

第1期末 (2024年2月20日)

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 11,326円 |
| 純資産総額 | 95百万円 |
| 騰落率 | 13.3% |
| 分配金 | 0円 |

DCニッセイ全世界株式 インデックスコレクト

追加型投信／内外／株式

交付運用報告書

作成対象期間: 2023年9月15日～2024年2月20日

第1期 (決算日 2024年2月20日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト」は、このたび第1期の決算を行いました。

当ファンドは投資対象の異なる3つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国（除く日本）および新興国の株式を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

お客様の口座内容に関するご照会は、お申し込みされた販売会社にお問い合わせください。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

当ファンドは、投資信託約款において、運用報告書（全体版）に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供する旨を定めており、下記の手順で運用報告書（全体版）をダウンロードすることができます。また、運用報告書（全体版）は、受益者のご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

【ダウンロード方法】上記ホームページ→ファンド検索→ファンド名入力→ファンド詳細ページ→運用レポート→運用報告書（全体版）

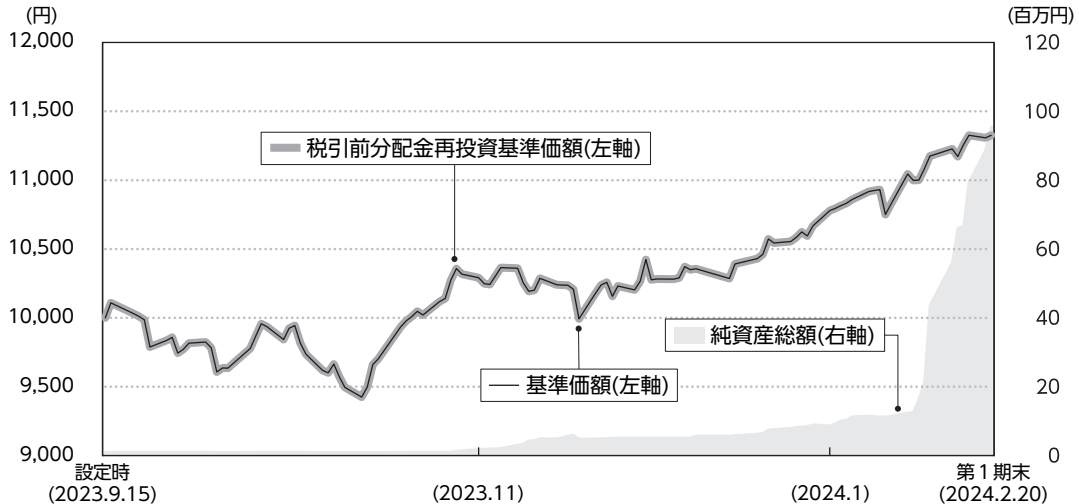
UD FONT

ユニバーサルデザイン（UD）の考えに基づいた見やすいデザインの文字を採用しています。

運用経過

2023年9月15日～2024年2月20日

基準価額等の推移



| | | | |
|------|---------|-----------------|-------|
| 設定時 | 10,000円 | 既払分配金 | 0円 |
| 第1期末 | 11,326円 | 騰落率 (分配金再投資ベース) | 13.3% |

(注1) 税引前分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、設定時の基準価額にあわせて指数化しています。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・ 11月に米国において追加利上げ観測が後退したことなどを受けて株価が上昇したこと
- ・ 年初から当期末にかけて、米経済や企業業績への見通しが堅調であったことや米国におけるインフレ鈍化への期待感の高まりを受けて株価が上昇したこと
- ・ 期を通じて見ると、為替市場において米ドル等が対円で上昇したこと

<下落要因>

- ・ 設定時から10月末にかけて、米連邦準備制度理事会(FRB)による金融引き締め姿勢を受けて米金利が上昇したことに加えて、米政府機関閉鎖問題や中東情勢の緊迫化を背景に株価が下落したこと

| 組入マザーファンド | 組入比率 | 騰落率 |
|------------------------|------|-------|
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 5.5% | 10.6% |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 84.4 | 14.3 |
| ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド | 10.1 | 6.8 |

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第1期 | | 項目の概要 |
|------------|------|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 5円 | 0.045% | $\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は10,271円です。</p> |
| (投信会社) | (2) | (0.018) | 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 |
| (販売会社) | (2) | (0.018) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 |
| (受託会社) | (1) | (0.010) | 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 |
| 売買委託手数料 | 0 | 0.002 | |
| (株式) | (0) | (0.001) | 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数 |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| 有価証券取引税 | 0 | 0.001 | |
| (株式) | (0) | (0.001) | 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| その他費用 | 3 | 0.025 | その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (1) | (0.011) | 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (監査費用) | (1) | (0.007) | 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 |
| (その他) | (1) | (0.007) | <ul style="list-style-type: none"> 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 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 8 | 0.073 | |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

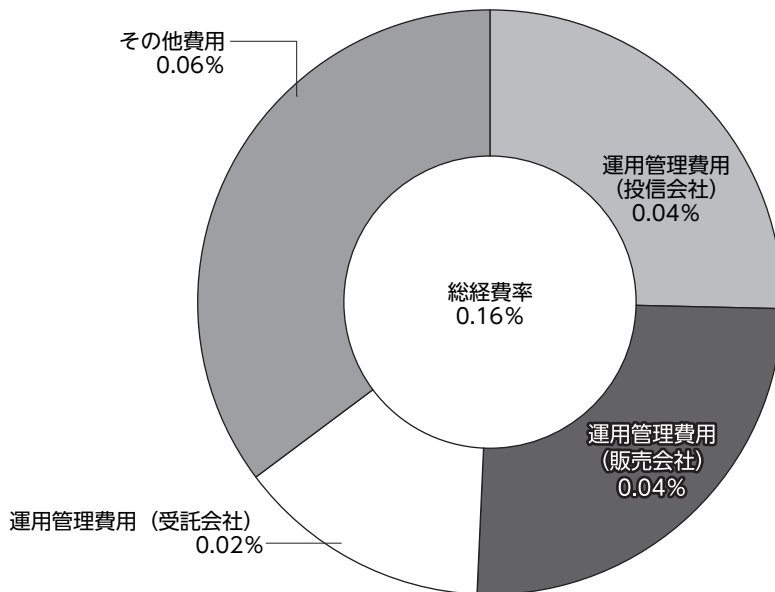
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(参考情報)

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.16%**です。



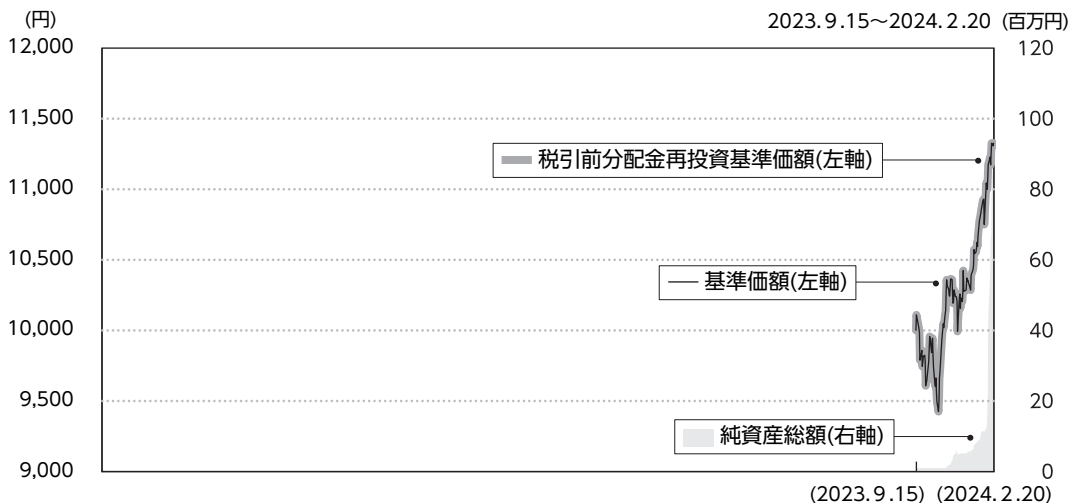
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

最近5年間の基準価額等の推移



(注1) 当ファンドの設定日は2023年9月15日です。

(注2) 税引前分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、設定時の基準価額にあわせて指数化しています。

(注3) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

| 決算日 | | 2023年9月15日 | 2024年2月20日 |
|-------------------|-------|------------|------------|
| 基準価額（分配落） | (円) | 10,000 | 11,326 |
| 期間分配金合計（税引前） | (円) | － | 0 |
| 税引前分配金再投資基準価額の騰落率 | (%) | － | 13.3 |
| 参考指数騰落率 | (%) | － | 13.3 |
| 純資産総額 | (百万円) | 1 | 95 |

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

(注2) 参考指数は、MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）です。なお参考指数の詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

投資環境

■国内株式市況

国内株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

設定時から10月末にかけては米金利の上昇を受けて株価は下落しましたが、11月に入ると日銀による金融緩和姿勢の継続が示唆されたことや米金利の低下を受けて上昇しました。その後は円高の進行などから下落する場面もありましたが、年明け以降は米株高や円安に加えて海外投資家の買いや新しい少額投資非課税制度(NISA)に伴う資金流入への期待感等を背景に株価は大きく上昇し、設定時を上回る水準で当期末を迎えました。

■先進国株式市況

先進国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

設定時から10月末にかけては、米政府機関閉鎖問題や中東情勢の緊迫化を背景に株価は下落する場面があったものの、11月に入ると米連邦公開市場委員会(FOMC)において追加利上げ観測が後退したことや米政府機関における一部閉鎖の回避等を受けて反発しました。12月にはFRBのパウエル議長が金融緩和に前向きな発言をしたことや市場予想並みであった米消費者物価指数(CPI)等を受けて株価は続伸しました。年初から2月にかけては、前月までの株式市場における上昇の反動や米雇用統計が市場予想を上回り堅調な経済環境が確認されたことなどから金利が上昇し株価は下落する場面がありましたが、米経済や企業業績への見通しが堅調であったことや米国におけるインフレ鈍化への期待感から米国やドイツの株式市場が上昇し、結局、設定時と比較すると上昇して当期末を迎えました。

■新興国株式市況

新興国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

設定時から10月末にかけては、中国における金融市場や景気への支援策が好感された一方、中国景気や不動産市場の不透明感が根強く株価は一進一退の展開となりました。11月に入ると米金融引き締めへの懸念の後退や中国における景気支援策への期待感から株価は上昇しました。12月には中国において積極的な景気支援策への期待感が後退したことや既存産業への規制強化が懸念された一方で、米金融政策における早期方針転換への期待感の高まりを背景に株価は続伸しました。1月には中国における緩和的な金融政策が好感されたものの、政府主導の景気刺激策への期待感が後退したことなどから株価は下落しましたが、その後は中国人民銀行(中央銀行)による市場予想を上回る利下げなどにより反発し、結局、設定時と比較すると上昇して当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

投資対象の異なる3つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国（除く日本）および新興国の株式を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。

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

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

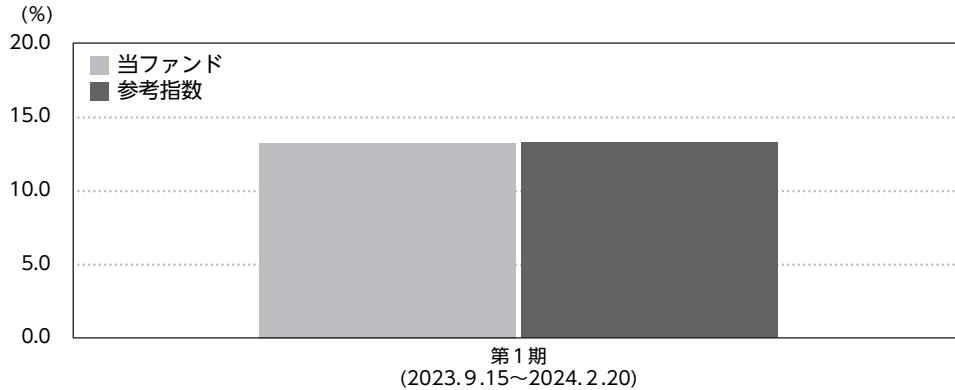
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド>

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

*ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

参考指数との差異



当ファンドはベンチマークを設けていません。参考指数はMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）です。

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+13.3%となり、参考指数騰落率（13.3%）と同程度となりました。

当ファンドは投資対象の異なる3つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国（除く日本）および新興国の株式を実質的な主要投資対象とし、投資割合はMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックスの時価総額の比率に基づき決定した結果、同程度の騰落率となりました。

（注1）基準価額の騰落率は分配金込みです。

（注2）参考指数の詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

分配金

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。

なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

| 項目 | 当期 2023年9月15日~2024年2月20日 |
|------------|-----------------------------|
| 当期分配金（税引前） | — |
| 対基準価額比率 | — |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,326円 |

（注1）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切り捨てで算出しているため、合計が当期分配金と一致しない場合があります。

（注2）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

今後の運用方針

■当ファンド

投資対象の異なる3つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国（除く日本）および新興国の株式を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

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

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマーク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>

日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド>

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■組入ファンド

| | 第1期末 2024年2月20日 |
|----------------------------|--------------------|
| ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド | 5.5% |
| ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド | 84.4 |
| ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド | 10.1 |

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

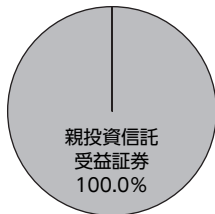
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

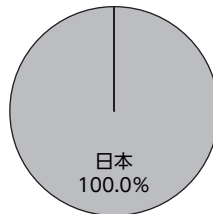
| 項目 | 第1期末 2024年2月20日 |
|------------|--------------------|
| 純資産総額 | 95,473,855円 |
| 受益権総口数 | 84,295,821口 |
| 1万口当たり基準価額 | 11,326円 |

(注) 当期間中における追加設定元本額は88,499,860円、同解約元本額は5,204,039円です。

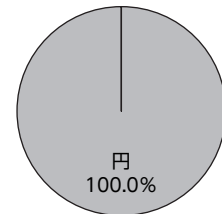
■資産別配分



■国別配分



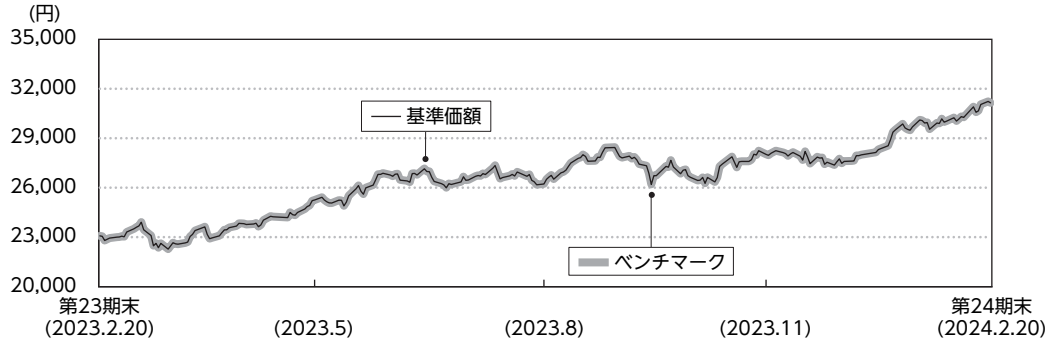
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年2月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

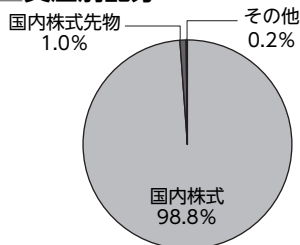
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------|----|-------|
| トヨタ自動車 | 円 | 5.0% |
| ソニーグループ | 円 | 2.5 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 円 | 2.4 |
| 東京エレクトロン | 円 | 1.9 |
| キーエンス | 円 | 1.8 |
| 三菱商事 | 円 | 1.7 |
| 日立製作所 | 円 | 1.6 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 円 | 1.5 |
| 信越化学工業 | 円 | 1.5 |
| 日本電信電話 | 円 | 1.4 |
| 組入銘柄数 | | 1,709 |

■ 1万口当たりの費用明細

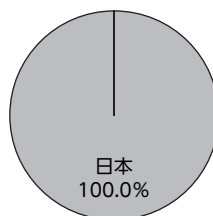
2023.2.21~2024.2.20

| 項目 | 金額 |
|------------|-----|
| 売買委託手数料 | 0円 |
| (株式) | (0) |
| (先物・オプション) | (0) |
| その他費用 | 0 |
| (その他) | (0) |
| 合計 | 0 |

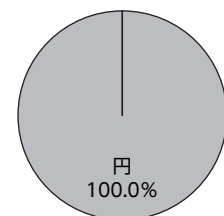
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



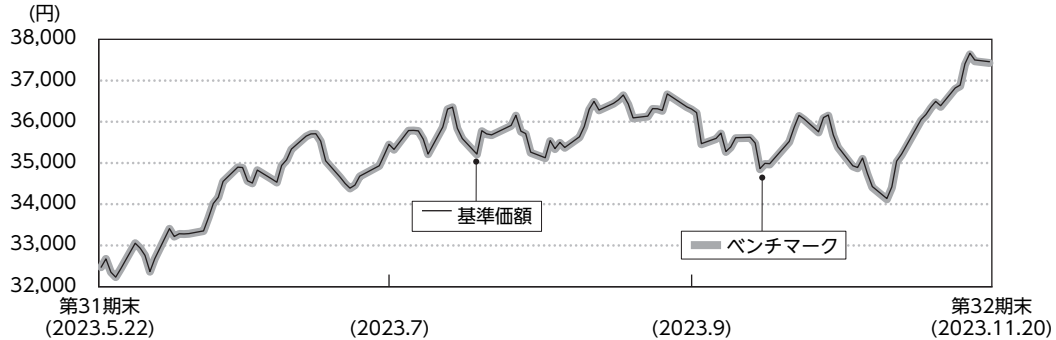
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2024年2月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書(全体版)の組入有価証券明細表をご参照ください。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

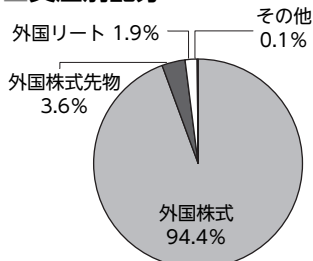
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------------------|-----|------|
| APPLE INC | 米ドル | 5.4% |
| MICROSOFT CORP | 米ドル | 4.7% |
| S&P 500 EMINI FUTURE 202312 買 | 米ドル | 2.7% |
| AMAZON.COM INC | 米ドル | 2.4% |
| NVIDIA CORP | 米ドル | 2.2% |
| ALPHABET INC-CL A | 米ドル | 1.4% |
| META PLATFORMS INC-A | 米ドル | 1.3% |
| ALPHABET INC-CL C | 米ドル | 1.3% |
| TESLA, INC. | 米ドル | 1.2% |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 米ドル | 0.9% |
| 組入銘柄数 | | 1278 |

■ 1万口当たりの費用明細

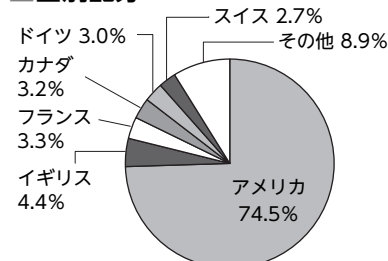
2023.5.23~2023.11.20

| 項目 | 金額 |
|------------|-----|
| 売買委託手数料 | 0円 |
| (株式) | (0) |
| (先物・オプション) | (0) |
| (投資信託証券) | (0) |
| 有価証券取引税 | 1 |
| (株式) | (1) |
| (投資信託証券) | (0) |
| その他費用 | 3 |
| (保管費用) | (3) |
| (その他) | (0) |
| 合計 | 5 |

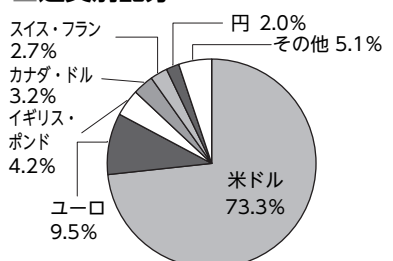
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

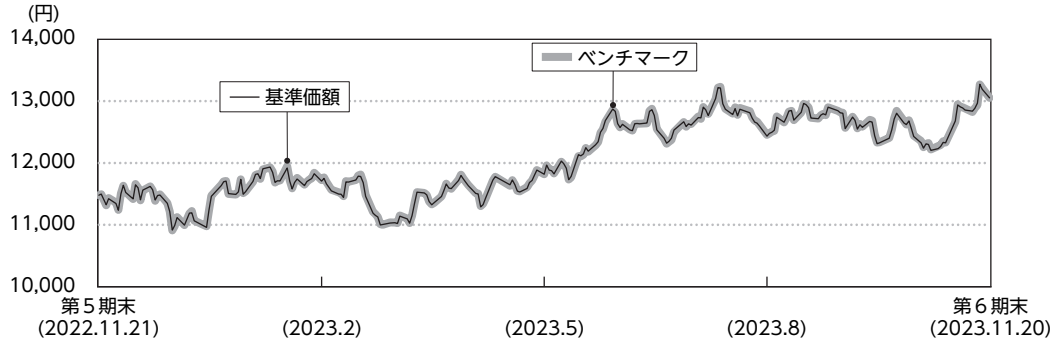
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2023年11月20日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 国別配分における海外先物は上場取引所の国・地域に基づき開示しています。

(注4) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書（全体版）の組入有価証券明細表をご参照ください。

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



■ 上位銘柄

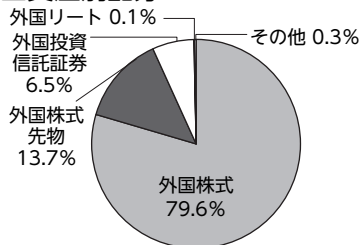
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|------------------------------------|---------|-------|
| MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202312 買 | 米ドル | 13.7% |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 台湾ドル | 5.8 |
| ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | 米ドル | 3.7 |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 香港ドル | 3.5 |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 韓国ウォン | 3.4 |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 香港ドル | 2.0 |
| ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF | 米ドル | 1.2 |
| RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | インド・ルピー | 1.1 |
| MEITUAN-B | 香港ドル | 0.9 |
| PDD HOLDINGS INC(ADR) | 米ドル | 0.9 |
| 組入銘柄数 | | 1,055 |

■ 1万口当たりの費用明細

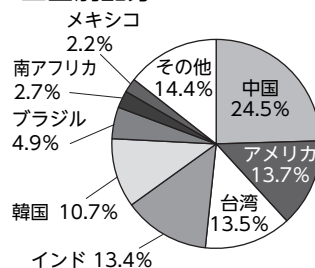
2022.11.22~2023.11.20

| 項目 | 金額 |
|-----------------|------------|
| 売買委託手数料 (株式) | 4円 (2) |
| (先物・オプション) | (1) |
| (投資信託証券) | (0) |
| 有価証券取引税 (株式) | 3 (3) |
| (投資信託証券) | (0) |
| その他費用 (保管費用) | 29 (21) |
| (その他) | (8) |
| 合計 | 36 |

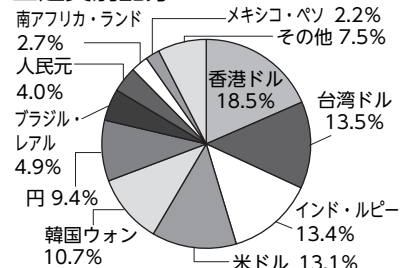
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

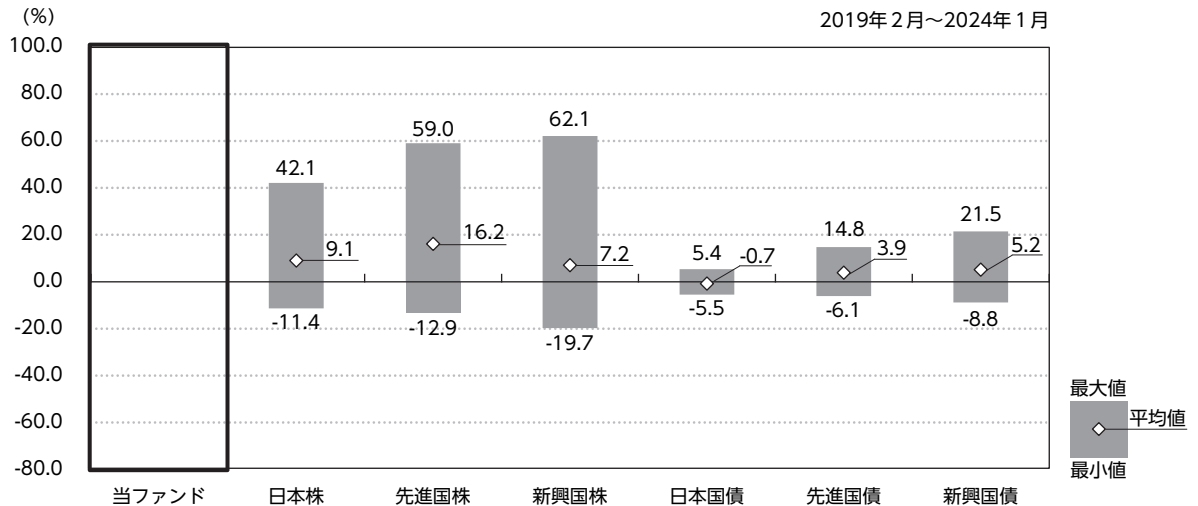
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2023年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 国別配分における海外先物は上場取引所の国・地域に基づき開示しています。

(注4) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書(全体版)の組入有価証券明細表をご参照ください。

参考情報

■ 代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(注1) 上記は、当ファンドの騰落率（税引前分配金再投資基準価額騰落率）と代表的な資産クラスの騰落率を比較したものであり、各資産クラスは当ファンドの投資対象を表しているものではありません。

(注2) 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものであり、決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドについては設定日以降のデータが1年分に満たないため、比較すべきデータが存在しません。

< 代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数 >

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

- ・すべての資産クラスが当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。

*各資産クラスの指数につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、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.は同インデックス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。

- ・TOPIX（東証株価指数）（配当込み）

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

- ・MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、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.は同インデックス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。

- ・MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、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.は同インデックス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。

■代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数について

- ・ T O P I X（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 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」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 J P X が有します。J P X 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。
- ・ M S C I 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。
- ・ M S C I 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。
- ・ N O M U R A - B P I 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。
- ・ F T S E 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。
- ・ J P モルガン G B I - E M グローバル・ディバーシファイドは、J P モルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

お知らせ

■ 自社による当ファンドの設定解約状況

| 当期 設定元本 | 当期 解約元本 | 当期末残高 | | | 取引の理由 |
|------------|------------|-------|-----|-----|-------------|
| | | 元本 | 評価額 | 比率 | |
| 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | % | |
| 1 | － | 1 | 1 | 1.2 | 当初設定時における取得 |

(注) 元本および評価額の単位未満は切り捨てています。なお当社は自社による当ファンドの保有分を解約することがあります。

当ファンドの概要

| | | |
|---------|--|--|
| 商 品 分 類 | 追加型投信／内外／株式 | |
| 信 託 期 間 | 無期限 | |
| 運 用 方 針 | 下記マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国（除く日本）および新興国の株式を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。 | |
| 主要運用対象 | DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト | 「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド」受益証券 |
| | ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 国内の金融商品取引所上場株式等 |
| | ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 日本を除く主要先進国の株式 |
| | ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド | 新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます） |
| 運用方法 | DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト | 各マザーファンド受益証券への投資割合は、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックスの時価総額の比率に基づき決定します。 |
| | ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。 |
| | ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| | ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| 分 配 方 針 | 毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 | |