

## 第8期末（2025年2月21日）

基準価額	11,225円
純資産総額	167億円
騰落率	△0.6%
分配金	0円

### 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。



NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

**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

# DCニッセイ ワールドセレクトファンド (安定型)

追加型投信／内外／資産複合

## 運用報告書(全体版)

作成対象期間:2024年2月22日～2025年2月21日

第8期(決算日 2025年2月21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。

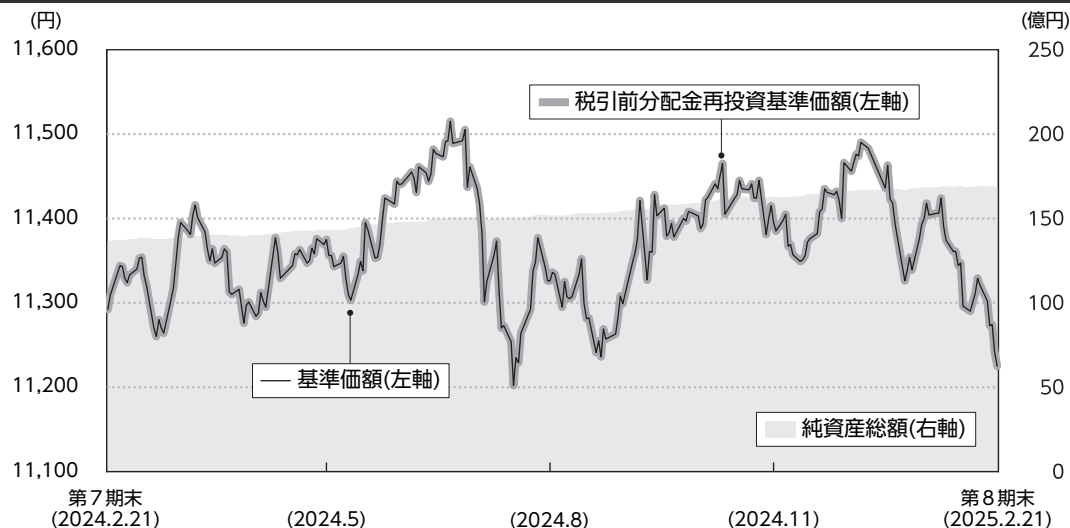
さて「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」は、このたび第8期の決算を行いました。

当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「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」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえ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。

運用経過 2024年2月22日～2025年2月21日

基準価額等の推移



第8期首	11,292円	既払分配金	0円
第8期末	11,225円	騰落率（分配金再投資ベース）	△0.6%

（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、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

（注2） 分配金を再投資するかどうかに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>

- ・2024年4月下旬から7月上旬にかけて、米国のインフレ鈍化や利下げへの期待感の高まり、堅調な企業業績などから国内外の株価が上昇したこと
- ・8月上旬から中旬にかけて、米経済の底堅さを示す経済指標や内田日銀副総裁による金融引き締めに慎重な発言などを受けて主要通貨に対して円安となったことから国内外の株価が上昇したこと
- ・9月下旬から11月中旬にかけて、米大統領選でトランプ氏優位との見方が強まったことなどを背景に物価上昇への懸念が高まったことから主要通貨に対して円安となったこと

<下落要因>

- ・2024年7月中旬から8月上旬にかけて、市場予想を上回る日銀の利上げ姿勢や米経済のソフトランディング（軟着陸）への期待感の後退などから国内外の株価が急落したこと
- ・12月下旬から当期末にかけて、堅調な米経済指標などを背景とした米利下げペースの鈍化見通しや、日銀の追加利上げ観測などから国内外の金利が上昇（債券価格は下落）基調となったこと

組入マザーファンド	投資比率	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	5.0%	5.0%	6.6%
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	60.0	60.4	△ 4.1
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	5.0	5.0	21.6
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25.0	24.7	2.0
短期金融資産	5.0	4.9	—

（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 8 期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	18円	0.154%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は11,368円です。</p>
(投信会社)	( 8)	(0.066)	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)	( 8)	(0.066)	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)	( 3)	(0.022)	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	0.000	
(株式)	( 0)	(0.000)	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)	(0.000)	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	0.000	
(株式)	( 0)	(0.000)	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	1	0.011	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)	(0.008)	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)	( 0)	(0.002)	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)	( 0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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</li> <li>・ 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</li> </ul>
合計	19	0.165	

(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。

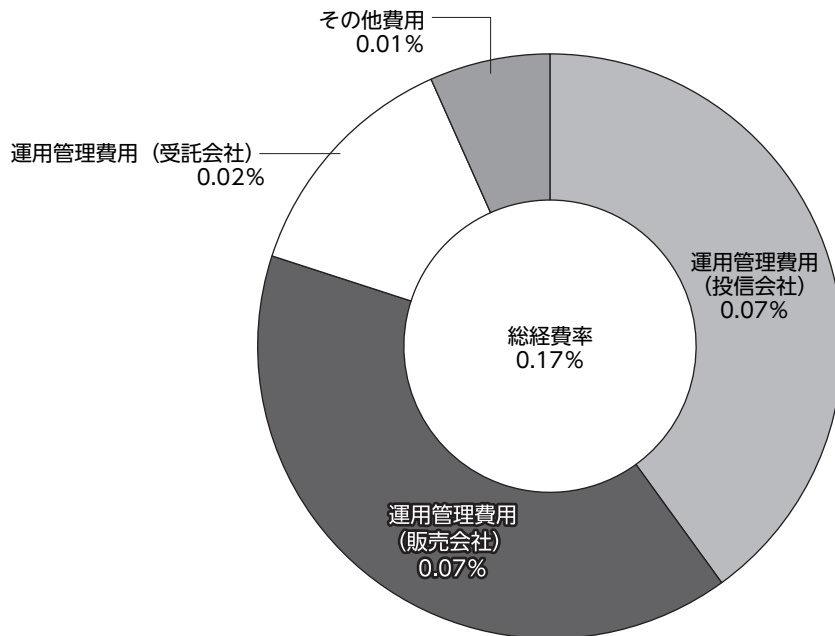
(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.17%**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。

## 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。

期初以降、米金利の上昇による円安進行や新しい少額投資非課税制度（NISA）に伴う資金流入継続などから株価は上昇する展開となりましたが、その後は中東における地政学リスクの高まりや米国における利下げ観測の後退などを受けて下落しました。2024年4月下旬以降は国内企業の積極的な株主還元姿勢や米国株の上昇を背景に堅調に推移し、6月中旬以降は米国のインフレ継続懸念が後退したことによる米金利の低下と米ハイテク銘柄の株高が追い風となって上昇しました。7月下旬以降は米景気後退懸念と日銀の追加利上げ観測の高まりによる急速な円高などから株価は大幅に下落しましたが、内田日銀副総裁の金融引き締めに慎重な発言を受けて再び円安になると反発しました。

10月に入ると株価は上下する展開となりましたが、為替市場における円安傾向や衆院選の結果を受けた景気刺激的な政策への期待感を受けて上昇しました。11月はトランプ次期米大統領の関税強化策に対する警戒感の高まりやウクライナを巡る地政学リスクの高まりからやや下落し、12月は米連邦準備制度理事会（FRB）の2025年の利下げペース鈍化見通しなどから下落する場面もありましたが、植田日銀総裁の金融引き締めに慎重な発言や堅調な米経済指標を受けて上昇しました。年明け以降もトランプ米新政権による関税強化に対する不確実性や、日銀の追加利上げとその後の金融政策への思惑が交錯し、株価は上下する展開となりましたが、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

### ■国内債券市況

10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

期初は早期のマイナス金利解除観測が高まったことを背景に上昇しました。3月中旬に日銀金融政策決定会合においてマイナス金利が解除されたものの、日銀の緩和的な金融政策継続の姿勢が示され金利は低下に転じました。4月以降は、植田日銀総裁の追加利上げに前向きな発言を受けて金利は上昇基調となりました。6月には、海外金利の低下などから低下圧力が強まる場面もありましたが、為替が円安基調を強める中、金利は上昇傾向となりました。その後、金利はもみ合い推移となりましたが、7月末の日銀金融政策決定会合において追加利上げが決定されたことをきっかけに急激な円高と株式市場の下落が進行し、8月上旬には急低下しました。

9月に入ると、米経済指標の不振から米利下げ観測が高まり国内金利も低下しましたが、10月上旬から11月下旬にかけては、堅調な米雇用統計を受けて米金利が上昇したことや衆院選における与党の過半数割れから、財政拡張への警戒感が強まったことなどを受けて上昇基調となりました。その後はもみ合い推移となりましたが、12月下旬には米利下げの鈍化見通しなどから上昇しました。年明け以降も、堅調な米経済指標や日銀の追加利上げの見通しなどから金利は上昇しました。米金利低下などから追隨して低下する局面もありましたが、1月下旬には政策金利の0.25%引き上げが決定され、追加利上げ観測も高まったことをを受けて上昇を続け、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

## ■海外株式市況

外国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2024年6月にかけて株価は下落する場面があったものの、米消費者物価指数（C P I）の伸び率鈍化などを受けて長期金利が低下したことや、欧州中央銀行（E C B）の利下げ観測等を背景に上昇しました。

7月中旬から8月上旬にかけては米大統領選を巡る混乱や米政府による対中半導体輸出規制の強化懸念、米景気の先行き懸念が高まり株価は下落しましたが、9月から10月にかけてはF R BやE C Bによる利下げ実施等を受けて上昇しました。その後は米大統領選や米連邦公開市場委員会（F O M C）での利下げの動向などを背景に市場のボラティリティ（価格変動性）が高まる場面があったものの、前期末と比較すると株価は上昇して当期末を迎えました。

## ■海外債券市況

当期の米国10年国債金利は、期初から2024年4月末にかけて米国の堅調な雇用統計や物価指標を受けて上昇しました。5月以降は物価上昇の伸びが鈍化したことで金利は低下基調となり、8月には軟調な米雇用統計の結果を受けて大きく低下しました。10月以降は米大統領選でトランプ氏が勝利するとの見方が強まったことで財政拡張への懸念から金利は上昇しました。12月のF O M Cでは2025年の利下げ回数の見通しが2回に留まったことを受けて金利は大幅に上昇し、2025年1月前半にはトランプ大統領の就任に伴い大きく上昇しました。その後は緩やかな低下基調となったものの、結局、期を通じて見ると米金利は上昇して当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初から2024年4月末にかけて米金利に伴い上昇基調となりました。その後はE C Bの金融政策で大きな動向がない中、米金利を追隨するかたちで推移し、9月末まで金利は低下基調となりました。10月のE C B理事会ではラガルド総裁の記者会見において物価安定への自信が示されたため、米金利が大幅に上昇する一方でドイツ金利の上昇幅は限定的となりました。その後、11月にドイツで連立政権が崩壊したことや12月上旬にフランスで内閣不信任決議が可決されるなどユーロ圏の政治不安が高まったものの、ドイツ金利はおおむね横ばいで推移しました。その後は再度、米金利に追隨する動きとなり、結局、期を通じて見ると、ドイツ金利は上昇して当期末を迎えました。

## ■為替市況

当期の米ドル／円レートは小幅な米ドル安円高となりました。

2024年3月前半には日銀のマイナス金利政策解除への期待感が高まったことで米ドル安円高となりました。その後、日銀はマイナス金利政策解除とイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、Y C C）の廃止を決定しましたが、植田日銀総裁が緩和的な金融環境を維持する姿勢を示したことを受けて米ドル高円安に転じました。4月以降も米ドル高円安基調となりましたが、7月には日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあり、急速に米ドル安円高となりました。8月には軟調な米雇用統計の結果を受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が高まり大きく米ドル安円高となりましたが、10月には米ドル高円安に転じ、米大統領選でトランプ氏優位との見方が強まったことから財政拡張などの懸念が高まり12月末までおおむね米ドル高円安基調となりました。2025年1月以降は植田日銀総裁の追加利上げに前向きな発言を受けて米ドル安円高基調となり、結局、期を通じて見ると小幅な米ドル安円高で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートはユーロ安円高となりました。

期初以降、ユーロ／円レートは米ドル／円レートの動きにおおむね追隨して推移しました。2024年8月に軟調な米雇用統計の結果を受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が高まり大きくユーロ安円高となりましたが、米ドル／円レートと比較して影響は限定的となりました。10月以降は米大統領選でトランプ氏優位との見方が強まり関税政策による欧州景気の下押し懸念が意識される場面もありましたが、米ドル高円安に連れるかたちでユーロ高円安となりました。2025年1月以降は植田日銀総裁の追加利上げに前向きな発言を受けてユーロ安円高基調となり、結局、期を通じて見るとユーロ安円高で当期末を迎えました。

## ポートフォリオ

### ■当ファンド

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「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」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行いました。

### ■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。

#### <ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

国内の公社債に投資することにより、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合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。

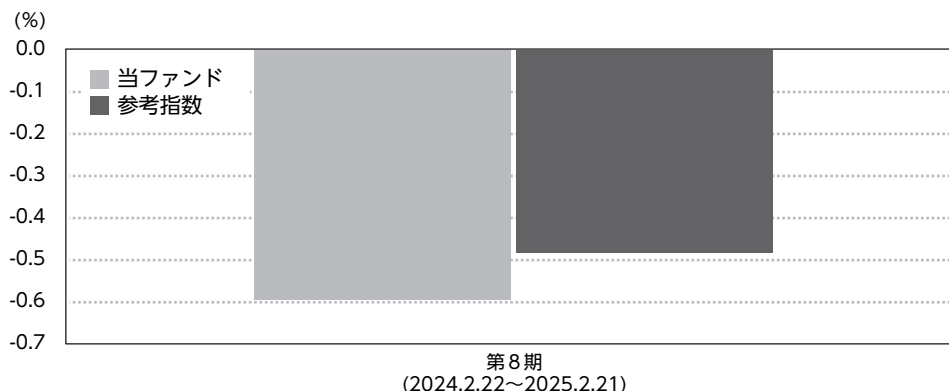
#### <ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く主要国の国債に投資することにより、ベンチマークである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、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、無担保コール翌日物の収益率に投資比率を乗じて合成したものです。

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-0.6%となり、参考指数騰落率（-0.5%）を下回りました。信託報酬等を控除した関係などから参考指数騰落率を下回る結果となりました。

（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 2024年2月22日～2025年2月21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	1,224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

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ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」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。相場動向やその見通しによって資産配分比率を変更するファンドではありません。従って、今後も投資比率（基準ポートフォリオ）に基づいて各マザーファンド受益証券の組み入れを行い、同投資比率を継続的に維持していく予定です。

## ■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。

### <ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

国内の公社債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。

### <ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く主要国の国債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8期末 2025年2月21日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	5.0%
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	60.4
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	5.0
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	24.7

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

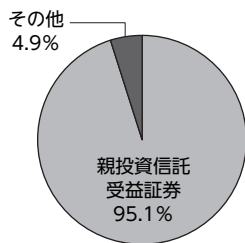
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

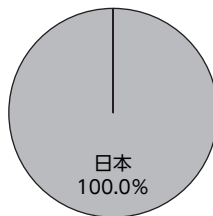
項目	第8期末 2025年2月21日
純資産総額	16,776,611,725円
受益権総口数	14,946,349,173口
1万口当たり基準価額	11,225円

(注) 当期間中における追加設定元本額は4,972,144,847円、同解約元本額は2,038,142,098円です。

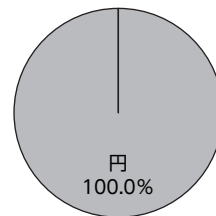
### ■資産別配分



### ■国別配分



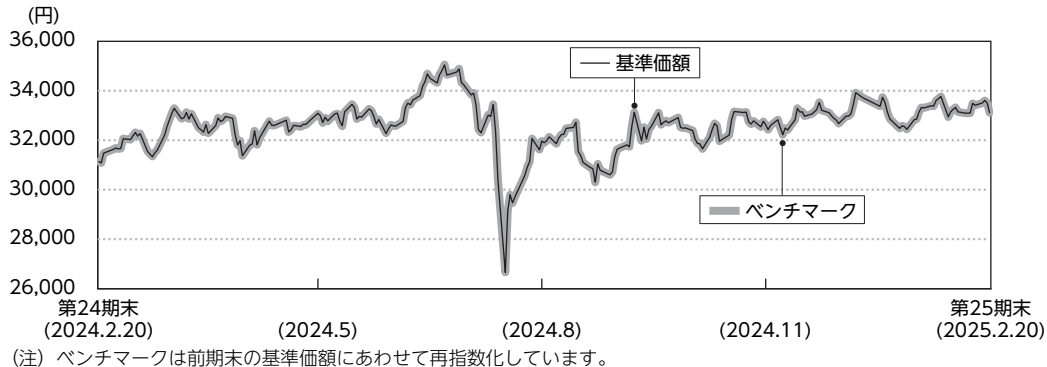
### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2025年2月21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



## ■ 上位銘柄

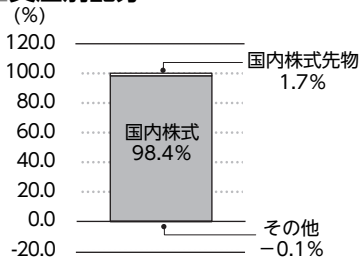
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.6%
ソニーグループ	円	3.2
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	3.1
日立製作所	円	2.8
三井住友フィナンシャルグループ	円	2.0
リクルートホールディングス	円	2.0
任天堂	円	1.8
TOPIX 先物 0703月 買	円	1.7
キーエンス	円	1.6
みずほフィナンシャルグループ	円	1.5
組入銘柄数	1,610	

## ■ 1万口当たりの費用明細

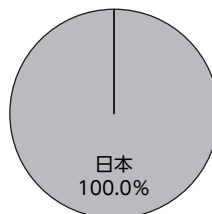
2024.2.21～2025.2.20

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

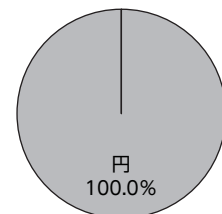
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



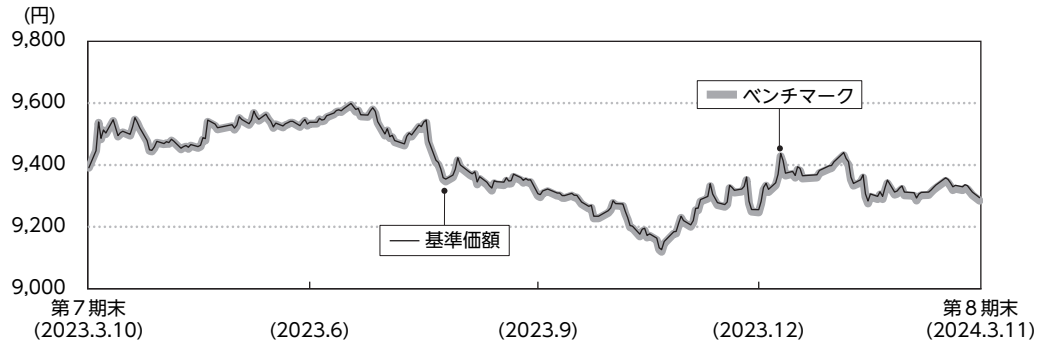
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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（2025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。

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



## ■ 上位銘柄

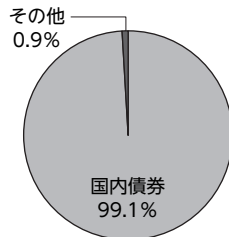
銘柄名	通貨	比率
第372回 利付国債 (10年)	円	0.9%
第340回 利付国債 (10年)	円	0.9
第341回 利付国債 (10年)	円	0.8
第145回 利付国債 (5年)	円	0.8
第370回 利付国債 (10年)	円	0.8
第149回 利付国債 (5年)	円	0.8
第339回 利付国債 (10年)	円	0.8
第350回 利付国債 (10年)	円	0.8
第369回 利付国債 (10年)	円	0.8
第366回 利付国債 (10年)	円	0.8
組入銘柄数		357

## ■ 1万口当たりの費用明細

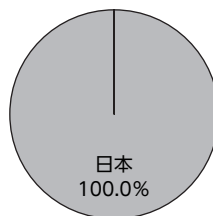
2023.3.11~2024.3.11

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

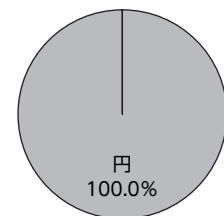
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



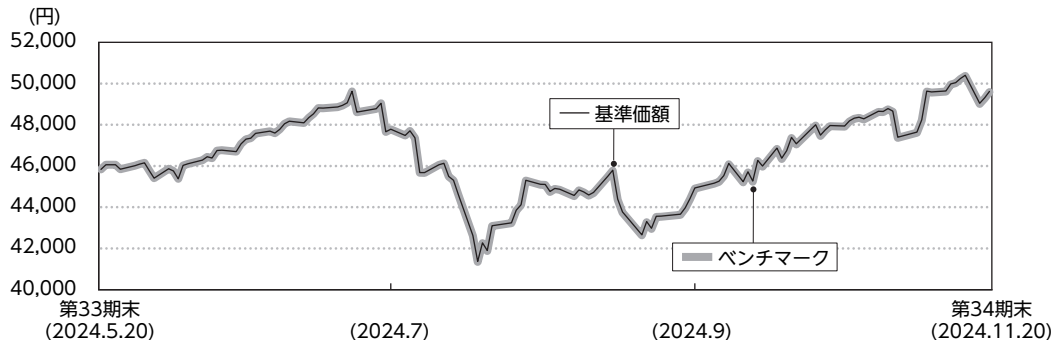
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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3月11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

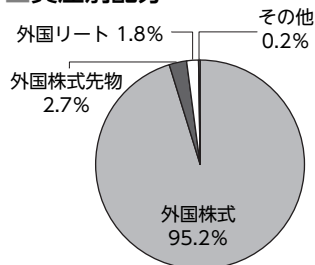
銘柄名	通貨	比率
NVIDIA CORP	米ドル	5.3%
APPLE INC	米ドル	4.9
MICROSOFT CORP	米ドル	4.3
AMAZON.COM INC	米ドル	2.8
S&P 500 EMINI FUTURE 202412 買	米ドル	2.0
META PLATFORMS INC-A	米ドル	1.8
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.5
TESLA, INC.	米ドル	1.4
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.3
BROADCOM INC	米ドル	1.1
組入銘柄数		1,214

## ■ 1万口当たりの費用明細

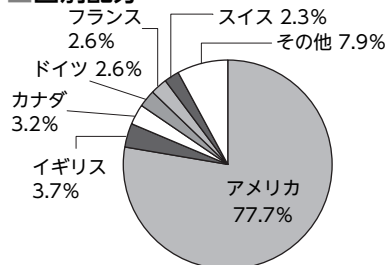
2024.5.21~2024.11.20

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

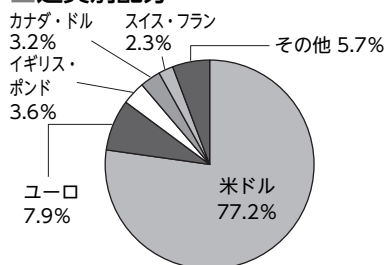
## ■ 資産別配分



## ■ 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。

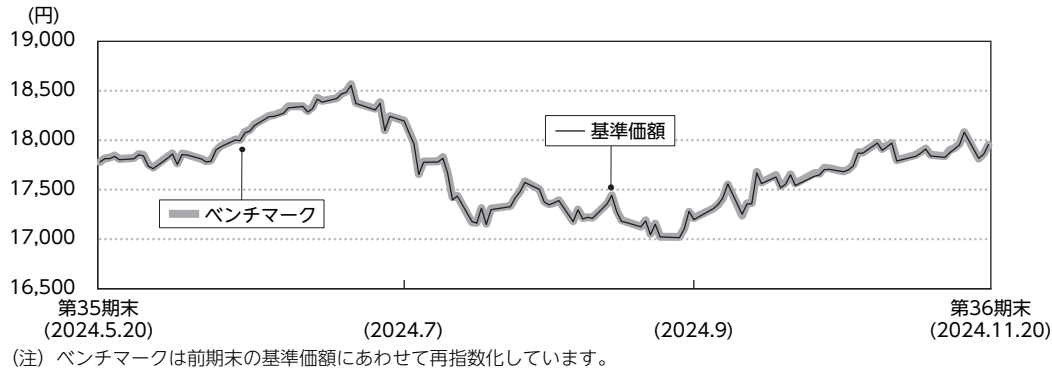
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2024年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(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。

## ニッセイ外国債券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

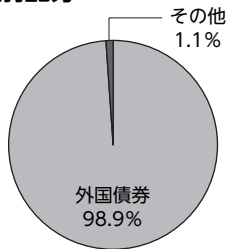
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 1.5% 2026/8/15	米ドル	2.4%
US TREASURY 1.625% 2026/2/15	米ドル	2.3
US TREASURY 1.625% 2026/5/15	米ドル	1.8
US TREASURY 2.625% 2029/2/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.25% 2025/11/15	米ドル	1.4
US TREASURY 2.375% 2029/5/15	米ドル	1.4
US TREASURY 2.375% 2027/5/15	米ドル	1.4
US TREASURY 2.0% 2026/11/15	米ドル	1.3
US TREASURY 1.625% 2029/8/15	米ドル	1.3
US TREASURY 2.25% 2027/2/15	米ドル	1.3
組入銘柄数	866	

## ■ 1万口当たりの費用明細

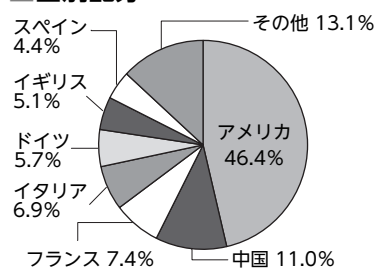
2024.5.21~2024.11.20

項目	金額
その他費用 (保管費用) (その他)	3円 (3) (0)
合計	3

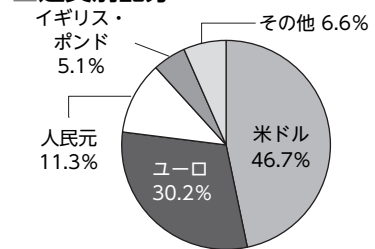
## ■ 資産別配分



## ■ 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) 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。

## 最近 5 期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
4 期 (2021年 2 月22日)	10,669	0	0.7	10,669	10,738	0.9	9.9	0.2	83.9	0.1	5,944
5 期 (2022年 2 月21日)	10,748	0	0.7	10,748	10,842	1.0	9.4	0.4	84.2	0.1	8,963
6 期 (2023年 2 月21日)	10,587	0	△1.5	10,587	10,714	△1.2	9.7	0.3	83.8	0.1	11,023
7 期 (2024年 2 月21日)	11,292	0	6.7	11,292	11,450	6.9	9.8	0.2	83.9	0.1	13,564
8 期 (2025年 2 月21日)	11,225	0	△0.6	11,225	11,395	△0.5	9.7	0.2	84.0	0.1	16,776

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注 2) 「基準価額+累計分配金」は、当該決算期の基準価額 (分配落) に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

(注 3) 参考指数は設定時を 10,000 として指数化しています。

(注 4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注 5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注 6) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2024年 2 月21日	11,292	—	11,450	—	9.8	0.2	83.9	0.1
2 月末	11,324	0.3	11,482	0.3	10.0	0.3	83.9	0.1
3 月末	11,401	1.0	11,560	1.0	9.9	0.2	84.0	0.1
4 月末	11,377	0.8	11,537	0.8	9.8	0.3	84.0	0.1
5 月末	11,303	0.1	11,463	0.1	9.9	0.3	83.8	0.1
6 月末	11,461	1.5	11,624	1.5	9.9	0.3	84.1	0.1
7 月末	11,316	0.2	11,475	0.2	9.4	0.2	84.5	0.1
8 月末	11,307	0.1	11,468	0.2	10.4	0.3	83.3	0.1
9 月末	11,327	0.3	11,492	0.4	9.8	0.3	84.1	0.1
10月末	11,465	1.5	11,632	1.6	9.9	0.3	84.1	0.1
11月末	11,357	0.6	11,526	0.7	9.9	0.2	84.0	0.1
12月末	11,483	1.7	11,654	1.8	9.9	0.2	84.3	0.1
2025年 1 月末	11,374	0.7	11,547	0.8	9.8	0.2	84.2	0.1
(期末)2025年 2 月21日	11,225	△0.6	11,395	△0.5	9.7	0.2	84.0	0.1

(注) 期末基準価額は分配金 (税引前) 込み、騰落率は期首比です。



## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2024年2月22日～2025年2月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	142,450	452,020	110,444	353,910
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	4,614,463	4,220,714	2,003,220	1,834,873
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	83,073	380,046	82,123	384,299
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	958,573	1,688,890	563,075	999,410

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	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
(a) 期中の株式売買金額	71,834,761千円	114,382,112千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	244,243,653千円	1,034,266,808千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.29	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 外国株式の(a)は各月末（決算日の属する月については決算日）、(b)は各月末の国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

## 利害関係人との取引状況等

2024年2月22日～2025年2月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)

## 親投資信託残高

2025年2月21日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	223,426	255,432	846,400
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	8,705,551	11,316,794	10,127,399
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	166,749	167,699	840,612
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,989,696	2,385,194	4,142,366

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが87,977,940千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,282,175千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが238,543,985千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが53,426,797千口です。

## 投資信託財産の構成

2025年2月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	846,400	5.0
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	10,127,399	60.2
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	840,612	5.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	4,142,366	24.6
コール・ローン等、その他	853,830	5.1
投資信託財産総額	16,810,609	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル149.86円、1カナダ・ドル105.67円、1オーストラリア・ドル95.85円、1香港ドル19.27円、1シンガポール・ドル112.32円、1ニュージーランド・ドル86.33円、1イギリス・ポンド189.74円、1イスラエル・シェケル42.231円、1スイス・フラン166.70円、1デンマーク・クローネ21.07円、1ノルウェー・クローネ13.48円、1スウェーデン・クローナ14.08円、1メキシコ・ペソ7.38円、1人民元20.676円、1マレーシア・リンギット33.899円、1ポーランド・ズロチ37.767円、1ユーロ157.19円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,181,764,978千円）の投資信託財産総額（1,197,250,461千円）に対する比率は98.7%です。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（92,711,238千円）の投資信託財産総額（93,081,815千円）に対する比率は99.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2025年2月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	16,810,609,748円
コール・ローン等	833,341,129
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	846,400,681
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	10,127,399,664
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	840,612,167
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	4,142,366,796
未収入金	20,489,311
(B)負債	33,998,023
未払解約金	21,425,216
未払信託報酬	12,483,725
その他未払費用	89,082
(C)純資産総額(A-B)	16,776,611,725
元本	14,946,349,173
次期繰越損益金	1,830,262,552
(D)受益権総口数	14,946,349,173口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,225円

(注) 期首元本額 12,012,346,424円  
期中追加設定元本額 4,972,144,847円  
期中一部解約元本額 2,038,142,098円

## 損益の状況

当期 (2024年2月22日～2025年2月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,176,167円
受取利息	1,180,078
支払利息	△ 3,911
(B)有価証券売買損益	△ 114,916,323
売買益	279,923,797
売買損	△ 394,840,120
(C)信託報酬等	△ 23,787,184
(D)当期損益金(A+B+C)	△ 137,527,340
(E)前期繰越損益金	564,214,576
(分配準備積立金)	( 564,416,597)
(繰越欠損金)	(△ 202,021)
(F)追加信託差損益金*	1,403,575,316
(配当等相当額)	( 848,842,350)
(売買損益相当額)	( 554,732,966)
(G)合計(D+E+F)	1,830,262,552
次期繰越損益金(G)	1,830,262,552
追加信託差損益金	1,403,575,316
(配当等相当額)	( 848,842,350)
(売買損益相当額)	( 554,732,966)
分配準備積立金	564,416,597
繰越欠損金	△ 137,729,361

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。  
(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。  
(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。  
(注4) (F)追加信託差損益金\*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

## 分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	1,265,845,955円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	564,416,597円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	1,830,262,552円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	1,224.55円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

# 当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合		
信 託 期 間	無期限		
運 用 方 針	下記マザーファンド受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。		
主要運用対象	D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ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」受益証券	
	国内株式マザーファンド	国内の金融商品取引所上場株式等	
	国内債券マザーファンド	国内の公社債	
	外国株式マザーファンド	日本を除く主要先進国の株式	
	外国債券マザーファンド	日本を除く主要国の国債	
運用方法	D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	各マザーファンドへは、原則として下記の比率で投資し、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。また株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の25%以下とし、外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。 ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド ..... 5% ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド .....60% ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド ..... 5% ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド .....25% 短期金融資産 ..... 5%	
	国内株式マザーファンド	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。	
	国内債券マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りです。	
	外国株式マザーファンド	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。	
	外国債券マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・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。		

# ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第 25 期

(計算期間：2024年2月21日～2025年2月20日)

### 運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。  
株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

### 主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

### 運用方法

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。



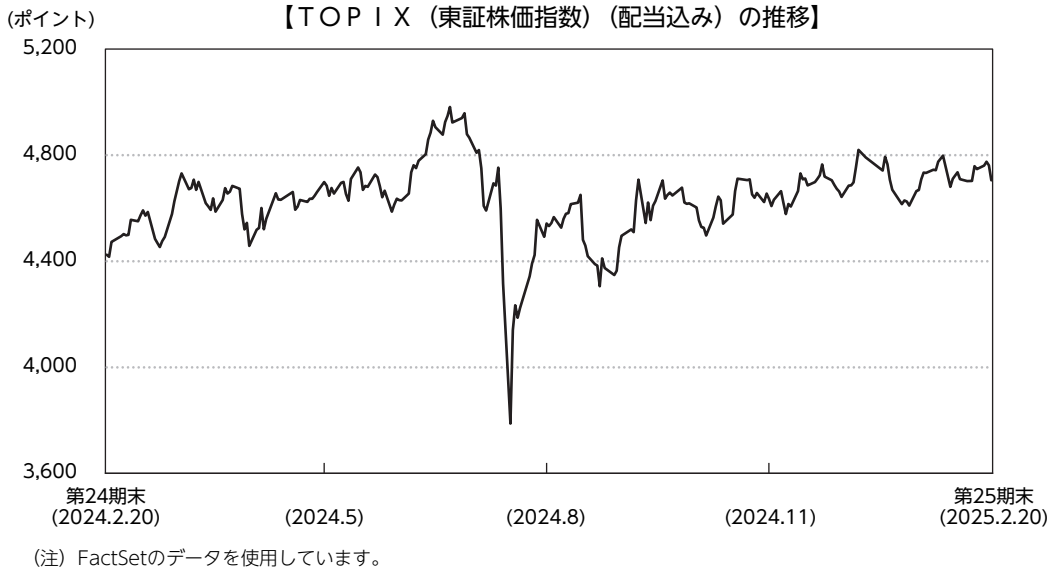
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2024年2月21日～2025年2月20日

## 国内株式市況

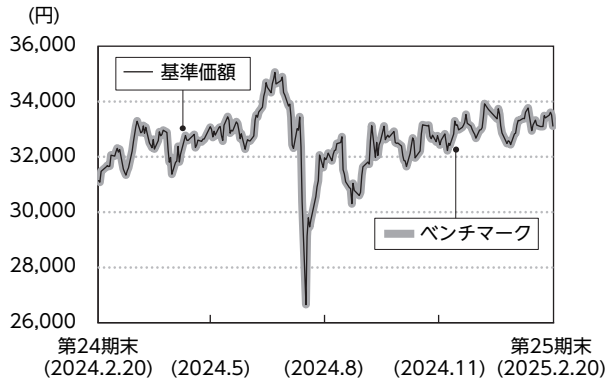


国内株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、米金利の上昇による円安進行や新しい少額投資非課税制度（NISA）に伴う資金流入継続などから株価は上昇する展開となりましたが、その後は中東における地政学リスクの高まりや米国における利下げ観測の後退などを受けて下落しました。2024年4月下旬以降は国内企業の積極的な株主還元姿勢や米国株の上昇を背景に堅調に推移し、6月中旬以降は米国のインフレ継続懸念が後退したことによる米金利の低下と米ハイテク銘柄の株高が追い風となって上昇しました。7月下旬以降は米景気後退懸念と日銀の追加利上げ観測の高まりによる急速な円高などから株価は大幅に下落しましたが、内田日銀副総裁の金融引き締めに慎重な発言を受けて再び円安になると反発しました。

10月に入ると株価は上下する展開となりましたが、為替市場における円安傾向や衆院選の結果を受けた景気刺激的な政策への期待感を受けて上昇しました。11月はトランプ次期米大統領の関税強化策に対する警戒感の高まりやウクライナを巡る地政学リスクの高まりからやや下落し、12月は米連邦準備制度理事会（FRB）の2025年の利下げペース鈍化見通しなどから下落する場面もありましたが、植田日銀総裁の金融引き締めに慎重な発言や堅調な米経済指標を受けて上昇しました。年明け以降もトランプ米新政権による関税強化に対する不確実性や、日銀の追加利上げとその後の金融政策への思惑が交錯し、株価は上下する展開となりましたが、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



### ■基準価額の主な変動要因

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った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは前掲の「国内株式市況」をご参照ください。

(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。

## ポートフォリオ

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した。

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+6.3%となり、ベンチマーク騰落率(+6.3%)に連動しました。

## ■今後の運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、ベンチマーク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。



## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	%		%	%	%	百万円
21期(2021年 2月22日)	21,336	18.5	21,558	18.6	99.3	0.7	170,293
22期(2022年 2月21日)	21,482	0.7	21,702	0.7	96.1	3.7	117,060
23期(2023年 2月20日)	23,077	7.4	23,334	7.5	97.9	2.1	187,428
24期(2024年 2月20日)	31,139	34.9	31,493	35.0	98.8	1.0	224,002
25期(2025年 2月20日)	33,113	6.3	33,486	6.3	98.4	1.7	291,269

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率
	円	%		%	%	%
(期首)2024年 2月20日	31,139	—	31,493	—	98.8	1.0
2月末	31,659	1.7	32,024	1.7	98.5	1.5
3月末	33,063	6.2	33,445	6.2	97.6	2.5
4月末	32,769	5.2	33,139	5.2	97.5	2.5
5月末	33,142	6.4	33,523	6.4	97.6	2.4
6月末	33,620	8.0	34,010	8.0	98.0	2.0
7月末	33,436	7.4	33,826	7.4	98.1	1.8
8月末	32,477	4.3	32,846	4.3	97.5	2.5
9月末	31,974	2.7	32,343	2.7	96.8	3.5
10月末	32,578	4.6	32,951	4.6	97.5	2.5
11月末	32,410	4.1	32,782	4.1	97.6	2.4
12月末	33,714	8.3	34,100	8.3	97.9	1.9
2025年 1月末	33,766	8.4	34,148	8.4	98.4	1.7
(期末)2025年 2月20日	33,113	6.3	33,486	6.3	98.4	1.7

(注) 騰落率は期首比です。

## 1 万口当たりの費用明細

2024年2月21日～2025年2月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (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 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
その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・ 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	0	0.001	

(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。

(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（32,600円）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。

## 売買および取引の状況

2024年2月21日～2025年2月20日

## (1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		30,179	63,989,608	5,066	7,805,742
		(21,921)			

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

(注2) ( )内は株式分割、合併などによる増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 株数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

## (2) 先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		51,466	48,819	—	—

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2024年2月21日～2025年2月20日

## 株式

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	707	2,037,617	2,880	J S R	64	281,154	4,332
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,121	1,959,480	1,747	ゆうちょ銀行	176	244,149	1,382
日立製作所	433	1,832,677	4,225	日本郵船	47	243,315	5,079
ソニーグループ	316	1,438,436	4,539	トヨタ自動車	59	188,125	3,145
リクルートホールディングス	143	1,396,928	9,734	三菱商事	61	179,397	2,898
三井住友フィナンシャルグループ	216	999,146	4,612	ローソン	13	140,443	10,326
キーエンス	14	943,532	65,523	三菱電機	53	127,758	2,388
任天堂	90	894,775	9,865	I N P E X	51	119,650	2,309
東京エレクトロン	30	844,202	27,769	大正製薬ホールディングス	13	113,098	8,568
第一三共	177	808,193	4,566	日本郵政	69	102,503	1,477

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 株数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

## 組入有望証券明細表

2025年2月20日現在

(1) 国内株式  
上場株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
極洋	3	4	17,780
ニッスイ	83	102	87,856
マルハニチロ	12	15	48,042
雪国まいたけ	7	8	10,612
カネコ種苗	2	2	4,057
サカタのタネ	9	12	43,815
ホクト	6	9	17,802
<b>鉱業(0.2%)</b>			
住石ホールディングス	9	12	10,087
日鉄鉱業	3	4	23,534
I N P E X	307	311	591,556
石油資源開発	9	56	63,562
K & Oエナジーグループ	3	4	15,134
<b>建設業(2.2%)</b>			
ショーボンドホールディングス	11	13	64,354
ミライト・ワン	27	33	75,723
タマホーム	5	6	21,417
ファーストコーポレーション	1	—	—
第一カッター興業	—	4	6,820
安藤・間	48	59	78,374
東急建設	26	32	24,858
コムシスホールディングス	26	36	117,274
ビーアールホールディングス	17	20	6,942
高松コンストラクショングループ	6	7	20,801
東建コーポレーション	2	2	27,412
ソネック	1	—	—
ヤマウラ	4	5	6,939

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オリエンタル白石	30	38	14,401
大成建設	54	65	454,333
大林組	208	237	478,014
清水建設	164	196	278,767
飛島建設	6	—	—
長谷工コーポレーション	53	66	131,274
松井建設	7	4	4,440
鹿島建設	128	159	493,473
不動テトラ	4	4	9,819
鉄建建設	4	4	12,102
西松建設	11	11	56,626
三井住友建設	43	58	23,937
大豊建設	2	2	7,270
佐田建設	2	—	—
ナカノフドー建設	0.100	—	—
奥村組	9	12	54,864
東鉄工業	7	7	24,371
浅沼組	4	28	19,440
戸田建設	78	88	87,696
熊谷組	9	11	45,517
植木組	0.900	—	—
矢作建設工業	7	9	12,622
ピーエス・コンストラクション	7	5	7,852
日本ハウスホールディングス	21	21	6,923
新日本建設	8	10	14,382
東亜道路工業	2	12	18,562
日本道路	6	7	13,752
東亜建設工業	4	21	29,468
日本国土開発	16	23	11,178
若築建設	2	2	7,465
東洋建設	14	20	27,593
五洋建設	82	94	61,776
世紀東急工業	7	10	15,851
福田組	2	2	13,824
住友林業	50	62	278,096
日本基礎技術	8	—	—
巴コーポレーション	6	—	—
大和ハウス工業	160	217	1,067,377
ライト工業	12	14	37,697
積水ハウス	176	218	732,513
日特建設	5	6	7,286

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
北陸電気工事	5	—	—
ユアテック	12	13	21,718
日本リーテック	5	5	8,187
四電工	2	9	12,123
中電工	9	11	36,008
関電工	36	39	103,272
きんでん	40	50	162,273
東京エネシス	6	7	8,323
トーエネック	1	11	11,947
住友電設	5	5	27,759
日本電設工業	10	13	28,903
エクシオグループ	28	74	130,002
新日本空調	3	9	15,317
九電工	12	15	70,652
三機工業	12	15	50,175
日揮ホールディングス	57	71	80,390
中外炉工業	2	2	8,868
ヤマト	2	—	—
太平電業	3	4	22,310
高砂熱学工業	15	17	95,787
朝日工業社	2	6	13,513
明星工業	11	12	15,197
大気社	6	9	42,872
ダイダン	7	9	36,527
日比谷総合設備	4	5	18,880
飛島ホールディングス	—	7	12,972
テスホールディングス	13	22	6,297
インフロニア・ホールディングス	67	75	86,372
東洋エンジニアリング	8	10	7,589
レイズネクスト	8	10	16,213
<b>食料品(2.9%)</b>			
ニッポン	17	23	50,337
日清製粉グループ本社	54	75	127,351
日東富士製粉	1	1	8,554
昭和産業	5	6	17,104
中部飼料	8	10	12,680
フィード・ワン	8	10	8,480
日本甜菜製糖	3	3	9,013
DM三井製糖ホールディングス	5	7	24,228
ウェルネオシュガー	2	4	9,274
森永製菓	25	30	74,775

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
中村屋	2	2	6,963
江崎グリコ	16	20	95,054
名糖産業	3	3	6,766
井村屋グループ	3	4	9,800
不二家	4	5	11,145
山崎製パン	39	48	132,519
モロゾフ	1	7	11,599
亀田製菓	3	4	18,147
寿スピリッツ	27	42	102,117
カルビー	26	33	94,335
森永乳業	20	26	81,991
六甲バター	4	6	6,894
ヤクルト本社	83	103	301,790
明治ホールディングス	71	93	272,629
雪印メグミルク	14	19	49,276
プリマハム	7	9	20,728
日本ハム	25	31	139,732
林兼産業	1	—	—
丸大食品	5	7	12,045
S Foods	6	8	18,824
柿安本店	2	3	8,912
伊藤ハム米久ホールディングス	8	11	40,755
サッポロホールディングス	19	23	183,141
アサヒグループホールディングス	134	542	969,076
キリンホールディングス	243	301	602,651
シマダヤ	—	4	6,696
宝ホールディングス	39	48	57,539
オエノンホールディングス	17	23	9,898
養命酒製造	3	—	—
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	45	45	108,538
ライフドリンク カンパニー	—	15	29,372
サントリー食品インターナショナル	41	50	234,801
ダイドーグループホールディングス	6	8	24,050
伊藤園	19	24	79,714
キーコーヒー	6	8	16,669
日清オイリオグループ	8	10	48,501
不二製油グループ本社	13	14	37,008
J-オイルミルズ	6	8	16,326
キッコーマン	38	239	341,886
味の素	138	167	999,472
ブルドックソース	3	4	7,040

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キューピー	31	38	108,737
ハウス食品グループ本社	20	24	67,250
カゴメ	25	30	87,524
アリアケジャパン	5	7	42,984
エバラ食品工業	2	2	6,847
ニチレイ	26	28	98,841
東洋水産	29	33	306,826
イートアンドホールディングス	3	3	7,788
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6	—	—
日清食品ホールディングス	61	91	266,248
永谷園ホールディングス	2	—	—
フジッコ	6	7	12,047
ロック・フィールド	7	8	12,619
日本たばこ産業	354	439	1,631,120
ケンコーマヨネーズ	4	4	8,374
わらべや日洋ホールディングス	3	4	10,084
なとり	3	4	9,720
ファーマフーズ	8	9	8,995
ユーグレナ	36	44	21,596
紀文食品	5	6	6,558
ピックルスホールディングス	5	6	6,922
理研ビタミン	5	6	14,415
<b>繊維製品(0.4%)</b>			
片倉工業	5	6	13,362
グンゼ	4	5	26,312
東洋紡	25	31	30,655
富士紡ホールディングス	2	2	13,601
倉敷紡績	4	4	29,057
シキボウ	—	6	7,003
日本毛織	15	18	24,590
帝国繊維	6	8	19,969
帝人	57	70	91,874
東レ	397	537	528,900
日本フェルト	5	—	—
イチカワ	3	—	—
アツギ	10	—	—
セーレン	11	14	37,516
ソトー	5	—	—
東海染工	1	—	—
小松マテーレ	8	10	8,485
ワコールホールディングス	12	15	78,523

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ホギメディカル	7	9	47,916
T S Iホールディングス	19	23	28,652
マツオカコーポレーション	3	—	—
ワールド	8	11	26,329
三陽商会	—	3	10,947
オンワードホールディングス	35	47	26,425
ルックホールディングス	—	3	7,027
ゴールドウイン	10	13	94,464
デサント	10	—	—
ヤマトインターナショナル	14	—	—
<b>パルプ・紙(0.1%)</b>			
特種東海製紙	3	3	13,338
王子ホールディングス	247	278	175,315
日本製紙	33	38	38,912
三菱製紙	4	—	—
北越コーポレーション	29	41	57,778
大王製紙	26	37	30,533
阿波製紙	3	—	—
レンゴー	54	66	53,573
トーモク	3	4	10,084
ザ・パックス	4	5	18,562
<b>化学(4.9%)</b>			
北の達人コーポレーション	26	41	6,987
クラレ	86	98	183,152
旭化成	401	497	498,992
レゾナック・ホールディングス	57	66	231,858
住友化学	440	591	203,535
住友精化	2	3	17,570
日産化学	27	37	164,959
ラサ工業	2	2	7,462
クレハ	13	15	41,967
多木化学	2	2	10,063
テイカ	5	5	7,801
石原産業	9	12	20,727
日本曹達	7	15	45,349
東ソー	79	98	206,956
トクヤマ	19	23	63,093
セントラル硝子	6	9	29,992
東亜合成	28	34	47,774
大阪ソーダ	4	25	35,440
関東電化工業	11	15	14,077

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
デンカ	21	26	55,789
信越化学工業	538	654	3,026,712
日本カーバイド工業	4	3	7,452
堺化学工業	4	5	13,907
第一稀元素化学工業	6	9	6,731
エア・ウォーター	56	69	131,166
日本酸素ホールディングス	57	71	307,160
日本化学工業	3	—	—
日本パーカライズニング	26	32	41,984
高圧ガス工業	8	10	9,137
四国化成ホールディングス	7	8	16,043
ステラ ケミファ	3	4	17,100
保土谷化学工業	1	2	7,222
日本触媒	8	47	85,203
大日精化工業	4	5	15,631
カネカ	15	18	67,631
三菱瓦斯化学	44	59	140,030
三井化学	49	66	221,770
J S R	64	—	—
東京応化工業	28	35	131,133
大阪有機化学工業	5	6	16,095
三菱ケミカルグループ	434	537	410,081
K Hネオケム	9	13	33,276
ダイセル	76	83	111,062
住友ベークライト	8	23	80,527
積水化学工業	119	146	366,000
日本ゼオン	40	56	84,426
アイカ工業	15	18	61,789
UBE	28	37	83,398
積水樹脂	8	9	17,856
タキロンシーアイ	15	—	—
旭有機材	4	4	19,649
ニチバン	3	4	9,236
リケンテクノス	12	13	13,173
大倉工業	2	3	12,121
積水化成成品工業	12	19	6,848
群栄化学工業	1	2	6,775
ダイキョーニシカワ	13	16	9,849
森六ホールディングス	3	4	8,200
恵和	4	6	8,636
日本化薬	45	49	66,906

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
カーリット	6	7	7,920
日本精化	3	4	10,760
扶桑化学工業	6	6	24,106
トリケミカル研究所	7	8	30,360
A D E K A	20	25	70,784
日油	17	86	182,379
新日本理化	5	—	—
ハリマ化成グループ	7	8	6,966
花王	134	179	1,155,374
第一工業製薬	3	2	6,999
石原ケミカル	3	3	6,822
三洋化成工業	3	4	17,910
大日本塗料	6	8	10,012
日本ペイントホールディングス	315	325	335,812
関西ペイント	58	61	135,242
中国塗料	12	16	36,204
藤倉化成	14	13	6,838
太陽ホールディングス	10	12	52,224
D I C	23	26	84,303
サカタインクス	13	16	29,241
a r t i e n c e	12	13	39,481
T & K T O K A	5	—	—
富士フイルムホールディングス	110	444	1,342,656
資生堂	124	153	409,917
ライオン	77	93	168,660
高砂香料工業	4	5	33,250
マンダム	12	14	18,060
ミルボン	8	11	34,633
ファンケル	26	—	—
コーセー	12	15	93,000
コタ	5	7	11,325
ポーラ・オルビスホールディングス	30	37	46,107
ノエビアホールディングス	5	6	27,456
新日本製薬	3	4	9,160
エステー	4	6	8,868
アグロ カネショウ	4	—	—
コニシ	17	23	27,979
長谷川香料	11	14	37,886
小林製薬	17	19	109,102
荒川化学工業	5	6	7,894
メック	4	6	15,988

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本高純度化学	2	2	6,886
タカラバイオ	16	23	20,559
J C U	6	8	30,213
新田ゼラチン	0.500	—	—
O A T アグリオ	3	—	—
デクセリアルズ	14	64	145,770
アース製薬	5	6	34,000
北興化学工業	6	6	8,553
大成ラミック	2	2	6,750
クミアイ化学工業	23	29	22,150
日本農薬	10	11	8,621
アキレス	4	4	6,862
有沢製作所	10	11	15,739
日東電工	38	232	691,765
レック	7	9	11,627
三光合成	—	10	6,681
きもと	4	—	—
Z A C R O S	4	5	24,447
前澤化成工業	4	5	9,287
未来工業	2	2	8,801
J S P	4	6	12,276
エフピコ	11	16	48,785
天馬	4	6	16,006
信越ポリマー	12	15	24,724
ニフコ	17	27	100,375
バルカー	5	5	18,564
ユニ・チャーム	123	460	517,955
<b>医薬品(4.0%)</b>			
協和キリン	71	86	176,447
武田薬品工業	526	655	2,726,287
アステラス製薬	521	645	938,815
住友ファーマ	44	65	50,238
塩野義製薬	75	244	536,751
わかもと製薬	3	—	—
日本新薬	15	19	74,324
中外製薬	186	230	1,695,558
科研製薬	10	12	55,880
エーザイ	72	96	407,656
ロート製薬	57	77	177,806
小野薬品工業	126	150	229,589
久光製薬	13	16	69,486



# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
持田製薬	6	9	28,737
参天製薬	108	133	187,760
扶桑薬品工業	2	2	7,032
ツムラ	18	25	110,181
キッセイ薬品工業	9	11	43,197
生化学工業	10	14	10,808
栄研化学	10	11	24,858
鳥居薬品	3	4	16,700
J C R ファーマ	20	24	13,197
東和薬品	9	9	28,264
富士製薬工業	4	5	7,414
ゼリア新薬工業	8	11	23,329
ネクスラファーマ	19	34	29,237
第一三共	518	695	2,374,815
杏林製薬	12	16	21,456
ダイト	4	5	10,429
大塚ホールディングス	123	181	1,297,310
大正製薬ホールディングス	13	—	—
ペプチドリーム	28	35	74,684
セルソース	3	8	6,930
あすか製薬ホールディングス	6	6	13,051
サワイグループホールディングス	13	43	89,154
<b>石油・石炭製品(0.6%)</b>			
日本コークス工業	60	74	6,881
ニチレキグループ	7	7	17,628
ユシロ化学工業	3	3	7,824
富士石油	17	18	6,128
出光興産	330	344	353,562
ENEOSホールディングス	941	1,249	1,056,778
コスモエネルギーホールディングス	17	24	163,174
<b>ゴム製品(0.6%)</b>			
横浜ゴム	30	37	124,694
TOYO TIRE	34	42	105,157
ブリヂストン	174	215	1,263,200
住友ゴム工業	58	72	123,633
藤倉コンポジット	4	7	10,209
オカモト	2	3	19,422
フコク	3	4	7,057
ニッタ	6	7	25,632
住友理工	9	14	24,066

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三ツ星ベルト	7	10	38,862
バンドー化学	8	10	18,758
<b>ガラス・土石製品(0.6%)</b>			
日東紡績	7	8	41,209
A G C	53	71	319,550
日本板硝子	28	37	14,816
日本電気硝子	24	27	97,188
オハラ	5	6	6,690
住友大阪セメント	9	12	44,825
太平洋セメント	35	45	180,601
日本ヒューム	7	6	12,684
日本コンクリート工業	13	19	6,856
三谷セキサン	2	2	15,184
アジアパイルホールディングス	8	10	9,366
東海カーボン	54	67	62,074
日本カーボン	3	4	17,178
東洋炭素	4	5	20,384
ノリタケ	3	8	29,110
T O T O	39	53	213,386
日本碍子	69	81	152,516
日本特殊陶業	49	60	269,455
M A R U W A	2	3	114,762
品川リフラクトリーズ	7	9	16,097
黒崎播磨	1	5	12,925
ヨータイ	4	0.100	170
ニッカトー	1	—	—
フジミインコーポレーテッド	16	19	41,104
クニミネ工業	0.900	—	—
ニチアス	15	18	83,755
ニチハ	7	9	27,968
<b>鉄鋼(0.9%)</b>			
日本製鉄	273	383	1,296,568
神戸製鋼所	123	152	266,525
中山製鋼所	14	15	11,778
合同製鐵	3	4	16,275
J F E ホールディングス	170	228	410,760
東京製鐵	17	21	33,114
共英製鋼	7	7	14,570
大和工業	11	14	115,872
東京鐵鋼	2	3	19,074

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大阪製鐵	2	3	9,324
淀川製鋼所	7	7	41,650
中部鋼板	4	5	10,880
丸一鋼管	18	23	79,695
モリ工業	—	1	8,578
大同特殊鋼	38	47	57,406
日本冶金工業	4	5	21,267
山陽特殊製鋼	6	7	20,587
愛知製鋼	3	4	31,592
大平洋金属	5	7	10,899
新日本電工	30	45	12,520
栗本鐵工所	2	3	17,325
三菱製鋼	4	5	9,368
日亜鋼業	10	—	—
日本精線	1	6	7,980
エンピロ・ホールディングス	10	7	2,726
シンニッタン	14	—	—
<b>非鉄金属(0.8%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	7	10	10,789
日本軽金属ホールディングス	17	22	34,609
三井金属鉱業	17	19	81,985
東邦亜鉛	5	—	—
三菱マテリアル	43	54	126,936
住友金属鉱山	70	95	325,005
DOWAホールディングス	15	20	94,443
古河機械金属	8	10	22,630
大阪チタニウムテクノロジーズ	10	13	25,256
東邦チタニウム	12	15	15,731
UACJ	8	10	53,607
CKサンエツ	1	1	7,267
古河電気工業	20	25	180,186
住友電気工業	228	261	726,332
フジクラ	72	81	547,474
SWCC	6	10	65,280
タツタ電線	10	—	—
平河ヒューテック	4	4	6,993
リョービ	6	8	17,795
AREホールディングス	23	30	57,313
<b>金属製品(0.5%)</b>			
稲葉製作所	4	4	7,030
宮地エンジニアリンググループ	3	9	16,425
トーカロ	17	21	38,455

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
SUMCO	108	144	171,211
川田テクノロジー	1	4	15,018
RS Technologies	4	5	20,502
東洋製罐グループホールディングス	35	48	112,708
ホッカンホールディングス	1	4	6,855
コロナ	6	7	6,941
横河ブリッジホールディングス	9	13	33,410
三和ホールディングス	61	74	369,362
文化シャッター	16	19	36,709
三協立山	7	11	6,865
アルインコ	6	6	6,804
LIXIL	95	110	190,771
日本フィルコン	0.100	—	—
ノーリツ	10	10	17,901
長府製作所	6	8	15,878
リンナイ	29	40	138,148
日東精工	11	12	7,092
岡部	10	13	11,056
ジーテクト	7	8	13,515
東プレ	10	13	24,139
高周波熱錬	9	11	11,144
東京製綱	4	—	—
サンコール	13	26	11,050
モリテックスチール	0.100	—	—
パイオラックス	7	10	24,112
エイチワン	7	7	8,455
日本発条	54	67	116,948
中央発条	8	4	7,590
三益半導体工業	5	—	—
<b>機械(5.5%)</b>			
日本製鋼所	16	22	119,745
三浦工業	25	34	110,768
タクマ	20	25	45,531
ツガミ	13	15	26,228
オークマ	5	13	43,160
芝浦機械	6	9	34,010
アマダ	95	103	150,277
アイダエンジニアリング	13	16	13,429
FUJII	28	32	70,534
牧野フライス製作所	6	8	96,695
オーエスジー	26	32	55,213
旭ダイヤモンド工業	13	18	15,614

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
DMG森精機	36	46	121,095
ソディック	14	19	17,953
ディスコ	28	35	1,652,910
日東工器	3	3	6,726
日進工具	6	9	6,946
パンチ工業	0.200	—	—
リケンN P R	6	9	24,077
島精機製作所	9	11	10,985
オプトラン	9	12	21,264
イワキ	4	4	11,965
フリュー	5	7	7,504
ヤマシンフィルタ	18	15	9,686
日阪製作所	6	9	9,288
やまびこ	9	12	29,233
野村マイクロ・サイエンス	2	12	31,598
平田機工	2	3	17,185
P E G A S U S	14	14	6,930
マルマエ	3	—	—
タツモ	3	5	12,137
ナブテスコ	37	46	111,507
三井海洋開発	7	9	39,903
レオン自動機	6	7	10,186
S M C	17	22	1,215,006
ホソカワミクロン	3	5	19,890
ユニオンツール	2	3	15,015
瑞光	4	—	—
オイレス工業	8	10	22,826
日精エー・エス・ビー機械	2	2	13,250
サトーホールディングス	8	9	19,062
技研製作所	5	7	9,968
日本エアータック	5	6	6,741
日精樹脂工業	5	7	6,862
ワイエイシイホールディングス	2	7	7,554
小松製作所	280	365	1,701,037
住友重機械工業	35	43	130,031
日立建機	23	29	114,961
日工	8	11	7,667
巴工業	2	2	10,585
井関農機	5	7	7,481
T O W A	6	22	36,774
北川鉄工所	4	5	6,748

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ローツェ	3	38	68,092
クボタ	313	379	740,198
荏原実業	3	3	14,087
三菱化工機	2	2	9,932
月島ホールディングス	8	10	15,820
帝国電機製作所	4	5	14,902
新東工業	12	16	14,866
澁谷工業	5	7	23,205
アイチコーポレーション	8	12	18,216
小森コーポレーション	14	18	23,607
鶴見製作所	4	5	17,698
酒井重工業	0.900	2	6,559
荏原製作所	24	152	400,286
西島製作所	5	6	15,193
北越工業	6	7	15,367
ダイキン工業	71	96	1,540,770
オルガノ	7	11	83,605
トーヨーカネツ	2	2	10,062
栗田工業	33	41	205,259
椿本チエイン	8	33	62,092
木村化工機	8	8	6,766
アネスト岩田	9	12	15,636
ダイフク	101	125	494,164
サムコ	1	—	—
タダノ	34	42	46,414
フジテック	14	23	136,850
C K D	16	20	47,375
平和	17	24	56,637
理想科学工業	4	11	16,969
S A N K Y O	13	85	175,427
日本金銭機械	7	9	10,458
マースグループホールディングス	3	5	15,850
フクシマガリレイ	3	10	29,549
ダイコク電機	2	3	8,396
竹内製作所	10	13	73,980
アマノ	17	21	79,212
J U K I	14	—	—
ジャノメ	9	7	6,993
マックス	8	8	36,178
グローリー	14	19	50,381
新晃工業	6	21	26,796

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大和冷機工業	9	11	17,749
セガサミーホールディングス	53	66	193,734
T P R	7	9	21,770
ツバキ・ナカシマ	12	18	8,893
ホシザキ	35	47	276,755
大豊工業	7	11	6,930
日本精工	110	137	87,144
NTN	129	175	41,769
ジェイテクト	53	66	75,108
不二越	4	5	18,122
日本トムソン	16	20	9,837
THK	34	42	158,531
ユーシン精機	9	10	6,814
前澤給装工業	4	5	7,276
イーグル工業	6	8	16,391
P I L L A R	5	6	25,116
キッツ	20	24	27,888
マキタ	68	92	441,286
三井E & S	29	39	67,874
カナデピア	52	60	56,908
三菱重工業	104	1,296	2,804,113
I H I	44	59	565,785
スター精密	11	12	24,437
<b>電気機器(18.6%)</b>			
キオクシアホールディングス	－	33	79,420
日清紡ホールディングス	45	55	49,968
イビデン	31	42	154,020
コニカミノルタ	133	165	88,264
ブラザー工業	80	99	261,574
ミネベアミツミ	104	129	295,926
日立製作所	287	1,909	8,243,311
三菱電機	666	754	1,782,928
富士電機	36	45	305,913
安川電機	65	80	345,908
シンフォニア テクノロジー	6	7	45,954
明電舎	11	12	57,375
オリジン	1	－	－
山洋電気	2	3	29,600
デンヨー	4	5	14,621
PHCホールディングス	11	13	15,039
KOKUSAI ELECTRIC	23	52	182,000

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ソシオネクスト	43	73	154,340
東芝テック	7	11	33,633
芝浦メカトロニクス	3	5	49,086
マブチモーター	29	32	74,172
ニデック	132	327	909,517
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	－	23	6,976
トレックス・セミコンダクター	3	5	7,592
東光高岳	3	4	8,132
ダブル・スコープ	17	－	－
ダイヘン	6	7	50,890
ヤーマン	11	14	11,223
JVCケンウッド	47	58	83,391
ミマキエンジニアリング	－	6	9,486
I－P E X	4	－	－
大崎電気工業	13	15	12,306
オムロン	45	67	309,488
日東工業	8	10	29,420
I D E C	8	10	27,609
不二電機工業	0.300	－	－
ジーエス・ユアサ コーポレーション	23	33	79,886
メルコホールディングス	1	1	2,601
テクノメディカ	3	3	6,860
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	9	12	7,130
日本電気	78	104	1,604,445
富士通	55	682	2,029,842
沖電気工業	27	35	33,207
電気興業	2	4	6,617
サンケン電気	5	7	49,605
アイホン	3	4	11,808
ルネサスエレクトロニクス	390	564	1,525,230
セイコーエプソン	76	95	232,899
ワコム	45	52	33,135
アルバック	13	16	91,801
E I Z O	4	9	20,554
日本信号	13	16	15,159
京三製作所	13	17	8,598
能美防災	8	10	30,250
ホーチキ	4	4	11,923
エレコム	14	17	28,408
パナソニック ホールディングス	707	876	1,584,246
シャープ	100	107	103,383

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アンリツ	42	52	75,220
富士通ゼネラル	17	21	57,855
ソニーグループ	419	2,532	9,452,036
T D K	94	640	1,082,596
帝国通信工業	3	3	7,539
タムラ製作所	23	29	16,815
アルプスアルパイン	53	60	93,370
日本電波工業	7	—	—
鈴木	5	4	6,824
メイコー	5	7	58,608
ローランド ディー. ジー.	3	—	—
フォスター電機	5	7	11,070
S M K	2	2	6,487
ヨコオ	5	6	9,659
ホシデン	13	18	37,819
ヒロセ電機	8	10	196,776
日本航空電子工業	14	19	51,357
T O A	6	7	7,065
マクセル	13	14	26,681
古野電気	7	8	20,240
スミダコーポレーション	8	10	9,590
アイコム	2	2	8,006
リオン	2	3	7,443
横河電機	65	81	233,486
新電元工業	2	2	7,299
アズビル	40	200	236,118
日本光電工業	25	65	145,821
チノー	2	3	6,410
共和電業	4	—	—
日本電子材料	3	4	10,030
堀場製作所	11	13	135,969
アドバンテス	169	231	2,216,812
エスベック	4	6	15,314
キーエンス	59	73	4,614,330
日置電機	2	3	27,729
シスメックス	51	190	522,204
日本マイクロニクス	10	12	58,503
メガチップス	4	5	28,671
O B A R A G R O U P	3	4	15,801
澤藤電機	3	—	—
原田工業	4	—	—

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コーセル	6	9	9,162
イリソ電子工業	5	7	20,105
オプテックスグループ	10	13	22,491
千代田インテグレ	2	2	8,086
レーザーテック	27	28	418,665
スタンレー電気	38	46	113,689
ウシオ電機	30	32	67,827
岡谷電機産業	0.100	—	—
日本セラミック	4	6	18,009
古河電池	7	5	7,462
山一電機	5	6	12,900
図研	5	6	31,289
日本電子	14	17	88,111
カシオ計算機	42	58	73,140
ファナック	289	355	1,571,847
日本シイエムケイ	12	21	10,449
エンプラス	1	2	10,069
大真空	8	11	6,700
ローム	109	133	221,711
浜松ホトニクス	47	117	198,375
三井ハイテック	5	32	29,347
新光電気工業	21	26	153,452
京セラ	368	456	786,945
太陽誘電	28	32	84,460
村田製作所	539	646	1,759,024
双葉電子工業	12	14	7,392
北陸電気工業	2	—	—
ニチコン	15	19	23,951
日本ケミコン	6	9	8,451
K O A	9	12	12,285
市光工業	10	16	6,776
小糸製作所	61	76	144,133
ミツバ	11	13	10,791
S C R E E Nホールディングス	20	30	342,612
キャノン電子	6	7	17,199
キャノン	295	366	1,872,014
リコー	148	193	293,968
象印マホービン	16	21	33,507
M U T O Hホールディングス	1	—	—
東京エレクトロン	125	155	3,916,080
イノテック	3	5	7,308

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>輸送用機器(7.2%)</b>			
トヨタ紡織	25	30	60,610
芦森工業	1	—	—
ユニプレス	10	13	13,741
豊田自動織機	50	62	793,782
モリタホールディングス	10	11	24,371
三櫻工業	9	10	6,751
デンソー	489	719	1,370,985
東海理化電機製作所	16	20	44,525
川崎重工業	48	55	444,999
名村造船所	14	21	41,895
日本車輛製造	2	3	6,798
三菱ロジスネクスト	9	11	23,423
日産自動車	800	917	384,608
いすゞ自動車	172	226	446,909
トヨタ自動車	3,255	3,902	10,578,810
日野自動車	89	110	53,212
三菱自動車工業	231	280	113,571
エフテック	1	—	—
武蔵精密工業	14	18	48,816
日産車体	6	11	11,502
新明和工業	17	21	29,107
極東開発工業	9	9	24,552
トピー工業	4	5	12,437
ティラド	1	1	6,830
タチエス	10	13	23,868
NOK	23	28	65,849
フタバ産業	15	22	16,685
カヤバ	5	12	36,537
大同メタル工業	11	14	7,171
プレス工業	23	28	16,215
ミクニ	3	—	—
太平洋工業	13	16	23,352
アイシン	45	155	268,237
マツダ	196	225	224,598
今仙電機製作所	2	—	—
本田技研工業	1,445	1,739	2,377,163
スズキ	108	593	1,153,375
S U B A R U	183	221	587,817
ヤマハ発動機	256	310	372,775
エクセディ	9	12	56,580

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
豊田合成	17	21	55,702
愛三工業	9	13	26,535
盟和産業	1	—	—
ヨロズ	6	7	7,645
エフ・シー・シー	10	12	40,764
シマノ	23	31	641,987
ティ・エス テック	21	29	51,129
ジャムコ	4	4	7,840
<b>精密機器(2.2%)</b>			
リガク・ホールディングス	—	37	42,034
テルモ	165	491	1,317,621
日機装	13	19	23,275
日本エム・ディ・エム	8	—	—
島津製作所	78	105	411,595
J M S	12	14	6,949
長野計器	4	4	9,609
パイ・テクノロジーズ	3	3	8,420
東京計器	4	5	17,498
愛知時計電機	2	2	4,865
インターアクション	4	6	7,265
東京精密	12	15	135,510
マニー	23	29	40,821
ニコン	85	115	178,389
トプコン	28	41	118,031
オリンパス	364	420	841,020
理研計器	4	10	30,014
タムロン	3	10	38,329
H O Y A	116	143	2,609,880
ノーリツ鋼機	5	7	32,130
A&Dホロンホールディングス	8	9	18,676
朝日インテック	72	89	241,336
シチズン時計	54	67	59,805
メニコン	20	27	37,455
松風	2	7	16,228
セイコーグループ	8	11	55,404
ニプロ	49	61	80,325
<b>その他製品(3.2%)</b>			
三井松島ホールディングス	5	5	20,975
スノーピーク	8	—	—
パラマウントベッドホールディングス	12	15	41,664
トランザクション	3	4	10,060

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ニホンフラッシュ	6	8	6,888
前田工織	5	15	27,045
アートネイチャー	7	9	6,879
フルヤ金属	1	6	18,389
パンダイナムコホールディングス	162	199	967,003
S H O E I	13	20	39,552
フランスベッドホールディングス	7	10	13,335
パイロットコーポレーション	8	11	47,252
萩原工業	—	4	7,350
フジシールインターナショナル	12	16	45,540
タカラトミー	27	30	117,779
広済堂ホールディングス	15	27	13,573
プロネクサス	6	7	9,591
TOPPANホールディングス	72	96	442,691
大日本印刷	64	152	325,784
共同印刷	1	2	8,977
N I S S H A	10	12	17,400
TAKARA & COMPANY	3	4	12,040
アシックス	50	271	964,844
ツツミ	3	—	—
ローランド	4	5	19,953
小松ウオール工業	2	4	7,340
ヤマハ	37	131	140,843
河合楽器製作所	1	2	7,018
クリナップ	7	10	6,825
ピジョン	37	46	77,149
キングジム	7	8	6,893
リンテック	11	13	39,726
イトーキ	12	14	25,754
任天堂	374	463	5,325,615
三菱鉛筆	8	10	26,421
タカラスタダード	12	16	29,355
コクヨ	24	35	101,850
ナカバヤシ	11	3	1,742
グローブライド	5	7	13,665
オカムラ	17	22	43,979
美津濃	5	7	60,517
<b>電気・ガス業(1.2%)</b>			
グリムス	3	3	7,227
東京電力ホールディングス	534	617	242,138
中部電力	218	270	426,172

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
関西電力	228	358	613,067
中国電力	103	127	107,311
北陸電力	60	75	58,232
東北電力	156	193	202,771
四国電力	55	68	77,223
九州電力	136	169	214,799
北海道電力	57	76	55,288
沖縄電力	15	18	17,126
電源開発	48	55	137,309
エフオン	14	—	—
イーレックス	10	14	11,082
レノバ	15	20	14,480
東京瓦斯	125	138	660,191
大阪瓦斯	120	144	479,609
東邦瓦斯	25	28	116,438
北海道瓦斯	3	22	11,198
広島ガス	1	19	6,930
西部ガスホールディングス	6	7	12,620
静岡ガス	11	16	16,883
メタウォーター	7	10	19,735
<b>陸運業(2.3%)</b>			
S B S ホールディングス	5	6	18,310
東武鉄道	65	77	199,047
相鉄ホールディングス	21	24	58,502
東急	166	205	346,014
京浜急行電鉄	73	90	139,077
小田急電鉄	98	121	177,244
京王電鉄	28	38	151,087
京成電鉄	38	127	188,696
富士急行	7	9	21,123
東日本旅客鉄道	108	404	1,149,713
西日本旅客鉄道	70	181	530,782
東海旅客鉄道	228	282	815,736
東京地下鉄	—	122	216,742
西武ホールディングス	71	79	247,530
鴻池運輸	10	12	36,550
西日本鉄道	15	21	46,067
ハマキョウレックス	5	25	31,400
サカイ引越センター	6	9	21,436
近鉄グループホールディングス	59	78	258,500
阪急阪神ホールディングス	78	97	353,322



# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
南海電気鉄道	26	32	81,406
京阪ホールディングス	32	40	135,905
神戸電鉄	2	2	5,618
名古屋鉄道	61	81	145,800
山陽電気鉄道	4	5	11,082
アルプス物流	4	—	—
ヤマトホールディングス	75	89	178,333
山九	15	17	102,872
丸全昭和運輸	3	4	26,055
センコーグループホールディングス	31	48	68,203
トナミホールディングス	1	1	9,552
ニッコンホールディングス	18	41	95,826
福山通運	6	7	28,782
セイノーホールディングス	33	36	80,611
神奈川中央交通	2	2	8,200
AZ-COM丸和ホールディングス	15	22	27,830
C&Fロジホールディングス	5	—	—
九州旅客鉄道	41	56	200,838
S Gホールディングス	99	123	177,202
NIPPON EXPRESSホールディングス	20	78	210,041
<b>海運業(0.7%)</b>			
日本郵船	169	151	798,538
商船三井	128	139	767,257
川崎汽船	47	166	354,783
N S ユナイテッド海運	3	4	18,676
明海グループ	2	—	—
飯野海運	21	26	28,002
共栄タンカー	0.600	—	—
乾汽船	6	9	13,258
<b>空運業(0.4%)</b>			
日本航空	145	168	439,992
ANAホールディングス	161	199	578,559
パスコ	0.400	—	—
<b>倉庫・運輸関連業(0.1%)</b>			
トランコム	1	—	—
日新	4	5	21,625
三菱倉庫	14	74	76,614
三井倉庫ホールディングス	5	7	55,800
住友倉庫	16	21	59,339
澁澤倉庫	2	3	10,296
日本トランスシティ	11	14	13,920

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
中央倉庫	2	3	4,817
安田倉庫	5	5	8,925
上組	27	33	110,796
キューソー流通システム	6	4	9,466
エーアイティー	3	4	7,626
内外トランスライン	2	2	7,090
日本コンセプト	3	3	7,026
<b>情報・通信業(7.8%)</b>			
NECネットエスアイ	23	28	94,710
クロスキャット	5	6	6,792
システナ	90	105	36,294
デジタルアーツ	3	4	30,550
日鉄ソリューションズ	10	25	103,487
キューブシステム	5	6	6,847
コア	3	3	6,793
ラクーンホールディングス	9	7	6,745
ソリトンシステムズ	4	—	—
ソフトクリエイトホールディングス	4	5	10,817
T I S	65	77	296,418
グリーホールディングス	19	24	13,980
GMOペパボ	—	4	7,080
コーエーテクモホールディングス	37	55	111,935
三菱総合研究所	2	3	16,310
ファインデックス	—	8	6,349
ブレインパッド	—	5	7,023
ポルトゥウィンホールディングス	12	15	7,037
ネクソン	133	161	327,038
アイスタイル	19	22	11,155
エムアップホールディングス	7	9	13,977
エイチーム	11	7	6,830
セルシス	—	10	13,146
エニグモ	17	20	6,895
コロプラ	23	25	12,225
ブロードリーフ	28	29	19,151
デジタルハーツホールディングス	6	6	6,739
メディアドゥ	4	4	7,303
じげん	17	18	8,188
バイキューブ	20	—	—
フィックスターズ	6	7	13,823
CARTA HOLDINGS	0.200	4	6,647
オプティム	6	10	7,150

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セレス	5	3	9,038
S H I F T	4	73	100,191
ティーガイア	6	—	—
テクマトリックス	10	15	35,186
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15	18	56,144
GMOペイメントゲートウェイ	11	16	134,383
システムリサーチ	2	5	8,405
インターネットイニシアティブ	28	40	103,515
さくらインターネット	6	11	49,795
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2	3	6,717
S R Aホールディングス	3	4	18,123
朝日ネット	10	10	6,921
e B A S E	9	11	6,925
アバントグループ	7	10	19,683
アドソル日進	4	3	7,068
コムチュア	8	9	18,730
アステリア	10	11	6,840
アイル	2	4	9,963
マークラインズ	3	4	10,780
メディカル・データ・ビジョン	9	—	—
g u m i	15	13	7,670
テラスカイ	4	2	6,683
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3	4	10,922
ネオジャパン	—	4	6,719
P R T I M E S	—	3	6,951
ラクス	28	34	74,715
ダブルスタンダード	3	4	6,520
オープンドア	7	11	7,084
アカツキ	2	3	10,569
Ubicomホールディングス	4	4	6,816
カナミックネットワーク	15	15	7,338
チェンジホールディングス	12	18	24,315
オークネット	3	3	8,238
マクロミル	11	14	18,081
オロ	2	3	8,134
ユーザーローカル	—	3	6,487
PKSHA Technology	—	5	24,042
マネーフォワード	13	18	80,345
プラスアルファ・コンサルティング	3	9	13,754
電算システムホールディングス	2	3	7,933
APPIER GROUP	20	22	39,150

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ビジョナル	4	8	65,223
ハイマックス	4	5	6,941
野村総合研究所	131	159	823,695
日本システム技術	2	6	13,872
インテージホールディングス	6	4	7,224
ソースネクスト	42	37	8,234
インフォコム	7	—	—
シンプレクス・ホールディングス	9	14	40,585
H E R O Z	3	—	—
ラクスル	14	17	22,250
メルカリ	28	40	91,471
イーソル	10	—	—
ウイングアーク1 s t	6	7	27,681
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	—	3	3,049
サーバーワークス	1	—	—
S a n s a n	19	20	49,608
ギフティ	5	6	9,990
メドレー	8	8	24,000
ベース	2	3	11,880
J M D C	10	9	28,575
フォーカスシステムズ	6	6	6,766
クレスコ	4	12	13,527
フジ・メディア・ホールディングス	57	70	193,223
オービック	19	136	602,983
ジャストシステム	8	10	39,379
T D C ソフト	5	12	16,802
L I N E ヤフー	846	1,178	564,711
トレンドマイクロ	28	38	444,276
I Dホールディングス	4	5	9,465
日本オラクル	11	14	206,001
アルファシステムズ	2	2	7,613
フューチャー	12	18	32,683
C A C H o l d i n g s	3	4	8,977
S B テクノロジー	2	—	—
オービックビジネスコンサルタント	8	12	90,978
アイティフォー	7	8	10,990
東計電算	—	2	9,261
大塚商会	29	83	290,246
サイボウズ	8	10	31,209
電通総研	7	7	44,280
A C C E S S	8	7	8,023

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
デジタルガレージ	9	11	54,280
イーエムシステムズ	9	11	9,280
ウェザーニューズ	1	5	21,092
C I J	9	20	9,534
ビジネスエンジニアリング	—	1	7,092
WOWOW	5	6	6,927
スカラ	8	17	7,221
ANYCOLOR	6	10	31,300
IMAGICA GROUP	—	13	6,686
ネットワンシステムズ	24	8	39,432
アルゴグラフィックス	5	6	35,088
マーベラス	9	13	7,000
エイベックス	10	13	17,512
B I P R O G Y	19	24	107,094
都築電気	3	4	10,617
T B S ホールディングス	29	36	158,303
日本テレビホールディングス	52	65	184,027
朝日放送グループホールディングス	9	0.100	68
テレビ朝日ホールディングス	14	17	45,949
スカパーJSATホールディングス	46	57	62,233
テレビ東京ホールディングス	4	4	15,772
ビジョン	9	11	12,853
U-NEXT HOLDINGS	6	24	44,739
日本通信	58	59	9,531
日本電信電話	17,686	21,902	3,197,808
KDDI	459	541	2,638,133
ソフトバンク	956	11,787	2,482,342
光通信	6	8	312,800
エムティーアイ	10	—	—
GMOインターネットグループ	22	24	68,592
KADOKAWA	31	38	143,074
学研ホールディングス	9	13	13,324
ゼンリン	10	12	12,398
アイネット	3	4	8,734
松竹	3	4	48,552
東宝	33	46	328,185
東映	2	12	63,684
NTTデータグループ	155	192	570,666
ピー・シー・エー	5	4	9,369
ビジネスブレイン太田昭和	2	3	7,932
D T S	12	12	54,567

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スクウェア・エニックス・ホールディングス	27	37	265,512
シーイーシー	7	9	17,242
カプコン	53	146	567,936
アイ・エス・ビー	4	5	6,655
ジャステック	4	—	—
S C S K	41	60	217,802
N S W	2	3	9,431
アイネス	4	5	10,037
T K C	9	13	49,976
富士ソフト	12	20	199,818
N S D	21	28	97,153
コナミグループ	22	27	515,016
福井コンピュータホールディングス	3	5	15,402
J B C C ホールディングス	3	4	23,250
ミロク情報サービス	5	6	12,247
ソフトバンクグループ	293	363	3,432,603
<b>卸売業(6.1%)</b>			
リョーサン菱洋ホールディングス	—	11	30,761
高千穂交易	2	3	12,493
伊藤忠食品	1	1	13,320
エレマテック	5	—	—
あらた	9	11	37,663
トーメンデバイス	1	1	6,710
東京エレクトロン デバイス	6	7	24,909
円谷フィールズホールディングス	10	12	19,618
双日	69	86	280,692
アルフレッサ ホールディングス	63	72	145,089
横浜冷凍	17	19	17,082
アルコニックス	8	11	16,461
神戸物産	48	60	191,057
ハイパー	4	—	—
あい ホールディングス	10	14	27,636
ディーブイエックス	4	—	—
ダイワボウホールディングス	27	34	90,609
マクニカホールディングス	14	60	110,798
ラクト・ジャパン	2	3	9,490
パイトルケーエスケー・ホールディングス	9	10	12,326
八洲電機	5	6	10,980
メディアスホールディングス	8	—	—
レスター	5	6	15,787
TOKAIホールディングス	34	42	39,457

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三洋貿易	7	8	11,424
ビューティガレージ	2	4	6,757
ウイン・パートナーズ	5	5	7,307
シッパヘルスケアホールディングス	22	30	60,632
明治電機工業	4	4	6,582
コメダホールディングス	15	20	54,424
アセンテック	10	—	—
フルサト・マルカホールディングス	5	6	13,999
ヤマエグループホールディングス	3	8	18,480
小野建	6	8	12,537
南陽	1	—	—
佐鳥電機	3	4	8,075
伯東	3	4	19,844
コンドーテック	5	6	7,872
中山福	0.100	—	—
ナガイレーベン	7	9	17,581
三菱食品	5	7	33,840
松田産業	4	5	18,555
第一興商	24	30	48,205
メディパルホールディングス	63	84	188,536
S P K	3	3	6,982
萩原電気ホールディングス	2	3	11,154
アズワン	9	24	58,273
スズデン	2	3	7,038
シモジマ	4	5	6,884
ドウシシャ	5	7	14,853
小津産業	2	—	—
高速	3	4	9,641
丸文	5	6	7,072
ハピネット	5	5	28,585
橋本総業ホールディングス	4	5	6,960
日本ライフライン	18	20	32,739
タカショー	—	17	6,811
I D O M	16	26	29,832
進和	3	4	13,160
ダイトロン	2	3	11,067
シークス	8	11	11,688
オーハシテクニカ	3	3	6,829
白銅	2	3	6,924
伊藤忠商事	421	522	3,187,508
丸紅	523	638	1,444,472

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
長瀬産業	28	34	94,765
蝶理	3	4	12,915
豊田通商	54	233	561,319
三共生興	8	11	7,256
兼松	26	32	80,112
三井物産	472	1,141	3,104,906
日本紙パルプ商事	3	37	22,074
カメイ	6	8	15,869
ＯＵＧホールディングス	1	—	—
スターゼン	4	5	15,600
山善	19	26	33,326
椿本興業	1	4	9,073
住友商事	379	465	1,502,634
内田洋行	2	3	21,421
三菱商事	1,242	1,435	3,401,173
第一実業	5	7	17,374
キャノンマーケティングジャパン	14	15	76,243
西華産業	2	3	16,280
佐藤商事	4	5	7,954
菱洋エレクトロ	5	—	—
東京産業	8	9	6,805
ユアサ商事	4	6	30,116
神鋼商事	1	1	10,064
阪和興業	11	12	63,360
正栄食品工業	4	5	19,630
カナデン	4	5	8,514
R Y O D E N	5	6	15,050
岩谷産業	14	77	120,895
ナイス	2	—	—
極東貿易	3	4	7,654
アステナホールディングス	13	15	6,817
三愛オブリ	15	18	32,013
稲畑産業	12	21	65,100
G S I クレオス	3	4	8,736
明和産業	9	11	7,914
ワキタ	10	11	19,277
東邦ホールディングス	17	21	87,570
サンゲツ	14	19	56,608
ミツウロコグループホールディングス	8	9	18,037
シナネンホールディングス	1	2	12,621
伊藤忠エネクス	15	19	30,725

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サンリオ	17	63	436,462
サンワテクノス	3	3	7,542
リョーサン	4	—	—
新光商事	8	10	10,212
トーヨー	2	3	8,741
三信電気	2	3	6,619
東陽テクニカ	6	7	10,123
モスフードサービス	9	11	40,527
加賀電子	5	15	42,470
ソーダニッカ	5	7	8,451
立花エレテック	4	4	11,509
PAL TAC	8	12	47,444
三谷産業	17	20	6,831
西本Wismettacホールディングス	1	3	6,342
コア商事ホールディングス	—	9	6,802
KPPグループホールディングス	16	16	11,012
ヤマタネ	2	3	11,888
泉州電業	2	5	25,296
トラスコ中山	13	16	31,899
オートバックスセブン	21	27	39,663
モリト	4	6	9,300
加藤産業	7	9	41,280
イエローハット	10	13	39,401
J Kホールディングス	5	6	6,786
日伝	4	4	12,946
北沢産業	10	—	—
杉本商事	3	6	8,376
因幡電機産業	16	21	83,783
東テク	2	7	19,344
ミスミグループ本社	94	117	289,508
スズケン	23	25	127,795
ジェコス	5	6	6,922
<b>小売業(4.5%)</b>			
インターメスティック	—	4	8,113
ローソン	13	—	—
サンエー	4	13	39,204
カワチ薬品	4	6	16,030
エービーシー・マート	27	34	100,368
ハードオフコーポレーション	3	3	6,778
アスクル	15	18	29,955
ゼオホールディングス	7	8	15,120

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アダストリア	7	10	32,367
くら寿司	7	9	28,119
キャンドウ	2	2	9,282
パルグループホールディングス	12	17	57,494
エディオン	24	33	58,203
サーラコーポレーション	13	16	12,632
ハローズ	2	3	12,214
フジオフードグループ本社	7	9	11,252
あみやき亭	1	5	8,741
大黒天物産	1	2	19,572
ハニーズホールディングス	5	6	11,274
アルペン	5	7	16,447
クオールホールディングス	8	9	15,081
ジンズホールディングス	3	5	40,769
ビックカメラ	33	46	74,888
DCMホールディングス	33	40	54,672
Monotaro	88	110	278,167
東京一番フーズ	8	—	—
J. フロントリテイリング	72	89	174,725
ドトール・日レスホールディングス	11	13	32,361
マツキヨココカラ&カンパニー	114	136	320,688
ブロンコビリー	3	4	16,123
ZOZO	40	57	270,959
トレジャー・ファクトリー	4	5	7,828
物語コーポレーション	10	15	47,942
三越伊勢丹ホールディングス	105	116	267,030
Hamee	5	5	6,715
ウエルシアホールディングス	32	40	89,768
クリエイトSDホールディングス	8	11	30,866
丸善CH1ホールディングス	12	—	—
ミサワ	2	—	—
シュッピン	6	7	7,660
オイシックス・ラ・大地	8	12	16,662
ネクステージ	14	17	25,735
ジョイフル本田	18	21	41,083
エターナルホスピタリティグループ	2	2	7,316
ホットランド	4	5	12,230
すかいらーくホールディングス	85	106	264,703
SFPホールディングス	3	4	9,442
綿半ホールディングス	4	6	9,792
ヨシックスホールディングス	—	2	7,246

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユニテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17	33	25,630
BEENOS	4	4	19,477
あさひ	5	6	9,392
日本調剤	4	5	6,987
コスモス薬品	5	15	104,581
セブン&アイ・ホールディングス	216	858	2,059,440
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	42	58	73,876
ツルハホールディングス	13	13	126,684
サンマルクホールディングス	5	6	14,023
フェリシモ	4	—	—
トリドールホールディングス	17	21	81,248
TOKYO BASE	19	20	6,789
JMホールディングス	4	5	12,527
アレンザホールディングス	5	6	6,885
串カツ田中ホールディングス	—	5	6,936
パロックジャパンリミテッド	7	9	7,052
クスリのアオキホールディングス	18	20	63,266
力の源ホールディングス	4	5	7,975
FOOD & LIFE COMPANIES	33	41	173,341
メディカルシステムネットワーク	10	16	6,837
はるやまホールディングス	5	—	—
ノジマ	18	25	57,684
カップ・クリエイト	9	12	17,677
ライトオン	6	—	—
良品計画	68	92	362,600
アドヴァングループ	6	7	6,679
アルビス	2	2	7,092
ハウス オブ ローゼ	0.400	—	—
G-7ホールディングス	6	8	10,812
イオン北海道	18	19	16,177
コジマ	10	15	15,000
ヒマラヤ	0.400	—	—
コーナン商事	7	8	30,788
エコス	2	3	6,968
ワタミ	6	9	9,588
バン・バン・フィク・インターナショナルホールディングス	126	156	637,484
西松屋チェーン	12	17	37,891
ゼンショーホールディングス	31	44	337,673
幸楽苑	—	6	7,316
サイゼリヤ	9	11	51,060
VTホールディングス	23	30	14,877

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
魚力	2	2	6,983
フジ・コーポレーション	3	3	6,789
ユニテッドアローズ	7	8	18,094
ハイデイ日高	9	12	33,944
コロワイド	27	43	74,722
壱番屋	5	30	28,888
スギホールディングス	12	41	113,757
薬王堂ホールディングス	3	3	7,052
スクロール	9	11	11,994
ヨンドシーホールディングス	5	7	13,271
木曽路	9	11	25,452
SRSホールディングス	10	12	15,782
リテールパートナーズ	9	11	13,972
上新電機	6	7	16,701
日本瓦斯	33	37	82,193
ロイヤルホールディングス	11	13	32,332
いなげや	6	—	—
チヨダ	7	7	8,228
ライフコーポレーション	6	8	29,038
リンガーハット	8	10	22,500
MrMa x HD	10	10	6,956
AOKIホールディングス	13	16	20,925
オークワ	9	12	9,610
コメリ	9	10	29,589
青山商事	13	16	34,660
しまむら	14	18	162,871
高島屋	43	107	133,796
松屋	10	13	13,556
エイチ・ツー・オー リテイリング	27	37	85,730
近鉄百貨店	2	4	9,279
丸井グループ	41	51	133,257
アクシアル リテイリング	4	21	20,161
イオン	212	287	1,041,462
イズミ	11	11	35,376
平和堂	10	12	29,654
フジ	9	14	28,900
ヤオコー	7	9	83,490
ゼビオホールディングス	8	10	12,894
ケーズホールディングス	42	52	72,453
日産東京販売ホールディングス	4	—	—
シルバーライフ	—	4	3,192

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
Genky DrugStores	2	6	19,536
ナルミヤ・インターナショナル	3	—	—
ブックオフグループホールディングス	—	5	7,431
ギフトホールディングス	2	3	14,250
アインホールディングス	8	7	34,476
GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS	3	4	13,926
ヤマダホールディングス	192	238	103,419
アークランズ	18	23	37,306
ニトリホールディングス	22	28	443,178
愛眼	1	—	—
ケーユーホールディングス	5	6	6,851
吉野家ホールディングス	23	30	88,616
松屋フーズホールディングス	3	3	21,238
サガミホールディングス	9	12	22,112
関西フードマーケット	4	—	—
王将フードサービス	4	15	46,053
ミニストップ	4	6	11,089
アークス	11	13	35,186
パローホールディングス	12	14	32,944
ベルク	3	3	24,765
大 庄	4	6	6,867
ファーストリテイリング	28	43	2,077,061
サンドラッグ	21	26	112,660
サックスパー ホールディングス	7	—	—
ヤマザワ	3	—	—
ベルーナ	15	18	17,017
<b>銀行業(9.3%)</b>			
いよぎんホールディングス	69	94	150,573
しずおかフィナンシャルグループ	129	159	245,322
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	49	60	95,856
楽天銀行	20	33	196,310
京都フィナンシャルグループ	74	91	194,148
じもとホールディングス	2	—	—
めぶきフィナンシャルグループ	289	363	228,000
東京きらばしフィナンシャルグループ	7	9	47,988
九州フィナンシャルグループ	113	127	95,501
ゆうちょ銀行	641	595	915,004
富山第一銀行	18	23	23,230
コンコルディア・フィナンシャルグループ	313	384	351,269
西日本フィナンシャルホールディングス	32	44	90,468
三十三フィナンシャルグループ	5	6	15,320

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
第四北越フィナンシャルグループ	9	22	63,673
ひろぎんホールディングス	83	101	121,531
おきなわフィナンシャルグループ	5	5	14,398
十六フィナンシャルグループ	7	10	46,716
北國フィナンシャルホールディングス	6	7	37,914
プロクレアホールディングス	6	8	14,574
あいちフィナンシャルグループ	9	13	37,624
あおぞら銀行	42	49	109,480
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,555	4,638	9,149,441
りそなホールディングス	680	893	1,111,016
三井住友トラストグループ	209	257	1,007,082
三井住友フィナンシャルグループ	415	1,508	5,908,794
千葉銀行	162	223	300,809
群馬銀行	113	125	132,068
武蔵野銀行	8	11	35,090
千葉興業銀行	11	17	26,077
筑波銀行	—	31	7,956
七十七銀行	17	23	104,028
秋田銀行	3	4	10,848
山形銀行	6	8	11,344
岩手銀行	3	4	14,398
東邦銀行	46	62	19,718
ふくおかフィナンシャルグループ	50	63	252,693
スルガ銀行	51	48	64,722
八十二銀行	125	169	165,473
山梨中央銀行	6	8	16,799
大垣共立銀行	11	13	30,718
福井銀行	5	6	12,148
清水銀行	4	2	3,171
富山銀行	1	—	—
滋賀銀行	9	10	52,320
南都銀行	8	10	38,913
百五銀行	54	68	48,280
紀陽銀行	20	25	57,135
ほくほくフィナンシャルグループ	36	40	87,505
山陰合同銀行	36	45	57,032
百十四銀行	5	7	23,714
四国銀行	8	10	12,529
阿波銀行	8	10	27,966
大分銀行	3	4	14,512
宮崎銀行	3	4	15,486

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
佐賀銀行	3	4	9,349
琉球銀行	12	16	19,090
セブン銀行	183	259	78,062
みずほフィナンシャルグループ	788	976	4,255,360
山口フィナンシャルグループ	57	70	118,048
名古屋銀行	3	4	33,660
北洋銀行	88	98	50,088
大光銀行	1	—	—
愛媛銀行	7	10	11,691
京葉銀行	24	32	26,845
栃木銀行	29	33	9,996
北日本銀行	2	2	8,800
東和銀行	10	13	8,684
トモニホールディングス	55	69	34,638
フィデアホールディングス	6	7	11,490
池田泉州ホールディングス	81	100	41,825
<b>証券・商品先物取引業(1.0%)</b>			
F P G	19	25	62,924
ジャパンインベストメントアドバイザー	9	11	20,545
マーキュリアホールディングス	1	—	—
S B I ホールディングス	85	116	529,969
ジャフコ グループ	17	21	49,256
大和証券グループ本社	452	517	542,591
野村ホールディングス	981	1,216	1,220,864
岡三証券グループ	51	57	35,120
丸三証券	19	24	23,834
東洋証券	19	21	12,441
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	69	85	42,778
光世証券	1	—	—
水戸証券	17	19	10,890
いちよし証券	10	14	11,315
松井証券	28	49	39,939
マネックスグループ	57	70	58,551
極東証券	8	9	14,670
岩井コスモホールディングス	6	8	20,778
アイザワ証券グループ	8	10	18,740
スパークス・グループ	6	8	12,676
<b>保険業(3.2%)</b>			
かんぽ生命保険	59	84	240,054
F P パートナー	1	3	7,462
S O M P O ホールディングス	87	353	1,510,152
アニコム ホールディングス	19	24	13,210

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	130	529	1,612,485
第一生命ホールディングス	285	340	1,532,720
東京海上ホールディングス	577	706	3,581,538
T & D ホールディングス	156	194	613,477
アドバンスクリエイト	3	5	3,051
<b>その他金融業(1.1%)</b>			
全国保証	15	18	103,269
ジェイリース	1	5	7,101
イントラスト	0.100	—	—
S B I アルヒ	7	7	5,971
プレミアグループ	9	12	27,218
ネットプロテクションズホールディングス	34	24	11,809
クレディセゾン	37	45	164,193
芙蓉総合リース	5	6	74,437
みずほリース	9	54	55,494
東京センチュリー	43	54	77,139
日本証券金融	21	26	47,720
アイフル	86	119	41,775
リコーリース	5	6	36,225
イオンフィナンシャルサービス	33	41	51,252
アコム	104	172	66,942
ジャックス	6	8	33,886
オリエントコーポレーション	19	23	19,092
オリックス	355	433	1,322,913
三菱H C キャピタル	260	362	363,587
日本取引所グループ	152	430	678,855
イー・ギャランティ	9	11	20,709
NECキャピタルソリューション	2	3	13,510
<b>不動産業(1.8%)</b>			
robot home	—	42	7,679
大東建託	21	24	385,073
いちご	67	61	21,726
日本駐車場開発	61	86	17,306
S R E ホールディングス	2	2	8,613
A D ワークスグループ	20	—	—
ヒューリック	136	168	227,491
野村不動産ホールディングス	32	45	184,869
三重交通グループホールディングス	12	15	8,013
サムティ	9	—	—
ディア・ライフ	10	12	13,001
コーセーアールイー	3	—	—
地主	4	6	13,561



# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
プレサンスコーポレーション	9	9	22,924
ハウスコム	4	—	—
JPMC	5	6	7,006
サンセイランディック	2	—	—
エストラスト	7	—	—
フージャースホールディングス	9	11	12,032
オープンハウスグループ	21	26	140,155
東急不動産ホールディングス	175	217	209,877
飯田グループホールディングス	55	69	154,504
And Doホールディングス	5	5	6,805
シーアールイー	4	3	6,452
ケイアイスター不動産	2	3	17,452
グッドコムアセット	8	—	—
ジェイ・エス・ビー	2	3	9,465
ロードスターキャピタル	3	4	10,172
霞ヶ関キャピタル	1	3	42,960
パーク24	37	56	114,689
パラカ	—	3	6,851
三井不動産	270	993	1,258,627
三菱地所	381	412	889,311
平和不動産	9	11	55,696
東京建物	51	63	150,416
京阪神ビルディング	10	12	17,946
住友不動産	84	117	586,706
テーオーシー	10	12	8,552
東京楽天地	1	—	—
レオパレス21	58	63	37,536
スターツコーポレーション	8	11	47,600
フジ住宅	8	9	6,742
空港施設	10	11	6,925
明和地所	—	6	6,910
ゴールドクレスト	4	4	14,896
エスリード	2	3	14,943
日神グループホールディングス	12	12	6,835
日本エスコン	10	18	19,315
MIRARTHホールディングス	26	42	21,454
A V A N T I A	3	—	—
イオンモール	30	43	83,969
ファースト住建	1	—	—
カチタス	15	19	39,964
トーセイ	9	12	28,992
サンフロンティア不動産	8	12	23,400

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
FJネクストホールディングス	6	7	8,823
グランディハウス	9	11	6,926
日本空港ビルデング	20	25	117,734
<b>サービス業(5.0%)</b>			
L I F U L L	32	38	6,400
M I X I	13	14	50,268
ジェイエイシーリクルートメント	22	27	21,621
日本M&Aセンターホールディングス	97	111	67,754
メンバーズ	6	—	—
UTグループ	7	9	22,618
アイティメディア	6	4	6,696
ケアネット	9	15	11,257
E・Jホールディングス	3	4	7,110
オープンアップグループ	18	25	46,368
コシダカホールディングス	18	23	24,909
パソナグループ	7	9	18,952
リンクアンドモチベーション	17	18	10,260
エス・エム・エス	21	28	34,992
パーソルホールディングス	620	688	157,024
クックパッド	53	—	—
学情	3	3	7,862
スタジオアリス	3	3	8,033
N J S	2	1	8,759
総合警備保障	101	126	132,531
カカコム	40	54	126,044
アイロムグループ	—	3	8,382
セントケア・ホールディング	6	9	6,947
ルネサンス	6	—	—
ディップ	9	13	29,132
デジタルホールディングス	—	4	7,035
新日本科学	5	8	12,576
ベネフィット・ワン	21	—	—
エムスリー	120	149	291,089
アウトソーシング	39	—	—
ワールドホールディングス	2	3	6,897
ディー・エヌ・エー	21	30	106,726
博報堂DYホールディングス	77	85	90,136
ぐるなび	23	20	7,011
ファンコミュニケーションズ	15	17	6,954
ライク	4	4	6,967
エスプール	20	23	7,456
WD Bホールディングス	3	3	7,000

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アドウェイズ	12	24	7,167
バリューコマース	5	9	7,709
インフォマート	63	71	29,405
J Pホールディングス	15	19	10,306
プレステージ・インターナショナル	28	35	25,063
プロトコーポレーション	6	8	17,577
アミューズ	4	4	7,107
ドリームインキュベータ	2	1	7,200
クイック	4	5	9,843
電通グループ	59	80	246,119
ぴあ	2	2	8,242
イオンファンタジー	2	3	9,880
シーティーエス	9	10	8,528
H. U. グループホールディングス	17	22	57,636
アルプス技研	5	6	16,513
日本空調サービス	7	8	8,035
オリエンタルランド	322	444	1,359,614
ダスキン	13	16	60,555
明光ネットワークジャパン	8	9	7,003
ファルコホールディングス	2	3	7,023
ラウンドワン	57	71	84,134
リゾートトラスト	26	29	90,294
ビー・エム・エル	7	9	26,439
リソー教育	31	47	12,980
早稲田アカデミー	—	4	8,400
ユー・エス・エス	68	155	213,167
東京個別指導学院	14	19	6,860
サイバーエージェント	134	166	194,572
楽天グループ	522	532	518,717
クリーク・アンド・リバー社	3	4	7,236
SBIグローバルアセットマネジメント	11	14	10,345
テー・オー・ダブリュー	18	21	6,748
山田コンサルティンググループ	3	3	6,669
セントラルスポーツ	2	2	7,015
フルキャストホールディングス	5	6	10,031
エン・ジャパン	9	12	20,651
テクノプロ・ホールディングス	35	45	140,454
アイ・アールジャパンホールディングス	4	9	6,826
KeePer 技研	3	4	18,494
イー・ガーディアン	4	3	6,966
ジャパンマテリアル	18	23	34,881

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ベクトル	7	10	10,042
チャーム・ケア・コーポレーション	5	6	8,064
キャリアリンク	2	2	6,454
I B J	9	10	7,207
アサンテ	3	4	6,900
バリューHR	5	6	9,764
M&Aキャピタルパートナーズ	4	6	18,208
ライドオンエクスプレスホールディングス	6	6	7,072
シグマックス・ホールディングス	8	22	21,296
ウィルグループ	5	6	6,865
メドピア	9	—	—
リクルートホールディングス	451	588	5,815,387
エラン	8	10	7,780
日本郵政	716	845	1,344,872
ベルシステム24ホールディングス	6	8	10,238
鎌倉新書	10	13	6,716
エアトリ	4	5	6,336
アトラエ	9	8	6,638
ストライク	2	3	11,858
ソラスト	16	20	9,817
インソース	13	16	16,170
ベイカレント	44	55	371,683
Orchestra Holdings	6	8	6,994
アイモパイル	14	14	6,824
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	19	29	88,486
ミダックホールディングス	3	4	8,675
キュービーネットホールディングス	4	6	6,758
オープングループ	24	—	—
マネジメントソリューションズ	2	—	—
プロレド・パートナーズ	17	16	7,040
アンビスホールディングス	6	16	11,242
カープスホールディングス	16	20	13,843
フォーラムエンジニアリング	8	8	9,460
Macbee Planet	—	2	6,930
ダイレクトマーケティングミックス	14	25	7,467
ポピンズ	5	—	—
LITALICO	4	6	7,990
リログループ	30	42	80,262
東祥	7	9	6,586
ID&E ホールディングス	3	5	32,350
サンウェルズ	—	12	9,900

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
TREホールディングス	11	17	26,261
人・夢・技術グループ	3	4	6,471
大栄環境	11	16	45,589
日本管財ホールディングス	6	7	20,247
M&A総研ホールディングス	2	8	11,907
エイチ・アイ・エス	17	24	34,679
ラックランド	2	—	—
共立メンテナンス	9	23	71,621
イチネンホールディングス	6	7	12,373
建設技術研究所	3	7	18,805
スペース	6	6	6,867
燦ホールディングス	5	6	7,604
スバル興業	—	2	9,729
ナガワ	1	2	13,200
東京都競馬	5	5	25,300
カナモト	9	11	35,568
ニシオホールディングス	5	6	26,257
トランス・コスモス	7	9	30,000
乃村工藝社	26	32	29,182
藤田観光	2	3	32,708
トーカイ	5	6	13,634
セコム	62	153	784,792
セントラル警備保障	3	4	12,152
丹青社	11	16	14,048
メイテックグループホールディングス	21	27	82,857
応用地質	5	6	20,434
船井総研ホールディングス	12	15	35,107
学究社	3	3	6,925

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ベネッセホールディングス	20	—	—
イオンディライト	6	8	36,450
ナック	12	10	7,040
ダイセキ	12	18	66,703
ステップ	1	3	6,976
合計	株数・金額	91,102	138,136 286,563,591
	銘柄数<比率>	1,708	1,609 <98.4%>

(注1) 銘柄欄の( )内は、当期末における国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 株数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

### (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
	TOPIX	5,007 —

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2025年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	286,563,591	98.2
コール・ローン等、その他	5,273,574	1.8
投資信託財産総額	291,837,165	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2025年2月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	291,780,459,183円
コール・ローン等	4,638,560,529
株式(評価額)	286,563,591,300
未収配当金	371,970,044
差入委託証拠金	206,337,310
(B)負債	511,296,167
未払金	9,686,650
未払解約金	501,609,517
(C)純資産総額(A-B)	291,269,163,016
元本	87,962,939,470
次期繰越損益金	203,306,223,546
(D)受益権総口数	87,962,939,470口
1万口当たり基準価額(C/D)	33,113円

- (注1) 期首元本額 71,936,737,810円  
 期中追加設定元本額 34,833,488,609円  
 期中一部解約元本額 18,807,286,949円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。
- |   |                 |
|---|-----------------|
| ニッセイTOPIXオープン                           | 5,056,152,623円  |
| ニッセイ国内株式インデックスS A (適格機関投資家限定)           | 2,909,961,878円  |
| ニッセイ日本バランス(成長型)S A (適格機関投資家限定)          | 1,695,602円      |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)              | 2,050,021,345円  |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型)                | 7,712,843,045円  |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)              | 7,033,795,199円  |
| ニッセイインデックスバランス(債券重視型)S A (適格機関投資家限定)    | 1,875,300円      |
| ニッセイインデックスバランス(標準型)S A (適格機関投資家限定)      | 4,278,822円      |
| ニッセイインデックスバランス(成長型)S A (適格機関投資家限定)      | 8,462,278円      |
| D Cニッセイ国内株式インデックス                       | 5,466,408,010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         | 25,528,690,186円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型) | 5,567,777,230円  |
| D Cニッセイターゲットデイトファンド2055                 | 496,392,826円    |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型)                | 255,226,405円    |
| D Cニッセイターゲットデイトファンド2045                 | 566,641,796円    |
| D Cニッセイターゲットデイトファンド2035                 | 652,057,583円    |
| D Cニッセイターゲットデイトファンド2025                 | 19,968,230円     |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型) | 126,939,648円    |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)                 | 15,155,487円     |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)             | 16,151,243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)          | 5,136,297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)          | 11,287,809円     |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型) | 31,016,873円     |
| D Cニッセイターゲットデイトファンド2060                 | 412,435,105円    |
| D Cニッセイターゲットデイトファンド2050                 | 280,460,887円    |
| D Cニッセイターゲットデイトファンド2040                 | 484,713,992円    |
| D Cニッセイターゲットデイトファンド2030                 | 170,684,612円    |
| ニッセイ国内株式市場連動S Aファンド(適格機関投資家限定)          | 22,690,721,624円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型)バスケツ      | 30,778,514円     |
| F Wニッセイ国内株インデックス                        | 79,143,003円     |
| D Cニッセイターゲットデイトファンド2065                 | 221,277,879円    |
| D Cニッセイ全世界株式インデックスコレクト                  | 44,088,651円     |
| D Cニッセイターゲットデイトファンド2070                 | 8,855,412円      |
| ニッセイインデックスバランス(外国株式重視型)S A (適格機関投資家限定)  | 1,314,716円      |
| ニッセイ全世界株式インデックスコレクトS A (適格機関投資家限定)      | 529,360円        |

## 損益の状況

当期 (2024年2月21日～2025年2月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	5,601,041,469円
受取配当金	5,591,077,390
受取利息	9,388,690
その他の収益	597,991
支払利息	22,602
(B)有価証券売買損益	8,964,053,746
売却益	31,612,789,155
売却損	22,648,735,409
(C)先物取引等損益	196,392,550
取引益	656,286,050
取引損	459,893,500
(D)信託報酬等	8,043
(E)当期損益金(A+B+C+D)	14,761,479,722
(F)前期繰越損益金	152,065,851,838
(G)追加信託差損益金	78,469,476,066
(H)解約差損益金	41,990,584,080
(I)合計(E+F+G+H)	203,306,223,546
次期繰越損益金(I)	203,306,223,546

- (注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
- (注2) (G)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。
- (注3) (H)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

# ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

## 運用報告書

### 第 8 期

(計算期間：2023年3月11日～2024年3月11日)

#### 運用方針

- ① 国内の公社債に投資し、NOMURA－B P I 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。

#### 主要運用 対象

国内の公社債

#### 運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。  
・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りします。



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

# 運用経過

2023年3月11日～2024年3月11日

## 国内債券市況



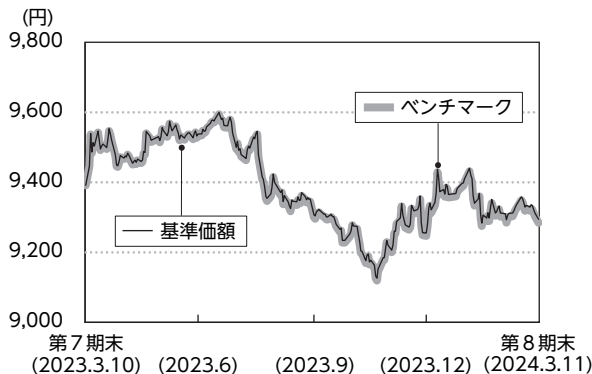
(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、日銀が金融緩和の現状維持を改めて示したことから金利は低下しましたが、金融緩和修正への思惑は継続し、徐々に上昇する展開となりました。4月下旬の金融政策決定会合においても金融緩和の現状維持が発表されたことから6月末まで緩やかに低下しましたが、7月に入り内田日銀副総裁のインタビューや日銀の物価上昇率の見通し引き上げ報道等を背景に、金融政策の修正観測が高まったことから金利は大きく上昇しました。その後も米金利の上昇を受けて、上昇基調で推移しました。

9月上旬には植田日銀総裁のインタビューをきっかけに再び金融政策の修正観測が高まり、金利は上昇基調となりましたが、11月に入ると米国において利下げへの期待感が高まったことなどを背景に、低下する展開となりました。1月中旬以降は、堅調な米経済指標や米連邦準備制度理事会（F R B）高官の早期利下げ期待をけん制する発言などにより米金利が上昇する中、国内金利も上昇基調となりました。

## 基準価額等の推移



(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。

### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 11月初旬から2024年1月中旬頃にかけて、米国において利下げへの期待感が高まったことなどを背景に金利が低下（債券価格上昇）したこと

#### <下落要因>

- ・ 7月から10月末にかけて、日銀による金融政策の修正観測が高まったことや米金利の上昇を受けて金利が上昇基調となったこと

## ポートフォリオ

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て、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比等を調整し、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した。

当期も上記クオンツモデルに基づき、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比（短期・中期・長期・超長期別の構成比）がベンチマークに対しおおむね中立となるよう、適宜売買を実施しました。

(注) デュレーションとは、債券投資におけるリスク度合いを表す主要な指標の一つで、金利変動に対する債券価格の反応の大きさ（リスクの大きさ）を表します。デュレーションが長いほど、金利変動に対する債券価格の反応は大きくなります。

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-1.0%となり、ベンチマーク騰落率（-1.1%）にほぼ連動しました。

## 今後の運用方針

引き続き、クオンツモデルに基づき、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。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	債券組入比率	純資産総額
	円	%		%	%	百万円
4期(2020年3月10日)	9,979	1.5	9,970	1.5	99.3	82,399
5期(2021年3月10日)	9,774	△2.1	9,767	△2.0	99.2	80,558
6期(2022年3月10日)	9,706	△0.7	9,699	△0.7	99.2	78,005
7期(2023年3月10日)	9,391	△3.2	9,388	△3.2	99.4	66,191
8期(2024年3月11日)	9,294	△1.0	9,281	△1.1	99.1	56,388

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	債券組入比率
	円	%		%	%
(期首)2023年3月10日	9,391	—	9,388	—	99.4
3月末	9,520	1.4	9,515	1.3	99.3
4月末	9,545	1.6	9,537	1.6	99.2
5月末	9,537	1.6	9,528	1.5	99.2
6月末	9,562	1.8	9,554	1.8	99.5
7月末	9,415	0.3	9,405	0.2	99.1
8月末	9,349	△0.4	9,337	△0.5	99.1
9月末	9,280	△1.2	9,271	△1.3	99.3
10月末	9,132	△2.8	9,123	△2.8	99.2
11月末	9,327	△0.7	9,315	△0.8	99.2
12月末	9,365	△0.3	9,353	△0.4	99.2
2024年1月末	9,298	△1.0	9,286	△1.1	99.2
2月末	9,329	△0.7	9,316	△0.8	99.1
(期末)2024年3月11日	9,294	△1.0	9,281	△1.1	99.1

(注) 騰落率は期首比です。



## 1 万口当たりの費用明細

2023年3月11日～2024年3月11日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	0円	0.000%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	・ 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	0	0.000	

(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。

(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（9,394円）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。

## 売買および取引の状況

2023年3月11日～2024年3月11日

## 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	20,791,252	25,555,631
	地方債証券	310,423	761,545
	特殊債券	405,495	1,395,106
			( 102,308)
社債券		1,102,621	3,716,402

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 金額の単位未満は切り捨てています。ただし、金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

主要な売買銘柄

2023年3月11日～2024年3月11日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第370回 利付国債（10年）	610,523	第142回 利付国債（5年）	529,988
第372回 利付国債（10年）	499,395	第338回 利付国債（10年）	508,231
第146回 利付国債（5年）	460,000	第218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	503,995
第369回 利付国債（10年）	428,392	第337回 利付国債（10年）	478,072
第453回 利付国債（2年）	394,388	第444回 利付国債（2年）	457,466
第156回 利付国債（5年）	379,016	第143回 利付国債（5年）	412,391
第448回 利付国債（2年）	350,535	第441回 利付国債（2年）	400,472
第148回 利付国債（5年）	349,251	第25回 首都高速道路	400,072
第447回 利付国債（2年）	300,348	第336回 利付国債（10年）	311,117
第373回 利付国債（10年）	290,757	第1回 京都市公募公債（20年）	308,730

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2024年3月11日現在

国内（邦貨建）公社債

区分	当期末				残存期間別組入比率		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	46,161,000 (20,622,000)	45,473,230 (19,388,594)	80.6 (34.4)	－	53.9 (23.3)	16.9 ( 5.2)	9.8 ( 5.9)
地方債証券	3,118,000 ( 3,118,000)	3,185,487 ( 3,185,487)	5.6 ( 5.6)	－	4.6 ( 4.6)	1.1 ( 1.1)	－
特殊債券 (除く金融債券)	3,862,792 ( 3,862,792)	3,928,347 ( 3,928,347)	7.0 ( 7.0)	－	5.5 ( 5.5)	1.5 ( 1.5)	－
金融債券	600,000 ( 600,000)	596,497 ( 596,497)	1.1 ( 1.1)	－	－	0.7 ( 0.7)	0.4 ( 0.4)
社債券	2,700,000 ( 2,700,000)	2,686,317 ( 2,686,317)	4.8 ( 4.8)	－	1.2 ( 1.2)	3.6 ( 3.6)	－
合計	56,441,792 (30,902,792)	55,869,880 (29,785,244)	99.1 (52.8)	－	65.2 (34.5)	23.8 (12.0)	10.1 ( 6.3)

(注1) 評価については、原則として証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。ただし、残存期間1年以内の公社債については、償却原価法により評価しています。以下同じです。

(注2) ( )内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注4) 額面金額および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、額面金額および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。以下同じです。

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(国内公社債の内訳)

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第447回 利付国債 (2年)	0.0050	2025/4/1	181,000	180,913
	第448回 利付国債 (2年)	0.0050	2025/5/1	181,000	180,875
	第449回 利付国債 (2年)	0.0050	2025/6/1	199,000	198,816
	第450回 利付国債 (2年)	0.0050	2025/7/1	208,000	207,754
	第452回 利付国債 (2年)	0.0050	2025/9/1	196,000	195,653
	第453回 利付国債 (2年)	0.0050	2025/10/1	395,000	394,138
	第454回 利付国債 (2年)	0.1000	2025/11/1	196,000	195,805
	第455回 利付国債 (2年)	0.0050	2025/12/1	199,000	198,434
	第456回 利付国債 (2年)	0.1000	2026/1/1	199,000	198,711
	第457回 利付国債 (2年)	0.1000	2026/2/1	108,000	107,826
	第144回 利付国債 (5年)	0.1000	2025/6/20	401,000	401,076
	第145回 利付国債 (5年)	0.1000	2025/9/20	466,000	465,785
	第146回 利付国債 (5年)	0.1000	2025/12/20	422,000	421,510
	第147回 利付国債 (5年)	0.0050	2026/3/20	228,000	227,149
	第148回 利付国債 (5年)	0.0050	2026/6/20	347,000	345,504
	第149回 利付国債 (5年)	0.0050	2026/9/20	450,000	447,790
	第150回 利付国債 (5年)	0.0050	2026/12/20	423,000	420,665
	第151回 利付国債 (5年)	0.0050	2027/3/20	195,000	193,798
	第152回 利付国債 (5年)	0.1000	2027/3/20	95,000	94,685
	第153回 利付国債 (5年)	0.0050	2027/6/20	335,000	332,494
	第155回 利付国債 (5年)	0.3000	2027/12/20	117,000	117,086
	第156回 利付国債 (5年)	0.2000	2027/12/20	231,000	230,309
	第160回 利付国債 (5年)	0.2000	2028/6/20	18,000	17,905
	第161回 利付国債 (5年)	0.3000	2028/6/20	146,000	145,845
	第162回 利付国債 (5年)	0.3000	2028/9/20	25,000	24,944
	第163回 利付国債 (5年)	0.4000	2028/9/20	242,000	242,484
	第164回 利付国債 (5年)	0.2000	2028/12/20	88,000	87,277
	第1回 利付国債 (40年)	2.4000	2048/3/20	81,000	93,214
	第2回 利付国債 (40年)	2.2000	2049/3/20	105,000	116,568
	第3回 利付国債 (40年)	2.2000	2050/3/20	84,000	93,003
	第4回 利付国債 (40年)	2.2000	2051/3/20	134,000	148,049
	第5回 利付国債 (40年)	2.0000	2052/3/20	113,000	119,547
	第6回 利付国債 (40年)	1.9000	2053/3/20	121,000	124,852
	第7回 利付国債 (40年)	1.7000	2054/3/20	143,000	140,348
	第8回 利付国債 (40年)	1.4000	2055/3/20	125,000	113,576
	第9回 利付国債 (40年)	0.4000	2056/3/20	203,000	134,477
	第10回 利付国債 (40年)	0.9000	2057/3/20	182,000	141,481
	第11回 利付国債 (40年)	0.8000	2058/3/20	153,000	114,095

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第 12 回 利付国債 (40年)	0.5000	2059/ 3 /20	106,000	70,076
	第 13 回 利付国債 (40年)	0.5000	2060/ 3 /20	170,000	110,918
	第 14 回 利付国債 (40年)	0.7000	2061/ 3 /20	196,000	136,012
	第 15 回 利付国債 (40年)	1.0000	2062/ 3 /20	220,000	168,126
	第 16 回 利付国債 (40年)	1.3000	2063/ 3 /20	179,000	149,570
	第339回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 6 /20	444,000	445,776
	第340回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 9 /20	493,000	495,026
	第341回 利付国債 (10年)	0.3000	2025/12/20	465,000	466,106
	第342回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 3 /20	395,000	394,281
	第343回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 6 /20	328,000	327,291
	第344回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 9 /20	322,000	321,188
	第345回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/12/20	358,000	356,961
	第346回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 3 /20	333,000	331,897
	第347回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 6 /20	269,000	267,819
	第348回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 9 /20	335,000	333,124
	第349回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/12/20	337,000	334,731
	第350回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 3 /20	431,000	427,487
	第351回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 6 /20	341,000	337,763
	第352回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 9 /20	288,000	284,791
	第353回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/12/20	275,000	271,515
	第354回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/ 3 /20	310,000	305,722
	第355回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/ 6 /20	318,000	313,312
	第356回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/ 9 /20	250,000	246,077
	第357回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/12/20	284,000	279,268
	第358回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/ 3 /20	245,000	240,675
	第359回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/ 6 /20	304,000	298,233
	第360回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/ 9 /20	363,000	355,282
	第361回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/12/20	373,000	364,174
	第362回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/ 3 /20	384,000	374,085
	第363回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/ 6 /20	384,000	372,956
	第364回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/ 9 /20	392,000	379,385
	第365回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/12/20	398,000	384,070
	第366回 利付国債 (10年)	0.2000	2032/ 3 /20	439,000	425,882
	第367回 利付国債 (10年)	0.2000	2032/ 6 /20	136,000	131,555
	第368回 利付国債 (10年)	0.2000	2032/ 9 /20	413,000	398,466
	第369回 利付国債 (10年)	0.5000	2032/12/20	432,000	426,617
	第370回 利付国債 (10年)	0.5000	2033/ 3 /20	470,000	463,001
	第371回 利付国債 (10年)	0.4000	2033/ 6 /20	147,000	143,097
	第372回 利付国債 (10年)	0.8000	2033/ 9 /20	495,000	498,306

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第373回 利付国債 (10年)	0.6000	2033/12/20	294,000	289,719
	第 1 回 利付国債 (30年)	2.8000	2029/ 9 /20	13,000	14,710
	第 2 回 利付国債 (30年)	2.4000	2030/ 2 /20	43,000	48,063
	第 3 回 利付国債 (30年)	2.3000	2030/ 5 /20	56,000	62,482
	第 4 回 利付国債 (30年)	2.9000	2030/11/20	27,000	31,359
	第 5 回 利付国債 (30年)	2.2000	2031/ 5 /20	21,000	23,526
	第 6 回 利付国債 (30年)	2.4000	2031/11/20	25,000	28,476
	第 7 回 利付国債 (30年)	2.3000	2032/ 5 /20	46,000	52,246
	第 8 回 利付国債 (30年)	1.8000	2032/11/22	36,000	39,522
	第 9 回 利付国債 (30年)	1.4000	2032/12/20	35,000	37,241
	第10回 利付国債 (30年)	1.1000	2033/ 3 /20	79,000	81,959
	第11回 利付国債 (30年)	1.7000	2033/ 6 /20	118,000	128,611
	第12回 利付国債 (30年)	2.1000	2033/ 9 /20	90,000	101,342
	第13回 利付国債 (30年)	2.0000	2033/12/20	108,000	120,624
	第14回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/ 3 /20	65,000	75,136
	第15回 利付国債 (30年)	2.5000	2034/ 6 /20	82,000	95,688
	第16回 利付国債 (30年)	2.5000	2034/ 9 /20	71,000	82,959
	第17回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/12/20	72,000	83,510
	第18回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 3 /20	59,000	67,894
	第19回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 6 /20	29,000	33,394
	第20回 利付国債 (30年)	2.5000	2035/ 9 /20	50,000	58,722
	第21回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/12/20	44,000	50,747
	第22回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 3 /20	43,000	50,573
	第23回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 6 /20	45,000	52,957
	第24回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 9 /20	28,000	32,987
	第25回 利付国債 (30年)	2.3000	2036/12/20	35,000	40,405
	第26回 利付国債 (30年)	2.4000	2037/ 3 /20	65,000	75,833
	第27回 利付国債 (30年)	2.5000	2037/ 9 /20	101,000	119,049
	第28回 利付国債 (30年)	2.5000	2038/ 3 /20	147,000	173,263
	第29回 利付国債 (30年)	2.4000	2038/ 9 /20	154,000	179,411
	第30回 利付国債 (30年)	2.3000	2039/ 3 /20	159,000	182,889
	第31回 利付国債 (30年)	2.2000	2039/ 9 /20	151,000	171,434
	第32回 利付国債 (30年)	2.3000	2040/ 3 /20	185,000	212,202
	第33回 利付国債 (30年)	2.0000	2040/ 9 /20	211,000	232,197
	第34回 利付国債 (30年)	2.2000	2041/ 3 /20	180,000	203,144
	第35回 利付国債 (30年)	2.0000	2041/ 9 /20	206,000	225,615
	第36回 利付国債 (30年)	2.0000	2042/ 3 /20	212,000	231,805
	第37回 利付国債 (30年)	1.9000	2042/ 9 /20	222,000	238,503
	第38回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 3 /20	148,000	156,188

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第 39 回 利付国債 (30年)	1.9000	2043/ 6 /20	140,000	149,828
	第 40 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 9 /20	118,000	124,001
	第 41 回 利付国債 (30年)	1.7000	2043/12/20	122,000	125,816
	第 42 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 3 /20	119,000	122,664
	第 43 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 6 /20	99,000	101,919
	第 44 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 9 /20	124,000	127,491
	第 45 回 利付国債 (30年)	1.5000	2044/12/20	135,000	133,938
	第 46 回 利付国債 (30年)	1.5000	2045/ 3 /20	169,000	167,394
	第 47 回 利付国債 (30年)	1.6000	2045/ 6 /20	159,000	160,143
	第 48 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/ 9 /20	162,000	157,062
	第 49 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/12/20	161,000	155,925
	第 50 回 利付国債 (30年)	0.8000	2046/ 3 /20	165,000	141,205
	第 51 回 利付国債 (30年)	0.3000	2046/ 6 /20	134,000	101,798
	第 52 回 利付国債 (30年)	0.5000	2046/ 9 /20	170,000	134,903
	第 53 回 利付国債 (30年)	0.6000	2046/12/20	155,000	125,460
	第 54 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 3 /20	164,000	138,545
	第 55 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 6 /20	153,000	128,855
	第 56 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 9 /20	158,000	132,653
	第 57 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/12/20	163,000	136,427
	第 58 回 利付国債 (30年)	0.8000	2048/ 3 /20	191,000	159,368
	第 59 回 利付国債 (30年)	0.7000	2048/ 6 /20	144,000	116,943
	第 60 回 利付国債 (30年)	0.9000	2048/ 9 /20	131,000	111,222
	第 61 回 利付国債 (30年)	0.7000	2048/12/20	132,000	106,481
	第 62 回 利付国債 (30年)	0.5000	2049/ 3 /20	99,000	75,557
	第 63 回 利付国債 (30年)	0.4000	2049/ 6 /20	106,000	78,382
	第 64 回 利付国債 (30年)	0.4000	2049/ 9 /20	118,000	86,902
	第 65 回 利付国債 (30年)	0.4000	2049/12/20	114,000	83,616
	第 66 回 利付国債 (30年)	0.4000	2050/ 3 /20	108,000	78,830
	第 67 回 利付国債 (30年)	0.6000	2050/ 6 /20	134,000	102,929
	第 68 回 利付国債 (30年)	0.6000	2050/ 9 /20	135,000	103,316
	第 69 回 利付国債 (30年)	0.7000	2050/12/20	134,000	105,089
	第 70 回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/ 3 /20	129,000	100,819
	第 71 回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/ 6 /20	132,000	102,804
	第 72 回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/ 9 /20	132,000	102,445
	第 73 回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/12/20	134,000	103,728
	第 74 回 利付国債 (30年)	1.0000	2052/ 3 /20	146,000	122,194
	第 75 回 利付国債 (30年)	1.3000	2052/ 6 /20	163,000	146,902
	第 76 回 利付国債 (30年)	1.4000	2052/ 9 /20	154,000	141,854
	第 77 回 利付国債 (30年)	1.6000	2052/12/20	153,000	147,478

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第 78 回 利付国債 (30年)	1.4000	2053/ 3 /20	157,000	144,202
	第 79 回 利付国債 (30年)	1.2000	2053/ 6 /20	136,000	118,762
	第 80 回 利付国債 (30年)	1.8000	2053/ 9 /20	148,000	149,004
	第 81 回 利付国債 (30年)	1.6000	2053/12/20	106,000	101,594
	第 78 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/ 6 /20	96,000	98,216
	第 79 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 6 /20	85,000	87,071
	第 80 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 6 /20	88,000	90,256
	第 81 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 9 /20	105,000	107,990
	第 82 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 9 /20	128,000	131,840
	第 83 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/12/20	104,000	107,562
	第 84 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/12/20	141,000	145,579
	第 85 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/ 3 /20	196,000	203,559
	第 86 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 3 /20	203,000	211,647
	第 87 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 3 /20	185,000	192,507
	第 88 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 6 /20	205,000	214,792
	第 89 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 6 /20	141,000	147,416
	第 90 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 9 /20	153,000	160,709
	第 91 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 9 /20	48,000	50,539
	第 92 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/12/20	114,000	119,978
	第 93 回 利付国債 (20年)	2.0000	2027/ 3 /20	43,000	45,317
	第 94 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 3 /20	73,000	77,154
	第 95 回 利付国債 (20年)	2.3000	2027/ 6 /20	82,000	87,515
	第 96 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 6 /20	32,000	33,944
	第 97 回 利付国債 (20年)	2.2000	2027/ 9 /20	81,000	86,505
	第 98 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 9 /20	57,000	60,674
	第 99 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/12/20	133,000	142,069
	第100回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 3 /20	88,000	94,681
	第101回 利付国債 (20年)	2.4000	2028/ 3 /20	42,000	45,522
	第102回 利付国債 (20年)	2.4000	2028/ 6 /20	78,000	84,857
	第103回 利付国債 (20年)	2.3000	2028/ 6 /20	70,000	75,859
	第104回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/ 6 /20	58,000	62,365
	第105回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/ 9 /20	109,000	117,577
	第106回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 9 /20	62,000	67,154
	第107回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/12/20	84,000	90,882
	第108回 利付国債 (20年)	1.9000	2028/12/20	133,000	142,647
	第109回 利付国債 (20年)	1.9000	2029/ 3 /20	104,000	111,871
	第110回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 3 /20	124,000	134,609
	第111回 利付国債 (20年)	2.2000	2029/ 6 /20	78,000	85,383
	第112回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 6 /20	131,000	142,723

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第113回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 9 /20	213,000	232,889
	第114回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/12/20	77,000	84,508
	第115回 利付国債 (20年)	2.2000	2029/12/20	63,000	69,499
	第116回 利付国債 (20年)	2.2000	2030/ 3 /20	85,000	94,106
	第117回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/ 3 /20	123,000	135,453
	第118回 利付国債 (20年)	2.0000	2030/ 6 /20	25,000	27,464
	第119回 利付国債 (20年)	1.8000	2030/ 6 /20	15,000	16,290
	第120回 利付国債 (20年)	1.6000	2030/ 6 /20	34,000	36,508
	第121回 利付国債 (20年)	1.9000	2030/ 9 /20	81,000	88,642
	第122回 利付国債 (20年)	1.8000	2030/ 9 /20	39,000	42,432
	第123回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/12/20	170,000	188,626
	第124回 利付国債 (20年)	2.0000	2030/12/20	108,000	119,122
	第125回 利付国債 (20年)	2.2000	2031/ 3 /20	115,000	128,697
	第126回 利付国債 (20年)	2.0000	2031/ 3 /20	105,000	116,037
	第127回 利付国債 (20年)	1.9000	2031/ 3 /20	101,000	110,930
	第128回 利付国債 (20年)	1.9000	2031/ 6 /20	164,000	180,303
	第129回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/ 6 /20	102,000	111,423
	第130回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/ 9 /20	163,000	178,175
	第131回 利付国債 (20年)	1.7000	2031/ 9 /20	100,000	108,585
	第132回 利付国債 (20年)	1.7000	2031/12/20	125,000	135,818
	第133回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/12/20	156,000	170,667
	第134回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/ 3 /20	123,000	134,760
	第135回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 3 /20	70,000	76,125
	第136回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/ 3 /20	72,000	77,748
	第137回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 6 /20	82,000	89,250
	第138回 利付国債 (20年)	1.5000	2032/ 6 /20	88,000	94,354
	第139回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/ 6 /20	96,000	103,689
	第140回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 9 /20	222,000	241,806
	第141回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/12/20	150,000	163,414
	第142回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/12/20	95,000	104,329
	第143回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/ 3 /20	211,000	228,179
	第144回 利付国債 (20年)	1.5000	2033/ 3 /20	149,000	159,792
	第145回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 6 /20	281,000	306,270
	第146回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 9 /20	278,000	302,825
	第147回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/12/20	302,000	325,972
	第148回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/ 3 /20	217,000	232,061
	第149回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/ 6 /20	228,000	243,613
	第150回 利付国債 (20年)	1.4000	2034/ 9 /20	245,000	259,143
	第151回 利付国債 (20年)	1.2000	2034/12/20	247,000	256,037



# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第152回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 3 /20	216,000	223,618
	第153回 利付国債 (20年)	1.3000	2035/ 6 /20	180,000	188,042
	第154回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 9 /20	191,000	197,188
	第155回 利付国債 (20年)	1.0000	2035/12/20	188,000	189,596
	第156回 利付国債 (20年)	0.4000	2036/ 3 /20	133,000	124,769
	第157回 利付国債 (20年)	0.2000	2036/ 6 /20	136,000	123,969
	第158回 利付国債 (20年)	0.5000	2036/ 9 /20	191,000	180,067
	第159回 利付国債 (20年)	0.6000	2036/12/20	160,000	152,232
	第160回 利付国債 (20年)	0.7000	2037/ 3 /20	126,000	120,947
	第161回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/ 6 /20	127,000	119,922
	第162回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/ 9 /20	136,000	127,917
	第163回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/12/20	210,000	196,732
	第164回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/ 3 /20	260,000	239,158
	第165回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/ 6 /20	212,000	194,151
	第166回 利付国債 (20年)	0.7000	2038/ 9 /20	193,000	181,174
	第167回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/12/20	219,000	198,884
	第168回 利付国債 (20年)	0.4000	2039/ 3 /20	189,000	168,255
	第169回 利付国債 (20年)	0.3000	2039/ 6 /20	198,000	172,766
	第170回 利付国債 (20年)	0.3000	2039/ 9 /20	175,000	151,901
	第171回 利付国債 (20年)	0.3000	2039/12/20	188,000	162,326
	第172回 利付国債 (20年)	0.4000	2040/ 3 /20	174,000	151,924
	第173回 利付国債 (20年)	0.4000	2040/ 6 /20	222,000	192,829
	第174回 利付国債 (20年)	0.4000	2040/ 9 /20	225,000	194,411
	第175回 利付国債 (20年)	0.5000	2040/12/20	217,000	189,822
	第176回 利付国債 (20年)	0.5000	2041/ 3 /20	191,000	166,339
	第177回 利付国債 (20年)	0.4000	2041/ 6 /20	202,000	171,986
	第178回 利付国債 (20年)	0.5000	2041/ 9 /20	198,000	170,757
	第179回 利付国債 (20年)	0.5000	2041/12/20	217,000	186,416
	第180回 利付国債 (20年)	0.8000	2042/ 3 /20	211,000	190,585
	第181回 利付国債 (20年)	0.9000	2042/ 6 /20	222,000	203,332
	第182回 利付国債 (20年)	1.1000	2042/ 9 /20	207,000	195,561
	第183回 利付国債 (20年)	1.4000	2042/12/20	211,000	209,132
	第184回 利付国債 (20年)	1.1000	2043/ 3 /20	208,000	195,397
	第185回 利付国債 (20年)	1.1000	2043/ 6 /20	209,000	195,768
	第186回 利付国債 (20年)	1.5000	2043/ 9 /20	208,000	208,156
	第187回 利付国債 (20年)	1.3000	2043/12/20	119,000	114,669
	小計	—	—	—	45,473,230

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
地方債証券	第764回 東京都公募公債	0.2150	2026/12/18	100,000	99,690
	第14回 東京都公募公債(20年)	2.3100	2028/3/17	100,000	107,549
	第34回 東京都公募公債(20年)	0.6680	2037/6/19	100,000	93,704
	第18回 宮城県1号公募公債(5年)	0.0600	2027/6/29	100,000	99,158
	第30回 神奈川県公募公債(20年)	1.1610	2035/9/20	100,000	101,653
	第448回 大阪府公募公債	0.0010	2029/9/27	38,000	37,016
	第455回 大阪府公募公債	0.1160	2030/4/26	180,000	175,881
	第7回 大阪府公募公債(20年)	1.8400	2031/9/26	100,000	108,940
	第11回 大阪府公募公債(20年)	1.6930	2033/9/27	100,000	108,084
	第12回 大阪府公募公債(20年)	1.4530	2034/9/26	100,000	105,363
	平成29年度第5回 京都府公募公債(20年)	0.6300	2037/8/14	100,000	93,408
	第15回 兵庫県公募公債(20年)	1.6400	2032/7/23	100,000	107,638
	第21回 兵庫県公募公債(20年)	1.5400	2034/5/9	100,000	106,429
	平成26年度第11回 愛知県公募公債(15年)	0.9610	2029/10/16	100,000	102,674
	令和4年度第3回 愛知県公募公債	0.3040	2032/5/31	200,000	193,933
	平成20年度第1回 福岡県公募公債(20年)	2.2600	2028/8/18	100,000	108,078
	平成24年度第2回 福岡県公募公債(20年)	1.6350	2032/8/16	100,000	107,607
	令和4年度第1回 千葉県公募公債	0.3040	2032/5/25	300,000	290,952
	第22回 大阪市公募公債(20年)	0.3470	2036/5/30	100,000	91,809
	第1回 名古屋市公募公債(30年)	2.5300	2035/3/20	100,000	116,313
	第25回 横浜市公募公債(20年)	1.7200	2032/7/16	100,000	108,294
	第26回 横浜市公募公債(20年)	1.7760	2033/1/28	100,000	108,829
	第31回 横浜市公募公債(20年)	1.1800	2035/4/20	100,000	102,240
	第9回 川崎市公募公債(20年)	2.1500	2030/5/24	100,000	110,059
	第4回 川崎市公募公債(30年)	2.1000	2041/9/20	100,000	109,528
	平成30年度第5回 広島市公募公債	0.1950	2028/12/25	200,000	197,682
	平成29年度第1回 仙台市公募公債	0.6160	2037/10/19	100,000	92,967
	小計	—	—	—	3,185,487
特殊債券 (除く金融債券)	第9回 新関西国際空港	1.2310	2028/12/20	300,000	308,936
	第16回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7000	2036/9/19	100,000	117,758
	第174回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6410	2032/9/30	100,000	107,774
	第205回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5320	2033/11/30	100,000	106,625
	第212回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5000	2034/2/28	100,000	106,240
	第233回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3150	2034/11/30	100,000	104,008
	第278回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.2370	2036/5/30	100,000	90,791
	第293回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.3970	2036/10/31	100,000	92,037
	第316回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.5690	2037/6/30	100,000	93,173
	第319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.6300	2037/7/31	100,000	93,806
	第17回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.8700	2031/9/26	200,000	215,868

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
特殊債券 (除く金融債券)	第 36 回 地方公共団体金融機構債券 (20年)	1.5660	2034/ 4 /28	100,000	105,029
	第 1 回 地方公共団体金融機構債券 (30年)	1.8640	2044/ 6 /28	100,000	101,358
	第 83 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0200	2026/ 4 /17	103,000	102,473
	第116回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0950	2029/ 1 /22	138,000	135,733
	第120回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0010	2029/ 7 /13	100,000	97,578
	第136回 地方公共団体金融機構債券	0.1450	2030/ 9 /27	200,000	193,187
	第 72 回 日本政策金融公庫債券	0.2550	2028/ 8 / 9	100,000	98,971
	第 97 回 都市再生債券	1.0170	2029/ 9 /20	100,000	102,588
	第 33 回 政保中部国際空港債券	0.2600	2028/ 3 /17	100,000	99,559
	第 59 回 住宅金融支援機構債券	1.9500	2030/10/22	200,000	217,563
	第143回 住宅金融支援機構債券	1.1920	2028/10/20	100,000	103,141
	第 37 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7100	2045/ 6 /10	17,734	18,356
	第 42 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4300	2045/11/10	44,608	45,928
	第 46 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8500	2046/ 3 /10	51,141	53,120
	第 54 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4700	2046/11/10	43,062	44,379
	第 55 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4100	2046/12/10	48,430	49,815
	第 60 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	2047/ 5 /10	49,720	51,017
	第 61 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2600	2047/ 6 /10	25,093	25,660
	第 62 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	2047/ 7 /10	226,928	231,262
	第 63 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1100	2047/ 8 /10	139,590	141,600
	第 73 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3000	2048/ 6 /10	99,432	101,619
	第 78 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0800	2048/11/10	86,481	87,691
	第109回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	2051/ 6 /10	189,573	180,871
	第 66 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.0860	2029/ 5 /29	100,000	102,818
	小計	—	—	—	3,928,347
金融債券	い第845号 利付商工債券	0.1200	2025/10/27	200,000	199,458
	い第854号 利付商工債券	0.0800	2026/ 7 /27	200,000	198,651
	い第862号 利付商工債券	0.1800	2027/ 3 /26	100,000	99,293
	第394回 利付信金中金債券	0.1500	2027/ 9 /27	100,000	99,094
	小計	—	—	—	596,497
社債券	第 36 回 フランス相互信用連合銀行 (B F C M) 円貨債 (2021)	0.3150	2028/10/20	100,000	96,317
	第 38 回 成田国際空港	0.1950	2030/10/28	200,000	193,547
	第 69 回 西日本高速道路	0.2250	2027/ 6 /18	100,000	99,406
	第 13 回 日本たばこ産業	0.3550	2028/ 9 / 8	100,000	98,953
	第 5 回 電通グループ	0.3200	2027/ 7 / 8	400,000	397,514
	第 2 回 アステラス製薬	0.4190	2027/12/ 3	100,000	99,484
	第 11 回 プリヂストーン	0.2950	2027/ 4 /21	100,000	99,366
	第 19 回 豊田通商	0.9540	2026/ 7 /10	100,000	101,177

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
社債券	第 18 回 NTTファイナンス	0.3800	2030/ 9 /20	100,000	97,418
	第 78 回 トヨタファイナンス	0.2650	2027/ 7 /23	100,000	99,283
	第 55 回 日立キャピタル	0.9630	2026/ 9 /18	100,000	101,158
	第 17 回 三井住友ファイナンス&リース	0.4500	2028/ 2 / 8	100,000	99,235
	第 2 回 三菱HCキャピタル	0.1900	2027/ 3 / 1	100,000	98,970
	第132回 三菱地所	0.4300	2030/ 4 /16	100,000	98,260
	第 7 回 野村不動産オフィスファンド投資法人	2.9000	2028/ 3 /17	200,000	216,468
	第 11 回 ジャパンエクセレント投資法人	0.6500	2027/ 4 /23	100,000	99,708
	第106回 東日本旅客鉄道	0.9810	2035/ 1 /29	100,000	98,412
	第 3 回 東日本旅客鉄道 (サステナビリティボンド)	0.2640	2032/ 1 /21	100,000	95,566
	第510回 関西電力	0.4900	2027/ 7 /23	100,000	99,830
	第494回 東北電力	0.4250	2027/ 6 /25	100,000	99,658
	第451回 九州電力	0.4500	2027/ 5 /25	100,000	99,790
	第 47 回 大阪瓦斯 (トランジションボンド)	0.5290	2032/ 9 / 1	100,000	96,789
	小計	—	—	—	2,686,317
合計		—	—	—	55,869,880

## 投資信託財産の構成

2024年3月11日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	55,869,880	98.3
コール・ローン等、その他	975,896	1.7
投資信託財産総額	56,845,777	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年3月11日現在)

項目	当期末
(A)資産	56,845,777,083円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	799,100,454
公 社 債 (評価額)	55,869,880,352
未 収 利 息	160,797,422
前 払 費 用	15,998,855
(B)負債	457,467,750
未 払 金	402,365,210
未 払 解 約 金	55,101,080
そ の 他 未 払 費 用	1,460
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	56,388,309,333
元 本	60,674,945,143
次 期 繰 越 損 益 金	△ 4,286,635,810
(D)受 益 権 総 口 数	60,674,945,143口
1万口当たり基準価額 (C / D)	9,294円

- (注1) 期首元本額 70,484,284,906円  
 期中追加設定元本額 15,372,128,811円  
 期中一部解約元本額 25,181,468,574円

- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。

ニッセイ国内債券パッシブD B (適格機関投資家限定)

	35,374,088,296円
DCニッセイ日本債券インデックス	5,214,727,778円
DCニッセイターゲットデットファンド2055	350,854,103円
DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	8,816,046,964円
DCニッセイターゲットデットファンド2045	642,290,762円
DCニッセイターゲットデットファンド2035	3,586,989,645円
DCニッセイターゲットデットファンド2025	1,208,005,642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)	384,915,856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)	38,635,807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)	149,044,598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)	86,288,489円
DCニッセイターゲットデットファンド2060	211,978,736円
DCニッセイターゲットデットファンド2050	229,582,939円
DCニッセイターゲットデットファンド2040	824,409,138円
DCニッセイターゲットデットファンド2030	3,471,043,373円
FWニッセイ国内債インデックス	47,391,415円
DCニッセイターゲットデットファンド2065	38,651,602円

- (注3) 元本の欠損  
 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は4,286,635,810円です。

## 損益の状況

当期 (2023年3月11日~2024年3月11日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	503,773,289円
受 取 利 息	504,044,208
支 払 利 息	△ 270,919
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 992,732,040
売 買 益	145,539,080
売 買 損	△ 1,138,271,120
(C)信 託 報 酬 等	△ 11,481
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 488,970,232
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△ 4,292,419,196
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△ 962,123,954
(G)解 約 差 損 益 金	1,456,877,572
(H)合 計 (D + E + F + G)	△ 4,286,635,810
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	△ 4,286,635,810

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

- (注2) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。

- (注3) (G)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

# ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第 34 期

(計算期間：2024年5月21日～2024年11月20日)

### 運用方針

主に日本を除く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）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

### 主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

### 運用方法

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

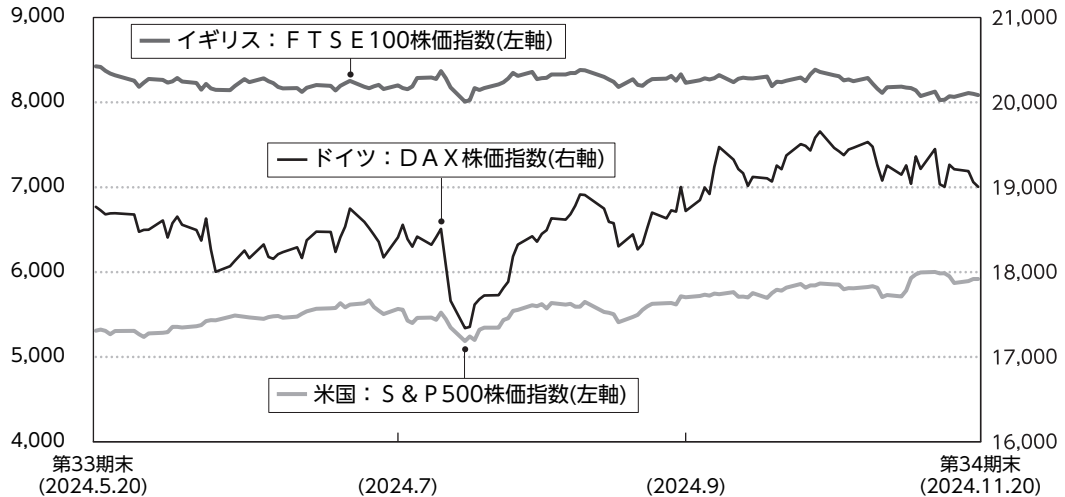
# 運用経過

2024年5月21日～2024年11月20日

## 投資環境

### 海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



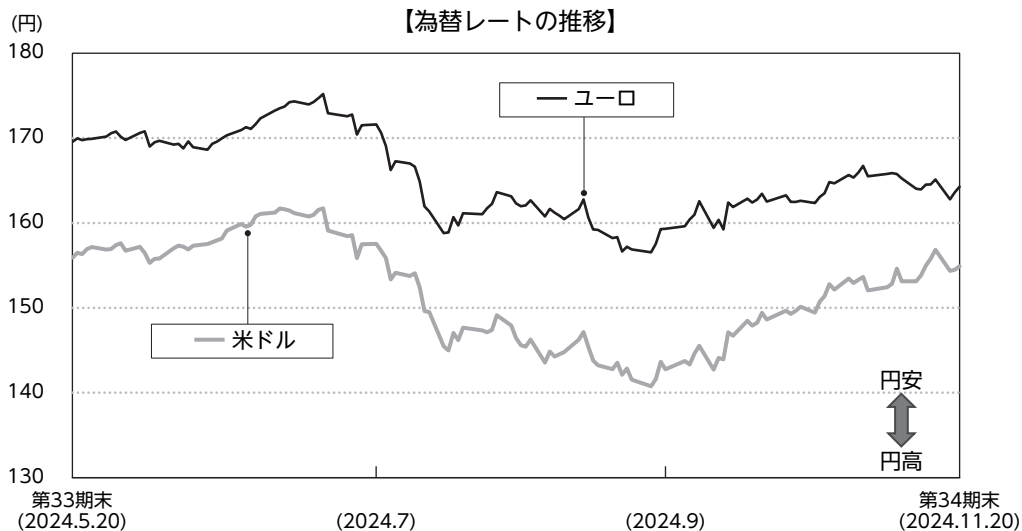
(注) FactSetのデータを使用しています。

外国株式市場は期を通じて見ると米国とドイツは上昇し、イギリスは下落しました。

期初から6月にかけては米消費者物価指数（CPI）の伸び率鈍化などを受けて長期金利が低下したことが好感され米国株式市場が上昇した一方、欧州の株式市場は欧州主要国における政治の不透明感が警戒され下落しました。

7月中旬から8月上旬にかけては米大統領選を巡る混乱や米政府による対中半導体輸出規制の強化懸念、米景気の先行き懸念が高まり株価は下落しましたが、9月から10月にかけては米連邦準備制度理事会（FRB）や欧州中央銀行（ECB）による利下げ実施等を受けて上昇しました。その後は米大統領選や米連邦公開市場委員会（FOMC）での利下げの動向などを背景に市場のボラティリティ（価格変動性）が高まる場面があったものの、前期末と比較すると米国とドイツは上昇し、イギリスは下落して当期末を迎えました。

■為替市況



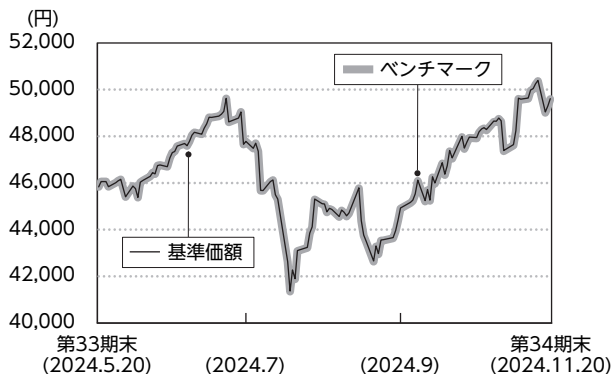
(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、期初以降、堅調な米経済指標が続いたことや日銀の利上げ観測・F R Bの利下げ観測がそれぞれ後退したことなどから米ドル高円安基調となりました。7月中旬には日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあったことや米経済指標が弱含んだことなどから、大きく米ドル安円高に転じました。9月下旬以降は自民党総裁選で石破氏が勝利し10月の衆院選で連立与党が過半数の議席数を確保できなかったことで政治の不透明感が高まったこと、さらに米大統領選でトランプ氏優位との見方が強まったことから財政拡張や関税引き上げに伴う物価上昇への懸念が高まったことから再び米ドル高円安となり、結局、期を通じて見るとほぼ横ばい圏で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、期初以降、日銀の追加利上げ観測が後退する一方で欧州域内の経済指標が堅調であったことからユーロ高円安基調となりました。7月中旬には日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあったことや米経済指標が弱含んだことなどから大きくユーロ安円高となりました。9月下旬以降は自民党総裁選で石破氏が勝利し10月の衆院選で連立与党が過半数の議席数を確保できなかったことで政治の不透明感が高まったこと、さらにユーロ圏実質域内総生産（GDP）が市場予想を上回るなど欧州域内の経済指標が堅調であったことなどから再びユーロ高円安推移となり、結局、期を通じて見るとややユーロ安円高で当期末を迎えました。



## 基準価額等の推移



(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。

### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 期初から6月にかけて、米CPIの伸び率鈍化などを受けて長期金利が低下したことなどが好感され米国株式市場が上昇したこと
- ・ 9月から10月にかけて、FRBやECBによる利下げ実施等を受けて株価が上昇したことや、日銀の追加利上げタイミングが遅れるとの見方が広まったことなどから主要通貨に対して円安が進行したこと

#### <下落要因>

- ・ 7月中旬から8月上旬にかけて、米大統領選を巡る混乱や米政府による対中半導体輸出規制の強化懸念、米景気の先行き懸念が高まり株価が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が進行したこと

## ポートフォリオ

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した。

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+8.3%となり、ベンチマーク騰落率(+8.2%)にほぼ連動しました。

## 今後の運用方針

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。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中 騰落率	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	%		%	%	%	%	百万円
30期(2022年11月21日)	30,643	11.3	29,840	11.2	94.1	2.9	2.1	601,452
31期(2023年5月22日)	32,472	6.0	31,568	5.8	95.1	2.9	2.0	668,843
32期(2023年11月20日)	37,454	15.3	36,382	15.2	94.4	3.6	1.9	827,057
33期(2024年5月20日)	45,829	22.4	44,477	22.2	95.8	2.1	1.8	1,045,118
34期(2024年11月20日)	49,611	8.3	48,122	8.2	95.2	2.7	1.8	1,175,777

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%
(期首)2024年5月20日	45,829	—	44,477	—	95.8	2.1	1.8
5月末	45,403	△0.9	44,062	△0.9	95.2	2.8	1.7
6月末	48,165	5.1	46,742	5.1	95.0	3.1	1.7
7月末	45,492	△0.7	44,140	△0.8	96.0	2.0	1.9
8月末	44,712	△2.4	43,368	△2.5	94.9	3.1	1.9
9月末	45,237	△1.3	43,869	△1.4	95.8	2.2	1.9
10月末	48,661	6.2	47,195	6.1	95.3	2.8	1.9
(期末)2024年11月20日	49,611	8.3	48,122	8.2	95.2	2.7	1.8

(注) 騰落率は期首比です。

## 1 万口当たりの費用明細

2024年5月21日～2024年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料	0円	0.000%	
(株式)	(0)	(0.000)	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)	(0.000)	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	1	0.002	
(株式)	(1)	(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	0.006	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)	(3)	(0.006)	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
(その他)	(0)	(0.000)	・ 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	4	0.008	

(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。

(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（46,488円）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。

## 売買および取引の状況

2024年5月21日～2024年11月20日

## (1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 19,777 ( 33,142)	千米ドル 236,518 (△ 305)	百株 6,547	千米ドル 29,142
	カナダ	2,134 ( 1,377)	千カナダ・ドル 13,535	567	千カナダ・ドル 1,622
	オーストラリア	3,366	千オーストラリア・ドル 9,118	2,332	千オーストラリア・ドル 1,165
	香港	3,077	千香港ドル 8,963	5,026	千香港ドル 5,382
	シンガポール	1,347	千シンガポール・ドル 1,114	4,015	千シンガポール・ドル 1,289
	ニュージーランド	298	千ニュージーランド・ドル 259	162	千ニュージーランド・ドル 537
	イギリス	13,319 ( 1,424)	千イギリス・ポンド 10,479 ( 972)	6,653	千イギリス・ポンド 10,441
	イスラエル	241	千イスラエル・シェケル 1,071	—	千イスラエル・シェケル —
	スイス	697	千スイス・フラン 6,812 (△ 9)	102	千スイス・フラン 1,086
	デンマーク	320	千デンマーク・クローネ 22,332	31	千デンマーク・クローネ 2,121
	ノルウェー	376	千ノルウェー・クローネ 6,023	133	千ノルウェー・クローネ 3,106
	スウェーデン	2,097	千スウェーデン・クローナ 48,376	229	千スウェーデン・クローナ 2,689

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

			買付		売付	
			株数	金額	株数	金額
外国	ユーロ		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
		アイルランド	382 (△ 279)	312 (△ 1,236)	15	17
		オランダ	1,623	4,656	200	369
		ベルギー	115	867	250	427
		ルクセンブルグ	40	69	39	95
		フランス	1,224 ( 361)	7,943 (△ 5)	669	738
		ドイツ	1,624	7,969 (△ 71)	190	911
		ポルトガル	208 (△ 320)	153 (△ 7)	—	—
		スペイン	7,689	3,458 (△ 3)	1,905	1,429
		イタリア	2,499	2,004 (△ 4)	150	300
		フィンランド	624	785	38	43
		オーストリア	28	128	12	41
		その他	47	57	83	49

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

(注2) ( )内は株式分割、合併などによる増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 地域は発行通貨によって区分しています。また、その他には国際機関等を含みます。以下同じです。

(注4) 株数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	0.732	51	—	—
CROWN CASTLE INC	2	237	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.611	72	0.660	78
PROLOGIS INC	4	571	—	—
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	2	50	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.702	148	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.485	55	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	1	95	1	115
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.314	89	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2	62	—	—
WELLTOWER INC	7	866	—	—
HOST HOTELS AND RESORTS INC	3	60	—	—
KIMCO REALTY CORP	3	69	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.573	84	—	—
PUBLIC STORAGE	0.745	233	—	—
REGENCY CENTERS CORP	0.859	58	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	242	—	—
SUN COMMUNITIES INC	0.626	80	—	—
UDR INC	1	64	—	—
VENTAS INC	2	124	—	—
WP CAREY INC	1	66	—	—
REALTY INCOME CORP	8	475	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.875	60	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	174	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	571	—	—
IRON MOUNTAIN INC	1	149	—	—
AMERICAN TOWER REIT INC	2	505	—	—
EQUINIX INC	0.564	442	—	—
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	2	74	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1	87	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.474	101	—	—
INVITATION HOMES INC	3	107	—	—
VICI PROPERTIES INC	5	185	—	—

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
<b>(カナダ)</b>	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.291	14	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.503	9	17	318
<b>(オーストラリア)</b>		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
GPT GROUP	9	42	—	—
GOODMAN GROUP	8	278	—	—
STOCKLAND	11	52	—	—
MIRVAC GROUP	19	39	—	—
VICINITY CENTRES	18	38	—	—
SCENTRE GROUP	25	84	—	—
DEXUS/AU	5	36	—	—
<b>(香港)</b>		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	10	356	—	—
<b>(シンガポール)</b>		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
CAPITALAND ASCENDAS REIT	19	52	—	—
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	32	(△ 3) 66	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	—	(△0.591) —	369	490
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	—	—	251	307
<b>(イギリス)</b>		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
LAND SECURITIES GROUP PLC	3	21	—	—
SEGRO PLC	18	168	—	—
<b>(ユーロ／ベルギー)</b>		千ユーロ		千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW SCA	1	30	—	—
<b>(ユーロ／フランス)</b>				
KLEPIERRE	0.970	25 (△ 2)	—	—
GECINA SA	0.234	22	—	—
COVIVIO	0.807	40	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.605	44	—	—

(注1) ( )内は分割、合併などによる増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注2) 口数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、口数および金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円 103,141	百万円 93,716	百万円 -	百万円 -

(注1) 外貨建取引の金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）における国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2024年5月21日～2024年11月20日

### 株式

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP	33	2,137,129	63,148	CRH PLC	73	914,769	12,448
APPLE INC	56	1,862,757	32,713	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	19	599,094	30,946
NVIDIA CORP	59	1,829,603	30,515	SMURFIT WESTROCK PLC	27	191,430	6,859
AMAZON.COM INC	51	1,409,990	27,214	RTX CORPORATION	10	178,017	17,364
CRH PLC	76	1,001,264	13,158	GENERAL MOTORS CO	21	157,366	7,246
META PLATFORMS INC-A	8	615,447	72,277	BORGWARNER INC	24	143,047	5,743
ALPHABET INC-CL A	24	608,792	25,363	HASBRO INC	13	134,739	9,628
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	19	596,710	30,317	GLOBE LIFE INC	9	132,536	13,329
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	7	525,284	67,499	FMC CORP	13	130,121	9,816
ELI LILLY & CO	3	510,535	128,598	CAESARS ENTERTAINMENT INC	23	126,895	5,372

(注1) 金額は受渡代金で、外国株式は各月末（決算日の属する月については決算日）における国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注2) 株数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。



## 組入有価証券明細表

2024年11月20日現在

## (1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
3M CO	585	611	7,842	1,214,907	資本財
ABBOTT LABORATORIES	1,839	1,926	22,570	3,496,375	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	1,870	1,955	32,580	5,046,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCENTURE PLC	664	693	24,556	3,804,077	ソフトウェア・サービス
ADOBE INC	478	491	24,535	3,800,770	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES INC	1,711	1,790	24,954	3,865,626	半導体・半導体製造装置
AECOM	144	150	1,640	254,130	資本財
AERCAP HOLDINGS NV	211	214	2,052	318,004	資本財
AES CORP	710	787	1,082	167,649	公益事業
AFLAC INC	588	597	6,641	1,028,846	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	310	323	4,061	629,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	235	246	8,077	1,251,258	素材
AIRBNB INC-CLASS A	462	488	6,427	995,609	消費者サービス
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	159	168	1,473	228,232	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	124	130	1,387	214,883	素材
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	365	417	803	124,503	生活必需品流通・小売り
ALIGN TECHNOLOGY INC	77	79	1,762	273,080	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGION PLC	92	96	1,337	207,200	資本財
ALLIANT ENERGY CORP	270	283	1,767	273,797	公益事業
ALLSTATE CORP	277	292	5,746	890,208	保険
ALLY FINANCIAL INC	287	302	1,077	166,951	金融サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	133	140	3,282	508,542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	6,264	6,504	115,860	17,947,972	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	5,465	5,600	100,568	15,579,077	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	1,874	1,902	10,629	1,646,631	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	9,855	10,373	212,250	32,879,763	一般消費財・サービス流通・小売り
AMCOR PLC	1,533	1,603	1,586	245,710	素材
AMEREN CORPORATION	278	295	2,721	421,630	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	557	583	5,645	874,565	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	617	637	18,204	2,820,129	金融サービス
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	75	79	1,095	169,632	保険

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	743	734	5,531	856,855	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	206	215	2,980	461,739	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	107	109	6,183	957,823	金融サービス
AMETEK INC	244	256	4,960	768,372	資本財
AMGEN INC	567	594	16,634	2,576,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	633	1,330	9,442	1,462,699	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES INC	525	549	11,565	1,791,635	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	92	96	3,282	508,488	ソフトウェア・サービス
AON PLC	212	216	8,218	1,273,120	保険
APA CORP	319	409	897	139,061	エネルギー
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	421	441	7,422	1,149,769	金融サービス
APPLE INC	15,564	16,134	368,314	57,055,561	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	880	917	15,525	2,405,090	半導体・半導体製造装置
APPLOVIN CORP-CLASS A	168	226	7,266	1,125,669	ソフトウェア・サービス
APTIV PLC	299	301	1,570	243,284	自動車・自動車部品
ARCH CAPITAL GROUP LTD	395	415	3,977	616,161	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	565	547	2,902	449,614	食品・飲料・タバコ
ARES MANAGEMENT CORP - A	177	205	3,506	543,268	金融サービス
ARISTA NETWORKS INC	280	295	11,142	1,726,147	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	228	242	7,078	1,096,583	保険
ASPEN TECHNOLOGY INC	30	31	780	120,910	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	55	57	1,260	195,323	保険
AT&T INC	7,591	7,956	18,084	2,801,541	電気通信サービス
ATLASSIAN CORP-CL A	164	176	4,370	677,103	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	159	167	2,452	379,855	公益事業
AUTODESK INC	226	238	7,282	1,128,160	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	435	453	13,489	2,089,623	商業・専門サービス
AUTOZONE INC	18	18	5,878	910,603	一般消費財・サービス流通・小売り
AVANTOR INC	716	752	1,483	229,854	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVERY DENNISON CORP	85	89	1,757	272,214	素材
AXON ENTERPRISE INC	75	79	4,846	750,726	資本財
BAKER HUGHES COMPANY	1,066	1,105	4,738	734,115	エネルギー
BALL CORP	334	343	2,059	319,059	素材
BANK OF AMERICA CORP	7,546	7,795	36,177	5,604,209	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	804	816	6,340	982,231	金融サービス
BATH & BODY WORKS INC	227	234	715	110,780	一般消費財・サービス流通・小売り

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
BAXTER INTERNATIONAL INC	537	564	1,836	284,558	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	306	320	7,127	1,104,170	ヘルスケア機器・サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	226	175	822	127,356	ソフトウェア・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,388	1,466	68,770	10,653,166	金融サービス
BEST BUY CO INC	205	227	1,975	306,069	一般消費財・サービス流通・小売り
BILL HOLDINGS, INC.	101	－	－	－	ソフトウェア・サービス
BIOGEN INC	153	161	2,506	388,324	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	199	210	1,304	202,008	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	22	22	708	109,778	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	167	174	1,158	179,523	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	157	－	－	－	金融サービス
BLACKROCK INC	－	164	16,918	2,620,856	金融サービス
BLACKSTONE INC	752	791	14,635	2,267,233	金融サービス
BLOCK INC	586	616	5,698	882,815	金融サービス
BOEING CO	609	647	9,429	1,460,722	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	36	37	18,698	2,896,592	消費者サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	138	143	1,977	306,334	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	249	－	－	－	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,552	1,627	14,704	2,277,937	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,156	2,245	13,077	2,025,848	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	471	4,897	80,984	12,545,379	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	124	130	2,943	455,924	商業・専門サービス
BROWN & BROWN INC	256	268	2,935	454,704	保険
BROWN-FORMAN CORP -CL B	325	202	813	125,974	食品・飲料・タバコ
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	130	135	2,415	374,219	資本財
BUNGE GLOBAL SA	153	156	1,403	217,370	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	68	70	1,937	300,088	一般消費財・サービス流通・小売り
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	123	129	1,415	219,296	運輸
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	288	301	9,030	1,398,922	ソフトウェア・サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	228	－	－	－	消費者サービス
CAMPBELL SOUP CO	205	215	936	145,046	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	403	422	7,655	1,185,869	金融サービス
CARDINAL HEALTH INC	261	269	3,191	494,410	ヘルスケア機器・サービス
CARLISLE COS INC	51	52	2,292	355,129	資本財
CARLYLE GROUP INC/THE	229	258	1,324	205,158	金融サービス
CARMAX INC	167	172	1,301	201,601	一般消費財・サービス流通・小売り
CARNIVAL CORP	1,067	1,118	2,810	435,403	消費者サービス

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CARRIER GLOBAL CORP	856	897	6,674	1,033,987	資本財
CATALENT INC	191	200	1,180	182,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	539	541	20,708	3,207,897	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	111	116	2,388	369,927	金融サービス
CBRE GROUP INC	323	339	4,489	695,505	不動産管理・開発
CDW CORP/DE	141	148	2,590	401,330	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	109	120	872	135,209	素材
CELSIUS HOLDINGS INC	158	167	458	70,971	食品・飲料・タバコ
CENCORA, INC.	180	198	4,790	742,049	ヘルスケア機器・サービス
CENTENE CORP	566	591	3,416	529,314	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	668	708	2,225	344,704	公益事業
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	202	202	1,773	274,660	素材
CHARLES RIVER LABORATORIES	54	57	1,061	164,468	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHARLES SCHWAB CORP	1,595	1,673	13,417	2,078,574	金融サービス
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	101	103	3,989	618,034	メディア・娯楽
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	99	98	1,714	265,543	ソフトウェア・サービス
CHENIERE ENERGY INC	252	253	5,573	863,340	エネルギー
CHEVRON CORP	1,894	1,939	30,949	4,794,432	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	29	1,521	8,933	1,383,939	消費者サービス
CHORD ENERGY CORP	－	69	883	136,824	エネルギー
CHUBB LTD	432	427	12,126	1,878,538	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	261	270	3,004	465,477	家庭用品・パーソナル用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	166	173	2,610	404,385	保険
CINTAS CORP	96	404	8,816	1,365,756	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	4,306	4,462	25,442	3,941,347	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CITIGROUP INC	2,016	2,112	14,492	2,244,991	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	494	503	2,320	359,426	銀行
CLEVELAND-CLIFFS INC	535	－	－	－	素材
CLOROX CO	131	137	2,314	358,531	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	313	333	3,213	497,841	ソフトウェア・サービス
CME GROUP INC	381	398	9,162	1,419,436	金融サービス
CMS ENERGY CORP	308	330	2,266	351,158	公益事業
CNH INDUSTRIAL NV	1,060	975	1,080	167,350	資本財
COCA-COLA CO	4,352	4,533	28,372	4,395,181	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	218	228	1,736	268,946	食品・飲料・タバコ

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	531	550	4,201	650,864	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	183	210	6,828	1,057,873	金融サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	828	863	8,081	1,251,925	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	4,255	4,335	18,347	2,842,210	メディア・娯楽
CONAGRA BRANDS INC	507	530	1,404	217,538	食品・飲料・タバコ
CONFLUENT INC-CLASS A	199	－	－	－	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	1,258	1,289	14,581	2,258,835	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	365	382	3,713	575,268	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	174	181	4,366	676,397	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION ENERGY	338	349	8,189	1,268,623	公益事業
COOPER COS INC/THE	209	220	2,183	338,254	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	915	959	5,420	839,715	商業・専門サービス
COREBRIDGE FINANCIAL INC	264	303	922	142,869	金融サービス
CORNING INC	859	901	4,263	660,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	747	771	4,495	696,468	素材
COSTAR GROUP INC	432	452	3,262	505,372	不動産管理・開発
COSTCO WHOLESALE CORP	470	491	45,671	7,074,940	生活必需品流通・小売り
COTERRA ENERGY INC	796	824	2,168	335,947	エネルギー
CRH PLC	－	760	7,593	1,176,234	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	241	255	9,034	1,399,563	ソフトウェア・サービス
CROWN HOLDINGS INC	127	133	1,197	185,478	素材
CSX CORP	2,093	2,164	7,489	1,160,259	運輸
CUMMINS INC	150	151	5,482	849,356	資本財
CVS HEALTH CORP	1,363	1,390	7,755	1,201,471	ヘルスケア機器・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	44	47	1,503	232,955	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	743	738	17,043	2,640,225	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DARDEN RESTAURANTS INC	126	132	2,128	329,705	消費者サービス
DARLING INTERNATIONAL INC	169	－	－	－	食品・飲料・タバコ
DATADOG INC - CLASS A	289	307	4,102	635,475	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	57	58	913	141,553	ヘルスケア機器・サービス
DAYFORCE, INC.	157	174	1,307	202,587	商業・専門サービス
DECKERS OUTDOOR CORP	27	168	2,976	461,086	耐久消費財・アパレル
DEERE & CO	281	289	11,601	1,797,112	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	254	311	4,235	656,157	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	169	178	1,153	178,671	運輸
DEVON ENERGY CORPORATION	678	694	2,632	407,860	エネルギー
DEXCOM INC	409	440	3,299	511,139	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	179	197	3,553	550,514	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	61	64	1,280	198,291	一般消費財・サービス流通・小売り

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	264	277	4,787	741,614	金融サービス
DOCUSIGN INC	216	226	1,803	279,369	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	232	243	1,863	288,728	生活必需品流通・小売り
DOLLAR TREE INC	219	226	1,467	227,308	生活必需品流通・小売り
DOMINION ENERGY INC	886	928	5,349	828,642	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	36	38	1,699	263,320	消費者サービス
DOORDASH INC - A	275	338	5,959	923,153	消費者サービス
DOVER CORP	148	152	3,022	468,274	資本財
DOW INC	743	779	3,403	527,178	素材
DR HORTON INC	317	328	5,326	825,182	耐久消費財・アパレル
DRAFTKINGS INC	444	483	2,087	323,370	消費者サービス
DROPBOX INC-CLASS A	270	－	－	－	ソフトウェア・サービス
DTE ENERGY COMPANY	218	229	2,788	431,953	公益事業
DUKE ENERGY CORP	816	854	9,708	1,503,940	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	455	462	3,766	583,477	素材
DYNATRACE INC	290	313	1,618	250,710	ソフトウェア・サービス
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	125	130	1,318	204,281	素材
EATON CORP PLC	423	442	16,103	2,494,644	資本財
EBAY INC	549	555	3,396	526,093	一般消費財・サービス流通・小売り
ECOLAB INC	271	284	6,954	1,077,319	素材
EDISON INTERNATIONAL	406	425	3,647	564,993	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	642	667	4,686	725,928	ヘルスケア機器・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	270	279	4,643	719,375	メディア・娯楽
ELEVANCE HEALTH, INC	248	257	10,147	1,571,948	ヘルスケア機器・サービス
ELI LILLY & CO	855	894	65,292	10,114,475	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMCOR GROUP INC	－	52	2,673	414,123	資本財
EMERSON ELECTRIC CO	604	633	8,209	1,271,764	資本財
ENPHASE ENERGY INC	144	150	925	143,301	半導体・半導体製造装置
ENTEGRIS INC	159	167	1,661	257,363	半導体・半導体製造装置
ENTERGY CORP	224	236	3,544	549,024	公益事業
EOG RESOURCES INC	617	636	8,600	1,332,333	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	61	64	1,462	226,494	ソフトウェア・サービス
EQT CORP	413	625	2,758	427,371	エネルギー
EQUIFAX INC	130	136	3,354	519,601	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	357	359	1,675	259,566	金融サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	26	28	1,171	181,537	保険

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ESSENTIAL UTILITIES INC	275	288	1,122	173,874	公益事業
ESTEE LAUDER COS INC	246	258	1,673	259,265	家庭用品・パーソナル用品
ETSY INC	126	－	－	－	一般消費財・サービス流通・小売り
EVEREST GROUP LTD	45	48	1,781	275,906	保険
EVERGY INC	243	254	1,630	252,575	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	370	390	2,408	373,027	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	191	204	1,102	170,838	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	1,054	1,107	4,330	670,889	公益事業
EXPAND ENERGY CORPORATION	117	123	1,180	182,795	エネルギー
EXPEDIA GROUP INC	141	140	2,487	385,395	消費者サービス
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	153	156	1,845	285,852	運輸
EXXON MOBIL CORP	4,810	4,968	58,939	9,130,378	エネルギー
F5 INC	63	64	1,554	240,881	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	40	42	2,029	314,328	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	26	27	6,250	968,218	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	605	634	5,175	801,787	資本財
FEDEX CORP	251	257	7,532	1,166,817	運輸
FERGUSON ENTERPRISES INC	－	223	4,514	699,391	資本財
FERGUSON PLC	215	－	－	－	資本財
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	274	287	1,752	271,415	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	628	616	5,303	821,534	金融サービス
FIFTH THIRD BANCORP	721	757	3,516	544,788	銀行
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	10	11	2,492	386,148	銀行
FIRST SOLAR INC	107	112	2,110	326,925	半導体・半導体製造装置
FIRSTENERGY CORP	577	605	2,518	390,147	公益事業
FISERV INC	635	647	13,938	2,159,244	金融サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	76	73	2,721	421,612	金融サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	－	196	5,184	803,059	消費者サービス
FMC CORP	132	－	－	－	素材
FORD MOTOR CO	4,167	4,343	4,799	743,530	自動車・自動車部品
FORTINET INC	691	719	6,529	1,011,446	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	372	389	2,903	449,837	資本財
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	133	138	1,018	157,780	資本財
FOX CORP - CLASS A	259	254	1,165	180,569	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	152	157	681	105,512	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	315	321	690	107,021	金融サービス
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,519	1,590	7,015	1,086,753	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	58	61	536	83,109	金融サービス
GARMIN LTD	162	170	3,529	546,745	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	82	85	4,449	689,252	ソフトウェア・サービス
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	434	480	3,962	613,796	ヘルスケア機器・サービス
GE VERNOVA INC	288	303	10,322	1,599,042	資本財
GEN DIGITAL INC	610	624	1,825	282,713	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	245	258	7,258	1,124,386	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,153	1,212	21,525	3,334,447	資本財
GENERAL MILLS INC	602	618	3,882	601,467	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	1,450	1,262	6,958	1,077,935	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	148	154	1,872	290,087	一般消費財・サービス流通・小売り
GILEAD SCIENCES INC	1,320	1,380	12,110	1,876,086	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	275	282	3,243	502,518	金融サービス
GLOBAL-E ONLINE LTD	104	111	474	73,498	一般消費財・サービス流通・小売り
GLOBE LIFE INC	99	－	－	－	保険
GODADDY INC - CLASS A	141	155	2,922	452,782	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	345	357	20,760	3,216,008	金融サービス
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	2,015	2,339	1,277	197,879	運輸
GRACO INC	178	187	1,646	255,094	資本財
HALLIBURTON CO	948	980	2,987	462,778	エネルギー
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	318	327	3,826	592,807	保険
HASBRO INC	139	－	－	－	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	212	217	7,289	1,129,187	ヘルスケア機器・サービス
HEICO CORP	46	48	1,319	204,351	資本財
HEICO CORP-CLASS A	79	83	1,778	275,481	資本財
HENRY SCHEIN INC	137	141	1,061	164,430	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	158	163	2,784	431,391	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	292	306	4,488	695,318	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,376	1,439	3,098	479,997	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HF SINCLAIR CORP	168	179	758	117,488	エネルギー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	271	276	6,912	1,070,870	消費者サービス
HOLOGIC INC	254	258	2,029	314,384	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	1,054	1,098	44,679	6,921,325	一般消費財・サービス流通・小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	698	721	16,460	2,549,864	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,172	1,228	569	88,266	不動産管理・開発
HORMEL FOODS CORP	319	334	995	154,214	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	414	429	4,979	771,361	資本財
HP INC	997	1,083	3,995	618,935	テクノロジー・ハードウェアおよび機器



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HUBBELL INC	56	59	2,689	416,675	資本財
HUBSPOT INC	50	53	3,660	567,033	ソフトウェア・サービス
HUMANA INC	130	133	3,708	574,462	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,535	1,605	2,816	436,274	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	42	43	837	129,711	資本財
HYATT HOTELS CORP - CL A	46	49	764	118,360	消費者サービス
IDEX CORP	80	83	1,877	290,867	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	88	91	3,807	589,808	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	318	330	8,807	1,364,421	資本財
ILLUMINA INC	168	176	2,383	369,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	201	180	1,273	197,272	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	429	446	4,573	708,452	資本財
INSULET CORP	74	77	2,032	314,898	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	4,467	4,715	11,411	1,767,760	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	606	635	10,031	1,553,988	金融サービス
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	967	1,017	21,391	3,313,719	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	270	282	2,516	389,809	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	348	365	2,114	327,505	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	406	418	1,156	179,173	メディア・娯楽
INTUIT INC	296	309	19,944	3,089,547	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	373	392	21,165	3,278,813	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	193	201	3,860	597,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JABIL CIRCUIT INC	135	125	1,601	248,071	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	77	80	1,387	214,904	金融サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	133	138	1,851	286,819	商業・専門サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	168	177	763	118,313	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	63	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	87	91	1,647	255,140	運輸
JM SMUCKER CO	112	117	1,319	204,477	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	2,550	2,665	40,785	6,318,155	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	721	746	6,232	965,451	資本財
JPMORGAN CHASE & CO	3,063	3,180	77,312	11,976,492	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	339	360	1,264	195,931	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KELLANOVA	290	303	2,441	378,270	食品・飲料・タバコ
KENVUE INC	1,827	2,121	5,026	778,632	家庭用品・パーソナル用品
KEURIG DR PEPPER INC	1,111	1,201	3,786	586,571	食品・飲料・タバコ

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
KEYCORP	992	1,044	1,985	307,517	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	185	193	2,940	455,539	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	358	373	5,059	783,784	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	2,119	2,212	6,212	962,396	エネルギー
KKR & CO INC -A	609	687	10,508	1,627,944	金融サービス
KLA CORPORATION	144	149	9,180	1,422,090	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	170	179	1,011	156,710	運輸
KRAFT HEINZ CO/THE	909	1,009	3,086	478,101	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	723	759	4,411	683,453	生活必需品流通・小売り
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	200	210	5,119	793,071	資本財
LABCORP HOLDINGS INC	－	93	2,205	341,681	ヘルスケア機器・サービス
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	89	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	139	1,448	10,160	1,573,981	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	152	160	1,202	186,251	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	399	412	2,029	314,399	消費者サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	146	－	－	－	半導体・半導体製造装置
LEAR CORP	61	－	－	－	自動車・自動車部品
LEIDOS HOLDINGS INC	138	142	2,251	348,733	商業・専門サービス
LENNAR CORP-CL A	264	267	4,516	699,587	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	33	35	2,212	342,737	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	126	－	－	－	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL LTD-C	201	－	－	－	電気通信サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	173	－	－	－	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA GROUP-C	209	230	1,871	289,930	メディア・娯楽
LINDE PLC	513	532	23,641	3,662,275	素材
LIVE NATION INC	170	178	2,394	370,996	メディア・娯楽
LKQ CORP	283	295	1,112	172,315	一般消費財・サービス流通・小売り
LOCKHEED MARTIN CORP	236	239	12,757	1,976,214	資本財
LOEWS CORP	200	207	1,746	270,615	保険
LOWE'S COS INC	609	631	16,362	2,534,742	一般消費財・サービス流通・小売り
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	80	82	2,602	403,189	金融サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	121	126	3,808	590,012	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	274	288	2,373	367,606	素材
M&T BANK CORP	175	184	3,950	611,894	銀行
MANHATTAN ASSOCIATES INC	65	68	1,845	285,823	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MARATHON OIL CORP	617	622	1,790	277,391	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	401	389	6,192	959,216	エネルギー
MARKEL GROUP INC	13	14	2,401	372,083	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	40	42	1,125	174,284	金融サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	264	268	7,506	1,162,788	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	522	546	12,064	1,868,970	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	65	68	3,976	615,975	素材
MARVELL TECHNOLOGY INC	916	958	8,565	1,326,946	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	237	243	1,856	287,612	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	887	919	47,767	7,399,657	金融サービス
MATCH GROUP INC	287	279	847	131,241	メディア・娯楽
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	266	279	2,102	325,768	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	768	798	23,208	3,595,302	消費者サービス
MCKESSON CORP	140	143	8,843	1,369,899	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	1,408	1,420	12,074	1,870,435	ヘルスケア機器・サービス
MERCADOLIBRE INC	48	50	9,686	1,500,464	一般消費財・サービス流通・小売り
MERCK & CO INC	2,685	2,805	27,084	4,195,673	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
META PLATFORMS INC-A	2,351	2,427	136,184	21,096,412	メディア・娯楽
METLIFE INC	666	669	5,531	856,833	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	22	23	2,744	425,225	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	289	259	968	150,099	消費者サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	573	594	3,855	597,204	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	1,169	1,228	12,002	1,859,233	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	7,481	7,820	326,718	50,612,022	ソフトウェア・サービス
MICROSTRATEGY INC-CL A	－	174	7,521	1,165,094	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	343	360	1,346	208,529	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOLINA HEALTHCARE INC	61	64	1,833	284,059	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	200	205	1,251	193,927	食品・飲料・タバコ
MONDAY.COM LTD	30	41	1,062	164,595	ソフトウェア・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,442	1,485	9,489	1,469,986	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	76	81	2,349	363,981	ソフトウェア・サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	50	53	3,158	489,271	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	827	818	4,398	681,354	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	174	181	8,530	1,321,515	金融サービス
MORGAN STANLEY	1,304	1,349	17,851	2,765,351	金融サービス
MOSAIC CO/THE	346	355	903	139,910	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	175	184	9,004	1,394,941	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	83	87	5,239	811,607	金融サービス
NASDAQ INC	366	478	3,839	594,740	金融サービス
NETAPP INC	218	227	2,784	431,376	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	463	477	41,582	6,441,603	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	104	111	1,328	205,785	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWMONT CORP	1,220	1,276	5,512	853,993	素材
NEWS CORP - CLASS A	403	419	1,207	187,022	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	2,174	2,275	17,539	2,717,040	公益事業
NIKE INC	1,289	1,342	9,918	1,536,532	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	473	496	1,841	285,228	公益事業
NORDSON CORP	57	60	1,506	233,357	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	239	250	6,498	1,006,757	運輸
NORTHERN TRUST CORP	219	226	2,442	378,412	金融サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	151	155	7,648	1,184,771	資本財
NRG ENERGY INC	239	230	2,189	339,213	公益事業
NUCOR CORP	260	265	3,842	595,183	素材
NVIDIA CORP	2,617	27,246	400,544	62,048,412	半導体・半導体製造装置
NVR INC	3	3	3,098	479,984	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	273	283	6,226	964,552	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	697	735	3,716	575,746	エネルギー
OKTA INC	167	178	1,328	205,788	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	208	216	4,585	710,400	運輸
OMNICOM GROUP	209	216	2,125	329,292	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	456	476	3,175	491,881	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	617	646	7,310	1,132,508	エネルギー
ORACLE CORP	1,747	1,833	34,630	5,364,635	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	62	65	7,831	1,213,169	一般消費財・サービス流通・小売り
OTIS WORLDWIDE CORP	433	447	4,491	695,706	資本財
OVINTIV INC	273	294	1,313	203,545	エネルギー
OWENS CORNING	94	95	1,859	288,036	資本財
PACCAR INC	554	580	6,410	992,988	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	94	99	2,369	367,061	素材
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,973	2,242	14,126	2,188,274	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	334	358	13,916	2,155,761	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PARAMOUNT GLOBAL	518	660	681	105,616	メディア・娯楽
PARKER HANNIFIN CORP	136	142	9,818	1,521,020	資本財
PAYCHEX INC	343	359	5,051	782,509	商業・専門サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	57	56	1,223	189,521	商業・専門サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	47	－	－	－	商業・専門サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	1,085	1,100	9,256	1,433,852	金融サービス
PENTAIR PLC	175	183	1,924	298,151	資本財
PEPSICO INC	1,457	1,521	23,844	3,693,699	食品・飲料・タバコ
PFIZER INC	5,984	6,277	15,757	2,440,948	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	2,146	2,246	4,718	730,872	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,645	1,721	22,305	3,455,383	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	465	469	6,146	952,106	エネルギー
PINTEREST INC- CLASS A	621	663	1,971	305,341	メディア・娯楽
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	422	440	9,031	1,399,031	銀行
POOL CORP	41	42	1,540	238,684	一般消費財・サービス流通・小売り
PPG INDUSTRIES INC	249	259	3,145	487,218	素材
PPL CORPORATION	780	816	2,786	431,731	公益事業
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	252	259	2,184	338,448	保険
PROCTER & GAMBLE CO	2,497	2,614	44,641	6,915,432	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	619	648	16,510	2,557,652	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	382	397	4,952	767,153	保険
PTC INC	126	132	2,507	388,428	ソフトウェア・サービス
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	527	551	4,966	769,399	公益事業
PULTE GROUP INC	228	232	2,990	463,306	耐久消費財・アパレル
PURE STORAGE INC - CLASS A	－	342	1,707	264,536	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QORVO INC	103	105	697	107,992	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,184	1,236	20,359	3,153,860	半導体・半導体製造装置
QUANTA SERVICES INC	153	162	5,362	830,721	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	119	123	1,983	307,272	ヘルスケア機器・サービス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	211	218	3,545	549,173	金融サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	113	120	8,936	1,384,382	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	985	1,014	2,663	412,566	銀行
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	60	63	1,964	304,321	素材
REPLIGEN CORP	56	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REPUBLIC SERVICES INC	233	244	5,149	797,721	商業・専門サービス
RESMED INC	155	162	3,874	600,191	ヘルスケア機器・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
REVVITY INC	130	136	1,502	232,696	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	705	821	835	129,360	自動車・自動車部品
ROBERT HALF INC	112	－	－	－	商業・専門サービス
ROBINHOOD MARKETS INC - A	430	585	2,062	319,456	金融サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	456	524	2,737	424,095	メディア・娯楽
ROCKWELL AUTOMATION INC	121	126	3,512	544,055	資本財
ROKU INC	132	140	1,035	160,473	メディア・娯楽
ROLLINS INC	307	321	1,593	246,914	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	113	118	6,495	1,006,220	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	356	369	5,144	797,005	一般消費財・サービス流通・小売り
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	257	270	6,352	984,068	消費者サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	402	426	1,108	171,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RPM INTERNATIONAL INC	136	142	1,924	298,110	素材
RTX CORPORATION	1,523	1,472	17,519	2,713,886	資本財
S&P GLOBAL INC	343	354	17,808	2,758,776	金融サービス
SALESFORCE INC	1,025	1,073	34,711	5,377,155	ソフトウェア・サービス
SAMSARA INC-CL A	182	229	1,199	185,889	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,513	1,583	6,823	1,057,062	エネルギー
SEA LTD-ADR	390	409	4,660	721,999	メディア・娯楽
SEAGATE TECHNOLOGY	210	220	2,160	334,667	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEI INVESTMENTS COMPANY	118	123	979	151,722	金融サービス
SEMPRA	666	700	6,543	1,013,713	公益事業
SERVICENOW INC	217	227	23,205	3,594,804	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	257	266	9,963	1,543,385	素材
SIRIUS XM HOLDINGS INC	814	－	－	－	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	169	177	1,485	230,071	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	130	133	955	148,055	資本財
SMURFIT WESTROCK PLC	－	575	3,057	473,587	素材
SNAP INC - A	1,106	1,152	1,211	187,669	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	55	58	2,070	320,814	資本財
SNOWFLAKE INC-CLASS A	296	333	4,347	673,457	ソフトウェア・サービス
SOLVENTUM CORP	146	162	1,089	168,763	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHERN CO	1,155	1,210	10,691	1,656,175	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	158	166	539	83,509	運輸
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	235	246	1,794	278,009	商業・専門サービス

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
STANLEY BLACK & DECKER INC	162	170	1,471	228,016	資本財
STARBUCKS CORP	1,199	1,254	12,340	1,911,722	消費者サービス
STATE STREET CORP	326	331	3,137	485,979	金融サービス
STEEL DYNAMICS INC	162	165	2,317	359,063	素材
STERIS PLC	104	109	2,321	359,575	ヘルスケア機器・サービス
STRYKER CORP	362	379	14,758	2,286,310	ヘルスケア機器・サービス
SUPER MICRO COMPUTER INC	53	583	1,649	255,576	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SYNCHRONY FINANCIAL	438	437	2,783	431,168	金融サービス
SYNOPSYS INC	161	169	9,060	1,403,595	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	534	551	4,104	635,862	生活必需品流通・小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	236	247	2,917	451,948	金融サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	180	184	3,426	530,739	メディア・娯楽
TARGA RESOURCES CORP	224	232	4,742	734,734	エネルギー
TARGET CORP	489	512	7,994	1,238,360	生活必需品流通・小売り
TE CONNECTIVITY PLC	327	338	4,970	769,970	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	50	52	2,443	378,459	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	49	52	1,006	155,972	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	162	172	1,777	275,322	半導体・半導体製造装置
TESLA, INC.	3,031	3,179	109,994	17,039,291	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	1,187	1,239	2,084	322,871	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	962	1,008	20,277	3,141,250	半導体・半導体製造装置
TEXAS PACIFIC LAND CORP	19	21	3,073	476,063	エネルギー
TEXTRON INC	207	210	1,714	265,621	資本財
THE CIGNA GROUP	310	314	10,146	1,571,843	ヘルスケア機器・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	409	422	21,524	3,334,293	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TJX COS INC	1,207	1,251	14,964	2,318,167	一般消費財・サービス流通・小売り
T-MOBILE US INC	554	587	13,705	2,123,139	電気通信サービス
TOAST INC-CLASS A	360	401	1,706	264,367	金融サービス
TORO CO	110	115	930	144,203	資本財
TRACTOR SUPPLY COMPANY	114	119	3,258	504,797	一般消費財・サービス流通・小売り
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	473	493	5,888	912,184	メディア・娯楽
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	115	128	1,729	267,925	金融サービス
TRANE TECHNOLOGIES PLC	241	250	10,353	1,603,848	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	58	61	7,750	1,200,566	資本財
TRANSUNION	205	215	2,086	323,258	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	241	253	6,575	1,018,627	保険
TRIMBLE INC	263	270	1,884	291,896	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TRUIST FINANCIAL CORP	1,413	1,482	6,912	1,070,848	銀行
TWILIO INC - A	182	180	1,736	268,958	ソフトウェア・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	44	47	2,819	436,799	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	303	317	1,995	309,104	食品・飲料・タバコ
UBER TECHNOLOGIES INC	1,962	2,082	14,398	2,230,509	運輸
U-HAUL HOLDING CO	102	107	646	100,211	運輸
UIPATH INC - CLASS A	410	－	－	－	ソフトウェア・サービス
ULTA BEAUTY INC	51	52	1,808	280,187	一般消費財・サービス流通・小売り
UNION PACIFIC CORP	645	675	15,764	2,442,089	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	766	808	10,763	1,667,372	運輸
UNITED RENTALS INC	71	73	6,054	937,889	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	49	46	1,683	260,780	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	980	1,019	58,820	9,111,888	ヘルスケア機器・サービス
UNITY SOFTWARE INC	261	－	－	－	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	64	66	1,299	201,351	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,651	1,728	8,711	1,349,481	銀行
VAIL RESORTS INC	40	－	－	－	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	360	361	5,139	796,223	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	162	170	3,570	553,064	ヘルスケア機器・サービス
VERALTO CORP	247	273	2,841	440,219	商業・専門サービス
VERISIGN INC	97	99	1,769	274,166	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	153	157	4,449	689,204	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	4,461	4,668	19,576	3,032,639	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	273	285	12,804	1,983,556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERTIV HOLDINGS CO	383	393	5,551	859,915	資本財
VIATRIS INC	1,270	1,319	1,721	266,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC-CLASS A SHARES	1,677	1,743	54,371	8,422,763	金融サービス
VISTRA CORP	359	384	5,957	922,894	公益事業
VULCAN MATERIALS CO	140	146	4,070	630,623	素材
WABTEC CORP	189	195	3,829	593,188	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	777	815	676	104,771	生活必需品流通・小売り
WALMART INC	4,707	4,899	42,430	6,572,954	生活必需品流通・小売り
WALT DISNEY CO	1,942	2,019	22,701	3,516,642	メディア・娯楽
WARNER BROS DISCOVERY INC	2,456	2,580	2,451	379,749	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	272	285	5,358	830,007	商業・専門サービス



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC		426	444	9,732	1,507,610	商業・専門サービス
WATERS CORP		62	65	2,264	350,778	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WATSCO INC		35	38	2,052	317,883	資本財
WEC ENERGY GROUP INC		334	349	3,466	537,003	公益事業
WELLS FARGO & CO		3,848	3,861	28,352	4,392,108	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES		78	80	2,454	380,162	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTERN DIGITAL CORP		343	361	2,360	365,704	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTLAKE CHEMICAL CORP		40	42	542	83,973	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED		272	－	－	－	素材
WEYERHAEUSER CO		773	807	2,477	383,818	エクイティ不動産投資信託（REIT）
WILLIAMS COS INC		1,288	1,349	7,908	1,225,120	エネルギー
WILLIAMS-SONOMA INC		64	142	1,954	302,761	一般消費財・サービス流通・小売り
WILLIS TOWERS WATSON PLC		109	113	3,482	539,479	保険
WIX.COM LTD		57	58	1,076	166,699	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		221	234	6,102	945,371	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP		218	339	2,046	316,961	保険
WW GRAINGER INC		47	48	5,732	888,036	資本財
WYNN RESORTS LTD		107	111	1,018	157,795	消費者サービス
XCEL ENERGY INC		584	615	4,283	663,513	公益事業
XYLEM INC		255	268	3,282	508,546	資本財
YUM! BRANDS INC		297	312	4,123	638,739	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A		54	56	2,177	337,358	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC - C W/I		163	174	1,310	203,029	不動産管理・開発
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		221	227	2,526	391,422	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC		486	505	8,872	1,374,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A		259	277	2,157	334,240	ソフトウェア・サービス
ZSCALER INC		94	100	2,052	317,998	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	362,061	408,434	5,639,180	873,565,519	
	銘柄数<比率>	591	573	－	<74.3%>	
(カナダ)				千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD		526	552	6,363	706,214	素材
AIR CANADA		188	197	461	51,201	運輸
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC		815	848	6,586	730,948	生活必需品流通・小売り

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
ALTAGAS LTD	315	332	1,151	127,796	公益事業
ARC RESOURCES LTD	636	665	1,701	188,884	エネルギー
BANK OF MONTREAL	765	809	10,635	1,180,288	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	1,290	1,365	10,704	1,187,943	銀行
BARRICK GOLD CORP	1,861	1,945	4,817	534,663	素材
BCE INC	94	99	378	42,039	電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	373	395	3,074	341,256	金融サービス
BROOKFIELD CORPORATION-A	1,474	1,508	11,964	1,327,807	金融サービス
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	145	150	647	71,875	公益事業
BRP INC/CA- SUB VOTING	37	39	269	29,944	耐久消費財・アパレル
CAE INC	339	355	1,114	123,650	資本財
CAMECO CORP	460	481	3,865	429,044	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	989	1,047	9,409	1,044,211	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	579	596	8,892	986,853	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,135	2,359	11,098	1,231,667	エネルギー
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	988	1,034	10,659	1,182,956	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	56	58	890	98,808	一般消費財・サービス流通・小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	145	153	544	60,407	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B	159	167	1,276	141,650	素材
CENOVUS ENERGY INC	1,492	1,546	3,466	384,750	エネルギー
CGI INC	219	226	3,473	385,536	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC	21	22	9,901	1,098,854	ソフトウェア・サービス
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	91	95	1,512	167,872	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC	299	315	4,687	520,175	一般消費財・サービス流通・小売り
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	415	450	1,298	144,087	商業・専門サービス
EMERA INC	305	323	1,681	186,616	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	152	153	621	68,956	生活必需品流通・小売り
ENBRIDGE INC	2,259	2,416	14,488	1,607,937	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	22	22	4,416	490,144	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	626	786	1,445	160,394	素材
FIRSTSERVICE CORP	43	45	1,177	130,727	不動産管理・開発
FORTIS INC	521	550	3,440	381,798	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	204	213	3,616	401,371	素材
GEORGE WESTON LTD	65	66	1,434	159,224	生活必需品流通・小売り
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	247	243	1,548	171,800	商業・専門サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	163	165	1,133	125,789	耐久消費財・アパレル

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
GREAT-WEST LIFECO INC	298	313	1,552	172,254	保険
HYDRO ONE LTD	353	368	1,660	184,238	公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	106	106	1,410	156,565	保険
IGM FINANCIAL INC	93	95	443	49,263	金融サービス
IMPERIAL OIL LTD	199	208	2,209	245,195	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	189	198	5,338	592,420	保険
IVANHOE MINES LTD-CL A	674	746	1,394	154,788	素材
KEYERA CORP	246	256	1,158	128,518	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	1,300	1,360	1,896	210,477	素材
LOBLAW COS LTD	166	170	2,983	331,087	生活必需品流通・小売り
LUNDIN MINING CORP	700	734	1,045	116,062	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	289	304	1,817	201,650	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,919	1,979	9,009	999,871	保険
MEG ENERGY CORP	292	300	762	84,633	エネルギー
METRO INC	243	239	2,062	228,850	生活必需品流通・小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	360	376	5,105	566,608	銀行
NORTHLAND POWER INC	273	－	－	－	公益事業
NUTRIEN LTD	525	549	3,496	388,023	素材
ONEX CORPORATION	70	72	808	89,764	金融サービス
OPEN TEXT CORP	289	298	1,190	132,072	ソフトウェア・サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	387	401	1,276	141,614	素材
PARKLAND CORP	149	156	538	59,798	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	586	645	3,822	424,241	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	606	628	2,901	321,970	保険
QUEBECOR INC -CL B	172	182	580	64,460	電気通信サービス
RB GLOBAL INC	193	203	2,665	295,842	商業・専門サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	315	333	3,239	359,531	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	381	401	2,007	222,791	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,492	1,568	26,931	2,988,853	銀行
SAPUTO INC	272	284	742	82,385	食品・飲料・タバコ
SHOPIFY INC - CLASS A	1,277	1,339	19,559	2,170,756	ソフトウェア・サービス
STANTEC INC	121	127	1,476	163,818	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	622	643	5,424	602,050	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,369	1,415	8,096	898,508	エネルギー
TC ENERGY CORP	1,101	1,151	8,013	889,342	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	488	510	3,357	372,627	素材
TFI INTERNATIONAL INC	85	89	1,777	197,231	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円		
THOMSON REUTERS CORP		168	174	3,925	435,674	商業・専門サービス	
TMX GROUP LTD		297	309	1,345	149,355	金融サービス	
TOROMONT INDUSTRIES LTD		88	92	1,067	118,437	資本財	
TORONTO-DOMINION BANK		1,882	1,938	15,113	1,677,317	銀行	
TOURMALINE OIL CORP		354	371	2,327	258,320	エネルギー	
WEST FRASER TIMBER CO LTD		59	61	796	88,343	素材	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		480	502	4,389	487,165	素材	
WSP GLOBAL INC		133	138	3,323	368,887	資本財	
小計	株数・金額	42,218	45,163	335,896	37,277,832		
	銘柄数<比率>	84	83	－	<3.2%>		
(オーストラリア)				千オーストラリアドル			
AMPOL LTD		251	263	771	78,173	エネルギー	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD		3,186	3,332	10,778	1,091,878	銀行	
APA GROUP		1,362	1,427	1,021	103,507	公益事業	
ARISTOCRAT LEISURE LTD		613	628	4,334	439,045	消費者サービス	
ASX LTD		205	214	1,438	145,713	金融サービス	
AURIZON HOLDINGS LTD		1,946	－	－	－	運輸	
BHP GROUP LIMITED		5,370	5,616	22,640	2,293,471	素材	
BLUESCOPE STEEL LTD		471	486	1,026	104,018	素材	
BRAMBLES LTD		1,472	1,542	3,023	306,270	商業・専門サービス	
CARSALES.COM LTD		379	396	1,661	168,259	メディア・娯楽	
COCHLEAR LTD		69	72	2,183	221,173	ヘルスケア機器・サービス	
COLES GROUP LTD		1,417	1,482	2,719	275,456	生活必需品流通・小売り	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		1,774	1,853	28,838	2,921,300	銀行	
COMPUTERSHARE LIMITED		570	589	1,820	184,448	商業・専門サービス	
CSL LIMITED		511	535	14,524	1,471,363	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA		1,518	1,687	740	75,047	生活必需品流通・小売り	
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,794	1,876	3,331	337,444	素材	
IDP EDUCATION LTD		280	－	－	－	消費者サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		2,541	2,621	2,160	218,854	保険	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		466	477	2,670	270,480	素材	
LOTTERY CORP LTD/THE		2,356	2,461	1,252	126,907	消費者サービス	
MACQUARIE GROUP LTD		387	401	9,284	940,521	金融サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD		2,912	3,051	1,159	117,469	保険	
MINERAL RESOURCES LTD		186	195	682	69,123	素材	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		3,305	3,425	13,543	1,371,970	銀行	

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等	
			株数	株数		評価額
				外貨建金額		邦貨換算金額
(オーストラリア)		百株	百株	千円		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		1,213	1,269	2,145	217,322	素材
ORICA LTD		509	538	986	99,974	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED		1,823	1,907	2,043	206,994	公益事業
PILBARA MINERALS LTD		3,029	3,167	927	94,005	素材
PRO MEDICUS LTD		－	63	1,350	136,792	ヘルスケア機器・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		889	877	787	79,737	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD		1,581	1,663	3,256	329,911	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED		194	203	787	79,744	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD		55	58	1,455	147,421	メディア・娯楽
REECE LTD		239	249	620	62,894	資本財
RIO TINTO LTD		392	410	4,753	481,568	素材
SANTOS LTD		3,438	3,597	2,460	249,283	エネルギー
SEEK LTD		377	395	1,045	105,956	メディア・娯楽
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD		173	－	－	－	資本財
SGH LTD		－	225	1,074	108,854	資本財
SONIC HEALTHCARE LTD		480	506	1,416	143,481	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD		4,796	5,013	1,840	186,396	素材
SUNCORP GROUP LTD		1,345	1,407	2,777	281,379	保険
TELSTRA GROUP LTD		4,398	4,574	1,802	182,579	電気通信サービス
TRANSURBAN GROUP		3,273	3,430	4,326	438,250	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD		860	899	1,001	101,406	食品・飲料・タバコ
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		248	259	901	91,341	金融サービス
WESFARMERS LIMITED		1,202	1,256	8,943	905,970	一般消費財・サービス流通・小売り
WESTPAC BANKING CORP		3,710	3,834	12,803	1,297,021	銀行
WISETECH GLOBAL LTD		176	184	2,563	259,658	ソフトウェア・サービス
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD		2,012	2,104	5,169	523,681	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,294	1,352	4,085	413,829	生活必需品流通・小売り
XERO LTD		152	160	2,839	287,636	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	73,224 51	74,258 50	205,774 －	20,844,997 <1.8%>	
(香港)				千香港ドル		
AIA GROUP LTD		12,038	12,338	70,577	1,404,495	保険
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		3,915	4,095	10,402	207,005	銀行
CK ASSET HOLDINGS LTD		2,064	2,129	6,770	134,733	不動産管理・開発
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,839	2,969	11,965	238,112	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED		670	695	3,763	74,892	公益事業
CLP HOLDINGS LTD		1,741	1,816	12,088	240,557	公益事業
ESR GROUP LIMITED		1,804	－	－	－	不動産管理・開発

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
<b>(香港)</b>		百株	百株	千香港ドル 千円	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD		2,308	2,418	7,919 157,593	消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD		1,911	—	—	不動産管理・開発
HANG SENG BANK LTD		811	838	7,798 155,194	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		1,546	1,616	4,041 80,416	不動産管理・開発
HKT TRUST AND HKT LTD		4,140	4,330	4,122 82,030	電気通信サービス
HONG KONG & CHINA GAS		11,874	12,394	7,424 147,742	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		1,276	1,333	40,046 796,927	金融サービス
MTR CORP		1,647	1,727	4,716 93,852	運輸
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,465	1,530	7,753 154,301	公益事業
SANDS CHINA LTD		2,565	2,681	5,234 104,173	消費者サービス
SINO LAND CO		4,080	4,320	3,378 67,226	不動産管理・開発
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		1,420	1,490	3,270 65,083	運輸
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD		1,535	1,605	12,360 245,969	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD		453	458	3,006 59,829	資本財
SWIRE PROPERTIES LTD		1,244	—	—	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		1,460	1,520	15,944 317,301	資本財
WH GROUP LTD		8,785	9,210	5,839 116,198	食品・飲料・タバコ
WHARF HOLDINGS LTD		1,130	1,180	2,684 53,421	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		1,767	1,847	3,916 77,935	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	76,494 26	74,545 23	255,024 —	5,074,996 <0.4%>
<b>(シンガポール)</b>				千シンガポールドル	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI		2,759	2,599	730 84,614	不動産管理・開発
CITY DEVELOPMENTS LTD		525	—	—	不動産管理・開発
DBS GROUP HOLDINGS LTD		2,111	2,206	9,391 1,088,133	銀行
GENTING SINGAPORE LTD		6,398	6,701	515 59,781	消費者サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		104	—	—	資本財
KEPPEL CORP LTD		1,544	1,612	1,083 125,506	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		3,586	3,748	6,176 715,632	銀行
SEATRUM LTD		2,347	—	—	資本財
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		942	983	510 59,109	公益事業
SINGAPORE AIRLINES LTD		1,575	1,648	1,046 121,245	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		907	949	1,147 132,930	金融サービス
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD		1,654	1,729	791 91,747	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		8,858	8,308	2,683 310,908	電気通信サービス
UNITED OVERSEAS BANK LTD		1,339	1,400	5,100 590,909	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
WILMAR INTERNATIONAL LTD		2,034	2,132	660	76,574	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	36,684	34,015	29,838	3,457,093	
	銘柄数<比率>	15	12	－	<0.3%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		1,398	1,470	1,107	101,513	運輸
EBOS GROUP LTD		162	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		618	648	2,467	226,256	ヘルスケア機器・サービス
MERCURY NZ LTD		732	770	530	48,622	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		1,365	1,430	857	78,582	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,968	2,061	636	58,319	電気通信サービス
小計	株数・金額	6,246	6,381	5,598	513,294	
	銘柄数<比率>	6	5	－	<0.0%>	
(イギリス)				千イギリス・ポンド		
3I GROUP PLC		1,029	1,076	3,732	733,864	金融サービス
ABRDN PLC		1,960	－	－	－	金融サービス
ADMIRAL GROUP PLC		275	288	722	142,132	保険
ANGLO AMERICAN PLC		1,346	1,407	3,242	637,529	素材
ANTOFAGASTA PLC		417	435	729	143,461	素材
ASHTAD GROUP PLC		463	484	2,975	585,036	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		361	371	804	158,090	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC		1,642	1,717	17,211	3,383,782	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTO TRADER GROUP PLC-WI		960	989	794	156,129	メディア・娯楽
AVIVA PLC		2,907	2,965	1,440	283,244	保険
BAE SYSTEMS PLC		3,212	3,355	4,404	865,953	資本財
BARCLAYS PLC		16,051	16,342	4,180	821,880	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		1,033	1,527	623	122,527	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT		112	112	492	96,842	耐久消費財・アパレル
BP PLC		18,128	18,307	7,008	1,377,799	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		2,134	2,213	6,431	1,264,478	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC		6,928	7,222	1,081	212,715	電気通信サービス
BUNZL PLC		357	374	1,288	253,262	資本財
BURBERRY GROUP PLC		380	－	－	－	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC		5,708	5,794	701	137,831	公益事業
COCA-COLA HBC AG-CDI		232	241	664	130,686	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC		1,810	1,883	4,951	973,446	消費者サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
CRH PLC	734	—	—	—	素材
CRODA INTERNATIONAL PLC	140	147	517	101,664	素材
DCC PLC	104	109	621	122,158	資本財
DIAGEO PLC	2,368	2,462	5,820	1,144,281	食品・飲料・タバコ
ENDEAVOUR MINING PLC	193	202	317	62,489	素材
ENTAIN PLC	677	709	532	104,599	消費者サービス
EXPERIAN PLC	973	1,017	3,738	734,903	商業・専門サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	187	—	—	—	消費者サービス
GLENCORE PLC	10,985	11,482	4,356	856,490	素材
GSK PLC	4,359	4,590	5,984	1,176,496	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HALEON PLC	6,358	8,089	2,968	583,699	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC	402	420	1,055	207,597	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARGREAVES LANSDOWN PLC	377	393	428	84,233	金融サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	175	184	338	66,549	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	20,297	20,510	14,855	2,920,638	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	886	899	2,225	437,444	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	1,456	1,474	1,245	244,790	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	174	178	1,692	332,659	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	170	178	802	157,788	商業・専門サービス
JD SPORTS FASHION PLC	2,748	2,869	335	65,901	一般消費財・サービス流通・小売り
KINGFISHER PLC	1,989	2,036	582	114,599	一般消費財・サービス流通・小売り
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	6,345	6,613	1,439	283,062	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	67,328	69,089	3,820	751,144	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	441	529	5,681	1,117,053	金融サービス
M&G PLC	2,396	2,509	503	98,913	金融サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,409	1,455	745	146,521	資本財
MONDI PLC/WI	467	488	568	111,855	素材
NATIONAL GRID PLC	3,939	5,329	5,264	1,034,971	公益事業
NATWEST GROUP PLC	6,044	7,358	2,884	567,094	銀行
NEXT PLC	128	132	1,257	247,176	一般消費財・サービス流通・小売り
NMC HEALTH PLC	47	47	0.005	0.933	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	615	—	—	—	生活必需品流通・小売り
PEARSON PLC	661	665	798	156,943	消費者サービス
PERSIMMON PLC	338	354	453	89,166	耐久消費財・アパレル
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	806	782	394	77,540	保険
PRUDENTIAL PLC	2,913	3,037	1,897	373,080	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	756	773	3,674	722,389	家庭用品・パーソナル用品



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
RELX PLC		1,997	2,067	7,376	1,450,167	商業・専門サービス	
RENTOKIL INITIAL PLC		2,674	2,797	1,130	222,268	商業・専門サービス	
RIO TINTO PLC		1,192	1,248	6,109	1,201,105	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		8,917	9,417	4,968	976,804	資本財	
SAGE GROUP PLC		1,079	1,110	1,195	235,054	ソフトウェア・サービス	
SAINSBURY (J) PLC		1,755	1,830	454	89,402	生活必需品流通・小売り	
SCHRODERS PLC		853	896	278	54,784	金融サービス	
SEVERN TRENT PLC		285	299	804	158,126	公益事業	
SHELL PLC-NEW		6,889	6,978	17,951	3,529,249	エネルギー	
SMITH & NEPHEW PLC		925	968	956	188,065	ヘルスケア機器・サービス	
SMITHS GROUP PLC		367	381	645	126,944	資本財	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		78	81	534	105,008	資本財	
SSE PLC		1,157	1,209	2,071	407,242	公益事業	
ST JAMES'S PLACE PLC		583	－	－	－	金融サービス	
STANDARD CHARTERED PLC		2,398	2,400	2,273	446,987	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC		3,747	3,925	510	100,321	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC		7,469	7,664	2,666	524,235	生活必需品流通・小売り	
UNILEVER PLC		2,649	2,763	12,591	2,475,415	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC		721	755	828	162,825	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC		24,812	25,329	1,790	352,070	電気通信サービス	
WHITBREAD PLC		197	199	575	113,054	消費者サービス	
WISE PLC - A		651	737	617	121,343	金融サービス	
WPP PLC		1,139	1,194	974	191,592	メディア・娯楽	
小計	株数・金額	290,402	298,493	208,589	41,008,667		
	銘柄数<比率>	82	76	－	<3.5%>		
(イスラエル)				千イスラエル・シケル			
AZRIELI GROUP		45	47	1,362	56,404	不動産管理・開発	
BANK HAPOLALIM BM		1,345	1,407	5,892	243,871	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL		1,613	1,680	6,821	282,310	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD		28	29	2,743	113,561	資本財	
ICL GROUP LTD		822	860	1,414	58,551	素材	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		1,309	1,369	3,217	133,185	銀行	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		164	171	2,733	113,126	銀行	
NICE LTD		67	70	4,595	190,203	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額	5,395	5,636	28,781	1,191,214		
	銘柄数<比率>	8	8	－	<0.1%>		

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
ABB LTD	1,694	1,750	8,580	1,506,087	資本財
ADECCO GROUP AG-REG	169	187	441	77,547	商業・専門サービス
ALCON INC	529	553	4,182	734,084	ヘルスケア機器・サービス
AVOLTA AG	104	101	336	59,113	一般消費財・サービス流通・小売り
BACHEM HOLDING AG-REG B	35	37	250	44,035	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BALOISE HOLDING AG	48	48	803	141,003	保険
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	31	33	293	51,484	銀行
BARRY CALLEBAUT AG-REG	3	3	521	91,469	食品・飲料・タバコ
BKW AG	22	23	345	60,663	公益事業
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	1	1,081	189,751	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.11	0.12	1,183	207,675	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	569	595	7,079	1,242,518	耐久消費財・アパレル
CLARIANT AG	228	239	264	46,493	素材
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	7	7	489	85,850	素材
GALDERMA GROUP AG	－	52	452	79,357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GEBERIT AG-REG	35	37	1,917	336,531	資本財
GIVAUDAN-REG	9	10	3,955	694,206	素材
HELVETIA HOLDING AG-REG	39	41	619	108,765	保険
HOLCIM LTD	551	576	5,101	895,335	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	218	228	1,196	210,000	金融サービス
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	57	53	1,125	197,498	運輸
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	174	172	1,188	208,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG	78	79	4,108	721,086	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA	2,829	2,901	22,246	3,904,665	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG	2,171	2,182	19,876	3,488,768	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDING AG	24	25	3,037	533,055	金融サービス
ROCHE HOLDING AG	744	777	19,488	3,420,603	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG-BR	34	35	947	166,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SANDOZ GROUP AG	433	453	1,801	316,132	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	25	26	642	112,723	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	42	44	1,135	199,272	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	158	170	1,481	260,087	商業・専門サービス
SIG GROUP AG	324	339	603	105,987	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円		
SIKA AG-BEARER		161	168	3,907	685,883	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG		53	56	1,684	295,741	ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG		118	123	1,371	240,658	ヘルスケア機器・サービス	
SWATCH GROUP AG		30	31	521	91,466	耐久消費財・アパレル	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		31	31	2,278	399,958	保険	
SWISS PRIME SITE-REG		81	85	805	141,371	不動産管理・開発	
SWISS RE AG		319	334	4,184	734,437	保険	
SWISSCOM AG		28	29	1,481	259,990	電気通信サービス	
TEMENOS GROUP AG-REG		67	66	394	69,233	ソフトウェア・サービス	
THE SWATCH GROUP AG-REG		56	58	190	33,420	耐久消費財・アパレル	
UBS GROUP AG		3,483	3,641	10,243	1,798,015	金融サービス	
VAT GROUP AG		28	29	1,021	179,378	資本財	
ZURICH INSURANCE GROUP AG		155	162	8,604	1,510,314	保険	
小計	株数・金額	16,016	16,612	153,467	26,936,675		
	銘柄数<比率>	45	46	－	<2.3%>		
(デンマーク)				千デンマーク・クローネ			
A P MOLLER - MAERSK A/S		4	4	6,055	133,339	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S		3	3	3,847	84,728	運輸	
CARLSBERG AS-B		104	105	7,556	166,402	食品・飲料・タバコ	
COLOPLAST-B		133	139	12,479	274,804	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S		730	763	15,623	344,031	銀行	
DEMANT A/S		106	109	2,912	64,128	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S		185	189	28,333	623,897	運輸	
GENMAB A/S		70	69	10,064	221,612	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVO-NORDISK A/S		3,457	3,567	258,608	5,694,569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S		395	390	15,552	342,476	素材	
ORSTED A/S		200	209	7,951	175,095	公益事業	
PANDORA A/S		89	90	9,694	213,472	耐久消費財・アパレル	
ROCKWOOL A/S-B SHS		9	10	3,050	67,174	資本財	
TRYGVESTA AS		370	377	5,949	131,012	保険	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		1,070	1,118	11,033	242,959	資本財	
ZEALAND PHARMA A/S		－	70	4,772	105,096	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額	6,931	7,220	403,487	8,884,801		
	銘柄数<比率>	15	16	－	<0.8%>		
(ノルウェー)				千ノルウェー・クローネ			
AKER BP ASA		334	350	7,960	112,477	エネルギー	

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
(ノルウェー)		百株	百株	千円	千円
DNB BANK ASA		978	990	22,634	319,820 銀行
EQUINOR ASA		953	927	24,413	344,961 エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		210	221	4,250	60,059 保険
KONGSBERG GRUPPEN ASA		93	97	12,073	170,598 資本財
MOWI ASA		492	514	10,219	144,404 食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		1,403	1,553	11,025	155,797 素材
ORKLA ASA		737	771	7,434	105,043 食品・飲料・タバコ
SALMAR ASA		70	73	4,120	58,223 食品・飲料・タバコ
TELENOR ASA		688	698	9,155	129,366 電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		174	182	5,764	81,448 素材
小計	株数・金額	6,136	6,380	119,051	1,682,202
	銘柄数<比率>	11	11	-	<0.1%>
(スウェーデン)				千円	千円
ADDTech AB-B SHARES		-	287	8,319	118,222 資本財
ALFA LAVAL AB		306	320	14,966	212,666 資本財
ASSA ABLOY AB		1,060	1,109	36,046	512,218 資本財
ATLAS COPCO AB		1,654	1,729	26,233	372,771 資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		2,845	2,973	51,442	730,996 資本財
BEIJER REF AB		408	399	6,406	91,040 資本財
BIOVITRUM		206	215	6,520	92,656 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOLIDEN AB		289	302	9,639	136,978 素材
EPIROC AB-A		698	729	14,295	203,145 資本財
EPIROC AB-B		413	432	7,637	108,526 資本財
EQT AB		395	413	12,069	171,511 金融サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B		645	674	19,970	283,780 家庭用品・パーソナル用品
EVOLUTION AB		194	199	19,631	278,968 消費者サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		690	733	5,943	84,456 不動産管理・開発
GETINGE AB-B SHS		242	253	4,331	61,556 ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB		684	627	9,596	136,366 一般消費財・サービス流通・小売り
HEXAGON AB-B SHS		2,199	2,299	21,396	304,048 テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLMEN AB-B SHARES		80	84	3,470	49,312 素材
HUSQVARNA AB-B SHS		371	389	2,379	33,818 資本財
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		139	142	5,069	72,036 金融サービス
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		153	167	5,936	84,360 金融サービス
INDUTRADE AB		289	302	8,252	117,272 資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(スウェーデン)		百株	百株	千ユーロ	千円		
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		157	163	4,463	63,423	資本財	
INVESTOR AB		1,832	1,914	56,636	804,803	金融サービス	
LIFCO AB-B SHS		246	257	8,084	114,877	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS		79	83	4,401	62,545	金融サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		1,607	1,679	7,978	113,369	資本財	
SAAB AB-B		338	354	8,816	125,288	資本財	
SAGAX AB-B		216	243	5,856	83,213	不動産管理・開発	
SANDVIK AB		1,128	1,180	23,886	339,432	資本財	
SECURITAS AB		519	544	7,229	102,729	商業・専門サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		1,679	1,756	26,318	373,978	銀行	
SKANSKA AB-B SHS		359	376	8,257	117,346	資本財	
SKF AB		360	377	7,675	109,064	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB		641	670	9,523	135,333	素材	
SVENSKA HANDELSBANKEN		1,543	1,616	17,860	253,796	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES		898	940	20,149	286,322	銀行	
TELE2 AB		591	611	6,869	97,611	電気通信サービス	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON		3,101	3,073	27,234	386,998	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB		2,615	2,684	8,409	119,492	電気通信サービス	
TRELLEBORG AB-B SHS		－	235	8,283	117,706	資本財	
VOLVO AB		1,593	1,754	46,802	665,069	資本財	
VOLVO AB-A SHS		216	226	6,068	86,229	資本財	
VOLVO CAR AB-B		788	823	1,886	26,800	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額	34,486	36,355	622,248	8,842,145		
	銘柄数<比率>	42	44	－	<0.8%>		
(ユーロ／アイルランド)				千ユーロ			
AIB GROUP PLC		1,664	2,010	1,077	177,036	銀行	
BANK OF IRELAND GROUP PLC		1,119	1,126	984	161,795	銀行	
KERRY GROUP PLC-A		167	171	1,464	240,592	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC		164	171	1,237	203,222	資本財	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		275	－	－	－	素材	
小計	株数・金額	3,391	3,479	4,764	782,647		
	銘柄数<比率>	5	4	－	<0.1%>		

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
(ユーロ／オランダ)		百株	百株	千ユーロ 千円	
ABN AMRO BANK NV		503	506	750 123,318	銀行
ADYEN NV		23	24	2,963 486,778	金融サービス
AIRBUS SE		628	658	9,033 1,483,909	資本財
AKZO NOBEL NV		180	189	1,058 173,863	素材
ASM INTERNATIONAL NV		49	51	2,555 419,760	半導体・半導体製造装置
ASML HOLDING NV		427	442	27,646 4,541,527	半導体・半導体製造装置
ASR NEDERLAND NV		167	175	791 130,068	保険
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES		81	85	920 151,141	半導体・半導体製造装置
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		652	681	386 63,424	食品・飲料・タバコ
DSM-FIRMENICH AG		197	206	2,140 351,577	素材
EURONEXT NV		90	88	922 151,619	金融サービス
EXOR NV		98	109	1,027 168,848	金融サービス
FERRARI NV		133	139	5,672 931,826	自動車・自動車部品
HEINEKEN HOLDING NV		136	143	876 144,029	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN NV		304	318	2,270 372,974	食品・飲料・タバコ
IMCD NV		60	63	877 144,216	資本財
ING GROEP NV-CVA		3,520	3,657	5,467 898,143	銀行
INPOST SA		—	221	382 62,906	運輸
JDE PEET'S BV		102	135	245 40,398	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		1,008	1,036	3,376 554,594	生活必需品流通・小売り
KONINKLIJKE PHILIPS NV		849	884	2,168 356,231	ヘルスケア機器・サービス
NN GROUP NV		286	299	1,343 220,720	保険
OCI NV		111	—	— —	素材
PROSUS		1,549	1,569	5,963 979,595	一般消費財・サービス流通・小売り
QIAGEN NV		233	245	947 155,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD NV		114	120	497 81,734	商業・専門サービス
ROYAL KPN NV		3,632	4,433	1,583 260,147	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV		724	749	1,741 286,066	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV		868	912	2,057 338,021	メディア・娯楽
WOLTERS KLUWER NV		263	275	4,216 692,596	商業・専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,001 29	18,425 29	89,886 —	14,765,712 <1.3%>
(ユーロ／ベルギー)					
AGEAS		169	176	854 140,417	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		919	994	5,271 865,990	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE		62	65	3,503 575,515	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
<b>(ユーロ／ベルギー)</b>		百株	百株	千ユーロ 千円	
D'IETTEREN GROUP		22	23	461 75,825	一般消費財・サービス流通・小売り
ELIA GROUP SA/NV		31	32	272 44,750	公益事業
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		92	92	596 98,048	金融サービス
KBC GROEP NV		265	254	1,790 294,179	銀行
LOTUS BAKERIES		0.44	0.45	513 84,418	食品・飲料・タバコ
SOFINA		16	17	369 60,730	金融サービス
SYENSCO SA		78	81	587 96,584	素材
UCB SA		133	139	2,300 377,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE		221	—	— —	素材
小計	株数・金額	2,014	1,879	16,523 2,714,348	
	銘柄数<比率>	12	11	— <0.2%>	
<b>(ユーロ／ルクセンブルグ)</b>					
ARCELORMITTAL		539	518	1,244 204,439	素材
TENARIS SA		499	521	907 149,037	エネルギー
小計	株数・金額	1,039	1,040	2,151 353,477	
	銘柄数<比率>	2	2	— <0.0%>	
<b>(ユーロ／フランス)</b>					
ACCOR		200	215	927 152,411	消費者サービス
ADP		36	38	414 68,129	運輸
AIR LIQUIDE		555	640	10,194 1,674,579	素材
ALSTOM RGPT		305	383	815 133,925	資本財
AMUNDI SA		65	67	456 74,965	金融サービス
ARKEMA		63	62	475 78,123	素材
AXA SA		1,924	2,012	6,850 1,125,300	保険
BIOMERIEUX		43	45	448 73,677	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS		1,094	1,127	6,685 1,098,165	銀行
BOLLORE SE		753	787	457 75,138	メディア・娯楽
BOUYGUES		202	210	614 100,906	資本財
BUREAU VERITAS SA		312	351	986 161,974	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA		164	171	2,694 442,695	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA		599	601	881 144,850	生活必需品流通・小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN		482	501	4,454 731,819	資本財
CREDIT AGRICOLE SA		1,130	1,172	1,566 257,285	銀行
DANONE		681	714	4,648 763,636	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA		21	21	427 70,199	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA		707	741	2,369 389,199	ソフトウェア・サービス
EDENRED		264	276	792 130,196	金融サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ／フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
EIFFAGE		77	81	689	113,200	資本財
ENGIE		1,936	2,022	3,123	513,028	公益事業
ESSILORLUXOTTICA		312	329	7,712	1,266,963	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO		44	50	349	57,374	金融サービス
EUROFINS SCIENTIFIC		143	149	680	111,785	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GETLINK SE - REGR		378	334	508	83,606	運輸
HERMES INTERNATIONAL		33	35	7,012	1,151,901	耐久消費財・アパレル
IPSEN		39	41	446	73,326	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KERING		78	82	1,775	291,680	耐久消費財・アパレル
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		111	113	445	73,102	消費者サービス
LEGRAND SA		279	290	2,787	457,944	資本財
L'OREAL SA		254	266	8,578	1,409,219	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		292	304	17,588	2,889,279	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)		719	751	2,337	384,001	自動車・自動車部品
ORANGE S.A.		2,012	2,100	2,076	341,176	電気通信サービス
PERNOD-RICARD		216	224	2,446	401,864	食品・飲料・タバコ
PUBLICIS GROUPE		242	253	2,515	413,150	メディア・娯楽
REMY COINTREAU		24	－	－	－	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA		203	212	883	145,197	自動車・自動車部品
REXEL SA		238	250	640	105,149	資本財
SAFRAN SA		362	378	8,250	1,355,261	資本財
SANOFI		1,206	1,262	11,513	1,891,342	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		30	32	543	89,252	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		576	605	14,470	2,377,107	資本財
SEB SA		26	27	251	41,273	耐久消費財・アパレル
SOCIETE GENERALE		764	799	2,091	343,577	銀行
SODEXO		93	97	790	129,848	消費者サービス
TELEPERFORMANCE		60	60	547	89,946	商業・専門サービス
THALES SA		100	104	1,613	265,032	資本財
TOTALENERGIES SE		2,299	2,389	13,730	2,255,528	エネルギー
VEOLIA ENVIRONNEMENT		730	763	2,151	353,452	公益事業
VINCI SA		530	554	5,557	912,967	資本財
VIVENDI SA		708	797	697	114,626	メディア・娯楽
WORLDLINE SA		254	－	－	－	金融サービス
小計	株数・金額	24,996	25,913	171,969	28,249,352	
	銘柄数<比率>	54	52	－	<2.4%>	



# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ／ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	171	179	3,825	628,406	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE	415	433	12,371	2,032,344	保険
BASF SE	946	989	4,234	695,574	素材
BAYER AG	1,041	1,087	2,192	360,172	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	337	352	2,436	400,312	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	62	65	423	69,605	自動車・自動車部品
BECHTLE AG	86	90	298	49,083	ソフトウェア・サービス
BEIERSDORF AG	106	109	1,332	218,887	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG SE	140	143	839	137,869	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	42	44	255	41,991	ヘルスケア機器・サービス
COMMERZBANK AG	1,114	1,114	1,787	293,694	銀行
CONTINENTAL AG	116	121	750	123,320	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	200	209	1,199	196,978	素材
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	－	69	625	102,795	メディア・娯楽
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	566	546	1,970	323,624	資本財
DELIVERY HERO SE	187	205	742	121,997	消費者サービス
DEUTSCHE BANK AG	2,051	2,097	3,334	547,735	金融サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	201	210	4,449	730,855	金融サービス
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	631	662	414	68,167	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG	3,451	3,881	11,146	1,831,015	電気通信サービス
DHL GROUP	1,050	1,129	3,968	651,934	運輸
DR ING HC F PORSCHE AG	120	126	771	126,735	自動車・自動車部品
E.ON SE	2,377	2,484	2,896	475,839	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	247	285	499	82,057	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	447	467	1,531	251,639	ヘルスケア機器・サービス
GEA GROUP AG	173	171	779	128,075	資本財
HANNOVER RUECK SE	63	66	1,591	261,476	保険
HEIDELBERG MATERIALS AG	137	150	1,783	292,993	素材
HENKEL AG & CO KGAA	110	115	816	134,175	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG	178	186	1,469	241,395	家庭用品・パーソナル用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,383	1,446	4,208	691,272	半導体・半導体製造装置
KNORR-BREMSE AG	76	80	582	95,730	資本財
LEG IMMOBILIEN SE	78	82	686	112,849	不動産管理・開発
MERCEDES-BENZ GROUP AG	850	829	4,385	720,330	自動車・自動車部品
MERCK KGAA	136	143	1,998	328,370	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	57	59	1,838	301,938	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
<b>(ユーロ／ドイツ)</b>		百株	百株	千ユーロ 千円	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG		144	148	7,020 1,153,330	保険
NEMETSCHEK SE		61	63	632 103,898	ソフトウェア・サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF		161	169	590 97,001	自動車・自動車部品
PUMA AG		111	117	537 88,289	耐久消費財・アパレル
RATIONAL AG		5	5	493 81,079	資本財
RHEINMETALL AG		46	48	2,916 479,167	資本財
RWE AG		669	699	2,198 361,130	公益事業
SAP SE		1,106	1,156	25,429 4,177,296	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		27	29	606 99,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCOUT24 SE		79	82	697 114,593	メディア・娯楽
SIEMENS AG		805	841	14,967 2,458,748	資本財
SIEMENS ENERGY AG		550	707	3,234 531,317	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG		298	312	1,540 253,121	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG		140	147	1,536 252,377	素材
TALANX AG		68	71	556 91,415	保険
VOLKSWAGEN AG		31	—	— —	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG		217	228	1,896 311,607	自動車・自動車部品
VONOVIA SE		777	820	2,381 391,238	不動産管理・開発
ZALANDO SE		237	248	677 111,259	一般消費財・サービス流通・小売り
小計	株数・金額	24,905	26,338	152,357 25,027,791	
	銘柄数<比率>	54	54	— <2.1%>	
<b>(ユーロ／ポルトガル)</b>					
EDP RENOVAVEIS SA		326	345	373 61,292	公益事業
EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH		320	—	— —	公益事業
EDP SA		3,325	3,477	1,188 195,169	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		490	514	804 132,073	エネルギー
JERONIMO MARTINS		300	314	547 89,890	生活必需品流通・小売り
小計	株数・金額	4,763	4,651	2,912 478,426	
	銘柄数<比率>	5	4	— <0.0%>	
<b>(ユーロ／スペイン)</b>					
ACCIONA SA		26	27	313 51,468	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		223	202	841 138,193	資本財
AENA SME SA		79	82	1,641 269,727	運輸
AMADEUS IT GROUP SA		477	498	3,275 538,072	消費者サービス

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
(ユーロ/スペイン)		百株	百株	千ユーロ 千円	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA		6,183	6,380	5,951 977,678	銀行
BANCO DE SABADELL SA		—	6,019	1,098 180,462	銀行
BANCO SANTANDER SA		17,135	17,150	7,798 1,281,061	銀行
CAIXABANK		3,973	4,026	2,170 356,485	銀行
CELLNEX TELECOM SAU		490	590	1,896 311,480	電気通信サービス
ENAGAS SA		263	—	— —	公益事業
ENDESA SA		335	351	701 115,183	公益事業
FERROVIAL SE		548	576	2,124 348,987	資本財
GRIFOLS SA		316	330	341 56,099	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA		6,497	6,758	9,056 1,487,757	公益事業
INDITEX SA		1,155	1,207	6,168 1,013,362	一般消費財・サービス流通・小売り
REDEIA CORPORACION SA		431	451	756 124,233	公益事業
REPSOL SA		1,281	1,345	1,585 260,429	エネルギー
TELEFONICA SA		5,272	4,473	1,936 318,098	電気通信サービス
小計	株数・金額	44,690	50,474	47,658 7,828,783	
	銘柄数<比率>	17	17	— <0.7%>	
(ユーロ/イタリア)					
AMPLIFON SPA		131	137	325 53,472	ヘルスケア機器・サービス
BANCO BPM SPA		1,282	1,427	959 157,625	銀行
DIASORIN ITALIA SPA		23	24	258 42,442	ヘルスケア機器・サービス
ENEL SPA		8,614	9,005	5,982 982,690	公益事業
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA		2,322	2,544	3,494 574,105	エネルギー
FINECOBANK SPA		647	676	978 160,786	銀行
GENERALI		1,073	1,128	3,031 498,050	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		374	392	375 61,628	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO		15,497	16,200	6,016 988,363	銀行
LEONARDO SPA		427	447	1,128 185,377	資本財
MEDIOBANCA SPA		540	553	779 128,001	銀行
MONCLER SPA		218	243	1,152 189,364	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA		625	656	351 57,792	金融サービス
POSTE ITALIANE SPA		485	506	653 107,396	保険
PRYSMIAN SPA		278	298	1,791 294,336	資本財
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		110	115	577 94,889	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAM SPA		2,135	2,234	967 158,962	公益事業
STELLANTIS NV		2,347	2,344	2,904 477,126	自動車・自動車部品
TELECOM ITALIA SPA		10,801	11,283	258 42,447	電気通信サービス
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA		1,487	1,555	1,204 197,919	公益事業
UNICREDIT SPA		1,632	1,630	6,321 1,038,475	銀行
小計	株数・金額	51,057	53,406	39,515 6,491,254	
	銘柄数<比率>	21	21	— <0.6%>	

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
(ユーロ／フィンランド)		百株	百株	千ユーロ 千円	
ELISA OYJ		156	162	701 115,200	電気通信サービス
FORTUM OYJ		475	495	686 112,812	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		289	302	578 95,060	生活必需品流通・小売り
KONE OYJ		360	376	1,832 301,046	資本財
METSO CORPORATION		703	688	555 91,226	資本財
NESTE OYJ		448	468	640 105,215	エネルギー
NOKIA OYJ		5,647	5,905	2,344 385,110	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NORDEA BANK ABP		3,363	3,494	3,747 615,583	銀行
ORION OYJ-CLASS B		114	119	532 87,445	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		477	499	1,985 326,094	保険
STORA ENSO OYJ		616	643	614 100,917	素材
UPM-KYMMENE OYJ		565	591	1,513 248,694	素材
WARTSILA OYJ		500	555	986 162,040	資本財
小計	株数・金額	13,717	14,303	16,719 2,746,447	
	銘柄数<比率>	13	13	－ <0.2%>	
(ユーロ／オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG		364	372	1,949 320,250	銀行
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A		72	75	543 89,350	公益事業
OMV AG		156	163	626 102,913	エネルギー
VOESTALPINE AG		122	119	216 35,494	素材
小計	株数・金額	715	731	3,336 548,008	
	銘柄数<比率>	4	4	－ <0.0%>	
(ユーロ／その他)					
AEGON LTD		1,537	1,491	890 146,330	保険
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		217	227	949 155,944	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	1,755	1,719	1,840 302,275	
	銘柄数<比率>	2	2	－ <0.0%>	
ユーロ計	株数・金額	190,048	202,361	549,634 90,288,523	
	銘柄数<比率>	218	213	－ <7.7%>	
合計	株数・金額	1,146,347	1,215,858	－ 1,119,567,964	
	銘柄数<比率>	1,194	1,160	－ <95.2%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。以下同じです。

(注2) 邦貨換算金額の< >内は、当期末の純資産総額に対する株式評価額の比率です。

(注3) 株数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(注4) 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およびMSCI Inc.に帰属します。

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千□	千□	千米ドル	千円
BOSTON PROPERTIES INC		15	16	1,313	203,441
CROWN CASTLE INC		45	48	5,029	779,184
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		17	17	1,823	282,519
PROLOGIS INC		97	102	11,806	1,828,904
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT		53	55	1,098	170,125
AVALONBAY COMMUNITIES INC		15	15	3,611	559,400
CAMDEN PROPERTY TRUST		11	11	1,432	221,842
EQUITY RESIDENTIAL		38	37	2,813	435,907
ESSEX PROPERTY TRUST INC		6	7	2,145	332,336
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		75	78	1,669	258,678
WELLTOWER INC		58	66	9,148	1,417,212
HOST HOTELS AND RESORTS INC		74	78	1,353	209,720
KIMCO REALTY CORP		71	74	1,870	289,733
MID-AMERICA APARTMENT COMM		12	12	2,046	317,050
PUBLIC STORAGE		16	17	5,857	907,446
REGENCY CENTERS CORP		18	19	1,441	223,358
SIMON PROPERTY GROUP INC		34	36	6,540	1,013,231
SUN COMMUNITIES INC		13	13	1,749	270,975
UDR INC		33	34	1,543	239,080
VENTAS INC		42	44	2,878	445,892
WP CAREY INC		23	24	1,371	212,503
REALTY INCOME CORP		88	96	5,520	855,180
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		18	19	1,390	215,391
EXTRA SPACE STORAGE INC		22	23	3,882	601,443
DIGITAL REALTY TRUST INC		32	35	6,730	1,042,648
IRON MOUNTAIN INC		30	32	3,779	585,495
AMERICAN TOWER REIT INC		49	51	10,404	1,611,727
EQUINIX INC		9	10	9,701	1,502,883
AMERICAN HOMES 4 RENT- A		34	36	1,369	212,200
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		28	30	1,513	234,484
SBA COMMUNICATIONS CORP		11	11	2,612	404,713
INVITATION HOMES INC		64	67	2,308	357,577
VICI PROPERTIES INC		109	115	3,726	577,207
小計	□数・金額	1,276	1,345	121,486	18,819,497
	銘柄数<比率>	33	33	—	<1.6%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
<b>(カナダ)</b>		千□	千□	千カナダ・ドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		8	9	414	46,043
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		16	—	—	—
小計	□数・金額	25	9	414	46,043
	銘柄数<比率>	2	1	—	<0.0%>
<b>(オーストラリア)</b>				千オーストラリア・ドル	
GPT GROUP		202	211	989	100,268
GOODMAN GROUP		181	189	7,100	719,237
STOCKLAND		252	263	1,358	137,605
MIRVAC GROUP		418	437	931	94,403
VICINITY CENTRES		409	427	920	93,202
SCENTRE GROUP		549	574	2,032	205,926
DEXUS/AU		114	119	834	84,542
小計	□数・金額	2,127	2,224	14,167	1,435,186
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>
<b>(香港)</b>				千香港ドル	
LINK REIT		272	283	9,475	188,560
小計	□数・金額	272	283	9,475	188,560
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>
<b>(シンガポール)</b>				千シンガポール・ドル	
CAPITALAND ASCENDAS REIT		394	413	1,059	122,763
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		563	596	1,162	134,695
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		369	—	—	—
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR		251	—	—	—
小計	□数・金額	1,579	1,010	2,222	257,458
	銘柄数<比率>	4	2	—	<0.0%>
<b>(イギリス)</b>				千イギリス・ポンド	
LAND SECURITIES GROUP PLC		75	78	468	92,010
SEGRO PLC		123	142	1,085	213,450
小計	□数・金額	198	220	1,553	305,460
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>
<b>(ユーロ／ベルギー)</b>				千ユーロ	
WAREHOUSES DE PAUW SCA		18	19	406	66,720
小計	□数・金額	18	19	406	66,720
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ/フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円
KLEPIERRE		22	23	688	113,124
GECINA SA		4	5	482	79,267
COVIVIO		5	6	318	52,382
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		12	13	973	159,877
小計	口数・金額	45	48	2,463	404,652
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
ユーロ計	口数・金額	64	67	2,869	471,373
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.0%>
合計	口数・金額	5,544	5,160	—	21,523,581
	銘柄数<比率>	54	51	—	<1.8%>

(注1) 邦貨換算金額の< >内は、当期末の純資産総額に対する投資信託証券評価額の比率です。

(注2) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、口数および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

## (3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
外国		百万円	百万円
	S&P 500 EMINI FUTURE	23,827	—
	FTSE 100	2,331	—
	DJ EURO STOXX 50	5,797	—

(注1) 外貨建ての評価額は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	1,119,567,964	95.1
投資信託証券	21,523,581	1.8
コール・ローン等、その他	36,675,610	3.1
投資信託財産総額	1,177,767,156	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル154.91円、1カナダ・ドル110.98円、1オーストラリア・ドル101.30円、1香港ドル19.90円、1シンガポール・ドル115.86円、1ニュージーランド・ドル91.69円、1イギリス・ポンド196.60円、1イスラエル・シェケル41.387円、1スイス・フラン175.52円、1デンマーク・クローネ22.02円、1ノルウェー・クローネ14.13円、1スウェーデン・クローナ14.21円、1ユーロ164.27円です。

(注2) 外貨建純資産 (1,160,760,262千円) の投資信託財産総額 (1,177,767,156千円) に対する比率は98.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	1,189,365,260,431円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	19,335,477,058
株 式 (評価額)	1,119,567,964,470
投 資 信 託 証 券 (評価額)	21,523,581,574
未 収 入 金	12,874,797,589
未 収 配 当 金	1,079,369,987
差 入 委 託 証 拠 金	14,984,069,753
(B)負債	13,588,075,106
未 払 金	11,842,837,384
未 払 解 約 金	1,745,237,722
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	1,175,777,185,325
元 本	236,998,387,944
次 期 繰 越 損 益 金	938,778,797,381
(D)受 益 権 総 口 数	236,998,387,944口
1万口当たり基準価額 (C / D)	49,611円

(注1)	期首元本額	228,048,095,816円
	期中追加設定元本額	23,976,725,288円
	期中一部解約元本額	15,026,433,160円
(注2)	当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。	
	DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	697,343,816円
	DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	3,470,977,936円
	DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	3,508,450,010円
	ニッセイ外国株式インデックスSA (適格機関投資家限定)	2,320,921,334円
	ニッセイインデックスバランス (債券重視型) SA (適格機関投資家限定)	655,727円
	ニッセイインデックスバランス (標準型) SA (適格機関投資家限定)	1,365,193円
	ニッセイインデックスバランス (成長型) SA (適格機関投資家限定)	4,377,084円
	ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ (適格機関投資家限定)	486,709,861円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	161,391,837,322円
	DCニッセイ外国株式インデックス	44,717,793,265円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
	バランスファンド (4資産均等型)	3,524,993,735円
	DCニッセイターゲットデットファンド2055	456,141,988円
	DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	170,795,264円
	DCニッセイターゲットデットファンド2045	522,390,715円
	DCニッセイターゲットデットファンド2035	638,505,039円
	DCニッセイターゲットデットファンド2025	8,367,952円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
	バランスファンド (6資産均等型)	87,345,461円
	ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)	9,376,316円
	ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート)	10,650,648円
	ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート/債券)	3,519,880円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
	バランスファンド (8資産均等型)	20,246,799円
	DCニッセイターゲットデットファンド2060	379,050,839円
	DCニッセイターゲットデットファンド2050	254,048,022円
	DCニッセイターゲットデットファンド2040	445,049,698円
	DCニッセイターゲットデットファンド2030	154,611,872円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02 (適格機関投資家限定)	124,705,835円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド (GDP型)バスケツト	281,731,466円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	125,508,152円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	123,087,223円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	122,623,889円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08 (適格機関投資家限定)	109,534,576円
	ニッセイ先進国株式インデックス (海替ヘッジあり) (ラップ専用)	31,658,672円
	ニッセイ先進国株式インデックス (海替ヘッジなし) (ラップ専用)	11,954,174,927円
	F Wニッセイ先進国株インデックス	53,058,104円
	DCニッセイターゲットデットファンド2065	180,150,980円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンドⅡ 2023-05 (適格機関投資家限定)	79,189,559円
	DCニッセイ世界株式インデックスコレクト	373,589,941円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-02 (適格機関投資家限定)	77,396,875円
	DCニッセイターゲットデットファンド2070	3,322,527円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-08 (適格機関投資家限定)	73,129,442円

## 損益の状況

当期 (2024年5月21日～2024年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	8,156,237,986円
受 取 配 当 金	7,735,425,708
受 取 利 息	86,586,623
そ の 他 収 益	334,225,655
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	79,781,133,956
売 益	135,108,083,041
売 買 損	△ 55,326,949,085
(C)先 物 取 引 等 損 益	1,292,973,123
取 引 益	2,026,674,224
取 引 損	△ 733,701,101
(D)信 託 報 酬 等	△ 63,179,275
(E)当期損益金 (A + B + C + D)	89,167,165,790
(F)前 期 繰 越 損 益 金	817,070,312,459
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	87,223,067,893
(H)解 約 差 損 益 金	△ 54,681,748,761
(I)合 計 (E + F + G + H)	938,778,797,381
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	938,778,797,381

- (注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
- (注2) (G)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。
- (注3) (H)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。



# ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第 36 期

(計算期間：2024年5月21日～2024年11月20日)

運用方針	主に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	日本を除く主要国の国債
運用方法	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 <ul style="list-style-type: none"><li>・ 株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li><li>・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>



ニッセイアセットマネジメント株式会社

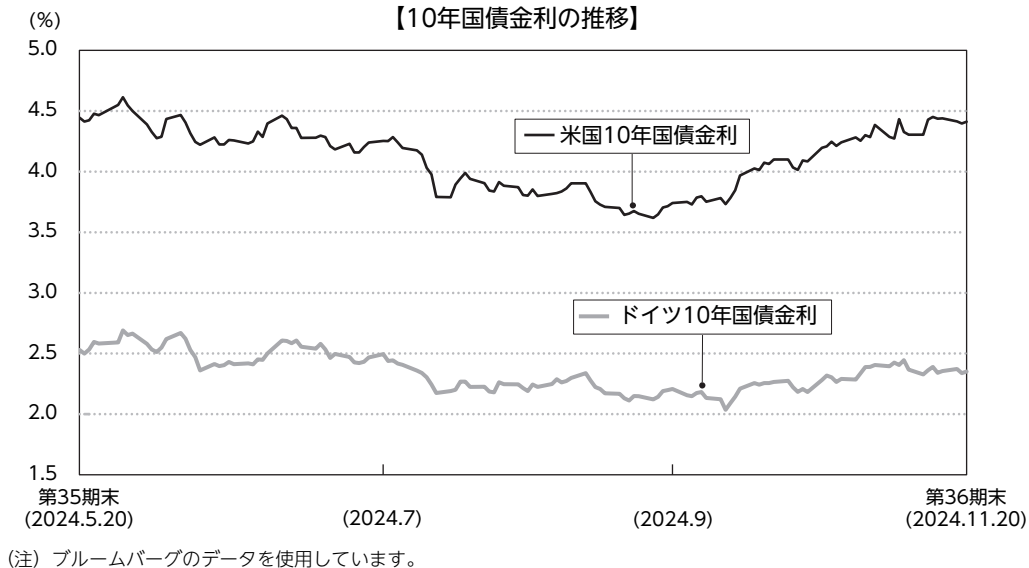
東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2024年5月21日～2024年11月20日

## 投資環境

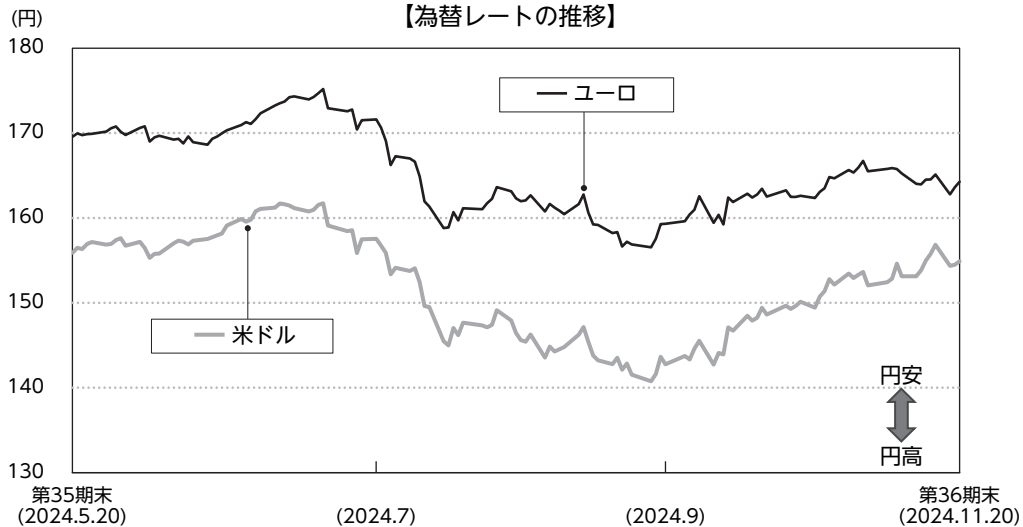
### ■ 海外債券市況



当期の米国10年国債金利は、期初は雇用統計等の米経済指標が堅調となったことで利下げ観測が後退し上昇して始まったものの、その後は米消費者物価指数（CPI）の伸びが鈍化したことや米サプライマネジメント協会（ISM）非製造業景況感指数が軟調であったこと、7月の米連邦公開市場委員会（FOMC）で将来の利下げへの可能性が示唆されたことなどから低下基調となりました。10月以降は米大統領選でトランプ氏が勝利するとの見方が強まったことで財政拡張や関税引き上げに伴う物価上昇への懸念が高まったことから金利は上昇し、結局、期を通じて見ると期初と同程度の水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初は景気の底堅さが確認され上昇しましたが、その後は欧州議会選において極右政党が議席数を伸ばしたことで投資家のリスク回避姿勢が強まったことや欧州域内の経済指標が鈍化したことなどから低下基調となりました。10月以降はユーロ圏消費者物価指数（HICP）が上昇したことや米国金利が上昇したことなどからドイツ金利も上昇に転じ、結局、期を通じて見るとやや低下して当期末を迎えました。

■為替市況

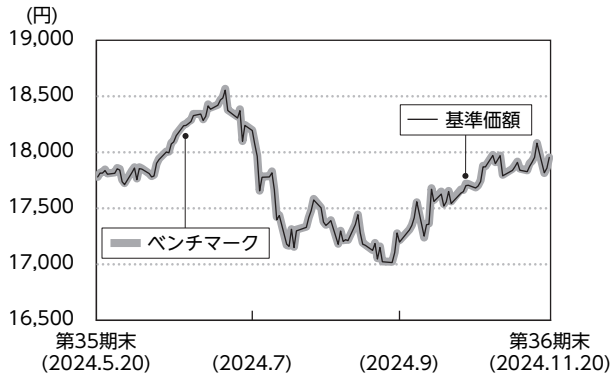


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、期初以降、堅調な米経済指標が続いたことや日銀の利上げ観測・米連邦準備制度理事会（F R B）の利下げ観測がそれぞれ後退したことなどから米ドル高円安基調となりました。7月中旬には日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあったことや米経済指標が弱含んだことなどから、大きく米ドル安円高に転じました。9月下旬以降は自民党総裁選で石破氏が勝利し10月の衆院選で連立与党が過半数の議席数を確保できなかったことで政治の不透明感が高まったこと、さらに米大統領選でトランプ氏優位との見方が強まったことから財政拡張や関税引き上げに伴う物価上昇への懸念が高まったことから再び米ドル高円安となり、結局、期を通じて見るとほぼ横ばい圏で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、期初以降、日銀の追加利上げ観測が後退する一方で欧州域内の経済指標が堅調であったことからユーロ高円安基調となりました。7月中旬には日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあったことや米経済指標が弱含んだことなどから大きくユーロ安円高となりました。9月下旬以降は自民党総裁選で石破氏が勝利し10月の衆院選で連立与党が過半数の議席数を確保できなかったことで政治の不透明感が高まったこと、さらにユーロ圏実質域内総生産（GDP）が市場予想を上回るなど欧州域内の経済指標が堅調であったことなどから再びユーロ高円安推移となり、結局、期を通じて見るとややユーロ安円高で当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



(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。

### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 期初から7月上旬にかけて、伸びが鈍化した米CPIや軟調な米経済指標を受けて金利が低下(債券価格は上昇)基調となったことに加えて、日米の金融政策が市場予想ほど縮小方向に進まなかったことから米ドル高円安となったこと
- ・ 9月下旬から当期末にかけて、日本の政治的な不透明感が高まったことや米大統領選でトランプ氏優位との見方が強まったことから物価上昇への懸念が高まったことで米ドル高円安となったこと

#### <下落要因>

- ・ 7月中旬から9月中旬にかけて、日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあったことや米経済指標が弱含んだことなどから大きく米ドル安円高となったこと

## ポートフォリオ

日本を除く主要国の国債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した。

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+1.0%となり、ベンチマーク騰落率(+1.0%)に連動しました。

## 今後の運用方針

日本を除く主要国の国債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。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中 騰落率	ベンチ マーク	期中 騰落率	債券 組入比率	純資産 総額
	円	%		%	%	百万円
32期(2022年11月21日)	15,301	2.1	15,493	2.1	99.0	56,285
33期(2023年 5 月22日)	15,369	0.4	15,569	0.5	99.0	61,820
34期(2023年11月20日)	16,626	8.2	16,850	8.2	98.9	72,121
35期(2024年 5 月20日)	17,780	6.9	18,023	7.0	98.8	84,737
36期(2024年11月20日)	17,954	1.0	18,199	1.0	98.9	92,549

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	債券 組入比率
	円	%		%	%
(期首)2024年 5 月20日	17,780	—	18,023	—	98.8
5 月末	17,711	△0.4	17,966	△0.3	98.6
6 月末	18,327	3.1	18,593	3.2	98.8
7 月末	17,663	△0.7	17,908	△0.6	98.8
8 月末	17,211	△3.2	17,452	△3.2	98.7
9 月末	17,251	△3.0	17,474	△3.1	98.3
10月末	17,970	1.1	18,217	1.1	98.7
(期末)2024年11月20日	17,954	1.0	18,199	1.0	98.9

(注) 騰落率は期首比です。

## 1 万口当たりの費用明細

2024年5月21日～2024年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	3円	0.017%	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)	(3)	(0.017)	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
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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</li> <li>・ 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</li> </ul>
合計	3	0.017	

(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。

(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（17,723円）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。

## 売買および取引の状況

2024年5月21日～2024年11月20日

## 公社債

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 75,686	千米ドル 53,863
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 3,235	千カナダ・ドル 2,402
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 1,574	千オーストラリア・ドル 388
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 454	千シンガポール・ドル 323
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 657	千ニュージーランド・ドル 48
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 4,909	千イギリス・ポンド 2,427
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シェケル 1,246	千イスラエル・シェケル 1,191
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 1,420	千デンマーク・クローネ 620
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 1,196	千ノルウェー・クローネ 342
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 1,487	千スウェーデン・クローナ 2,234
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 13,845	千メキシコ・ペソ 2,890
	中国	国債証券	千人民元 153,187	千人民元 49,615
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 1,486	千マレーシア・リンギット 685
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 3,073	千ポーランド・ズロチ 2,117
	ユーロ	アイルランド	千ユーロ 224	千ユーロ 176
		オランダ	848	1,030
		ベルギー	1,082	1,175
		フランス	6,001	4,023
		ドイツ	5,128	3,941
		ポルトガル	3,293	—
		スペイン	3,454	3,016
		イタリア	5,674	3,749
		フィンランド	516	434
		オーストリア	928	664

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

(注3) 金額の単位未満は切り捨てています。ただし、金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

主要な売買銘柄

2024年5月21日～2024年11月20日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
US TREASURY	1,289,905	US TREASURY	1,422,018
US TREASURY	1,104,757	US TREASURY	1,167,721
US TREASURY	930,765	US TREASURY	1,074,500
US TREASURY	834,555	US TREASURY	763,720
US TREASURY	737,951	US TREASURY	717,920
US TREASURY	697,798	US TREASURY	599,777
US TREASURY	617,584	US TREASURY	458,647
US TREASURY	590,897	CHINA GOVERNMENT BOND	440,841
US TREASURY	438,113	US TREASURY	380,575
US TREASURY	422,495	US TREASURY	302,384

(注1) 金額は受渡代金（経過利子分は含まれていません）で、外国公社債は各月末（決算日の属する月については決算日）における国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2024年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
	310,860	277,039	42,916,152	46.4	—	19.0	16.7	10.7
カナダ	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		1.9	—	1.1	0.4	0.4
	17,000	16,090	1,785,768					
オーストラリア	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		1.3	—	0.9	0.3	0.2
	13,040	11,591	1,174,220					
シンガポール	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		0.4	—	0.2	0.1	0.1
	3,330	3,253	376,940					
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル		0.3	—	0.2	0.1	0.0
	3,090	2,788	255,684					
イギリス	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		5.1	—	3.6	1.2	0.3
	29,260	23,951	4,708,844					
イスラエル	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル		0.3	—	0.2	0.1	0.0
	7,750	6,984	289,059					



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
デンマーク	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	%	%	%	%	%
	11,120	10,937	240,845	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ						
	10,860	10,135	143,211	0.2	—	0.1	0.0	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ						
	10,850	10,648	151,309	0.2	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ						
	98,250	88,369	680,605	0.7	—	0.4	0.2	0.1
中国	千人民元	千人民元						
	455,770	475,936	10,192,509	11.0	—	5.0	3.9	2.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット						
	12,970	13,267	459,964	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ						
	13,120	12,320	467,006	0.5	—	0.1	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
	アイルランド	2,920	2,644	434,358	0.5	—	0.3	0.1
	オランダ	7,930	7,376	1,211,691	1.3	—	0.8	0.4
	ベルギー	9,390	8,766	1,440,099	1.6	—	1.1	0.4
	フランス	45,110	41,594	6,832,706	7.4	—	4.3	2.2
	ドイツ	34,030	32,221	5,293,058	5.7	—	3.2	1.8
	ポルトガル	3,430	3,292	540,935	0.6	—	0.4	0.2
	スペイン	25,970	25,036	4,112,782	4.4	—	2.5	1.4
	イタリア	39,390	38,759	6,366,971	6.9	—	3.9	1.9
	フィンランド	3,070	2,763	453,927	0.5	—	0.3	0.1
	オーストリア	6,740	6,146	1,009,605	1.1	—	0.7	0.3
合計		—	—	91,538,259	98.9	—	48.5	32.4
							17.9	

(注1) 外貨建金額は、原則として証券会社、価格情報会社等より入手した時価により評価したものです。また邦貨換算金額は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。以下同じです。

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する邦貨換算金額（評価額）の比率です。

(注3) 格付については証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注4) 額面金額および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、額面金額および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。以下同じです。

# ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
アメリカ		%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/02/15	100	102	15,815
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	120	126	19,583
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	120	124	19,276
	US TREASURY	5.3750	2031/02/15	180	190	29,574
	US TREASURY	2.2500	2025/11/15	8,610	8,433	1,306,432
	US TREASURY	2.6250	2025/12/31	1,410	1,383	214,310
	US TREASURY	1.6250	2026/02/15	14,490	14,019	2,171,694
	US TREASURY	2.2500	2026/03/31	2,580	2,509	388,704
	US TREASURY	1.6250	2026/05/15	11,270	10,837	1,678,795
	US TREASURY	1.8750	2026/06/30	2,290	2,204	341,522
	US TREASURY	1.5000	2026/08/15	15,180	14,477	2,242,681
	US TREASURY	0.7500	2026/08/31	1,360	1,277	197,969
	US TREASURY	1.6250	2026/09/30	1,130	1,077	166,849
	US TREASURY	2.0000	2026/11/15	8,190	7,839	1,214,488
	US TREASURY	1.7500	2026/12/31	2,230	2,118	328,163
	US TREASURY	2.2500	2027/02/15	7,800	7,468	1,156,897
	US TREASURY	0.6250	2027/03/31	2,070	1,903	294,859
	US TREASURY	2.3750	2027/05/15	8,580	8,204	1,270,978
	US TREASURY	0.5000	2027/06/30	3,820	3,468	537,338
	US TREASURY	2.2500	2027/08/15	7,710	7,318	1,133,742
	US TREASURY	0.3750	2027/09/30	1,460	1,309	202,791
	US TREASURY	2.2500	2027/11/15	6,340	5,987	927,572
	US TREASURY	0.6250	2027/12/31	1,170	1,047	162,226
	US TREASURY	2.7500	2028/02/15	5,930	5,663	877,278
	US TREASURY	1.1250	2028/02/29	1,310	1,185	183,667
	US TREASURY	1.2500	2028/03/31	1,150	1,042	161,486
	US TREASURY	1.2500	2028/04/30	1,390	1,257	194,759
	US TREASURY	2.8750	2028/05/15	6,210	5,934	919,374
	US TREASURY	1.2500	2028/05/31	900	812	125,820
	US TREASURY	2.8750	2028/08/15	7,100	6,762	1,047,573
	US TREASURY	1.1250	2028/08/31	1,670	1,488	230,615
	US TREASURY	1.3750	2028/10/31	1,940	1,738	269,333
	US TREASURY	3.1250	2028/11/15	5,430	5,206	806,589
	US TREASURY	1.5000	2028/11/30	1,820	1,635	253,390
	US TREASURY	2.6250	2029/02/15	9,370	8,781	1,360,323
	US TREASURY	2.3750	2029/05/15	9,000	8,315	1,288,203
	US TREASURY	1.6250	2029/08/15	8,720	7,754	1,201,212

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
アメリカ		%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY	1.7500	2029/11/15	3,300	2,936	454,909
	US TREASURY	1.5000	2030/02/15	3,890	3,386	524,635
	US TREASURY	0.6250	2030/08/15	5,110	4,165	645,201
	US TREASURY	0.8750	2030/11/15	5,440	4,473	693,061
	US TREASURY	1.1250	2031/02/15	5,550	4,606	713,592
	US TREASURY	1.6250	2031/05/15	5,630	4,781	740,632
	US TREASURY	1.2500	2031/08/15	5,910	4,858	752,583
	US TREASURY	1.3750	2031/11/15	2,550	2,099	325,271
	US TREASURY	1.8750	2032/02/15	2,390	2,027	314,003
	US TREASURY	2.8750	2032/05/15	2,290	2,076	321,720
	US TREASURY	2.7500	2032/08/15	2,260	2,024	313,567
	US TREASURY	4.1250	2032/11/15	2,280	2,247	348,129
	US TREASURY	3.5000	2033/02/15	2,220	2,088	323,599
	US TREASURY	3.3750	2033/05/15	2,280	2,120	328,524
	US TREASURY	3.8750	2033/08/15	2,480	2,390	370,308
	US TREASURY	4.5000	2033/11/15	2,620	2,643	409,525
	US TREASURY	4.0000	2034/02/15	2,760	2,679	415,058
	US TREASURY	4.3750	2034/05/15	2,740	2,737	424,118
	US TREASURY	3.8750	2034/08/15	2,550	2,447	379,093
	US TREASURY	4.5000	2036/02/15	180	183	28,373
	US TREASURY	5.0000	2037/05/15	160	169	26,235
	US TREASURY	4.3750	2038/02/15	150	149	23,121
	US TREASURY	4.5000	2038/05/15	190	191	29,608
	US TREASURY	3.5000	2039/02/15	190	170	26,457
	US TREASURY	4.2500	2039/05/15	270	262	40,737
	US TREASURY	4.5000	2039/08/15	280	279	43,334
	US TREASURY	4.3750	2039/11/15	300	295	45,754
	US TREASURY	4.6250	2040/02/15	320	323	50,130
	US TREASURY	1.1250	2040/05/15	920	568	88,092
	US TREASURY	1.1250	2040/08/15	1,100	673	104,297
	US TREASURY	3.8750	2040/08/15	290	268	41,582
	US TREASURY	1.3750	2040/11/15	1,260	800	123,980
	US TREASURY	4.2500	2040/11/15	300	290	44,940
	US TREASURY	1.8750	2041/02/15	1,500	1,031	159,785
	US TREASURY	4.7500	2041/02/15	320	327	50,765
	US TREASURY	2.2500	2041/05/15	1,260	917	142,074
	US TREASURY	1.7500	2041/08/15	1,720	1,143	177,090
	US TREASURY	2.0000	2041/11/15	1,460	1,006	155,959

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	3.1250	2041/11/15	300	248	38,475
	US TREASURY	2.3750	2042/02/15	1,130	825	127,872
	US TREASURY	3.1250	2042/02/15	330	271	42,100
	US TREASURY	3.0000	2042/05/15	290	233	36,126
	US TREASURY	3.2500	2042/05/15	1,040	867	134,359
	US TREASURY	2.7500	2042/08/15	350	269	41,784
	US TREASURY	3.3750	2042/08/15	910	770	119,349
	US TREASURY	2.7500	2042/11/15	520	399	61,824
	US TREASURY	4.0000	2042/11/15	890	821	127,313
	US TREASURY	3.1250	2043/02/15	450	365	56,546
	US TREASURY	3.8750	2043/02/15	890	805	124,814
	US TREASURY	2.8750	2043/05/15	690	536	83,046
	US TREASURY	3.8750	2043/05/15	900	813	125,999
	US TREASURY	3.6250	2043/08/15	500	434	67,333
	US TREASURY	4.3750	2043/08/15	960	927	143,640
	US TREASURY	3.7500	2043/11/15	510	450	69,794
	US TREASURY	4.7500	2043/11/15	980	993	153,827
	US TREASURY	3.6250	2044/02/15	530	458	71,056
	US TREASURY	4.5000	2044/02/15	980	960	148,751
	US TREASURY	3.3750	2044/05/15	490	408	63,212
	US TREASURY	4.6250	2044/05/15	980	975	151,146
	US TREASURY	3.1250	2044/08/15	670	534	82,815
	US TREASURY	4.1250	2044/08/15	630	586	90,806
	US TREASURY	3.0000	2044/11/15	560	436	67,650
	US TREASURY	2.5000	2045/02/15	740	527	81,724
	US TREASURY	3.0000	2045/05/15	340	264	40,900
	US TREASURY	2.8750	2045/08/15	480	364	56,394
	US TREASURY	3.0000	2045/11/15	300	232	35,949
	US TREASURY	2.5000	2046/02/15	600	422	65,417
	US TREASURY	2.5000	2046/05/15	600	420	65,207
	US TREASURY	2.2500	2046/08/15	750	498	77,292
	US TREASURY	2.8750	2046/11/15	340	254	39,411
	US TREASURY	3.0000	2047/02/15	670	510	79,135
	US TREASURY	3.0000	2047/05/15	520	395	61,298
	US TREASURY	2.7500	2047/08/15	730	529	81,968
	US TREASURY	2.7500	2047/11/15	740	535	82,889
	US TREASURY	3.0000	2048/02/15	830	627	97,280
	US TREASURY	3.1250	2048/05/15	890	687	106,562

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						千円	邦貨換算金額
アメリカ			%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY	3.0000	2048/08/15	1,000	753	116,757	
	US TREASURY	3.3750	2048/11/15	1,000	805	124,840	
	US TREASURY	3.0000	2049/02/15	1,080	811	125,639	
	US TREASURY	2.8750	2049/05/15	1,030	754	116,824	
	US TREASURY	2.2500	2049/08/15	1,000	640	99,232	
	US TREASURY	2.3750	2049/11/15	940	618	95,742	
	US TREASURY	2.0000	2050/02/15	1,190	715	110,913	
	US TREASURY	1.3750	2050/08/15	1,540	780	120,910	
	US TREASURY	1.6250	2050/11/15	1,530	828	128,356	
	US TREASURY	1.8750	2051/02/15	1,660	959	148,674	
	US TREASURY	2.3750	2051/05/15	1,720	1,121	173,708	
	US TREASURY	2.0000	2051/08/15	1,710	1,015	157,374	
	US TREASURY	1.8750	2051/11/15	1,580	906	140,410	
	US TREASURY	2.2500	2052/02/15	1,440	906	140,489	
	US TREASURY	2.8750	2052/05/15	1,340	972	150,607	
	US TREASURY	3.0000	2052/08/15	1,310	975	151,176	
	US TREASURY	4.0000	2052/11/15	1,300	1,174	181,983	
	US TREASURY	3.6250	2053/02/15	1,300	1,096	169,876	
	US TREASURY	3.6250	2053/05/15	1,290	1,088	168,631	
	US TREASURY	4.1250	2053/08/15	1,440	1,330	206,172	
	US TREASURY	4.7500	2053/11/15	1,530	1,569	243,131	
	US TREASURY	4.2500	2054/02/15	1,610	1,522	235,919	
	US TREASURY	4.6250	2054/05/15	1,580	1,591	246,554	
	US TREASURY	4.2500	2054/08/15	1,320	1,250	193,649	
	US TREASURY	6.2500	2030/05/15	150	164	25,466	
	US TREASURY	0.6250	2030/05/15	4,420	3,635	563,140	
	US TREASURY	4.3750	2040/05/15	310	304	47,211	
	US TREASURY	4.3750	2041/05/15	300	293	45,537	
	US TREASURY	3.7500	2041/08/15	280	253	39,221	
	US TREASURY	1.2500	2050/05/15	1,380	678	105,158	
小計			－	－	－	－	42,916,152
カナダ					千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	4.5000	2025/11/01	410	414	45,991	
	CANADIAN GOVERNMENT	4.5000	2026/02/01	520	527	58,515	
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2026/03/01	420	404	44,872	
	CANADIAN GOVERNMENT	3.0000	2026/04/01	240	239	26,539	
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2026/05/01	590	596	66,145	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/06/01	190	185	20,567	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
カナダ		%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2026/08/01	480	485	53,923
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2026/09/01	410	394	43,804
	CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2026/11/01	450	450	49,984
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2027/03/01	380	364	40,423
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2027/06/01	200	190	21,099
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/09/01	370	366	40,648
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2028/03/01	330	333	37,052
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/06/01	180	173	19,261
	CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2028/09/01	450	452	50,172
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2029/03/01	600	620	68,907
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/06/01	140	135	15,020
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2029/06/01	190	211	23,458
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2029/09/01	680	690	76,661
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/12/01	130	124	13,841
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2030/03/01	80	78	8,702
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2030/06/01	740	668	74,140
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2030/12/01	640	546	60,612
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/06/01	840	755	83,811
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/12/01	700	623	69,235
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2032/06/01	550	503	55,908
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2032/12/01	480	453	50,367
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2033/06/01	430	413	45,842
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/06/01	190	224	24,868
	CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2033/12/01	490	488	54,181
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2034/03/01	110	111	12,398
	CANADIAN GOVERNMENT	3.0000	2034/06/01	780	760	84,393
	CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2034/12/01	460	457	50,764
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/06/01	120	140	15,551
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/06/01	180	194	21,597
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/01	230	234	26,046
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/01	250	224	24,931
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2051/12/01	910	689	76,509
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2053/12/01	710	499	55,480
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2055/12/01	600	530	58,820
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2064/12/01	150	132	14,710
小計		—	—	—	—	1,785,768
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.2500	2025/11/21	430	413	41,904

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
オーストラリア		%		千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/04/21	460	460	46,685
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.5000	2026/09/21	620	581	58,868
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	540	548	55,546
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	480	462	46,818
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	450	423	42,879
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	440	418	42,370
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	530	511	51,786
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2029/11/21	500	468	47,416
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5000	2030/05/21	550	503	51,045
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2030/12/21	470	388	39,307
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/06/21	590	494	50,116
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2031/11/21	710	566	57,370
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.2500	2032/05/21	700	559	56,645
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2032/11/21	610	499	50,585
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	580	580	58,822
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2033/11/21	590	524	53,091
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2034/05/21	520	488	49,502
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2034/06/21	160	156	15,848
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.5000	2034/12/21	480	439	44,487
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	430	364	36,891
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2035/12/21	310	300	30,455
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/04/21	360	329	33,382
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	230	193	19,646
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2041/05/21	340	259	26,288
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	310	227	23,077
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2051/06/21	450	235	23,876
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2054/06/21	200	192	19,503
小計		—	—	—	—	1,174,220
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	0.5000	2025/11/01	170	166	19,262
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/06/01	240	237	27,533
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.2500	2026/11/01	210	203	23,609
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	210	213	24,688
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2027/09/01	100	100	11,609
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2028/05/01	160	159	18,444
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2028/08/01	100	100	11,620
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2029/04/01	50	50	5,845
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	220	220	25,565

# ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額	
シンガポール			%		千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	200	200	23,236	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.6250	2031/07/01	140	129	15,028	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2032/08/01	120	117	13,650	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	200	207	24,029	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2034/05/01	60	62	7,243	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	200	187	21,735	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2039/07/01	140	130	15,165	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	140	136	15,823	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	200	196	22,712	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2050/03/01	160	133	15,497	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2051/10/01	130	107	12,471	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.2500	2054/06/01	60	65	7,562	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2072/08/01	120	126	14,605	
小計			—	—	—	—	376,940
ニュージーランド					千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	
国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	0.5000	2026/05/15	260	247	22,658	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5000	2027/04/15	190	192	17,628	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	0.2500	2028/05/15	330	289	26,541	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.0000	2029/04/20	250	238	21,852	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5000	2030/05/15	300	303	27,785	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.5000	2031/05/15	220	184	16,896	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.0000	2032/05/15	230	193	17,774	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.5000	2033/04/14	340	315	28,889	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.2500	2034/05/15	170	165	15,150	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5000	2035/05/15	120	118	10,828	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.2500	2036/05/15	150	143	13,114	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2037/04/15	150	120	11,086	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.7500	2041/05/15	130	82	7,566	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2051/05/15	150	98	8,995	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	5.0000	2054/05/15	100	97	8,915	
小計			—	—	—	—	255,684
イギリス					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	
国債証券	UK TREASURY	0.1250	2026/01/30	390	372	73,261	
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	380	363	71,423	
	UK TREASURY	0.3750	2026/10/22	630	586	115,244	
	UK TREASURY	4.1250	2027/01/29	740	735	144,686	
	UK TREASURY	3.7500	2027/03/07	850	837	164,725	
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	410	379	74,683	



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
イギリス		%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円
国債証券	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	370	370	72,876
	UK TREASURY	0.1250	2028/01/31	490	432	85,044
	UK TREASURY	4.5000	2028/06/07	780	784	154,153
	UK TREASURY	1.6250	2028/10/22	360	327	64,424
	UK TREASURY	6.0000	2028/12/07	280	298	58,757
	UK TREASURY	0.5000	2029/01/31	660	567	111,586
	UK TREASURY	4.1250	2029/07/22	660	654	128,741
	UK TREASURY	0.8750	2029/10/22	390	334	65,700
	UK TREASURY	0.3750	2030/10/22	430	345	67,924
	UK TREASURY	4.7500	2030/12/07	510	524	103,088
	UK TREASURY	0.2500	2031/07/31	660	509	100,139
	UK TREASURY	4.0000	2031/10/22	450	441	86,757
	UK TREASURY	1.0000	2032/01/31	810	646	127,180
	UK TREASURY	4.2500	2032/06/07	510	508	100,003
	UK TREASURY	3.2500	2033/01/31	770	710	139,733
	UK TREASURY	0.8750	2033/07/31	760	569	112,017
	UK TREASURY	4.6250	2034/01/31	750	760	149,598
	UK TREASURY	4.2500	2034/07/31	490	482	94,940
	UK TREASURY	4.5000	2034/09/07	360	362	71,212
	UK TREASURY	0.6250	2035/07/31	550	372	73,247
	UK TREASURY	4.2500	2036/03/07	490	478	94,127
	UK TREASURY	1.7500	2037/09/07	490	357	70,381
	UK TREASURY	3.7500	2038/01/29	670	614	120,802
	UK TREASURY	4.7500	2038/12/07	380	384	75,597
	UK TREASURY	1.1250	2039/01/31	560	358	70,450
	UK TREASURY	4.2500	2039/09/07	310	295	58,172
	UK TREASURY	4.3750	2040/01/31	190	183	36,009
	UK TREASURY	4.2500	2040/12/07	350	331	65,156
	UK TREASURY	1.2500	2041/10/22	590	354	69,700
	UK TREASURY	4.5000	2042/12/07	460	444	87,388
	UK TREASURY	4.7500	2043/10/22	580	574	112,967
	UK TREASURY	3.2500	2044/01/22	510	409	80,603
	UK TREASURY	3.5000	2045/01/22	470	389	76,527
	UK TREASURY	0.8750	2046/01/31	400	192	37,873
	UK TREASURY	4.2500	2046/12/07	400	367	72,183
	UK TREASURY	1.5000	2047/07/22	440	239	47,153
	UK TREASURY	1.7500	2049/01/22	290	163	32,195
	UK TREASURY	4.2500	2049/12/07	310	282	55,594

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						千円	邦貨換算金額
イギリス			%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円
国債証券	UK TREASURY		0.6250	2050/10/22	470	182	35,916
	UK TREASURY		1.2500	2051/07/31	620	290	57,045
	UK TREASURY		3.7500	2052/07/22	300	249	49,142
	UK TREASURY		1.5000	2053/07/31	520	253	49,858
	UK TREASURY		3.7500	2053/10/22	650	538	105,835
	UK TREASURY		4.3750	2054/07/31	450	415	81,763
	UK TREASURY		1.6250	2054/10/22	330	164	32,413
	UK TREASURY		4.2500	2055/12/07	410	371	73,069
	UK TREASURY		1.7500	2057/07/22	490	248	48,759
	UK TREASURY		4.0000	2060/01/22	310	268	52,742
	UK TREASURY		0.5000	2061/10/22	600	174	34,231
	UK TREASURY		4.0000	2063/10/22	330	283	55,827
	UK TREASURY		2.5000	2065/07/22	370	222	43,710
	UK TREASURY		3.5000	2068/07/22	390	302	59,512
	UK TREASURY		1.6250	2071/10/22	440	191	37,715
	UK TREASURY		1.1250	2073/10/22	250	87	17,261
小計			—	—	—	—	4,708,844
イスラエル					千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル	
国債証券	ISRAEL FIXED BOND		0.5000	2026/02/27	660	631	26,154
	ISRAEL FIXED BOND		6.2500	2026/10/30	330	342	14,180
	ISRAEL FIXED BOND		2.0000	2027/03/31	580	556	23,043
	ISRAEL FIXED BOND		3.7500	2027/09/30	420	414	17,151
	ISRAEL FIXED BOND		2.2500	2028/09/28	740	685	28,375
	ISRAEL FIXED BOND		3.7500	2029/02/28	800	799	33,090
	ISRAEL FIXED BOND		1.0000	2030/03/31	880	740	30,657
	ISRAEL FIXED BOND		1.3000	2032/04/30	690	553	22,911
	ISRAEL FIXED BOND		4.0000	2035/03/30	390	377	15,631
	ISRAEL FIXED BOND		1.5000	2037/05/31	740	517	21,437
	ISRAEL FIXED BOND		5.5000	2042/01/31	520	576	23,878
	ISRAEL FIXED BOND		3.7500	2047/03/31	600	512	21,190
	ISRAEL FIXED BOND		2.8000	2052/11/29	400	274	11,355
小計			—	—	—	—	289,059
デンマーク					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	
国債証券	KINGDOM OF DENMARK		1.7500	2025/11/15	1,580	1,577	34,730
	KINGDOM OF DENMARK		2.2500	2026/11/15	640	645	14,217
	KINGDOM OF DENMARK		0.5000	2027/11/15	1,290	1,243	27,371
	KINGDOM OF DENMARK		0.5000	2029/11/15	1,200	1,123	24,738
	KINGDOM OF DENMARK		0.0000	2031/11/15	1,200	1,050	23,137

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
							邦貨換算金額
デンマーク			%		千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円
国債証券	KINGDOM OF DENMARK		2.2500	2033/11/15	1,330	1,352	29,774
	KINGDOM OF DENMARK		4.5000	2039/11/15	2,390	3,067	67,547
	KINGDOM OF DENMARK		0.2500	2052/11/15	1,490	877	19,327
	小計		—	—	—	—	240,845
ノルウェー					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.5000	2026/02/19	1,360	1,319	18,642
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.7500	2027/02/17	1,240	1,186	16,760
	NORWEGIAN GOVERNMENT		2.0000	2028/04/26	1,060	1,003	14,174
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.7500	2029/09/06	970	890	12,580
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.3750	2030/08/19	1,280	1,131	15,983
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.2500	2031/09/17	1,060	908	12,832
	NORWEGIAN GOVERNMENT		2.1250	2032/05/18	1,070	963	13,616
	NORWEGIAN GOVERNMENT		3.0000	2033/08/15	1,340	1,269	17,941
	NORWEGIAN GOVERNMENT		3.6250	2034/04/13	1,010	1,002	14,161
	NORWEGIAN GOVERNMENT		3.5000	2042/10/06	470	461	6,518
	小計		—	—	—	—	143,211
スウェーデン					千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT		1.0000	2026/11/12	2,020	1,988	28,256
	SWEDISH GOVERNMENT		0.7500	2028/05/12	1,740	1,675	23,808
	SWEDISH GOVERNMENT		0.7500	2029/11/12	1,750	1,653	23,497
	SWEDISH GOVERNMENT		0.1250	2031/05/12	1,300	1,154	16,399
	SWEDISH GOVERNMENT		2.2500	2032/06/01	1,070	1,086	15,434
	SWEDISH GOVERNMENT		1.7500	2033/11/11	1,360	1,324	18,815
	SWEDISH GOVERNMENT		2.2500	2035/05/11	600	606	8,616
	SWEDISH GOVERNMENT		3.5000	2039/03/30	1,010	1,159	16,480
	小計		—	—	—	—	151,309
メキシコ					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT		5.7500	2026/03/05	9,150	8,697	66,988
	MEX BONOS DESARR FIX RT		7.0000	2026/09/03	7,100	6,773	52,171
	MEX BONOS DESARR FIX RT		5.5000	2027/03/04	9,220	8,411	64,782
	MEX BONOS DESARR FIX RT		7.5000	2027/06/03	7,720	7,361	56,696
	MEX BONOS DESARR FIX RT		8.5000	2029/03/01	6,650	6,355	48,952
	MEX BONOS DESARR FIX RT		8.5000	2029/05/31	7,440	7,116	54,811
	MEX BONOS DESARR FIX RT		7.7500	2031/05/29	9,280	8,434	64,963
	MEX BONOS DESARR FIX RT		7.5000	2033/05/26	7,250	6,288	48,434
	MEX BONOS DESARR FIX RT		7.7500	2034/11/23	5,320	4,625	35,621
	MEX BONOS DESARR FIX RT		8.0000	2035/05/24	600	529	4,076

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
							邦貨換算金額
メキシコ			%		千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	1,650	1,672	12,883	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	4,910	4,381	33,745	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	8,570	6,900	53,142	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	5,940	4,830	37,204	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2053/07/31	7,450	5,989	46,129	
小計			-	-	-	-	680,605
中国					千人民元	千人民元	
国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.3300	2025/12/15	9,000	9,092	194,713	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.4600	2026/02/15	7,000	7,091	151,876	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.0300	2026/03/11	1,200	1,226	26,272	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1.9900	2026/03/15	4,000	4,033	86,377	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.3000	2026/05/15	17,600	17,832	381,891	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1.6700	2026/06/15	14,500	14,589	312,446	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.6900	2026/08/12	17,400	17,785	380,894	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.1800	2026/08/15	6,000	6,080	130,208	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.3900	2026/11/15	12,500	12,735	272,745	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.3700	2027/01/20	3,200	3,262	69,868	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.0400	2027/02/25	16,000	16,205	347,047	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.4800	2027/04/15	6,700	6,861	146,946	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1.8500	2027/05/15	10,000	10,094	216,180	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	9,800	10,041	215,053	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1.6200	2027/08/15	5,000	5,022	107,549	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.4400	2027/10/15	10,300	10,563	226,221	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.6400	2028/01/15	4,400	4,547	97,379	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.6200	2028/04/15	10,200	10,546	225,856	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.0100	2028/05/13	10,920	11,451	245,236	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.4000	2028/07/15	11,300	11,600	248,427	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.9100	2028/10/14	5,400	5,655	121,106	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.5500	2028/10/15	11,400	11,772	252,112	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.3700	2029/01/15	17,000	17,462	373,980	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.8000	2029/03/24	3,600	3,761	80,552	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.0500	2029/04/15	10,000	10,146	217,294	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/06/15	4,500	4,700	100,674	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1.9100	2029/07/15	10,200	10,282	220,202	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.6200	2029/09/25	5,300	5,514	118,100	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.7900	2029/12/15	6,900	7,243	155,130	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.8000	2030/03/25	8,400	8,831	189,131	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.6800	2030/05/21	6,500	6,802	145,680	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額			
							邦貨換算金額		
中国			%		千人民元	千人民元	千円		
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.6200	2030/06/25	7,400	7,704	164,989		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.6000	2030/09/15	12,300	12,806	274,252		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.5400	2030/12/25	13,800	14,307	306,412		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.2800	2031/03/25	9,000	9,180	196,611		
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.0200	2031/05/27	7,000	7,486	160,319		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.1200	2031/06/25	7,600	7,675	164,372		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.8900	2031/11/18	4,140	4,397	94,170		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.7500	2032/02/17	5,000	5,265	112,767		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.7600	2032/05/15	4,100	4,318	92,479		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.6900	2032/08/15	5,400	5,660	121,225		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.6000	2032/09/01	4,000	4,164	89,184		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.8000	2032/11/15	5,700	6,020	128,934		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.8800	2033/02/25	4,100	4,358	93,346		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.6700	2033/05/25	7,900	8,256	176,810		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.5200	2033/08/25	6,400	6,609	141,546		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.6700	2033/11/25	8,400	8,781	188,069		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.3500	2034/02/25	10,600	10,802	231,339		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.2700	2034/05/25	12,400	12,550	268,778		
		CHINA GOVERNMENT BOND	2.1100	2034/08/25	2,100	2,102	45,023		
		CHINA GOVERNMENT BOND	4.0800	2048/10/22	1,600	2,107	45,126		
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.8600	2049/07/22	4,900	6,317	135,299		
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.3900	2050/03/16	700	842	18,033		
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.8100	2050/09/14	1,200	1,541	33,002		
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.7200	2051/04/12	1,260	1,604	34,367		
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.5300	2051/10/18	3,650	4,524	96,893		
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.3200	2052/04/15	5,400	6,474	138,645		
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.1200	2052/10/25	5,800	6,734	144,222		
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.1900	2053/04/15	7,400	8,710	186,540		
		CHINA GOVERNMENT BOND	3.0000	2053/10/15	10,300	11,794	252,581		
		小計			—	—	—	—	10,192,509
		マレーシア					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	
マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/04/15	360	364	12,652		
		MALAYSIA GOVERNMENT	3.9060	2026/07/15	350	352	12,233		
		MALAYSIA GOVERNMENT	3.9000	2026/11/30	470	474	16,449		
		MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/03/15	610	615	21,345		
		MALAYSIA GOVERNMENT	3.8990	2027/11/16	530	535	18,574		
		MALAYSIA GOVERNMENT	3.5190	2028/04/20	350	349	12,113		

# ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
マレーシア		%		千円・シア・リンギット	千円・シア・リンギット	千円
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/06/15	550	552	19,161
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.5040	2029/04/30	230	238	8,262
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8850	2029/08/15	640	646	22,425
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/04/15	610	633	21,959
	MALAYSIA GOVERNMENT	2.6320	2031/04/15	680	635	22,028
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	380	389	13,494
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.5820	2032/07/15	390	383	13,288
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	410	408	14,176
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.6420	2033/11/07	570	603	20,914
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8280	2034/07/05	460	458	15,912
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/05/31	350	359	12,468
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	590	635	22,028
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.8930	2038/06/08	550	601	20,863
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.0540	2039/04/18	250	252	8,750
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7570	2040/05/22	540	523	18,157
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.6960	2042/10/15	560	603	20,932
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	190	210	7,306
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1800	2044/05/16	220	223	7,733
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	240	260	9,038
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9210	2048/07/06	410	458	15,883
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.0650	2050/06/15	640	631	21,892
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4570	2053/03/31	500	522	18,126
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.5020	2027/05/31	340	340	11,788
小計		—	—	—	—	459,964
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	1,190	1,144	43,363
	POLAND GOVERNMENT BOND	0.2500	2026/10/25	930	851	32,274
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.7500	2027/05/25	770	748	28,373
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	1,000	939	35,593
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	890	827	31,353
	POLAND GOVERNMENT BOND	7.5000	2028/07/25	1,030	1,111	42,113
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/04/25	1,120	1,142	43,301
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.7500	2029/07/25	1,040	1,017	38,568
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/10/25	1,220	1,088	41,248
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.2500	2030/10/25	1,170	929	35,226
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.7500	2032/04/25	1,100	851	32,293
	POLAND GOVERNMENT BOND	6.0000	2033/10/25	1,180	1,213	45,987
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.0000	2034/10/25	480	456	17,307
	小計					467,006

# ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
アイルランド						
国債証券	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/05/15	260	255	41,952
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.2000	2027/05/15	190	181	29,759
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.9000	2028/05/15	190	181	29,868
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.1000	2029/05/15	230	218	35,849
	IRELAND GOVERNMENT BOND	2.4000	2030/05/15	220	220	36,199
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.2000	2030/10/18	180	158	26,057
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3500	2031/03/18	160	150	24,652
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2031/10/18	200	169	27,766
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3000	2033/05/15	130	117	19,356
	IRELAND GOVERNMENT BOND	2.6000	2034/10/18	110	109	18,044
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.4000	2035/05/15	120	95	15,647
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.7000	2037/05/15	170	151	24,843
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.5500	2041/04/22	90	63	10,421
	IRELAND GOVERNMENT BOND	3.0000	2043/10/18	90	92	15,153
	IRELAND GOVERNMENT BOND	2.0000	2045/02/18	250	217	35,701
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2050/05/15	210	160	26,372
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.3500	2032/10/18	120	101	16,710
小計		—	—	—	—	434,358
オランダ						
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2026/01/15	270	263	43,245
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2026/07/15	390	379	62,390
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2027/01/15	360	344	56,513
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2027/07/15	410	395	64,935
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/01/15	300	329	54,188
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2028/07/15	430	407	67,004
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2029/01/15	370	337	55,366
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2029/07/15	280	255	41,897
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2030/01/15	280	282	46,376
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2030/07/15	320	280	46,116
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2031/07/15	350	299	49,153
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2032/07/15	310	268	44,077
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/01/15	360	360	59,221
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/07/15	280	279	45,919
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2034/07/15	270	268	44,080
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/01/15	410	465	76,545
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2038/01/15	320	224	36,925
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2040/01/15	360	262	43,052

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
オランダ						
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/01/15	430	490	80,514
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.2500	2044/01/15	210	226	37,197
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/01/15	460	463	76,202
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2052/01/15	450	223	36,733
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2054/01/15	310	268	44,033
小計		—	—	—	—	1,211,691
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/03/28	260	267	43,935
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/06/22	380	372	61,181
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2027/06/22	390	375	61,675
	BELGIUM KINGDOM	0.0000	2027/10/22	250	233	38,403
	BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	470	516	84,825
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2028/06/22	400	378	62,183
	BELGIUM KINGDOM	0.9000	2029/06/22	470	438	72,027
	BELGIUM KINGDOM	2.7000	2029/10/22	200	201	33,156
	BELGIUM KINGDOM	0.1000	2030/06/22	330	288	47,421
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/06/22	400	360	59,277
	BELGIUM KINGDOM	0.0000	2031/10/22	320	266	43,825
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/03/28	210	227	37,400
	BELGIUM KINGDOM	0.3500	2032/06/22	370	309	50,884
	BELGIUM KINGDOM	1.2500	2033/04/22	280	249	40,961
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2033/06/22	440	446	73,409
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/06/22	220	222	36,588
	BELGIUM KINGDOM	2.8500	2034/10/22	330	328	53,986
	BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	470	556	91,355
	BELGIUM KINGDOM	1.4500	2037/06/22	160	133	21,941
	BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/06/22	210	182	29,974
	BELGIUM KINGDOM	2.7500	2039/04/22	170	162	26,775
	BELGIUM KINGDOM	0.4000	2040/06/22	200	131	21,680
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/03/28	400	452	74,312
	BELGIUM KINGDOM	3.4500	2043/06/22	100	102	16,814
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/06/22	230	245	40,295
	BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/06/22	250	182	29,967
	BELGIUM KINGDOM	1.7000	2050/06/22	250	179	29,442
	BELGIUM KINGDOM	1.4000	2053/06/22	240	153	25,212
	BELGIUM KINGDOM	3.3000	2054/06/22	250	243	40,043
	BELGIUM KINGDOM	3.5000	2055/06/22	190	191	31,437



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2057/06/22	190	146	24,043
	BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/06/22	200	149	24,498
	BELGIUM KINGDOM	0.6500	2071/06/22	160	67	11,160
小計		—	—	—	—	1,440,099
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	820	808	132,802
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2026/02/25	1,060	1,030	169,200
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/04/25	1,010	1,026	168,630
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/05/25	1,170	1,139	187,139
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2026/09/24	1,060	1,063	174,631
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	910	873	143,443
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2027/02/25	1,080	1,024	168,292
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2027/05/25	1,030	995	163,567
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2027/09/24	770	771	126,668
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	1,420	1,432	235,297
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/02/25	1,170	1,106	181,780
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/05/25	1,470	1,383	227,258
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/11/25	1,360	1,266	208,061
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2029/02/25	1,310	1,317	216,357
	FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/04/25	970	1,084	178,230
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2029/05/25	1,340	1,220	200,550
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2029/11/25	1,100	965	158,574
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2030/02/25	540	541	88,916
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/05/25	1,480	1,466	240,975
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2030/11/25	1,300	1,106	181,740
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/05/25	1,480	1,370	225,170
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2031/11/25	1,310	1,079	177,259
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2032/05/25	940	760	124,962
	FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	800	961	157,877
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2032/11/25	1,160	1,085	178,281
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2033/05/25	970	973	159,848
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2033/11/25	1,090	1,133	186,148
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2034/05/25	1,340	1,146	188,413
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2034/11/25	610	606	99,649
	FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/04/25	680	780	128,263
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/05/25	1,110	909	149,431
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2038/05/25	680	532	87,494

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	邦貨換算金額 千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	600	651	106,972
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2039/06/25	800	664	109,147
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2040/05/25	670	444	72,993
	FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/04/25	880	1,010	166,048
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2043/05/25	480	422	69,413
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2044/06/25	510	304	49,949
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/05/25	720	706	116,004
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2048/05/25	710	548	90,047
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2049/06/25	210	195	32,136
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2050/05/25	750	505	83,070
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2052/05/25	760	401	66,019
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2053/05/25	770	397	65,243
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2054/05/25	600	542	89,183
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/04/25	520	565	92,829
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2055/05/25	370	349	57,446
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/04/25	500	546	89,775
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/05/25	410	260	42,770
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2072/05/25	310	114	18,734
小計		—	—	—	—	6,832,706
ドイツ						
国債証券	BUNDESobligation	0.0000	2026/04/10	640	621	102,096
	BUNDESobligation	0.0000	2026/10/09	550	529	86,915
	BUNDESobligation	0.0000	2027/04/16	510	485	79,776
	BUNDESobligation	1.3000	2027/10/15	220	215	35,409
	BUNDESobligation	1.3000	2027/10/15	680	666	109,425
	BUNDESobligation	2.2000	2028/04/13	570	572	94,038
	BUNDESobligation	2.4000	2028/10/19	670	677	111,294
	BUNDESobligation	2.1000	2029/04/12	90	89	14,765
	BUNDESobligation	2.1000	2029/04/12	590	589	96,763
	BUNDESobligation	2.5000	2029/10/11	320	324	53,385
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	760	744	122,309
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	740	713	117,280
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	710	682	112,179
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2027/08/15	760	729	119,916
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2027/11/15	500	470	77,317
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2028/02/15	640	610	100,232
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2028/08/15	660	618	101,603

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ						
国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2028/11/15	620	572	93,995
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2029/02/15	670	622	102,197
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2029/08/15	670	608	99,935
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.1000	2029/11/15	590	588	96,674
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/01/04	270	322	53,024
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/02/15	640	574	94,376
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	230	204	33,564
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	760	675	110,890
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.4000	2030/11/15	620	627	103,033
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/02/15	630	552	90,833
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/08/15	210	182	29,912
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/08/15	740	641	105,382
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2032/02/15	700	598	98,377
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7000	2032/08/15	640	617	101,367
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.3000	2033/02/15	210	210	34,637
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.3000	2033/02/15	880	883	145,070
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.6000	2033/08/15	690	707	116,187
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.2000	2034/02/15	800	793	130,281
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/07/04	570	688	113,150
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.6000	2034/08/15	610	624	102,545
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2035/05/15	550	429	70,631
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2036/05/15	600	455	74,856
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	640	743	122,057
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2038/05/15	600	497	81,759
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	440	532	87,415
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	490	628	103,304
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.6000	2041/05/15	180	181	29,740
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	450	494	81,247
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	710	704	115,805
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	730	724	119,054
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	850	658	108,141
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	280	148	24,416
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	980	519	85,292
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2052/08/15	760	383	62,968
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8000	2053/08/15	220	187	30,857
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8000	2053/08/15	680	579	95,218
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2054/08/15	430	426	70,119

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	邦貨換算金額 千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ						
国債証券	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	3.1000	2025/12/12	310	312	51,333
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.5000	2026/03/19	420	421	69,228
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.9000	2026/06/18	430	434	71,392
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.7000	2026/09/17	410	413	67,993
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.0000	2026/12/10	20	19	3,277
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	300	333	54,774
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	380	420	69,100
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	330	360	59,244
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	480	570	93,673
小計		—	—	—	—	5,293,058
ポルトガル						
国債証券	OBRIGACOES DO TESOURO	2.8750	2026/07/21	260	262	43,192
	OBRIGACOES DO TESOURO	0.7000	2027/10/15	370	355	58,405
	OBRIGACOES DO TESOURO	2.1250	2028/10/17	370	369	60,661
	OBRIGACOES DO TESOURO	1.9500	2029/06/15	300	296	48,629
	OBRIGACOES DO TESOURO	3.8750	2030/02/15	170	183	30,073
	OBRIGACOES DO TESOURO	0.4750	2030/10/18	260	233	38,380
	OBRIGACOES DO TESOURO	0.3000	2031/10/17	210	181	29,868
	OBRIGACOES DO TESOURO	1.6500	2032/07/16	160	150	24,695
	OBRIGACOES DO TESOURO	2.2500	2034/04/18	200	192	31,643
	OBRIGACOES DO TESOURO	2.8750	2034/10/20	130	131	21,535
	OBRIGACOES DO TESOURO	0.9000	2035/10/12	160	131	21,531
	OBRIGACOES DO TESOURO	4.1000	2037/04/15	240	268	44,065
	OBRIGACOES DO TESOURO	3.5000	2038/06/18	110	115	19,026
	OBRIGACOES DO TESOURO	1.1500	2042/04/11	120	88	14,484
	OBRIGACOES DO TESOURO	4.1000	2045/02/15	150	169	27,843
	OBRIGACOES DO TESOURO	1.0000	2052/04/12	150	90	14,825
	OBRIGACOES DO TESOURO	3.6250	2054/06/12	70	73	12,071
小計		—	—	—	—	540,935
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	590	588	96,690
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2026/01/31	490	476	78,228
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	530	527	86,608
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.8000	2026/05/31	540	543	89,222
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	560	592	97,331
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	650	637	104,748
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2027/01/31	530	503	82,697

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	590	578	94,963
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.5000	2027/05/31	520	520	85,582
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2027/07/30	530	507	83,446
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	580	564	92,699
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2028/01/31	640	592	97,293
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/04/30	630	608	99,936
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/07/30	570	548	90,143
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	500	549	90,205
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/01/31	610	694	114,056
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2029/04/30	550	525	86,258
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.5000	2029/05/31	550	571	93,891
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2029/07/30	620	571	93,928
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6000	2029/10/31	580	527	86,580
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2030/04/30	600	536	88,101
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/07/30	590	568	93,451
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2500	2030/10/31	680	627	103,075
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.1000	2031/04/30	640	542	89,157
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.1000	2031/07/30	130	132	21,811
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2031/10/31	580	498	81,938
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7000	2032/04/30	620	534	87,751
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/07/30	600	721	118,512
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.5500	2032/10/31	530	519	85,307
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.1500	2033/04/30	550	560	92,091
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.3500	2033/07/30	500	479	78,690
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.5500	2033/10/31	560	586	96,305
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.2500	2034/04/30	570	581	95,594
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2034/10/31	540	559	91,838
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.8500	2035/07/30	540	480	78,945
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/01/31	510	562	92,376
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8500	2037/07/30	380	286	47,043
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.9000	2039/07/30	390	414	68,146
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/07/30	480	568	93,349
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2000	2040/10/31	450	329	54,148
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/07/30	510	593	97,566
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0000	2042/07/30	310	211	34,779
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2043/07/30	350	347	57,096
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	410	507	83,438

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	邦貨換算金額 千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	460	418	68,784
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7000	2048/10/31	450	390	64,222
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0000	2050/10/31	500	288	47,375
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9000	2052/10/31	460	325	53,469
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0000	2054/10/31	180	191	31,437
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/07/30	370	352	57,906
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2071/10/31	170	88	14,549
	小計	—	—	—	—	4,112,782
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2025/11/15	430	429	70,619
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/01	480	477	78,429
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2026/01/15	400	404	66,372
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2000	2026/01/28	350	352	57,880
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5000	2026/02/01	440	429	70,552
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/03/01	540	553	90,863
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2026/04/01	480	464	76,234
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8000	2026/04/15	370	376	61,796
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6000	2026/06/01	510	503	82,712
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1000	2026/07/15	410	407	66,935
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2026/08/01	440	421	69,321
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1000	2026/08/28	210	211	34,801
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2026/09/15	440	450	73,923
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2500	2026/12/01	490	478	78,573
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.8500	2027/01/15	460	444	72,973
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.9500	2027/02/15	390	393	64,579
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.1000	2027/04/01	390	377	62,001
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2000	2027/06/01	470	466	76,616
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2027/07/15	310	316	52,009
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0500	2027/08/01	450	444	72,958
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2027/09/15	510	487	80,128
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5000	2027/11/01	630	699	114,916
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.6500	2027/12/01	420	420	69,101
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2028/02/01	550	539	88,697
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.2500	2028/03/15	450	416	68,344
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4000	2028/04/01	420	429	70,588
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5000	2028/07/15	380	351	57,733
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8000	2028/08/01	400	414	68,145

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/09/01	610	654	107,484
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2028/12/01	510	512	84,117
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.1000	2029/02/01	410	430	70,755
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.4500	2029/02/15	360	326	53,708
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2029/06/15	370	369	60,686
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.3500	2029/07/01	420	428	70,434
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0000	2029/08/01	520	524	86,119
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0000	2029/10/01	170	170	28,035
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/01	700	778	127,814
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2029/12/15	530	553	90,849
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/03/01	650	669	110,023
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2030/04/01	520	479	78,751
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7000	2030/06/15	370	382	62,908
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2030/08/01	430	384	63,093
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2030/11/15	370	388	63,858
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2030/12/01	540	498	81,913
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2031/02/15	390	398	65,475
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9000	2031/04/01	610	533	87,669
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/05/01	740	867	142,527
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2031/07/15	350	356	58,528
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6000	2031/08/01	490	416	68,403
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2031/10/30	260	274	45,103
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1500	2031/11/15	220	219	36,036
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2031/12/01	460	396	65,207
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/03/01	630	569	93,474
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2032/06/01	480	408	67,154
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2032/12/01	450	426	70,111
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/02/01	610	716	117,739
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.4000	2033/05/01	490	529	87,050
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2033/09/01	440	412	67,679
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.3500	2033/11/01	490	527	86,622
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2000	2034/03/01	470	499	82,064
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2034/07/01	450	464	76,337
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/08/01	640	722	118,677
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2035/02/01	290	298	49,000
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.3500	2035/03/01	430	425	69,909
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2035/04/30	300	314	51,723

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	邦貨換算金額 千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2036/03/01	350	281	46,311
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/09/01	400	349	57,382
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/02/01	760	793	130,282
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2037/03/01	400	295	48,489
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0500	2037/10/30	210	218	35,900
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2038/03/01	300	285	46,910
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.9500	2038/09/01	380	349	57,388
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/08/01	600	681	111,921
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.1500	2039/10/01	340	352	57,901
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1000	2040/03/01	320	293	48,280
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/09/01	550	623	102,485
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8000	2041/03/01	410	309	50,830
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.4500	2043/09/01	300	320	52,569
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/09/01	470	522	85,866
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2045/04/30	320	214	35,246
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/09/01	420	378	62,221
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/03/01	430	353	57,997
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2048/03/01	440	406	66,784
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2049/09/01	410	401	65,989
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2050/09/01	380	288	47,456
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7000	2051/09/01	390	250	41,153
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2052/09/01	220	154	25,316
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2053/10/01	320	343	56,437
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.3000	2054/10/01	250	257	42,259
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/03/01	220	169	27,885
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2072/03/01	170	108	17,855
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/01	240	261	42,980
小計		-	-	-	-	6,366,971
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/04/15	170	165	27,249
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2026/09/15	90	86	14,195
	FINNISH GOVERNMENT	1.3750	2027/04/15	100	97	16,087
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2027/09/15	140	133	21,922
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/07/04	120	121	20,008
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2028/09/15	170	158	26,039
	FINNISH GOVERNMENT	2.8750	2029/04/15	140	142	23,419
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2029/09/15	170	155	25,500



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						邦貨換算金額
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	2.5000	2030/04/15	120	120	19,725
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2030/09/15	130	112	18,474
	FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/04/15	110	98	16,155
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2031/09/15	140	118	19,494
	FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2032/09/15	140	128	21,108
	FINNISH GOVERNMENT	3.0000	2033/09/15	190	194	31,875
	FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2034/04/15	130	112	18,481
	FINNISH GOVERNMENT	3.0000	2034/09/15	120	122	20,068
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2036/04/15	120	88	14,478
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2038/04/15	90	88	14,473
	FINNISH GOVERNMENT	0.2500	2040/09/15	90	59	9,761
	FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/07/04	140	133	21,901
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2043/04/15	100	65	10,681
	FINNISH GOVERNMENT	1.3750	2047/04/15	140	103	17,059
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2052/04/15	100	48	7,901
	FINNISH GOVERNMENT	2.9500	2055/04/15	110	108	17,861
小計		—	—	—	—	453,927
オーストリア						
国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	190	196	32,220
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.0000	2026/07/15	130	129	21,265
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2026/10/20	380	369	60,705
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2027/04/20	350	335	55,151
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	210	231	37,975
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2028/02/20	310	294	48,434
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2028/10/20	260	237	38,967
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2029/02/20	340	314	51,599
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.9000	2029/05/23	120	122	20,106
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.5000	2029/10/20	100	100	16,459
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2030/02/20	310	272	44,768
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4500	2030/10/20	160	167	27,582
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2031/02/20	370	315	51,849
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.9000	2032/02/20	300	265	43,669
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.9000	2033/02/20	400	405	66,646
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.9000	2034/02/20	280	283	46,495
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/05/23	210	203	33,489
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.2500	2036/10/20	200	147	24,169
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	350	395	64,918
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.2000	2039/07/15	90	92	15,227

# ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					邦貨換算金額	
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
オーストリア						
国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2040/10/20	160	100	16,547
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/06/20	210	214	35,203
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/02/20	230	175	28,819
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.8500	2049/05/23	150	121	19,920
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2051/03/20	240	143	23,607
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2053/10/20	120	122	20,058
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/01/26	100	117	19,272
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7000	2071/04/20	140	65	10,761
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2086/11/02	80	49	8,146
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1000	2117/09/20	130	101	16,648
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.8500	2120/06/30	120	54	8,917
	小計	—	—	—	—	1,009,605
ユーロ小計		—	—	—	—	27,696,137
合計		—	—	—	—	91,538,259

投資信託財産の構成			2024年11月20日現在
項目	当期末		
	評価額	比率	
	千円		%
公社債	91,538,259		98.4
コール・ローン等、その他	1,482,788		1.6
投資信託財産総額	93,021,048		100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル154.91円、1カナダ・ドル110.98円、1オーストラリア・ドル101.30円、1シンガポール・ドル115.86円、1ニュージーランド・ドル91.69円、1イギリス・ポンド196.60円、1イスラエル・シェケル41.387円、1デンマーク・クローネ22.02円、1ノルウェー・クローネ14.13円、1スウェーデン・クローナ14.21円、1メキシコ・ペソ7.701円、1人民元21.415円、1マレーシア・リンギット34.667円、1ポーランド・ズロチ37.904円、1ユーロ164.27円です。

(注2) 外貨建純資産（92,515,496千円）の投資信託財産総額（93,021,048千円）に対する比率は99.5%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	93,067,446,882円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	857,912,337
公 社 債(評価額)	91,538,259,497
未 収 入 金	57,322,000
未 収 利 息	555,900,675
前 払 費 用	58,052,373
(B)負債	517,514,897
未 払 金	243,166,837
未 払 解 約 金	274,348,060
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	92,549,931,985
元 本	51,547,252,121
次 期 繰 越 損 益 金	41,002,679,864
(D)受 益 権 総 口 数	51,547,252,121口
1万口当たり基準価額 (C / D)	17,954円

- (注1) 期首元本額 47,657,979,877円  
期中追加設定元本額 9,522,485,855円  
期中一部解約元本額 5,633,213,611円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。  
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型) 3,719,554,724円  
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) 6,943,025,077円  
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) 3,119,770,989円  
ニッセイ外国債券インデックス S A (適格機関投資家限定) 948,516,964円  
ニッセイインデックスバランス (債券重視型)  
S A (適格機関投資家限定) 1,748,607円  
ニッセイインデックスバランス (標準型)  
S A (適格機関投資家限定) 1,820,511円  
ニッセイインデックスバランス (成長型)  
S A (適格機関投資家限定) 4,169,717円  
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券  
インデックスファンド 16,419,568,826円  
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス  
バランスファンド (4資産均等型) 9,407,607,078円  
DCニッセイ外国債券インデックス 5,312,167,039円  
DCニッセイターゲットデートファンド2055 415,696,244円  
DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型) 2,277,794,873円  
DCニッセイターゲットデートファンド2045 481,210,463円  
DCニッセイターゲットデートファンド2035 658,843,100円  
DCニッセイターゲットデートファンド2025 47,605,942円  
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス  
バランスファンド (6資産均等型) 232,962,464円  
ニッセイ・インデックスパッケージ  
(内外・株式/リート/債券) 23,409,296円  
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス  
バランスファンド (8資産均等型) 53,877,032円  
DCニッセイターゲットデートファンド2060 343,759,203円  
DCニッセイターゲットデートファンド2050 233,207,795円  
DCニッセイターゲットデートファンド2040 418,890,043円  
DCニッセイターゲットデートファンド2030 229,579,308円  
FWニッセイ外国債券インデックス 87,499,591円  
DCニッセイターゲットデートファンド2065 161,963,647円  
DCニッセイターゲットデートファンド2070 3,003,588円

## 損益の状況

当期 (2024年5月21日~2024年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	1,111,665,457円
受 取 利 息	1,111,656,322
そ の 他 収 益 金	9,135
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 183,191,904
売 買 益	1,521,544,924
売 買 損	△ 1,704,736,828
(C)信 託 報 酬 等	△ 14,988,773
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	913,484,780
(E)前 期 繰 越 損 益 金	37,079,358,443
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	7,310,657,552
(G)解 約 差 損 益 金	△ 4,300,820,911
(H)合 計 (D + E + F + G)	41,002,679,864
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	41,002,679,864

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
- (注2) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。
- (注3) (G)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

## 指数に関して

### ■ファンドのベンチマーク等について

#### ・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。

#### ・NOMURA-BPI総合

NOMURA-BPI総合は、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。"

#### ・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。

#### ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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