

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

追加型投信／内外／資産複合
課税上は株式投資信託として取扱われます。

- ◆本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書（請求目論見書）です。
- ◆「DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）／（標準型）／（株式重視型）」は、主に国内外の株式および債券を投資対象としますので、組入株式の価格の下落、組入株式の発行会社の倒産または財務状況の悪化等の影響により、もしくは金利変動等による組入債券の価格の下落、組入債券の発行体の倒産または財務状況の悪化等の影響により、ファンドの基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、これらに加え、為替の変動により損失を被ることがあります。
- ◆本書により行う当ファンドの受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年11月21日に関東財務局長に提出しており、2024年11月22日にその届出の効力が生じております。

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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当事項はありません。

目 次

第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	57
第3【ファンドの経理状況】	62
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	227
第三部【委託会社等の情報】	228
第1【委託会社等の概況】	228
約款	巻末

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

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

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

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

① 契約型の追加型証券投資信託振替受益権です。

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

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

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

なお、委託会社へは後記「(8) 申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

申込単位につきましては、販売会社にお問合せください。

なお、販売会社につきましては、後記「(8) 申込取扱場所」の照会先にお問合せください。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2024年11月22日から2025年5月21日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

申込取扱場所につきましては、以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

払込取扱場所は申込取扱場所と同じです。以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

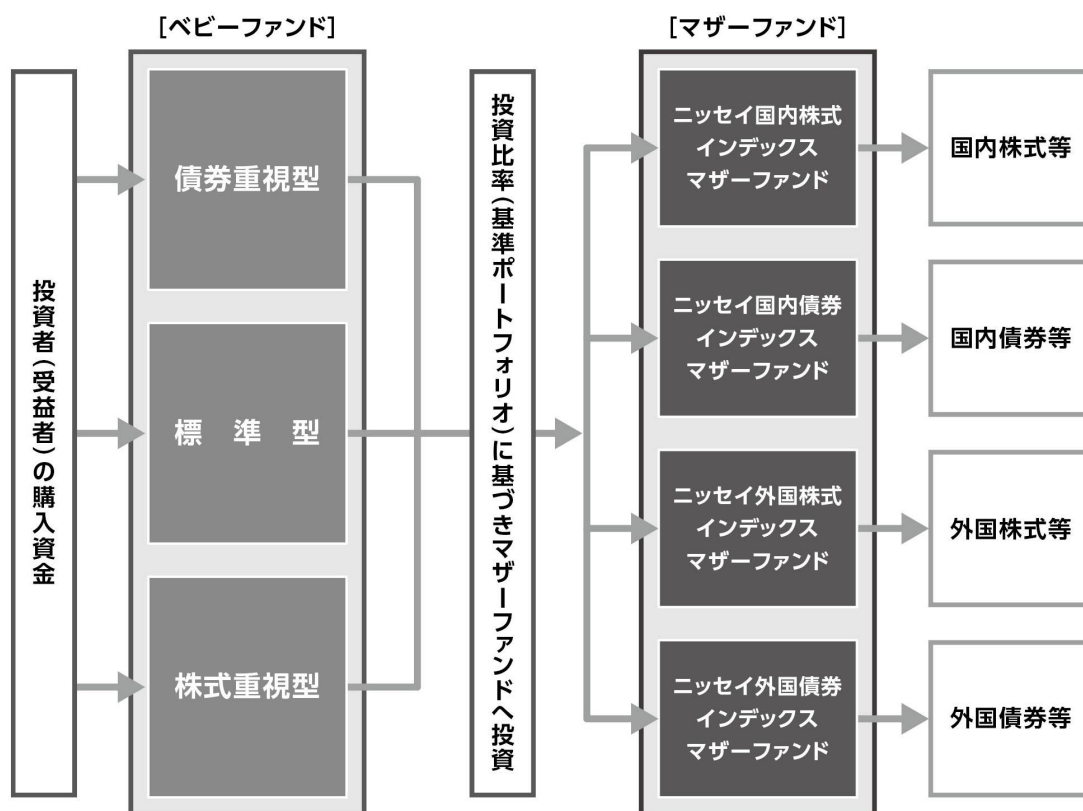
① 基本方針

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

② ファンドの特色

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

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



1 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・解約等にもない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

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

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

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

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

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

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

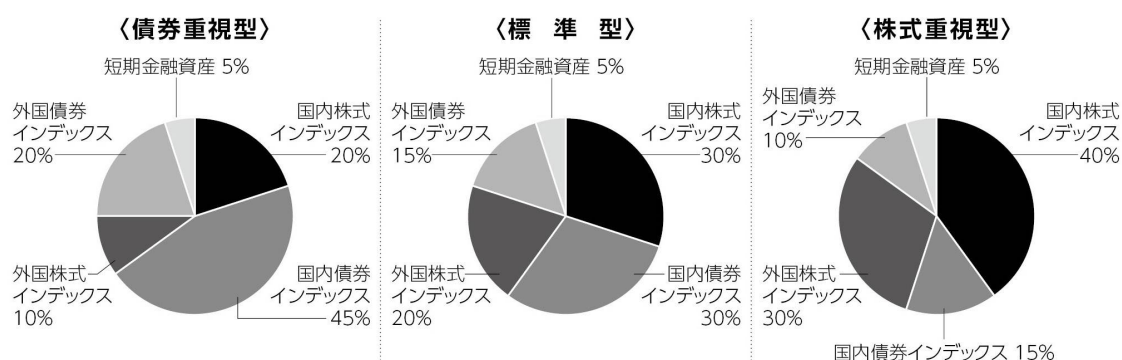
日本を除く世界の主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)^{*3}の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

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

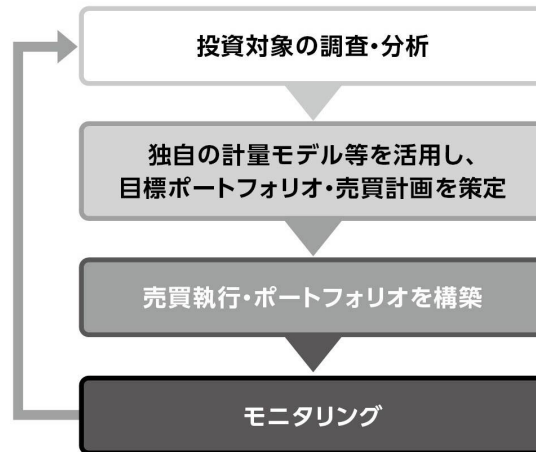
日本を除く世界の主要国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)^{*4}の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

- ※1 TOPIX(東証株価指数)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により株式会社JPX総研が算出する株価指数です。
TOPIX(東証株価指数)の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※2 NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。
- ※3 MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く世界の主要先進国の株式市場の動きを捉える基準として広く認知されているものです。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。
- ※4 FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

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



〈各マザーファンドの運用プロセス〉



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

<MSCI 指数にかかる免責条項等>

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては、前述のような運用ができない場合があります。

③ 信託金の上限

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

④ ファンドの分類

追加型投信／内外／資産複合に属します。

○ 課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
	海 外	債 券
追 加 型	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 (資産複合(株式・債券) 資産配分固定型))	日 々 その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマー ジング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

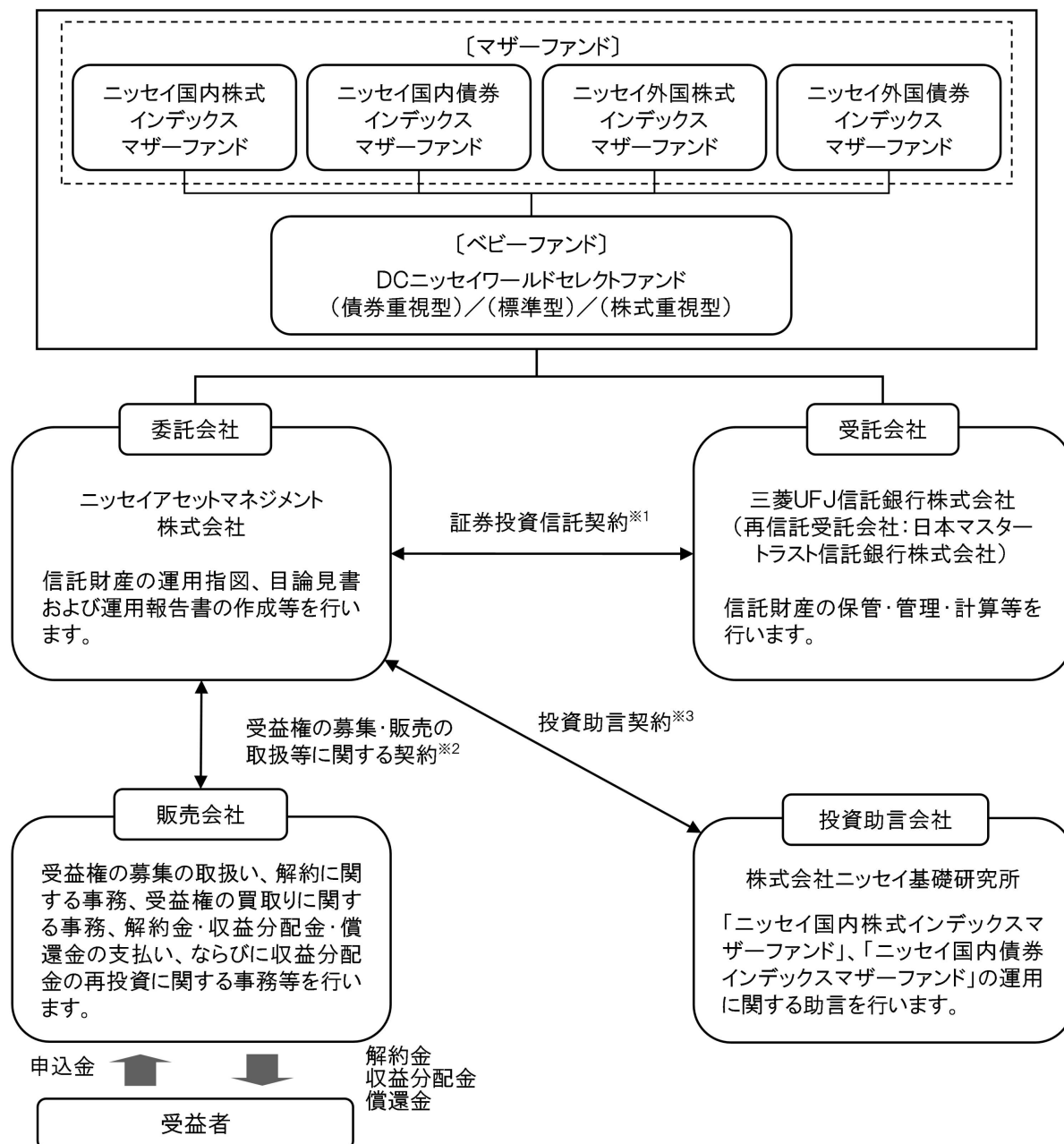
商品分類表	
追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
属性区分表	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式・債券) 資産配分固定型))	目論見書または約款において、主たる投資対象を投資信託証券(マザーファンド)とし、ファンドの実質的な運用をマザーファンドにて行う旨の記載があるものをいう。 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

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】



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

委託会社の概況（2024年8月末現在）

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

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

2 【投資方針】

（1）【投資方針】

- ① 下記の各マザーファンドを主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

- ② 各マザーファンドへの投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

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

- ③ 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等にもなう資金フローの影響により、一時的に上記②の配分から乖離する場合があります。
- ④ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の証券取引所上場株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

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

(3) 投資制限

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

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

このマザーファンドは、主に国内の公社債への投資を行うことにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行うことを基本方針とします。

(2) 運用方法

a 投資対象

国内の公社債を主要投資対象とします。

b 投資態度

- ① 国内の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。
- ③ 組入銘柄は、原則として投資適格銘柄に限定し、信用リスクを抑制します。
- ④ 公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- ⑤ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 投資対象資産は、国内の通貨建てまたはユーロ円建て表示であるものに限りません。
- ④ 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。
- ⑤ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

b 投資態度

- ① 主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。
- ② 株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- ③ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ④ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ② 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ④ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑤ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑥ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑦ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ⑧ デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます）および外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- ⑨ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

a 投資対象

日本を除く世界主要先進国の国債を主要投資対象とします。

b 投資態度

- ① 主として、日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。
- ② 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- ③ 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ④ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

(2) 【投資対象】

a 主な投資対象

下記の各マザーファンドを主要投資対象とします。また、各マザーファンドはそれぞれ下記の指数の動きに連動する投資成果をめざします。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

…T O P I X (東証株価指数) (配当込み)

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

…N O M U R A - B P I 総合

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

…M S C I コクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

…F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)

なお、直接、株式、公社債等に投資を行う場合があります。

b 約款に定める投資対象

① 投資の対象とする資産の種類

このファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権 (イ. およびニ. に掲げるものに該当するものを除きます)

ニ. 約束手形 (イ. に掲げるものを除きます)

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

② 有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券 (金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます)

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

14. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で21.の有価証券の性質を有するもの

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

③ 金融商品

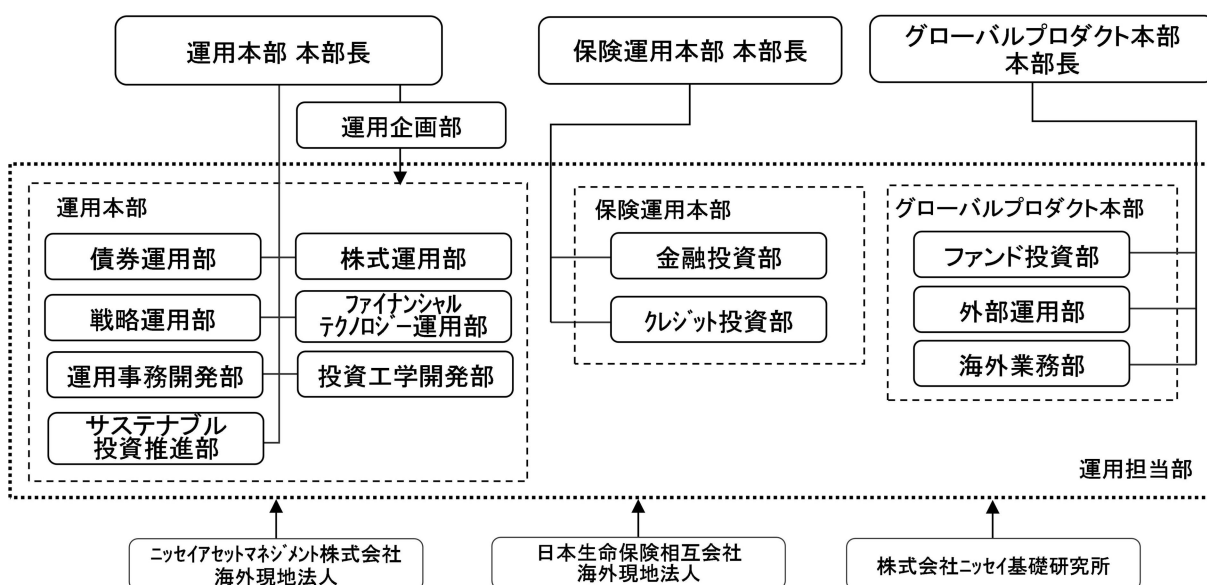
信託金を前記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下④において同じ）により運用することができます。

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

④ 前記②にかかわらず、このファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、信託金を前記③の1.から4.までに掲げる金融商品により運用することができます。

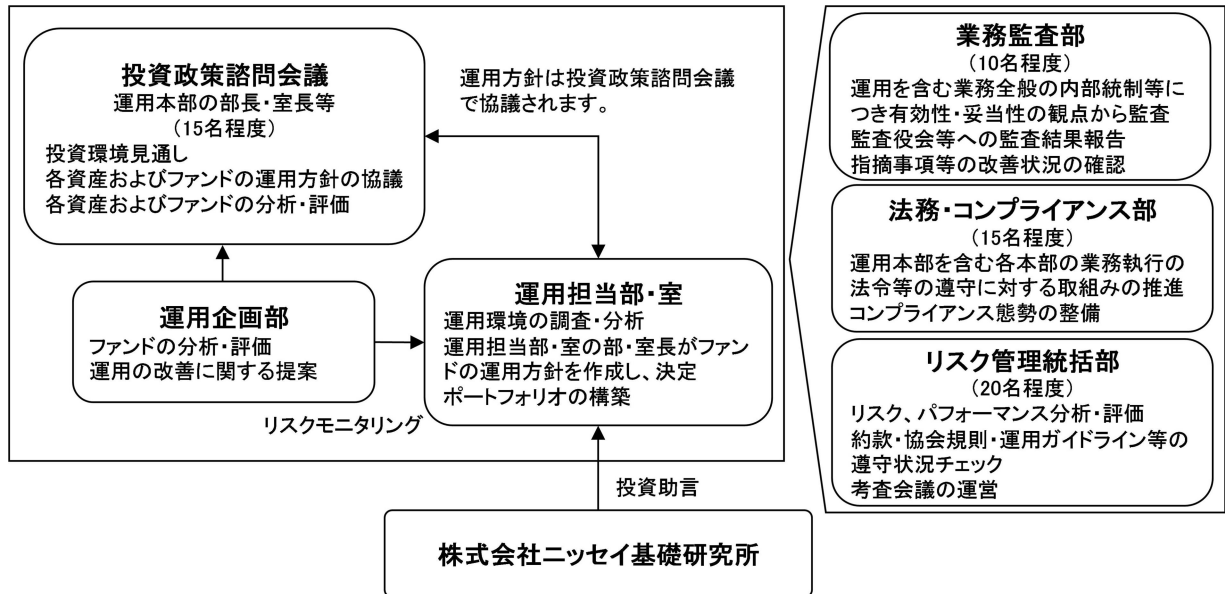
(3) 【運用体制】

委託会社の組織体制



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

内部管理体制および意思決定を監督する組織



<受託会社に対する管理体制等>

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

- 上記運用体制は、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

- ① 原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます）等の全額とします。

2. 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

3. 留保益の運用方針

特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

- ② 分配時期

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

- ③ 支払方法

<分配金受取コースの場合>

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

<分配金再投資コースの場合>

税金を差引いた後※、自動的に無手数料で再投資されます。

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

- 将来の分配金の支払いおよび水準について、保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

a 約款に定める主な投資制限

① 株式への実質投資割合

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

② 外貨建資産への実質投資割合

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

③ 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。

④ 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。

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

⑥ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑦ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧ 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。

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

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

b 約款に定めるその他の投資制限

① 投資する株式等の範囲

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

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

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

② 信用取引の範囲

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

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

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

③ 先物取引等

1. 国内の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ）ならびに外国の取引所にお

けるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ）。

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

④ スワップ取引

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

⑤ 金利先渡取引および為替先渡取引

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

⑥ 有価証券の貸付けおよび範囲

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

⑦ 有価証券の空売り

1. 信託財産を効率的に運用するため、信託財産において有しない有価証券または後記⑧により借入れた有価証券を売付けることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことができます。
2. 前記1.の売付けは、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2.の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するものとします。

⑧ 有価証券の借入れ

1. 信託財産を効率的に運用するため、有価証券の借入れを行うことができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供を行うものとしします。
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します。
4. 前記1. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支払われます。

⑨ 外国為替予約等

1. 外国為替の売買の予約取引を行うことができます。
2. 前記1. の予約取引は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとしします。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します。
5. 外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

⑩ 資金の借入れ

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

c. 法令に定める投資制限

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

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

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

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

③ 同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

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

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

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

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

（1）投資リスクおよび留意事項

ファンドが有する主なリスクおよび留意事項は以下の通りです。

・株式投資リスク

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

・債券投資リスク

金利変動リスク

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

信用リスク

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

・短期金融資産の運用に関するリスク

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

・為替変動リスク

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

・流動性リスク

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

・収益分配金に関する留意点

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

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

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

・ファミリーファンド方式に関する留意点

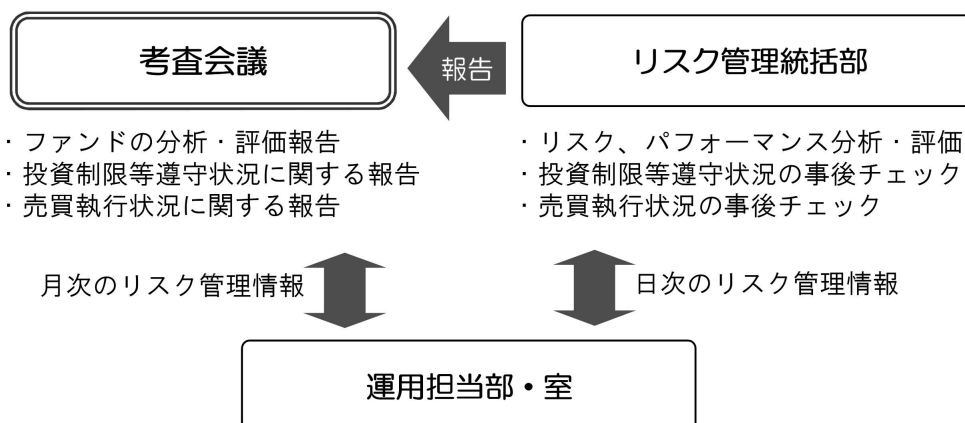
ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。このため、マザーファンドに投資する他のベビーファンドの追加設定・解約等にともない、ファンドの基準価額が影響を受けることがあります。

・流動性に関する留意点

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

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

(2) 投資リスク管理体制



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

○ 上記投資リスク管理体制は、今後変更となる場合があります。

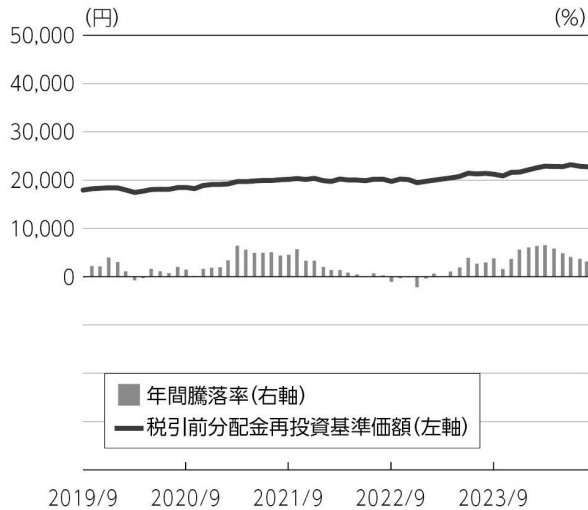
<流動性リスクに関する管理体制>

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

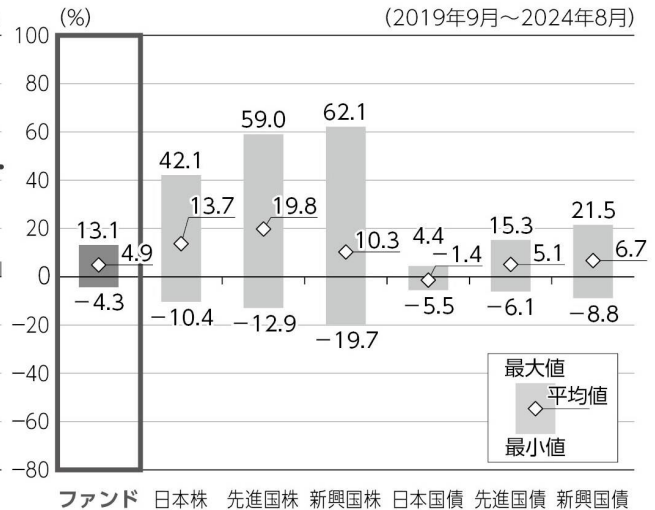
(参考情報) 投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

●DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移

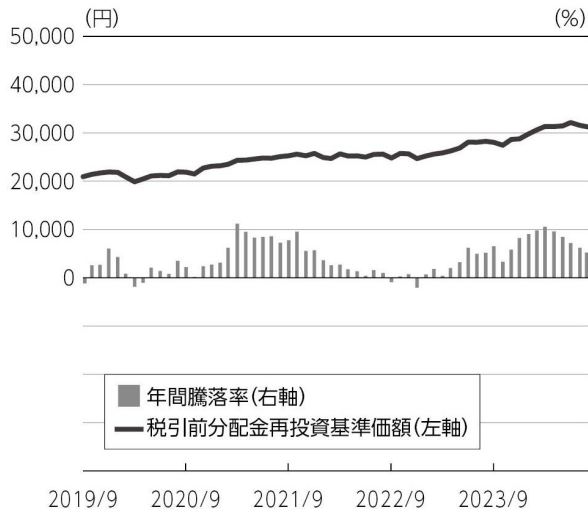


②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

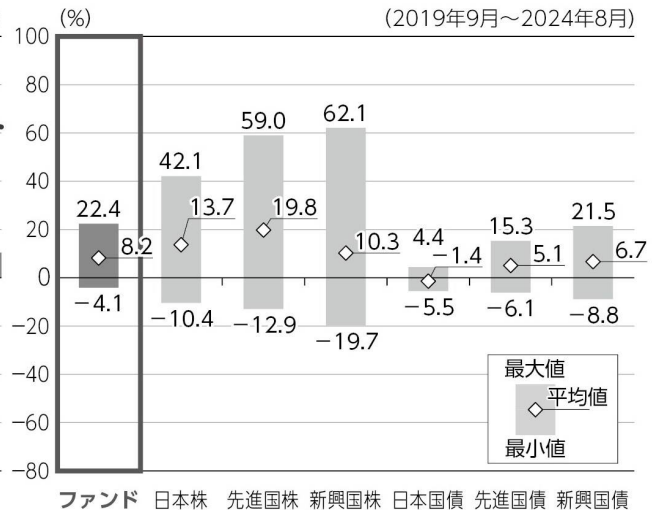


●DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移

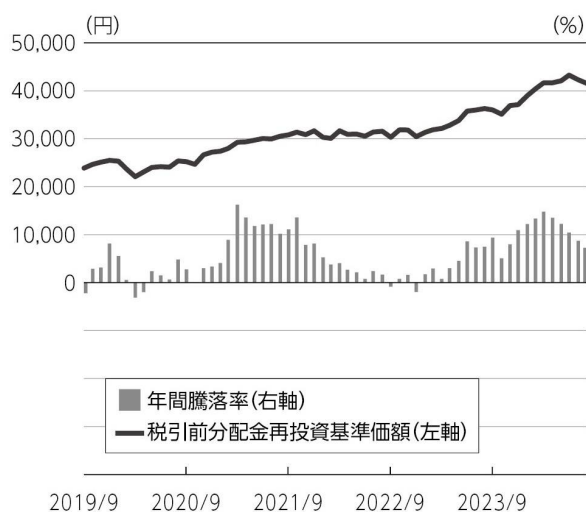


②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

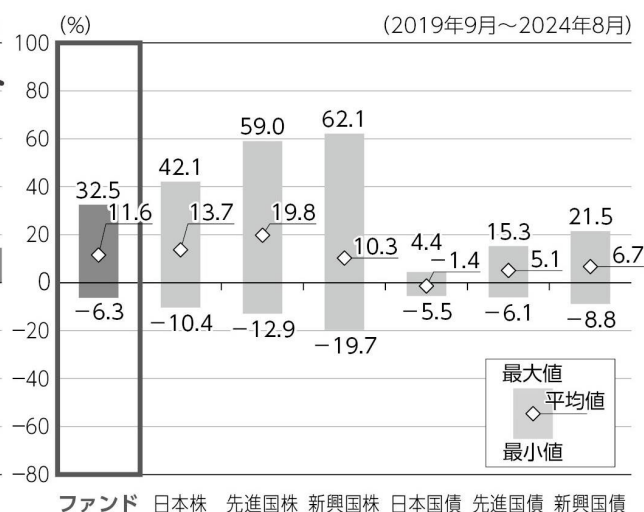


●DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

①ファンドの年間騰落率および
税引前分配金再投資基準価額の推移



②ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較



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

・グラフ①は、過去5年間のファンドの実績です。グラフ②は、過去5年間におけるファンドおよび代表的な資産クラスの年間騰落率の最大値・最小値・平均値について表示しています。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株 … TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株 … MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債 … NOMURA-BPI 国債
- 先進国債 … FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債 … JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)

- ・すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
- ・海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.154%（税抜0.14%）の率をかけた額とし、その配分は次の通りです。

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

・表に記載の料率には、別途消費税がかかります。

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

(4) 【その他の手数料等】

① 証券取引の手数料等

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

② 監査費用

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

③ 信託事務の諸費用

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

④ 借入金の利息

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

⑤ 信託財産留保額

ありません。

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

<ご参考>

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

《確定拠出年金としてファンドを取得した場合》

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

《確定拠出年金としてではなくファンドを取得した場合》

課税対象

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

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

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

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

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

個人の課税の取扱い

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

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

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

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

税率（個人）

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

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

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

<少額投資非課税制度について>

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

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

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

詳しくは、販売会社にお問合せください。

法人の課税の取扱い（分配時・解約請求・償還時）

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

益金不算入制度の適用はありません。

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

税率（法人）

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

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

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

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

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

(参考情報) ファンドの総経費率

債券重視型

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.17%	0.15%	0.01%

標準型

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.17%	0.15%	0.01%

株式重視型

総経費率(①+②)	① 運用管理費用の比率	② その他費用の比率
0.17%	0.15%	0.01%

- ・対象期間:2023年2月22日～2024年2月21日
- ・対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。
- ・費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。
- ・①運用管理費用の比率、②その他費用の比率および総経費率は、表示桁数未満を四捨五入しているため、①と②の合計が総経費率の数字と一致しないことがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	30,662,106,606	95.02
内 日本	30,662,106,606	95.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,607,738,909	4.98
純資産総額	32,269,845,515	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	76,576,302,279	95.06
内 日本	76,576,302,279	95.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,983,164,376	4.94
純資産総額	80,559,466,655	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	51,178,182,425	95.08
内 日本	51,178,182,425	95.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,645,731,417	4.92
純資産総額	53,823,913,842	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	246,759,461,720	97.52
内 日本	246,759,461,720	97.52
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,276,582,490	2.48
純資産総額	253,036,044,210	100.00

その他資産の投資状況

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）	6,272,805,000	2.48
内 日本	6,272,805,000	2.48

（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。

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	78,666,331,920	98.94
内 日本	78,666,331,920	98.94
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	846,527,850	1.06
純資産総額	79,512,859,770	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。

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	998,932,837,569	94.93
内 アメリカ	737,324,430,691	70.07
内 イギリス	40,634,445,726	3.86
内 カナダ	33,710,469,105	3.20
内 スイス	31,588,247,984	3.00
内 フランス	28,748,459,025	2.73
内 ドイツ	23,846,105,950	2.27
内 オーストラリア	19,081,033,845	1.81
内 オランダ	17,905,800,973	1.70
内 アイルランド	11,908,546,631	1.13
内 デンマーク	10,236,668,532	0.97
内 スウェーデン	8,896,108,012	0.85
内 スペイン	7,414,047,549	0.70
内 イタリア	6,411,911,806	0.61
内 香港	4,263,307,024	0.41
内 シンガポール	2,919,180,707	0.28
内 フィンランド	2,806,460,970	0.27
内 ベルギー	2,679,292,585	0.25
内 ノルウェー	1,597,541,032	0.15
内 イスラエル	1,512,099,020	0.14
内 ジャージー	1,331,061,398	0.13
内 オランダ領キュラソー	992,989,715	0.09
内 バミューダ	865,449,252	0.08
内 オーストリア	521,951,025	0.05
内 ポルトガル	519,856,514	0.05
内 ニュージーランド	492,260,168	0.05
内 ケイマン諸島	443,063,307	0.04
内 ルクセンブルグ	282,049,023	0.03
投資証券	19,729,844,632	1.87
内 アメリカ	17,139,938,369	1.63
内 オーストラリア	1,283,068,279	0.12
内 フランス	371,314,381	0.04
内 イギリス	318,300,901	0.03
内 シンガポール	267,904,044	0.03
内 香港	190,505,410	0.02
内 カナダ	85,685,085	0.01
内 ベルギー	73,128,163	0.01
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	33,618,769,860	3.19
純資産総額	1,052,281,452,061	100.00

その他資産の投資状況

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 (買建)	32,433,810,544	3.08
内 アメリカ	24,004,292,400	2.28
内 ドイツ	6,042,290,730	0.57
内 イギリス	2,387,227,414	0.23

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

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

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	84,963,408,191	98.65
内 アメリカ	40,212,961,320	46.69
内 中国	8,630,001,344	10.02
内 フランス	6,485,785,950	7.53
内 イタリア	5,934,181,401	6.89
内 ドイツ	5,207,700,555	6.05
内 イギリス	4,586,691,812	5.33
内 スペイン	3,856,964,547	4.48
内 カナダ	1,720,154,200	2.00
内 ベルギー	1,377,985,081	1.60
内 オランダ	1,160,750,772	1.35
内 オーストラリア	1,134,979,558	1.32
内 オーストリア	982,893,801	1.14
内 メキシコ	602,276,567	0.70
内 ポーランド	443,923,131	0.52
内 フィンランド	431,233,510	0.50
内 マレーシア	430,714,116	0.50
内 アイルランド	417,357,104	0.48
内 シンガポール	348,644,577	0.40
内 イスラエル	275,436,005	0.32
内 デンマーク	226,582,993	0.26
内 ニュージーランド	222,119,327	0.26
内 スウェーデン	137,853,995	0.16
内 ノルウェー	136,216,525	0.16
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	1,161,651,279	1.35
純資産総額	86,125,059,470	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	10,988,096,961	1.2949 14,229,093,570	1.2793 14,057,072,442	— —	43.56
2	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,140,273,480	3.1085 6,653,246,814	3.2477 6,950,966,180	— —	21.54
3	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,651,591,557	1.7099 6,244,030,591	1.7211 6,284,754,228	— —	19.48
4	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	753,559,169	4.1848 3,153,496,722	4.4712 3,369,313,756	— —	10.44

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年8月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	国内		95.02
	小計		95.02
合計 (対純資産総額比)			95.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,832,975,104	3.1126 24,381,181,307	3.2477 25,439,153,245	— —	31.58
2	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	18,011,267,884	1.2947 23,319,664,079	1.2793 23,041,815,004	— —	28.60
3	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,698,925,667	4.1749 15,442,707,871	4.4712 16,538,636,442	— —	20.53
4	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,714,715,931	1.7087 11,474,104,410	1.7211 11,556,697,588	— —	14.35

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年8月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	国内		95.06
	小計		95.06
合 計 (対純資産総額比)			95.06

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,858,956,619	3.1240 21,427,490,003	3.2477 22,275,833,411	— —	41.39
2	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,642,485,429	4.1887 15,257,387,235	4.4712 16,286,280,850	— —	30.26
3	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,909,502,650	1.2933 7,643,054,419	1.2793 7,560,026,740	— —	14.05
4	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,937,680,219	1.7129 5,032,000,865	1.7211 5,056,041,424	— —	9.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年8月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	国内		95.08
	小計		95.08
合 計 (対純資産総額比)			95.08

(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。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	3,433,500	3,387.24 11,630,122,192	2,759.50 9,474,743,250	— —	3.74
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	452,300	13,300.83 6,015,968,973	14,200.00 6,422,660,000	— —	2.54
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	3,873,900	1,494.31 5,788,830,098	1,528.00 5,919,319,200	— —	2.34
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	1,567,600	2,522.03 3,953,535,108	3,572.00 5,599,467,200	— —	2.21
5	キーエンス 日本	株式	64,600	68,943.02	69,610.00	—	1.78

	日本	電気機器		4,453,719,230	4,496,806,000	—	
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	478,200	6,051.58 2,893,867,836	9,047.00 4,326,275,400	— —	1.71
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	445,500	8,177.58 3,643,113,230	9,550.00 4,254,525,000	— —	1.68
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,312,200	3,124.30 4,099,711,680	3,013.00 3,953,658,600	— —	1.56
9	信越化学工業 日本	株式 化学	580,200	6,128.12 3,555,539,893	6,422.00 3,726,044,400	— —	1.47
10	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	459,400	6,644.46 3,052,465,440	7,706.00 3,540,136,400	— —	1.40
11	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	136,700	34,404.18 4,703,052,184	25,805.00 3,527,543,500	— —	1.39
12	第一三共 日本	株式 医薬品	564,400	4,973.03 2,806,779,910	6,108.00 3,447,355,200	— —	1.36
13	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	621,100	4,468.87 2,775,616,352	5,506.00 3,419,776,600	— —	1.35
14	任天堂 日本	株式 その他製品	407,800	8,249.66 3,364,214,832	7,902.00 3,222,435,600	— —	1.27
15	三井物産 日本	株式 卸売業	1,023,700	3,206.14 3,282,127,830	3,123.00 3,197,015,100	— —	1.26
16	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	19,268,500	179.36 3,456,123,636	155.70 3,000,105,450	— —	1.19
17	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	319,500	8,550.11 2,731,762,540	8,405.00 2,685,397,500	— —	1.06
18	HOYA 日本	株式 精密機器	127,200	18,535.89 2,357,766,086	20,595.00 2,619,684,000	— —	1.04
19	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	858,600	2,764.42 2,373,531,150	3,009.00 2,583,527,400	— —	1.02
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	573,400	4,444.23 2,548,323,200	4,333.00 2,484,542,200	— —	0.98
21	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,530,300	1,738.50 2,660,431,466	1,588.00 2,430,116,400	— —	0.96
22	KDDI 日本	株式 情報・通信業	476,500	4,610.52 2,196,917,172	4,911.00 2,340,091,500	— —	0.92
23	三菱重工業 日本	株式 機械	1,140,800	1,187.56 1,354,775,302	1,942.50 2,216,004,000	— —	0.88
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	1,034,900	1,964.15 2,032,702,282	2,038.00 2,109,126,200	— —	0.83
25	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	38,400	41,548.87 1,595,476,720	46,650.00 1,791,360,000	— —	0.71

26	村田製作所	株式	577,000	2,959.30	3,033.00	—	0.69
	日本	電気機器		1,707,520,500	1,750,041,000	—	
27	三菱電機	株式	714,600	2,317.38	2,441.00	—	0.69
	日本	電気機器		1,656,005,270	1,744,338,600	—	
28	日本たばこ産業	株式	386,400	3,931.32	4,203.00	—	0.64
	日本	食料品		1,519,064,732	1,624,039,200	—	
29	キヤノン	株式	322,100	4,228.50	5,017.00	—	0.64
	日本	電気機器		1,362,001,376	1,615,975,700	—	
30	富士通	株式	600,300	2,321.75	2,677.50	—	0.64
	日本	電気機器		1,393,747,685	1,607,303,250	—	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年8月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	電気機器	17.11
		銀行業	7.38
		輸送用機器	7.33
		情報・通信業	7.29
		卸売業	7.13
		化学	5.55
		機械	5.21
		医薬品	4.97
		サービス業	4.65
		小売業	4.20
		食料品	3.08
		保険業	3.05
		その他製品	2.41
		精密機器	2.36
		陸運業	2.27
		建設業	2.10
		不動産業	2.00
		電気・ガス業	1.40
		その他金融業	1.18
		証券、商品先物取引業	0.85
		鉄鋼	0.84
		海運業	0.79
		非鉄金属	0.75
		ガラス・土石製品	0.65
		ゴム製品	0.58
		石油・石炭製品	0.54
金属製品	0.49		
繊維製品	0.36		
空運業	0.36		
鋳業	0.29		
パルプ・紙	0.14		
倉庫・運輸関連業	0.14		
水産・農林業	0.08		
	小計		97.52
合計 (対純資産総額比)			97.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	第342回 利付国債(10年) 日本	国債証券	5,892,000,000	99.72 5,875,810,690	99.66 5,872,026,120	0.1 2026/3/20	7.39
2	第346回 利付国債(10年) 日本	国債証券	5,671,000,000	99.28 5,630,636,980	99.31 5,632,380,490	0.1 2027/3/20	7.08
3	第370回 利付国債(10年) 日本	国債証券	5,121,000,000	97.61 4,998,800,620	97.95 5,016,173,130	0.5 2033/3/20	6.31
4	第160回 利付国債(20年) 日本	国債証券	4,817,000,000	95.97 4,623,213,070	94.44 4,549,415,650	0.7 2037/3/20	5.72
5	第362回 利付国債(10年) 日本	国債証券	4,647,000,000	96.59 4,488,602,390	97.03 4,509,169,980	0.1 2031/3/20	5.67
6	第358回 利付国債(10年) 日本	国債証券	4,525,000,000	98.13 4,440,496,070	97.78 4,424,907,000	0.1 2030/3/20	5.57
7	第354回 利付国債(10年) 日本	国債証券	3,774,000,000	97.62 3,684,289,520	98.33 3,711,011,940	0.1 2029/3/20	4.67
8	第168回 利付国債(5年) 日本	国債証券	3,582,000,000	100.55 3,601,880,100	100.55 3,601,915,920	0.6 2029/3/20	4.53
9	第158回 利付国債(5年) 日本	国債証券	3,442,000,000	99.25 3,416,201,880	98.95 3,405,893,420	0.1 2028/3/20	4.28
10	第148回 利付国債(20年) 日本	国債証券	3,192,000,000	106.88 3,411,663,160	105.83 3,378,157,440	1.5 2034/3/20	4.25
11	第46回 利付国債(30年) 日本	国債証券	3,243,000,000	98.94 3,208,844,310	95.42 3,094,730,040	1.5 2045/3/20	3.89
12	第134回 利付国債(20年) 日本	国債証券	2,785,000,000	109.33 3,044,929,200	108.46 3,020,778,100	1.8 2032/3/20	3.80
13	第344回 利付国債(10年) 日本	国債証券	2,836,000,000	99.68 2,827,169,500	99.47 2,820,997,560	0.1 2026/9/20	3.55
14	第184回 利付国債(20年) 日本	国債証券	2,894,000,000	90.60 2,622,062,370	91.21 2,639,848,920	1.1 2043/3/20	3.32
15	第350回 利付国債(10年) 日本	国債証券	2,615,000,000	99.18 2,593,693,710	98.95 2,587,568,650	0.1 2028/3/20	3.25
16	第34回 利付国債(30年)	国債証券	2,325,000,000	113.03	109.86	2.2	3.21

	年) 日本	券		2,628,148,360	2,554,268,250	2041/3/20	
17	第152回 利付国債(20年) 日本	国債証券	2,431,000,000	101.57 2,469,274,090	102.20 2,484,482,000	1.2 2035/3/20	3.12
18	第7回 利付国債(40年) 日本	国債証券	2,573,000,000	90.16 2,320,033,840	91.29 2,348,943,160	1.7 2054/3/20	2.95
19	第4回 利付国債(40年) 日本	国債証券	1,860,000,000	109.34 2,033,747,140	103.64 1,927,834,200	2.2 2051/3/20	2.42
20	第8回 利付国債(40年) 日本	国債証券	1,991,000,000	84.59 1,684,385,280	83.92 1,671,006,480	1.4 2055/3/20	2.10
21	第348回 利付国債(10年) 日本	国債証券	1,550,000,000	99.15 1,536,918,000	99.15 1,536,902,500	0.1 2027/9/20	1.93
22	第143回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,263,000,000	108.06 1,364,837,740	107.04 1,351,915,200	1.6 2033/3/20	1.70
23	第176回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,579,000,000	86.33 1,363,185,940	85.10 1,343,855,320	0.5 2041/3/20	1.69
24	第168回 利付国債(20年) 日本	国債証券	1,408,000,000	86.19 1,213,597,510	87.23 1,228,198,400	0.4 2039/3/20	1.54
25	第26回 利付国債(30年) 日本	国債証券	774,000,000	116.57 902,281,230	114.20 883,946,700	2.4 2037/3/20	1.11
26	第54回 利付国債(30年) 日本	国債証券	1,085,000,000	80.95 878,309,710	80.54 873,859,000	0.8 2047/3/20	1.10
27	第15回 利付国債(40年) 日本	国債証券	1,058,000,000	72.81 770,433,920	68.17 721,302,080	1 2062/3/20	0.91
28	第11回 利付国債(40年) 日本	国債証券	758,000,000	71.58 542,601,210	67.62 512,605,080	0.8 2058/3/20	0.64
29	第366回 利付国債(10年) 日本	国債証券	420,000,000	96.97 407,303,770	96.69 406,110,600	0.2 2032/3/20	0.51
30	第90回 利付国債(20年) 日本	国債証券	347,000,000	104.84 363,825,710	103.75 360,022,910	2.2 2026/9/20	0.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年8月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	国内	国債証券	98.94
	小計		98.94
合計 (対純資産総額比)			98.94

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類 業種	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー・ ハード ウェアおよび機器	1,599,949	27,579.35 44,125,554,725	33,273.59 53,236,050,246	— —	5.06
2	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,726,613	13,473.46 36,736,921,272	17,027.03 46,426,126,802	— —	4.41
3	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア・ サービス	769,874	60,848.22 46,845,470,101	59,819.77 46,053,690,228	— —	4.38
4	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	1,021,112	26,718.14 27,282,215,301	24,922.97 25,449,149,869	— —	2.42
5	META PLATFORMS INC-A アメリカ	株式 メディア ・エンタ テイン	238,974	68,307.35 16,323,682,387	75,038.25 17,932,192,189	— —	1.70
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 メディア ・エンタ テイン	642,696	25,474.08 16,372,089,351	23,425.74 15,055,631,965	— —	1.43
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 メディア ・エンタ テイン	556,668	25,655.88 14,281,812,500	23,660.31 13,170,943,013	— —	1.25
8	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	88,142	111,626.95 9,839,022,780	136,140.95 11,999,736,496	— —	1.14
9	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製	480,153	20,215.34 9,706,460,555	22,723.46 10,910,739,409	— —	1.04

		造装置					
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	313,230	29,683.04 9,297,620,730	32,176.00 10,078,490,985	— —	0.96
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	142,973	60,440.12 8,641,306,603	67,819.97 9,696,425,428	— —	0.92
12	TESLA, INC. アメリカ	株式 自動車・ 自動車部 品	312,619	25,827.78 8,074,257,026	29,869.34 9,337,724,451	— —	0.89
13	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア機器・ サービス	100,563	76,093.12 7,652,152,844	85,659.33 8,614,159,806	— —	0.82
14	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 エネル ギー	489,247	17,319.62 8,473,573,622	17,105.22 8,368,679,526	— —	0.80
15	NOVO-NORDISK A/S デンマーク	株式 医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	355,913	19,431.37 6,915,880,670	19,836.52 7,060,076,054	— —	0.67
16	VISA INC-CLASS A SHARES アメリカ	株式 金融サー ビス	172,496	40,500.80 6,986,226,967	39,721.53 6,851,806,073	— —	0.65
17	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 金融サー ビス	90,870	66,603.30 6,052,242,215	69,619.83 6,326,354,860	— —	0.60
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用 品・パー ソナル用 品	256,643	24,254.01 6,224,623,994	24,620.34 6,318,638,945	— —	0.60
19	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	262,829	22,400.30 5,887,448,453	23,780.50 6,250,206,085	— —	0.59
20	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	48,369	115,290.63 5,576,492,655	128,384.02 6,209,806,856	— —	0.59
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	43,579	136,703.67 5,957,409,261	132,042.11 5,754,263,547	— —	0.55
22	HOME DEPOT INC	株式	108,088	49,892.14	53,150.28	—	0.55

	アメリカ	一般消費財・サービス流通・小売り		5,392,742,220	5,744,908,329	—	
23	ABBVIE INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	193,127	24,148.06 4,663,643,829	28,262.06 5,458,167,634	— —	0.52
24	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・小売り	483,354	9,375.44 4,531,661,230	11,065.61 5,348,609,756	— —	0.51
25	NETFLIX INC アメリカ	株式 メディア・娯楽	47,222	89,939.57 4,247,126,730	100,271.10 4,735,002,073	— —	0.45
26	MERCK & CO 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	276,236	18,943.70 5,232,932,517	17,008.20 4,698,279,345	— —	0.45
27	COCA-COLA CO アメリカ	株式 食品・飲料・タバコ	446,740	9,140.11 4,083,255,380	10,432.83 4,660,766,941	— —	0.44
28	NESTLE SA スイス	株式 食品・飲料・タバコ	291,192	16,477.93 4,798,243,780	15,563.52 4,531,973,680	— —	0.43
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	774,502	5,695.52 4,411,191,884	5,816.61 4,504,980,725	— —	0.43
30	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	169,074	23,101.88 3,905,927,779	25,313.51 4,279,857,742	— —	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年8月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	ソフトウェア・サービス	9.31
		半導体・半導体製造装置	8.64
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.03
		資本財	6.73
		金融サービス	6.57
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.50
		メディア・娯楽	6.04
		銀行	5.49
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.48
		エネルギー	4.21
		ヘルスケア機器・サービス	4.10
		素材	3.54
		食品・飲料・タバコ	3.12
		保険	3.05
		公益事業	2.60
		消費者サービス	1.80
		生活必需品流通・小売り	1.75
		商業・専門サービス	1.58
		家庭用品・パーソナル用品	1.56
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.51
		耐久消費財・アパレル	1.28
	電気通信サービス	1.11	
不動産管理・開発	0.28		
その他	0.06		
	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.03	
	小計	94.93	
投資証券	外国		1.87
	小計		1.87
合計 (対純資産総額比)			96.81

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

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 国/地域	種類	株数、口数又は 額面金額	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	2,112,632,000	94.59 1,998,414,194	96.50 2,038,689,880	1.625 2026/2/15	2.37
2	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,629,000,000	96.12 1,565,811,090	97.64 1,590,620,760	2.25 2025/11/15	1.85
3	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,631,896,000	94.29 1,538,875,598	96.08 1,568,072,547	1.625 2026/5/15	1.82
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,343,744,000	92.19 1,238,814,680	95.52 1,283,584,581	2.625 2029/2/15	1.49
5	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,320,576,000	93.60 1,236,182,357	95.45 1,260,582,232	1.5 2026/8/15	1.46
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券	1,311,888,000	91.09 1,195,077,673	94.27 1,236,756,174	2.375 2029/5/15	1.44
7	US TREASURY N/B	国債証券	1,148,264,000	93.88	96.08	2	1.28

	アメリカ	券		1,078,008,709	1,103,309,464	2026/11/15	
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,129,440,000	94.02 1,061,982,834	96.32 1,087,876,608	2.25 2027/2/15	1.26
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,097,584,000	96.36 1,057,697,319	97.75 1,072,976,166	2 2025/8/15	1.25
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,028,080,000	93.80 964,358,950	96.84 995,664,637	2.875 2028/8/15	1.16
11	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	1,002,016,000	93.95 941,459,015	96.32 965,221,972	2.375 2027/5/15	1.12
12	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	903,552,000	94.71 855,816,360	97.01 876,617,114	2.875 2028/5/15	1.02
13	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	918,032,000	92.68 850,896,783	95.48 876,610,396	2.25 2027/11/15	1.02
14	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	851,424,000	94.10 801,207,193	96.75 823,812,319	2.75 2028/2/15	0.96
15	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	786,264,000	94.82 745,579,429	97.63 767,676,719	3.125 2028/11/15	0.89
16	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	799,296,000	93.04 743,712,956	95.78 765,605,673	2.25 2027/8/15	0.89
17	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	819,568,000	83.47 684,129,311	87.37 716,122,127	1.625 2031/5/15	0.83
18	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	779,024,000	87.89 684,733,234	90.75 706,987,650	1.625 2029/8/15	0.82
19	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	803,640,000	81.42 654,348,331	85.23 684,974,517	1.125 2031/2/15	0.80
20	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	780,472,000	80.25 626,352,194	84.26 657,664,730	0.875 2030/11/15	0.76
21	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	739,928,000	79.41 587,592,608	83.47 617,691,894	0.625 2030/8/15	0.72
22	WI TREASURY SEC. アメリカ	国債証 券	631,328,000	80.39 507,527,362	84.11 531,054,173	0.625 2030/5/15	0.62
23	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	553,136,000	89.25 493,693,675	91.26 504,819,570	0.5 2027/6/30	0.59
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	563,272,000	85.26 480,273,870	89.03 501,531,756	1.5 2030/2/15	0.58
25	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	487,976,000	87.33 426,177,705	90.83 443,238,360	1.75 2029/11/15	0.51
26	CHINA GOVERNMENT BOND 中国	国債証 券	436,485,100	100.57 438,981,794	100.72 439,671,441	2.22 2025/9/25	0.51
27	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	434,400,000	98.03 425,881,416	99.13 430,625,064	3.5 2025/9/15	0.50
28	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	495,216,000	81.30 402,640,827	84.65 419,249,865	1.25 2031/8/15	0.49
29	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	388,064,000	100.62 390,471,392	104.04 403,765,069	4.375 2034/5/15	0.47
30	US TREASURY N/B アメリカ	国債証 券	399,648,000	96.63 386,185,162	101.01 403,704,427	4 2034/2/15	0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

種類別及び業種別投資比率

2024年8月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
公社債券	外国	国債証券	98.65
	小計		98.65
合計 (対純資産総額比)			98.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)

該当事項はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)

該当事項はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)

該当事項はありません。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)

該当事項はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)

該当事項はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)

該当事項はありません。

(参考)

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物 0 609月	買建	231	6,146,972,050	6,272,805,000	2.48

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

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

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P 500 EMINI FUTURE 202409	買建	591	23,649,658,376	24,004,292,400	2.28
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 202409	買建	757	5,926,271,592	6,042,290,730	0.57
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE 202409	買建	149	2,345,819,197	2,387,227,414	0.23

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

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

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド
該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

直近日（2024年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第12計算期間末 (2015年2月23日)	3,980,051,806	3,980,051,806	1.6341	1.6341
第13計算期間末 (2016年2月22日)	3,885,525,955	3,885,525,955	1.5825	1.5825
第14計算期間末 (2017年2月21日)	4,330,175,126	4,330,175,126	1.6728	1.6728
第15計算期間末 (2018年2月21日)	8,063,626,857	8,063,626,857	1.7587	1.7587
第16計算期間末 (2019年2月21日)	10,111,525,053	10,111,525,053	1.7614	1.7614
第17計算期間末 (2020年2月21日)	14,127,179,670	14,127,179,670	1.8561	1.8561
第18計算期間末 (2021年2月22日)	19,046,053,868	19,046,053,868	1.9431	1.9431
第19計算期間末 (2022年2月21日)	22,732,694,346	22,732,694,346	1.9791	1.9791
第20計算期間末 (2023年2月21日)	25,112,526,201	25,112,526,201	1.9943	1.9943
第21計算期間末 (2024年2月21日)	30,184,264,705	30,184,264,705	2.2416	2.2416
2023年8月末日	27,896,349,286	—	2.1401	—
9月末日	27,791,597,983	—	2.1233	—
10月末日	27,563,167,258	—	2.0876	—
11月末日	28,713,915,245	—	2.1607	—
12月末日	28,871,610,368	—	2.1675	—
2024年1月末日	29,760,995,407	—	2.2147	—
2月末日	30,479,581,196	—	2.2560	—
3月末日	31,172,472,755	—	2.2900	—
4月末日	31,259,608,122	—	2.2853	—
5月末日	31,734,757,803	—	2.2818	—
6月末日	32,319,635,709	—	2.3207	—
7月末日	32,279,449,640	—	2.2879	—
8月末日	32,269,845,515	—	2.2754	—

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

直近日（2024年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第12計算期間末 (2015年2月23日)	13,482,628,252	13,482,628,252	1.8574	1.8574
第13計算期間末 (2016年2月22日)	12,635,415,827	12,635,415,827	1.7401	1.7401
第14計算期間末 (2017年2月21日)	14,588,527,021	14,588,527,021	1.9186	1.9186
第15計算期間末 (2018年2月21日)	20,339,334,655	20,339,334,655	2.0634	2.0634
第16計算期間末 (2019年2月21日)	24,036,451,161	24,036,451,161	2.0548	2.0548
第17計算期間末 (2020年2月21日)	32,729,549,548	32,729,549,548	2.2096	2.2096
第18計算期間末 (2021年2月22日)	41,565,072,750	41,565,072,750	2.3873	2.3873
第19計算期間末 (2022年2月21日)	50,637,554,080	50,637,554,080	2.4790	2.4790
第20計算期間末 (2023年2月21日)	57,667,388,246	57,667,388,246	2.5589	2.5589
第21計算期間末 (2024年2月21日)	74,327,010,389	74,327,010,389	3.0332	3.0332
2023年8月末日	66,561,242,473	—	2.8272	—
9月末日	66,267,757,598	—	2.8051	—
10月末日	65,627,516,665	—	2.7465	—
11月末日	69,206,705,623	—	2.8660	—
12月末日	69,714,048,407	—	2.8775	—
2024年1月末日	72,986,103,730	—	2.9823	—
2月末日	75,280,156,908	—	3.0637	—
3月末日	77,553,627,266	—	3.1349	—
4月末日	77,802,108,161	—	3.1324	—
5月末日	79,463,746,838	—	3.1452	—
6月末日	81,445,922,292	—	3.2160	—
7月末日	80,955,300,762	—	3.1570	—
8月末日	80,559,466,655	—	3.1227	—

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

直近日（2024年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第12計算期間末 (2015年2月23日)	7,804,670,283	7,804,670,283	2.0739	2.0739
第13計算期間末 (2016年2月22日)	7,049,086,725	7,049,086,725	1.8772	1.8772
第14計算期間末 (2017年2月21日)	8,327,982,509	8,327,982,509	2.1564	2.1564
第15計算期間末 (2018年2月21日)	10,879,143,991	10,879,143,991	2.3709	2.3709
第16計算期間末 (2019年2月21日)	12,332,756,808	12,332,756,808	2.3458	2.3458
第17計算期間末 (2020年2月21日)	16,619,730,165	16,619,730,165	2.5721	2.5721
第18計算期間末 (2021年2月22日)	21,780,985,562	21,780,985,562	2.8551	2.8551
第19計算期間末 (2022年2月21日)	28,100,805,563	28,100,805,563	3.0209	3.0209
第20計算期間末 (2023年2月21日)	33,393,591,976	33,393,591,976	3.1923	3.1923
第21計算期間末 (2024年2月21日)	47,666,394,029	47,666,394,029	3.9860	3.9860
2023年8月末日	40,478,198,744	—	3.6298	—
9月末日	40,495,695,605	—	3.6012	—
10月末日	40,143,712,446	—	3.5117	—
11月末日	42,768,788,426	—	3.6940	—
12月末日	43,381,468,277	—	3.7119	—
2024年1月末日	46,306,867,883	—	3.9003	—
2月末日	48,534,911,747	—	4.0404	—
3月末日	50,641,638,750	—	4.1670	—
4月末日	51,119,205,649	—	4.1688	—
5月末日	52,773,035,577	—	4.2093	—
6月末日	54,624,984,758	—	4.3269	—
7月末日	54,287,133,247	—	4.2289	—
8月末日	53,823,913,842	—	4.1574	—

②【分配の推移】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

	1口当たりの分配金（円）
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
2024年2月22日～2024年8月21日	—

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

	1口当たりの分配金（円）
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
2024年2月22日～2024年8月21日	—

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

	1口当たりの分配金（円）
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
2024年2月22日～2024年8月21日	—

③【収益率の推移】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

	収益率（％）
第12計算期間	11.4
第13計算期間	△3.2
第14計算期間	5.7
第15計算期間	5.1
第16計算期間	0.2
第17計算期間	5.4
第18計算期間	4.7
第19計算期間	1.9
第20計算期間	0.8
第21計算期間	12.4
2024年2月22日～2024年8月21日	1.3

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

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

	収益率（％）
第12計算期間	15.4
第13計算期間	△6.3
第14計算期間	10.3
第15計算期間	7.5
第16計算期間	△0.4
第17計算期間	7.5
第18計算期間	8.0
第19計算期間	3.8
第20計算期間	3.2
第21計算期間	18.5
2024年2月22日～2024年8月21日	2.5

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

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

	収益率（％）
第12計算期間	19.5
第13計算期間	△9.5
第14計算期間	14.9
第15計算期間	9.9
第16計算期間	△1.1
第17計算期間	9.6
第18計算期間	11.0
第19計算期間	5.8
第20計算期間	5.7
第21計算期間	24.9
2024年2月22日～2024年8月21日	3.7

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

（４）【設定及び解約の実績】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

	設定口数	解約口数	発行済数量
第12計算期間	400,729,347	272,919,476	2,435,551,135
第13計算期間	470,047,100	450,270,647	2,455,327,588
第14計算期間	410,584,996	277,359,669	2,588,552,915
第15計算期間	2,361,820,149	365,488,159	4,584,884,905
第16計算期間	1,655,374,012	499,770,847	5,740,488,070
第17計算期間	2,521,627,930	650,916,773	7,611,199,227
第18計算期間	3,349,785,978	1,159,166,367	9,801,818,838
第19計算期間	2,931,115,272	1,246,490,259	11,486,443,851
第20計算期間	2,316,630,394	1,211,155,989	12,591,918,256
第21計算期間	2,552,719,943	1,679,168,996	13,465,469,203
2024年2月22日～ 2024年8月21日	1,701,302,027	1,068,438,506	14,098,332,724

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

	設定口数	解約口数	発行済数量
第12計算期間	937,661,500	689,801,801	7,258,743,523
第13計算期間	943,466,343	940,757,157	7,261,452,709
第14計算期間	928,099,553	585,769,447	7,603,782,815
第15計算期間	3,154,753,330	901,476,667	9,857,059,478
第16計算期間	2,639,726,677	799,319,778	11,697,466,377
第17計算期間	4,420,105,679	1,305,239,903	14,812,332,153
第18計算期間	4,457,846,329	1,859,533,952	17,410,644,530
第19計算期間	4,720,130,092	1,703,835,982	20,426,938,640
第20計算期間	3,940,594,899	1,831,397,366	22,536,136,173
第21計算期間	4,340,901,715	2,372,836,083	24,504,201,805
2024年2月22日～ 2024年8月21日	2,528,958,232	1,408,055,405	25,625,104,632

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

	設定口数	解約口数	発行済数量
第12計算期間	620,216,297	574,658,447	3,763,295,471
第13計算期間	684,049,192	692,168,947	3,755,175,716
第14計算期間	586,496,868	479,619,455	3,862,053,129
第15計算期間	1,365,271,724	638,735,089	4,588,589,764
第16計算期間	1,229,209,838	560,358,494	5,257,441,108
第17計算期間	1,961,765,805	757,768,658	6,461,438,255
第18計算期間	2,425,818,267	1,258,493,198	7,628,763,324
第19計算期間	2,886,289,935	1,212,865,927	9,302,187,332
第20計算期間	2,324,599,896	1,165,981,454	10,460,805,774
第21計算期間	3,040,409,875	1,542,620,953	11,958,594,696
2024年2月22日～ 2024年8月21日	1,843,949,562	966,821,229	12,835,723,029

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

3.運用実績

2024年8月末現在

DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

●基準価額・純資産の推移



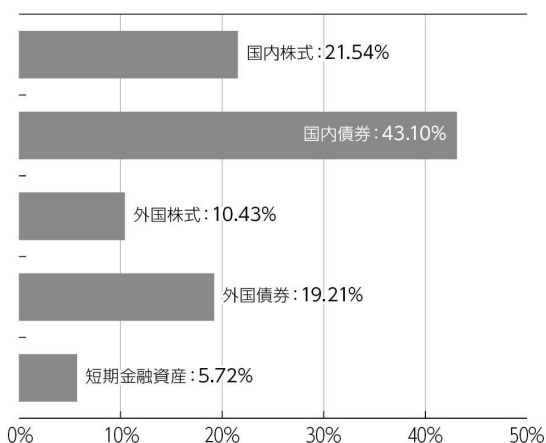
- ・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
- ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

基準価額	22,754円
純資産総額	322億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

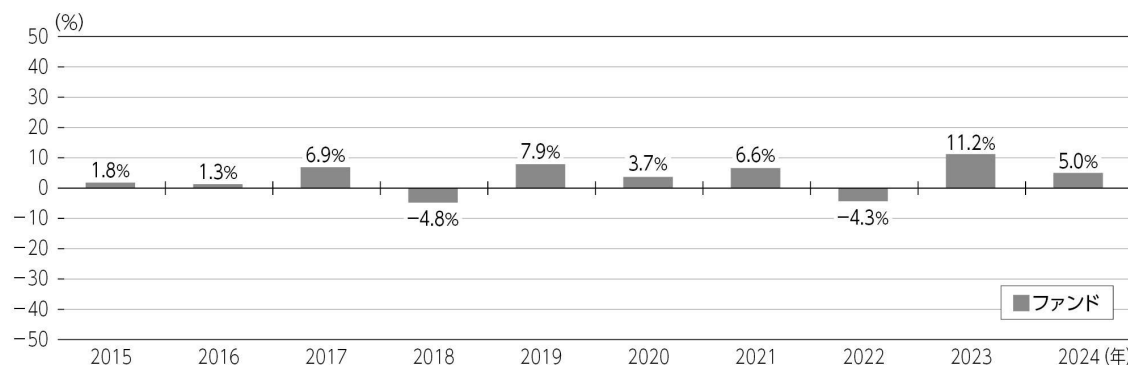
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

●資産構成比率



- ・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●年間収益率の推移



- ・ファンドにはベンチマークはありません。
- ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
- ・2024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。

DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

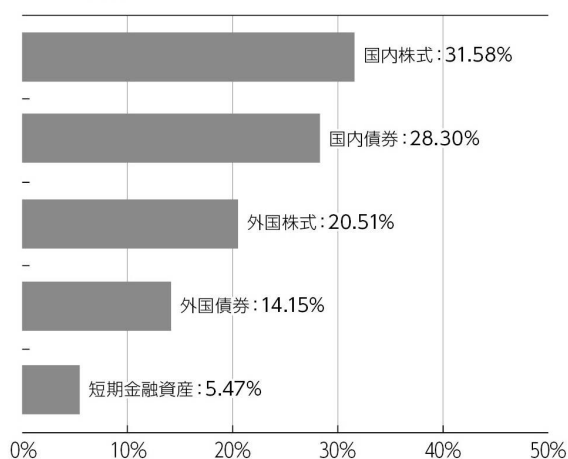
●基準価額・純資産の推移



・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。

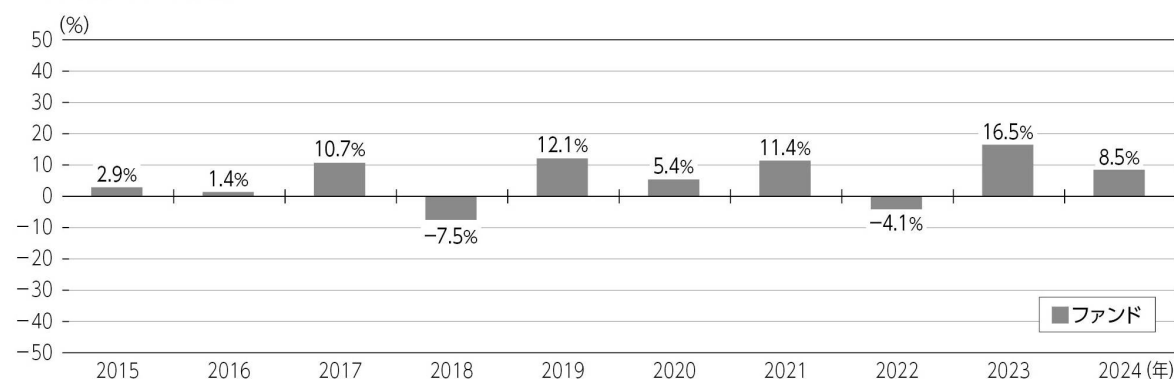
・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したもとして計算しております。

●資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

●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)を再投資したもとして計算しております。

・2024年は年始から上記作成基準日までの収益率です。

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

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

基準価額	31,227円
純資産総額	805億円

●分配の推移 1万口当り(税引前)

2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

● 基準価額・純資産の推移



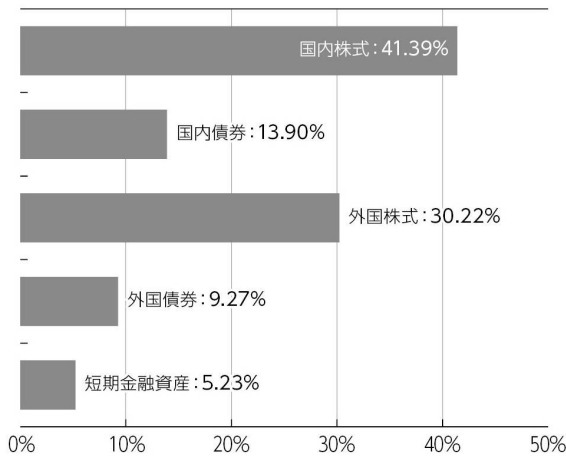
基準価額	41,574円
純資産総額	538億円

● 分配の推移 1万口当り(税引前)

2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
直近1年間累計	0円
設定来累計	0円

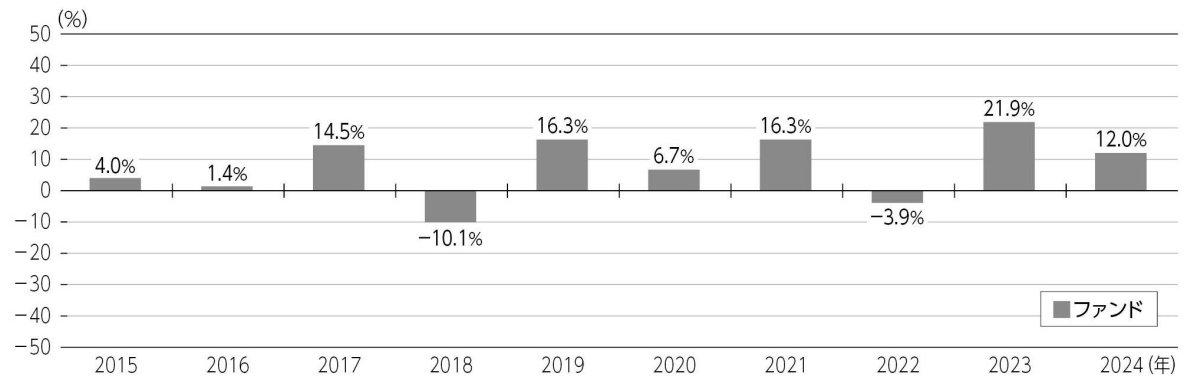
・基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。
 ・税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

● 資産構成比率



・比率(当ファンドにおける実質組入比率)は対純資産総額比です。

● 年間収益率の推移



・ファンドにはベンチマークはありません。
 ・ファンド収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
 ・2024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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

① 申込受付

販売会社において、原則として毎営業日に申込みの受付けを行います。

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

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

② 取扱コース

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

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

③ 申込単位

各販売会社が定める単位とします。

○ 販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④ 申込価額（発行価額）

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

⑤ 販売価額

申込価額と同額とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥ 申込手数料

ありません。

⑦ その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

2【換金（解約）手続等】

① 換金受付

販売会社において、原則として毎営業日に換金の受付けを行います。

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

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

② 換金方法

「解約請求」および「買取請求」の2つの方法があります。

③ 換金単位

各販売会社が定める単位とします。

○ 販売会社および販売会社の取扱コースによって異なります。

④ 換金価額

<解約請求の場合>

解約価額：解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

<買取請求の場合>

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

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

○ 換金手数料はありません。

⑤ 信託財産留保額

ありません。

⑥ 支払開始日

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

⑦ その他

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

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

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

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

- ① 基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を差引いた金額（「純資産総額」といいます）を計算日の受益権総口数で割った金額をいいます。
- ② ファンドおよびマザーファンドの主な投資資産の評価方法の概要は以下の通りです。

主な投資資産	評価方法の概要
マザーファンド	計算日の基準価額で評価します。
国内株式	証券取引所における計算日の最終相場で評価します。
国内債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法で評価します。
外国株式	証券取引所における計算日に知りうる直近の日の最終相場で評価します。
外国債券	価格情報会社の提供する価額等で評価します。
国内株式先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。
国内債券先物取引	証券取引所の発表する計算日の清算値段で評価します。

- ③ 外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます）の円換算については、原則として国内における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ④ 予約為替の評価は、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。
- ⑤ 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に計算されます。
- ⑥ 基準価額につきましては、販売会社または委託会社にお問合せください。また、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、委託会社へは以下にお問合せください。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

コールセンター 0120-762-506

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限です。

(4) 【計算期間】

毎年2月22日から翌年2月21日までとします。

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

(5) 【その他】

① 繰上償還

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

i. 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

ii. やむを得ない事情が発生したとき

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

3. 前記2. の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
 4. 前記3. の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1. の信託契約の解約をしません。
 5. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 6. 前記3. から5. までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記3. の一定の期間を1ヵ月以上設けることが困難な場合には適用しません。
 7. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、この信託契約を解約しファンドを終了させます。
 8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、ファンドは、後記「② 約款の変更 4. 」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社の間において存続します。
 9. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は後記「② 約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、ファンドを終了させます。
 10. 償還金については、原則として償還日から起算して5営業日目（償還日が休業日の場合には翌営業日から起算して5営業日目）までにお支払いします。
- ② 約款の変更
1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することができます。この場合、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
 2. 委託会社は、前記1. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
 3. 前記2. の公告および書面には、異議のある受益者は一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てることができる旨を付記します。なお、一定の期間は1ヵ月以上設けるものとします。
 4. 前記3. の一定の期間内に異議を申立てた受益者の受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えるときは、前記1. の約款の変更をしません。
 5. 委託会社は、当該約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは前記1. から5. の規定にしたがいます。
- ③ 反対者の買取請求権
- 前記「① 繰上償還」に規定する信託契約の解約または前記「② 約款の変更」に規定する約款の変更を行う場合において、「① 繰上償還 3. 」または「② 約款の変更 3. 」の一定の期間内に委託会社に対して異議を申立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権の買取りを請求することができます。ただし、当該買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社および販売会社の協議により決定します。
- ④ 公告
- 電子公告により行い、委託会社のホームページ (<https://www.nam.co.jp/>) に掲載します。

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

⑤ 運用報告書の作成

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

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じてファンドの知られたる受益者に交付します。
- ・ 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（<https://www.nam.co.jp/>）に掲載します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、交付します。

⑥ 信託事務処理の再信託

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

⑦ 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

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

(3) 解約請求権

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

(4) 帳簿閲覧権

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

(5) 反対者の買取請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間（2023年2月22日から2024年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間（2023年2月22日から2024年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

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

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間（2023年2月22日から2024年2月21日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年5月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の2023年2月22日から2024年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の2024年2月21日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

1 【財務諸表】

【DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 2023年2月21日現在	第21期 2024年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	40,494,675	15,278,530
コール・ローン	1,237,020,473	1,506,714,765
親投資信託受益証券	23,854,764,989	28,687,946,950
未収入金	11,033,326	66,234,743
流動資産合計	25,143,313,463	30,276,174,988
資産合計	25,143,313,463	30,276,174,988
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,178,701	69,198,482
未払受託者報酬	2,728,212	3,165,105
未払委託者報酬	16,369,502	18,990,776
その他未払費用	510,847	555,920
流動負債合計	30,787,262	91,910,283
負債合計	30,787,262	91,910,283
純資産の部		
元本等		
元本	12,591,918,256	13,465,469,203
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	12,520,607,945	16,718,795,502
（分配準備積立金）	2,057,589,773	4,830,748,690
元本等合計	25,112,526,201	30,184,264,705
純資産合計	25,112,526,201	30,184,264,705
負債純資産合計	25,143,313,463	30,276,174,988

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第20期		第21期	
	自	2022年2月22日 至 2023年2月21日	自	2023年2月22日 至 2024年2月21日
営業収益				
受取利息		25,837		29,275
有価証券売買等損益		206,826,238		3,266,058,932
営業収益合計		206,852,075		3,266,088,207
営業費用				
支払利息		609,447		586,085
受託者報酬		5,305,406		6,056,092
委託者報酬		31,832,888		36,336,867
その他費用		1,035,332		1,104,705
営業費用合計		38,783,073		44,083,749
営業利益又は営業損失(△)		168,069,002		3,222,004,458
経常利益又は経常損失(△)		168,069,002		3,222,004,458
当期純利益又は当期純損失(△)		168,069,002		3,222,004,458
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(△)		16,733,252		200,054,113
期首剰余金又は期首欠損金(△)		11,246,250,495		12,520,607,945
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,311,188,891		2,860,769,587
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		—		—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,311,188,891		2,860,769,587
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,188,167,191		1,684,532,375
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,188,167,191		1,684,532,375
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(△)		12,520,607,945		16,718,795,502

(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21期	
	自 2023年2月22日	至 2024年2月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第20期	第21期
	2023年2月21日現在	2024年2月21日現在
1. 期首元本額	11,486,443,851円	12,591,918,256円
期中追加設定元本額	2,316,630,394円	2,552,719,943円
期中一部解約元本額	1,211,155,989円	1,679,168,996円
2. 受益権の総数	12,591,918,256口	13,465,469,203口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第20期	第21期
	自 2022年2月22日 至 2023年2月21日	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(151,385,884円)、収益調整金(10,463,577,149円)及び分配準備積立金(1,906,203,889円)より分配対象収益は12,521,166,922円(1万口当たり9,943.81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(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,021,976,323円)、収益調整金(11,888,564,172円)及び分配準備積立金(1,808,772,367円)より分配対象収益は16,719,312,862円(1万口当たり12,416.44円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(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20期	第21期
	自 2022年2月22日 至 2023年2月21日	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 2023年2月21日現在	第21期 2024年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第20期 2023年2月21日現在	第21期 2024年2月21日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	129,594,064	2,820,867,064
合計	129,594,064	2,820,867,064

(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20期 2023年2月21日現在	第21期 2024年2月21日現在
1口当たり純資産額	1,9943円	2,2416円
(1万口当たり純資産額)	(19,943円)	(22,416円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	10,380,040,410	13,486,786,504	
	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	1,979,649,440	6,152,552,494	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	3,526,311,777	6,003,193,169	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	738,730,087	3,045,414,783	
親投資信託受益証券 合計		16,624,731,714	28,687,946,950	
合計			28,687,946,950	

(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。

独立監査人の監査報告書

2024年5月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の2023年2月22日から2024年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の2024年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

【DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 2023年2月21日現在	第21期 2024年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	90,472,997	37,412,505
コール・ローン	2,763,744,840	3,689,489,396
親投資信託受益証券	54,857,246,419	70,657,601,050
未収入金	18,826,661	83,952,135
流動資産合計	57,730,290,917	74,468,455,086
資産合計	57,730,290,917	74,468,455,086
負債の部		
流動負債		
未払解約金	18,824,327	87,092,095
未払受託者報酬	6,174,506	7,621,336
未払委託者報酬	37,047,174	45,728,276
その他未払費用	856,664	1,002,990
流動負債合計	62,902,671	141,444,697
負債合計	62,902,671	141,444,697
純資産の部		
元本等		
元本	22,536,136,173	24,504,201,805
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	35,131,252,073	49,822,808,584
（分配準備積立金）	9,882,921,301	19,627,042,621
元本等合計	57,667,388,246	74,327,010,389
純資産合計	57,667,388,246	74,327,010,389
負債純資産合計	57,730,290,917	74,468,455,086

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第20期		第21期	
	自	2022年2月22日	自	2023年2月22日
	至	2023年2月21日	至	2024年2月21日
営業収益				
受取利息		57,428		66,111
有価証券売買等損益		1,779,825,370		11,291,378,611
営業収益合計		1,779,882,798		11,291,444,722
営業費用				
支払利息		1,352,312		1,320,446
受託者報酬		11,939,390		14,339,614
委託者報酬		71,636,695		86,038,188
その他費用		1,737,598		1,966,156
営業費用合計		86,665,995		103,664,404
営業利益又は営業損失(△)		1,693,216,803		11,187,780,318
経常利益又は経常損失(△)		1,693,216,803		11,187,780,318
当期純利益又は当期純損失(△)		1,693,216,803		11,187,780,318
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(△)		74,667,284		492,721,429
期首剰余金又は期首欠損金(△)		30,210,615,440		35,131,252,073
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,018,030,688		7,727,676,454
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		6,018,030,688		7,727,676,454
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,715,943,574		3,731,178,832
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,715,943,574		3,731,178,832
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		—		—
分配金		—		—
期末剰余金又は期末欠損金(△)		35,131,252,073		49,822,808,584

(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21期	
	自 2023年2月22日	至 2024年2月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第20期	第21期
	2023年2月21日現在	2024年2月21日現在
1. 期首元本額	20,426,938,640円	22,536,136,173円
期中追加設定元本額	3,940,594,899円	4,340,901,715円
期中一部解約元本額	1,831,397,366円	2,372,836,083円
2. 受益権の総数	22,536,136,173口	24,504,201,805口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第20期	第21期
	自 2022年2月22日 至 2023年2月21日	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,618,655,904円)、収益調整金(25,249,579,021円)及び分配準備積立金(8,264,265,397円)より分配対象収益は35,132,500,322円(1万口当たり15,589.41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(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(10,695,118,820円)、収益調整金(30,196,954,035円)及び分配準備積立金(8,931,923,801円)より分配対象収益は49,823,996,656円(1万口当たり20,332.84円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(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20期	第21期
	自 2022年2月22日 至 2023年2月21日	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期	第21期
	2023年2月21日現在	2024年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第20期	第21期
	2023年2月21日現在	2024年2月21日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,532,796,898	10,040,133,429
合計	1,532,796,898	10,040,133,429

(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20期	第21期
	2023年2月21日現在	2024年2月21日現在
1口当たり純資産額	2,5589円	3,0332円
(1万口当たり純資産額)	(25,589円)	(30,332円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	16,970,093,713	22,049,242,761	
	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	7,281,858,546	22,631,288,175	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	6,485,816,535	11,041,454,069	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	3,622,951,133	14,935,616,045	
親投資信託受益証券 合計		34,360,719,927	70,657,601,050	
合計			70,657,601,050	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

2024年5月17日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の2023年2月22日から2024年2月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の2024年2月21日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

【DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 2023年2月21日現在	第21期 2024年2月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	51,105,079	23,920,821
コール・ローン	1,561,144,237	2,358,987,116
親投資信託受益証券	31,807,021,303	45,322,713,159
未収入金	18,026,205	119,805,316
流動資産合計	33,437,296,824	47,825,426,412
資産合計	33,437,296,824	47,825,426,412
負債の部		
流動負債		
未払解約金	18,398,064	125,288,730
未払受託者報酬	3,530,741	4,718,804
未払委託者報酬	21,184,693	28,313,073
その他未払費用	591,350	711,776
流動負債合計	43,704,848	159,032,383
負債合計	43,704,848	159,032,383
純資産の部		
元本等		
元本	10,460,805,774	11,958,594,696
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	22,932,786,202	35,707,799,333
（分配準備積立金）	6,439,679,236	14,012,086,196
元本等合計	33,393,591,976	47,666,394,029
純資産合計	33,393,591,976	47,666,394,029
負債純資産合計	33,437,296,824	47,825,426,412

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第20期		第21期	
	自	2022年2月22日 至 2023年2月21日	自	2023年2月22日 至 2024年2月21日
営業収益				
受取利息		32,193		38,267
有価証券売買等損益		1,728,648,475		8,981,993,891
営業収益合計		1,728,680,668		8,982,032,158
営業費用				
支払利息		758,756		761,729
受託者報酬		6,769,778		8,679,407
委託者報酬		40,619,092		52,076,925
その他費用		1,189,505		1,375,214
営業費用合計		49,337,131		62,893,275
営業利益又は営業損失(△)		1,679,343,537		8,919,138,883
経常利益又は経常損失(△)		1,679,343,537		8,919,138,883
当期純利益又は当期純損失(△)		1,679,343,537		8,919,138,883
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(△)		87,740,198		512,580,349
期首剰余金又は期首欠損金(△)		18,798,618,231		22,932,786,202
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,909,174,188		7,797,496,096
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		4,909,174,188		7,797,496,096
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,366,609,556		3,429,041,499
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,366,609,556		3,429,041,499
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(△)		22,932,786,202		35,707,799,333

(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21期
	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第20期	第21期
	2023年2月21日現在	2024年2月21日現在
1. 期首元本額	9,302,187,332円	10,460,805,774円
期中追加設定元本額	2,324,599,896円	3,040,409,875円
期中一部解約元本額	1,165,981,454円	1,542,620,953円
2. 受益権の総数	10,460,805,774口	11,958,594,696口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第20期	第21期
	自 2022年2月22日 至 2023年2月21日	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,591,712,950円)、収益調整金(16,493,798,655円)及び分配準備積立金(4,847,966,286円)より分配対象収益は22,933,477,891円(1万口当たり21,923.24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(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(8,406,628,465円)、収益調整金(21,696,385,160円)及び分配準備積立金(5,605,457,731円)より分配対象収益は35,708,471,356円(1万口当たり29,860.09円)のため、基準価額の水準、市場動向等を勘案して分配は見送り(0円)としております。

(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20期	第21期
	自 2022年2月22日 至 2023年2月21日	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。親投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期	第21期
	2023年2月21日現在	2024年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第20期	第21期
	2023年2月21日現在	2024年2月21日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,549,647,579	8,037,345,249
合計	1,549,647,579	8,037,345,249

(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20期	第21期
	2023年2月21日現在	2024年2月21日現在
1口当たり純資産額	3,192円	3,986円
(1万口当たり純資産額)	(31,923円)	(39,860円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	5,419,511,545	7,041,571,350	
	ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	6,200,768,267	19,271,367,697	
	ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	2,761,806,981	4,701,700,204	
	ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	3,470,727,449	14,308,073,908	
親投資信託受益証券 合計		17,852,814,242	45,322,713,159	
合計			45,322,713,159	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2024年2月21日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	28,025,355
コール・ローン	2,763,761,790
株式	220,995,693,370
派生商品評価勘定	151,549,900
未収配当金	313,784,351
差入委託証拠金	105,736,774
流動資産合計	224,358,551,540
資産合計	224,358,551,540
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,550
前受金	160,615,000
未払解約金	589,558,627
その他未払費用	2,794
流動負債合計	750,187,971
負債合計	750,187,971
純資産の部	
元本等	
元本	71,947,940,917
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	151,660,422,652
元本等合計	223,608,363,569
純資産合計	223,608,363,569
負債純資産合計	224,358,551,540

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年2月22日 至 2024年2月21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>
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>
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>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年2月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	81,220,752,700円
同期中追加設定元本額	19,784,678,849円
同期中一部解約元本額	29,057,490,632円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,320,998,515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)	3,051,939,606円
ニッセイ日本バランス (成長型) SA (適格機関投資家限定)	3,074,466円
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	1,979,649,440円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	7,281,858,546円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	6,200,768,267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)	2,308,348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)	3,095,481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)	9,705,673円
DCニッセイ国内株式インデックス	3,116,773,837円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	24,340,801,407円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	3,680,327,641円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	383,215,348円
DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	223,426,418円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	437,203,057円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	600,144,922円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	32,113,024円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)	118,398,075円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)	10,305,956円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート)	13,314,308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)	4,770,341円
ニッセイ・インデックスパッケージ (国内・株式/リート/債券)	9,712,908円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	26,586,091円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	309,315,380円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	197,082,472円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	372,091,655円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	169,588,820円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド (適格機関投資家限定)	13,880,195,796円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド (GDP型バスケット)	25,302,708円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド (安定型)	34,365円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド (積極型)	75,805円
FWニッセイ国内株インデックス	66,897,499円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	75,172,806円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	1,691,936円
計	71,947,940,917円
2. 受益権の総数	71,947,940,917口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年2月21日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	
株式	△419,978,420	
合計	△419,978,420	

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2024年2月21日現在			
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	2,556,275,000	—		2,707,870,000
合計	2,556,275,000	—		2,707,870,000

(注) 株価指数先物取引

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年2月21日現在	
1口当たり純資産額	3.1079円
(1万口当たり純資産額)	(31,079円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年2月21日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,100	3,590.00	11,129,000	
ニッセイ	83,100	926.70	77,008,770	
マルハニチロ	12,300	2,882.50	35,454,750	
雪国まいたけ	7,100	955.00	6,780,500	
カネコ種苗	2,800	1,457.00	4,079,600	
サカタのタネ	9,500	3,655.00	34,722,500	
ホクト	6,700	1,844.00	12,354,800	
ショーボンドホールディングス	11,300	6,262.00	70,760,600	
ミライト・ワン	27,500	1,772.00	48,730,000	

タマホーム	5,200	3,995.00	20,774,000
ファーストコーポレーション	1,300	785.00	1,020,500
住石ホールディングス	9,400	2,083.00	19,580,200
日鉄鉱業	3,300	5,170.00	17,061,000
三井松島ホールディングス	5,000	3,000.00	15,000,000
I N P E X	307,400	1,980.00	608,652,000
石油資源開発	9,600	6,080.00	58,368,000
K&Oエナジーグループ	3,800	2,344.00	8,907,200
安藤・間	48,200	1,221.00	58,852,200
東急建設	26,000	809.00	21,034,000
コムシスホールディングス	26,500	3,336.00	88,404,000
ビーアールホールディングス	17,100	378.00	6,463,800
高松コンストラクショングループ	6,200	2,722.00	16,876,400
東建コーポレーション	2,100	9,600.00	20,160,000
ソネック	1,500	928.00	1,392,000
ヤマウラ	4,200	1,488.00	6,249,600
オリエンタル白石	30,800	384.00	11,827,200
大成建設	54,400	4,823.00	262,371,200
大林組	208,000	1,415.00	294,320,000
清水建設	164,900	881.10	145,293,390
飛島建設	6,000	1,458.00	8,748,000
長谷工コーポレーション	53,300	1,896.50	101,083,450
松井建設	7,600	852.00	6,475,200
鹿島建設	128,900	2,804.00	361,435,600
不動テトラ	4,000	2,189.00	8,756,000
鉄建建設	4,200	2,484.00	10,432,800
西松建設	11,100	4,514.00	50,105,400
三井住友建設	43,300	427.00	18,489,100
大豊建設	2,000	3,240.00	6,480,000
佐田建設	2,100	698.00	1,465,800
ナカノフドー建設	100	646.00	64,600
奥村組	9,400	5,080.00	47,752,000
東鉄工業	7,200	3,005.00	21,636,000
浅沼組	4,300	4,165.00	17,909,500
戸田建設	78,700	957.80	75,378,860
熊谷組	9,600	3,805.00	36,528,000
植木組	900	1,794.00	1,614,600
矢作建設工業	7,900	1,575.00	12,442,500
ピーエス三菱	7,400	1,044.00	7,725,600
日本ハウスホールディングス	21,000	306.00	6,426,000
大東建託	21,400	17,290.00	370,006,000
新日本建設	8,200	1,259.00	10,323,800
東亜道路工業	2,300	6,430.00	14,789,000
日本道路	6,800	2,035.00	13,838,000
東亜建設工業	4,500	4,680.00	21,060,000
日本国土開発	16,500	521.00	8,596,500
若築建設	2,100	3,155.00	6,625,500
東洋建設	14,600	1,317.00	19,228,200
五洋建設	82,400	770.70	63,505,680
世紀東急工業	7,500	1,930.00	14,475,000

福田組	2,200	5,330.00	11,726,000
住友林業	50,300	4,130.00	207,739,000
日本基礎技術	8,100	452.00	3,661,200
巴コーポレーション	6,000	650.00	3,900,000
大和ハウス工業	160,800	4,357.00	700,605,600
ライト工業	12,000	1,892.00	22,704,000
積水ハウス	176,400	3,337.00	588,646,800
日特建設	5,600	1,154.00	6,462,400
北陸電気工事	5,500	1,238.00	6,809,000
ユアテック	12,800	1,325.00	16,960,000
日本リーテック	5,100	1,261.00	6,431,100
四電工	2,400	4,150.00	9,960,000
中電工	9,000	2,988.00	26,892,000
関電工	36,400	1,595.00	58,058,000
きんでん	40,900	2,620.00	107,158,000
東京エネシス	6,200	1,150.00	7,130,000
トーエネック	1,900	5,430.00	10,317,000
住友電設	5,500	3,090.00	16,995,000
日本電設工業	10,900	2,083.00	22,704,700
エクシオグループ	28,400	3,157.00	89,658,800
新日本空調	3,800	2,844.00	10,807,200
九電工	12,600	5,608.00	70,660,800
三機工業	12,600	1,937.00	24,406,200
日揮ホールディングス	57,500	1,371.50	78,861,250
中外炉工業	2,400	2,743.00	6,583,200
ヤマト	2,100	970.00	2,037,000
太平電業	3,600	4,285.00	15,426,000
高砂熱学工業	15,600	4,315.00	67,314,000
NEC ネットズエスアイ	23,200	2,410.00	55,912,000
朝日工業社	2,700	2,979.00	8,043,300
明星工業	11,300	1,224.00	13,831,200
大気社	6,700	4,805.00	32,193,500
ダイダン	7,600	1,830.00	13,908,000
日比谷総合設備	4,200	2,571.00	10,798,200
ニッポン	17,500	2,375.00	41,562,500
日清製粉グループ本社	54,000	2,124.00	114,696,000
日東富士製粉	1,200	5,300.00	6,360,000
昭和産業	5,700	3,455.00	19,693,500
中部飼料	8,100	1,265.00	10,246,500
フィード・ワン	8,500	1,034.00	8,789,000
日本甜菜製糖	3,400	2,098.00	7,133,200
DM三井製糖ホールディングス	5,800	3,250.00	18,850,000
ウェルネオシュガー	2,900	2,270.00	6,583,000
L I F U L L	32,200	166.00	5,345,200
M I X I	13,100	2,429.00	31,819,900
ジェイエイシーリクルートメント	22,000	746.00	16,412,000
日本M&Aセンターホールディングス	97,100	1,021.00	99,139,100
メンバーズ	6,400	925.00	5,920,000
UTグループ	7,900	3,345.00	26,425,500
アイティメディア	6,000	1,945.00	11,670,000

ケアネット	9,400	666.00	6,260,400
E・Jホールディングス	3,600	1,686.00	6,069,600
オープンアップグループ	18,300	2,186.00	40,003,800
コシダカホールディングス	18,200	914.00	16,634,800
パソナグループ	7,400	2,698.00	19,965,200
リンクアンドモチベーション	17,500	606.00	10,605,000
エス・エム・エス	21,400	2,582.50	55,265,500
パーソルホールディングス	620,400	222.90	138,287,160
クックパッド	53,600	128.00	6,860,800
森永製菓	25,000	2,698.00	67,450,000
中村屋	2,000	3,150.00	6,300,000
江崎グリコ	16,700	4,637.00	77,437,900
名糖産業	3,700	1,861.00	6,885,700
井村屋グループ	3,500	2,459.00	8,606,500
不二家	4,000	2,504.00	10,016,000
山崎製パン	39,100	3,746.00	146,468,600
モロゾフ	1,900	4,280.00	8,132,000
亀田製菓	3,300	4,415.00	14,569,500
寿スピリッツ	27,600	1,940.00	53,544,000
カルビー	26,700	3,163.00	84,452,100
森永乳業	20,400	3,190.00	65,076,000
六甲バター	4,700	1,371.00	6,443,700
ヤクルト本社	83,400	3,156.00	263,210,400
明治ホールディングス	71,600	3,425.00	245,230,000
雪印メグミルク	14,100	2,205.00	31,090,500
プリマハム	7,800	2,265.00	17,667,000
日本ハム	25,100	5,311.00	133,306,100
林兼産業	1,900	556.00	1,056,400
丸大食品	5,900	1,648.00	9,723,200
S F o o d s	6,400	3,195.00	20,448,000
柿安本店	2,500	2,630.00	6,575,000
伊藤ハム米久ホールディングス	8,900	4,160.00	37,024,000
学情	3,600	1,876.00	6,753,600
スタジオアリス	3,000	2,065.00	6,195,000
クロスキャット	5,400	1,208.00	6,523,200
システナ	90,000	288.00	25,920,000
N J S	2,300	2,733.00	6,285,900
デジタルアーツ	3,800	4,535.00	17,233,000
日鉄ソリューションズ	10,100	4,940.00	49,894,000
総合警備保障	101,800	816.40	83,109,520
キューブシステム	5,600	1,108.00	6,204,800
いちご	67,200	398.00	26,745,600
日本駐車場開発	61,800	181.00	11,185,800
コア	3,500	1,865.00	6,527,500
カカコム	40,300	1,705.50	68,731,650
セントケア・ホールディング	6,600	922.00	6,085,200
ルネサンス	6,900	1,074.00	7,410,600
ディップ	9,300	2,709.00	25,193,700
S B Sホールディングス	5,300	2,400.00	12,720,000
新日本科学	5,500	1,630.00	8,965,000

ベネフィット・ワン	21,200	2,168.50	45,972,200
エムスリー	120,400	2,059.00	247,903,600
アウトソーシング	39,100	1,729.00	67,603,900
ワールドホールディングス	2,700	2,494.00	6,733,800
ディー・エヌ・エー	21,700	1,260.50	27,352,850
博報堂DYホールディングス	77,700	1,448.50	112,548,450
ぐるなび	23,500	293.00	6,885,500
ファンコミュニケーションズ	15,900	403.00	6,407,700
ライク	4,200	1,550.00	6,510,000
エスプール	20,500	313.00	6,416,500
WDBホールディングス	3,100	2,290.00	7,099,000
アドウェイズ	12,400	465.00	5,766,000
バリューコマース	5,300	1,161.00	6,153,300
インフォマート	63,300	378.00	23,927,400
サッポロホールディングス	19,200	6,758.00	129,753,600
アサヒグループホールディングス	134,900	5,434.00	733,046,600
麒麟ホールディングス	243,200	2,147.50	522,272,000
宝ホールディングス	39,800	1,205.00	47,959,000
オエノンホールディングス	17,400	346.00	6,020,400
養命酒製造	3,400	1,876.00	6,378,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	45,700	1,994.00	91,125,800
サントリー食品インターナショナル	41,100	4,904.00	201,554,400
ダイドーグループホールディングス	6,600	3,045.00	20,097,000
伊藤園	19,800	4,217.00	83,496,600
キーコーヒー	6,500	2,055.00	13,357,500
日清オイリオグループ	8,200	5,130.00	42,066,000
不二製油グループ本社	13,600	2,366.00	32,177,600
J-オイルミルズ	6,700	1,954.00	13,091,800
ローソン	13,300	10,260.00	136,458,000
サンエー	4,800	4,550.00	21,840,000
カワチ薬品	4,900	2,708.00	13,269,200
エービーシー・マート	27,400	2,560.00	70,144,000
ハードオフコーポレーション	3,400	1,792.00	6,092,800
高千穂交易	2,000	3,950.00	7,900,000
アスクル	15,100	2,021.00	30,517,100
ゲオホールディングス	7,000	1,947.00	13,629,000
アダストリア	7,600	3,470.00	26,372,000
伊藤忠食品	1,400	7,780.00	10,892,000
くら寿司	7,300	4,075.00	29,747,500
キャンドゥ	2,400	2,713.00	6,511,200
エレマテック	5,600	1,793.00	10,040,800
パルグループホールディングス	12,300	2,261.00	27,810,300
エディオン	24,800	1,503.00	37,274,400
あらた	9,600	3,215.00	30,864,000
サーラコーポレーション	13,200	802.00	10,586,400
トーマンデバイス	1,200	5,160.00	6,192,000
ハローズ	2,800	4,370.00	12,236,000
J Pホールディングス	15,600	478.00	7,456,800
フジオフードグループ本社	7,000	1,383.00	9,681,000

あみやき亭	1,500	4,325.00	6,487,500
東京エレクトロン デバイス	6,300	6,720.00	42,336,000
円谷フィールズホールディングス	10,800	1,597.00	17,247,600
双日	69,800	3,798.00	265,100,400
アルフレッサ ホールディングス	63,000	2,327.00	146,601,000
大黒天物産	1,900	8,600.00	16,340,000
ハニーズホールディングス	5,600	1,623.00	9,088,800
キッコーマン	38,700	9,243.00	357,704,100
味の素	138,700	5,796.00	803,905,200
ブルドックソース	3,100	2,135.00	6,618,500
キューピー	31,400	2,723.50	85,517,900
ハウス食品グループ本社	20,100	3,155.00	63,415,500
カゴメ	25,100	3,552.00	89,155,200
アリアケジャパン	5,800	5,340.00	30,972,000
エバラ食品工業	2,200	2,900.00	6,380,000
ニチレイ	26,800	3,835.00	102,778,000
横浜冷凍	17,100	1,071.00	18,314,100
東洋水産	29,500	8,444.00	249,098,000
イトアンドホールディングス	3,000	2,123.00	6,369,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,400	1,216.00	7,782,400
日清食品ホールディングス	61,600	4,434.00	273,134,400
永谷園ホールディングス	2,900	2,235.00	6,481,500
フジッコ	6,000	1,947.00	11,682,000
ロック・フィールド	7,100	1,660.00	11,786,000
日本たばこ産業	354,700	3,915.00	1,388,650,500
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,088.00	8,352,000
わらべや日洋ホールディングス	3,900	2,825.00	11,017,500
なとり	3,700	2,179.00	8,062,300
ファーマフーズ	8,400	982.00	8,248,800
北の達人コーポレーション	26,500	225.00	5,962,500
ユウグレナ	36,300	621.00	22,542,300
紀文食品	5,300	1,187.00	6,291,100
ピクルスホールディングス	5,100	1,269.00	6,471,900
SREホールディングス	2,500	3,325.00	8,312,500
ADワークスグループ	20,100	231.00	4,643,100
片倉工業	5,500	1,829.00	10,059,500
グンゼ	4,200	5,550.00	23,310,000
ヒューリック	136,200	1,521.50	207,228,300
アルペン	5,200	1,993.00	10,363,600
ラクーンホールディングス	9,200	692.00	6,366,400
クオールホールディングス	8,600	1,630.00	14,018,000
アルコニックス	8,300	1,395.00	11,578,500
神戸物産	48,500	3,791.00	183,863,500
ソリトンシステムズ	4,600	1,376.00	6,329,600
ジーンズホールディングス	3,700	3,915.00	14,485,500
ビックカメラ	33,400	1,280.00	42,752,000
DCMホールディングス	33,100	1,401.00	46,373,100
ハイパー	4,500	305.00	1,372,500
Monotaro	88,900	1,529.50	135,972,550
東京一番フーズ	8,200	524.00	4,296,800

あい ホールディングス	10,000	2,388.00	23,880,000
ディービーエックス	4,000	1,072.00	4,288,000
J. フロント リテイリング	72,000	1,540.00	110,880,000
ドトール・日レスホールディングス	11,100	2,065.00	22,921,500
マツキヨココカラ&カンパニー	114,100	2,641.50	301,395,150
ブロンコビリー	3,700	3,265.00	12,080,500
ZOZO	40,000	3,398.00	135,920,000
トレジャー・ファクトリー	4,800	1,464.00	7,027,200
物語コーポレーション	10,500	4,585.00	48,142,500
三越伊勢丹ホールディングス	105,600	2,129.50	224,875,200
東洋紡	25,700	1,093.00	28,090,100
富士紡ホールディングス	2,600	4,410.00	11,466,000
日清紡ホールディングス	45,000	1,242.50	55,912,500
倉敷紡績	4,200	3,150.00	13,230,000
ダイワボウホールディングス	27,800	2,678.00	74,448,400
日東紡績	7,500	5,280.00	39,600,000
トヨタ紡織	25,000	2,422.00	60,550,000
マクニカホールディングス	14,800	8,075.00	119,510,000
Hamee	5,700	1,092.00	6,224,400
ラクト・ジャパン	2,800	2,224.00	6,227,200
ウエルシアホールディングス	32,500	2,638.50	85,751,250
クリエイトSDホールディングス	8,900	3,175.00	28,257,500
グリムス	3,000	1,937.00	5,811,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	9,500	1,291.00	12,264,500
八洲電機	5,100	1,333.00	6,798,300
メディアスホールディングス	8,300	732.00	6,075,600
レスターホールディングス	5,300	2,945.00	15,608,500
丸善CHIホールディングス	12,600	328.00	4,132,800
TOKAIホールディングス	34,100	1,010.00	34,441,000
ミサワ	2,300	624.00	1,435,200
三洋貿易	7,100	1,334.00	9,471,400
シュッピン	6,100	1,070.00	6,527,000
ビューティガレージ	2,900	2,241.00	6,498,900
オイシックス・ラ・大地	8,400	1,415.00	11,886,000
ウイン・パートナーズ	5,100	1,283.00	6,543,300
ネクステージ	14,300	2,282.00	32,632,600
ジョイフル本田	18,200	1,998.00	36,363,600
鳥貴族ホールディングス	2,300	4,055.00	9,326,500
ホットランド	4,800	1,826.00	8,764,800
すかいらーくホールディングス	85,700	2,171.00	186,054,700
SFPホールディングス	3,400	2,087.00	7,095,800
綿半ホールディングス	4,900	1,504.00	7,369,600
日本毛織	15,200	1,372.00	20,854,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17,500	996.00	17,430,000
野村不動産ホールディングス	32,500	3,711.00	120,607,500
三重交通グループホールディングス	12,500	602.00	7,525,000
サムティ	9,300	2,493.00	23,184,900
ディア・ライフ	10,000	921.00	9,210,000

コーセーアールイー	3,700	902.00	3,337,400
地主	4,500	2,109.00	9,490,500
プレサンスコーポレーション	9,300	1,652.00	15,363,600
ハウスコム	4,000	964.00	3,856,000
JPMC	5,500	1,210.00	6,655,000
サンセイランディック	2,300	1,023.00	2,352,900
エストラスト	7,500	649.00	4,867,500
フージャースホールディングス	9,000	1,059.00	9,531,000
オープンハウスグループ	21,400	4,923.00	105,352,200
東急不動産ホールディングス	175,500	982.20	172,376,100
飯田グループホールディングス	55,900	1,946.50	108,809,350
帝国繊維	6,700	2,154.00	14,431,800
日本コークス工業	60,400	114.00	6,885,600
B E E N O S	4,200	1,651.00	6,934,200
あさひ	5,800	1,277.00	7,406,600
日本調剤	4,500	1,421.00	6,394,500
コスモス薬品	5,300	15,030.00	79,659,000
シップヘルスケアホールディングス	22,500	2,156.50	48,521,250
ソフトクリエイトホールディングス	4,900	1,869.00	9,158,100
セブン&アイ・ホールディングス	216,200	6,302.00	1,362,492,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	42,500	1,081.00	45,942,500
明治電機工業	4,400	1,486.00	6,538,400
ツルハホールディングス	13,200	11,025.00	145,530,000
サンマルクホールディングス	5,000	2,203.00	11,015,000
フェリシモ	4,400	922.00	4,056,800
トリドールホールディングス	17,600	4,217.00	74,219,200
帝人	57,100	1,253.50	71,574,850
東レ	397,900	693.90	276,102,810
クラレ	86,500	1,503.00	130,009,500
旭化成	401,800	1,047.50	420,885,500
T O K Y O B A S E	19,800	293.00	5,801,400
稲葉製作所	4,200	1,509.00	6,337,800
宮地エンジニアリンググループ	3,100	3,970.00	12,307,000
トーカロ	17,600	1,656.00	29,145,600
S U M C O	108,700	2,201.50	239,303,050
川田テクノロジーズ	1,400	8,940.00	12,516,000
R S T e c h n o l o g i e s	4,100	2,637.00	10,811,700
A n d D o ホールディングス	5,600	1,113.00	6,232,800
シーアールイー	4,400	1,310.00	5,764,000
ケイアイスター不動産	2,800	3,675.00	10,290,000
グッドコムアセット	8,200	748.00	6,133,600
ジェイ・エス・ビー	2,900	2,680.00	7,772,000
ロードスターキャピタル	3,800	2,214.00	8,413,200
霞ヶ関キャピタル	1,600	12,910.00	20,656,000
日本フェルト	5,500	440.00	2,420,000
イチカワ	3,400	1,752.00	5,956,800
芦森工業	1,800	2,749.00	4,948,200
アツギ	10,200	599.00	6,109,800
J Mホールディングス	4,700	2,474.00	11,627,800

コメダホールディングス	15,400	2,737.00	42,149,800
アレンザホールディングス	5,800	1,141.00	6,617,800
パロックジャパンリミテッド	7,700	826.00	6,360,200
クスリのアオキホールディングス	18,900	3,041.00	57,474,900
力の源ホールディングス	4,500	1,663.00	7,483,500
FOOD & LIFE COMPANIES	33,500	3,070.00	102,845,000
アセンテック	10,500	625.00	6,562,500
セーレン	11,500	2,406.00	27,669,000
ソトー	5,700	687.00	3,915,900
東海染工	1,600	816.00	1,305,600
小松マテーレ	8,600	777.00	6,682,200
ワコールホールディングス	12,200	3,695.00	45,079,000
ホギメディカル	7,800	3,525.00	27,495,000
T S I ホールディングス	19,300	705.00	13,606,500
マツオカコーポレーション	3,200	1,556.00	4,979,200
ワールド	8,400	1,998.00	16,783,200
T I S	65,000	3,374.00	219,310,000
グリー	19,900	527.00	10,487,300
コーエーテックモホールディングス	37,300	1,851.50	69,060,950
三菱総合研究所	2,900	4,880.00	14,152,000
ポルトゥウィンホールディングス	12,300	515.00	6,334,500
ネクソン	133,100	2,507.50	333,748,250
アイスタイル	19,400	438.00	8,497,200
エムアップホールディングス	7,300	1,029.00	7,511,700
エイチーム	11,100	561.00	6,227,100
エニグモ	17,900	349.00	6,247,100
コロプラ	23,100	582.00	13,444,200
ブロードリーフ	28,200	552.00	15,566,400
デジタルハーツホールディングス	6,200	1,040.00	6,448,000
メディアドゥ	4,700	1,249.00	5,870,300
じげん	17,300	516.00	8,926,800
ブイキューブ	20,600	328.00	6,756,800
フィックスターズ	6,700	1,744.00	11,684,800
CARTA HOLDINGS	200	1,447.00	289,400
オブティム	6,700	1,050.00	7,035,000
セレス	5,500	1,605.00	8,827,500
SHIFT	4,000	26,220.00	104,880,000
特種東海製紙	3,200	3,815.00	12,208,000
ティーガイア	6,200	2,125.00	13,175,000
テクマトリックス	10,900	1,985.00	21,636,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15,500	2,251.50	34,898,250
GMOペイメントゲートウェイ	11,900	8,910.00	106,029,000
システムリサーチ	2,100	3,355.00	7,045,500
インターネットイニシアティブ	28,400	2,875.00	81,650,000
さくらインターネット	6,700	5,270.00	35,309,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,200	2,724.00	5,992,800
SRAホールディングス	3,000	3,875.00	11,625,000

朝日ネット	10,200	629.00	6,415,800
eBASE	9,000	739.00	6,651,000
アバントグループ	7,500	1,343.00	10,072,500
アドソル日進	4,000	1,635.00	6,540,000
コムチュア	8,600	1,967.00	16,916,200
アステリア	10,700	642.00	6,869,400
アイル	2,800	3,570.00	9,996,000
王子ホールディングス	247,400	559.90	138,519,260
日本製紙	33,500	1,145.00	38,357,500
三菱製紙	4,500	535.00	2,407,500
北越コーポレーション	29,200	1,341.00	39,157,200
大王製紙	26,200	1,086.00	28,453,200
阿波製紙	3,900	486.00	1,895,400
マークライNZ	3,200	3,165.00	10,128,000
メディカル・データ・ビジョン	9,900	570.00	5,643,000
gumi	15,600	396.00	6,177,600
テラスカイ	4,200	1,495.00	6,279,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,700	1,895.00	7,011,500
ラクス	28,100	2,138.50	60,091,850
ダブルスタンダード	3,900	1,839.00	7,172,100
オープンドア	7,500	783.00	5,872,500
アカツキ	2,800	2,400.00	6,720,000
Ubicomホールディングス	4,300	1,381.00	5,938,300
カナミックネットワーク	15,300	496.00	7,588,800
レンゴー	54,100	1,011.50	54,722,150
トーモク	3,400	2,325.00	7,905,000
ザ・パック	4,400	3,795.00	16,698,000
チェンジホールディングス	12,900	1,448.00	18,679,200
オークネット	3,000	2,160.00	6,480,000
マクロミル	11,700	781.00	9,137,700
オロ	2,100	2,651.00	5,567,100
マネーフォワード	13,200	5,712.00	75,398,400
レゾナック・ホールディングス	57,400	3,394.00	194,815,600
住友化学	440,700	310.40	136,793,280
住友精化	2,800	5,050.00	14,140,000
日産化学	27,900	6,297.00	175,686,300
ラサ工業	2,700	2,300.00	6,210,000
クレハ	13,000	2,706.00	35,178,000
多木化学	2,300	3,500.00	8,050,000
テイカ	5,100	1,401.00	7,145,100
石原産業	9,800	1,517.00	14,866,600
日本曹達	7,000	5,950.00	41,650,000
東ソー	79,300	2,036.00	161,454,800
トクヤマ	19,200	2,327.50	44,688,000
セントラル硝子	6,300	2,891.00	18,213,300
東亜合成	28,600	1,542.50	44,115,500
大阪ソーダ	4,100	11,390.00	46,699,000
関東電化工業	11,500	923.00	10,614,500
デンカ	21,600	2,511.50	54,248,400

イビデン	31,200	7,359.00	229,600,800
信越化学工業	538,500	6,105.00	3,287,542,500
日本カーバイド工業	4,200	1,827.00	7,673,400
プラスアルファ・コンサルティング	3,500	2,541.00	8,893,500
電算システムホールディングス	2,600	2,652.00	6,895,200
堺化学工業	4,500	1,957.00	8,806,500
第一稀元素化学工業	6,500	920.00	5,980,000
エア・ウォーター	56,000	2,176.00	121,856,000
日本酸素ホールディングス	57,600	4,156.00	239,385,600
日本化学工業	3,200	2,140.00	6,848,000
日本パーカライジング	26,500	1,266.00	33,549,000
高压ガス工業	8,600	885.00	7,611,000
四国化成ホールディングス	7,600	1,756.00	13,345,600
ステラ ケミファ	3,200	3,815.00	12,208,000
保土谷化学工業	1,900	3,600.00	6,840,000
日本触媒	8,600	5,643.00	48,529,800
大日精化工業	4,100	2,749.00	11,270,900
カネカ	15,100	3,699.00	55,854,900
協和キリン	71,800	2,879.50	206,748,100
APPIER GROUP	20,300	1,804.00	36,621,200
三菱瓦斯化学	44,300	2,572.00	113,939,600
三井化学	49,000	4,040.00	197,960,000
JSR	64,700	4,062.00	262,811,400
東京応化工業	28,300	4,141.00	117,190,300
大阪有機化学工業	5,000	2,953.00	14,765,000
三菱ケミカルグループ	434,100	863.70	374,932,170
KHネオケム	9,100	2,258.00	20,547,800
ビジョナル	4,600	9,220.00	42,412,000
ダイセル	76,300	1,452.00	110,787,600
住友ベークライト	8,300	8,104.00	67,263,200
積水化学工業	119,300	2,102.00	250,768,600
日本ゼオン	40,700	1,310.00	53,317,000
アイカ工業	15,000	3,554.00	53,310,000
UBE	28,300	2,560.00	72,448,000
積水樹脂	8,900	2,515.00	22,383,500
タキロンシーアイ	15,100	644.00	9,724,400
旭有機材	4,000	3,985.00	15,940,000
ニチバン	3,700	1,845.00	6,826,500
リケンテクノス	12,800	961.00	12,300,800
大倉工業	2,800	3,110.00	8,708,000
積水化成成品工業	12,600	454.00	5,720,400
群栄化学工業	1,900	3,565.00	6,773,500
ダイキョーニシカワ	13,100	735.00	9,628,500
森六ホールディングス	3,100	2,762.00	8,562,200
恵和	4,500	1,177.00	5,296,500
日本化薬	45,400	1,282.50	58,225,500
カーリットホールディングス	6,600	981.00	6,474,600
プレステージ・インターナショナル	28,500	603.00	17,185,500
プロトコーポレーション	6,500	1,313.00	8,534,500
ハイマックス	4,500	1,396.00	6,282,000

アマューズ	4,000	1,499.00	5,996,000
野村総合研究所	131,700	4,071.00	536,150,700
ドリームインキュベータ	2,100	3,040.00	6,384,000
クイック	4,200	2,415.00	10,143,000
日本システム技術	2,200	3,410.00	7,502,000
電通グループ	59,900	4,283.00	256,551,700
インテージホールディングス	6,700	1,799.00	12,053,300
ぴあ	2,100	3,140.00	6,594,000
イオンファンタジー	2,500	2,511.00	6,277,500
ソースネクスト	42,300	134.00	5,668,200
シーティーエス	9,400	735.00	6,909,000
インフォコム	7,700	2,229.00	17,163,300
メディカルシステムネットワーク	10,200	623.00	6,354,600
日本精化	3,900	2,617.00	10,206,300
扶桑化学工業	6,300	4,555.00	28,696,500
トリケミカル研究所	7,200	4,285.00	30,852,000
シンプレクス・ホールディングス	9,000	2,568.00	23,112,000
HEROZ	3,900	1,794.00	6,996,600
ラクスル	14,300	1,053.00	15,057,900
メルカリ	28,900	2,121.50	61,311,350
ADEKA	20,700	2,957.50	61,220,250
日油	17,900	7,060.00	126,374,000
新日本理化	5,700	209.00	1,191,300
ハリマ化成グループ	7,300	902.00	6,584,600
イーソル	10,900	992.00	10,812,800
ウイングアーク1st	6,200	2,934.00	18,190,800
サーバーワークス	1,700	3,875.00	6,587,500
Sansan	19,500	1,493.00	29,113,500
ギフトィ	5,200	1,446.00	7,519,200
花王	134,300	5,651.00	758,929,300
第一工業製薬	3,100	3,455.00	10,710,500
石原ケミカル	3,000	1,892.00	5,676,000
三洋化成工業	3,700	4,165.00	15,410,500
メドレー	8,000	4,815.00	38,520,000
ベース	2,100	3,485.00	7,318,500
JMDC	10,100	3,575.00	36,107,500
武田薬品工業	526,200	4,431.00	2,331,592,200
アステラス製薬	521,600	1,677.00	874,723,200
住友ファーマ	44,200	358.00	15,823,600
塩野義製薬	75,000	7,058.00	529,350,000
わかもと製薬	3,100	207.00	641,700
日本新薬	15,600	4,931.00	76,923,600
中外製薬	186,100	5,890.00	1,096,129,000
科研製薬	10,200	3,541.00	36,118,200
エーザイ	72,300	6,198.00	448,115,400
理研ビタミン	5,000	2,407.00	12,035,000
ロート製薬	57,600	2,992.00	172,339,200
小野薬品工業	126,200	2,423.00	305,782,600
久光製薬	13,200	4,005.00	52,866,000
持田製薬	6,800	3,180.00	21,624,000

参天製薬	108,400	1,534.50	166,339,800
扶桑薬品工業	2,900	2,210.00	6,409,000
ツムラ	18,700	2,750.00	51,425,000
テルモ	165,800	5,658.00	938,096,400
H. U. グループホールディングス	17,800	2,719.50	48,407,100
キッセイ薬品工業	9,800	3,290.00	32,242,000
生化学工業	10,100	750.00	7,575,000
栄研化学	10,900	1,877.00	20,459,300
鳥居薬品	3,200	4,030.00	12,896,000
JCRファーマ	20,100	911.00	18,311,100
東和薬品	9,100	2,999.00	27,290,900
富士製薬工業	4,400	1,730.00	7,612,000
ゼリア新薬工業	8,200	2,155.00	17,671,000
そーせいグループ	19,500	1,419.00	27,670,500
第一三共	518,000	4,931.00	2,554,258,000
杏林製薬	12,900	1,765.00	22,768,500
ダイト	4,600	1,992.00	9,163,200
大塚ホールディングス	123,700	5,596.00	692,225,200
大正製薬ホールディングス	13,200	8,594.00	113,440,800
ペプチドリーム	28,800	1,556.50	44,827,200
大日本塗料	6,600	1,091.00	7,200,600
日本ペイントホールディングス	315,300	1,122.00	353,766,600
関西ペイント	58,200	2,309.00	134,383,800
中国塗料	12,200	2,117.00	25,827,400
藤倉化成	14,000	458.00	6,412,000
太陽ホールディングス	10,300	3,140.00	32,342,000
DIC	23,200	2,988.00	69,321,600
サカタインクス	13,200	1,385.00	18,282,000
artience	12,900	2,956.00	38,132,400
T&K TOKA	5,700	1,408.00	8,025,600
アルプス技研	5,800	2,933.00	17,011,400
日本空調サービス	7,500	895.00	6,712,500
オリエンタルランド	322,500	5,385.00	1,736,662,500
フォーカスシステムズ	6,000	1,117.00	6,702,000
ダスキン	13,600	3,355.00	45,628,000
パーク24	37,900	1,734.50	65,737,550
明光ネットワークジャパン	8,900	731.00	6,505,900
ファルコホールディングス	2,900	2,307.00	6,690,300
クレスコ	4,900	1,967.00	9,638,300
フジ・メディア・ホールディングス	57,100	1,954.50	111,601,950
ラウンドワン	57,400	701.00	40,237,400
リゾートトラスト	26,500	2,512.50	66,581,250
オービック	19,900	22,515.00	448,048,500
ジャストシステム	8,500	2,568.00	21,828,000
TDCソフト	5,600	2,071.00	11,597,600
LINEヤフー	846,500	423.20	358,238,800
ビー・エム・エル	7,500	2,730.00	20,475,000
トレンドマイクロ	28,100	7,090.00	199,229,000
IDホールディングス	4,000	1,651.00	6,604,000
リソー教育	31,100	233.00	7,246,300

日本オラクル	11,400	11,475.00	130,815,000
アルファシステムズ	2,100	3,465.00	7,276,500
フューチャー	12,700	1,667.00	21,170,900
CAC Holdings	3,600	1,792.00	6,451,200
S Bテクノロジー	2,600	2,131.00	5,540,600
ユー・エス・エス	68,400	2,612.00	178,660,800
オービックビジネスコンサルタント	8,400	6,940.00	58,296,000
アイティフォー	7,600	1,377.00	10,465,200
東京個別指導学院	14,200	449.00	6,375,800
サイバーエージェント	134,700	1,053.50	141,906,450
楽天グループ	522,400	767.30	400,837,520
クリーク・アンド・リバー社	3,200	1,944.00	6,220,800
SBIグローバルアセットマネジメント	11,900	733.00	8,722,700
テー・オー・ダブリュー	18,900	374.00	7,068,600
大塚商会	29,500	6,482.00	191,219,000
サイボウズ	8,200	2,005.00	16,441,000
山田コンサルティンググループ	3,600	1,751.00	6,303,600
セントラルスポーツ	2,600	2,443.00	6,351,800
電通総研	7,200	5,300.00	38,160,000
ACCESS	8,100	943.00	7,638,300
デジタルガレージ	9,500	3,390.00	32,205,000
イーエムシステムズ	9,900	718.00	7,108,200
ウェザーニューズ	1,800	5,120.00	9,216,000
C I J	9,900	696.00	6,890,400
WOWOW	5,600	1,127.00	6,311,200
スカラ	8,300	711.00	5,901,300
フルキャストホールディングス	5,800	1,514.00	8,781,200
エン・ジャパン	9,900	2,742.00	27,145,800
セルソース	3,900	1,241.00	4,839,900
あすか製薬ホールディングス	6,100	2,064.00	12,590,400
サワイグループホールディングス	13,600	5,914.00	80,430,400
富士フイルムホールディングス	110,300	9,389.00	1,035,606,700
コニカミノルタ	133,700	471.00	62,972,700
資生堂	124,200	4,154.00	515,926,800
ライオン	77,800	1,337.50	104,057,500
高砂香料工業	4,500	3,400.00	15,300,000
マンダム	12,800	1,315.00	16,832,000
ミルボン	8,100	3,424.00	27,734,400
ファンケル	26,000	2,169.50	56,407,000
コーセー	12,100	8,485.00	102,668,500
コタ	5,500	1,598.00	8,789,000
ポーラ・オルビスホールディングス	30,500	1,478.00	45,079,000
ノエビアホールディングス	5,300	5,270.00	27,931,000
新日本製薬	3,600	1,720.00	6,192,000
エステー	4,600	1,553.00	7,143,800
アグロ カネショウ	4,500	1,260.00	5,670,000
コニシ	17,200	1,378.00	23,701,600
長谷川香料	11,400	3,130.00	35,682,000
小林製薬	17,300	6,168.00	106,706,400

荒川化学工業	5,800	1,118.00	6,484,400
メック	4,900	4,120.00	20,188,000
日本高純度化学	2,400	2,747.00	6,592,800
タカラバイオ	16,000	1,051.00	16,816,000
JCU	6,600	4,045.00	26,697,000
新田ゼラチン	500	673.00	336,500
OATアグリオ	3,200	1,686.00	5,395,200
デクセリアルズ	14,900	5,906.00	87,999,400
アース製薬	5,400	4,275.00	23,085,000
北興化学工業	6,100	1,075.00	6,557,500
大成ラミック	2,100	3,045.00	6,394,500
クミアイ化学工業	23,600	823.00	19,422,800
日本農薬	10,900	698.00	7,608,200
ニチレキ	7,800	2,402.00	18,735,600
ユシロ化学工業	3,400	2,134.00	7,255,600
富士石油	17,400	330.00	5,742,000
出光興産	330,200	915.30	302,232,060
ENEOSホールディングス	941,400	635.50	598,259,700
コスモエネルギーホールディングス	17,700	6,354.00	112,465,800
ANYCOLOR	6,300	3,110.00	19,593,000
テスホールディングス	13,600	456.00	6,201,600
インフロニア・ホールディングス	67,000	1,492.00	99,964,000
横浜ゴム	30,100	4,083.00	122,898,300
TOYO TIRE	34,200	2,886.00	98,701,200
ブリヂストン	174,100	6,412.00	1,116,329,200
住友ゴム工業	58,300	1,808.00	105,406,400
藤倉コンポジット	4,600	1,439.00	6,619,400
オカモト	2,800	4,805.00	13,454,000
アキレス	4,000	1,504.00	6,016,000
フコク	3,100	1,596.00	4,947,600
ニッタ	6,000	3,715.00	22,290,000
住友理工	9,200	1,106.00	10,175,200
三ツ星ベルト	7,200	4,920.00	35,424,000
バンドー化学	8,800	1,728.00	15,206,400
AGC	53,000	5,415.00	286,995,000
日本板硝子	28,400	531.00	15,080,400
有沢製作所	10,400	1,140.00	11,856,000
日本電気硝子	24,300	3,585.00	87,115,500
オハラ	5,400	1,164.00	6,285,600
住友大阪セメント	9,900	3,624.00	35,877,600
太平洋セメント	35,200	3,210.00	112,992,000
日本ヒューム	7,100	885.00	6,283,500
日本コンクリート工業	13,900	443.00	6,157,700
三谷セキサン	2,500	5,660.00	14,150,000
アジアパイルホールディングス	8,400	781.00	6,560,400
東海カーボン	54,900	1,008.50	55,366,650
日本カーボン	3,100	5,370.00	16,647,000
東洋炭素	4,200	7,000.00	29,400,000
ノリタケカンパニーリミテド	3,300	8,060.00	26,598,000
TOTO	39,200	3,745.00	146,804,000

日本碍子	69,200	1,930.00	133,556,000
日本特殊陶業	49,800	4,418.00	220,016,400
MARUWA	2,200	30,850.00	67,870,000
品川リフラクトリーズ	7,300	2,048.00	14,950,400
黒崎播磨	1,200	14,250.00	17,100,000
ヨータイ	4,400	1,443.00	6,349,200
ニッカトー	1,900	579.00	1,100,100
フジインコーポレーテッド	16,000	3,335.00	53,360,000
クニミネ工業	900	1,018.00	916,200
ニチアス	15,000	3,760.00	56,400,000
日本製鉄	273,900	3,566.00	976,727,400
神戸製鋼所	123,000	2,036.00	250,428,000
中山製鋼所	14,000	920.00	12,880,000
合同製鉄	3,400	5,930.00	20,162,000
JFEホールディングス	170,100	2,368.00	402,796,800
東京製鉄	17,200	1,656.00	28,483,200
共英製鋼	7,000	2,278.00	15,946,000
大和工業	11,500	8,459.00	97,278,500
東京鐵鋼	2,700	5,280.00	14,256,000
大阪製鉄	2,800	2,281.00	6,386,800
淀川製鋼所	7,000	4,275.00	29,925,000
中部鋼鈑	4,000	2,493.00	9,972,000
丸一鋼管	18,600	4,040.00	75,144,000
大同特殊鋼	38,500	1,816.00	69,916,000
日本冶金工業	4,500	4,595.00	20,677,500
山陽特殊製鋼	6,100	2,228.00	13,590,800
愛知製鋼	3,500	3,465.00	12,127,500
大太平洋金属	5,200	1,375.00	7,150,000
新日本電工	30,500	299.00	9,119,500
栗本鐵工所	2,800	3,265.00	9,142,000
日本製鋼所	16,500	2,518.50	41,555,250
三菱製鋼	4,500	1,443.00	6,493,500
日亜鋼業	10,400	338.00	3,515,200
日本精線	1,200	5,810.00	6,972,000
エンビプロ・ホールディングス	10,100	488.00	4,928,800
大紀アルミニウム工業所	7,700	1,229.00	9,463,300
日本軽金属ホールディングス	17,800	1,709.00	30,420,200
三井金属鉱業	17,800	4,337.00	77,198,600
東邦亜鉛	5,500	1,045.00	5,747,500
三菱マテリアル	43,700	2,571.00	112,352,700
住友金属鉱山	70,900	4,108.00	291,257,200
DOWAホールディングス	15,100	5,377.00	81,192,700
古河機械金属	8,100	1,733.00	14,037,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,600	2,676.00	28,365,600
東邦チタニウム	12,600	1,722.00	21,697,200
UACJ	8,600	4,135.00	35,561,000
CKサンエツ	1,700	3,860.00	6,562,000
古河電気工業	20,400	2,964.00	60,465,600
住友電気工業	228,800	2,154.50	492,949,600
フジクラ	72,200	1,755.50	126,747,100

SWCC	6,800	3,355.00	22,814,000
タツタ電線	10,900	695.00	7,575,500
平河ヒューテック	4,600	1,305.00	6,003,000
いよぎんホールディングス	69,500	1,084.00	75,338,000
しずおかフィナンシャルグループ	129,700	1,437.50	186,443,750
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	49,200	1,117.50	54,981,000
楽天銀行	20,300	2,659.00	53,977,700
京都フィナンシャルグループ	74,000	2,591.00	191,734,000
リョービ	6,500	2,483.00	16,139,500
AREホールディングス	23,000	1,953.00	44,919,000
東洋製罐グループホールディングス	35,100	2,474.00	86,837,400
ホッカインホールディングス	1,300	1,834.00	2,384,200
コロナ	6,600	963.00	6,355,800
横河ブリッジホールディングス	9,600	2,764.00	26,534,400
三和ホールディングス	61,500	2,622.50	161,283,750
文化シャッター	16,000	1,562.00	24,992,000
三協立山	7,700	879.00	6,768,300
アルインコ	6,000	1,046.00	6,276,000
LIXIL	95,500	1,961.00	187,275,500
日本フィルコン	100	546.00	54,600
ノーリツ	10,100	1,659.00	16,755,900
長府製作所	6,100	2,105.00	12,840,500
リンナイ	29,300	3,561.00	104,337,300
ユニプレス	10,600	1,051.00	11,140,600
日東精工	11,700	582.00	6,809,400
岡部	10,900	791.00	8,621,900
ジーテクト	7,800	2,010.00	15,678,000
東プレ	10,800	2,296.00	24,796,800
高周波熱錬	9,400	1,067.00	10,029,800
東京製綱	4,700	1,523.00	7,158,100
サンコール	13,300	470.00	6,251,000
モリテックスチール	100	261.00	26,100
パイオラックス	7,600	2,699.00	20,512,400
エイチワン	7,700	675.00	5,197,500
日本発条	54,100	1,464.00	79,202,400
中央発條	8,800	730.00	6,424,000
三浦工業	25,000	2,964.00	74,100,000
タクマ	20,200	1,850.00	37,370,000
テクノプロ・ホールディングス	35,700	3,260.00	116,382,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	1,345.00	5,514,500
Keepers 技研	3,800	6,540.00	24,852,000
イー・ガーディアン	4,000	1,347.00	5,388,000
ジャパンマテリアル	18,600	2,668.00	49,624,800
ベクトル	7,500	1,231.00	9,232,500
チャーム・ケア・コーポレーション	5,300	1,331.00	7,054,300
キャリアリンク	2,400	2,649.00	6,357,600
IBJ	9,000	582.00	5,238,000
アサンテ	3,800	1,674.00	6,361,200
バリューHR	5,300	1,334.00	7,070,200

M&Aキャピタルパートナーズ	4,900	2,475.00	12,127,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,100	1,060.00	6,466,000
シグマクシス・ホールディングス	8,200	1,732.00	14,202,400
ウィルグループ	5,300	1,138.00	6,031,400
メドピア	9,100	803.00	7,307,300
リクルートホールディングス	451,200	5,936.00	2,678,323,200
エラン	8,100	940.00	7,614,000
ツガミ	13,300	1,138.00	15,135,400
オークマ	5,200	7,184.00	37,356,800
芝浦機械	6,000	3,445.00	20,670,000
アマダ	95,500	1,621.50	154,853,250
アイダエンジニアリング	13,900	851.00	11,828,900
F U J I	28,200	2,622.00	73,940,400
牧野フライス製作所	6,600	5,940.00	39,204,000
オーエスジー	26,400	2,145.50	56,641,200
旭ダイヤモンド工業	13,800	872.00	12,033,600
DMG森精機	36,300	3,433.00	124,617,900
ソディック	14,600	717.00	10,468,200
ディスコ	28,800	43,330.00	1,247,904,000
日東工器	3,300	1,926.00	6,355,800
日進工具	6,100	995.00	6,069,500
パンチ工業	200	422.00	84,400
日本郵政	716,200	1,406.00	1,006,977,200
ベルシステム24ホールディングス	6,500	1,782.00	11,583,000
鎌倉新書	10,400	605.00	6,292,000
エアトリ	4,500	1,593.00	7,168,500
アトラエ	9,300	477.00	4,436,100
ストライク	2,600	5,260.00	13,676,000
ソラスト	16,800	527.00	8,853,600
インソース	13,200	802.00	10,586,400
豊田自動織機	50,600	14,795.00	748,627,000
リケンNPR	6,500	2,866.00	18,629,000
島精機製作所	9,500	1,388.00	13,186,000
オプトラン	9,800	1,871.00	18,335,800
イワキ	4,000	2,421.00	9,684,000
フリーー	5,600	1,203.00	6,736,800
ヤマシンフィルタ	18,800	351.00	6,598,800
日阪製作所	6,500	982.00	6,383,000
やまびこ	9,800	1,794.00	17,581,200
野村マイクロ・サイエンス	2,000	13,770.00	27,540,000
平田機工	2,900	7,600.00	22,040,000
PEGASUS	14,100	437.00	6,161,700
マルマエ	3,400	1,875.00	6,375,000
タツモ	3,600	3,760.00	13,536,000
ナブテスコ	37,600	2,555.50	96,086,800
三井海洋開発	7,600	2,888.00	21,948,800
レオン自動機	6,900	1,422.00	9,811,800
SMC	17,900	84,440.00	1,511,476,000
ホソカワミクロン	3,800	4,335.00	16,473,000

ユニオンツール	2,600	3,925.00	10,205,000
瑞光	4,300	1,723.00	7,408,900
オイレス工業	8,100	2,055.00	16,645,500
日精エー・エス・ビー機械	2,400	4,390.00	10,536,000
サトーホールディングス	8,500	2,284.00	19,414,000
技研製作所	5,600	2,065.00	11,564,000
日本エアテック	5,100	1,146.00	5,844,600
日精樹脂工業	5,600	1,135.00	6,356,000
ワイエイシイホールディングス	2,600	2,255.00	5,863,000
小松製作所	280,700	4,250.00	1,192,975,000
住友重機械工業	35,400	4,530.00	160,362,000
日立建機	23,800	4,164.00	99,103,200
日工	8,900	766.00	6,817,400
巴工業	2,300	3,750.00	8,625,000
井関農機	5,600	1,002.00	5,611,200
TOWA	6,700	7,670.00	51,389,000
北川鉄工所	4,100	1,552.00	6,363,200
シンニッタン	14,300	276.00	3,946,800
ローツェ	3,100	19,400.00	60,140,000
クボタ	313,000	2,199.00	688,287,000
荏原実業	3,200	3,100.00	9,920,000
東洋エンジニアリング	8,500	808.00	6,868,000
三菱化工機	2,100	3,715.00	7,801,500
月島ホールディングス	8,100	1,357.00	10,991,700
帝国電機製作所	4,200	2,733.00	11,478,600
新東工業	12,100	1,146.00	13,866,600
澁谷工業	5,600	3,105.00	17,388,000
アイチコーポレーション	8,300	1,092.00	9,063,600
小森コーポレーション	14,700	1,295.00	19,036,500
鶴見製作所	4,600	3,395.00	15,617,000
酒井重工業	900	6,410.00	5,769,000
荏原製作所	24,600	11,150.00	274,290,000
西島製作所	5,200	2,530.00	13,156,000
北越工業	6,000	2,420.00	14,520,000
ダイキン工業	71,500	21,200.00	1,515,800,000
オルガノ	7,200	6,840.00	49,248,000
トーヨーカネツ	2,000	4,430.00	8,860,000
栗田工業	33,500	5,771.00	193,328,500
椿本チエイン	8,500	4,680.00	39,780,000
日機装	13,800	1,176.00	16,228,800
木村化工機	8,700	707.00	6,150,900
レイズネクスト	8,400	2,315.00	19,446,000
アネスト岩田	9,300	1,335.00	12,415,500
ダイフク	101,100	3,340.00	337,674,000
サムコ	1,600	5,030.00	8,048,000
タダノ	34,500	1,300.00	44,850,000
フジテック	14,000	3,720.00	52,080,000
CKD	16,600	2,733.00	45,367,800
平和	17,700	2,086.00	36,922,200
理想科学工業	4,800	3,210.00	15,408,000

SANKYO	13,800	8,958.00	123,620,400
日本金銭機械	7,200	1,386.00	9,979,200
マースグループホールディングス	3,000	2,877.00	8,631,000
フクシマガリレイ	3,900	5,890.00	22,971,000
ダイコク電機	2,900	4,085.00	11,846,500
竹内製作所	10,900	5,110.00	55,699,000
アマノ	17,000	3,687.00	62,679,000
JUKI	14,200	498.00	7,071,600
ジャノメ	9,100	687.00	6,251,700
ブラザー工業	80,000	2,515.50	201,240,000
マックス	8,400	3,110.00	26,124,000
モリタホールディングス	10,400	1,623.00	16,879,200
グローリー	14,400	2,924.00	42,105,600
新晃工業	6,000	3,170.00	19,020,000
大和冷機工業	9,200	1,459.00	13,422,800
セガサミーホールディングス	53,500	1,807.00	96,674,500
TPR	7,600	2,119.00	16,104,400
ツバキ・ナカシマ	12,000	779.00	9,348,000
ホシザキ	35,300	5,226.00	184,477,800
大豊工業	7,500	839.00	6,292,500
日本精工	110,900	809.20	89,740,280
NTN	129,900	294.30	38,229,570
ジェイテクト	53,300	1,375.50	73,314,150
不二越	4,400	3,345.00	14,718,000
ミネベアミツミ	104,200	3,032.00	315,934,400
日本トムソン	16,300	626.00	10,203,800
THK	34,500	3,121.00	107,674,500
ユウシン精機	9,400	682.00	6,410,800
前澤給装工業	4,900	1,279.00	6,267,100
イーグル工業	6,600	1,775.00	11,715,000
日本ピラー工業	5,600	5,370.00	30,072,000
キッツ	20,000	1,307.00	26,140,000
日立製作所	287,800	12,455.00	3,584,549,000
三菱電機	666,500	2,279.00	1,518,953,500
富士電機	36,400	8,956.00	325,998,400
安川電機	65,000	5,521.00	358,865,000
シンフォニアテクノロジー	6,600	2,524.00	16,658,400
明電舎	11,100	2,627.00	29,159,700
オリジン	1,600	1,220.00	1,952,000
山洋電気	2,600	6,160.00	16,016,000
デンヨー	4,600	2,341.00	10,768,600
PHCホールディングス	11,200	1,258.00	14,089,600
KOKUSAI ELECTRIC	23,100	4,575.00	105,682,500
ソシオネクスト	43,500	3,847.00	167,344,500
ベイカレント・コンサルティング	44,800	3,134.00	140,403,200
Orchestra Holdings	6,300	1,105.00	6,961,500
アイモバイル	14,100	460.00	6,486,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	19,700	2,225.00	43,832,500

ミダックホールディングス	3,700	1,582.00	5,853,400
キュービーネットホールディングス	4,200	1,326.00	5,569,200
R P Aホールディングス	24,900	256.00	6,374,400
三櫻工業	9,100	1,080.00	9,828,000
マキタ	68,300	3,839.00	262,203,700
東芝テック	7,700	3,060.00	23,562,000
芝浦メカトロニクス	3,400	6,490.00	22,066,000
マブチモーター	29,400	2,715.50	79,835,700
ニデック	132,200	5,701.00	753,672,200
トレックス・セミコンダクター	3,500	1,861.00	6,513,500
東光高岳	3,600	2,419.00	8,708,400
ダブル・スコープ	17,100	768.00	13,132,800
ダイヘン	6,000	7,080.00	42,480,000
ヤーマン	11,600	1,009.00	11,704,400
J V Cケンウッド	47,300	708.00	33,488,400
I - P E X	4,200	1,808.00	7,593,600
大崎電気工業	13,100	676.00	8,855,600
オムロン	45,700	5,729.00	261,815,300
日東工業	8,100	4,285.00	34,708,500
I D E C	8,800	2,823.00	24,842,400
不二電機工業	300	1,134.00	340,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	23,400	2,718.00	63,601,200
メルコホールディングス	1,900	3,200.00	6,080,000
テクノメディカ	3,200	1,777.00	5,686,400
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	9,100	667.00	6,069,700
日本電気	78,600	9,680.00	760,848,000
富士通	55,100	22,600.00	1,245,260,000
沖電気工業	27,100	1,065.00	28,861,500
電気興業	2,700	2,084.00	5,626,800
サンケン電気	5,600	7,800.00	43,680,000
アイホン	3,200	2,857.00	9,142,400
ルネサスエレクトロニクス	390,800	2,429.00	949,253,200
セイコーエプソン	76,800	2,428.00	186,470,400
ワコム	45,500	640.00	29,120,000
アルバック	13,100	8,844.00	115,856,400
E I Z O	4,400	5,010.00	22,044,000
日本信号	13,600	971.00	13,205,600
京三製作所	13,700	457.00	6,260,900
能美防災	8,100	2,215.00	17,941,500
ホーチキ	4,500	2,254.00	10,143,000
エレコム	14,300	1,617.00	23,123,100
パナソニック ホールディングス	707,400	1,427.00	1,009,459,800
シャープ	100,900	809.80	81,708,820
アンリツ	42,200	1,179.00	49,753,800
富士通ゼネラル	17,000	1,991.50	33,855,500
ソニーグループ	419,400	13,185.00	5,529,789,000
T D K	94,800	7,713.00	731,192,400
帝国通信工業	3,100	1,884.00	5,840,400
タムラ製作所	23,900	563.00	13,455,700

アルプスアルパイン	53,500	1,059.00	56,656,500
日本電波工業	7,200	1,351.00	9,727,200
鈴木	5,400	1,155.00	6,237,000
メイコー	5,900	4,590.00	27,081,000
ローランド ディー. ジー.	3,300	5,020.00	16,566,000
フォスター電機	5,800	1,075.00	6,235,000
SMK	2,500	2,494.00	6,235,000
ヨコオ	5,300	1,566.00	8,299,800
ホシデン	13,600	2,009.00	27,322,400
ヒロセ電機	8,800	15,995.00	140,756,000
日本航空電子工業	14,300	2,689.00	38,452,700
TOA	6,800	1,139.00	7,745,200
マクセル	13,200	1,578.00	20,829,600
古野電気	7,800	2,166.00	16,894,800
スミダコーポレーション	8,000	1,190.00	9,520,000
アイコム	2,300	3,410.00	7,843,000
リオン	2,600	2,777.00	7,220,200
横河電機	65,500	3,017.00	197,613,500
新電元工業	2,300	3,080.00	7,084,000
アズビル	40,800	4,461.00	182,008,800
日本光電工業	25,400	4,162.00	105,714,800
チノー	2,700	2,312.00	6,242,400
共和電業	4,200	423.00	1,776,600
日本電子材料	3,600	1,980.00	7,128,000
堀場製作所	11,300	13,965.00	157,804,500
アドバンテスト	169,900	6,594.00	1,120,320,600
エスペック	4,700	2,693.00	12,657,100
キーエンス	59,300	68,860.00	4,083,398,000
日置電機	2,800	6,770.00	18,956,000
シスメックス	51,200	7,890.00	403,968,000
日本マイクロニクス	10,600	6,560.00	69,536,000
メガチップス	4,700	4,185.00	19,669,500
OBARA GROUP	3,200	3,670.00	11,744,000
澤藤電機	3,300	1,293.00	4,266,900
デンソー	489,100	2,677.50	1,309,565,250
原田工業	4,500	755.00	3,397,500
コーセル	6,300	1,530.00	9,639,000
イリソ電子工業	5,500	3,105.00	17,077,500
オプテックスグループ	10,900	1,820.00	19,838,000
千代田インテグレ	2,300	2,607.00	5,996,100
レーザーテック	27,200	39,020.00	1,061,344,000
スタンレー電気	38,000	2,556.50	97,147,000
ウシオ電機	30,100	2,028.50	61,057,850
岡谷電機産業	100	272.00	27,200
日本セラミック	4,800	2,589.00	12,427,200
古河電池	7,000	958.00	6,706,000
山一電機	5,300	2,226.00	11,797,800
図研	5,200	4,345.00	22,594,000
日本電子	14,900	6,290.00	93,721,000
カシオ計算機	42,800	1,190.50	50,953,400

ファナック	289,100	4,220.00	1,220,002,000
日本シイエムケイ	12,600	581.00	7,320,600
エンプラス	1,700	9,000.00	15,300,000
大真空	8,800	875.00	7,700,000
ローム	109,600	2,615.00	286,604,000
浜松ホトニクス	47,600	5,434.00	258,658,400
三井ハイテック	5,200	8,270.00	43,004,000
新光電気工業	21,000	5,485.00	115,185,000
京セラ	368,400	2,216.50	816,558,600
太陽誘電	28,900	3,361.00	97,132,900
村田製作所	539,400	2,976.00	1,605,254,400
双葉電子工業	12,400	508.00	6,299,200
日東電工	38,200	13,880.00	530,216,000
北陸電気工業	2,800	1,410.00	3,948,000
東海理化電機製作所	16,700	2,395.00	39,996,500
ニチコン	15,600	1,223.00	19,078,800
日本ケミコン	6,300	1,336.00	8,416,800
KOA	9,000	1,507.00	13,563,000
三井E&S	29,700	1,144.00	33,976,800
日立造船	52,800	1,113.00	58,766,400
三菱重工業	104,700	11,225.00	1,175,257,500
川崎重工業	48,400	3,846.00	186,146,400
IHI	44,600	3,097.00	138,126,200
名村造船所	14,800	1,738.00	25,722,400
マネジメントソリューションズ	2,600	2,868.00	7,456,800
プロレド・パートナーズ	17,700	358.00	6,336,600
アンビスホールディングス	6,500	2,486.00	16,159,000
カーブスホールディングス	16,600	741.00	12,300,600
フォーラムエンジニアリング	8,300	978.00	8,117,400
日本車輛製造	2,900	2,310.00	6,699,000
三菱ロジスネクスト	9,500	1,416.00	13,452,000
フルサト・マルカホールディングス	5,600	2,261.00	12,661,600
ヤマエグループホールディングス	3,500	2,466.00	8,631,000
FPG	19,700	1,829.00	36,031,300
じもとホールディングス	2,500	543.00	1,357,500
全国保証	15,300	5,515.00	84,379,500
めぶきフィナンシャルグループ	289,700	441.00	127,757,700
ジャパンインベストメントアドバイザー	9,500	886.00	8,417,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7,500	4,110.00	30,825,000
九州フィナンシャルグループ	113,000	957.80	108,231,400
かんぽ生命保険	59,500	2,653.00	157,853,500
ゆうちょ銀行	641,600	1,538.50	987,101,600
富山第一銀行	18,500	882.00	16,317,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	313,300	726.80	227,706,440
ジェイリース	1,800	2,580.00	4,644,000
西日本フィナンシャルホールディングス	32,900	1,626.00	53,495,400
イントラスト	100	811.00	81,100

SBIアルヒ	7,400	899.00	6,652,600
プレミアグループ	9,800	1,797.00	17,610,600
日産自動車	800,100	566.40	453,176,640
いすゞ自動車	172,400	2,147.00	370,142,800
トヨタ自動車	3,255,400	3,429.00	11,162,766,600
日野自動車	89,200	470.00	41,924,000
三菱自動車工業	231,300	451.00	104,316,300
エフテック	1,400	706.00	988,400
武蔵精密工業	14,500	1,619.00	23,475,500
日産車体	6,400	959.00	6,137,600
新明和工業	17,100	1,211.00	20,708,100
極東開発工業	9,800	2,366.00	23,186,800
トピー工業	4,800	2,956.00	14,188,800
ティラド	1,700	3,770.00	6,409,000
タチエス	10,900	2,011.00	21,919,900
NOK	23,000	2,082.50	47,897,500
フタバ産業	15,900	1,068.00	16,981,200
カヤバ	5,700	4,915.00	28,015,500
市光工業	10,900	539.00	5,875,100
大同メタル工業	11,600	546.00	6,333,600
プレス工業	23,700	655.00	15,523,500
ミクニ	3,600	459.00	1,652,400
太平洋工業	13,600	1,455.00	19,788,000
アイシン	45,700	5,491.00	250,938,700
マツダ	196,100	1,759.50	345,037,950
今仙電機製作所	2,500	664.00	1,660,000
本田技研工業	1,445,800	1,747.00	2,525,812,600
スズキ	108,900	6,507.00	708,612,300
SUBARU	183,900	3,330.00	612,387,000
ヤマハ発動機	256,200	1,378.50	353,171,700
小糸製作所	61,400	1,944.00	119,361,600
エクセディ	9,700	2,876.00	27,897,200
ミツバ	11,100	1,308.00	14,518,800
豊田合成	17,000	2,993.50	50,889,500
愛三工業	9,800	1,494.00	14,641,200
盟和産業	1,300	1,027.00	1,335,100
ヨロズ	6,800	929.00	6,317,200
エフ・シー・シー	10,500	2,119.00	22,249,500
シマノ	23,900	20,800.00	497,120,000
テイ・エス テック	21,100	1,957.00	41,292,700
三十三フィナンシャルグループ	5,200	1,936.00	10,067,200
第四北越フィナンシャルグループ	9,200	4,215.00	38,778,000
ひろぎんホールディングス	83,100	1,039.50	86,382,450
マーキュリアホールディングス	1,400	749.00	1,048,600
おきなわフィナンシャルグループ	5,000	2,493.00	12,465,000
ダイレクトマーケティングミックス	14,300	312.00	4,461,600
ポピンズ	5,600	1,400.00	7,840,000
LITALICO	4,700	2,127.00	9,996,900
十六フィナンシャルグループ	7,600	4,225.00	32,110,000
北國フィナンシャルホールディングス	6,100	4,690.00	28,609,000

ネットプロテクションズホールディングス	34,600	194.00	6,712,400
プロクレアホールディングス	6,700	1,831.00	12,267,700
F P パートナー	1,200	6,770.00	8,124,000
あいちフィナンシャルグループ	9,000	2,615.00	23,535,000
ジャムコ	4,000	1,342.00	5,368,000
小野建	6,200	1,750.00	10,850,000
はるやまホールディングス	5,300	604.00	3,201,200
南陽	1,400	2,480.00	3,472,000
ノジマ	18,200	1,714.00	31,194,800
佐島電機	3,500	2,449.00	8,571,500
カップ・クリエイト	9,900	1,660.00	16,434,000
伯東	3,600	5,980.00	21,528,000
コンドーテック	5,100	1,268.00	6,466,800
中山福	100	368.00	36,800
ライトオン	6,600	412.00	2,719,200
ナガイレーベン	7,900	2,325.00	18,367,500
三菱食品	5,800	5,070.00	29,406,000
良品計画	68,500	2,313.50	158,474,750
松田産業	4,800	2,386.00	11,452,800
第一興商	24,300	1,914.50	46,522,350
メディバルホールディングス	63,800	2,361.50	150,663,700
アドヴァングループ	6,000	1,175.00	7,050,000
S P K	3,200	2,060.00	6,592,000
萩原電気ホールディングス	2,700	4,775.00	12,892,500
アルビス	2,400	2,613.00	6,271,200
アズワン	9,800	5,216.00	51,116,800
スズデン	2,600	2,210.00	5,746,000
シモジマ	4,800	1,285.00	6,168,000
ドウシシャ	5,800	2,147.00	12,452,600
小津産業	2,300	1,670.00	3,841,000
高速	3,700	2,387.00	8,831,900
ハウス オブ ローゼ	400	1,626.00	650,400
G-7ホールディングス	6,800	1,457.00	9,907,600
イオン北海道	18,500	923.00	17,075,500
コジマ	10,400	741.00	7,706,400
ヒマラヤ	400	942.00	376,800
コーナン商事	7,700	3,890.00	29,953,000
ネットワンシステムズ	24,000	2,557.50	61,380,000
エコス	2,600	2,346.00	6,099,600
ワタミ	6,600	1,030.00	6,798,000
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	126,700	3,483.00	441,296,100
丸文	5,600	1,506.00	8,433,600
西松屋チェーン	12,300	2,104.00	25,879,200
ゼンショーホールディングス	31,900	6,472.00	206,456,800
ハピネット	5,300	3,190.00	16,907,000
橋本総業ホールディングス	4,700	1,304.00	6,128,800
日本ライフライン	18,400	1,276.00	23,478,400
サイゼリヤ	9,300	4,965.00	46,174,500

VTホールディングス	23,800	514.00	12,233,200
アルゴグラフィックス	5,500	4,200.00	23,100,000
魚力	2,700	2,387.00	6,444,900
IDOM	16,600	900.00	14,940,000
日本エム・ディ・エム	8,300	707.00	5,868,100
フジ・コーポレーション	3,600	1,747.00	6,289,200
ユナイテッドアローズ	7,400	1,770.00	13,098,000
進和	3,800	2,436.00	9,256,800
ダイトロン	2,500	2,887.00	7,217,500
ハイデイ日高	9,300	2,693.00	25,044,900
シークス	8,900	1,572.00	13,990,800
コロワイド	27,000	2,230.00	60,210,000
オーハシテクニカ	3,600	1,740.00	6,264,000
壺番屋	5,000	6,050.00	30,250,000
白銅	2,600	2,584.00	6,718,400
スギホールディングス	12,600	7,208.00	90,820,800
薬王堂ホールディングス	3,100	2,800.00	8,680,000
島津製作所	78,800	3,838.00	302,434,400
JMS	12,000	514.00	6,168,000
長野計器	4,300	2,291.00	9,851,300
ブイ・テクノロジー	3,100	2,605.00	8,075,500
スター精密	11,200	1,695.00	18,984,000
東京計器	4,500	2,261.00	10,174,500
愛知時計電機	2,600	2,552.00	6,635,200
インターアクション	4,300	1,177.00	5,061,100
東京精密	12,100	9,599.00	116,147,900
マニー	23,700	2,054.00	48,679,800
ニコン	85,700	1,583.00	135,663,100
トプコン	28,800	1,769.00	50,947,200
オリンパス	364,900	2,201.00	803,144,900
理研計器	4,200	7,710.00	32,382,000
SCREENホールディングス	20,300	18,060.00	366,618,000
キヤノン電子	6,600	2,216.00	14,625,600
タムロン	3,600	6,370.00	22,932,000
HOYA	116,700	18,395.00	2,146,696,500
ノーリツ鋼機	5,600	3,030.00	16,968,000
A&Dホロンホールディングス	8,600	2,144.00	18,438,400
朝日インテック	72,300	2,884.00	208,513,200
キヤノン	295,700	4,216.00	1,246,671,200
リコー	148,600	1,266.00	188,127,600
シチズン時計	54,500	1,073.00	58,478,500
メニコン	20,400	1,700.00	34,680,000
スノーピーク	8,500	1,249.00	10,616,500
パラマウントベッドホールディングス	12,300	2,503.00	30,786,900
トランザクション	3,900	2,501.00	9,753,900
ニホンフラッシュ	6,800	965.00	6,562,000
前田工織	5,000	3,395.00	16,975,000
アートネイチャー	7,900	784.00	6,193,600
フルヤ金属	1,400	9,840.00	13,776,000
バンダイナムコホールディングス	162,400	2,984.50	484,682,800

SHOEI	13,400	2,106.00	28,220,400
フランスベッドホールディングス	7,700	1,319.00	10,156,300
マーベラス	9,700	738.00	7,158,600
パイロットコーポレーション	8,300	3,937.00	32,677,100
エイベックス	10,100	1,293.00	13,059,300
フジシールインターナショナル	12,000	2,074.00	24,888,000
タカラトミー	27,000	2,395.50	64,678,500
広済堂ホールディングス	15,300	650.00	9,945,000
レック	7,600	1,083.00	8,230,800
プロネクサス	6,100	1,226.00	7,478,600
きもと	4,000	207.00	828,000
TOPPANホールディングス	72,900	3,585.00	261,346,500
大日本印刷	64,800	4,589.00	297,367,200
共同印刷	1,900	3,130.00	5,947,000
NISSHA	10,100	1,534.00	15,493,400
藤森工業	4,700	3,875.00	18,212,500
TAKARA & COMPANY	3,500	2,795.00	9,782,500
前澤化成工業	4,000	1,592.00	6,368,000
未来工業	2,100	5,210.00	10,941,000
アシックス	50,500	6,038.00	304,919,000
ツツミ	3,000	2,089.00	6,267,000
JSP	4,200	2,235.00	9,387,000
ニチハ	7,400	3,480.00	25,752,000
ローランド	4,400	4,895.00	21,538,000
エフピコ	11,200	2,839.50	31,802,400
小松ウオール工業	2,400	3,315.00	7,956,000
ヤマハ	37,400	3,179.00	118,894,600
河合楽器製作所	1,800	3,395.00	6,111,000
クリナップ	7,000	754.00	5,278,000
ピジョン	37,800	1,596.00	60,328,800
天馬	4,300	2,371.00	10,195,300
キングジム	7,300	878.00	6,409,400
象印マホービン	16,100	1,435.00	23,103,500
リンテック	11,900	2,995.00	35,640,500
信越ポリマー	12,800	1,588.00	20,326,400
イトーキ	12,100	1,986.00	24,030,600
任天堂	374,300	8,401.00	3,144,494,300
三菱鉛筆	8,400	2,427.00	20,386,800
松風	2,700	2,720.00	7,344,000
タカラスタンダード	12,500	1,840.00	23,000,000
コクヨ	24,300	2,461.50	59,814,450
ナカバヤシ	11,700	534.00	6,247,800
ニフコ	17,800	3,635.00	64,703,000
グローブライド	5,300	2,025.00	10,732,500
オカムラ	17,800	2,204.00	39,231,200
バルカー	5,000	4,455.00	22,275,000
MUTOHホールディングス	1,800	2,238.00	4,028,400
伊藤忠商事	421,700	6,648.00	2,803,461,600
丸紅	523,000	2,442.50	1,277,427,500
スクロール	9,300	922.00	8,574,600

ヨンドシーホールディングス	5,900	1,957.00	11,546,300
長瀬産業	28,800	2,465.00	70,992,000
蝶理	3,900	3,075.00	11,992,500
豊田通商	54,900	9,243.00	507,440,700
オンワードホールディングス	35,000	524.00	18,340,000
三共生興	8,700	764.00	6,646,800
兼松	26,200	2,372.00	62,146,400
美津濃	5,900	5,230.00	30,857,000
三井物産	472,600	6,373.00	3,011,879,800
日本紙パルプ商事	3,000	5,020.00	15,060,000
東京エレクトロン	125,500	34,520.00	4,332,260,000
カメイ	6,700	1,879.00	12,589,300
OUGホールディングス	1,700	2,620.00	4,454,000
スターゼン	4,300	2,797.00	12,027,100
セイコーグループ	8,300	3,190.00	26,477,000
山善	19,000	1,286.00	24,434,000
椿本興業	1,300	6,870.00	8,931,000
住友商事	379,600	3,554.00	1,349,098,400
B I P R O G Y	19,500	4,588.00	89,466,000
内田洋行	2,500	7,920.00	19,800,000
三菱商事	1,242,900	3,154.00	3,920,106,600
第一実業	5,900	1,992.00	11,752,800
キャノンマーケティングジャパン	14,500	4,310.00	62,495,000
西華産業	2,500	2,977.00	7,442,500
佐藤商事	4,300	1,754.00	7,542,200
菱洋エレクトロ	5,900	3,950.00	23,305,000
東京産業	8,500	727.00	6,179,500
ユアサ商事	4,900	5,050.00	24,745,000
神鋼商事	1,600	7,180.00	11,488,000
阪和興業	11,300	5,550.00	62,715,000
正栄食品工業	4,200	4,625.00	19,425,000
カナデン	4,700	1,536.00	7,219,200
RYODEN	5,100	2,617.00	13,346,700
ニプロ	49,400	1,262.50	62,367,500
岩谷産業	14,300	7,348.00	105,076,400
ナイス	2,900	1,618.00	4,692,200
極東貿易	3,700	2,150.00	7,955,000
アステナホールディングス	13,200	474.00	6,256,800
三愛オブリ	15,100	1,886.00	28,478,600
稲畑産業	12,400	3,165.00	39,246,000
G S I クレオス	3,400	2,384.00	8,105,600
明和産業	9,500	713.00	6,773,500
ゴールドウイン	10,500	8,975.00	94,237,500
ユニ・チャーム	123,900	5,230.00	647,997,000
デサント	10,300	3,210.00	33,063,000
ワキタ	10,400	1,595.00	16,588,000
ヤマトインターナショナル	14,100	304.00	4,286,400
東邦ホールディングス	17,400	3,236.00	56,306,400
サンゲツ	14,400	3,620.00	52,128,000
ミツウロコグループホールディングス	8,000	1,492.00	11,936,000

シナネンホールディングス	1,700	4,180.00	7,106,000
伊藤忠エネクス	15,500	1,516.00	23,498,000
サンリオ	17,800	7,885.00	140,353,000
サンワテクノス	3,200	2,303.00	7,369,600
リョーサン	4,400	5,100.00	22,440,000
新光商事	8,400	1,221.00	10,256,400
トーヨー	2,400	2,944.00	7,065,600
三信電気	2,600	2,312.00	6,011,200
東陽テクニカ	6,400	1,490.00	9,536,000
モスフードサービス	9,200	3,485.00	32,062,000
加賀電子	5,700	6,440.00	36,708,000
三益半導体工業	5,500	3,075.00	16,912,500
都築電気	3,100	2,387.00	7,399,700
ソーダニッカ	5,300	1,185.00	6,280,500
立花エレテック	4,200	3,125.00	13,125,000
木曽路	9,500	2,583.00	24,538,500
SRSホールディングス	10,300	1,183.00	12,184,900
リテールパートナーズ	9,300	1,748.00	16,256,400
上新電機	6,200	2,379.00	14,749,800
日本瓦斯	33,200	2,341.00	77,721,200
ロイヤルホールディングス	11,100	2,431.00	26,984,100
いなげや	6,100	1,309.00	7,984,900
チヨダ	7,200	886.00	6,379,200
ライフコーポレーション	6,600	3,710.00	24,486,000
リンガーハット	8,100	2,348.00	19,018,800
MrMaxHD	10,200	628.00	6,405,600
AOKIホールディングス	13,400	1,140.00	15,276,000
オークワ	9,000	863.00	7,767,000
コメリ	9,700	3,350.00	32,495,000
青山商事	13,400	1,603.00	21,480,200
しまむら	14,800	8,173.00	120,960,400
高島屋	43,400	2,284.50	99,147,300
松屋	10,600	963.00	10,207,800
エイチ・ツー・オーリテイリング	27,800	1,804.00	50,151,200
近鉄百貨店	2,700	2,487.00	6,714,900
丸井グループ	41,600	2,467.50	102,648,000
クレディセゾン	37,000	2,862.00	105,894,000
アクシアルリテイリング	4,300	4,040.00	17,372,000
イオン	212,600	3,565.00	757,919,000
イズミ	11,100	3,725.00	41,347,500
平和堂	10,500	2,056.00	21,588,000
フジ	9,600	1,973.00	18,940,800
ヤオコー	7,100	8,449.00	59,987,900
ゼビオホールディングス	8,500	964.00	8,194,000
ケーズホールディングス	42,100	1,231.00	51,825,100
PALTAC	8,500	4,305.00	36,592,500
三谷産業	17,200	390.00	6,708,000
日産東京販売ホールディングス	4,800	505.00	2,424,000
あおぞら銀行	42,000	2,404.50	100,989,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,555,900	1,475.50	5,246,730,450

りそなホールディングス	680,900	809.80	551,392,820
三井住友トラスト・ホールディングス	209,800	2,956.00	620,168,800
三井住友フィナンシャルグループ	415,200	8,001.00	3,322,015,200
千葉銀行	162,700	1,173.50	190,928,450
群馬銀行	113,300	781.00	88,487,300
武蔵野銀行	8,100	2,763.00	22,380,300
千葉興業銀行	11,000	833.00	9,163,000
七十七銀行	17,000	3,685.00	62,645,000
秋田銀行	3,900	2,051.00	7,998,900
山形銀行	6,500	1,105.00	7,182,500
岩手銀行	3,700	2,513.00	9,298,100
東邦銀行	46,200	318.00	14,691,600
ふくおかフィナンシャルグループ	50,900	3,636.00	185,072,400
スルガ銀行	51,500	776.00	39,964,000
八十二銀行	125,300	888.30	111,303,990
山梨中央銀行	6,500	1,724.00	11,206,000
大垣共立銀行	11,100	2,063.00	22,899,300
福井銀行	5,200	1,772.00	9,214,400
清水銀行	4,000	1,574.00	6,296,000
富山銀行	1,100	1,785.00	1,963,500
滋賀銀行	9,700	3,975.00	38,557,500
南都銀行	8,800	2,697.00	23,733,600
百五銀行	54,900	606.00	33,269,400
紀陽銀行	20,900	1,820.00	38,038,000
ほくほくフィナンシャルグループ	36,100	1,686.50	60,882,650
山陰合同銀行	36,500	1,024.00	37,376,000
百十四銀行	5,700	2,677.00	15,258,900
四国銀行	8,600	1,065.00	9,159,000
阿波銀行	8,200	2,518.00	20,647,600
大分銀行	3,500	2,632.00	9,212,000
宮崎銀行	3,500	2,722.00	9,527,000
佐賀銀行	3,400	1,907.00	6,483,800
琉球銀行	12,400	1,126.00	13,962,400
セブン銀行	183,000	299.40	54,790,200
みずほフィナンシャルグループ	788,100	2,727.00	2,149,148,700
山口フィナンシャルグループ	57,300	1,500.50	85,978,650
芙蓉総合リース	5,400	13,745.00	74,223,000
みずほリース	9,800	5,390.00	52,822,000
東京センチュリー	43,600	1,585.50	69,127,800
SBIホールディングス	85,600	3,943.00	337,520,800
日本証券金融	21,500	1,635.00	35,152,500
アイフル	86,000	428.00	36,808,000
名古屋銀行	3,800	5,890.00	22,382,000
北洋銀行	88,500	344.00	30,444,000
大光銀行	1,200	1,380.00	1,656,000
愛媛銀行	7,900	1,093.00	8,634,700
京葉銀行	24,500	713.00	17,468,500
栃木銀行	29,200	305.00	8,906,000
北日本銀行	2,800	2,122.00	5,941,600
東和銀行	10,700	662.00	7,083,400

リコーリース	5,500	5,100.00	28,050,000
イオンフィナンシャルサービス	33,500	1,340.00	44,890,000
アコム	104,200	388.50	40,481,700
ジャックス	6,200	5,540.00	34,348,000
オリエントコーポレーション	19,100	1,072.00	20,475,200
オリックス	355,900	3,096.00	1,101,866,400
三菱HCキャピタル	260,200	1,039.00	270,347,800
ジャフコ グループ	17,400	1,743.00	30,328,200
トモニホールディングス	55,300	403.00	22,285,900
大和証券グループ本社	452,300	1,084.50	490,519,350
野村ホールディングス	981,900	836.30	821,162,970
岡三証券グループ	51,300	731.00	37,500,300
丸三証券	19,400	966.00	18,740,400
東洋証券	19,200	368.00	7,065,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	69,300	570.00	39,501,000
光世証券	1,100	652.00	717,200
水戸証券	17,200	474.00	8,152,800
いちよし証券	10,900	792.00	8,632,800
松井証券	28,700	847.00	24,308,900
SOMPOホールディングス	87,800	8,718.00	765,440,400
日本取引所グループ	152,300	3,797.00	578,283,100
マネックスグループ	57,200	868.00	49,649,600
極東証券	8,000	1,016.00	8,128,000
岩井コスモホールディングス	6,700	2,187.00	14,652,900
アイザワ証券グループ	8,400	1,118.00	9,391,200
フィデアホールディングス	6,000	1,590.00	9,540,000
池田泉州ホールディングス	81,000	364.00	29,484,000
アニコム ホールディングス	19,800	586.00	11,602,800
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	130,700	7,249.00	947,444,300
スパークス・グループ	6,500	1,827.00	11,875,500
第一生命ホールディングス	285,300	3,311.00	944,628,300
東京海上ホールディングス	577,200	4,321.00	2,494,081,200
イー・ギャランティ	9,500	1,938.00	18,411,000
NECキャピタルソリューション	2,900	3,710.00	10,759,000
T&Dホールディングス	156,800	2,470.50	387,374,400
アドバンスクリエイト	3,300	1,024.00	3,379,200
三井不動産	270,000	4,051.00	1,093,770,000
三菱地所	381,700	2,120.00	809,204,000
平和不動産	9,500	3,980.00	37,810,000
東京建物	51,000	2,178.00	111,078,000
京阪神ビルディング	10,900	1,585.00	17,276,500
住友不動産	84,400	4,614.00	389,421,600
テーオーシー	10,400	678.00	7,051,200
東京楽天地	1,000	6,700.00	6,700,000
レオパレス21	58,400	419.00	24,469,600
スターツコーポレーション	8,400	2,983.00	25,057,200
フジ住宅	8,900	714.00	6,354,600
空港施設	10,400	601.00	6,250,400

ゴールドクレスト	4,800	2,226.00	10,684,800
リログループ	30,500	1,308.50	39,909,250
エスリード	2,700	3,340.00	9,018,000
日神グループホールディングス	12,200	508.00	6,197,600
日本エスコン	10,900	987.00	10,758,300
MIRARTHホールディングス	26,800	489.00	13,105,200
AVANTIA	3,500	893.00	3,125,500
イオンモール	30,300	1,828.00	55,388,400
ファースト住建	1,500	1,104.00	1,656,000
カチタス	15,700	1,959.00	30,756,300
東祥	7,000	795.00	5,565,000
トーセイ	9,700	2,034.00	19,729,800
サンフロンティア不動産	8,600	1,698.00	14,602,800
FJネクストホールディングス	6,100	1,170.00	7,137,000
グランディハウス	9,700	642.00	6,227,400
東武鉄道	65,100	3,823.00	248,877,300
相鉄ホールディングス	21,200	2,717.50	57,611,000
東急	166,300	1,764.50	293,436,350
京浜急行電鉄	73,400	1,299.50	95,383,300
小田急電鉄	98,000	2,084.50	204,281,000
京王電鉄	28,500	4,190.00	119,415,000
京成電鉄	38,200	7,369.00	281,495,800
富士急行	7,300	3,855.00	28,141,500
東日本旅客鉄道	108,900	8,955.00	975,199,500
西日本旅客鉄道	70,300	6,210.00	436,563,000
東海旅客鉄道	228,400	3,775.00	862,210,000
西武ホールディングス	71,700	2,162.00	155,015,400
鴻池運輸	10,100	1,797.00	18,149,700
西日本鉄道	15,800	2,393.50	37,817,300
ハマキョウレックス	5,100	3,805.00	19,405,500
サカイ引越センター	6,600	2,594.00	17,120,400
近鉄グループホールディングス	59,200	4,458.00	263,913,600
阪急阪神ホールディングス	78,900	4,296.00	338,954,400
南海電気鉄道	26,400	2,900.00	76,560,000
京阪ホールディングス	32,600	3,442.00	112,209,200
神戸電鉄	2,200	2,825.00	6,215,000
名古屋鉄道	61,100	2,120.50	129,562,550
山陽電気鉄道	4,500	2,113.00	9,508,500
アルプス物流	4,700	1,923.00	9,038,100
トランコム	1,700	6,360.00	10,812,000
ヤマトホールディングス	75,800	2,390.00	181,162,000
山九	15,100	5,316.00	80,271,600
日新	4,500	2,858.00	12,861,000
丸全昭和運輸	3,700	4,515.00	16,705,500
センコーグループホールディングス	31,300	1,067.00	33,397,100
トナミホールディングス	1,000	4,365.00	4,365,000
ニッコンホールディングス	18,900	3,178.00	60,064,200
福山通運	6,800	4,205.00	28,594,000
セイノーホールディングス	33,300	2,255.50	75,108,150
神奈川中央交通	2,100	3,020.00	6,342,000

AZ-COM丸和ホールディングス	15,100	1,421.00	21,457,100
C&Fロジホールディングス	5,700	1,780.00	10,146,000
日本郵船	169,700	4,845.00	822,196,500
商船三井	128,500	5,351.00	687,603,500
川崎汽船	47,500	7,167.00	340,432,500
NSユニテッド海運	3,200	5,220.00	16,704,000
明海グループ	2,500	795.00	1,987,500
飯野海運	21,700	1,337.00	29,012,900
共栄タンカー	600	1,095.00	657,000
九州旅客鉄道	41,800	3,370.00	140,866,000
SGホールディングス	99,400	1,924.50	191,295,300
NIPPON EXPRESSホールディングス	20,100	8,137.00	163,553,700
ID&Eホールディングス	3,700	3,765.00	13,930,500
日本航空	145,400	2,750.50	399,922,700
ANAホールディングス	161,100	3,226.00	519,708,600
パスコ	400	1,856.00	742,400
TREホールディングス	11,700	1,213.00	14,192,100
人・夢・技術グループ	3,300	1,737.00	5,732,100
西本Wismettacホールディングス	1,600	6,690.00	10,704,000
Genky Drug Stores	2,700	6,220.00	16,794,000
KPPグループホールディングス	16,200	627.00	10,157,400
ナルミヤ・インターナショナル	3,300	1,268.00	4,184,400
ギフトホールディングス	2,700	2,861.00	7,724,700
三菱倉庫	14,500	4,597.00	66,656,500
三井倉庫ホールディングス	5,500	4,565.00	25,107,500
住友倉庫	16,000	2,578.00	41,248,000
澁澤倉庫	2,700	3,045.00	8,221,500
ヤマタネ	2,800	2,558.00	7,162,400
乾汽船	6,900	1,031.00	7,113,900
日本トランスシティ	11,900	620.00	7,378,000
中央倉庫	2,300	1,146.00	2,635,800
安田倉庫	5,200	1,194.00	6,208,800
大栄環境	11,100	2,675.00	29,692,500
日本管財ホールディングス	6,400	2,579.00	16,505,600
上組	27,300	3,427.00	93,557,100
キューソー流通システム	6,700	924.00	6,190,800
エーアイテイー	3,700	1,857.00	6,870,900
内外トランスライン	2,600	2,394.00	6,224,400
日本コンセプト	3,700	1,878.00	6,948,600
TBSホールディングス	29,900	4,253.00	127,164,700
日本テレビホールディングス	52,600	2,222.00	116,877,200
朝日放送グループホールディングス	9,500	685.00	6,507,500
テレビ朝日ホールディングス	14,400	2,087.00	30,052,800
スカパーJSATホールディングス	46,200	883.00	40,794,600
テレビ東京ホールディングス	4,300	3,030.00	13,029,000
ビジョン	9,000	1,119.00	10,071,000
USEN-NEXT HOLDINGS	6,700	4,450.00	29,815,000

日本通信	58,500	213.00	12,460,500
日本電信電話	17,686,900	182.00	3,219,015,800
KDDI	459,500	4,644.00	2,133,918,000
ソフトバンク	956,900	1,973.00	1,887,963,700
光通信	6,000	25,575.00	153,450,000
エムティーアイ	10,600	734.00	7,780,400
GMOインターネットグループ	22,000	2,573.00	56,606,000
KADOKAWA	31,400	3,200.00	100,480,000
学研ホールディングス	9,900	980.00	9,702,000
ゼンリン	10,200	849.00	8,659,800
東京電力ホールディングス	534,400	779.30	416,457,920
中部電力	218,500	1,895.00	414,057,500
関西電力	228,900	1,950.00	446,355,000
中国電力	103,000	995.20	102,505,600
北陸電力	60,600	718.40	43,535,040
東北電力	156,100	979.00	152,821,900
四国電力	55,200	1,046.00	57,739,200
九州電力	136,700	1,141.50	156,043,050
北海道電力	57,300	643.20	36,855,360
沖縄電力	15,100	1,080.00	16,308,000
電源開発	48,700	2,474.00	120,483,800
エフオン	14,100	408.00	5,752,800
イーレックス	10,500	751.00	7,885,500
レノバ	15,800	1,203.00	19,007,400
東京瓦斯	125,300	3,276.00	410,482,800
大阪瓦斯	120,100	3,041.00	365,224,100
東邦瓦斯	25,700	2,910.00	74,787,000
北海道瓦斯	3,500	2,266.00	7,931,000
広島ガス	1,800	383.00	689,400
西部ガスホールディングス	6,200	1,864.00	11,556,800
静岡ガス	11,800	890.00	10,502,000
メタウォーター	7,100	2,223.00	15,783,300
M&A総研ホールディングス	2,900	6,700.00	19,430,000
アイネット	3,600	2,109.00	7,592,400
松竹	3,100	10,070.00	31,217,000
東宝	33,100	4,931.00	163,216,100
エイチ・アイ・エス	17,700	1,670.00	29,559,000
東映	2,000	20,080.00	40,160,000
ラックランド	2,800	2,580.00	7,224,000
NTTデータグループ	155,500	2,341.50	364,103,250
共立メンテナンス	9,600	6,344.00	60,902,400
イチネンホールディングス	6,500	1,638.00	10,647,000
建設技術研究所	3,100	6,040.00	18,724,000
スペース	6,700	990.00	6,633,000
アインホールディングス	8,600	4,725.00	40,635,000
燦ホールディングス	5,700	1,024.00	5,836,800
ピー・シー・エー	5,300	1,631.00	8,644,300
ビジネスブレイン太田昭和	2,900	2,260.00	6,554,000
ナガワ	1,900	7,100.00	13,490,000
東京都競馬	5,100	4,130.00	21,063,000

カナモト	9,400	2,942.00	27,654,800
D T S	12,500	3,835.00	47,937,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	27,200	6,750.00	183,600,000
シーイーシー	7,500	1,809.00	13,567,500
カプコン	53,200	5,978.00	318,029,600
ニシオホールディングス	5,700	3,850.00	21,945,000
アイ・エス・ビー	4,000	1,378.00	5,512,000
日本空港ビルデング	20,700	5,832.00	120,722,400
トランス・コスモス	7,600	2,995.00	22,762,000
乃村工藝社	26,600	883.00	23,487,800
ジャステック	4,700	1,360.00	6,392,000
S C S K	41,600	2,682.50	111,592,000
藤田観光	2,400	6,740.00	16,176,000
トーカイ	5,400	2,122.00	11,458,800
セコム	62,100	10,950.00	679,995,000
N S W	2,600	2,945.00	7,657,000
セントラル警備保障	3,300	2,611.00	8,616,300
アイネス	4,600	1,487.00	6,840,200
丹青社	11,800	805.00	9,499,000
メイテックグループホールディングス	21,900	3,043.00	66,641,700
T K C	9,400	3,670.00	34,498,000
富士ソフト	12,000	6,020.00	72,240,000
応用地質	5,700	2,366.00	13,486,200
船井総研ホールディングス	12,700	2,612.00	33,172,400
N S D	21,200	2,743.00	58,151,600
コナミグループ	22,300	9,645.00	215,083,500
学究社	3,100	2,114.00	6,553,400
ベネッセホールディングス	20,500	2,595.50	53,207,750
イオンディライト	6,500	3,530.00	22,945,000
ナック	12,000	527.00	6,324,000
福井コンピュータホールディングス	3,700	2,615.00	9,675,500
ダイセキ	12,400	4,020.00	49,848,000
ステップ	1,000	2,050.00	2,050,000
泉州電業	2,900	3,780.00	10,962,000
元気寿司	3,500	3,510.00	12,285,000
トラスコ中山	13,200	2,322.00	30,650,400
ヤマダホールディングス	192,900	432.10	83,352,090
オートバックスセブン	21,800	1,663.00	36,253,400
モリト	4,500	1,409.00	6,340,500
アー克蘭ズ	18,700	1,663.00	31,098,100
ニトリホールディングス	22,800	21,720.00	495,216,000
愛眼	1,400	181.00	253,400
ケーユーホールディングス	5,400	1,176.00	6,350,400
吉野家ホールディングス	23,100	3,191.00	73,712,100
加藤産業	7,800	4,735.00	36,933,000
イノテック	3,900	1,863.00	7,265,700
イエローハット	10,000	1,900.00	19,000,000
松屋フーズホールディングス	3,000	5,590.00	16,770,000
J B C Cホールディングス	3,900	3,615.00	14,098,500

J Kホールディングス	5,900	1,030.00	6,077,000
サガミホールディングス	9,400	1,501.00	14,109,400
日伝	4,200	2,726.00	11,449,200
関西フードマーケット	4,400	1,605.00	7,062,000
ミロク情報サービス	5,400	1,926.00	10,400,400
北沢産業	10,100	329.00	3,322,900
杉本商事	3,000	2,255.00	6,765,000
因幡電機産業	16,300	3,520.00	57,376,000
王将フードサービス	4,600	7,740.00	35,604,000
ミニストップ	4,600	1,631.00	7,502,600
アークス	11,500	3,045.00	35,017,500
バローホールディングス	12,000	2,436.00	29,232,000
東テク	2,100	6,930.00	14,553,000
ミスミグループ本社	94,700	2,083.00	197,260,100
ベルク	3,100	6,560.00	20,336,000
大 庄	4,700	1,302.00	6,119,400
ファーストリテイリング	28,200	41,950.00	1,182,990,000
ソフトバンクグループ	293,300	8,370.00	2,454,921,000
スズケン	23,900	4,904.00	117,205,600
サンドラッグ	21,200	4,445.00	94,234,000
サックスパー ホールディングス	7,600	861.00	6,543,600
ジェコス	5,800	1,174.00	6,809,200
ヤマザワ	3,400	1,261.00	4,287,400
ベルーナ	15,100	615.00	9,286,500
合計	91,102,700		220,995,693,370

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年2月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	6,082,448
コール・ローン	599,829,608
国債証券	73,432,746,970
未収利息	207,220,060
前払費用	42,188,386
流動資産合計	74,288,067,472
資産合計	74,288,067,472
負債の部	
流動負債	
未払解約金	162,901,046
その他未払費用	613
流動負債合計	162,901,659
負債合計	162,901,659
純資産の部	
元本等	
元本	57,048,145,189
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	17,077,020,624
元本等合計	74,125,165,813
純資産合計	74,125,165,813
負債純資産合計	74,288,067,472

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年2月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	46,476,547,724円
同期中追加設定元本額	19,587,190,688円
同期中一部解約元本額	9,015,593,223円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券インデックスSA (適格機関投資家限定)	1,664,714,865円
DCニッセイ国内債券インデックス	7,800,054,586円
ニッセイ日本バランス (成長型) SA (適格機関投資家限定)	3,818,373円
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	10,380,040,410円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	16,970,093,713円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	5,419,511,545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)	14,828,175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)	8,466,885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)	12,135,646円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	6,174,760,059円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	8,579,417,471円
ニッセイ日経225高値参照型アロケーションファンド	19,402,055円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド (安定型)	552,920円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド (積極型)	348,486円
計	57,048,145,189円
2. 受益権の総数	57,048,145,189口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年2月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年2月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	59,472,430	
合計	59,472,430	

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年2月21日現在
1口当たり純資産額	1.2993円
(1万口当たり純資産額)	(12,993円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年2月21日現在

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第450回 利付国債(2年)	12,000,000	11,991,000	
	第452回 利付国債(2年)	4,353,000,000	4,347,036,390	

第143回 利付国債（5年）	10,000,000	10,009,100	
第151回 利付国債（5年）	119,000,000	118,435,940	
第158回 利付国債（5年）	4,552,000,000	4,522,639,600	
第4回 利付国債（40年）	2,248,000,000	2,512,252,400	
第8回 利付国債（40年）	358,000,000	331,776,500	
第12回 利付国債（40年）	1,344,000,000	908,772,480	
第16回 利付国債（40年）	72,000,000	61,964,640	
第338回 利付国債（10年）	592,000,000	594,439,040	
第340回 利付国債（10年）	2,959,000,000	2,973,410,330	
第342回 利付国債（10年）	1,179,000,000	1,178,139,330	
第344回 利付国債（10年）	1,523,000,000	1,521,233,320	
第346回 利付国債（10年）	2,396,000,000	2,391,591,360	
第350回 利付国債（10年）	5,562,000,000	5,526,125,100	
第354回 利付国債（10年）	1,271,000,000	1,254,540,550	
第358回 利付国債（10年）	5,637,000,000	5,541,678,330	
第362回 利付国債（10年）	117,000,000	114,076,170	
第366回 利付国債（10年）	3,703,000,000	3,598,649,460	
第14回 利付国債（30年）	121,000,000	140,483,420	
第30回 利付国債（30年）	882,000,000	1,021,470,660	
第34回 利付国債（30年）	1,127,000,000	1,281,229,950	
第38回 利付国債（30年）	260,000,000	277,113,200	
第46回 利付国債（30年）	3,678,000,000	3,678,000,000	
第70回 利付国債（30年）	3,548,000,000	2,806,929,240	
第90回 利付国債（20年）	3,423,000,000	3,603,460,560	
第94回 利付国債（20年）	10,000,000	10,594,500	
第117回 利付国債（20年）	1,435,000,000	1,582,876,750	
第125回 利付国債（20年）	124,000,000	139,013,920	

	年)			
	第134回 利付国債(20年)	5,034,000,000	5,526,677,580	
	第136回 利付国債(20年)	18,000,000	19,475,640	
	第143回 利付国債(20年)	1,166,000,000	1,263,582,540	
	第148回 利付国債(20年)	3,859,000,000	4,143,562,660	
	第152回 利付国債(20年)	1,561,000,000	1,623,674,150	
	第160回 利付国債(20年)	5,051,000,000	4,873,002,760	
	第176回 利付国債(20年)	4,472,000,000	3,922,838,400	
国債証券	合計	73,776,000,000	73,432,746,970	
合計			73,432,746,970	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年2月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,372,405,258
金銭信託	172,769,726
コール・ローン	17,037,941,647
株式	872,487,004,422
投資証券	16,736,453,996
派生商品評価勘定	1,334,947,350
未収入金	5,444,252
未収配当金	795,761,422
差入委託証拠金	12,426,253,567
流動資産合計	923,368,981,640
資産合計	923,368,981,640
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,438,163
未払金	19,937
未払解約金	843,348,648
その他未払費用	11,266
流動負債合計	869,818,014
負債合計	869,818,014
純資産の部	
元本等	
元本	223,769,394,697
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	698,729,768,929
元本等合計	922,499,163,626
純資産合計	922,499,163,626
負債純資産合計	923,368,981,640

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年2月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	200,521,891,495円
同期中追加設定元本額	51,599,688,156円
同期中一部解約元本額	28,352,184,954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）	738,730,087円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,622,951,133円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,470,727,449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）	2,216,155,962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）	861,399円
ニッセイインデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	1,540,217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）	5,440,953円
ニッセイ外国株式インデックスファンドII（適格機関投資家限定）	328,261,431円

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	157,574,230,168円
DCニッセイ外国株式インデックス	41,196,319,317円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	2,746,711,226円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	410,687,695円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	166,749,256円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	463,188,971円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	600,697,351円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	9,986,203円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)	88,365,123円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,804,721円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	10,084,149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)	3,613,514円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	20,142,736円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	331,143,926円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	209,595,491円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	392,167,814円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	140,137,185円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適 格機関投資家限定)	161,214,614円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バス ケット)	258,752,912円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適 格機関投資家限定)	162,383,215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)	159,072,340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)	158,413,004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)	141,521,435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)	30,763,683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)	7,700,466,481円
FWニッセイ先進国株インデックス	40,109,475円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	80,719,959円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンドII2023-05 (適格機関投資家限定)	100,252,286円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	19,431,816円
計	223,769,394,697円
2. 受益権の総数	223,769,394,697口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年2月21日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	
株式	75,840,567,437	
投資証券	1,045,413,436	
合計	76,885,980,873	

(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 (2023年11月21日から2024年2月21日まで) に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年2月21日現在			
	契約額等 (円)	うち		評価損益 (円)
1年超		時価 (円)		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	15,146,185,868	—	15,243,778,209	97,592,341
イギリス・ポンド	10,694,356,604	—	10,755,989,329	61,632,725
ユーロ	1,564,252,732	—	1,574,730,443	10,477,711
ユーロ	2,887,576,532	—	2,913,058,437	25,481,905
合計	15,146,185,868	—	15,243,778,209	97,592,341

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2024年2月21日現在			
	契約額等 (円)	うち		評価損益 (円)
1年超		時価 (円)		
市場取引 先物取引 買建				
買建	30,491,388,128	—	31,702,304,973	1,210,916,845
合計	30,491,388,128	—	31,702,304,973	1,210,916,845

(注) 株価指数先物取引

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年2月21日現在	
1口当たり純資産額	4,1225円
(1万口当たり純資産額)	(41,225円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年2月21日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	3M CO	56,060	91.820	5,147,429.20	
	ABBOTT LABORATORIES	176,180	116.640	20,549,635.20	
	ABBVIE INC	179,201	175.750	31,494,575.75	
	ACCENTURE PLC	63,716	362.950	23,125,722.20	
	ADOBE INC	46,219	541.910	25,046,538.29	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	164,024	165.690	27,177,136.56	
	AECOM	13,377	87.850	1,175,169.45	
	AERCAP HOLDINGS NV	20,290	77.940	1,581,402.60	
	AES CORP	68,024	16.420	1,116,954.08	
	AFLAC INC	57,276	78.780	4,512,203.28	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,717	134.140	3,986,238.38	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	22,558	228.090	5,145,254.22	
	AIRBNB INC-CLASS A	43,282	148.150	6,412,228.30	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	15,388	108.360	1,667,443.68	
	ALBEMARLE CORP	11,916	114.820	1,368,195.12	
	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	35,030	21.280	745,438.40	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	7,382	313.530	2,314,478.46	
	ALLEGION PLC	8,911	132.060	1,176,786.66	
	ALLIANT ENERGY CORP	25,623	48.250	1,236,309.75	
	ALLSTATE CORP	26,554	159.720	4,241,204.88	
	ALLY FINANCIAL INC	27,543	36.690	1,010,552.67	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,699	149.690	1,900,913.31	
	ALPHABET INC-CL A	601,929	141.120	84,944,220.48	
	ALPHABET INC-CL C	530,388	142.200	75,421,173.60	
	ALTRIA GROUP INC	180,212	40.250	7,253,533.00	
	AMAZON.COM INC	942,706	167.080	157,507,318.48	
	AMCOR PLC	147,058	9.120	1,341,168.96	
	AMEREN CORPORATION	26,655	69.870	1,862,384.85	
	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	52,292	80.880	4,229,376.96	
	AMERICAN EXPRESS CO	63,555	212.490	13,504,801.95	
AMERICAN FINANCIAL GROUP	7,329	123.590	905,791.11		

INC				
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	72,214	68.130	4,919,939.82	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	19,762	121.160	2,394,363.92	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,412	396.780	4,131,273.36	
AMETEK INC	23,424	174.810	4,094,749.44	
AMGEN INC	54,304	283.510	15,395,727.04	
AMPHENOL CORP-CL A	60,563	104.610	6,335,495.43	
ANALOG DEVICES INC	50,601	189.400	9,583,829.40	
ANSYS INC	8,810	332.140	2,926,153.40	
AON PLC	20,593	315.500	6,497,091.50	
APA CORP	31,087	30.980	963,075.26	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	40,299	109.600	4,416,770.40	
APPLE INC	1,587,177	181.560	288,167,856.12	
APPLIED MATERIALS INC	84,915	189.140	16,060,823.10	
APTIV PLC	28,721	77.760	2,233,344.96	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	37,831	85.370	3,229,632.47	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	54,435	53.400	2,906,829.00	
ARES MANAGEMENT CORP - A	16,577	132.610	2,198,275.97	
ARISTA NETWORKS INC	26,718	259.610	6,936,259.98	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,884	241.740	5,290,238.16	
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,946	175.360	516,610.56	
ASSURANT INC	5,376	174.630	938,810.88	
AT&T INC	727,029	16.910	12,294,060.39	
ATLISSIAN CORP-CL A	15,752	204.780	3,225,694.56	
ATMOS ENERGY CORP	15,066	113.690	1,712,853.54	
AUTODESK INC	21,697	255.260	5,538,376.22	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	41,831	252.940	10,580,733.14	
AUTOZONE INC	1,813	2,696.150	4,888,119.95	
AVANTOR INC	68,626	24.050	1,650,455.30	
AVERY DENNISON CORP	8,183	209.710	1,716,056.93	
AXON ENTERPRISE INC	7,214	267.700	1,931,187.80	
BAKER HUGHES COMPANY	102,495	29.050	2,977,479.75	
BALL CORP	31,987	61.880	1,979,355.56	
BANK OF AMERICA CORP	726,022	33.960	24,655,707.12	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	79,017	54.870	4,335,662.79	
BATH & BODY WORKS INC	21,922	47.360	1,038,225.92	
BAXTER INTERNATIONAL INC	51,421	41.770	2,147,855.17	
BECTON DICKINSON & CO	29,450	240.660	7,087,437.00	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	21,580	52.330	1,129,281.40	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	132,789	407.150	54,065,041.35	
BEST BUY CO INC	19,883	73.270	1,456,827.41	
BILL HOLDINGS, INC.	9,745	63.050	614,422.25	

BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,196	343.760	754,896.96
BIO-TECHNE CORP	16,083	70.330	1,131,117.39
BIOGEN INC	14,698	219.210	3,221,948.58
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	19,111	88.670	1,694,572.37
BLACKROCK INC	15,157	798.110	12,096,953.27
BLACKSTONE INC	72,059	126.330	9,103,213.47
BLOCK INC	55,791	65.730	3,667,142.43
BOEING CO	58,174	203.370	11,830,846.38
BOOKING HOLDINGS INC	3,624	3,700.860	13,411,916.64
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	13,299	145.100	1,929,684.90
BORGWARNER INC	23,863	30.160	719,708.08
BOSTON SCIENTIFIC CORP	148,622	66.220	9,841,748.84
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	212,099	49.860	10,575,256.14
BROADCOM INC	45,052	1,226.550	55,258,530.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	11,991	195.160	2,340,163.56
BROWN & BROWN INC	24,467	82.700	2,023,420.90
BROWN-FORMAN CORP -CL B	31,513	58.510	1,843,825.63
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	12,689	182.900	2,320,818.10
BUNGE GLOBAL SA	15,288	91.670	1,401,450.96
BURLINGTON STORES INC	6,584	193.730	1,275,518.32
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,811	71.640	846,140.04
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	27,591	292.070	8,058,503.37
CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,861	41.650	910,510.65
CAMPBELL SOUP CO	19,675	42.160	829,498.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,716	137.390	5,319,191.24
CARDINAL HEALTH INC	25,004	105.370	2,634,671.48
CARLISLE COS INC	5,067	346.920	1,757,843.64
CARLYLE GROUP INC/THE	21,920	44.260	970,179.20
CARMAX INC	16,104	70.660	1,137,908.64
CARNIVAL CORP	102,267	14.760	1,509,460.92
CARRIER GLOBAL CORP	85,040	53.430	4,543,687.20
CATALENT INC	18,309	57.980	1,061,555.82
CATERPILLAR INC	51,789	313.740	16,248,280.86
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,701	191.720	2,051,595.72
CBRE GROUP INC	31,458	90.970	2,861,734.26
CDW CORP/DE	13,608	241.790	3,290,278.32
CELANESE CORP-SERIES A	10,491	149.370	1,567,040.67
CELSIUS HOLDINGS INC	15,231	63.560	968,082.36
CENCORA, INC.	17,327	232.360	4,026,101.72
CENTENE CORP	54,981	79.290	4,359,443.49
CENTERPOINT ENERGY INC	64,006	27.790	1,778,726.74
CF INDUSTRIES HOLDINGS	19,576	77.190	1,511,071.44

INC				
CHARLES RIVER LABORATORIES	5,209	238.940	1,244,638.46	
CHARLES SCHWAB CORP	152,759	63.580	9,712,417.22	
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	9,874	295.130	2,914,113.62	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,485	160.100	1,518,548.50	
CHENIERE ENERGY INC	24,414	161.100	3,933,095.40	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	11,398	77.650	885,054.70	
CHEVRON CORP	184,199	154.000	28,366,646.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,801	2,580.200	7,227,140.20	
CHUBB LTD	41,691	250.510	10,444,012.41	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,984	98.050	2,449,681.20	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15,923	110.940	1,766,497.62	
CINTAS CORP	9,305	614.640	5,719,225.20	
CISCO SYSTEMS INC	411,218	48.280	19,853,605.04	
CITIGROUP INC	195,473	55.420	10,833,113.66	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	47,925	31.370	1,503,407.25	
CLEVELAND-CLIFFS INC	51,641	19.580	1,011,130.78	
CLOROX CO	12,596	152.240	1,917,615.04	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	28,216	97.990	2,764,885.84	
CME GROUP INC	36,521	210.990	7,705,565.79	
CMS ENERGY CORP	29,580	57.030	1,686,947.40	
CNH INDUSTRIAL NV	101,405	11.940	1,210,775.70	
COCA-COLA CO	417,105	60.700	25,318,273.50	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	20,924	68.340	1,429,946.16	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	51,252	76.740	3,933,078.48	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	17,356	173.300	3,007,794.80	
COLGATE-PALMOLIVE CO	79,749	84.610	6,747,562.89	
COMCAST CORP	417,819	41.660	17,406,339.54	
CONAGRA BRANDS INC	48,579	28.480	1,383,529.92	
CONFLUENT INC-CLASS A	18,410	32.720	602,375.20	
CONOCOPHILLIPS	121,560	109.540	13,315,682.40	
CONSOLIDATED EDISON INC	35,003	87.580	3,065,562.74	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,779	245.260	4,115,217.54	
CONSTELLATION ENERGY	32,640	131.800	4,301,952.00	
COOPER COS INC/THE	20,096	95.700	1,923,187.20	
COPART INC	87,478	48.520	4,244,432.56	
CORNING INC	82,312	32.290	2,657,854.48	
CORTEVA INC	72,068	54.360	3,917,616.48	
COSTAR GROUP INC	41,464	81.240	3,368,535.36	
COSTCO WHOLESALE CORP	44,947	725.690	32,617,588.43	
COTERRA ENERGY INC	76,631	24.630	1,887,421.53	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	22,949	323.710	7,428,820.79
CROWN HOLDINGS INC	12,237	73.140	895,014.18
CSX CORP	203,625	36.860	7,505,617.50
CUMMINS INC	14,384	261.840	3,766,306.56
CVS HEALTH CORP	130,406	76.310	9,951,281.86
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,237	250.000	1,059,250.00
DANAHER CORP	71,215	247.770	17,644,940.55
DARDEN RESTAURANTS INC	12,221	165.310	2,020,253.51
DARLING INTERNATIONAL INC	16,199	42.180	683,273.82
DATADOG INC - CLASS A	25,809	127.660	3,294,776.94
DAVITA INC	5,556	123.000	683,388.00
DAYFORCE, INC.	15,011	71.540	1,073,886.94
DECKERS OUTDOOR CORP	2,653	860.680	2,283,384.04
DEERE & CO	27,776	357.380	9,926,586.88
DELL TECHNOLOGIES -C	25,985	82.460	2,142,723.10
DELTA AIR LINES INC	16,279	40.600	660,927.40
DEVON ENERGY CORPORATION	65,039	43.410	2,823,342.99
DEXCOM INC	39,381	117.870	4,641,838.47
DIAMONDBACK ENERGY INC	17,227	178.060	3,067,439.62
DICK'S SPORTING GOODS INC	6,238	166.450	1,038,315.10
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	25,371	124.420	3,156,659.82
DOCUSIGN INC	20,621	49.980	1,030,637.58
DOLLAR GENERAL CORP	22,286	142.490	3,175,532.14
DOLLAR TREE INC	21,218	146.290	3,103,981.22
DOMINION ENERGY INC	84,976	45.350	3,853,661.60
DOMINO'S PIZZA INC	3,541	417.150	1,477,128.15
DOORDASH INC - A	26,001	115.480	3,002,595.48
DOVER CORP	14,198	160.080	2,272,815.84
DOW INC	71,397	54.710	3,906,129.87
DR HORTON INC	30,902	143.470	4,433,509.94
DRAFTKINGS INC	42,388	41.320	1,751,472.16
DROPBOX INC-CLASS A	26,243	24.230	635,867.89
DTE ENERGY COMPANY	20,927	107.640	2,252,582.28
DUKE ENERGY CORP	78,243	91.940	7,193,661.42
DUPONT DE NEMOURS INC	46,572	67.970	3,165,498.84
DYNATRACE INC	25,297	50.260	1,271,427.22
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,038	84.510	1,017,331.38
EATON CORP PLC	40,508	276.090	11,183,853.72
EBAY INC	53,976	43.590	2,352,813.84
ECOLAB INC	26,043	216.390	5,635,444.77
EDISON INTERNATIONAL	38,899	66.540	2,588,339.46
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	61,708	86.900	5,362,425.20
ELECTRONIC ARTS INC	26,122	141.040	3,684,246.88
ELEVANCE HEALTH, INC	23,925	508.910	12,175,671.75

ELI LILLY & CO	81,917	755.660	61,901,400.22
EMERSON ELECTRIC CO	58,027	104.800	6,081,229.60
ENPHASE ENERGY INC	13,849	127.550	1,766,439.95
ENTEGRIS INC	15,243	135.520	2,065,731.36
ENTERGY CORP	21,463	100.010	2,146,514.63
EOG RESOURCES INC	59,105	113.130	6,686,548.65
EPAM SYSTEMS INC	5,886	297.810	1,752,909.66
EQT CORP	39,646	33.730	1,337,259.58
EQUIFAX INC	12,459	257.850	3,212,553.15
EQUITABLE HOLDINGS INC	35,179	34.340	1,208,046.86
ERIE INDEMNITY COMPANY- CL A	2,581	355.480	917,493.88
ESSENTIAL UTILITIES INC	25,557	36.160	924,141.12
ESTEE LAUDER COS INC	23,583	145.110	3,422,129.13
ETSY INC	12,493	75.870	947,843.91
EVEREST GROUP LTD	4,402	368.110	1,620,420.22
EVERGY INC	23,311	50.180	1,169,745.98
EVERSOURCE ENERGY	35,458	57.520	2,039,544.16
EXACT SCIENCES CORP	18,347	62.740	1,151,090.78
EXELON CORP	100,985	34.730	3,507,209.05
EXPEDIA GROUP INC	13,988	135.990	1,902,228.12
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	15,000	115.570	1,733,550.00
EXXON MOBIL CORP	406,712	102.750	41,789,658.00
F5 INC	6,015	183.140	1,101,587.10
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,871	456.860	1,768,505.06
FAIR ISAAC CORP	2,522	1,259.200	3,175,702.40
FASTENAL CO	58,000	70.080	4,064,640.00
FEDEX CORP	24,241	239.540	5,806,689.14
FERGUSON PLC	20,707	202.070	4,184,263.49
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	26,261	52.130	1,368,985.93
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	60,175	62.960	3,788,618.00
FIFTH THIRD BANCORP	69,127	33.800	2,336,492.60
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,097	1,510.060	1,656,535.82
FIRST SOLAR INC	10,305	153.250	1,579,241.25
FIRSTENERGY CORP	55,297	37.150	2,054,283.55
FISERV INC	61,890	147.930	9,155,387.70
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,128	272.910	1,945,302.48
FMC CORP	12,696	50.990	647,369.04
FORD MOTOR CO	399,137	12.250	4,889,428.25
FORTINET INC	67,768	67.910	4,602,124.88
FORTIVE CORP	35,730	83.740	2,992,030.20
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	12,869	79.320	1,020,769.08
FOX CORP - CLASS A	25,034	30.090	753,273.06

FOX CORP- CLASS B	14,715	27.630	406,575.45
FRANKLIN RESOURCES INC	30,386	27.100	823,460.60
FREEMPORT-MCMORAN INC	145,521	38.140	5,550,170.94
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,600	49.760	278,656.00
GARMIN LTD	15,556	122.750	1,909,499.00
GARTNER INC	8,003	445.000	3,561,335.00
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	41,550	86.390	3,589,504.50
GEN DIGITAL INC	58,402	21.700	1,267,323.40
GENERAL DYNAMICS CORP	23,564	268.930	6,337,066.52
GENERAL ELECTRIC CO	110,480	148.620	16,419,537.60
GENERAL MILLS INC	59,039	65.780	3,883,585.42
GENERAL MOTORS CO	139,626	39.010	5,446,810.26
GENUINE PARTS CO	14,266	144.280	2,058,298.48
GILEAD SCIENCES INC	126,499	72.040	9,112,987.96
GLOBAL PAYMENTS INC	26,395	130.800	3,452,466.00
GLOBAL-E ONLINE LTD	9,179	40.310	370,005.49
GLOBE LIFE INC	9,595	125.850	1,207,530.75
GODADDY INC - CLASS A	14,145	108.900	1,540,390.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,465	384.520	12,867,961.80
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	192,551	3.490	672,002.99
GRACO INC	17,162	88.010	1,510,427.62
HALLIBURTON CO	91,207	35.130	3,204,101.91
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	31,007	93.430	2,896,984.01
HASBRO INC	13,400	50.190	672,546.00
HCA HEALTHCARE INC	20,709	308.580	6,390,383.22
HEICO CORP	4,418	192.570	850,774.26
HEICO CORP-CLASS A	7,669	156.010	1,196,440.69
HENRY SCHEIN INC	13,250	75.640	1,002,230.00
HERSHEY CO/THE	15,222	193.570	2,946,522.54
HESS CORP	28,054	146.680	4,114,960.72
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	130,183	15.010	1,954,046.83
HF SINCLAIR CORP	14,926	59.360	886,007.36
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	26,544	197.090	5,231,556.96
HOLOGIC INC	24,858	74.580	1,853,909.64
HOME DEPOT INC	101,531	362.570	36,812,094.67
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	67,412	198.940	13,410,943.28
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	112,300	3.260	366,098.00
HORMEL FOODS CORP	30,568	29.440	899,921.92
HOWMET AEROSPACE INC	39,734	63.110	2,507,612.74
HP INC	90,267	28.630	2,584,344.21
HUBBELL INC	5,445	355.350	1,934,880.75
HUBSPOT INC	4,824	595.340	2,871,920.16
HUMANA INC	12,580	367.140	4,618,621.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	147,113	12.760	1,877,161.88

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4,049	284.800	1,153,155.20
HYATT HOTELS CORP - CL A	4,658	132.280	616,160.24
IDEX CORP	7,680	230.350	1,769,088.00
IDEXX LABORATORIES INC	8,428	551.210	4,645,597.88
ILLINOIS TOOL WORKS INC	30,704	255.600	7,847,942.40
ILLUMINA INC	16,081	140.050	2,252,144.05
INCYTE CORP	19,331	58.820	1,137,049.42
INGERSOLL-RAND INC	41,073	86.740	3,562,672.02
INSULET CORP	7,092	192.210	1,363,153.32
INTEL CORP	425,153	44.520	18,927,811.56
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	58,087	136.430	7,924,809.41
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	92,487	183.440	16,965,815.28
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	25,933	82.030	2,127,283.99
INTERNATIONAL PAPER CO	33,364	35.740	1,192,429.36
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	39,126	32.600	1,275,507.60
INTUIT INC	28,452	645.910	18,377,431.32
INTUITIVE SURGICAL INC	35,671	377.640	13,470,796.44
IQVIA HOLDINGS INC	18,593	234.760	4,364,892.68
JABIL CIRCUIT INC	13,279	137.330	1,823,605.07
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,395	173.100	1,280,074.50
JACOBS SOLUTIONS INC	12,777	145.370	1,857,392.49
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16,100	42.050	677,005.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,076	126.360	767,763.36
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,388	199.730	1,675,335.24
JM SMUCKER CO	10,783	125.880	1,357,364.04
JOHNSON & JOHNSON	244,468	157.860	38,591,718.48
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,082	56.630	3,912,113.66
JPMORGAN CHASE & CO	295,014	179.730	53,022,866.22
JUNIPER NETWORKS INC	32,653	36.900	1,204,895.70
KELLANOVA	27,846	56.130	1,562,995.98
KENVUE INC	175,033	19.060	3,336,128.98
KEURIG DR PEPPER INC	106,425	31.230	3,323,652.75
KEYCORP	95,100	14.190	1,349,469.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	18,036	154.430	2,785,299.48
KIMBERLY-CLARK CORP	34,350	119.150	4,092,802.50
KINDER MORGAN INC	203,601	17.060	3,473,433.06
KKR & CO INC -A	58,378	93.140	5,437,326.92
KLA CORPORATION	13,838	651.770	9,019,193.26
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16,354	56.800	928,907.20
KRAFT HEINZ CO/THE	87,306	35.620	3,109,839.72

KROGER CO	69,357	48.000	3,329,136.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,210	211.830	4,069,254.30	
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	8,981	215.670	1,936,932.27	
LAM RESEARCH CORP	13,423	900.440	12,086,606.12	
LAMB WESTON HOLDING INC	14,716	102.160	1,503,386.56	
LAS VEGAS SANDS CORP	34,914	53.060	1,852,536.84	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	14,001	72.170	1,010,452.17	
LEAR CORP	5,967	136.110	812,168.37	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,244	123.500	1,635,634.00	
LENNAR CORP-CL A	25,384	150.990	3,832,730.16	
LENOX INTERNATIONAL INC	3,242	448.860	1,455,204.12	
LIBERTY BROADBAND-C	12,140	60.900	739,326.00	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	23,924	19.490	466,278.76	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	16,618	29.870	496,379.66	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	20,016	67.350	1,348,077.60	
LINDE PLC	49,538	435.960	21,596,586.48	
LIVE NATION INC	16,356	92.050	1,505,569.80	
LKQ CORP	27,165	49.860	1,354,446.90	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,671	424.270	9,618,625.17	
LOEWS CORP	19,370	73.870	1,430,861.90	
LOWE'S COS INC	58,588	225.510	13,212,179.88	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	7,680	255.860	1,965,004.80	
LUCID GROUP INC	92,996	3.680	342,225.28	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,711	444.600	5,206,710.60	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	26,326	96.270	2,534,404.02	
M&T BANK CORP	16,842	137.360	2,313,417.12	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	6,255	242.880	1,519,214.40	
MARATHON OIL CORP	61,312	23.170	1,420,599.04	
MARATHON PETROLEUM CORP	40,554	164.290	6,662,616.66	
MARKEL GROUP INC	1,278	1,453.130	1,857,100.14	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,824	213.980	818,259.52	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	25,732	242.940	6,251,332.08	
MARSH & MCLENNAN COS INC	50,149	200.890	10,074,432.61	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,274	533.140	3,344,920.36	
MARVELL TECHNOLOGY INC	87,601	65.040	5,697,569.04	
MASCO CORP	22,816	73.970	1,687,699.52	
MASTERCARD INC-CLASS A	85,417	451.750	38,587,129.75	
MATCH GROUP INC	28,223	36.150	1,020,261.45	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	25,525	68.060	1,737,231.50	
MCDONALD'S CORP	73,992	292.650	21,653,758.80	
MCKESSON CORP	13,693	506.740	6,938,790.82	
MEDTRONIC PLC	135,086	85.850	11,597,133.10	

MERCADOLIBRE INC	4,577	1,740.010	7,964,025.77	
MERCK & CO INC	257,618	127.370	32,812,804.66	
META PLATFORMS INC-A	225,631	471.750	106,441,424.25	
METLIFE INC	64,898	68.620	4,453,300.76	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,221	1,184.370	2,630,485.77	
MGM MIRAGE	28,473	42.360	1,206,116.28	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	55,262	82.400	4,553,588.80	
MICRON TECHNOLOGY INC	111,472	80.710	8,996,905.12	
MICROSOFT CORP	716,549	402.790	288,618,771.71	
MODERNA INC	32,862	86.990	2,858,665.38	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,920	401.490	2,376,820.80	
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	19,266	62.720	1,208,363.52	
MONDAY.COM LTD	2,696	217.320	585,894.72	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	138,120	73.190	10,109,002.80	
MONGODB INC	7,242	444.810	3,221,314.02	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,610	712.320	3,283,795.20	
MONSTER BEVERAGE CORP	79,769	55.400	4,419,202.60	
MOODY'S CORP	16,763	375.320	6,291,489.16	
MORGAN STANLEY	126,174	85.350	10,768,950.90	
MOSAIC CO/THE	33,713	30.360	1,023,526.68	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,960	323.040	5,478,758.40	
MSCI INC	8,029	556.560	4,468,620.24	
NASDAQ INC	34,906	55.540	1,938,679.24	
NETAPP INC	21,191	85.460	1,810,982.86	
NETFLIX INC	44,989	575.130	25,874,523.57	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,914	132.650	1,315,092.10	
NEWMONT CORP	116,932	33.190	3,880,973.08	
NEWS CORP - CLASS A	38,684	26.250	1,015,455.00	
NEXTERA ENERGY INC	208,232	56.610	11,788,013.52	
NIKE INC	124,266	103.300	12,836,677.80	
NISOURCE INC	41,878	26.020	1,089,665.56	
NORDSON CORP	5,211	264.110	1,376,277.21	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,046	253.790	5,848,844.34	
NORTHERN TRUST CORP	21,016	79.610	1,673,083.76	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,593	453.910	6,623,908.63	
NRG ENERGY INC	23,246	51.700	1,201,818.20	
NUCOR CORP	25,250	183.990	4,645,747.50	
NVIDIA CORP	250,753	694.520	174,152,973.56	
NVR INC	331	7,420.020	2,456,026.62	
NXP SEMICONDUCTORS NV	26,169	231.350	6,054,198.15	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,116	1,035.630	6,333,913.08	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	67,356	59.560	4,011,723.36	
OKTA INC	15,912	83.660	1,331,197.92	
OLD DOMINION FREIGHT	9,982	419.410	4,186,550.62	

LINE				
OMNICOM GROUP	20,069	88.360	1,773,296.84	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	43,810	77.470	3,393,960.70	
ONEOK INC	59,126	71.690	4,238,742.94	
ORACLE CORP	166,858	108.450	18,095,750.10	
OTIS WORLDWIDE CORP	41,805	91.020	3,805,091.10	
OVINTIV INC	26,261	44.340	1,164,412.74	
OWENS CORNING	9,108	141.560	1,289,328.48	
PACCAR INC	53,078	107.410	5,701,107.98	
PACKAGING CORP OF AMERICA	9,123	169.610	1,547,352.03	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	187,363	23.400	4,384,294.20	
PALO ALTO NETWORKS INC	31,327	366.090	11,468,501.43	
PARAMOUNT GLOBAL	49,644	11.950	593,245.80	
PARKER HANNIFIN CORP	13,039	519.530	6,774,151.67	
PAYCHEX INC	33,016	124.490	4,110,161.84	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,529	190.050	1,050,786.45	
PAYLOCITY HOLDING CORP	4,566	176.060	803,889.96	
PAYPAL HOLDINGS INC	105,901	58.630	6,208,975.63	
PENTAIR PLC	16,750	74.610	1,249,717.50	
PEPSICO INC	139,592	168.650	23,542,190.80	
PFIZER INC	573,221	27.590	15,815,167.39	
PG&E CORP	205,674	16.630	3,420,358.62	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	157,622	89.640	14,129,236.08	
PHILLIPS 66	45,183	141.140	6,377,128.62	
PINTEREST INC- CLASS A	59,058	35.110	2,073,526.38	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	23,686	229.140	5,427,410.04	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,443	146.700	5,932,988.10	
POOL CORP	3,965	384.770	1,525,613.05	
PPG INDUSTRIES INC	23,913	141.160	3,375,559.08	
PPL CORPORATION	74,752	26.440	1,976,442.88	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,529	80.300	1,969,678.70	
PROCTER & GAMBLE CO	239,282	158.510	37,928,589.82	
PROGRESSIVE CORP	59,420	189.480	11,258,901.60	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	36,856	107.310	3,955,017.36	
PTC INC	12,060	176.890	2,133,293.40	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	50,639	60.110	3,043,910.29	
PULTE GROUP INC	22,254	103.040	2,293,052.16	
QORVO INC	9,926	111.860	1,110,322.36	
QUALCOMM INC	113,295	151.960	17,216,308.20	
QUANTA SERVICES INC	14,745	209.200	3,084,654.00	
QUEST DIAGNOSTICS	11,393	123.800	1,410,453.40	
RAYMOND JAMES FINANCIAL	20,131	116.450	2,344,254.95	

INC				
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,836	946.870	10,260,283.32	
REGIONS FINANCIAL CORP	95,227	18.420	1,754,081.34	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	5,942	317.570	1,887,000.94	
REPLIGEN CORP	5,382	199.730	1,074,946.86	
REPUBLIC SERVICES INC	22,476	180.010	4,045,904.76	
RESMED INC	14,939	180.660	2,698,879.74	
REVVITY INC	12,615	101.980	1,286,477.70	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	66,888	15.890	1,062,850.32	
ROBERT HALF INC	10,870	80.030	869,926.10	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	43,807	14.090	617,240.63	
ROBLOX CORP -CLASS A	43,158	41.410	1,787,172.78	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,662	272.620	3,179,294.44	
ROKU INC	12,602	67.250	847,484.50	
ROLLINS INC	29,551	40.950	1,210,113.45	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,832	544.110	5,893,799.52	
ROSS STORES INC	34,375	144.450	4,965,468.75	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	24,699	115.140	2,843,842.86	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	38,744	30.300	1,173,943.20	
RPM INTERNATIONAL INC	13,084	108.840	1,424,062.56	
RTX CORPORATION	147,788	90.980	13,445,752.24	
S&P GLOBAL INC	33,037	426.010	14,074,092.37	
SALESFORCE INC	98,777	286.390	28,288,745.03	
SCHLUMBERGER LTD	144,282	48.520	7,000,562.64	
SEA LTD-ADR	37,195	44.690	1,662,244.55	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,045	86.770	1,739,304.65	
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,370	66.270	753,489.90	
SEMPRA	63,883	70.660	4,513,972.78	
SERVICENOW INC	20,739	752.840	15,613,148.76	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,801	311.260	7,719,559.26	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	78,142	4.730	369,611.66	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,176	103.920	1,681,009.92	
SMITH (A. O.) CORP	12,641	79.640	1,006,729.24	
SNAP INC - A	104,193	10.950	1,140,913.35	
SNAP-ON INC	5,370	269.040	1,444,744.80	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	28,450	220.080	6,261,276.00	
SOUTHERN CO	110,705	67.040	7,421,663.20	
SOUTHWEST AIRLINES CO	15,198	33.860	514,604.28	
SPLUNK INC	16,247	155.400	2,524,783.80	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	22,650	64.010	1,449,826.50	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,558	88.460	1,376,260.68	
STARBUCKS CORP	116,285	93.460	10,867,996.10	
STATE STREET CORP	32,338	71.550	2,313,783.90	
STEEL DYNAMICS INC	15,973	122.610	1,958,449.53	

STERIS PLC	10,029	229.250	2,299,148.25
STRYKER CORP	34,699	348.070	12,077,680.93
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,834	787.570	3,807,113.38
SYNCHRONY FINANCIAL	42,398	40.480	1,716,271.04
SYNOPSIS INC	15,438	547.980	8,459,715.24
SYSCO CORP	51,205	79.070	4,048,779.35
T ROWE PRICE GROUP INC	22,770	109.410	2,491,265.70
T-MOBILE US INC	54,009	162.050	8,752,158.45
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	17,241	151.940	2,619,597.54
TARGA RESOURCES CORP	21,540	96.360	2,075,594.40
TARGET CORP	46,870	149.890	7,025,344.30
TE CONNECTIVITY LTD	31,876	140.220	4,469,652.72
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,782	430.760	2,059,894.32
TELEFLEX INC	4,768	250.950	1,196,529.60
TERADYNE INC	15,632	100.170	1,565,857.44
TESLA, INC.	290,003	193.760	56,190,981.28
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	113,699	13.070	1,486,045.93
TEXAS INSTRUMENTS INC	92,191	162.740	15,003,163.34
TEXAS PACIFIC LAND CORP	624	1,490.980	930,371.52
TEXTRON INC	20,096	84.580	1,699,719.68
THE CIGNA GROUP	30,047	341.350	10,256,543.45
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	39,184	548.140	21,478,317.76
TJX COS INC	116,144	97.360	11,307,779.84
TOAST INC-CLASS A	33,407	21.780	727,604.46
TORO CO	10,553	93.750	989,343.75
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11,048	236.420	2,611,968.16
TRADE DESK INC/THE - CLASS A	45,307	82.560	3,740,545.92
TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A	11,049	102.500	1,132,522.50
TRANE TECHNOLOGIES PLC	23,187	276.160	6,403,321.92
TRANSDIGM GROUP INC	5,603	1,159.010	6,493,933.03
TRANSUNION	19,629	74.600	1,464,323.40
TRAVELERS COS INC/THE	23,238	220.100	5,114,683.80
TRIMBLE INC	25,216	60.130	1,516,238.08
TRUIST FINANCIAL CORP	135,232	35.560	4,808,849.92
TWILIO INC - A	17,467	56.680	990,029.56
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,272	435.380	1,859,943.36
TYSON FOODS INC-CL A	29,017	54.050	1,568,368.85
U-HAUL HOLDING CO	9,852	65.230	642,645.96
UBER TECHNOLOGIES INC	186,708	76.600	14,301,832.80
UIPATH INC - CLASS A	39,336	23.820	936,983.52
ULTA BEAUTY INC	4,995	541.290	2,703,743.55
UNION PACIFIC CORP	61,868	247.140	15,290,057.52
UNITED PARCEL SERVICE INC	73,431	148.640	10,914,783.84

UNITED RENTALS INC	6,930	643.910	4,462,296.30
UNITED THERAPEUTICS CORP	4,763	214.160	1,020,044.08
UNITEDHEALTH GROUP INC	94,041	521.060	49,001,003.46
UNITY SOFTWARE INC	25,317	32.020	810,650.34
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,304	162.430	1,023,958.72
US BANCORP	155,642	41.140	6,403,111.88
VAIL RESORTS INC	3,876	228.140	884,270.64
VALERO ENERGY CORP	35,827	135.030	4,837,719.81
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	15,497	218.760	3,390,123.72
VERALTO CORP	23,741	85.770	2,036,265.57
VERISIGN INC	9,413	192.230	1,809,460.99
VERISK ANALYTICS INC	14,719	248.510	3,657,818.69
VERIZON COMMUNICATIONS INC	427,380	40.500	17,308,890.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,202	420.640	11,021,609.28
VERTIV HOLDINGS CO	34,772	62.020	2,156,559.44
VF CORP	33,588	16.200	544,125.60
VIATRIS INC	121,679	13.240	1,611,029.96
VISA INC-CLASS A SHARES	163,121	275.150	44,882,743.15
VISTRA CORP	33,532	46.150	1,547,501.80
VULCAN MATERIALS CO	13,489	251.380	3,390,864.82
WABTEC CORP	18,190	134.400	2,444,736.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	74,638	22.310	1,665,173.78
WALMART INC	150,286	175.860	26,429,295.96
WALT DISNEY CO	185,764	109.440	20,330,012.16
WARNER BROS DISCOVERY INC	235,170	9.890	2,325,831.30
WASTE CONNECTIONS INC	26,156	167.210	4,373,544.76
WASTE MANAGEMENT INC	41,122	201.790	8,298,008.38
WATERS CORP	6,000	323.950	1,943,700.00
WATSCO INC	3,407	377.910	1,287,539.37
WEC ENERGY GROUP INC	32,012	78.000	2,496,936.00
WELLS FARGO & CO	371,419	51.770	19,228,361.63
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,499	350.180	2,625,999.82
WESTERN DIGITAL CORP	32,906	54.130	1,781,201.78
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,887	132.810	516,232.47
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	26,050	43.780	1,140,469.00
WEYERHAEUSER CO	74,137	33.060	2,450,969.22
WILLIAMS COS INC	123,472	34.110	4,211,629.92
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,638	275.640	2,932,258.32
WIX.COM LTD	5,507	125.320	690,137.24
WORKDAY INC-CLASS A	21,010	301.980	6,344,599.80
WR BERKLEY CORP	20,895	81.980	1,712,972.10
WW GRAINGER INC	4,568	935.150	4,271,765.20
WYNN RESORTS LTD	10,404	103.230	1,074,004.92

	XCEL ENERGY INC	55,971	59.190	3,312,923.49	
	XYLEM INC	24,454	124.100	3,034,741.40	
	YUM! BRANDS INC	28,450	133.950	3,810,877.50	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP- CL A	5,212	271.930	1,417,299.16	
	ZILLOW GROUP INC - C W/I	15,526	53.520	830,951.52	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	21,203	124.980	2,649,950.94	
	ZOETIS INC	46,736	186.550	8,718,600.80	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	24,186	61.320	1,483,085.52	
	ZSCALER INC	8,964	249.040	2,232,394.56	
アメリカ・ドル	小計	34,543,618		4,370,079,988.94 (656,211,211,137)	
イギリス・ポンド	3I GROUP PLC	98,613	24.520	2,417,990.76	
	ABRDN PLC	192,013	1.592	305,684.69	
	ADMIRAL GROUP PLC	26,429	25.830	682,661.07	
	ANGLO AMERICAN PLC	128,982	17.196	2,217,974.47	
	ANTOFAGASTA PLC	39,990	17.760	710,222.40	
	ASHTED GROUP PLC	44,451	53.500	2,378,128.50	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34,965	23.070	806,642.55	
	ASTRAZENECA PLC	157,348	102.040	16,055,789.92	
	AUTO TRADER GROUP PLC-WI	92,806	7.228	670,801.76	
	AVIVA PLC	278,344	4.438	1,235,290.67	
	BAE SYSTEMS PLC	308,611	12.530	3,866,895.83	
	BARCLAYS PLC	1,532,683	1.618	2,479,881.09	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	99,076	4.808	476,357.40	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS- UNIT	10,785	47.910	516,709.35	
	BP PLC	1,731,921	4.665	8,079,411.46	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	215,730	23.835	5,141,924.55	
	BT GROUP PLC	661,688	1.068	706,682.78	
	BUNZL PLC	34,285	32.530	1,115,291.05	
	BURBERRY GROUP PLC	36,912	13.075	482,624.40	
	CENTRICA PLC	555,104	1.334	740,508.73	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	22,426	24.810	556,389.06	
	COMPASS GROUP PLC	173,977	22.070	3,839,672.39	
	CRH PLC	71,799	61.400	4,408,458.60	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	14,186	49.990	709,158.14	
	DCC PLC	10,022	58.260	583,881.72	
	DIAGEO PLC	228,207	29.665	6,769,760.65	
	ENDEAVOUR MINING PLC	18,674	12.970	242,201.78	
	ENTAIN PLC	64,884	9.230	598,879.32	
	EXPERIAN PLC	93,371	33.900	3,165,276.90	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17,939	165.900	2,976,080.10	
	GLENCORE PLC	1,062,384	3.904	4,147,547.13	

GSK PLC	415,616	16.778	6,973,205.24
HALEON PLC	562,409	3.256	1,831,203.70
HALMA PLC	38,554	22.820	879,802.28
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,110	8.054	290,829.94
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,787	19.850	333,221.95
HSBC HOLDINGS PLC	1,977,771	6.438	12,732,889.69
IMPERIAL BRANDS PLC	86,468	18.240	1,577,176.32
INFORMA PLC	140,516	8.214	1,154,198.42
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	16,762	83.340	1,396,945.08
INTERTEK GROUP PLC	16,363	44.910	734,862.33
JD SPORTS FASHION PLC	263,056	1.122	295,148.83
KINGFISHER PLC	192,045	2.239	429,988.75
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	607,799	2.414	1,467,226.78
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,445,775	0.436	2,810,357.90
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	42,270	88.440	3,738,358.80
M&G PLC	228,750	2.253	515,373.75
MELROSE INDUSTRIES PLC	136,607	6.136	838,220.55
MONDI PLC/WI	44,785	13.825	619,152.62
NATIONAL GRID PLC	374,296	10.390	3,888,935.44
NATWEST GROUP PLC	584,848	2.288	1,338,132.22
NEXT PLC	12,219	85.340	1,042,769.46
NMC HEALTH PLC	4,758	0.001	4.75
OCADO GROUP PLC	58,882	5.318	313,134.47
PEARSON PLC	64,847	9.582	621,363.95
PERSIMMON PLC	32,469	14.285	463,819.66
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	77,163	5.018	387,203.93
PRUDENTIAL PLC	279,396	8.150	2,277,077.40
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	72,836	58.160	4,236,141.76
RELX PLC	191,759	34.360	6,588,839.24
RENTOKIL INITIAL PLC	256,209	4.253	1,089,656.87
RIO TINTO PLC	114,272	52.300	5,976,425.60
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	854,283	3.305	2,823,405.31
SAGE GROUP PLC	104,168	11.730	1,221,890.64
SAINSBURY (J) PLC	168,093	2.563	430,822.35
SCHRODERS PLC	81,699	4.026	328,920.17
SEVERN TRENT PLC	27,296	25.890	706,693.44
SHELL PLC-NEW	671,756	24.880	16,713,289.28
SMITH & NEPHEW PLC	88,602	11.295	1,000,759.59
SMITHS GROUP PLC	35,216	16.395	577,366.32
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,498	103.950	779,417.10
SSE PLC	110,795	16.095	1,783,245.52
ST JAMES' S PLACE PLC	55,883	6.538	365,363.05
STANDARD CHARTERED PLC	232,460	6.008	1,396,619.68

	TAYLOR WIMPEY PLC	359,336	1.456	523,193.21	
	TESCO PLC	720,785	2.845	2,050,633.32	
	UNILEVER PLC	253,843	40.530	10,288,256.79	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	69,124	10.540	728,566.96	
	VODAFONE GROUP PLC	2,370,413	0.670	1,588,176.71	
	WHITBREAD PLC	19,581	35.500	695,125.50	
	WISE PLC - A	62,463	8.382	523,564.86	
	WPP PLC	109,133	7.882	860,186.30	
イギリス・ポンド 小計		27,853,429		191,311,943.00 (36,268,918,154)	
イスラエル・ シュケル	AZRIELI GROUP	4,344	243.600	1,058,198.40	
	BANK HAPOALIM BM	128,890	32.600	4,201,814.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	154,726	28.070	4,343,158.82	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,707	758.000	2,051,906.00	
	ICL GROUP LTD	78,651	18.050	1,419,650.55	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	125,515	17.930	2,250,483.95	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	15,690	136.000	2,133,840.00	
	NICE LTD	6,427	825.900	5,308,059.30	
イスラエル・シュケル 小計		516,950		22,767,111.02 (928,005,659)	
オーストラリ ア・ドル	AMPOL LTD	24,132	37.800	912,189.60	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	305,029	27.880	8,504,208.52	
	APA GROUP	130,491	8.010	1,045,232.91	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	59,246	44.350	2,627,560.10	
	ASX LTD	19,657	64.280	1,263,551.96	
	AURIZON HOLDINGS LTD	186,458	3.920	730,915.36	
	BHP GROUP LIMITED	514,521	45.540	23,431,286.34	
	BLUESCOPE STEEL LTD	45,748	22.500	1,029,330.00	
	BRAMBLES LTD	140,900	15.280	2,152,952.00	
	CARSALES.COM LTD	36,380	35.450	1,289,671.00	
	COCHLEAR LTD	6,648	330.310	2,195,900.88	
	COLES GROUP LTD	135,813	16.030	2,177,082.39	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	170,165	116.950	19,900,796.75	
	COMPUTERSHARE LIMITED	55,160	26.030	1,435,814.80	
	CSL LIMITED	49,048	282.280	13,845,269.44	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	145,555	5.400	785,997.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	171,935	28.210	4,850,286.35	
	IDP EDUCATION LTD	26,879	19.510	524,409.29	
	IGO LTD	69,265	6.980	483,469.70	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	247,009	6.190	1,528,985.71	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES- CDI	44,670	56.540	2,525,641.80	
LOTTERY CORP LTD/THE	225,580	5.050	1,139,179.00		

	MACQUARIE GROUP LTD	37,275	191.020	7,120,270.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	279,175	3.890	1,085,990.75	
	MINERAL RESOURCES LTD	17,847	59.410	1,060,290.27	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	317,684	33.490	10,639,237.16	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	116,315	13.170	1,531,868.55	
	ORICA LTD	46,176	16.850	778,065.60	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	174,689	8.670	1,514,553.63	
	PILBARA MINERALS LTD	290,166	3.560	1,032,990.96	
	QANTAS AIRWAYS LTD	85,178	5.720	487,218.16	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	151,542	17.110	2,592,883.62	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	18,638	50.790	946,624.02	
	REA GROUP LTD	5,364	192.850	1,034,447.40	
	REECE LTD	22,976	23.830	547,518.08	
	RIO TINTO LTD	37,633	128.040	4,818,529.32	
	SANTOS LTD	329,395	7.400	2,437,523.00	
	SEEK LTD	36,149	26.210	947,465.29	
	SONIC HEALTHCARE LTD	45,768	29.240	1,338,256.32	
	SOUTH32 LTD	459,947	2.840	1,306,249.48	
	SUNCORP GROUP LTD	128,853	15.290	1,970,162.37	
	TELSTRA GROUP LTD	420,984	3.940	1,658,676.96	
	TRANSURBAN GROUP	313,623	13.160	4,127,278.68	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	81,048	11.740	951,503.52	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	23,767	34.230	813,544.41	
	WESFARMERS LIMITED	115,180	63.010	7,257,491.80	
	WESTPAC BANKING CORP	356,262	25.900	9,227,185.80	
	WISETECH GLOBAL LTD	16,938	79.850	1,352,499.30	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	192,777	30.190	5,819,937.63	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	123,955	35.870	4,446,265.85	
	XERO LTD	14,603	113.680	1,660,069.04	
	オーストラリア・ドル 小計	7,070,196		174,884,328.37 (17,210,366,755)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	50,343	65.760	3,310,555.68	
	AIR CANADA	18,039	17.890	322,717.71	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	67,324	8.000	538,592.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	78,595	85.070	6,686,076.65	
	ALTAGAS LTD	28,902	28.480	823,128.96	
	ARC RESOURCES LTD	61,797	21.990	1,358,916.03	
	BANK OF MONTREAL	73,415	127.920	9,391,246.80	
	BANK OF NOVA SCOTIA	122,757	64.130	7,872,406.41	
	BARRICK GOLD CORP	178,320	19.930	3,553,917.60	
	BCE INC	9,057	51.230	463,990.11	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	35,792	55.150	1,973,928.80	

BROOKFIELD CORPORATION-A	141,636	54.650	7,740,407.40	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	13,940	33.780	470,893.20	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,525	90.340	318,448.50	
CAE INC	32,476	26.050	845,999.80	
CAMECO CORP	44,035	56.050	2,468,161.75	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	94,264	62.820	5,921,664.48	
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	56,700	173.120	9,815,904.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	110,866	85.430	9,471,282.38	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	94,708	114.790	10,871,531.32	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,395	139.560	752,926.20	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	13,833	30.530	422,321.49	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15,322	58.630	898,328.86	
CENOVUS ENERGY INC	144,777	23.240	3,364,617.48	
CGI INC	21,311	152.880	3,258,025.68	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,047	3,722.930	7,620,837.71	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	8,728	116.850	1,019,866.80	
DOLLARAMA INC	28,814	104.420	3,008,757.88	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	39,850	22.680	903,798.00	
EMERA INC	28,119	48.090	1,352,242.71	
EMPIRE CO LTD 'A'	14,934	34.310	512,385.54	
ENBRIDGE INC	216,400	46.560	10,075,584.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,168	1,361.730	2,952,230.64	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	59,932	11.610	695,810.52	
FIRSTSERVICE CORP	4,127	222.400	917,844.80	
FORTIS INC	49,726	53.610	2,665,810.86	
FRANCO-NEVADA CORP	19,538	146.090	2,854,306.42	
GEORGE WESTON LTD	6,379	175.990	1,122,640.21	
GFL ENVIRONMENTAL INC- SUB VT	23,729	49.260	1,168,890.54	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,959	45.780	822,163.02	
GREAT-WEST LIFECO INC	28,730	42.300	1,215,279.00	
HYDRO ONE LTD	33,995	40.710	1,383,936.45	
IA FINANCIAL CORP INC	10,434	93.750	978,187.50	
IGM FINANCIAL INC	8,941	35.300	315,617.30	
IMPERIAL OIL LTD	20,261	79.840	1,617,638.24	
INTACT FINANCIAL CORP	18,160	227.580	4,132,852.80	
IVANHOE MINES LTD-CL A	62,210	14.480	900,800.80	
KEYERA CORP	23,584	33.230	783,696.32	
KINROSS GOLD CORP	124,626	6.860	854,934.36	

	LOBLAW COS LTD	16,070	139.020	2,234,051.40	
	LUNDIN MINING CORP	67,181	11.360	763,176.16	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	27,743	73.430	2,037,168.49	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	185,325	32.990	6,113,871.75	
	MEG ENERGY CORP	29,083	25.800	750,341.40	
	METRO INC	23,574	71.230	1,679,176.02	
	NATIONAL BANK OF CANADA	34,496	104.480	3,604,142.08	
	NORTHLAND POWER INC	26,125	23.600	616,550.00	
	NUTRIEN LTD	50,276	68.420	3,439,883.92	
	ONEX CORPORATION	6,889	102.650	707,155.85	
	OPEN TEXT CORP	27,670	53.010	1,466,786.70	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	37,026	17.490	647,584.74	
	PARKLAND CORP	14,360	46.650	669,894.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	56,195	45.500	2,556,872.50	
	POWER CORP OF CANADA	58,958	38.670	2,279,905.86	
	QUEBECOR INC -CL B	16,334	31.930	521,544.62	
	RB GLOBAL INC	18,521	91.590	1,696,338.39	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	29,289	103.220	3,023,210.58	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC	36,542	61.540	2,248,794.68	
	ROYAL BANK OF CANADA	141,884	132.550	18,806,724.20	
	SAPUTO INC	25,995	28.050	729,159.75	
	SHOPIFY INC - CLASS A	122,178	106.300	12,987,521.40	
	STANTEC INC	11,377	111.800	1,271,948.60	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	59,884	73.430	4,397,282.12	
	SUNCOR ENERGY INC	132,245	44.120	5,834,649.40	
	TC ENERGY CORP	104,692	53.690	5,620,913.48	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	46,836	51.260	2,400,813.36	
	TFI INTERNATIONAL INC	8,297	195.420	1,621,399.74	
	THOMSON REUTERS CORP	16,255	213.340	3,467,841.70	
	TMX GROUP LTD	28,616	34.190	978,381.04	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	8,448	124.780	1,054,141.44	
	TORONTO-DOMINION BANK	184,951	80.660	14,918,147.66	
	TOURMALINE OIL CORP	32,867	57.000	1,873,419.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,813	106.370	618,328.81	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	46,053	59.780	2,753,048.34	
	WSP GLOBAL INC	12,741	208.260	2,653,440.66	
	カナダ・ドル 小計	4,121,309		261,835,711.55 (29,069,000,696)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	264,000	2.920	770,880.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	50,400	6.070	305,928.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	183,800	34.170	6,280,446.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	613,000	1.060	649,780.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,000	26.190	261,900.00	
	KEPPEL CORP LTD	148,000	7.390	1,093,720.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING	343,600	13.450	4,621,420.00	

	CORP				
	SEATRUM LTD	4,496,352	0.097	436,146.14	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	90,300	5.810	524,643.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	150,900	7.370	1,112,133.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	86,800	9.420	817,656.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	158,400	3.920	620,928.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	848,300	2.390	2,027,437.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	128,300	29.510	3,786,133.00	
	UOL Group Limited	46,800	6.210	290,628.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,800	3.240	631,152.00	
	シンガポール・ドル 小計	7,813,752		24,230,930.14 (2,707,321,825)	
スイス・フラン	ABB LTD	162,355	40.150	6,518,553.25	
	ADECCO GROUP AG-REG	16,239	36.680	595,646.52	
	ALCON INC	50,710	68.880	3,492,904.80	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	3,436	64.500	221,622.00	
	BALOISE HOLDING AG	4,641	144.200	669,232.20	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,050	108.100	329,705.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	362	1,319.000	477,478.00	
	BKW AG	2,134	133.000	283,822.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	97	11,230.000	1,089,310.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- REG	11	111,000.000	1,221,000.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON- REG	52,999	135.800	7,197,264.20	
	CLARIANT AG	21,886	11.070	242,278.02	
	DUFREY AG-REG	9,888	35.240	348,453.12	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG- REG	715	636.000	454,740.00	
	GEBERIT AG-REG	3,393	511.800	1,736,537.40	
	GIVAUDAN-REG	937	3,744.000	3,508,128.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	3,761	123.600	464,859.60	
	HOLCIM LTD	52,879	68.060	3,598,944.74	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20,905	48.250	1,008,666.25	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG- REG	5,515	284.800	1,570,672.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL- REG	16,687	76.920	1,283,564.04	
	LONZA GROUP AG	7,562	454.300	3,435,416.60	
	NESTLE SA	271,054	99.600	26,996,978.40	
	NOVARTIS AG	208,063	90.770	18,885,878.51	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,303	1,237.500	2,849,962.50	
	ROCHE HOLDING AG	71,310	232.200	16,558,182.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	3,264	247.000	806,208.00	
	SANDOZ GROUP AG	41,555	28.060	1,166,033.30	

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,419	223.400	540,404.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,099	231.700	949,738.30	
	SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	15,216	84.680	1,288,490.88	
	SIG GROUP AG	31,061	18.140	563,446.54	
	SIKA AG-BEARER	15,481	255.400	3,953,847.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,144	285.100	1,466,554.40	
	STRAUMANN HOLDING AG	11,335	145.700	1,651,509.50	
	SWATCH GROUP AG	2,926	212.600	622,067.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,994	648.800	1,942,507.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,775	86.300	670,982.50	
	SWISS RE AG	30,605	102.750	3,144,663.75	
	SWISSCOM AG	2,679	520.600	1,394,687.40	
	TEMENOS GROUP AG-REG	6,482	62.240	403,439.68	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,388	41.000	220,908.00	
	UBS GROUP AG	333,762	24.400	8,143,792.80	
	VAT GROUP AG	2,743	428.500	1,175,375.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,857	443.900	6,595,022.30	
スイス・フラン	小計	1,532,677		141,739,478.80 (24,136,815,845)	
スウェーデン・クローナ	ALFA LAVAL AB	29,333	379.400	11,128,940.20	
	ASSA ABLOY AB	101,654	293.900	29,876,110.60	
	ATLAS COPCO AB	158,545	151.100	23,956,149.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	272,562	174.550	47,575,697.10	
	BEIJER REF AB	39,146	145.800	5,707,486.80	
	BIOVITRUM	19,706	263.200	5,186,619.20	
	BOLIDEN AB	27,716	269.950	7,481,934.20	
	EPIROC AB-A	66,819	193.200	12,909,430.80	
	EPIROC AB-B	39,664	172.600	6,846,006.40	
	EQT AB	36,110	279.800	10,103,578.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	61,776	243.600	15,048,633.60	
	EVOLUTION AB	18,611	1,350.000	25,124,850.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	66,149	65.260	4,316,883.74	
	GETINGE AB-B SHS	23,193	208.800	4,842,698.40	
	HENNES & MAURITZ AB	65,536	142.460	9,336,258.56	
	HEXAGON AB-B SHS	210,768	117.550	24,775,778.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,708	403.300	3,108,636.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	35,432	79.200	2,806,214.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	13,351	344.500	4,599,419.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,543	344.300	5,007,154.90	
	INDUTRADE AB	27,781	275.200	7,645,331.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	15,060	265.000	3,990,900.00	
	INVESTOR AB	175,580	255.600	44,878,248.00	
	LIFCO AB-B SHS	23,662	275.900	6,528,345.80	

	LUNDBERGS AB-B SHS	7,639	559.400	4,273,256.60	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	153,937	59.360	9,137,700.32	
	SAAB AB-B	8,116	799.600	6,489,553.60	
	SAGAX AB-B	20,082	254.400	5,108,860.80	
	SANDVIK AB	108,145	222.700	24,083,891.50	
	SECURITAS AB	49,811	107.600	5,359,663.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	160,900	152.500	24,537,250.00	
	SKANSKA AB-B SHS	34,491	184.350	6,358,415.85	
	SKF AB	34,535	216.400	7,473,374.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB	61,401	142.300	8,737,362.30	
	SVENSKA HANDELSBANKEN	147,855	124.350	18,385,769.25	
	SWEDBANK AB - A SHARES	86,104	218.000	18,770,672.00	
	TELE2 AB	56,411	84.920	4,790,422.12	
	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	297,160	56.040	16,652,846.40	
	TELIA CO AB	249,402	25.000	6,235,050.00	
	VOLVO AB	152,689	274.000	41,836,786.00	
	VOLVO AB-A SHS	20,739	279.200	5,790,328.80	
	VOLVO CAR AB-B	60,370	36.360	2,195,053.20	
	スウェーデン・クローナ 小計	3,260,192		538,997,562.04 (7,820,854,625)	
デンマーク・ク ローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S	488	10,485.000	5,116,680.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S	312	10,330.000	3,222,960.00	
	CARLSBERG AS-B	9,988	948.800	9,476,614.40	
	COLOPLAST-B	13,874	885.600	12,286,814.40	
	DANSKE BANK A/S	69,967	192.850	13,493,135.95	
	DEMANT A/S	10,214	364.400	3,721,981.60	
	DSV A/S	18,893	1,135.500	21,453,001.50	
	GENMAB A/S	6,710	1,985.000	13,319,350.00	
	NOVO-NORDISK A/S	331,293	843.300	279,379,386.90	
	NOVOZYMES A/S	37,174	384.700	14,300,837.80	
	ORSTED A/S	19,227	389.500	7,488,916.50	
	PANDORA A/S	8,575	1,141.500	9,788,362.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	933	2,220.000	2,071,260.00	
	TRYGVESTA AS	35,513	144.450	5,129,852.85	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	102,529	183.340	18,797,666.86	
	デンマーク・クローネ 小計	665,690		419,046,821.26 (9,126,839,767)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	133,749	8.045	1,076,010.70	
	EBOS GROUP LTD	15,569	35.800	557,370.20	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	58,983	23.740	1,400,256.42	
	MERCURY NZ LTD	70,246	6.795	477,321.57	
	MERIDIAN ENERGY LTD	130,900	5.570	729,113.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	191,016	5.105	975,136.68	
	ニュージーランド・ドル 小計	600,463		5,215,208.57 (483,084,770)	

ノルウェー・クローネ	ADEVINTA ASA-B	35,506	115.000	4,083,190.00	
	AKER BP ASA	32,035	259.300	8,306,675.50	
	DNB BANK ASA	93,748	208.600	19,555,832.80	
	EQUINOR ASA	91,374	264.250	24,145,579.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20,217	171.700	3,471,258.90	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,909	662.000	5,897,758.00	
	MOWI ASA	47,177	202.900	9,572,213.30	
	NORSK HYDRO ASA	134,553	56.620	7,618,390.86	
	ORKLA ASA	70,763	75.800	5,363,835.40	
	SALMAR ASA	7,361	637.200	4,690,429.20	
	TELENOR ASA	65,886	116.650	7,685,601.90	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,744	351.200	5,880,492.80	
ノルウェー・クローネ 小計	624,273		106,271,258.16 (1,522,867,129)		
ユーロ	ABN AMRO BANK NV	48,205	14.530	700,418.65	
	ACCIONA SA	2,506	108.500	271,901.00	
	ACCOR	20,104	37.850	760,936.40	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,149	36.630	774,687.87	
	ADIDAS AG	16,443	181.120	2,978,156.16	
	ADP	3,512	127.200	446,726.40	
	ADYEN NV	2,205	1,482.800	3,269,574.00	
	AEGON LTD	164,722	5.394	888,510.46	
	AENA SME SA	7,604	170.500	1,296,482.00	
	AGEAS	16,190	39.360	637,238.40	
	AIB GROUP PLC	159,180	4.152	660,915.36	
	AIR LIQUIDE	53,163	185.860	9,880,875.18	
	AIRBUS SE	60,177	144.960	8,723,257.92	
	AKZO NOBEL NV	17,295	68.040	1,176,751.80	
	ALLIANZ SE	40,936	249.400	10,209,438.40	
	ALSTOM RGPT	29,275	11.440	334,906.00	
	AMADEUS IT GROUP SA	45,719	61.400	2,807,146.60	
	AMPLIFON SPA	12,641	31.470	397,812.27	
	AMUNDI SA	6,244	60.350	376,825.40	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	88,158	58.260	5,136,085.08	
	ARCELORMITTAL	51,763	24.420	1,264,052.46	
	ARGENX SE	5,999	366.300	2,197,433.70	
	ARKEMA	6,081	96.440	586,451.64	
	ASM INTERNATIONAL NV	4,765	542.500	2,585,012.50	
	ASML HOLDING NV	40,925	837.700	34,282,872.50	
	ASR NEDERLAND NV	16,085	42.950	690,850.75	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	102,793	20.930	2,151,457.49	
	AXA SA	183,134	31.165	5,707,371.11	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	605,295	9.098	5,506,973.91	
	BANCO BPM SPA	122,757	4.933	605,560.28	

BANCO SANTANDER SA	1, 641, 828	3. 800	6, 238, 946. 40	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	107, 147	8. 438	904, 106. 38	
BASF SE	90, 640	46. 045	4, 173, 518. 80	
BAYER AG	99, 732	28. 765	2, 868, 790. 98	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	32, 330	101. 820	3, 291, 840. 60	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6, 013	96. 150	578, 149. 95	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	7, 823	153. 200	1, 198, 483. 60	
BECHTLE AG	8, 308	46. 240	384, 161. 92	
BEIERSDORF AG	10, 218	139. 050	1, 420, 812. 90	
BIOMERIEUX	4, 200	103. 700	435, 540. 00	
BNP PARIBAS	106, 614	55. 500	5, 917, 077. 00	
BOLLORE SE	74, 922	6. 280	470, 510. 16	
BOUYGUES	19, 359	34. 570	669, 240. 63	
BRENTAG SE	14, 108	81. 560	1, 150, 648. 48	
BUREAU VERITAS SA	29, 937	25. 240	755, 609. 88	
CAIXABANK	418, 779	4. 100	1, 716, 993. 90	
CAPGEMINI SA	15, 857	218. 800	3, 469, 511. 60	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4, 092	110. 950	454, 007. 40	
CARREFOUR SA	58, 329	15. 705	916, 056. 94	
CELLNEX TELECOM SAU	57, 662	33. 360	1, 923, 604. 32	
CIE DE SAINT-GOBAIN	46, 241	68. 300	3, 158, 260. 30	
COMMERZBANK AG	106, 875	10. 605	1, 133, 409. 37	
CONTINENTAL AG	11, 152	72. 940	813, 426. 88	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	6, 655	20. 840	138, 690. 20	
COVESTRO AG	19, 629	47. 850	939, 247. 65	
CREDIT AGRICOLE SA	108, 335	12. 440	1, 347, 687. 40	
D' IETEREN GROUP	2, 187	174. 000	380, 538. 00	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	54, 281	35. 510	1, 927, 518. 31	
DANONE	65, 332	61. 680	4, 029, 677. 76	
DASSAULT AVIATION SA	2, 048	182. 600	373, 964. 80	
DASSAULT SYSTEMES SA	67, 825	43. 100	2, 923, 257. 50	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	53, 049	9. 818	520, 835. 08	
DELIVERY HERO SE	17, 884	22. 330	399, 349. 72	
DEUTSCHE BANK AG	196, 556	11. 954	2, 349, 630. 42	
DEUTSCHE BOERSE AG	19, 280	188. 850	3, 641, 028. 00	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	60, 583	7. 339	444, 618. 63	
DEUTSCHE TELEKOM AG	330, 482	22. 265	7, 358, 181. 73	
DHL GROUP	100, 606	42. 980	4, 324, 045. 88	
DIASORIN ITALIA SPA	2, 273	92. 460	210, 161. 58	
DR ING HC F PORSCHE AG	11, 566	79. 080	914, 639. 28	
DSM-FIRMENICH AG	18, 883	102. 920	1, 943, 438. 36	
E. ON SE	227, 789	12. 035	2, 741, 440. 61	
EDENRED	25, 340	56. 360	1, 428, 162. 40	
EDP RENOVAVEIS SA	31, 263	13. 820	432, 054. 66	

EIFFAGE	7,442	96.420	717,557.64
ELIA GROUP SA/NV	2,985	103.500	308,947.50
ELISA OYJ	14,895	42.790	637,357.05
ENAGAS SA	25,256	14.925	376,945.80
ENDESA SA	32,157	16.750	538,629.75
ENEL SPA	825,296	5.903	4,871,722.28
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	318,469	3.752	1,194,895.68
ENGIE	185,472	14.446	2,679,328.51
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	239,714	14.132	3,387,638.24
ERSTE GROUP BANK AG	34,864	39.090	1,362,833.76
ESSILORLUXOTTICA	29,932	188.520	5,642,780.64
EURAZEO	4,396	77.550	340,909.80
EUROFINS SCIENTIFIC	13,702	57.580	788,961.16
EURONEXT NV	8,694	82.550	717,689.70
EVONIK INDUSTRIES AG	23,688	17.350	410,986.80
EXOR NV	9,414	97.520	918,053.28
FERRARI NV	12,796	362.500	4,638,550.00
FERROVIAL SE	51,989	35.500	1,845,609.50
FINECOBANK SPA	62,040	13.200	818,928.00
FORTUM OYJ	45,565	11.085	505,088.02
PRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO. KGAA	20,839	37.700	785,630.30
PRESENIUS SE & CO KGAA	42,870	26.040	1,116,334.80
GALP ENERGIA SGPS SA	45,924	14.225	653,268.90
GEA GROUP AG	16,607	37.510	622,928.57
GETLINK SE - REGR	36,231	15.425	558,863.17
GRIFOLS SA	30,251	10.930	330,643.43
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,891	70.720	628,771.52
HANNOVER RUECK SE	6,116	231.600	1,416,465.60
HEIDELBERG MATERIALS AG	14,133	87.680	1,239,181.44
HEINEKEN HOLDING NV	13,116	73.750	967,305.00
HEINEKEN NV	29,210	88.160	2,575,153.60
HELLOFRESH SE	15,782	12.065	190,409.83
HENKEL AG & CO KGAA	10,620	64.440	684,352.80
HENKEL KGAA-VORZUG	17,118	71.460	1,223,252.28
HERMES INTERNATIONAL	3,216	2,219.500	7,137,912.00
IBERDROLA SA	612,173	10.900	6,672,685.70
IMCD NV	5,787	141.050	816,256.35
INDITEX SA	110,725	40.100	4,440,072.50
INFINEON TECHNOLOGIES AG	132,574	32.560	4,316,609.44
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	35,679	10.770	384,262.83
ING GROEP NV-CVA	367,290	12.696	4,663,113.84
INTESA SANPAOLO	1,577,252	2.849	4,493,590.94
IPSEN	3,819	105.600	403,286.40
JDE PEET'S BV	9,843	23.160	227,963.88
JERONIMO MARTINS	28,751	21.980	631,946.98
KBC GROEP NV	25,414	62.040	1,576,684.56

KERING	7, 559	428. 200	3, 236, 763. 80
KERRY GROUP PLC-A	16, 163	79. 000	1, 276, 877. 00
KESKO OYJ-B SHS	27, 730	17. 995	499, 001. 35
KINGSPAN GROUP PLC	15, 696	85. 140	1, 336, 357. 44
KNORR-BREMSE AG	7, 353	58. 160	427, 650. 48
KONE OYJ	34, 499	46. 010	1, 587, 298. 99
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	97, 430	27. 730	2, 701, 733. 90
KONINKLIJKE PHILIPS NV	80, 068	18. 688	1, 496, 310. 78
L' OREAL SA	24, 486	443. 600	10, 861, 989. 60
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10, 686	38. 720	413, 761. 92
LEG IMMOBILIE SE	7, 525	70. 820	532, 920. 50
LEGRAND SA	26, 898	89. 080	2, 396, 073. 84
LEONARDO SPA	40, 963	19. 150	784, 441. 45
LOTUS BAKERIES	42	9, 000. 000	378, 000. 00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	28, 034	820. 200	22, 993, 486. 80
MEDIOBANCA SPA	55, 997	11. 850	663, 564. 45
MERCEDES-BENZ GROUP AG	81, 458	66. 780	5, 439, 765. 24
MERCK KGAA	13, 119	153. 400	2, 012, 454. 60
METSO CORPORATION	67, 372	10. 045	676, 751. 74
MICHELIN (C. G. D. E.)	68, 853	33. 330	2, 294, 870. 49
MONCLER SPA	20, 920	62. 680	1, 311, 265. 60
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	5, 463	223. 500	1, 220, 980. 50
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	13, 847	412. 800	5, 716, 041. 60
NATURGY ENERGY GROUP SA	12, 729	23. 020	293, 021. 58
NEMETSCHEK SE	5, 858	84. 720	496, 289. 76
NESTE OYJ	42, 931	27. 550	1, 182, 749. 05
NEXI SPA	59, 992	7. 090	425, 343. 28
NN GROUP NV	27, 469	37. 550	1, 031, 460. 95
NOKIA OYJ	548, 357	3. 240	1, 776, 676. 68
NORDEA BANK ABP	324, 909	11. 116	3, 611, 688. 44
OCI NV	10, 743	25. 500	273, 946. 50
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS- A	6, 912	64. 650	446, 860. 80
OMV AG	14, 953	40. 800	610, 082. 40
ORANGE S. A.	192, 253	10. 904	2, 096, 326. 71
ORION OYJ-CLASS B	10, 930	38. 940	425, 614. 20
PERNOD-RICARD	20, 759	155. 850	3, 235, 290. 15
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	15, 519	45. 140	700, 527. 66
POSTE ITALIANE SPA	53, 034	10. 110	536, 173. 74
PROSUS	148, 489	27. 695	4, 112, 402. 85
PRYSMIAN SPA	26, 631	43. 630	1, 161, 910. 53
PUBLICIS GROUPE	23, 243	98. 120	2, 280, 603. 16
PUMA AG	10, 713	41. 700	446, 732. 10
QIAGEN NV	22, 420	39. 450	884, 469. 00

RANDSTAD NV	11, 188	51. 320	574, 168. 16
RATIONAL AG	520	754. 000	392, 080. 00
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	10, 609	52. 120	552, 941. 08
REDEIA CORPORACION SA	41, 383	15. 090	624, 469. 47
REMY COINTREAU	2, 343	98. 440	230, 644. 92
RENAULT SA	19, 466	36. 480	710, 119. 68
REPSOL SA	129, 291	13. 650	1, 764, 822. 15
RHEINMETALL AG	4, 421	401. 900	1, 776, 799. 90
ROYAL KPN NV	349, 731	3. 372	1, 179, 292. 93
RWE AG	64, 134	31. 170	1, 999, 056. 78
SAFRAN SA	34, 694	190. 460	6, 607, 819. 24
SAMPO OYJ	45, 806	41. 475	1, 899, 803. 85
SANOFI	115, 546	87. 130	10, 067, 522. 98
SAP SE	105, 997	163. 060	17, 283, 870. 82
SARTORIUS AG-VORZUG	2, 663	334. 900	891, 838. 70
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2, 812	249. 300	701, 031. 60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	55, 247	201. 150	11, 112, 934. 05
SCOUT24 SE	7, 585	65. 340	495, 603. 90
SEB SA	2, 520	112. 300	282, 996. 00
SIEMENS AG	77, 153	168. 720	13, 017, 254. 16
SIEMENS ENERGY AG	52, 751	13. 430	708, 445. 93
SIEMENS HEALTHINEERS AG	28, 639	54. 920	1, 572, 853. 88
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	26, 394	38. 100	1, 005, 611. 40
SNAM SPA	204, 658	4. 476	916, 049. 20
SOCIETE GENERALE	74, 930	22. 150	1, 659, 699. 50
SODEXO	8, 977	75. 660	679, 199. 82
SOFINA	1, 571	214. 000	336, 194. 00
STELLANTIS NV	224, 545	23. 400	5, 254, 353. 00
STMICROELECTRONICS NV	69, 361	40. 945	2, 839, 986. 14
STORA ENSO OYJ	59, 002	11. 140	657, 282. 28
SYENSQO SA	7, 506	84. 280	632, 605. 68
SYMRISE AG	13, 477	98. 420	1, 326, 406. 34
TALANX AG	6, 535	65. 450	427, 715. 75
TELECOM ITALIA SPA	1, 032, 214	0. 287	296, 245. 41
TELEFONICA SA	503, 932	3. 667	1, 847, 918. 64
TELEPERFORMANCE	6, 044	133. 900	809, 291. 60
TENARIS SA	47, 824	14. 770	706, 360. 48
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	142, 598	7. 538	1, 074, 903. 72
THALES SA	10, 666	135. 150	1, 441, 509. 90
TOTALENERGIES SE	232, 587	58. 600	13, 629, 598. 20
UCB SA	12, 825	95. 060	1, 219, 144. 50
UMICORE	21, 255	19. 930	423, 612. 15
UNICREDIT SPA	162, 986	29. 950	4, 881, 430. 70
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	83, 211	26. 980	2, 245, 032. 78
UPM-KYMMENE OYJ	54, 159	29. 340	1, 589, 025. 06
VEOLIA ENVIRONNEMENT	69, 010	29. 750	2, 053, 047. 50
VINCI SA	51, 541	114. 440	5, 898, 352. 04
VIVENDI SA	67, 932	10. 225	694, 604. 70

	VOESTALPINE AG	11,774	25.280	297,646.72	
	VOLKSWAGEN AG	3,033	134.200	407,028.60	
	VOLKSWAGEN AG	20,884	118.080	2,465,982.72	
	VONOVIA SE	74,456	26.580	1,979,040.48	
	WACKER CHEMIE AG	1,856	99.660	184,968.96	
	WARTSILA OYJ	47,972	14.595	700,151.34	
	WOLTERS KLUWER NV	25,211	147.200	3,711,059.20	
	WORLDLINE SA	24,415	11.500	280,772.50	
	ZALANDO SE	22,769	19.650	447,410.85	
ユーロ 小計		18,441,648		507,330,061.47 (82,359,962,179)	
香港・ドル	AIA GROUP LTD	1,165,275	63.750	74,286,281.25	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	375,039	19.400	7,275,756.60	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	174,900	13.180	2,305,182.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	197,909	35.450	7,015,874.05	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	271,909	42.150	11,460,964.35	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	64,000	46.800	2,995,200.00	
	CLP HOLDINGS LTD	166,643	65.100	10,848,459.30	
	ESR GROUP LIMITED	221,000	9.350	2,066,350.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	221,810	45.150	10,014,721.50	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	182,157	8.270	1,506,438.39	
	HANG SENG BANK LTD	77,512	81.850	6,344,357.20	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	147,641	21.300	3,144,753.30	
	HKT TRUST AND HKT LTD	401,000	9.220	3,697,220.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,137,437	5.990	6,813,247.63	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	122,211	244.800	29,917,252.80	
	MTR CORP	157,755	25.900	4,085,854.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	152,917	9.360	1,431,303.12	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	140,587	46.900	6,593,530.30	
	SANDS CHINA LTD	246,180	23.500	5,785,230.00	
	SINO LAND CO	374,000	8.010	2,995,740.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	136,000	12.620	1,716,320.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	147,023	72.450	10,651,816.35	
	SWIRE PACIFIC LTD	43,366	63.150	2,738,562.90	
	SWIRE PROPERTIES LTD	119,200	15.560	1,854,752.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	139,500	83.100	11,592,450.00		
WH GROUP LTD	843,000	4.750	4,004,250.00		
WHARF HOLDINGS LTD	109,000	27.000	2,943,000.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	169,733	26.250	4,455,491.25		

	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	172,000	7.080	1,217,760.00	
香港・ドル	小計	7,876,704		241,758,118.79 (4,641,755,881)	
合計		114,920,901		872,487,004,422 (872,487,004,422)	

(2) 株式以外の有価証券

2024年2月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,705.00	1,985,055.15	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	32,992.00	1,134,264.96	
		AMERICAN TOWER REIT INC	47,325.00	8,916,030.00	
		ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	50,179.00	938,347.30	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,408.00	2,540,706.72	
		BOSTON PROPERTIES INC	15,132.00	999,165.96	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,844.00	1,024,649.56	
		CROWN CASTLE INC	44,033.00	4,796,074.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	30,728.00	4,150,123.68	
		EQUINIX INC	9,497.00	8,117,465.78	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,943.00	1,195,721.52	
		EQUITY RESIDENTIAL	36,545.00	2,197,085.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,510.00	1,516,504.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	21,454.00	3,034,024.68	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	26,674.00	1,202,730.66	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	55,561.00	940,092.12	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	72,209.00	1,419,628.94	
		INVITATION HOMES INC	62,107.00	2,035,246.39	
		IRON MOUNTAIN INC	29,631.00	2,027,353.02	
		KIMCO REALTY CORP	62,977.00	1,236,868.28	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,845.00	1,499,813.90	
		PROLOGIS INC	93,801.00	12,508,363.35	
		PUBLIC STORAGE	16,065.00	4,564,387.80	
		REALTY INCOME CORP	72,024.00	3,779,099.28	
		REGENCY CENTERS CORP	16,844.00	1,021,083.28	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,999.00	2,277,232.96	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	33,217.00	4,946,011.30	
		SUN COMMUNITIES INC	12,633.00	1,653,028.05	
		UDR INC	31,782.00	1,137,795.60	
		VENTAS INC	40,824.00	1,757,064.96	
VICI PROPERTIES INC	102,968.00	3,043,734.08			
WELLTOWER INC	52,644.00	4,885,889.64			

	WP CAREY INC	21,731.00	1,237,363.14	
アメリカ・ドル	小計	1,180,831.00	95,718,006.32 (14,373,015,827)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	71,973.00	464,513.74	
	SEGRO PLC	118,491.00	1,020,918.45	
イギリス・ポンド	小計	190,464.00	1,485,432.19 (281,608,235)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	109,312.00	834,050.56	
	GOODMAN GROUP	173,414.00	4,978,715.94	
	GPT GROUP	194,418.00	857,383.38	
	MIRVAC GROUP	400,368.00	892,820.64	
	SCENTRE GROUP	526,252.00	1,568,230.96	
	STOCKLAND	241,955.00	1,115,412.55	
	VICINITY CENTRES	392,507.00	779,126.39	
オーストラリア・ドル	小計	2,038,226.00	11,025,740.42 (1,085,043,115)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,683.00	436,581.24	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,718.00	290,783.00	
カナダ・ドル	小計	24,401.00	727,364.24 (80,751,978)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	378,100.00	1,035,994.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	540,290.00	1,064,371.30	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	352,000.00	535,040.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	241,000.00	334,990.00	
シンガポール・ドル	小計	1,511,390.00	2,970,395.30 (331,882,267)	
ユーロ	COVIVIO	5,172.00	214,327.68	
	GECINA SA	4,657.00	435,429.50	
	KLEPIERRE	21,823.00	517,205.10	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,967.00	833,381.88	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	16,834.00	429,603.68	
ユーロ	小計	60,453.00	2,429,947.84 (394,477,732)	
香港・ドル	LINK REIT	259,971.00	9,878,898.00	
香港・ドル	小計	259,971.00	9,878,898.00 (189,674,842)	
投資証券	合計	5,265,736	16,736,453,996 (16,736,453,996)	
合計			16,736,453,996 (16,736,453,996)	

(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 589銘柄	71.13	—	75.41
	投資証券 33銘柄	—	1.56	
イギリス・ポンド	株式 82銘柄	3.93	—	4.11
	投資証券 2銘柄	—	0.03	
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	0.10	—	0.10
オーストラリア・ドル	株式 51銘柄	1.87	—	2.06
	投資証券 7銘柄	—	0.12	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.15	—	3.28
	投資証券 2銘柄	—	0.01	
シンガポール・ドル	株式 16銘柄	0.29	—	0.34
	投資証券 4銘柄	—	0.04	
スイス・フラン	株式 45銘柄	2.62	—	2.71
スウェーデン・クローナ	株式 42銘柄	0.85	—	0.88
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	0.99	—	1.03
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	0.05	—	0.05
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.17	—	0.17
ユーロ	株式 220銘柄	8.93	—	9.31
	投資証券 5銘柄	—	0.04	
香港・ドル	株式 29銘柄	0.50	—	0.54
	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。

2024年2月21日現在

資産の部	
流動資産	
預金	357,676,395
金銭信託	1,903,913
コール・ローン	187,757,225
国債証券	76,245,549,955
派生商品評価勘定	192,897
未収利息	488,631,071
前払費用	52,462,397
流動資産合計	77,334,173,853
資産合計	77,334,173,853
負債の部	
流動負債	
未払金	167,984,323
未払解約金	140,874,899
その他未払費用	262
流動負債合計	308,859,484
負債合計	308,859,484
純資産の部	
元本等	
元本	45,245,373,230
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	31,779,941,139
元本等合計	77,025,314,369
純資産合計	77,025,314,369
負債純資産合計	77,334,173,853

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年2月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,232,944,932円
同期中追加設定元本額	13,847,099,417円
同期中一部解約元本額	7,834,671,119円
元本の内訳	
ファンド名	
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）	3,526,311,777円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	6,485,816,535円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	2,761,806,981円
ニッセイ外国債券インデックスSA（適格機関投資家限定）	914,449,865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）	2,056,064円
ニッセイインデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	1,837,832円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	4,638,232円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	15,762,977,826円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（4資産均等型）	6,558,196,137円
DCニッセイ外国債券インデックス	4,549,029,843円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	334,822,894円
DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）	1,989,696,306円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	381,669,763円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	554,565,697円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	50,831,910円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（6資産均等型）	210,904,841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）	21,163,499円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド（8資産均等型）	47,171,000円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	268,739,393円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	172,166,036円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	330,290,972円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	186,130,353円
FWニッセイ外国債インデックス	65,134,970円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	64,964,504円
計	45,245,373,230円
2. 受益権の総数	45,245,373,230口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	取引の執行・管理については、投資信託及び投資法人に関する法律及び同施行規則、投資信託協会の諸規則、信託約款、取引権限及び管理体制等を定めた社内規則に従い、運用部門が決裁担当者の承認を得て行っております。また、リスク管理部門が日々遵守状況を確認し、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニターを行い、問題があると判断した場合は速やかに対応できる体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年2月21日現在	
	当期間の 損益に含まれた 評価差額 (円)	
国債証券	1,226,195,570	
合計	1,226,195,570	

(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 (2023年11月21日から2024年2月21日まで) に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年2月21日現在			
	契約額等 (円)	時価 (円)		評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	144,906,487	—	145,099,384	192,897
イギリス・ポンド	77,851,929	—	78,039,604	187,675
オフショア・人民元	7,068,590	—	7,068,948	358
デンマーク・クローネ	18,745,200	—	18,746,100	900
ユーロ	584,378	—	584,482	104
ユーロ	40,656,390	—	40,660,250	3,860
合計	144,906,487	—	145,099,384	192,897

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年2月21日現在
1口当たり純資産額	1.7024円
(1万口当たり純資産額)	(17,024円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年2月21日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY BONDS	120,000.00	127,264.80	
		US TREASURY BONDS	120,000.00	124,906.80	
		US TREASURY BONDS	180,000.00	192,690.00	
		US TREASURY BONDS	100,000.00	102,664.00	
		US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,060,636.70	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,085,313.60	
		US TREASURY N/B	500,000.00	384,430.00	
		US TREASURY N/B	870,000.00	791,256.30	
		US TREASURY N/B	2,210,000.00	2,055,808.30	
		US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,086,346.80	
		US TREASURY N/B	860,000.00	781,654.00	
		US TREASURY N/B	180,000.00	185,230.80	
		US TREASURY N/B	2,370,000.00	2,292,595.80	
		US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,312,674.30	
		US TREASURY N/B	670,000.00	523,169.50	
		US TREASURY N/B	940,000.00	915,024.20	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,439,000.00	
		US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,396,074.40	
		US TREASURY N/B	850,000.00	870,051.50	
		US TREASURY N/B	480,000.00	420,033.60	
		US TREASURY N/B	490,000.00	436,060.80	
		US TREASURY N/B	630,000.00	507,099.60	
		US TREASURY N/B	7,460,000.00	7,244,928.20	
		US TREASURY N/B	8,070,000.00	7,807,967.10	
		US TREASURY N/B	420,000.00	341,922.00	
		US TREASURY N/B	510,000.00	445,133.10	
		US TREASURY N/B	480,000.00	402,768.00	
		US TREASURY N/B	540,000.00	424,677.60	
		US TREASURY N/B	720,000.00	516,880.80	
		US TREASURY N/B	330,000.00	258,390.00	
		US TREASURY N/B	480,000.00	366,936.00	
		US TREASURY N/B	6,870,000.00	6,601,039.50	
		US TREASURY N/B	11,240,000.00	10,788,601.60	
		US TREASURY N/B	280,000.00	218,366.40	
		US TREASURY N/B	8,160,000.00	7,703,856.00	
		US TREASURY N/B	580,000.00	411,591.20	
		US TREASURY N/B	6,880,000.00	6,459,907.20	
		US TREASURY N/B	590,000.00	417,584.30	
		US TREASURY N/B	6,890,000.00	6,413,074.20	
		US TREASURY N/B	730,000.00	490,034.40	
US TREASURY N/B	7,730,000.00	7,251,358.40			
US TREASURY N/B	330,000.00	249,740.70			
US TREASURY N/B	3,620,000.00	3,405,189.20			
US TREASURY N/B	650,000.00	502,196.50			
US TREASURY N/B	4,460,000.00	4,193,425.80			
US TREASURY N/B	500,000.00	385,625.00			
US TREASURY N/B	5,380,000.00	5,017,011.40			

US TREASURY N/B	710,000.00	521,402.70
US TREASURY N/B	6,160,000.00	5,721,777.60
US TREASURY N/B	150,000.00	150,720.00
US TREASURY N/B	730,000.00	535,265.20
US TREASURY N/B	5,720,000.00	5,395,332.80
US TREASURY N/B	170,000.00	172,602.70
US TREASURY N/B	820,000.00	629,727.20
US TREASURY N/B	2,870,000.00	2,799,799.80
US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,623,404.50
US TREASURY N/B	890,000.00	698,614.40
US TREASURY N/B	170,000.00	153,384.20
US TREASURY N/B	270,000.00	264,988.80
US TREASURY N/B	4,820,000.00	4,692,125.40
US TREASURY N/B	6,900,000.00	6,504,837.00
US TREASURY N/B	960,000.00	735,446.40
US TREASURY N/B	280,000.00	282,130.80
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,022,059.50
US TREASURY N/B	5,340,000.00	5,078,393.40
US TREASURY N/B	980,000.00	804,011.60
US TREASURY N/B	300,000.00	297,549.00
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,553,070.40
US TREASURY N/B	5,750,000.00	5,328,812.50
US TREASURY N/B	1,050,000.00	802,956.00
US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,462,481.00
US TREASURY N/B	4,050,000.00	3,693,721.50
US TREASURY N/B	300,000.00	305,670.00
US TREASURY N/B	1,020,000.00	760,654.80
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,016,950.00
US TREASURY N/B	3,630,000.00	3,173,237.10
US TREASURY N/B	950,000.00	619,979.50
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,173,904.20
US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,803,488.00
US TREASURY N/B	290,000.00	269,006.90
US TREASURY N/B	910,000.00	610,227.80
US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,073,008.00
US TREASURY N/B	3,790,000.00	3,238,517.10
US TREASURY N/B	280,000.00	271,488.00
US TREASURY N/B	1,130,000.00	692,430.10
US TREASURY N/B	140,000.00	150,150.00
US TREASURY N/B	2,070,000.00	1,846,978.20
US TREASURY N/B	890,000.00	542,828.80
US TREASURY N/B	300,000.00	308,694.00
US TREASURY N/B	2,170,000.00	1,910,771.80
US TREASURY N/B	4,980,000.00	3,957,307.20
US TREASURY N/B	1,500,000.00	772,965.00
US TREASURY N/B	1,070,000.00	646,301.40
US TREASURY N/B	1,460,000.00	1,268,827.60
US TREASURY N/B	5,270,000.00	4,236,763.80
US TREASURY N/B	1,470,000.00	811,013.70
US TREASURY N/B	1,210,000.00	760,073.60

	US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,017,666.00	
	US TREASURY N/B	2,330,000.00	1,897,761.70	
	US TREASURY N/B	1,640,000.00	964,779.20	
	US TREASURY N/B	1,460,000.00	996,333.20	
	US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,095,267.20	
	US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,018,693.00	
	US TREASURY N/B	2,310,000.00	1,932,800.10	
	US TREASURY N/B	1,660,000.00	1,102,273.20	
	US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,228,509.80	
	US TREASURY N/B	900,000.00	793,719.00	
	US TREASURY N/B	1,260,000.00	911,421.00	
	US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,035,681.20	
	US TREASURY N/B	1,640,000.00	992,642.80	
	US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,082,711.60	
	US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,240,782.40	
	US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,454,653.50	
	US TREASURY N/B	2,450,000.00	1,984,010.00	
	US TREASURY N/B	1,530,000.00	894,988.80	
	US TREASURY N/B	300,000.00	247,662.00	
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	961,674.00	
	US TREASURY N/B	1,940,000.00	1,702,350.00	
	US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,453,732.50	
	US TREASURY N/B	2,330,000.00	1,951,910.90	
	US TREASURY N/B	1,380,000.00	887,229.60	
	US TREASURY N/B	310,000.00	255,033.90	
	US TREASURY N/B	1,120,000.00	816,760.00	
	US TREASURY N/B	290,000.00	233,267.30	
	US TREASURY N/B	1,330,000.00	985,383.70	
	US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,020,457.60	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	835,030.00	
	US TREASURY N/B	2,180,000.00	1,941,290.00	
	US TREASURY N/B	1,260,000.00	958,482.00	
	US TREASURY N/B	850,000.00	721,667.00	
	US TREASURY N/B	350,000.00	270,032.00	
	US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,826,201.60	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,172,236.00	
	US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,163,131.20	
	US TREASURY N/B	850,000.00	787,941.50	
	US TREASURY NOTES	150,000.00	165,873.00	
	WI TREASURY SEC.	290,000.00	286,612.80	
	WI TREASURY SEC.	1,330,000.00	663,177.90	
	WI TREASURY SEC.	4,340,000.00	3,479,117.60	
	WI TREASURY SEC.	280,000.00	274,878.80	
	WI TREASURY SEC.	280,000.00	253,366.40	
	アメリカ・ドル 小計	272,350,000.00 (40,896,076,000)	240,513,234.40 (36,115,467,277)	
イギリス・ポンド	UNITED KINGDOM GILT	230,000.00	208,044.20	
	UNITED KINGDOM GILT	570,000.00	579,507.60	
	UNITED KINGDOM GILT	500,000.00	413,675.00	

UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	364,297.50	
UNITED KINGDOM GILT	190,000.00	194,480.20	
UNITED KINGDOM GILT	110,000.00	108,533.70	
UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	285,939.50	
UNITED KINGDOM GILT	130,000.00	124,889.70	
UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	353,158.00	
UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	384,511.50	
UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	251,711.30	
UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	308,208.00	
UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	221,263.00	
UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	338,238.00	
UNITED KINGDOM GILT	420,000.00	235,191.60	
UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	354,144.00	
UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	237,321.00	
UNITED KINGDOM GILT	390,000.00	370,866.60	
UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	352,313.50	
UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	309,852.20	
UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	359,320.40	
UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	306,860.20	
UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	155,828.80	
UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	151,465.60	
UNITED KINGDOM GILT	320,000.00	329,568.00	
UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	283,970.90	
UNITED KINGDOM GILT	260,000.00	282,978.80	
UNITED KINGDOM GILT	450,000.00	471,654.00	
UNITED KINGDOM GILT	310,000.00	160,883.80	
UNITED KINGDOM GILT	300,000.00	272,220.00	
UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	304,884.00	
UNITED KINGDOM GILT	370,000.00	352,003.20	
UNITED KINGDOM GILT	340,000.00	330,786.00	
UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	380,832.20	
UNITED KINGDOM GILT	440,000.00	438,345.60	
UNITED KINGDOM GILT	560,000.00	340,037.60	
UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	317,544.00	
UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	144,368.70	
UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	351,150.40	
UNITED KINGDOM GILT	350,000.00	301,017.50	
UNITED KINGDOM GILT	400,000.00	159,464.00	
UNITED KINGDOM GILT	470,000.00	318,848.00	
UNITED KINGDOM GILT	620,000.00	472,737.60	
UNITED KINGDOM GILT	360,000.00	177,094.80	
UNITED KINGDOM GILT	610,000.00	552,226.90	
UNITED KINGDOM GILT	590,000.00	286,197.20	
UNITED KINGDOM GILT	530,000.00	340,196.40	
UNITED KINGDOM GILT	620,000.00	524,501.40	
UNITED KINGDOM GILT	600,000.00	450,690.00	
UNITED KINGDOM GILT	490,000.00	469,988.40	
UNITED KINGDOM GILT	380,000.00	192,428.20	
UNITED KINGDOM GILT	790,000.00	630,143.50	
UNITED KINGDOM GILT	240,000.00	86,786.40	

	UNITED KINGDOM GILT	290,000.00	274,690.90	
	UNITED KINGDOM GILT	430,000.00	431,096.50	
	UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	489,225.60	
	UNITED KINGDOM GILT	710,000.00	708,438.00	
	UNITED KINGDOM GILT	480,000.00	449,097.60	
	UNITED KINGDOM GILT	730,000.00	686,499.30	
	UNITED KINGDOM GILT	800,000.00	786,840.00	
	UNITED KINGDOM GILT	610,000.00	526,497.10	
イギリス・ポンド 小計		25,520,000.00 (4,838,081,600)	21,045,553.60 (3,989,816,051)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND	320,000.00	317,200.00	
	ISRAEL FIXED BOND	590,000.00	555,219.50	
	ISRAEL FIXED BOND	630,000.00	616,833.00	
	ISRAEL FIXED BOND	330,000.00	356,664.00	
	ISRAEL FIXED BOND	580,000.00	560,251.00	
	ISRAEL FIXED BOND	830,000.00	704,711.50	
	ISRAEL FIXED BOND	430,000.00	477,171.00	
	ISRAEL FIXED BOND	560,000.00	502,040.00	
	ISRAEL FIXED BOND	580,000.00	413,163.00	
	ISRAEL FIXED BOND	520,000.00	502,736.00	
	ISRAEL FIXED BOND	470,000.00	440,460.50	
	ISRAEL FIXED BOND	270,000.00	188,041.50	
ISRAEL FIXED BOND	610,000.00	495,899.50		
イスラエル・シュケル 小計		6,720,000.00 (273,912,576)	6,130,390.50 (249,879,621)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	410,000.00	384,719.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	170,000.00	175,909.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	460,000.00	447,515.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	530,000.00	543,689.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	450,000.00	454,293.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	330,000.00	286,235.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	460,000.00	456,214.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	290,000.00	273,913.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	230,000.00	200,831.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	380,000.00	357,454.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	405,354.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	310,000.00	241,570.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	305,571.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	410,000.00	386,326.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	510,000.00	469,908.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	254,310.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	540,000.00	453,778.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	670,000.00	536,830.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	430,000.00	353,834.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	440,000.00	413,622.00	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	430,000.00	242,386.70		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	680,000.00	542,150.40		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	570,000.00	524,941.50		

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	580,000.00	478,813.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	471,291.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	470,000.00	483,916.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	410,000.00	395,084.20	
	オーストラリア・ドル 小計	11,740,000.00 (1,155,333,400)	10,540,468.10 (1,037,287,466)	
オフショア・人 民元	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,464,328.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,041,650.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,242,598.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,012,630.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,400,000.00	8,594,040.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,336,374.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	8,852,503.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,900,000.00	8,031,298.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,600,000.00	17,648,576.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,992,440.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	7,488,726.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	11,346,330.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,999,940.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000.00	6,440,448.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	21,400,000.00	21,441,302.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	12,300,000.00	12,441,204.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,800,000.00	3,041,360.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	11,400,000.00	11,542,272.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,544,850.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	5,916,174.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,014,120.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,338,637.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	2,312,471.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,458,396.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	720,000.00	741,873.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,223,352.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,260,000.00	1,515,313.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,041,240.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000.00	4,456,760.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	5,554,818.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,340,000.00	3,443,540.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,650,000.00	4,261,630.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,219,360.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,655,796.00	
CHINA GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,682,800.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	6,700,000.00	6,758,759.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000.00	6,103,350.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,591,440.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	5,500,000.00	5,506,710.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	4,100,000.00	4,189,257.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,837,104.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,018,090.00		
CHINA GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,527,020.00		

	CHINA GOVERNMENT BOND	8,300,000.00	8,306,972.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,300,000.00	5,375,843.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,300,000.00	10,365,920.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,800,000.00	6,317,940.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,700,000.00	5,836,572.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,518,375.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,900,000.00	7,058,217.00	
	オフショア・人民元 小計	296,870,000.00 (6,187,275,479)	303,650,719.90 (6,328,597,209)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	395,224.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	219,952.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	215,303.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	220,000.00	222,105.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	340,000.00	336,810.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	440,000.00	433,334.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	420,000.00	414,544.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	470,000.00	460,491.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	430,000.00	431,268.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	360,000.00	367,088.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	482,990.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	90,000.00	86,170.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	240,000.00	213,801.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	138,870.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	130,774.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	250,000.00	243,140.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	160,852.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	188,108.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	165,173.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	140,662.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	190,000.00	223,403.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	180,000.00	192,366.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	880,000.00	659,709.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	140,000.00	131,674.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	720,000.00	628,977.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	170,000.00	164,366.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	610,000.00	575,785.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	620,000.00	508,976.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	370,644.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	697,040.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	390,000.00	362,852.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	670,000.00	466,346.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	660,000.00	570,022.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	360,000.00	334,094.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	270,000.00	261,090.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	530,000.00	472,691.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	110,000.00	103,020.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	360,000.00	348,361.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	230,000.00	225,193.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	460,000.00	425,017.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	327,987.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	320,000.00	317,225.60	
カナダ・ドル	小計	14,970,000.00 (1,661,969,400)	13,813,510.60 (1,533,575,947)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	60,000.00	59,683.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	205,002.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	134,992.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	138,950.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	220,000.00	217,096.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	153,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	160,000.00	156,320.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	180,000.00	165,193.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	137,830.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	100,000.00	91,798.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	140,000.00	112,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	210,000.00	212,625.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	197,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	170,000.00	162,166.40	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	108,612.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	130,000.00	104,318.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	150,000.00	142,890.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	110,000.00	112,035.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	120,000.00	116,124.00	
SINGAPORE GOVERNMENT	70,000.00	69,615.00		
シンガポール・ドル	小計	2,920,000.00 (326,251,600)	2,798,650.50 (312,693,220)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,820,000.00	1,804,639.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,850,000.00	1,769,525.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,110,000.00	1,097,534.70	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,640,000.00	1,528,627.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,520,000.00	1,390,526.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	930,000.00	1,035,815.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,250,000.00	1,064,800.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,080,000.00	1,019,422.80	
スウェーデン・クローナ	小計	11,200,000.00 (162,512,000)	10,710,891.10 (155,415,030)	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK	780,000.00	765,312.60	
	KINGDOM OF DENMARK	1,550,000.00	1,523,216.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,420,000.00	1,322,318.20	
	KINGDOM OF DENMARK	1,230,000.00	1,107,356.70	
	KINGDOM OF DENMARK	1,350,000.00	723,384.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,550,000.00	1,292,498.50	
	KINGDOM OF DENMARK	2,260,000.00	2,809,315.60	
デンマーク・クローネ	小計	10,140,000.00 (220,849,200)	9,543,401.60 (207,855,287)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	110,000.00	108,836.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	240,000.00	232,934.40	

	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	99,224.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	250,000.00	231,047.50	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	130,000.00	102,055.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	170,000.00	136,674.90	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	160,000.00	133,067.20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	270,000.00	243,950.40	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	100,000.00	61,892.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	150,000.00	98,637.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	290,000.00	263,233.00	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	180,000.00	146,314.80	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	120,000.00	114,168.00	
ニュージーランド・ドル 小計		2,270,000.00 (210,270,100)	1,972,034.60 (182,669,565)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,110,000.00	1,039,448.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,350,000.00	1,313,887.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,170,000.00	1,113,512.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,110,000.00	1,043,166.90	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	910,000.00	846,281.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	930,000.00	836,860.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,240,000.00	1,070,033.20	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	930,000.00	775,573.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	440,000.00	433,351.60	
ノルウェー・クローネ 小計		10,140,000.00 (145,306,200)	9,309,122.80 (133,399,730)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	810,000.00	843,833.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,030,000.00	1,004,857.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,230,000.00	1,160,664.90	
	POLAND GOVERNMENT BOND	710,000.00	654,357.30	
	POLAND GOVERNMENT BOND	840,000.00	767,869.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,070,000.00	945,644.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	850,000.00	870,060.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	770,000.00	733,663.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND	880,000.00	686,875.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	760,000.00	671,482.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	614,456.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	730,000.00	702,325.70	
ポーランド・ズロチ 小計		11,480,000.00 (431,753,616)	10,747,230.80 (404,194,753)	
マレーシア・リ ンギット	MALAYSIA GOVERNMENT	330,000.00	342,738.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	550,000.00	552,216.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	635,833.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	410,000.00	408,942.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	190,000.00	209,853.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	617,167.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	680,000.00	685,140.80	

	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	366,973.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	380,000.00	389,800.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	320,000.00	328,611.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	370,000.00	374,399.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	240,000.00	259,699.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	590,000.00	637,028.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	530,000.00	536,741.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	342,074.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	500,000.00	547,655.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	361,199.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	440,000.00	444,998.40	
	MALAYSIA GOVERNMENT	360,000.00	398,685.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	250,000.00	252,910.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	460,000.00	457,815.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	540,000.00	520,975.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	610,000.00	597,287.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	340,000.00	315,305.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	390,000.00	382,207.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	530,000.00	571,954.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	230,000.00	239,275.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	340,190.40	
	マレーシア・リンギット 小計	11,840,000.00 (370,413,216)	12,117,680.30 (379,100,416)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,900,000.00	2,719,591.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	600,000.00	545,940.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,950,000.00	1,882,998.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,520,000.00	2,265,177.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,310,000.00	8,578,978.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,070,000.00	6,052,697.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,850,000.00	9,077,563.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,840,000.00	5,075,894.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,650,000.00	1,745,766.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,820,000.00	7,387,241.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,240,000.00	6,053,236.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,610,000.00	4,312,147.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,020,000.00	7,173,168.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,200,000.00	3,039,936.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,600,000.00	3,944,868.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,050,000.00	5,395,208.50	
	メキシコ・ペソ 小計	82,230,000.00 (723,944,697)	75,250,413.10 (662,497,112)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	240,000.00	235,476.00	
	BELGIUM KINGDOM	90,000.00	92,005.20	
	BELGIUM KINGDOM	150,000.00	148,695.00	
	BELGIUM KINGDOM	450,000.00	535,410.00	
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	234,942.40	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	228,746.70	
	BELGIUM KINGDOM	210,000.00	211,652.70	
	BELGIUM KINGDOM	390,000.00	346,164.00	
	BELGIUM KINGDOM	260,000.00	268,551.40	

BELGIUM KINGDOM	500,000.00	484,710.00	
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	171,498.00	
BELGIUM KINGDOM	370,000.00	355,066.80	
BELGIUM KINGDOM	240,000.00	173,419.20	
BELGIUM KINGDOM	190,000.00	143,381.60	
BELGIUM KINGDOM	370,000.00	348,066.40	
BELGIUM KINGDOM	160,000.00	124,748.80	
BELGIUM KINGDOM	160,000.00	131,531.20	
BELGIUM KINGDOM	460,000.00	510,728.80	
BELGIUM KINGDOM	380,000.00	352,294.20	
BELGIUM KINGDOM	250,000.00	219,250.00	
BELGIUM KINGDOM	420,000.00	384,472.20	
BELGIUM KINGDOM	240,000.00	171,561.60	
BELGIUM KINGDOM	320,000.00	272,784.00	
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	129,184.00	
BELGIUM KINGDOM	240,000.00	217,989.60	
BELGIUM KINGDOM	390,000.00	441,979.20	
BELGIUM KINGDOM	310,000.00	252,126.10	
BELGIUM KINGDOM	140,000.00	59,015.60	
BELGIUM KINGDOM	340,000.00	278,980.20	
BELGIUM KINGDOM	230,000.00	147,133.30	
BELGIUM KINGDOM	120,000.00	114,115.20	
BELGIUM KINGDOM	400,000.00	404,580.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	538,358.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	290,000.00	299,407.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	554,266.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	180,000.00	184,962.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	98,731.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	319,273.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	360,000.00	433,728.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	673,880.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	529,004.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	494,172.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	566,024.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	529,561.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	498,661.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	650,000.00	640,906.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	509,054.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	430,000.00	375,136.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	298,415.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	640,000.00	613,702.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	570,000.00	546,168.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	460,000.00	428,871.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	532,302.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	620,000.00	584,188.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	347,944.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	519,687.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	646,023.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	507,243.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	437,659.30	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	421,262.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	560,000.00	492,279.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	580,000.00	500,424.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	500,005.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	309,948.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	475,712.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	269,090.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	590,000.00	528,203.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	470,000.00	533,849.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	306,675.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	462,795.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	530,000.00	431,292.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	170,000.00	82,720.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	630,000.00	563,232.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	320,000.00	229,984.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	430,034.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	260,000.00	168,139.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	459,530.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	540,000.00	447,606.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	490,000.00	470,390.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	440,000.00	293,233.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	610,000.00	545,327.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	510,000.00	487,565.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	260,000.00	249,657.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	520,000.00	518,024.00	
BUNDESobligation	650,000.00	650,702.00	
BUNDESobligation	80,000.00	79,068.00	
BUNDESobligation	510,000.00	492,211.20	
BUNDESobligation	610,000.00	582,196.20	
BUNDESobligation	170,000.00	162,501.30	
BUNDESobligation	610,000.00	576,254.80	
BUNDESobligation	530,000.00	495,550.00	
BUNDESobligation	480,000.00	444,168.00	
BUNDESobligation	660,000.00	634,378.80	
BUNDESobligation	200,000.00	192,496.00	
BUNDESobligation	550,000.00	545,545.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	140,000.00	139,813.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	140,000.00	119,098.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	684,197.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	290,000.00	291,392.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	110,000.00	108,354.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	702,225.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	554,735.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000.00	660,402.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	730,000.00	698,310.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	540,000.00	655,835.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	675,367.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	626,885.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	720,000.00	674,056.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	420,000.00	509,174.40	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	470,000.00	605,538.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	830,000.00	637,166.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	576,277.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	630,000.00	574,635.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	587,561.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	650,000.00	573,865.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	870,000.00	452,226.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	430,000.00	470,996.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	532,670.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	457,350.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	520,000.00	397,196.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	740,000.00	639,389.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	722,380.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	210,000.00	181,658.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	620,000.00	529,777.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	570,000.00	422,917.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	220,000.00	114,945.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	591,605.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	538,026.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	169,072.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	331,931.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000.00	567,534.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	260,000.00	315,226.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	670,000.00	661,122.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	409,020.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	581,842.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	580,000.00	572,715.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	590,000.00	501,146.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	840,000.00	838,462.80	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	390,000.00	386,880.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	400,000.00	398,364.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	380,000.00	380,592.80	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	420,000.00	421,512.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	326,905.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	369,785.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	354,529.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	226,560.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	314,126.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	460,354.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	388,512.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	427,102.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	270,000.00	271,231.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	443,639.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	319,129.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	270,000.00	279,657.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	110,000.00	109,341.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	199,626.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	457,077.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	692,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	701,344.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	334,951.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	488,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	650,000.00	654,108.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	560,000.00	485,077.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	570,000.00	605,636.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	440,734.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	710,000.00	823,316.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	319,549.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	483,210.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	315,160.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	446,923.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	210,000.00	152,000.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	395,441.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	417,598.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	361,849.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	414,821.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	288,667.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	530,000.00	507,167.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	670,000.00	736,309.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	490,385.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	332,612.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	327,334.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	501,625.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	271,222.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	633,412.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	443,665.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	487,324.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	520,000.00	568,001.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	266,470.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	340,000.00	258,889.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	590,000.00	647,814.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	390,000.00	378,908.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	359,818.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	471,601.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	510,000.00	453,772.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	263,369.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	417,819.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	540,000.00	452,190.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	223,916.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	263,302.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	380,535.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	187,803.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	444,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	90,105.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	320,382.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	379,049.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	407,862.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	412,535.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	480,000.00	449,217.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	440,000.00	391,063.20	

BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	400,348.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	392,184.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	669,468.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	313,383.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	373,285.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	430,000.00	424,917.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	131,688.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	370,000.00	361,704.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	320,000.00	300,870.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	349,156.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	420,000.00	383,846.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	340,868.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	280,000.00	254,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	392,688.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	260,000.00	262,672.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	380,000.00	381,903.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	495,032.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	410,000.00	419,594.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	402,896.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	220,000.00	224,606.80	
DEUTSCHLAND REP	360,000.00	401,968.80	
DEUTSCHLAND REP	300,000.00	338,205.00	
DEUTSCHLAND REP	300,000.00	329,001.00	
DEUTSCHLAND REP	470,000.00	563,938.90	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	86,801.40	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	142,028.60	
FINNISH GOVERNMENT	70,000.00	70,678.30	
FINNISH GOVERNMENT	50,000.00	49,158.00	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	120,536.40	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	112,551.60	
FINNISH GOVERNMENT	110,000.00	96,175.20	
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	145,255.50	
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	142,902.00	
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	139,029.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	84,919.00	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	94,697.20	
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	133,381.50	
FINNISH GOVERNMENT	120,000.00	85,395.60	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	101,177.00	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	57,420.00	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	109,257.20	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	46,701.00	
FINNISH GOVERNMENT	140,000.00	115,369.80	
FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	145,438.40	
FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	83,891.70	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	63,026.00	
FINNISH GOVERNMENT	130,000.00	117,486.20	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	96,019.00	
FRANCE (GOVT OF)	520,000.00	487,609.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,040,000.00	1,032,657.60	

FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	1,302,834.00	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	803,320.00	
FRANCE (GOVT OF)	830,000.00	842,856.70	
FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	737,969.40	
FRANCE (GOVT OF)	450,000.00	474,714.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	99,319.00	
FRANCE (GOVT OF)	180,000.00	171,963.00	
FRANCE (GOVT OF)	670,000.00	670,495.80	
FRANCE (GOVT OF)	630,000.00	660,384.90	
FRANCE (GOVT OF)	1,370,000.00	1,358,642.70	
FRANCE (GOVT OF)	920,000.00	889,870.00	
FRANCE (GOVT OF)	870,000.00	841,290.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,370,000.00	1,265,277.20	
FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	998,888.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,120,000.00	1,064,201.60	
FRANCE (GOVT OF)	380,000.00	257,279.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,040,000.00	855,462.40	
FRANCE (GOVT OF)	880,000.00	822,439.20	
FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	612,411.60	
FRANCE (GOVT OF)	910,000.00	862,552.60	
FRANCE (GOVT OF)	680,000.00	536,812.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,390,000.00	1,285,472.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,020,000.00	874,323.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	1,191,476.00	
FRANCE (GOVT OF)	590,000.00	653,218.50	
FRANCE (GOVT OF)	840,000.00	988,033.20	
FRANCE (GOVT OF)	730,000.00	504,043.10	
FRANCE (GOVT OF)	1,290,000.00	1,156,420.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,050,000.00	1,013,365.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,060,000.00	912,649.40	
FRANCE (GOVT OF)	740,000.00	400,687.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,010,000.00	954,439.90	
FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	983,492.70	
FRANCE (GOVT OF)	440,000.00	504,433.60	
FRANCE (GOVT OF)	1,260,000.00	1,054,645.20	
FRANCE (GOVT OF)	570,000.00	379,471.80	
FRANCE (GOVT OF)	290,000.00	112,604.10	
FRANCE (GOVT OF)	490,000.00	293,769.70	
FRANCE (GOVT OF)	1,190,000.00	967,362.90	
FRANCE (GOVT OF)	920,000.00	848,654.00	
FRANCE (GOVT OF)	690,000.00	365,493.00	
FRANCE (GOVT OF)	820,000.00	656,254.20	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	483,630.00	
FRANCE (GOVT OF)	420,000.00	330,972.60	
FRANCE (GOVT OF)	780,000.00	955,219.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,090,000.00	1,011,923.30	
FRANCE (GOVT OF)	1,030,000.00	969,034.30	
FRANCE (GOVT OF)	440,000.00	497,173.60	
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	268,365.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	60,000.00	59,044.80	

IRELAND GOVERNMENT BOND	240,000.00	202,452.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	208,068.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	260,000.00	250,484.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	147,922.10	
IRELAND GOVERNMENT BOND	190,000.00	177,779.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	120,000.00	106,702.80	
IRELAND GOVERNMENT BOND	150,000.00	138,394.50	
IRELAND GOVERNMENT BOND	230,000.00	213,840.20	
IRELAND GOVERNMENT BOND	200,000.00	145,398.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	120,000.00	93,042.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	250,000.00	255,397.50	
IRELAND GOVERNMENT BOND	170,000.00	157,584.90	
IRELAND GOVERNMENT BOND	180,000.00	154,436.40	
IRELAND GOVERNMENT BOND	210,000.00	172,592.70	
IRELAND GOVERNMENT BOND	90,000.00	61,056.00	
IRELAND GOVERNMENT BOND	80,000.00	80,406.40	
IRISH GOVERNMENT BOND	110,000.00	90,781.90	
ITALIAN GOVT	220,000.00	243,218.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	266,959.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	220,000.00	219,368.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	110,000.00	117,438.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	449,685.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	340,000.00	337,681.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	430,000.00	413,660.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	420,000.00	398,710.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	390,000.00	367,138.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	420,000.00	389,104.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	452,876.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	239,498.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	248,451.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	310,000.00	264,194.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	410,000.00	464,464.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	324,733.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	380,000.00	183,049.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	330,000.00	274,022.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	270,000.00	184,169.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	290,000.00	320,861.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	280,000.00	247,741.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	330,000.00	312,721.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	253,398.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	190,000.00	162,197.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	100,904.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	91,060.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	104,165.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	90,000.00	90,143.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	201,001.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	115,373.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	191,031.70	
REPUBLIC OF AUSTRIA	290,000.00	281,795.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA	340,000.00	322,932.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	220,000.00	163,314.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	320,000.00	298,860.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	60,000.00	36,118.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	98,554.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	233,578.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	259,918.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	369,626.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	269,781.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	190,000.00	197,379.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	255,870.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	122,545.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	84,667.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	45,423.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	340,000.00	281,146.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	80,000.00	36,148.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	192,774.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	180,000.00	128,381.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	185,598.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	280,000.00	242,516.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	140,000.00	110,143.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	147,255.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	360,000.00	361,688.40	
	ユーロ 小計	162,380,000.00 (26,360,769,200)	151,244,925.90 (24,553,101,271)	
国債証券	合計	83,964,718,284 (83,964,718,284)	76,245,549,955 (76,245,549,955)	
合計			76,245,549,955 (76,245,549,955)	

(注)

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 141銘柄	46.89	47.37
イギリス・ポンド	国債証券 61銘柄	5.18	5.23
イスラエル・シェケル	国債証券 13銘柄	0.32	0.33
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.35	1.36
オフショア・人民元	国債証券 50銘柄	8.22	8.30
カナダ・ドル	国債証券 42銘柄	1.99	2.01
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	0.41	0.41
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.20	0.20
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.27	0.27
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	0.24	0.24
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	0.17	0.17
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.52	0.53
マレーシア・リンギット	国債証券 28銘柄	0.49	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	0.86	0.87
ユーロ	国債証券 381銘柄	31.88	32.20

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

中間財務諸表

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2024年2月22日から2024年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2024年2月22日から2024年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2024年2月22日から2024年8月21日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月19日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の2024年2月22日から2024年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の2024年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月22日から2024年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

【DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 2024年2月21日現在	第22期中間計算期間 2024年8月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	15,278,530	59,215,256
コール・ローン	1,506,714,765	1,564,232,466
親投資信託受益証券	28,687,946,950	30,419,683,047
未収入金	66,234,743	22,733,133
流動資産合計	30,276,174,988	32,065,863,902
資産合計	30,276,174,988	32,065,863,902
負債の部		
流動負債		
未払解約金	69,198,482	23,385,172
未払受託者報酬	3,165,105	3,446,515
未払委託者報酬	18,990,776	20,679,374
その他未払費用	555,920	372,249
流動負債合計	91,910,283	47,883,310
負債合計	91,910,283	47,883,310
純資産の部		
元本等		
元本	13,465,469,203	14,098,332,724
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	16,718,795,502	17,919,647,868
（分配準備積立金）	4,830,748,690	4,471,246,489
元本等合計	30,184,264,705	32,017,980,592
純資産合計	30,184,264,705	32,017,980,592
負債純資産合計	30,276,174,988	32,065,863,902

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第21期中間計算期間 自 2023年2月22日 至 2023年8月21日	第22期中間計算期間 自 2024年2月22日 至 2024年8月21日
営業収益		
受取利息	12,837	530,267
有価証券売買等損益	1,461,658,910	407,722,054
営業収益合計	1,461,671,747	408,252,321
営業費用		
支払利息	358,212	8,658
受託者報酬	2,890,987	3,446,515
委託者報酬	17,346,091	20,679,374
その他費用	537,272	375,560
営業費用合計	21,132,562	24,510,107
営業利益又は営業損失(△)	1,440,539,185	383,742,214
経常利益又は経常損失(△)	1,440,539,185	383,742,214
中間純利益又は中間純損失(△)	1,440,539,185	383,742,214
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	61,110,696	38,171,783
期首剰余金又は期首欠損金(△)	12,520,607,945	16,718,795,502
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,271,968,545	2,184,334,146
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,271,968,545	2,184,334,146
剰余金減少額又は欠損金増加額	774,850,410	1,329,052,211
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	774,850,410	1,329,052,211
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	14,397,154,569	17,919,647,868

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第22期中間計算期間	
	自 2024年2月22日	至 2024年8月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第21期	第22期中間計算期間
	2024年2月21日現在	2024年8月21日現在
1. 期首元本額	12,591,918,256円	13,465,469,203円
期中追加設定元本額	2,552,719,943円	1,701,302,027円
期中一部解約元本額	1,679,168,996円	1,068,438,506円
2. 受益権の総数	13,465,469,203口	14,098,332,724口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第21期	第22期中間計算期間
	2024年2月21日現在	2024年8月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額ははありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額ははありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第21期 2024年2月21日現在	第22期中間計算期間 2024年8月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,2416円 (22,416円)	2,2710円 (22,710円)

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月19日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の2024年2月22日から2024年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の2024年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月22日から2024年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

【DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 2024年2月21日現在	第22期中間計算期間 2024年8月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	37,412,505	146,552,971
コール・ローン	3,689,489,396	3,871,348,906
親投資信託受益証券	70,657,601,050	75,737,484,077
未収入金	83,952,135	36,802,657
流動資産合計	74,468,455,086	79,792,188,611
資産合計	74,468,455,086	79,792,188,611
負債の部		
流動負債		
未払解約金	87,092,095	37,382,815
未払受託者報酬	7,621,336	8,592,575
未払委託者報酬	45,728,276	51,555,666
その他未払費用	1,002,990	753,520
流動負債合計	141,444,697	98,284,576
負債合計	141,444,697	98,284,576
純資産の部		
元本等		
元本	24,504,201,805	25,625,104,632
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	49,822,808,584	54,068,799,403
（分配準備積立金）	19,627,042,621	18,555,780,480
元本等合計	74,327,010,389	79,693,904,035
純資産合計	74,327,010,389	79,693,904,035
負債純資産合計	74,468,455,086	79,792,188,611

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第21期中間計算期間 自 2023年2月22日 至 2023年8月21日	第22期中間計算期間 自 2024年2月22日 至 2024年8月21日
営業収益		
受取利息	28,816	1,311,963
有価証券売買等損益	4,747,411,306	1,893,348,493
営業収益合計	4,747,440,122	1,894,660,456
営業費用		
支払利息	803,816	21,258
受託者報酬	6,718,278	8,592,575
委託者報酬	40,309,912	51,555,666
その他費用	937,052	761,628
営業費用合計	48,769,058	60,931,127
営業利益又は営業損失(△)	4,698,671,064	1,833,729,329
経常利益又は経常損失(△)	4,698,671,064	1,833,729,329
中間純利益又は中間純損失(△)	4,698,671,064	1,833,729,329
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	151,527,682	124,790,644
期首剰余金又は期首欠損金(△)	35,131,252,073	49,822,808,584
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,494,157,964	5,406,149,583
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,494,157,964	5,406,149,583
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,873,946,883	2,869,097,449
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,873,946,883	2,869,097,449
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	41,298,606,536	54,068,799,403

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第22期中間計算期間 自 2024年2月22日 至 2024年8月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第21期 2024年2月21日現在	第22期中間計算期間 2024年8月21日現在
1. 期首元本額	22,536,136,173円	24,504,201,805円
期中追加設定元本額	4,340,901,715円	2,528,958,232円
期中一部解約元本額	2,372,836,083円	1,408,055,405円
2. 受益権の総数	24,504,201,805口	25,625,104,632口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第21期 2024年2月21日現在	第22期中間計算期間 2024年8月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額ははありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額ははありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第21期 2024年2月21日現在	第22期中間計算期間 2024年8月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,0332円 (30,332円)	3,1100円 (31,100円)

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月19日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役 会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の2024年2月22日から2024年8月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の2024年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月22日から2024年8月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

【DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 2024年2月21日現在	第22期中間計算期間 2024年8月21日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	23,920,821	97,206,034
コール・ローン	2,358,987,116	2,567,798,323
親投資信託受益証券	45,322,713,159	50,410,501,348
未収入金	119,805,316	53,232,900
流動資産合計	47,825,426,412	53,128,738,605
資産合計	47,825,426,412	53,128,738,605
負債の部		
流動負債		
未払解約金	125,288,730	55,131,763
未払受託者報酬	4,718,804	5,668,606
未払委託者報酬	28,313,073	34,011,847
その他未払費用	711,776	535,072
流動負債合計	159,032,383	95,347,288
負債合計	159,032,383	95,347,288
純資産の部		
元本等		
元本	11,958,594,696	12,835,723,029
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	35,707,799,333	40,197,668,288
（分配準備積立金）	14,012,086,196	12,963,513,636
元本等合計	47,666,394,029	53,033,391,317
純資産合計	47,666,394,029	53,033,391,317
負債純資産合計	47,825,426,412	53,128,738,605

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第21期中間計算期間 自 2023年2月22日 至 2023年8月21日	第22期中間計算期間 自 2024年2月22日 至 2024年8月21日
営業収益		
受取利息	16,452	863,474
有価証券売買等損益	3,580,875,485	1,715,840,417
営業収益合計	3,580,891,937	1,716,703,891
営業費用		
支払利息	459,549	13,629
受託者報酬	3,960,603	5,668,606
委託者報酬	23,763,852	34,011,847
その他費用	648,088	540,273
営業費用合計	28,832,092	40,234,355
営業利益又は営業損失(△)	3,552,059,845	1,676,469,536
経常利益又は経常損失(△)	3,552,059,845	1,676,469,536
中間純利益又は中間純損失(△)	3,552,059,845	1,676,469,536
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	144,396,983	154,022,960
期首剰余金又は期首欠損金(△)	22,932,786,202	35,707,799,333
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,316,573,550	5,866,260,576
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,316,573,550	5,866,260,576
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,714,911,687	2,898,838,197
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,714,911,687	2,898,838,197
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金(△)	27,942,110,927	40,197,668,288

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第22期中間計算期間	
	自 2024年2月22日	至 2024年8月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第21期	第22期中間計算期間
	2024年2月21日現在	2024年8月21日現在
1. 期首元本額	10,460,805,774円	11,958,594,696円
期中追加設定元本額	3,040,409,875円	1,843,949,562円
期中一部解約元本額	1,542,620,953円	966,821,229円
2. 受益権の総数	11,958,594,696口	12,835,723,029口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第21期	第22期中間計算期間
	2024年2月21日現在	2024年8月21日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額ははありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額ははありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第21期 2024年2月21日現在	第22期中間計算期間 2024年8月21日現在
1口当たり純資産額	3,986円	4,131円
(1万口当たり純資産額)	(39,860円)	(41,317円)

(参考)

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

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年8月21日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	232,182,012
コール・ローン	6,133,328,928
株式	242,420,835,240
派生商品評価勘定	122,694,000
未収配当金	289,361,253
差入委託証拠金	557,993,100
流動資産合計	249,756,394,533
資産合計	249,756,394,533
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	95,229,600
前受金	31,410,000
未払解約金	1,798,309,839
流動負債合計	1,924,949,439
負債合計	1,924,949,439
純資産の部	
元本等	
元本	77,693,815,011
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	170,137,630,083
元本等合計	247,831,445,094
純資産合計	247,831,445,094
負債純資産合計	249,756,394,533

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月22日 至 2024年8月21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>
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>
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>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年8月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	71,947,940,917円
同期中追加設定元本額	15,761,459,101円
同期中一部解約元本額	10,015,585,007円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイTOPIXオープン	5,185,187,188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)	3,026,104,779円
ニッセイ日本バランス (成長型) SA (適格機関投資家限定)	2,973,053円
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	2,128,544,830円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	7,783,110,344円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	6,802,100,525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)	1,999,493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)	3,118,432円
ニッセイインデックスバランス (成長型) SA (適格機関投資家限定)	8,659,163円
DCニッセイ国内株式インデックス	4,701,250,071円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	25,567,042,887円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	4,941,811,800円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	442,869,895円
DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	254,629,664円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	512,137,472円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	680,494,014円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	34,606,909円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)	140,175,448円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)	13,264,632円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート)	15,138,321円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート/債券)	5,268,622円
ニッセイ・インデックスパッケージ (国内・株式/リート/債券)	11,037,661円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	30,084,216円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	373,898,032円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	245,644,094円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	448,082,348円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	214,187,938円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド (適格機関投資家限定)	13,815,248,925円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド (GDP型バスケット)	30,013,903円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド (安定型)	30,744円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド (積極型)	68,524円
FWニッセイ国内株インデックス	93,180,296円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	165,863,204円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	15,882,210円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	105,374円
計	77,693,815,011円
2. 受益権の総数	77,693,815,011口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2024年8月21日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	5,098,830,000	—		5,126,400,000	27,570,000
合計	5,098,830,000	—		5,126,400,000	27,570,000

(注) 株価指数先物取引

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年8月21日現在
1口当たり純資産額	3.1898円
(1万口当たり純資産額)	(31,898円)

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年8月21日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	23,151,198
コール・ローン	611,562,944
国債証券	78,449,703,080
未収利息	205,004,856
前払費用	41,348,602
流動資産合計	79,330,770,680
資産合計	79,330,770,680
負債の部	
流動負債	
未払金	793,231,360
未払解約金	101,147,144
流動負債合計	894,378,504
負債合計	894,378,504
純資産の部	
元本等	
元本	61,276,259,179
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	17,160,132,997
元本等合計	78,436,392,176
純資産合計	78,436,392,176
負債純資産合計	79,330,770,680

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月22日 至 2024年8月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。ただし、買付後の最初の利払日までは個別法に基づいております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。ただし、償還までの残存期間が1年以内の債券については、償却原価法によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年8月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	57,048,145,189円
同期中追加設定元本額	15,843,467,548円
同期中一部解約元本額	11,615,353,558円
元本の内訳	
ファンド名	
ニッセイ国内債券インデックスSA (適格機関投資家限定)	1,660,106,106円
DCニッセイ国内債券インデックス	7,780,059,068円
ニッセイ日本バランス (成長型) SA (適格機関投資家限定)	3,767,005円
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	10,921,707,513円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	17,885,894,872円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	5,855,965,781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)	12,717,249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)	8,478,648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)	10,975,518円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	5,865,060,149円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	11,258,214,000円
ニッセイ日経225高値参照型アロケーションファンド	12,400,953円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド (安定型)	557,275円
ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランスファンド (積極型)	355,042円
計	61,276,259,179円
2. 受益権の総数	61,276,259,179口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年8月21日現在
1口当たり純資産額	1,2800円
(1万口当たり純資産額)	(12,800円)

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年8月21日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	3,404,311,219
金銭信託	485,579,508
コール・ローン	12,827,086,930
株式	1,000,755,310,115
投資証券	19,422,691,656
派生商品評価勘定	482,326,956
未収入金	758,765,797
未収配当金	1,091,490,076
差入委託証拠金	13,455,843,169
流動資産合計	1,052,683,405,426
資産合計	1,052,683,405,426
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	162,871,382
未払金	1,558,974,358
未払解約金	667,925,541
流動負債合計	2,389,771,281
負債合計	2,389,771,281
純資産の部	
元本等	
元本	234,632,191,925
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	815,661,442,220
元本等合計	1,050,293,634,145
純資産合計	1,050,293,634,145
負債純資産合計	1,052,683,405,426

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月22日 至 2024年8月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として国内における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、残額については入金時に計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年8月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	223,769,394,697円
同期中追加設定元本額	25,878,836,683円
同期中一部解約元本額	15,016,039,455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）	749,331,286円
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）	3,674,982,934円
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）	3,611,845,489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）	2,316,831,437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）	703,022円
ニッセイインデックスバランス（標準型）SA（適格機関投資家限定）	1,464,892円
ニッセイインデックスバランス（成長型）SA（適格機関投資家限定）	4,627,896円
ニッセイ外国株式インデックスファンドII（適格機関投資家限定）	491,819,740円

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	161,172,747,230円
DCニッセイ外国株式インデックス	43,760,333,363円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)	3,415,714,630円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	448,447,220円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	179,293,826円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	512,824,004円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	641,901,600円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	9,270,966円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)	89,552,647円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	9,031,496円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	10,326,517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)	3,596,701円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)	20,527,009円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	378,132,859円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	246,858,625円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	446,410,688円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	151,836,049円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適 格機関投資家限定)	125,386,001円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バス ケット)	276,146,581円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適 格機関投資家限定)	126,299,638円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01(適 格機関投資家限定)	123,711,041円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05(適 格機関投資家限定)	123,192,011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)	110,045,439円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)	31,021,708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)	10,745,936,327円
FWニッセイ先進国株インデックス	49,114,891円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	168,203,073円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンドII2023-05 (適格機関投資家限定)	79,980,467円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	173,224,650円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-02(適 格機関投資家限定)	78,238,678円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	107,018円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-08(適 格機関投資家限定)	73,172,276円
計	234,632,191,925円
2. 受益権の総数	234,632,191,925口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年8月21日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	10,071,958,929	—	9,990,423,540		△81,535,389
イギリス・ポンド	6,605,818,512	—	6,525,769,661		△80,048,851
ユーロ	1,049,871,244	—	1,052,700,478		2,829,234
合計	2,416,269,173	—	2,411,953,401		△4,315,772
合計	10,071,958,929	—	9,990,423,540		△81,535,389

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

株式関連

種類	2024年8月21日現在			
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	26,971,538,008	—	27,372,528,971	400,990,963
合計	26,971,538,008	—	27,372,528,971	400,990,963

(注) 株価指数先物取引

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

2024年8月21日現在	
1口当たり純資産額	4,4763円
(1万口当たり純資産額)	(44,763円)

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年8月21日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	337,137,829
金銭信託	10,675,977
コール・ローン	282,017,022
国債証券	85,382,858,557
派生商品評価勘定	17,504
未収利息	500,701,348
前払費用	54,643,359
流動資産合計	86,568,051,596
資産合計	86,568,051,596
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	858,693
未払金	518,756,220
未払解約金	146,923,669
流動負債合計	666,538,582
負債合計	666,538,582
純資産の部	
元本等	
元本	49,521,933,411
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	36,379,579,603
元本等合計	85,901,513,014
純資産合計	85,901,513,014
負債純資産合計	86,568,051,596

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月22日 至 2024年8月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<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. 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	2024年8月21日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	45,245,373,230円
同期中追加設定元本額	9,942,158,456円
同期中一部解約元本額	5,665,598,275円
元本の内訳	
ファンド名	
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	3,629,674,564円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,668,192,759円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,911,230,793円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	957,445,313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)	1,747,361円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	1,792,400円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,044,965円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	16,492,369,012円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	8,481,690,507円
DCニッセイ外国債券インデックス	5,110,744,115円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	370,060,269円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	2,172,934,377円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	427,695,183円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	619,833,838円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	49,131,619円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	222,517,050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)	22,990,342円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	52,515,393円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	310,489,148円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	205,166,920円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	380,655,510円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	209,854,414円
FWニッセイ外国債インデックス	81,985,892円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	137,084,557円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	87,110円
計	49,521,933,411円
2. 受益権の総数	49,521,933,411口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2024年8月21日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	499,716,021	—	498,874,832	△841,189
アメリカ・ドル	248,827,725	—	248,099,819	△727,906
イギリス・ポンド	25,126,123	—	25,117,939	△8,184
イスラエル・シケル	3,077,388	—	3,077,318	△70
オーストラリア・ドル	10,858,727	—	10,858,782	55
オフショア・人民元	47,009,700	—	47,005,100	△4,600
カナダ・ドル	9,245,775	—	9,233,746	△12,029
シンガポール・ドル	3,321,591	—	3,322,043	452
スウェーデン・クローナ	571,967	—	572,132	165
デンマーク・クローネ	1,501,651	—	1,501,783	132
ニュージーランド・ドル	3,068,866	—	3,068,705	△161
ノルウェー・クローネ	402,256	—	402,241	△15
ポーランド・ズロチ	3,302,108	—	3,295,086	△7,022
メキシコ・ペソ	2,779,809	—	2,749,871	△29,938
ユーロ	140,622,335	—	140,570,267	△52,068
合計	499,716,021	—	498,874,832	△841,189

(注) 為替予約取引

時価の算定方法

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年8月21日現在	
1口当たり純資産額		1.7346円
(1万口当たり純資産額)		(17,346円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

2024年8月30日現在

I 資産総額	32,283,002,837円
II 負債総額	13,157,322円
III 純資産総額（I－II）	32,269,845,515円
IV 発行済数量	14,181,947,066口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.2754円

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

2024年8月30日現在

I 資産総額	80,660,427,099円
II 負債総額	100,960,444円
III 純資産総額（I－II）	80,559,466,655円
IV 発行済数量	25,797,753,430口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	3.1227円

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

2024年8月30日現在

I 資産総額	53,872,978,262円
II 負債総額	49,064,420円
III 純資産総額（I－II）	53,823,913,842円
IV 発行済数量	12,946,481,007口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	4.1574円

（参考）

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

I 資産総額	253,636,526,089円
II 負債総額	600,481,879円
III 純資産総額（I－II）	253,036,044,210円
IV 発行済数量	77,913,565,353口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	3.2477円

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

I 資産総額	95,103,758,813円
II 負債総額	15,590,899,043円
III 純資産総額（I－II）	79,512,859,770円
IV 発行済数量	62,155,038,318口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.2793円

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

I 資産総額	1,053,469,238,301円
II 負債総額	1,187,786,240円
III 純資産総額 (I - II)	1,052,281,452,061円
IV 発行済数量	235,346,819,343口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	4.4712円

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

2024年8月30日現在

I 資産総額	86,566,004,286円
II 負債総額	440,944,816円
III 純資産総額 (I - II)	86,125,059,470円
IV 発行済数量	50,039,501,200口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.7211円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限

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

(4) 受益権の譲渡

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

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

③ 前記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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、解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2024年8月末現在の委託会社の資本金は、100億円です。

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

最近5年間における資本金の増減はありません。

(2) 委託会社等の機構

① 会社の意思決定機構

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

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

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

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

② 投資運用の意思決定機構

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

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

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。

2024年8月末現在、委託会社が運用するファンドの本数および純資産総額合計額は以下の通りです（ファンド数、純資産総額合計額とも親投資信託を除きます）。

種類	ファンド数（本）	純資産総額合計額 （単位：億円）
追加型株式投資信託	410	77,173
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	115	20,031
単位型公社債投資信託	0	0
合計	525	97,204

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

3 【委託会社等の経理状況】

1. 財務諸表の作成方法について

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

財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期事業年度（自2023年4月1日 至 2024年3月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年5月31日

ニッセイアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 樋口 誠之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大竹 新

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		31,522,565		23,594,998
有価証券		5,099,877		4,958,109
前払費用		595,955		645,436
未収委託者報酬		5,813,921		7,068,985
未収運用受託報酬		3,456,007		7,149,867
未収投資助言報酬		259,830		308,690
その他		18,700		58,384
流動資産合計		46,766,858		43,784,472
固定資産				
有形固定資産				
建物附属設備	※1	150,182	※1	143,306
車両	※1	482	※1	0
器具備品	※1	92,889	※1	67,645
有形固定資産合計		243,554		210,951
無形固定資産				
ソフトウェア		1,803,047		1,890,946
ソフトウェア仮勘定		1,198,151		1,968,913
その他		8,013		8,032
無形固定資産合計		3,009,212		3,867,892
投資その他の資産				
投資有価証券		37,635,584		47,543,934
関係会社株式		66,222		66,222
長期前払費用		11,881		27,817
差入保証金		367,613		360,305
繰延税金資産		1,600,306		1,809,123
その他		10,037		12,801
投資その他の資産合計		39,691,645		49,820,204
固定資産合計		42,944,413		53,899,049
資産合計		89,711,272		97,683,522

負債の部			
流動負債			
預り金		53,649	89,613
未払収益分配金		7,080	6,178
未払手数料	※2	2,148,508	※2 2,551,424
未払運用委託報酬	※2	1,868,264	※2 4,921,643
未払投資助言報酬	※2	801,755	※2 895,917
その他未払金	※2	2,880,396	※2 1,753,139
未払費用	※2	122,649	※2 181,100
未払法人税等		1,689,458	3,839,095
未払消費税等		321,144	937,421
賞与引当金		1,047,233	1,342,646
その他		46,054	34,063
流動負債合計		10,986,194	16,552,244
固定負債			
退職給付引当金		2,402,314	2,474,312
役員退職慰労引当金		16,150	21,250
固定負債合計		2,418,464	2,495,562
負債合計		13,404,658	19,047,806
純資産の部			
株主資本			
資本金		10,000,000	10,000,000
資本剰余金			
資本準備金		8,281,840	8,281,840
資本剰余金合計		8,281,840	8,281,840
利益剰余金			
利益準備金		139,807	139,807
その他利益剰余金			
配当準備積立金		120,000	120,000
研究開発積立金		70,000	70,000
別途積立金		350,000	350,000
繰越利益剰余金		57,905,876	60,488,508
利益剰余金合計		58,585,683	61,168,315
株主資本合計		76,867,523	79,450,155
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		△ 254,732	△ 484,519
繰延ヘッジ損益		△ 306,177	△ 329,920
評価・換算差額等合計		△ 560,910	△ 814,439
純資産合計		76,306,613	78,635,715
負債・純資産合計		89,711,272	97,683,522

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	27,807,455	29,505,710
運用受託報酬	18,365,703	24,242,291
投資助言報酬	1,146,302	1,181,976
その他営業収益	4,497	11,333
営業収益計	47,323,959	54,941,312
営業費用		
支払手数料	10,826,133	11,188,210
広告宣伝費	34,423	46,512
公告費	125	375
調査費	9,426,129	14,344,571
支払運用委託報酬	3,994,350	8,375,976
支払投資助言報酬	3,279,321	3,524,180
委託調査費	143,143	140,696
調査費	2,009,314	2,303,717
委託計算費	278,897	281,167
営業雑経費	876,260	980,132
通信費	60,541	72,591
印刷費	166,600	174,220
協会費	37,646	37,566
その他営業雑経費	611,472	695,754
営業費用計	21,441,969	26,840,969
一般管理費		
役員報酬	114,167	242,750
給料・手当	5,179,604	5,515,210
賞与引当金繰入額	1,033,669	1,325,993
賞与	357,187	329,794
福利厚生費	988,302	1,094,736
退職給付費用	411,161	446,711
役員退職慰労引当金繰入額	5,850	8,700
役員退職慰労金	2,550	821
その他人件費	214,336	192,956
不動産賃借料	803,805	805,677
その他不動産経費	35,247	37,672
交際費	27,169	28,219
旅費交通費	133,750	177,813
固定資産減価償却費	663,401	687,280
租税公課	367,046	393,138
業務委託費	438,018	414,081
器具備品費	769,903	1,022,398
保険料	49,248	49,463
寄付金	10,762	4,382
諸経費	279,825	352,612
一般管理費計	11,885,008	13,130,414
営業利益	13,996,981	14,969,928
営業外収益		
受取利息	950	825
有価証券利息	15,666	61,304

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自2022年4月1日 至2023年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度(自2023年4月1日 至2024年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金		利益準備金	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

注記事項

(重要な会計方針)

項目	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>① 満期保有目的の債券 償却原価法（定額法）によっております。</p> <p>② その他有価証券 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）によっております。</p> <p>③ 関係会社株式 移動平均法に基づく原価法によっております。</p>
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引の評価は時価法によっております。</p>
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>① 有形固定資産 定率法（ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については定額法）によっております。なお、主な耐用年数は、建物附属設備3～18年、車両6年、器具備品2～20年であります。</p> <p>② 無形固定資産 定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>① 賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、当期末在籍者に対する支給見込額のうち当期負担額を計上しております。</p> <p>② 退職給付引当金 従業員への退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。年俸制適用者の退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当該事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における年俸制適用者の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>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。</p> <p>③ 役員退職慰労引当金 役員への退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</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>① 投資信託委託業務 投資信託委託業務においては、投資信託契約に基づき信託財産の運用指図等を行っております。 委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を各契約で定められた運用期間経過後の一時点で個別に収受しております。当該報酬は、運用期間に</p>

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

(未適用の会計基準等)

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

1. 概要

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

2. 適用予定日

2025年3月期の期首より適用予定であります。

3. 当該会計基準等の適用による影響

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

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産の減価償却累計額は以下のとおりであります。

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

(損益計算書関係)

※1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは、以下のとおりであります。

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

※2. 固定資産除却損の内訳は以下のとおりであります。

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

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

①配当金支払額

2022年6月30日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

当事業年度 (自2023年4月1日 至2024年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 配当に関する事項

①配当金支払額

2023年6月26日開催の定時株主総会決議による配当に関する事項

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

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（2024年3月31日）

（単位：千円）

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

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

（注1）市場価格のない株式等

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2023年3月31日)
関係会社株式	66,222

（単位：千円）

区分	当事業年度 (2024年3月31日)
関係会社株式	66,222

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

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

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

当事業年度（2024年3月31日）

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券 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	—	24,454,430	—	24,454,430

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融商品

前事業年度 (2023年3月31日)

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

当事業年度 (2024年3月31日)

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

(注) 時価の算定に用いた評価技法および時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

デリバティブ取引

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

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

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

(注) 投資信託受益証券であります。

当事業年度(2024年3月31日)

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

(注) 投資信託受益証券であります。

(有価証券関係)

1. 満期保有目的の債券

前事業年度 (2023年3月31日)

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

当事業年度 (2024年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度（2023年3月31日）

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

（注1） 投資信託受益証券等であります。

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

当事業年度（2024年3月31日）

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

（注1）投資信託受益証券等であります。

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自2022年4月1日 至2023年3月31日）

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

当事業年度（自2023年4月1日 至2024年3月31日）

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

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前事業年度 (2023年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度 (2024年3月31日)

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度 (2023年3月31日)

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

当事業年度 (2024年3月31日)

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

(注1) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

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

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

(2) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用

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

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表しております。）

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自2022年4月1日 至2023年3月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	5,921,322

当事業年度（自2023年4月1日 至2024年3月31日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
日本生命保険相互会社	6,138,470

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は以下のとおりであります。

(単位：千円)

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

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

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

(関連当事者との取引)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自2022年4月1日 至2023年3月31日）

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

当事業年度（自2023年4月1日 至2024年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

取引条件は第三者との取引価格を参考に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

日本生命保険相互会社（非上場）

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

- ① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます）。
- ② 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます）。
- ③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- ④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

- ① 定款の変更等
該当事項はありません。
- ② 訴訟その他の重要事項
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

追加型証券投資信託

DC ニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)

投資信託約款

ニッセイアセットマネジメント株式会社

DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

運用の基本方針

投資信託約款第24条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、主として親投資信託の受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

下記の親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。また、各親投資信託はそれぞれ下記の指数の動きに連動する投資成果をめざします。

親投資信託 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）

親投資信託 ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

…NOMURA-BPI総合指数

親投資信託 ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

…MSCI KOKUSAI 指数（配当込み、円換算ベース）

親投資信託 ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

…FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。

(2) 投資態度

① 上記の親投資信託の受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

② 各親投資信託への投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド … 20%

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド … 45%

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド … 10%

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド … 20%

短期金融資産 … 5%

③ 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等に伴う資金フローの影響により、一時的に上記②の配分から乖離する場合があります。

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

(3) 投資制限

① 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の45%以下とします。

② 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の45%以下とします。

③ 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。

④ 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、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。

- ⑤ 投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦ 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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑧ 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。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑨ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3. 収益分配方針

毎期、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

追加型証券投資信託
DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）
投資信託約款

（信託の種類、委託者および受託者）

第1条 この信託は、証券投資信託であり、ニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第2条 受託者は、信託法第26条第1項に基づき、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の許可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と投資信託契約を締結し、これを委託することができます。

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的および金額）

第3条 委託者は、金10,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

（信託金の限度額）

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 追加信託が行われたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第5条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第57条第1項、第58条第1項、第59条第1項、または第61条第2項の規定による信託終了日または投資信託契約解約の日までとします。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第7条 この投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権の取得申込者とし、第8条により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割および再分割）

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については、10,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

（追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法）

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

- ② この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第34条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国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。
- ③ 第36条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国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。

（信託日時の異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生じることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り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り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、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、委託者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なわないものとします。
- ③ 委託者は、第8条の規定により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なうものとします。振替機関等は、委託者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ないません。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に投資信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、取扱販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第12条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行いません。

(受益権の申込単位、価額および手数料等)

第13条 取扱販売会社は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、最低申込単位を1口単位として取扱販売会社が定める単位をもって取得申込に応じます。ただし、別に定める「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権の取得申込者に対しては、1口単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行な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係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、取扱販売会社は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

③ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、第3条の規定による受益権の価額は、1口につき1円とします。

④ 前項の手数料の額は取得申込日の翌営業日の基準価額に取扱販売会社がそれぞれ別に定める率を乗じて得た額とします。

⑤ 別に定める契約を結んだ受益者が、第53条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第47条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行な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。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受付けた取得申込の受付を取り消すことができます。

(受益証券の種類)

第14条 (削除)

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第15条 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係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係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、前項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なわれるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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係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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第16条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(無記名式の受益証券の再交付)

第17条 (削除)

(記名式の受益証券の再交付)

第18条 (削除)

(受益証券を毀損した場合等の再交付)

第19条 (削除)

(受益証券の再交付の費用)

第20条 (削除)

(投資の対象とする資産の種類)

第21条 この信託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係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第29条、第30条および第31条に定めるものに限ります。)
 - ハ. 金銭債権(イ及びニに掲げるものに該当するものを除きます。)
 - ニ. 約束手形(イに掲げるものを除きます。)
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

(運用の指図範囲等)

第22条 委託者は、信託金を、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者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された別に定める親投資信託(以下、「マザーファンド」といいます。)の受益証券のほか、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。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号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、有価証券に係るものに限り。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り。）
 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つ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前号の有価証券の性質を有するもの
なお、第1号の証券または証書、第12号および第17号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。
- ② 委託者は、信託金を、前項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。以下本条において同じ。）により運用することを指図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つ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前号の権利の性質を有するもの
- ③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- ④ 委託者は、投資信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の45を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の45を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。
- ⑤ 委託者は、投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑥ 委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）の

時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ⑦ 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の45を超えることとなる指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の45を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。
- ⑧ 前4項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該新株引受権証券、当該新株予約権証券、当該投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）および当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑨ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの投資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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第23条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第37条において同じ。）、第37条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第21条および第22条第1項に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関係法令に反しない限り行うことができます。

- ② 前項の取扱いは、第28条から第32条まで、第36条、第42条、第43条および第44条における委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第24条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第25条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- ② 前項の規定にかかわらず、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、委託者が投資することを指図することができるものとします。

（同一銘柄の株式等への投資制限）

第26条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時

価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ③ 前2項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第27条 委託者は、投資信託財産に属する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。）の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 前項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第28条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。

- ② 前項の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる建玉の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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ための指図をするものとしします。

(先物取引等の運用指図)

第29条 委託者は、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとしします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ③ 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図・範囲)

第30条 委託者は、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。）を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとしします。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 スワップ取引の指図にあたっては、当該投資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投資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投資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。以下本項において同じ。）が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資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投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④ 前項においてマザーファンドの投資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投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資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投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 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 委託者は、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け入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

第31条 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める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 委託者は、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け入れの指図を行うものとします。

（有価証券の貸付の指図および範囲）

第32条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

- 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資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。
- 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資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 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

（有価証券の空売りの指図範囲）

第33条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない有価証券または第34条の規定により借り入れた有価証券を売付けることの指図をすることができます。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き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当す

る売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(有価証券の借入れ)

第34条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。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、担保の提供の指図をするものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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ための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れにかかる品借料は投資信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第35条 外貨建有価証券への投資については、わが国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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第36条 委託者は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項の予約取引の指図は、投資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、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資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の指図については、この限りではありません。
- ③ 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、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の指図をするものとします。

(信託業務の委託等)

第37条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの(受託者の利害関係人を含みます。)を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
 - ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務(裁量性のないものに限りません。)を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みます。)に委託することができるものとします。
 1. 投資信託財産の保存に係る業務
 2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(投資信託証券等の保管)

第38条 (削除)

(混蔵寄託)

第39条 金融機関または証券会社（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

(一括登録)

第40条 (削除)

(投資信託財産の登記等および記載等の留保等)

第41条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 投資信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(一部解約の請求および有価証券売却等の指図)

第42条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第43条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第44条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴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。）の指図をすることができます。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 一部解約に伴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投資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投資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投資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、資金借入額は借入指図を行う日における投資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投資信託財産から収益分配金が支弁さ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 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第45条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第46条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 投資信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第47条 この信託の計算期間は、原則として毎年2月22日から2月21日までとします。ただし、第1計算期間は、平成15年1月10日から平成16年2月23日までとします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により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、第5条に規定する信託期間の終了日とします。

(投資信託財産に関する報告)

第48条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用および会計監査費用)

第49条 投資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者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

② 投資信託財産にかかる会計監査費用および当該会計監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額および支弁の方法)

第50条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第47条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の14の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとします。

③ 第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第51条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産にかかる会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資

信託財産にかかる会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第52条 受託者は、収益分配金については第53条第1項に規定する支払開始日および第53条第2項に規定する交付開始日までに、償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第53条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第53条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第53条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため取扱販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、平成19年1月4日以降においても、第54条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が取扱販売会社に交付されます。この場合、取扱販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため取扱販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

④ 一部解約金は、第55条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第2項を除く。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、取扱販売会社の営業所等において行うものとし、

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

（収益分配金および償還金の時効）

第54条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(一部解約)

第55条 受益者（取扱販売会社を含みます。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に最低単位を1口単位として取扱販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、投資信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、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係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 平成19年1月4日以降の投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、取扱販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日前行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ⑤ 委託者は、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第56条 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、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

第57条 委託者は、信託期間中において、この投資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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。

- ② 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の投資信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、

すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- ⑥ 第3項から前項までの規定は、投資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、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第58条 委託者は、監督官庁よりこの投資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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第62条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第59条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁が、この投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第62条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第60条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第61条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第62条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(投資信託約款の変更)

第62条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の投資信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第63条 第57条に規定する投資信託契約の解約または前条に規定する投資信託約款の変更を行う場合

において、第57条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

- ② 前項の買取請求の取扱いについては、委託者、受託者および取扱販売会社の協議により決定するものとします。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第63条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供することとし、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nam.co.jp/>

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(公告)

第64条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nam.co.jp/>

- ② 前項の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。

(投資信託約款に関する疑義の取扱い)

第65条 この投資信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めま

す。

附則第1条 約款第13条第1項の「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとします。

附則第2条 第53条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

附則第3条 第31条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- ② 第31条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。）

す。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

附則第4条 平成18年12月29日現在の投資信託約款第11条、第12条、第14条から第20条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

1. 別に定める親投資信託

投資信託約款第22条第1項の「別に定める親投資信託」とは次のものをいいます。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 15 年 1 月 10 日

委託者
東京都千代田区大手町一丁目8番1号
ニッセイアセットマネジメント株式会社
取締役社長 山田 昌弘

受託者
東京都千代田区永田町二丁目11番1号
三菱信託銀行株式会社
取締役社長 内海 暎郎

追加型証券投資信託

DC ニッセイワールドセレクトファンド(標準型)

投資信託約款

ニッセイアセットマネジメント株式会社

DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

運用の基本方針

投資信託約款第24条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、主として親投資信託の受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

下記の親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。また、各親投資信託はそれぞれ下記の指数の動きに連動する投資成果をめざします。

親投資信託 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)

親投資信託 ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

…NOMURA-BPI総合指数

親投資信託 ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

…MSCI KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)

親投資信託 ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。

(2) 投資態度

① 上記の親投資信託の受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

② 各親投資信託への投資比率(基準ポートフォリオ)は、以下を基本とします。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド … 30%

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド … 30%

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド … 20%

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド … 15%

短期金融資産 … 5%

③ 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等に伴う資金フローの影響により、一時的に上記②の配分から乖離する場合があります。

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

(3) 投資制限

① 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。

② 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

③ 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。

④ 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、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。

- ⑤ 投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦ 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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑧ 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。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑨ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3. 収益分配方針

毎期、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

追加型証券投資信託
DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）
投資信託約款

（信託の種類、委託者および受託者）

第1条 この信託は、証券投資信託であり、ニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第2条 受託者は、信託法第26条第1項に基づき、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の許可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と投資信託契約を締結し、これを委託することができます。

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的および金額）

第3条 委託者は、金10,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

（信託金の限度額）

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 追加信託が行われたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第5条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第57条第1項、第58条第1項、第59条第1項、または第61条第2項の規定による信託終了日または投資信託契約解約の日までとします。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第7条 この投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権の取得申込者とし、第8条により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割および再分割）

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については、10,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

（追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法）

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

- ② この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第34条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国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。
- ③ 第36条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国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。

（信託日時の異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生じることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り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り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、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、委託者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なわないものとします。
- ③ 委託者は、第8条の規定により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なうものとします。振替機関等は、委託者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ないます。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に投資信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、取扱販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第12条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行いません。

(受益権の申込単位、価額および手数料等)

第13条 取扱販売会社は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、最低申込単位を1口単位として取扱販売会社が定める単位をもって取得申込に応じます。ただし、別に定める「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権の取得申込者に対しては、1口単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行な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係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、取扱販売会社は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

③ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、第3条の規定による受益権の価額は、1口につき1円とします。

④ 前項の手数料の額は取得申込日の翌営業日の基準価額に取扱販売会社がそれぞれ別に定める率を乗じて得た額とします。

⑤ 別に定める契約を結んだ受益者が、第53条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第47条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行な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。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受付けた取得申込の受付を取り消すことができます。

(受益証券の種類)

第14条 (削除)

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第15条 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係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係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、前項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なわれるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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係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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第16条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(無記名式の受益証券の再交付)

第17条 (削除)

(記名式の受益証券の再交付)

第18条 (削除)

(受益証券を毀損した場合等の再交付)

第19条 (削除)

(受益証券の再交付の費用)

第20条 (削除)

(投資の対象とする資産の種類)

第21条 この信託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係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第29条、第30条および第31条に定めるものに限ります。)
 - ハ. 金銭債権(イ及びニに掲げるものに該当するものを除きます。)
 - ニ. 約束手形(イに掲げるものを除きます。)
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

(運用の指図範囲等)

第22条 委託者は、信託金を、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者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された別に定める親投資信託(以下、「マザーファンド」といいます。)の受益証券のほか、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。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号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、有価証券に係るものに限り。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り。）
 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前号の有価証券の性質を有するもの
なお、第1号の証券または証書、第12号および第17号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。
- ② 委託者は、信託金を、前項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。以下本条において同じ。）により運用することを指図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前号の権利の性質を有するもの
- ③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- ④ 委託者は、投資信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の65を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の65を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。
- ⑤ 委託者は、投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑥ 委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）の

時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ⑦ 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の50を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。
- ⑧ 前4項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該新株引受権証券、当該新株予約権証券、当該投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）および当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑨ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの投資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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第23条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第37条において同じ。）、第37条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第21条および第22条第1項に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関係法令に反しない限り行うことができます。

- ② 前項の取扱いは、第28条から第32条まで、第36条、第42条、第43条および第44条における委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第24条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第25条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- ② 前項の規定にかかわらず、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、委託者が投資することを指図することができるものとします。

（同一銘柄の株式等への投資制限）

第26条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時

価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ③ 前2項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第27条 委託者は、投資信託財産に属する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。）の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 前項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第28条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。

- ② 前項の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる建玉の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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ための指図をするものとしします。

(先物取引等の運用指図)

第29条 委託者は、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとしします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ③ 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図・範囲)

第30条 委託者は、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。）を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとしします。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 スワップ取引の指図にあたっては、当該投資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投資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投資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。以下本項において同じ。）が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資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投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④ 前項においてマザーファンドの投資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投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資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投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 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 委託者は、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け入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

第31条 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める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 委託者は、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け入れの指図を行うものとします。

（有価証券の貸付の指図および範囲）

第32条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

- 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資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。
- 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資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 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

（有価証券の空売りの指図範囲）

第33条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない有価証券または第34条の規定により借り入れた有価証券を売付けることの指図をすることができます。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き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当す

る売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(有価証券の借入れ)

第34条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。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、担保の提供の指図をするものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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ための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れにかかる品借料は投資信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第35条 外貨建有価証券への投資については、わが国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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第36条 委託者は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項の予約取引の指図は、投資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、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資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の指図については、この限りではありません。
- ③ 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、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の指図をするものとします。

(信託業務の委託等)

第37条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの(受託者の利害関係人を含みます。)を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
 - ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務(裁量性のないものに限りません。)を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みます。)に委託することができるものとします。
 1. 投資信託財産の保存に係る業務
 2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(投資信託証券等の保管)

第38条 (削除)

(混蔵寄託)

第39条 金融機関または証券会社（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

(一括登録)

第40条 (削除)

(投資信託財産の登記等および記載等の留保等)

第41条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 投資信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(一部解約の請求および有価証券売却等の指図)

第42条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第43条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第44条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴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。）の指図をすることができます。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 一部解約に伴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投資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投資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投資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、資金借入額は借入指図を行う日における投資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投資信託財産から収益分配金が支弁さ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 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第45条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第46条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 投資信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第47条 この信託の計算期間は、原則として毎年2月22日から2月21日までとします。ただし、第1計算期間は、平成15年1月10日から平成16年2月23日までとします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により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、第5条に規定する信託期間の終了日とします。

(投資信託財産に関する報告)

第48条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用および会計監査費用)

第49条 投資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者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

② 投資信託財産にかかる会計監査費用および当該会計監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額および支弁の方法)

第50条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第47条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の14の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとします。

③ 第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第51条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産にかかる会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資

信託財産にかかる会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第52条 受託者は、収益分配金については第53条第1項に規定する支払開始日および第53条第2項に規定する交付開始日までに、償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第53条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第53条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第53条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため取扱販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、平成19年1月4日以降においても、第54条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が取扱販売会社に交付されます。この場合、取扱販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため取扱販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

④ 一部解約金は、第55条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第2項を除く。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、取扱販売会社の営業所等において行うものとし、

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

（収益分配金および償還金の時効）

第54条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(一部解約)

第55条 受益者（取扱販売会社を含みます。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に最低単位を1口単位として取扱販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、投資信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、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係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 平成19年1月4日以降の投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、取扱販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日前行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ⑤ 委託者は、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第56条 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、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

第57条 委託者は、信託期間中において、この投資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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。

- ② 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の投資信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、

すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- ⑥ 第3項から前項までの規定は、投資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、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第58条 委託者は、監督官庁よりこの投資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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第62条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第59条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁が、この投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第62条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第60条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第61条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第62条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(投資信託約款の変更)

第62条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の投資信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第63条 第57条に規定する投資信託契約の解約または前条に規定する投資信託約款の変更を行う場合

において、第57条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

- ② 前項の買取請求の取扱いについては、委託者、受託者および取扱販売会社の協議により決定するものとします。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第63条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供することとし、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nam.co.jp/>

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(公告)

第64条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nam.co.jp/>

- ② 前項の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。

(投資信託約款に関する疑義の取扱い)

第65条 この投資信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めま

す。

附則第1条 約款第13条第1項の「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとします。

附則第2条 第53条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

附則第3条 第31条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- ② 第31条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいま

す。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

附則第4条 平成18年12月29日現在の投資信託約款第11条、第12条、第14条から第20条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

1. 別に定める親投資信託

投資信託約款第22条第1項の「別に定める親投資信託」とは次のものをいいます。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 15 年 1 月 10 日

委託者 東京都千代田区大手町一丁目8番1号
ニッセイアセットマネジメント株式会社
取締役社長 山田 昌弘

受託者 東京都千代田区永田町二丁目11番1号
三菱信託銀行株式会社
取締役社長 内海 暎郎

追加型証券投資信託

DC ニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)

投資信託約款

ニッセイアセットマネジメント株式会社

DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

運用の基本方針

投資信託約款第24条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、主として親投資信託の受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

下記の親投資信託の受益証券を主要投資対象とします。また、各親投資信託はそれぞれ下記の指数の動きに連動する投資成果をめざします。

親投資信託 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）

親投資信託 ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

…NOMURA-BPI総合指数

親投資信託 ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

…MSCI KOKUSAI 指数（配当込み、円換算ベース）

親投資信託 ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

…FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

なお、直接株式、公社債等に投資を行う場合があります。

(2) 投資態度

① 上記の親投資信託の受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、国内外の株式市場および債券市場の動きを捉えることを目標とした運用を行います。

② 各親投資信託への投資比率（基準ポートフォリオ）は、以下を基本とします。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド … 40%

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド … 15%

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド … 30%

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド … 10%

短期金融資産 … 5%

③ 基準ポートフォリオの構成比率は、短期間での見直しは原則として行わず、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。ただし、追加設定・一部解約等に伴う資金フローの影響により、一時的に上記②の配分から乖離する場合があります。

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

(3) 投資制限

① 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。

② 外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の55%以下とします。

③ 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。

④ 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、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。

- ⑤ 投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑦ 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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑧ 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。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑨ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3. 収益分配方針

毎期、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

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

追加型証券投資信託
DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）
投資信託約款

（信託の種類、委託者および受託者）

第1条 この信託は、証券投資信託であり、ニッセイアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、投資信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第2条 受託者は、信託法第26条第1項に基づき、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の許可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。）を含みます。）と投資信託契約を締結し、これを委託することができます。

② 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的および金額）

第3条 委託者は、金10,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

（信託金の限度額）

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 追加信託が行われたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第5条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第57条第1項、第58条第1項、第59条第1項、または第61条第2項の規定による信託終了日または投資信託契約解約の日までとします。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第7条 この投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権の取得申込者とし、第8条により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割および再分割）

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については、10,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

（追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法）

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

- ② この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第34条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国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。
- ③ 第36条に規定する予約為替の評価は、原則としてわが国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。

（信託日時の異なる受益権の内容）

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生じることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第11条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り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り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、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、委託者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なわないものとします。
- ③ 委託者は、第8条の規定により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なうものとします。振替機関等は、委託者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ないます。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に投資信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、取扱販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第12条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行いません。

(受益権の申込単位、価額および手数料等)

第13条 取扱販売会社は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、最低申込単位を1口単位として取扱販売会社が定める単位をもって取得申込に応じます。ただし、別に定める「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく(累積)投資約款」にしたがって契約(以下「別に定める契約」といいます。)を結んだ受益権の取得申込者に対しては、1口単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

② 前項の取得申込者は取扱販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行な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係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、取扱販売会社は、当該取得申込の代金(第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。)の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

③ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、次項に規定する手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を加算した価額とします。ただし、第3条の規定による受益権の価額は、1口につき1円とします。

④ 前項の手数料の額は取得申込日の翌営業日の基準価額に取扱販売会社がそれぞれ別に定める率を乗じて得た額とします。

⑤ 別に定める契約を結んだ受益者が、第53条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として第47条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行な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。)における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受付けた取得申込の受付を取り消すことができます。

(受益証券の種類)

第14条 (削除)

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第15条 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係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係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、前項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なわれるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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係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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第16条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(無記名式の受益証券の再交付)

第17条 (削除)

(記名式の受益証券の再交付)

第18条 (削除)

(受益証券を毀損した場合等の再交付)

第19条 (削除)

(受益証券の再交付の費用)

第20条 (削除)

(投資の対象とする資産の種類)

第21条 この信託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係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第29条、第30条および第31条に定めるものに限ります。)
 - ハ. 金銭債権(イ及びニに掲げるものに該当するものを除きます。)
 - ニ. 約束手形(イに掲げるものを除きます。)
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

(運用の指図範囲等)

第22条 委託者は、信託金を、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者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結された別に定める親投資信託(以下、「マザーファンド」といいます。)の受益証券のほか、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。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号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、有価証券に係るものに限ります。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
なお、第1号の証券または証書、第12号および第17号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。
- ② 委託者は、信託金を、前項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。以下本条において同じ。）により運用することを指図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前号の権利の性質を有するもの
- ③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。
- ④ 委託者は、投資信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の85を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の85を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。
- ⑤ 委託者は、投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑥ 委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）の

時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ⑦ 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の55を超えることとなる指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の55を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。
- ⑧ 前4項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該新株引受権証券、当該新株予約権証券、当該投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）および当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑨ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの投資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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第23条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第37条において同じ。）、第37条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第21条および第22条第1項に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。

- ② 前項の取扱いは、第28条から第32条まで、第36条、第42条、第43条および第44条における委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第24条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第25条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- ② 前項の規定にかかわらず、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、委託者が投資することを指図することができるものとします。

（同一銘柄の株式等への投資制限）

第26条 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時

価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- ③ 前2項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該株式、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第27条 委託者は、投資信託財産に属する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。）の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- ② 前項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第28条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。

- ② 前項の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる建玉の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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ための指図をするものとしします。

(先物取引等の運用指図)

第29条 委託者は、わが国の証券取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとしします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ③ 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図・範囲)

第30条 委託者は、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。）を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第5条に定める信託期間を超えないものとしします。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 スワップ取引の指図にあたっては、当該投資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投資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投資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。以下本項において同じ。）が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資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投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④ 前項においてマザーファンドの投資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投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資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投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 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 委託者は、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け入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）

第31条 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める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 委託者は、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け入れの指図を行うものとします。

（有価証券の貸付の指図および範囲）

第32条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

- 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資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。
- 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資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 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

（有価証券の空売りの指図範囲）

第33条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない有価証券または第34条の規定により借り入れた有価証券を売付けることの指図をすることができます。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き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付けにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当す

る売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(有価証券の借入れ)

第34条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。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、担保の提供の指図をするものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる有価証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、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ための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れにかかる品借料は投資信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第35条 外貨建有価証券への投資については、わが国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。

(外国為替予約取引の指図および範囲)

第36条 委託者は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項の予約取引の指図は、投資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、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資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の指図については、この限りではありません。
- ③ 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、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の指図をするものとします。

(信託業務の委託等)

第37条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの(受託者の利害関係人を含みます。)を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
 - ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務(裁量性のないものに限りません。)を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みます。)に委託することができるものとします。
 1. 投資信託財産の保存に係る業務
 2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(投資信託証券等の保管)

第38条 (削除)

(混蔵寄託)

第39条 金融機関または証券会社（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

(一括登録)

第40条 (削除)

(投資信託財産の登記等および記載等の留保等)

第41条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 投資信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(一部解約の請求および有価証券売却等の指図)

第42条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第43条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第44条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴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。）の指図をすることができます。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 一部解約に伴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投資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投資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投資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、資金借入額は借入指図を行う日における投資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投資信託財産から収益分配金が支弁さ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 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第45条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第46条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申し出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 投資信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第47条 この信託の計算期間は、原則として毎年2月22日から2月21日までとします。ただし、第1計算期間は、平成15年1月10日から平成16年2月23日までとします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により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、第5条に規定する信託期間の終了日とします。

(投資信託財産に関する報告)

第48条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用および会計監査費用)

第49条 投資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者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

② 投資信託財産にかかる会計監査費用および当該会計監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額および支弁の方法)

第50条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第47条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年10,000分の14の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとします。

③ 第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第51条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産にかかる会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資

信託財産にかかる会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第52条 受託者は、収益分配金については第53条第1項に規定する支払開始日および第53条第2項に規定する交付開始日までに、償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第53条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第53条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第53条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため取扱販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、平成19年1月4日以降においても、第54条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が取扱販売会社に交付されます。この場合、取扱販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため取扱販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

④ 一部解約金は、第55条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第2項を除く。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、取扱販売会社の営業所等において行うものとし、

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

（収益分配金および償還金の時効）

第54条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(一部解約)

第55条 受益者（取扱販売会社を含みます。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に最低単位を1口単位として取扱販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、投資信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、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係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、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なわれます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 平成19年1月4日以降の投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、取扱販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日前行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ⑤ 委託者は、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第56条 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、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

第57条 委託者は、信託期間中において、この投資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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。

- ② 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の投資信託契約の解約をしません。
- ⑤ 委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、

すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- ⑥ 第3項から前項までの規定は、投資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、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第58条 委託者は、監督官庁よりこの投資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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第62条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第59条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁が、この投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第62条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第60条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第61条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第62条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(投資信託約款の変更)

第62条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の投資信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第63条 第57条に規定する投資信託契約の解約または前条に規定する投資信託約款の変更を行う場合

において、第57条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

- ② 前項の買取請求の取扱いについては、委託者、受託者および取扱販売会社の協議により決定するものとします。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第63条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供することとし、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nam.co.jp/>

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(公告)

第64条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.nam.co.jp/>

- ② 前項の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。

(投資信託約款に関する疑義の取扱い)

第65条 この投資信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めま

す。

附則第1条 約款第13条第1項の「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と取扱販売会社が締結する「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「DCニッセイワールドセレクトファンド自動けいぞく（累積）投資約款」は当該別の名称で読み替えるものとします。

附則第2条 第53条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

附則第3条 第31条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- ② 第31条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいま

す。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

附則第4条 平成18年12月29日現在の投資信託約款第11条、第12条、第14条から第20条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

1. 別に定める親投資信託

投資信託約款第22条第1項の「別に定める親投資信託」とは次のものをいいます。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 15 年 1 月 10 日

委託者 東京都千代田区大手町一丁目8番1号
ニッセイアセットマネジメント株式会社
取締役社長 山田 昌弘

受託者 東京都千代田区永田町二丁目11番1号
三菱信託銀行株式会社
取締役社長 内海 暎郎