近似する金融商品は、注記を省略しております。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
有価証券			
満期保有目的の債券	9,351,176	9,321,930	29,246
その他有価証券	-	-	-
投資有価証券			
満期保有目的の債券	20,746,511	20,394,602	351,909
その他有価証券	22,432,042	22,432,042	-
デリバティブ取引 ()			
ヘッジ会計が適用され ていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用され ているもの	5,121	5,121	-

()デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については 〇 で示しております。

（注1）市場価格のない株式等

関係会社株式（中間貸借対照表計上額66,222千円）は、市場価格のない株式等と認められるため、上表に記載しておりません。

2．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融商品
第31期中間会計期間末（2025年9月30日現在）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券				
其他有価証券	-	22,432,042	-	22,432,042
デリバティブ取引（ ）				
為替予約	-	5,121	-	5,121
合計	-	22,426,921	-	22,426,921

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

(2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融商品
第31期中間会計期間末（2025年9月30日現在）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券 国債・地方債等	-	29,716,532	-	29,716,532
合計	-	29,716,532	-	29,716,532

(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。

(有価証券関係)

第31期中間会計期間末（2025年9月30日現在）

1. 満期保有目的の債券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えるもの	(1)国債・地方債等	-	-	-
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	-	-	-
時価が中間貸借 対照表計上額を 超えないもの	(1)国債・地方債等	30,097,687	29,716,532	381,155
	(2)社債	-	-	-
	(3)その他	-	-	-
	小計	30,097,687	29,716,532	381,155
合計		30,097,687	29,716,532	381,155

2. その他有価証券

	種類	取得原価または 償却原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えるもの	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	8,665,965	9,449,601	783,635
小計		8,665,965	9,449,601	783,635
中間貸借対照表 計上額が取得原 価または償却原 価を超えないも の	(1)株式	-	-	-
	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他(注)	14,132,000	12,982,441	1,149,558
小計		14,132,000	12,982,441	1,149,558
合計		22,797,965	22,432,042	365,922

(注) 投資信託受益証券等であります。

（デリバティブ取引関係）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第31期中間会計期間末（2025年9月30日現在）

該当事項はありません。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

第31期中間会計期間末（2025年9月30日現在）

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（千円）	契約額等のうち1年超（千円）	時価（千円）
原則的処理方法	為替予約取引 米ドル売建	投資有価証券	560,533	-	5,121
合計			560,533	-	5,121

（注1）時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

区分	第31期中間会計期間 （自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）
営業収益	
投資信託委託業務	15,048,337千円
投資運用業務	12,476,176千円
投資助言業務	599,598千円
その他	22,190千円
計	28,146,302千円

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第31期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第31期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

1．サービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	3,537,309

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

第31期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

第31期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

第31期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	第31期中間会計期間 (自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)
1株当たり純資産額	695,243円20銭
1株当たり中間純利益金額	44,889円43銭

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

2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益金額	4,868,169千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	<u>4,868,169千円</u>
期中平均株式数	108千株

(重要な後発事象)

第31期中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

定款の変更等

該当事項はありません。

訴訟その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

三菱UFJ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

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	
株式会社スマートプラス ¹	100	
楽天証券株式会社	19,495	
moomoo証券株式会社	5,869	
松井証券株式会社	11,945	
株式会社千葉銀行	145,069	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,450,000	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、生命保険業を営んでいます。
ニッセイアセットマネジメント株式会社 ²	10,000	金融商品取引法に定める第二種金融商品取引業を営んでいます。

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

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

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【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【参考情報】

下記の書類が関東財務局長に提出されています。

2025年5月20日	有価証券報告書 有価証券届出書
2025年11月20日	半期報告書 有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

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

2026年5月18日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイ全世界株式インデックスコレクトの2025年2月21日から2026年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイ全世界株式インデックスコレクトの2026年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

2025年11月28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 山口 圭 介

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鈴木 健 嗣

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているニッセイアセットマネジメント株式会社の2025年4月1日から2026年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（2025年4月1日から2025年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニッセイアセットマネジメント株式会社の2025年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2025年4月1日から2025年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以上

1. 上記の中間監査報告書の原本は当社（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。