

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

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。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

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期末 (2025.2.21)	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値化しています。

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・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つたことなどを背景に物価上昇への懸念が高まつ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。

DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）

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%	信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は11,368円です。
(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"> ・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	19	0.165	

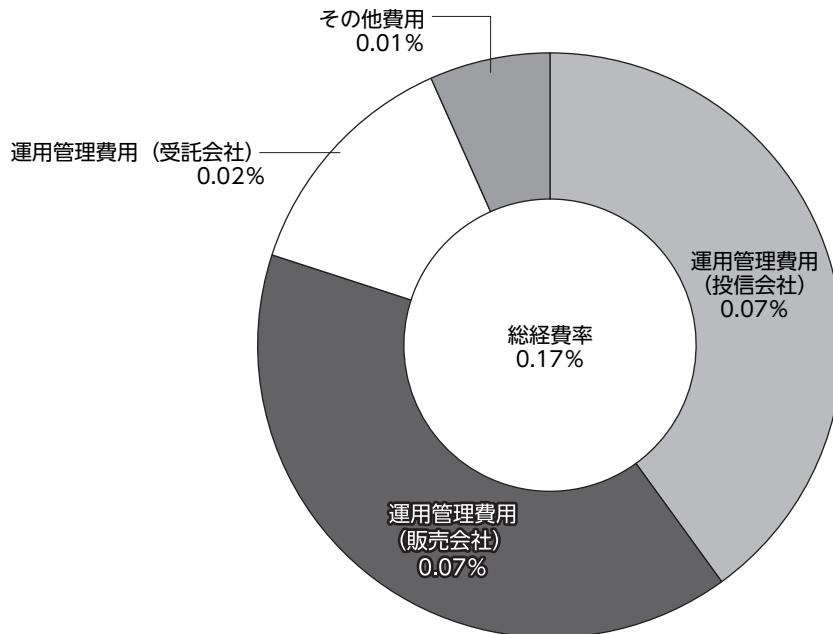
(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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きました。

■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る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随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受けて上昇を続け、結局、期初を上回る水準で当期末を迎きました。

■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（CPI）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（ECB）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FRBや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や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つ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FOMC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ECB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ECB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つたものの、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つ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、YCC）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によっ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つ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随して推移しました。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T O P I X（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N O M U R A – B P I 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＞

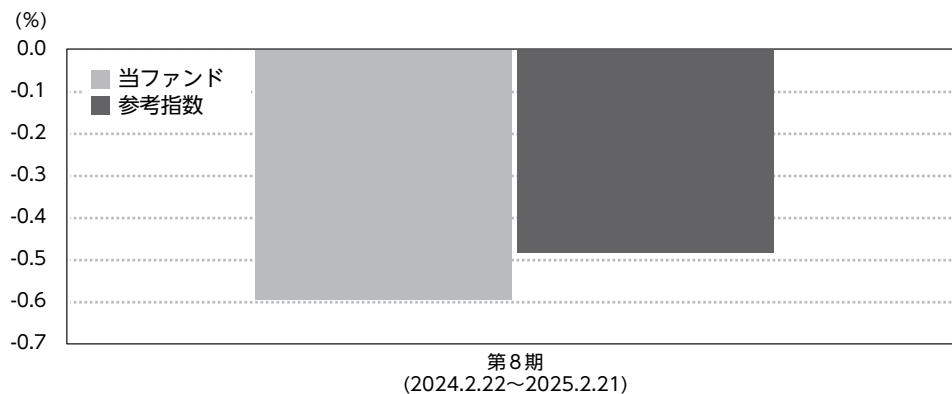
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークであるM S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

＜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F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

*ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数について」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。参考指標は、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、参考指標騰落率（-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標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) 参考指標の詳細につきましては、後掲の「指標について」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ジブ 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。

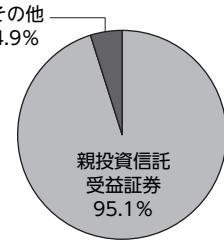
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

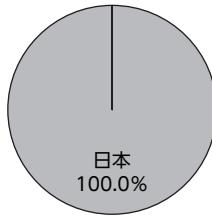
項目	第8期末 2025年2月21日
純資産総額	16,776,611,725円
受益権総口数	14,946,349,173口
1万口当たり基準価額	11,225円

(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。

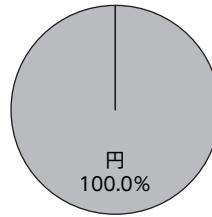
■資産別配分



■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



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指標化しています。

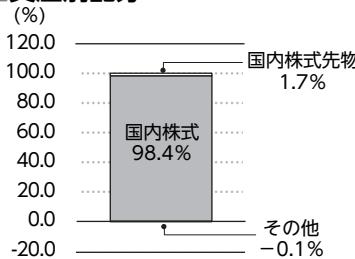
■上位銘柄

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

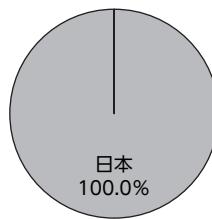
■1万口当たりの費用明細

2024.2.21～2025.2.20	
項目	金額
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)
(先物・オプション)	(0)
その他費用 (その他)	0 (0)
合計	0

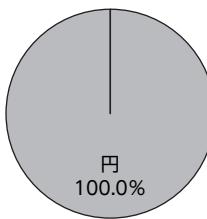
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



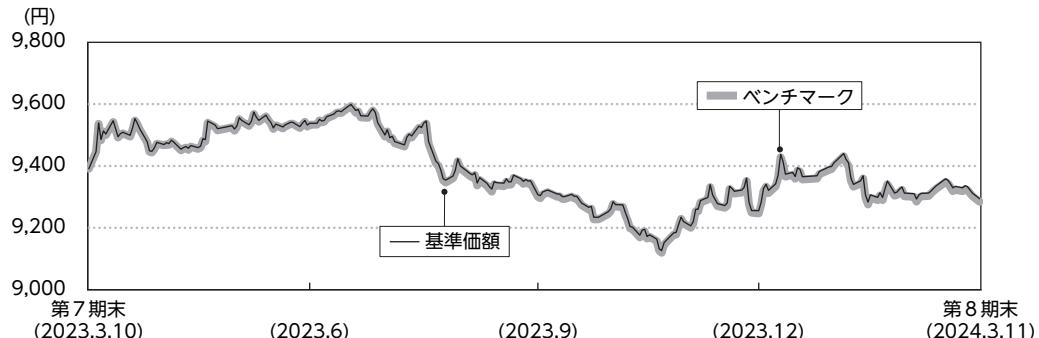
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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



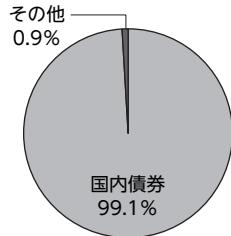
■上位銘柄

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

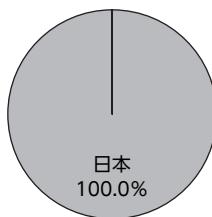
■1万口当たりの費用明細

2023.3.11～2024.3.11	
項目	金額
その他費用	0円
(その他)	(0)
合計	0

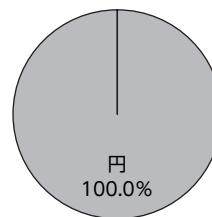
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



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

（注2）上位銘柄・資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2024年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

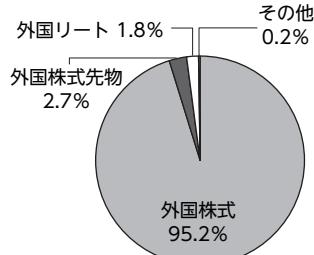
■基準価額の推移



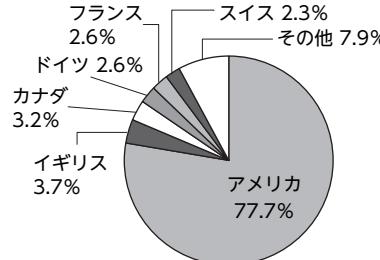
■上位銘柄

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

■資産別配分



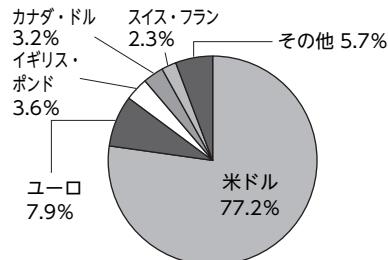
■国別配分



■1万口当たりの費用明細

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

■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



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指標化しています。

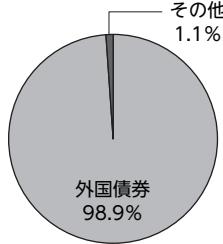
■上位銘柄

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

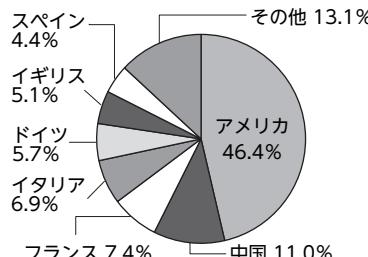
■1万口当たりの費用明細

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

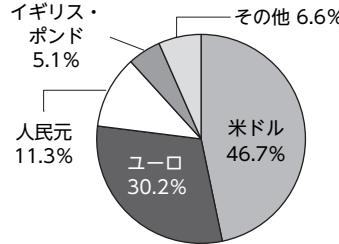
■資産別配分



■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。

DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配額)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)		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
				基準価額 +累計分配金	参考指 数							
	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(分配額)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) 参考指數は設定時を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	千口	口数	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
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	846,400,681	
マザーファンド（評価額）	10,127,399,664	
ニッセイ国内債券パッシブ	840,612,167	
マザーファンド（評価額）	4,142,366,796	
ニッセイ外国株式インデックス	20,489,311	
マザーファンド（評価額）		
ニッセイ外国債券インデックス		
マザーファンド（評価額）		
未収入金		
(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	DC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	DC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ます。
	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。

【受益者の皆様へ】 法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

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。



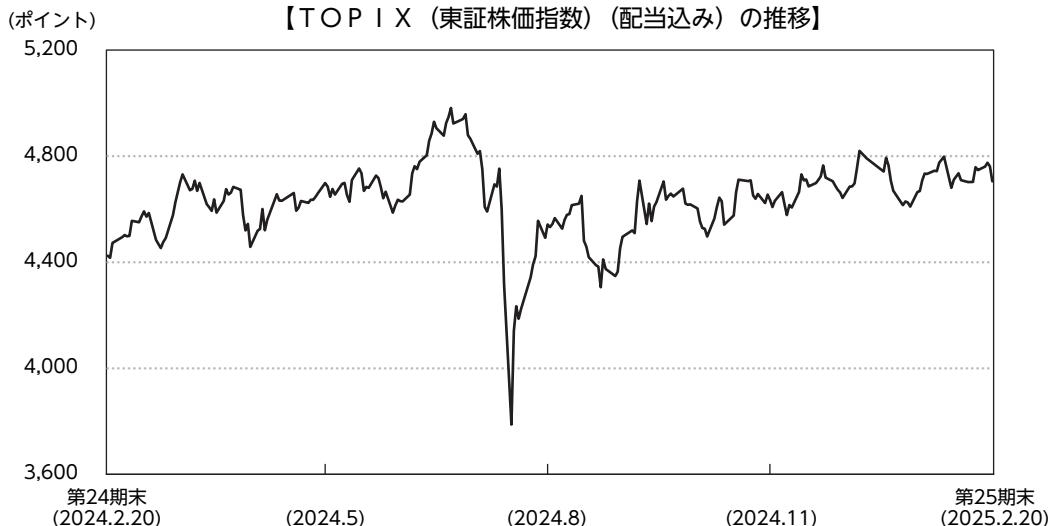
ニッセイアセットマネジメント株式会社

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



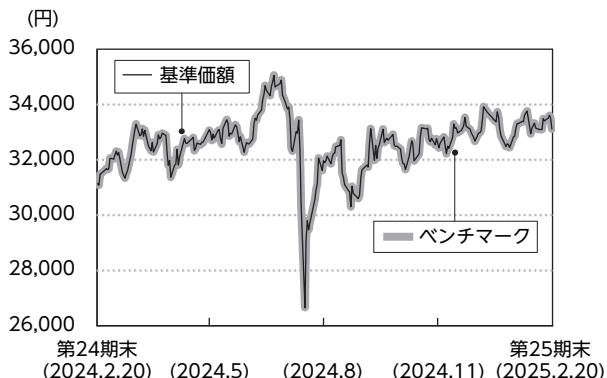
(注) FactSetのデータを使用しています。

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るました。

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。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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) 謄落率は期首比です。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	51,466	48,819	—	—

(注) 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

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
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
ソニーブループ	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。

組入有価証券明細表

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

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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
オリエンタル白石	30	38	14,401			北陸電気工事	5	—	—		
大成建設	54	65	454,333			ユアテック	12	13	21,718		
大林組	208	237	478,014			日本リーテック	5	5	8,187		
清水建設	164	196	278,767			四電工	2	9	12,123		
飛島建設	6	—	—			中電工	9	11	36,008		
長谷工コーポレーション	53	66	131,274			関電工	36	39	103,272		
松井建設	7	4	4,440			きんでん	40	50	162,273		
鹿島建設	128	159	493,473			東京エネシス	6	7	8,323		
不動テトラ	4	4	9,819			トーエニック	1	11	11,947		
鉄建建設	4	4	12,102			住友電設	5	5	27,759		
西松建設	11	11	56,626			日本電設工業	10	13	28,903		
三井住友建設	43	58	23,937			エクシオグループ	28	74	130,002		
大豊建設	2	2	7,270			新日本空調	3	9	15,317		
佐田建設	2	—	—			九電工	12	15	70,652		
ナカノフドー建設	0.100	—	—			三機工業	12	15	50,175		
奥村組	9	12	54,864			日揮ホールディングス	57	71	80,390		
東鉄工業	7	7	24,371			中外炉工業	2	2	8,868		
淺沼組	4	28	19,440			ヤマト	2	—	—		
戸田建設	78	88	87,696			太平電業	3	4	22,310		
熊谷組	9	11	45,517			高砂熟学工業	15	17	95,787		
植木組	0.900	—	—			朝日工業社	2	6	13,513		
矢作建設工業	7	9	12,622			明星工業	11	12	15,197		
ピーエス・コンストラクション	7	5	7,852			大氣社	6	9	42,872		
日本ハウスホールディングス	21	21	6,923			ダイダン	7	9	36,527		
新日本建設	8	10	14,382			日比谷総合設備	4	5	18,880		
東亜道路工業	2	12	18,562			飛島ホールディングス	—	7	12,972		
日本道路	6	7	13,752			テスホールディングス	13	22	6,297		
東亜建設工業	4	21	29,468			インフロニア・ホールディングス	67	75	86,372		
日本国土開発	16	23	11,178			東洋エンジニアリング	8	10	7,589		
若築建設	2	2	7,465			レイズネクスト	8	10	16,213		
東洋建設	14	20	27,593			食料品(2.9%)					
五洋建設	82	94	61,776			ニップン	17	23	50,337		
世紀東急工業	7	10	15,851			日清粉グルーブ本社	54	75	127,351		
福田組	2	2	13,824			日東富士製粉	1	1	8,554		
住友林業	50	62	278,096			昭和産業	5	6	17,104		
日本基礎技術	8	—	—			中部飼料	8	10	12,680		
巴コーポレーション	6	—	—			フィード・ワン	8	10	8,480		
大和ハウス工業	160	217	1,067,377			日本甜菜製糖	3	3	9,013		
ライト工業	12	14	37,697			DM三井製糖ホールディングス	5	7	24,228		
積水ハウス	176	218	732,513			ウェルネオシュガー	2	4	9,274		
日特建設	5	6	7,286			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
中村屋	2	2	6,963			キユーピー	31	38	108,737		
江崎グリコ	16	20	95,054			ハウス食品グループ本社	20	24	67,250		
名糖産業	3	3	6,766			カゴメ	25	30	87,524		
井村屋グループ	3	4	9,800			アリアケジャパン	5	7	42,984		
不二家	4	5	11,145			エバラ食品工業	2	2	6,847		
山崎製パン	39	48	132,519			ニチレイ	26	28	98,841		
モロゾフ	1	7	11,599			東洋水産	29	33	306,826		
亀田製菓	3	4	18,147			イートアンドホールディングス	3	3	7,788		
寿スピリッツ	27	42	102,117			ヨシムラ・フード・ホールディングス	6	—	—		
カルビー	26	33	94,335			日清食品ホールディングス	61	91	266,248		
森永乳業	20	26	81,991			永谷園ホールディングス	2	—	—		
六甲バター	4	6	6,894			フジッコ	6	7	12,047		
ヤクルト本社	83	103	301,790			ロック・フィールド	7	8	12,619		
明治ホールディングス	71	93	272,629			日本たばこ産業	354	439	1,631,120		
雪印メグミルク	14	19	49,276			ケンコーマヨネーズ	4	4	8,374		
プリマハム	7	9	20,728			わらべや日洋ホールディングス	3	4	10,084		
日本ハム	25	31	139,732			なとり	3	4	9,720		
林兼産業	1	—	—			ファーマフーズ	8	9	8,995		
丸大食品	5	7	12,045			ユーレナ	36	44	21,596		
S Foods	6	8	18,824			紀文食品	5	6	6,558		
柿安本店	2	3	8,912			ピックルスホールディングス	5	6	6,922		
伊藤ハム米久ホールディングス	8	11	40,755			理研ビタミン	5	6	14,415		
サッポロホールディングス	19	23	183,141			繊維製品(0.4%)					
アサヒグループホールディングス	134	542	969,076			片倉工業	5	6	13,362		
キリンホールディングス	243	301	602,651			グンゼ	4	5	26,312		
シマダヤ	—	4	6,696			東洋紡	25	31	30,655		
宝ホールディングス	39	48	57,539			富士紡ホールディングス	2	2	13,601		
オエノンホールディングス	17	23	9,898			倉敷紡績	4	4	29,057		
養命酒製造	3	—	—			シキボウ	—	6	7,003		
コカ・コーラ ポトラーズジャパンホールディングス	45	45	108,538			日本毛織	15	18	24,590		
ライフドリンク カンパニー	—	15	29,372			帝国繊維	6	8	19,969		
サントリー食品インターナショナル	41	50	234,801			帝人	57	70	91,874		
ダイドーグループホールディングス	6	8	24,050			東レ	397	537	528,900		
伊藤園	19	24	79,714			日本フェルト	5	—	—		
キーコーヒー	6	8	16,669			イチカワ	3	—	—		
日清オイリオグループ	8	10	48,501			アツギ	10	—	—		
不二製油グループ本社	13	14	37,008			セーレン	11	14	37,516		
J-オイルミルズ	6	8	16,326			ソニー	5	—	—		
キッコーマン	38	239	341,886			東海染工	1	—	—		
味の素	138	167	999,472			小松マテーレ	8	10	8,485		
ブルドックソース	3	4	7,040			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
ホギメディカル	7	9	47,916			デンカ	21	26	55,789		
ＴＳＩホールディングス	19	23	28,652			信越化学工業	538	654	3,026,712		
マツオカコーポレーション	3	—	—			日本カーバイド工業	4	3	7,452		
ワールド	8	11	26,329			堺化学工業	4	5	13,907		
三陽商会	—	3	10,947			第一稀元素化学工業	6	9	6,731		
オンワードホールディングス	35	47	26,425			エア・ウォーター	56	69	131,166		
ルックホールディングス	—	3	7,027			日本酸素ホールディングス	57	71	307,160		
ゴールドワイン	10	13	94,464			日本化学工業	3	—	—		
デサント	10	—	—			日本パーカライジング	26	32	41,984		
ヤマトイターナショナル	14	—	—			高圧ガス工業	8	10	9,137		
パルプ・紙(0.1%)						四国化成ホールディングス	7	8	16,043		
特種東海製紙	3	3	13,338			ステラ ケミファ	3	4	17,100		
王子ホールディングス	247	278	175,315			保土谷化学工業	1	2	7,222		
日本製紙	33	38	38,912			日本触媒	8	47	85,203		
三菱製紙	4	—	—			大日精化工業	4	5	15,631		
北越コーポレーション	29	41	57,778			カネカ	15	18	67,631		
大王製紙	26	37	30,533			三菱瓦斯化学	44	59	140,030		
阿波製紙	3	—	—			三井化学	49	66	221,770		
レンゴー	54	66	53,573			ＪＳＲ	64	—	—		
トーモク	3	4	10,084			東京応化工業	28	35	131,133		
ザ・パック	4	5	18,562			大阪有機化学工業	5	6	16,095		
化学(4.9%)						三菱ケミカルグループ	434	537	410,081		
北の達人コーポレーション	26	41	6,987			ＫＨネオケム	9	13	33,276		
クラレ	86	98	183,152			ダイセル	76	83	111,062		
旭化成	401	497	498,992			住友ベーライト	8	23	80,527		
レゾナック・ホールディングス	57	66	231,858			積水化学工業	119	146	366,000		
住友化学	440	591	203,535			日本ゼオン	40	56	84,426		
住友精化	2	3	17,570			アイカ工業	15	18	61,789		
日産化学	27	37	164,959			ＵＢＥ	28	37	83,398		
ラサ工業	2	2	7,462			積水樹脂	8	9	17,856		
クレハ	13	15	41,967			タキロンシーアイ	15	—	—		
多木化学	2	2	10,063			旭有機材	4	4	19,649		
ティカ	5	5	7,801			ニチバン	3	4	9,236		
石原産業	9	12	20,727			リケンテクノス	12	13	13,173		
日本曹達	7	15	45,349			大倉工業	2	3	12,121		
東ソー	79	98	206,956			積水化成品工業	12	19	6,848		
トフヤマ	19	23	63,093			群栄化学工業	1	2	6,775		
セントラル硝子	6	9	29,992			ダイキヨーニシカワ	13	16	9,849		
東亞合成	28	34	47,774			森六ホールディングス	3	4	8,200		
大阪ソーダ	4	25	35,440			恵和	4	6	8,636		
関東電化工業	11	15	14,077			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
カーリット	6	7	7,920			日本高純度化学	2	2	6,886		
日本精化	3	4	10,760			タカラバイオ	16	23	20,559		
扶桑化学工業	6	6	24,106			J C U	6	8	30,213		
トリケミカル研究所	7	8	30,360			新田ゼラチン	0.500	—	—		
A D E K A	20	25	70,784			○ A T アグリオ	3	—	—		
日油	17	86	182,379			デクセリアルズ	14	64	145,770		
新日本理化	5	—	—			アース製薬	5	6	34,000		
ハリマ化成グループ	7	8	6,966			北興化学工業	6	6	8,553		
花王	134	179	1,155,374			大成ラミック	2	2	6,750		
第一工業製薬	3	2	6,999			クミアイ化学工業	23	29	22,150		
石原ケミカル	3	3	6,822			日本農薬	10	11	8,621		
三洋化成工業	3	4	17,910			アキレス	4	4	6,862		
大日本塗料	6	8	10,012			有沢製作所	10	11	15,739		
日本ペイントホールディングス	315	325	335,812			日東電工	38	232	691,765		
関西ペイント	58	61	135,242			レック	7	9	11,627		
中国塗料	12	16	36,204			三光合成	—	10	6,681		
藤倉化成	14	13	6,838			きもと	4	—	—		
太陽ホールディングス	10	12	52,224			Z A C R O S	4	5	24,447		
D I C	23	26	84,303			前澤化成工業	4	5	9,287		
サカタインクス	13	16	29,241			未来工業	2	2	8,801		
a r t i e n c e	12	13	39,481			J S P	4	6	12,276		
T & K T O K A	5	—	—			エフピコ	11	16	48,785		
富士フィルムホールディングス	110	444	1,342,656			天馬	4	6	16,006		
資生堂	124	153	409,917			信越ポリマー	12	15	24,724		
ライオン	77	93	168,660			ニフコ	17	27	100,375		
高砂香料工業	4	5	33,250			バルカー	5	5	18,564		
マンダム	12	14	18,060			ユニ・チャーム	123	460	517,955		
ミルボン	8	11	34,633			医薬品(4.0%)					
ファンケル	26	—	—			協和キリン	71	86	176,447		
コーワ	12	15	93,000			武田薬品工業	526	655	2,726,287		
コタ	5	7	11,325			アステラス製薬	521	645	938,815		
ポーラ・オルビスホールディングス	30	37	46,107			住友ファーマ	44	65	50,238		
ノエビアホールディングス	5	6	27,456			塩野義製薬	75	244	536,751		
新日本製薬	3	4	9,160			わかもと製薬	3	—	—		
エステー	4	6	8,868			日本新薬	15	19	74,324		
アグロ カネショウ	4	—	—			中外製薬	186	230	1,695,558		
コニシ	17	23	27,979			科研製薬	10	12	55,880		
長谷川香料	11	14	37,886			エーザイ	72	96	407,656		
小林製薬	17	19	109,102			ロート製薬	57	77	177,806		
荒川化学工業	5	6	7,894			小野薬品工業	126	150	229,589		
メック	4	6	15,988			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
持田製薬	6	9	28,737			三ツ星ベルト	7	10	38,862		
参天製薬	108	133	187,760			バンドー化学	8	10	18,758		
扶桑薬品工業	2	2	7,032			ガラス・土石製品(0.6%)					
ツムラ	18	25	110,181			日東紡績	7	8	41,209		
キッセイ薬品工業	9	11	43,197			A G C	53	71	319,550		
生化学工業	10	14	10,808			日本板硝子	28	37	14,816		
栄研化学	10	11	24,858			日本電気硝子	24	27	97,188		
鳥居薬品	3	4	16,700			オハラ	5	6	6,690		
J C R ファーマ	20	24	13,197			住友大阪セメント	9	12	44,825		
東和薬品	9	9	28,264			太平洋セメント	35	45	180,601		
富士製薬工業	4	5	7,414			日本ヒューム	7	6	12,684		
ゼリア新薬工業	8	11	23,329			日本コンクリート工業	13	19	6,856		
ネクセラファーマ	19	34	29,237			三谷セキサン	2	2	15,184		
第一三共	518	695	2,374,815			アジアパイルホールディングス	8	10	9,366		
杏林製薬	12	16	21,456			東海カーボン	54	67	62,074		
ダイト	4	5	10,429			日本カーボン	3	4	17,178		
大塚ホールディングス	123	181	1,297,310			東洋炭素	4	5	20,384		
大正製薬ホールディングス	13	—	—			ノリタケ	3	8	29,110		
ペプチドリーム	28	35	74,684			T O T O	39	53	213,386		
セルソース	3	8	6,930			日本碍子	69	81	152,516		
あすか製薬ホールディングス	6	6	13,051			日本特殊陶業	49	60	269,455		
サワイグループホールディングス	13	43	89,154			M A R U W A	2	3	114,762		
石油・石炭製品(0.6%)						品川リフラクトリーズ	7	9	16,097		
日本コーカス工業	60	74	6,881			黒崎播磨	1	5	12,925		
ニチレキグループ	7	7	17,628			ヨータイ	4	0.100	170		
ユシロ化学工業	3	3	7,824			ニッカトー	1	—	—		
富士石油	17	18	6,128			フジミインコーポレーテッド	16	19	41,104		
出光興産	330	344	353,562			クニミネ工業	0.900	—	—		
ENEOSホールディングス	941	1,249	1,056,778			ニチアス	15	18	83,755		
コスモエネルギーホールディングス	17	24	163,174			ニチハ	7	9	27,968		
ゴム製品(0.6%)						鉄鋼(0.9%)					
横浜ゴム	30	37	124,694			日本製鉄	273	383	1,296,568		
TOYO T I R E	34	42	105,157			神戸製鋼所	123	152	266,525		
ブリヂストン	174	215	1,263,200			中山製鋼所	14	15	11,778		
住友ゴム工業	58	72	123,633			合同製鐵	3	4	16,275		
藤倉コンポジット	4	7	10,209			J F E ホールディングス	170	228	410,760		
オカモト	2	3	19,422			東京製鐵	17	21	33,114		
フコク	3	4	7,057			共英製鋼	7	7	14,570		
ニッタ	6	7	25,632			大和工業	11	14	115,872		
住友理工	9	14	24,066			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
大阪製鐵	2	3	9,324			S U M C O	108	144	171,211		
淀川製鋼所	7	7	41,650			川田テクノロジーズ	1	4	15,018		
中部鋼鉄	4	5	10,880			R S T e c h n o l o g i e s	4	5	20,502		
丸一鋼管	18	23	79,695			東洋製罐グループホールディングス	35	48	112,708		
モリ工業	—	1	8,578			ホッカンホールディングス	1	4	6,855		
大同特殊鋼	38	47	57,406			コロナ	6	7	6,941		
日本冶金工業	4	5	21,267			横河プリッジホールディングス	9	13	33,410		
山陽特殊製鋼	6	7	20,587			三和ホールディングス	61	74	369,362		
愛知製鋼	3	4	31,592			文化シヤッター	16	19	36,709		
太平洋金属	5	7	10,899			三協立山	7	11	6,865		
新日本電工	30	45	12,520			アルインコ	6	6	6,804		
栗本鐵工所	2	3	17,325			L I X I L	95	110	190,771		
三菱製鋼	4	5	9,368			日本ファイルコン	0.100	—	—		
日亜鋼業	10	—	—			ノーリツ	10	10	17,901		
日本精線	1	6	7,980			長府製作所	6	8	15,878		
エンビプロ・ホールディングス	10	7	2,726			リンナイ	29	40	138,148		
シンニッタン	14	—	—			日東精工	11	12	7,092		
非鉄金属(0.8%)						岡部	10	13	11,056		
大紀アルミニウム工業所	7	10	10,789			ジー・テクト	7	8	13,515		
日本軽金属ホールディングス	17	22	34,609			東プレ	10	13	24,139		
三井金属鉱業	17	19	81,985			高周波熱鍊	9	11	11,144		
東邦亜鉛	5	—	—			東京製綱	4	—	—		
三菱マテリアル	43	54	126,936			サンコール	13	26	11,050		
住友金属鉱山	70	95	325,005			モリテックスチール	0.100	—	—		
DOWAホールディングス	15	20	94,443			パイオラックス	7	10	24,112		
古河機械金属	8	10	22,630			エイチワン	7	7	8,455		
大阪チタニウムテクノロジーズ	10	13	25,256			日本発条	54	67	116,948		
東邦チタニウム	12	15	15,731			中央発條	8	4	7,590		
U A C J	8	10	53,607			三益半導体工業	5	—	—		
C K サンエツ	1	1	7,267			機械(5.5%)					
古河電気工業	20	25	180,186			日本製鋼所	16	22	119,745		
住友電気工業	228	261	726,332			三浦工業	25	34	110,768		
フジクラ	72	81	547,474			タクマ	20	25	45,531		
S W C C	6	10	65,280			ツガミ	13	15	26,228		
タツタ電線	10	—	—			オーツマ	5	13	43,160		
平河ヒューテック	4	4	6,993			芝浦機械	6	9	34,010		
リヨービ	6	8	17,795			アマダ	95	103	150,277		
A R E ホールディングス	23	30	57,313			アイダエンジニアリング	13	16	13,429		
金属製品(0.5%)						F U J I	28	32	70,534		
稻葉製作所	4	4	7,030			牧野フライス製作所	6	8	96,695		
宮地エンジニアリンググループ	3	9	16,425			オーエスジー	26	32	55,213		
トーカロ	17	21	38,455			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		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
DMG森精機	36	46	121,095	ローツエ	3	38	68,092	千株	千円
ソディック	14	19	17,953	クボタ	313	379	740,198		
ディスコ	28	35	1,652,910	荏原実業	3	3	14,087		
日東工器	3	3	6,726	三菱化工機	2	2	9,932		
日進工具	6	9	6,946	月島ホールディングス	8	10	15,820		
パンチ工業	0.200	—	—	帝国電機製作所	4	5	14,902		
リケンN P R	6	9	24,077	新東工業	12	16	14,866		
島精機製作所	9	11	10,985	澁谷工業	5	7	23,205		
オプトラン	9	12	21,264	アイチコーポレーション	8	12	18,216		
イワキ	4	4	11,965	小森コーポレーション	14	18	23,607		
フリュー	5	7	7,504	鶴見製作所	4	5	17,698		
ヤマシンフィルタ	18	15	9,686	酒井重工業	0.900	2	6,559		
日阪製作所	6	9	9,288	荏原製作所	24	152	400,286		
やまびこ	9	12	29,233	西島製作所	5	6	15,193		
野村マイクロ・サイエンス	2	12	31,598	北越工業	6	7	15,367		
平田機工	2	3	17,185	ダイキン工業	71	96	1,540,770		
PEGASUS	14	14	6,930	オルガノ	7	11	83,605		
マルマエ	3	—	—	トーヨーカネツ	2	2	10,062		
タツモ	3	5	12,137	栗田工業	33	41	205,259		
ナブテスコ	37	46	111,507	椿本チエイン	8	33	62,092		
三井海洋開発	7	9	39,903	木村化工機	8	8	6,766		
レオン自動機	6	7	10,186	アネスト岩田	9	12	15,636		
SMC	17	22	1,215,006	ダイワフ	101	125	494,164		
ホソカワミクロン	3	5	19,890	サムコ	1	—	—		
ユニオンツール	2	3	15,015	タダノ	34	42	46,414		
瑞光	4	—	—	フジテック	14	23	136,850		
オイレス工業	8	10	22,826	C K D	16	20	47,375		
日精エー・エス・ビー機械	2	2	13,250	平和	17	24	56,637		
サトーホールディングス	8	9	19,062	理想科学工業	4	11	16,969		
技研製作所	5	7	9,968	SANKYO	13	85	175,427		
日本エアーテック	5	6	6,741	日本金銭機械	7	9	10,458		
日精樹脂工業	5	7	6,862	マースグループホールディングス	3	5	15,850		
ワイベイシホールディングス	2	7	7,554	フクシマガリレイ	3	10	29,549		
小松製作所	280	365	1,701,037	ダイコク電機	2	3	8,396		
住友重機械工業	35	43	130,031	竹内製作所	10	13	73,980		
日立建機	23	29	114,961	アマノ	17	21	79,212		
日工	8	11	7,667	JUKI	14	—	—		
巴工業	2	2	10,585	ジャノメ	9	7	6,993		
井関農機	5	7	7,481	マックス	8	8	36,178		
TOWA	6	22	36,774	グローリー	14	19	50,381		
北川鉄工所	4	5	6,748	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
大和冷機工業	9	11	17,749			ソシオネクスト	43	73	154,340		
セガサミーホールディングス	53	66	193,734			東芝テック	7	11	33,633		
T P R	7	9	21,770			芝浦メカトロニクス	3	5	49,086		
ツバキ・ナカシマ	12	18	8,893			マブチモーター	29	32	74,172		
ホシザキ	35	47	276,755			ニデック	132	327	909,517		
大豊工業	7	11	6,930			ユ・エム・シー・エレクトロニクス	—	23	6,976		
日本精工	110	137	87,144			トレックス・セミコンダクター	3	5	7,592		
N T N	129	175	41,769			東光高岳	3	4	8,132		
ジェイテクト	53	66	75,108			ダブル・スコーピ	17	—	—		
不二越	4	5	18,122			ダイヘン	6	7	50,890		
日本トムソン	16	20	9,837			ヤーマン	11	14	11,223		
T H K	34	42	158,531			J V C ケンウッド	47	58	83,391		
ユーシン精機	9	10	6,814			ミマキエンジニアリング	—	6	9,486		
前澤給装工業	4	5	7,276			I - P E X	4	—	—		
イーグル工業	6	8	16,391			大崎電気工業	13	15	12,306		
P I L L A R	5	6	25,116			オムロン	45	67	309,488		
キツツ	20	24	27,888			日東工業	8	10	29,420		
マキタ	68	92	441,286			I D E C	8	10	27,609		
三井E & S	29	39	67,874			不二電機工業	0.300	—	—		
カナデビア	52	60	56,908			ジー・エス・ユアサ コーポレーション	23	33	79,886		
三菱重工業	104	1,296	2,804,113			メルコホールディングス	1	1	2,601		
I H I	44	59	565,785			テクノメディア	3	3	6,860		
スター精密	11	12	24,437			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		
電気機器(18.6%)						日本電気	78	104	1,604,445		
キオクシアホールディングス	—	33	79,420			富士通	55	682	2,029,842		
日清紡ホールディングス	45	55	49,968			沖電気工業	27	35	33,207		
イビデン	31	42	154,020			電気興業	2	4	6,617		
コニカミノルタ	133	165	88,264			サンケン電気	5	7	49,605		
ブラザー工業	80	99	261,574			アイホン	3	4	11,808		
ミネベアミツミ	104	129	295,926			ルネサスエレクトロニクス	390	564	1,525,230		
日立製作所	287	1,909	8,243,311			セイコーエプソン	76	95	232,899		
三菱電機	666	754	1,782,928			ワコム	45	52	33,135		
富士電機	36	45	305,913			アルパック	13	16	91,801		
安川電機	65	80	345,908			E I Z O	4	9	20,554		
シンフォニア テクノロジー	6	7	45,954			日本信号	13	16	15,159		
明電舎	11	12	57,375			京三製作所	13	17	8,598		
オリジン	1	—	—			能美防災	8	10	30,250		
山洋電気	2	3	29,600			ホーチキ	4	4	11,923		
デンヨー	4	5	14,621			エレコム	14	17	28,408		
P H C ホールディングス	11	13	15,039			パナソニック ホールディングス	707	876	1,584,246		
KOKUSAI ELECTRIC	23	52	182,000			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
アンリツ	42	52	75,220			コーセル	6	9	9,162		
富士通ゼネラル	17	21	57,855			イリソ電子工業	5	7	20,105		
ソニーグループ	419	2,532	9,452,036			オプテックスグループ	10	13	22,491		
TDK	94	640	1,082,596			千代田インテグレ	2	2	8,086		
帝国通信工業	3	3	7,539			レーザーテック	27	28	418,665		
タムラ製作所	23	29	16,815			スタンレー電気	38	46	113,689		
アルプスアルパイン	53	60	93,370			ウシオ電機	30	32	67,827		
日本電波工業	7	—	—			岡谷電機産業	0.100	—	—		
鈴木	5	4	6,824			日本セラミック	4	6	18,009		
メイコー	5	7	58,608			古河電池	7	5	7,462		
ローランド ディー. ジー.	3	—	—			山一電機	5	6	12,900		
フォスター電機	5	7	11,070			図研	5	6	31,289		
SMK	2	2	6,487			日本電子	14	17	88,111		
ヨコオ	5	6	9,659			カシオ計算機	42	58	73,140		
ホシデン	13	18	37,819			ファナック	289	355	1,571,847		
ヒロセ電機	8	10	196,776			日本シイエムケイ	12	21	10,449		
日本航空電子工業	14	19	51,357			エンプラス	1	2	10,069		
TOA	6	7	7,065			大真空	8	11	6,700		
マクセル	13	14	26,681			ローム	109	133	221,711		
古野電気	7	8	20,240			浜松ホトニクス	47	117	198,375		
スミダコーポレーション	8	10	9,590			三井ハイテック	5	32	29,347		
アイコム	2	2	8,006			新光電気工業	21	26	153,452		
リオン	2	3	7,443			京セラ	368	456	786,945		
横河電機	65	81	233,486			太陽誘電	28	32	84,460		
新電元工業	2	2	7,299			村田製作所	539	646	1,759,024		
アズビル	40	200	236,118			双葉電子工業	12	14	7,392		
日本光工業	25	65	145,821			北陸電気工業	2	—	—		
チノー	2	3	6,410			ニチコン	15	19	23,951		
共和電業	4	—	—			日本ケミコン	6	9	8,451		
日本電子材料	3	4	10,030			KOA	9	12	12,285		
堀場製作所	11	13	135,969			市光工業	10	16	6,776		
アドバンテスト	169	231	2,216,812			小糸製作所	61	76	144,133		
エスペック	4	6	15,314			ミツバ	11	13	10,791		
キーエンス	59	73	4,614,330			SCREENホールディングス	20	30	342,612		
日置電機	2	3	27,729			キヤノン電子	6	7	17,199		
シスメックス	51	190	522,204			キヤノン	295	366	1,872,014		
日本マイクロニクス	10	12	58,503			リコー	148	193	293,968		
メガチップス	4	5	28,671			象印マホービン	16	21	33,507		
O B A R A G R O U P	3	4	15,801			MUTOHホールディングス	1	—	—		
澤藤電機	3	—	—			東京エレクトロン	125	155	3,916,080		
原田工業	4	—	—			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千株	千円	千株	千株	千円					
輸送用機器(7.2%)											
トヨタ紡織	25	30	60,610				豊田合成	17	21	55,702	
芦森工業	1	—	—				愛三工業	9	13	26,535	
ユニプレス	10	13	13,741				盟和産業	1	—	—	
豊田自動織機	50	62	793,782				ヨロズ	6	7	7,645	
モリタホールディングス	10	11	24,371				エフ・シー・シー	10	12	40,764	
三櫻工業	9	10	6,751				シマノ	23	31	641,987	
デンソー	489	719	1,370,985				ティ・エス・テック	21	29	51,129	
東海理化電機製作所	16	20	44,525				ジャムコ	4	4	7,840	
川崎重工業	48	55	444,999				精密機器(2.2%)				
名村造船所	14	21	41,895				リガク・ホールディングス	—	37	42,034	
日本車輪製造	2	3	6,798				テルモ	165	491	1,317,621	
三菱ロジスネクスト	9	11	23,423				日機装	13	19	23,275	
日産自動車	800	917	384,608				日本エム・ディ・エム	8	—	—	
いすゞ自動車	172	226	446,909				島津製作所	78	105	411,595	
トヨタ自動車	3,255	3,902	10,578,810				J M S	12	14	6,949	
日野自動車	89	110	53,212				長野計器	4	4	9,609	
三菱自動車工業	231	280	113,571				ブイ・テクノロジー	3	3	8,420	
エフテック	1	—	—				東京計器	4	5	17,498	
武藏精密工業	14	18	48,816				愛知時計電機	2	2	4,865	
日産車体	6	11	11,502				インターラクション	4	6	7,265	
新明和工業	17	21	29,107				東京精密	12	15	135,510	
極東開発工業	9	9	24,552				マニー	23	29	40,821	
トピー工業	4	5	12,437				ニコン	85	115	178,389	
ティラド	1	1	6,830				トプコン	28	41	118,031	
タチエス	10	13	23,868				オリンパス	364	420	841,020	
NOK	23	28	65,849				理研計器	4	10	30,014	
フタバ産業	15	22	16,685				タムロン	3	10	38,329	
カヤバ	5	12	36,537				H O Y A	116	143	2,609,880	
大同メタル工業	11	14	7,171				ノーリツ鋼機	5	7	32,130	
プレス工業	23	28	16,215				A & D ホロンホールディングス	8	9	18,676	
ミクニ	3	—	—				朝日インテック	72	89	241,336	
太平洋工業	13	16	23,352				シチズン時計	54	67	59,805	
アイシン	45	155	268,237				メニコン	20	27	37,455	
マツダ	196	225	224,598				松風	2	7	16,228	
今仙電機製作所	2	—	—				セイコーブループ	8	11	55,404	
本田技研工業	1,445	1,739	2,377,163				ニプロ	49	61	80,325	
スズキ	108	593	1,153,375				その他製品(3.2%)				
S U B A R U	183	221	587,817				三井松島ホールディングス	5	5	20,975	
ヤマハ発動機	256	310	372,775				スノーピーク	8	—	—	
エクセディ	9	12	56,580				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		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
ニホンフラッシュ	千株	千株	千円				千株	千株	千円
前田工織	6	8	6,888	関西電力	228	358	613,067		
アートネイチャー	5	15	27,045	中国電力	103	127	107,311		
フルヤ金属	7	9	6,879	北陸電力	60	75	58,232		
パンダynamコホールディングス	1	6	18,389	東北電力	156	193	202,771		
S H O E I	162	199	967,003	四国電力	55	68	77,223		
フランスペッドホールディングス	13	20	39,552	九州電力	136	169	214,799		
パイロットコーポレーション	7	10	13,335	北海道電力	57	76	55,288		
萩原工業	8	11	47,252	沖縄電力	15	18	17,126		
フジシールインターナショナル	—	4	7,350	電源開発	48	55	137,309		
タカラトミー	12	16	45,540	エフオン	14	—	—		
広済堂ホールディングス	27	30	117,779	イーレックス	10	14	11,082		
プロネクサス	15	27	13,573	レノバ	15	20	14,480		
TOPPANホールディングス	64	152	325,784	東京瓦斯	125	138	660,191		
大日本印刷	72	96	442,691	大阪瓦斯	120	144	479,609		
共同印刷	1	2	8,977	東邦瓦斯	25	28	116,438		
N I S S H A	10	12	17,400	北海道瓦斯	3	22	11,198		
TAKARA & COMPANY	3	4	12,040	広島ガス	1	19	6,930		
アシックス	50	271	964,844	西部ガスホールディングス	6	7	12,620		
ツツミ	3	—	—	静岡ガス	11	16	16,883		
ローランド	4	5	19,953	メタウォーター	7	10	19,735		
小松ウォール工業	2	4	7,340	陸運業(2.3%)					
ヤマハ	37	131	140,843	S B S ホールディングス	5	6	18,310		
河合楽器製作所	1	2	7,018	東武鉄道	65	77	199,047		
クリナップ	7	10	6,825	相鉄ホールディングス	21	24	58,502		
ピジョン	37	46	77,149	東急	166	205	346,014		
キングジム	7	8	6,893	京浜急行電鉄	73	90	139,077		
リンテック	11	13	39,726	小田急電鉄	98	121	177,244		
イトーキ	12	14	25,754	京王電鉄	28	38	151,087		
任天堂	374	463	5,325,615	京成電鉄	38	127	188,696		
三菱鉛筆	8	10	26,421	富士急行	7	9	21,123		
タカラスタンダード	12	16	29,355	東日本旅客鉄道	108	404	1,149,713		
コクヨ	24	35	101,850	西日本旅客鉄道	70	181	530,782		
ナカバヤシ	11	3	1,742	東海旅客鉄道	228	282	815,736		
グローブライド	5	7	13,665	東京地下鉄	—	122	216,742		
オカムラ	17	22	43,979	西武ホールディングス	71	79	247,530		
美津濃	5	7	60,517	鴻池運輸	10	12	36,550		
電気・ガス業(1.2%)				西日本鉄道	15	21	46,067		
グリムス	3	3	7,227	ハマキヨウレックス	5	25	31,400		
東京電力ホールディングス	534	617	242,138	サカイ引越センター	6	9	21,436		
中部電力	218	270	426,172	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	評価額	千円
南海電気鉄道	26	32	81,406	中央倉庫	2	3	4,817				
京阪ホールディングス	32	40	135,905	安田倉庫	5	5	8,925				
神戸電鉄	2	2	5,618	上組	27	33	110,796				
名古屋鉄道	61	81	145,800	キユーソー流通システム	6	4	9,466				
山陽電気鉄道	4	5	11,082	エーアイテイー	3	4	7,626				
アルプラス物流	4	—	—	内外トランスライン	2	2	7,090				
ヤマトホールディングス	75	89	178,333	日本コンセプト	3	3	7,026				
山九	15	17	102,872	情報・通信業(7.8%)							
丸全昭和運輸	3	4	26,055	N E C ネッツエスアイ	23	28	94,710				
センコーグループホールディングス	31	48	68,203	クロスキャット	5	6	6,792				
トナミホールディングス	1	1	9,552	システナ	90	105	36,294				
ニッコンホールディングス	18	41	95,826	デジタルアーツ	3	4	30,550				
福山通運	6	7	28,782	日鉄ソリューションズ	10	25	103,487				
セイノーホールディングス	33	36	80,611	キューブシステム	5	6	6,847				
神奈川中央交通	2	2	8,200	コア	3	3	6,793				
A Z - C O M 株和ホールディングス	15	22	27,830	ラクーンホールディングス	9	7	6,745				
C & F ロジホールディングス	5	—	—	ソリトンシステムズ	4	—	—				
九州旅客鉄道	41	56	200,838	ソフトクリエイトホールディングス	4	5	10,817				
S G ホールディングス	99	123	177,202	T I S	65	77	296,418				
N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	20	78	210,041	グリーホールディングス	19	24	13,980				
海運業(0.7%)				G M O ペパボ	—	4	7,080				
日本郵船	169	151	798,538	コーエーテクモホールディングス	37	55	111,935				
商船三井	128	139	767,257	三菱総合研究所	2	3	16,310				
川崎汽船	47	166	354,783	ファインデックス	—	8	6,349				
N S ユナイテッド海運	3	4	18,676	ブレインパッド	—	5	7,023				
明海グループ	2	—	—	ポールトウインホールディングス	12	15	7,037				
飯野海運	21	26	28,002	ネクソン	133	161	327,038				
共栄タンカー	0.600	—	—	アイスタイル	19	22	11,155				
乾汽船	6	9	13,258	エムアップホールディングス	7	9	13,977				
空運業(0.4%)				エイチーム	11	7	6,830				
日本航空	145	168	439,992	セルシス	—	10	13,146				
AN A ホールディングス	161	199	578,559	エニグモ	17	20	6,895				
パスコ	0.400	—	—	コロプラ	23	25	12,225				
倉庫・運輸関連業(0.1%)				ブロードリーフ	28	29	19,151				
トランコム	1	—	—	デジタルハーツホールディングス	6	6	6,739				
日新	4	5	21,625	メディアドゥ	4	4	7,303				
三菱倉庫	14	74	76,614	じげん	17	18	8,188				
三井倉庫ホールディングス	5	7	55,800	ブイキューブ	20	—	—				
住友倉庫	16	21	59,339	フィックススターズ	6	7	13,823				
澁澤倉庫	2	3	10,296	CARTA HOLDINGS	0.200	4	6,647				
日本トランシスティ	11	14	13,920	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
セレス	5	3	9,038			ビジョナル	4	8	65,223		
S H I F T	4	73	100,191			ハイマックス	4	5	6,941		
ティーガイア	6	—	—			野村総合研究所	131	159	823,695		
テクマトリックス	10	15	35,186			日本システム技術	2	6	13,872		
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15	18	56,144			インテージホールディングス	6	4	7,224		
GMOペイメントゲートウェイ	11	16	134,383			ソースネクスト	42	37	8,234		
システムリサーチ	2	5	8,405			インフォコム	7	—	—		
インターネットイニシアティブ	28	40	103,515			シープレックス・ホールディングス	9	14	40,585		
さくらインターネット	6	11	49,795			H E R O Z	3	—	—		
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2	3	6,717			ラクスル	14	17	22,250		
S R A ホールディングス	3	4	18,123			メルカリ	28	40	91,471		
朝日ネット	10	10	6,921			イーソル	10	—	—		
e B A S E	9	11	6,925			ウイングアーク 1 s t	6	7	27,681		
アバントグループ	7	10	19,683			ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	—	3	3,049		
アドソル臼進	4	3	7,068			サーバーワークス	1	—	—		
コムチュア	8	9	18,730			S a n s a n	19	20	49,608		
アステリア	10	11	6,840			ギフティ	5	6	9,990		
アイル	2	4	9,963			メドレー	8	8	24,000		
マーカライズ	3	4	10,780			ベース	2	3	11,880		
メディカル・データ・ビジョン	9	—	—			J M D C	10	9	28,575		
g u m i	15	13	7,670			フォーカスシステムズ	6	6	6,766		
テラスカイ	4	2	6,683			クレスコ	4	12	13,527		
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3	4	10,922			フジ・メディア・ホールディングス	57	70	193,223		
ネオジャパン	—	4	6,719			オービック	19	136	602,983		
P R T I M E S	—	3	6,951			ジャストシステム	8	10	39,379		
ラクス	28	34	74,715			T D C ソフト	5	12	16,802		
ダブルスタンダード	3	4	6,520			L I N E ヤフー	846	1,178	564,711		
オープンドア	7	11	7,084			トレンドマイクロ	28	38	444,276		
アカツキ	2	3	10,569			I D ホールディングス	4	5	9,465		
Ub i c o m ホールディングス	4	4	6,816			日本オラクル	11	14	206,001		
カナミックネットワーク	15	15	7,338			アルファシステムズ	2	2	7,613		
チェンジホールディングス	12	18	24,315			フューチャー	12	18	32,683		
オーネット	3	3	8,238			C A C Holdings	3	4	8,977		
マクロミル	11	14	18,081			S B テクノロジー	2	—	—		
オロ	2	3	8,134			オービックビジネスコンサルタント	8	12	90,978		
ユーザーローカル	—	3	6,487			アイティフォー	7	8	10,990		
PKSHA Technology	—	5	24,042			東計電算	—	2	9,261		
マネーフォワード	13	18	80,345			大塚商会	29	83	290,246		
プラスアルファ・コンサルティング	3	9	13,754			サイボウズ	8	10	31,209		
電算システムホールディングス	2	3	7,933			電通総研	7	7	44,280		
APP I E R G R O U P	20	22	39,150			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
デジタルガレージ	9	11	54,280			スクウェア・エニックス・ホールディングス	27	37	265,512		
イーエムシステムズ	9	11	9,280			シーイーシー	7	9	17,242		
ウェザーニューズ	1	5	21,092			カプコン	53	146	567,936		
C I J	9	20	9,534			アイ・エス・ビー	4	5	6,655		
ビジネスエンジニアリング	—	1	7,092			ジャステック	4	—	—		
WOWOW	5	6	6,927			S C S K	41	60	217,802		
スカラ	8	17	7,221			N S W	2	3	9,431		
ANY COLOR	6	10	31,300			アイネス	4	5	10,037		
IMAGICA GROUP	—	13	6,686			T K C	9	13	49,976		
ネットワンシステムズ	24	8	39,432			富士ソフト	12	20	199,818		
アルゴグラフィックス	5	6	35,088			N S D	21	28	97,153		
マーベラス	9	13	7,000			コナミグループ	22	27	515,016		
エイベックス	10	13	17,512			福井コンピュータホールディングス	3	5	15,402		
B I P R O G Y	19	24	107,094			J B C C ホールディングス	3	4	23,250		
都築電気	3	4	10,617			ミロク情報サービス	5	6	12,247		
T B S ホールディングス	29	36	158,303			ソフトバンクグループ	293	363	3,432,603		
日本テレビホールディングス	52	65	184,027			卸売業(6.1%)					
朝日放送グループホールディングス	9	0.100	68			リョーサン菱洋ホールディングス	—	11	30,761		
テレビ朝日ホールディングス	14	17	45,949			高千穂交易	2	3	12,493		
スカパーＪＳＡＴホールディングス	46	57	62,233			伊藤忠食品	1	1	13,320		
テレビ東京ホールディングス	4	4	15,772			エレマテック	5	—	—		
ビジョン	9	11	12,853			あらた	9	11	37,663		
U-NEXT HOLDINGS	6	24	44,739			トーメンデバイス	1	1	6,710		
日本通信	58	59	9,531			東京エレクトロン デバイス	6	7	24,909		
日本電信電話	17,686	21,902	3,197,808			円谷フィールズホールディングス	10	12	19,618		
K D D I	459	541	2,638,133			双日	69	86	280,692		
ソフトバンク	956	11,787	2,482,342			アルフレッサ ホールディングス	63	72	145,089		
光通信	6	8	312,800			横浜冷凍	17	19	17,082		
エムティーアイ	10	—	—			アルコニックス	8	11	16,461		
GMOインターネットグループ	22	24	68,592			神戸物産	48	60	191,057		
K A D O K A W A	31	38	143,074			ハイパー	4	—	—		
学研ホールディングス	9	13	13,324			あい ホールディングス	10	14	27,636		
ゼンリン	10	12	12,398			ディーブイエックス	4	—	—		
アイネット	3	4	8,734			ダイワボウホールディングス	27	34	90,609		
松竹	3	4	48,552			マクニカホールディングス	14	60	110,798		
東宝	33	46	328,185			ラクト・ジャパン	2	3	9,490		
東映	2	12	63,684			パイタルケースター・ホールディングス	9	10	12,326		
N T T データグループ	155	192	570,666			八洲電機	5	6	10,980		
ピー・シー・エー	5	4	9,369			メディアスホールディングス	8	—	—		
ビジネスブレイン太田昭和	2	3	7,932			レスター	5	6	15,787		
D T S	12	12	54,567			TOKA I 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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
三洋貿易	7	8	11,424			長瀬産業	28	34	94,765		
ビューティガレージ	2	4	6,757			蝶理	3	4	12,915		
ワイン・パートナーズ	5	5	7,307			豊田通商	54	233	561,319		
シップヘルスケアホールディングス	22	30	60,632			三共生興	8	11	7,256		
明治電機工業	4	4	6,582			兼松	26	32	80,112		
コメダホールディングス	15	20	54,424			三井物産	472	1,141	3,104,906		
アセンテック	10	—	—			日本紙パルプ商事	3	37	22,074		
フルサト・マルカホールディングス	5	6	13,999			カメイ	6	8	15,869		
ヤマエグループホールディングス	3	8	18,480			OUGホールディングス	1	—	—		
小野建	6	8	12,537			スターゼン	4	5	15,600		
南陽	1	—	—			山善	19	26	33,326		
佐鳥電機	3	4	8,075			椿本興業	1	4	9,073		
伯東	3	4	19,844			住友商事	379	465	1,502,634		
コンドーテック	5	6	7,872			内田洋行	2	3	21,421		
中山福	0.100	—	—			三菱商事	1,242	1,435	3,401,173		
ナガイレーベン	7	9	17,581			第一実業	5	7	17,374		
三菱食品	5	7	33,840			キヤノンマーケティングジャパン	14	15	76,243		
松田産業	4	5	18,555			西華産業	2	3	16,280		
第一興商	24	30	48,205			佐藤商事	4	5	7,954		
メディパルホールディングス	63	84	188,536			菱洋エレクトロ	5	—	—		
S P K	3	3	6,982			東京産業	8	9	6,805		
萩原電気ホールディングス	2	3	11,154			ユアサ商事	4	6	30,116		
アズワン	9	24	58,273			神鋼商事	1	1	10,064		
スズデン	2	3	7,038			阪和興業	11	12	63,360		
シモジマ	4	5	6,884			正栄食品工業	4	5	19,630		
ドウシシャ	5	7	14,853			カナデン	4	5	8,514		
小津産業	2	—	—			R Y O D E N	5	6	15,050		
高速	3	4	9,641			岩谷産業	14	77	120,895		
丸文	5	6	7,072			ナイス	2	—	—		
ハピネット	5	5	28,585			極東貿易	3	4	7,654		
橋本総業ホールディングス	4	5	6,960			アステナホールディングス	13	15	6,817		
日本ライフライン	18	20	32,739			三愛オブリ	15	18	32,013		
タカシヨー	—	17	6,811			稻畑産業	12	21	65,100		
I DOM	16	26	29,832			G S I クレオス	3	4	8,736		
進和	3	4	13,160			明和産業	9	11	7,914		
ダイトロン	2	3	11,067			ワキタ	10	11	19,277		
シーケス	8	11	11,688			東邦ホールディングス	17	21	87,570		
オーハシテクニカ	3	3	6,829			サンゲツ	14	19	56,608		
白銅	2	3	6,924			ミツウコグループホールディングス	8	9	18,037		
伊藤忠商事	421	522	3,187,508			シナネンホールディングス	1	2	12,621		
丸紅	523	638	1,444,472			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
サンリオ	17	63	436,462			アダストリア	7	10	32,367		
サンワ テクノス	3	3	7,542			くら寿司	7	9	28,119		
リョーサン	4	—	—			キャンドゥ	2	2	9,282		
新光商事	8	10	10,212			パルグループホールディングス	12	17	57,494		
トーホー	2	3	8,741			エディオン	24	33	58,203		
三信電気	2	3	6,619			サーラコーポレーション	13	16	12,632		
東陽テクニカ	6	7	10,123			ハローズ	2	3	12,214		
モスフードサービス	9	11	40,527			フジオフードグループ本社	7	9	11,252		
加賀電子	5	15	42,470			あみやき亭	1	5	8,741		
ソーダニッカ	5	7	8,451			大黒天物産	1	2	19,572		
立花エレテック	4	4	11,509			ハニーズホールディングス	5	6	11,274		
P A L T A C	8	12	47,444			アルペン	5	7	16,447		
三谷産業	17	20	6,831			クオールホールディングス	8	9	15,081		
西本Wismettacホールディングス	1	3	6,342			ジンズホールディングス	3	5	40,769		
コーナー商事ホールディングス	—	9	6,802			ビックカメラ	33	46	74,888		
K P Pグループホールディングス	16	16	11,012			DCMホールディングス	33	40	54,672		
ヤマタネ	2	3	11,888			MonotaRO	88	110	278,167		
泉州電業	2	5	25,296			東京一番フーズ	8	—	—		
トラスコ中山	13	16	31,899			J.フロント リテイリング	72	89	174,725		
オートバックスセブン	21	27	39,663			ドトール・日レスホールディングス	11	13	32,361		
モリト	4	6	9,300			マツキヨココカラ&カンパニー	114	136	320,688		
加藤産業	7	9	41,280			ブロンコビリー	3	4	16,123		
イエローハット	10	13	39,401			ZOZO	40	57	270,959		
J K ホールディングス	5	6	6,786			トレジャー・ファクトリー	4	5	7,828		
日伝	4	4	12,946			物語コーポレーション	10	15	47,942		
北沢産業	10	—	—			三越伊勢丹ホールディングス	105	116	267,030		
杉本商事	3	6	8,376			Hamee	5	5	6,715		
因幡電機産業	16	21	83,783			ウエルシアホールディングス	32	40	89,768		
東テク	2	7	19,344			クリエイトSDホールディングス	8	11	30,866		
ミスミグループ本社	94	117	289,508			丸善CHIホールディングス	12	—	—		
スズケン	23	25	127,795			ミサワ	2	—	—		
ジェコス	5	6	6,922			シュッピン	6	7	7,660		
小売業(4.5%)						オイシックス・ラ・大地	8	12	16,662		
インターメスティック	—	4	8,113			ネクステージ	14	17	25,735		
ローソン	13	—	—			ジョイフル本田	18	21	41,083		
サンエー	4	13	39,204			エターナルホスピタリティグループ	2	2	7,316		
カワチ薬品	4	6	16,030			ホットランド	4	5	12,230		
エービーシー・マート	27	34	100,368			すかいらーくホールディングス	85	106	264,703		
ハードオフコーポレーション	3	3	6,778			S F P ホールディングス	3	4	9,442		
アスクル	15	18	29,955			綿半ホールディングス	4	6	9,792		
ゲオホールディングス	7	8	15,120			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17	33	25,630			魚力	2	2	6,983		
B E E N O S	4	4	19,477			フジ・コーポレーション	3	3	6,789		
あさひ	5	6	9,392			ユナイテッドアローズ	7	8	18,094		
日本調剤	4	5	6,987			ハイディ日高	9	12	33,944		
コスモス薬品	5	15	104,581			コロワイド	27	43	74,722		
セブン&アイ・ホールディングス	216	858	2,059,440			壱番屋	5	30	28,888		
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	42	58	73,876			スギホールディングス	12	41	113,757		
ツルハホールディングス	13	13	126,684			薬王堂ホールディングス	3	3	7,052		
サンマルクホールディングス	5	6	14,023			スクワール	9	11	11,994		
フェリシモ	4	—	—			ヨンドシーホールディングス	5	7	13,271		
トリドールホールディングス	17	21	81,248			木曽路	9	11	25,452		
TOKYO BASE	19	20	6,789			S R S ホールディングス	10	12	15,782		
J M ホールディングス	4	5	12,527			リテールパートナーズ	9	11	13,972		
アレンザホールディングス	5	6	6,885			上新電機	6	7	16,701		
串カツ田中ホールディングス	—	5	6,936			日本瓦斯	33	37	82,193		
パロックジャパンリミテッド	7	9	7,052			ロイヤルホールディングス	11	13	32,332		
クスリのアオキホールディングス	18	20	63,266			いなげや	6	—	—		
力の源ホールディングス	4	5	7,975			チヨダ	7	7	8,228		
FOOD & LIFE COMPANIES	33	41	173,341			ライフコーポレーション	6	8	29,038		
メディカルシステムネットワーク	10	16	6,837			リングガーハット	8	10	22,500		
はるやまホールディングス	5	—	—			Mr Max HD	10	10	6,956		
ノジマ	18	25	57,684			AOKIホールディングス	13	16	20,925		
カッパ・クリエイト	9	12	17,677			オーツワ	9	12	9,610		
ライトオン	6	—	—			コメリ	9	10	29,589		
良品計画	68	92	362,600			青山商事	13	16	34,660		
アドヴァングループ	6	7	6,679			しまむら	14	18	162,871		
アルビス	2	2	7,092			高島屋	43	107	133,796		
ハウス オブ ローゼ	0.400	—	—			松屋	10	13	13,556		
G-7ホールディングス	6	8	10,812			エイチ・ツー・オー リテイリング	27	37	85,730		
イオン北海道	18	19	16,177			近鉄百貨店	2	4	9,279		
コジマ	10	15	15,000			丸井グループ	41	51	133,257		
ヒマラヤ	0.400	—	—			アクシアル リテイリング	4	21	20,161		
コーナン商事	7	8	30,788			イオン	212	287	1,041,462		
エコス	2	3	6,968			イズミ	11	11	35,376		
ワタミ	6	9	9,588			平和堂	10	12	29,654		
ル・ル・ワイヤー・イタナショナルホールディングス	126	156	637,484			フジ	9	14	28,900		
西松屋チェーン	12	17	37,891			ヤオコー	7	9	83,490		
ゼンショーホールディングス	31	44	337,673			ゼビオホールディングス	8	10	12,894		
幸楽苑	—	6	7,316			ケーズホールディングス	42	52	72,453		
サイゼリヤ	9	11	51,060			日産東京販売ホールディングス	4	—	—		
VTホールディングス	23	30	14,877			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
Genky DrugStores	2	6	19,536			第四北越フィナンシャルグループ	9	22	63,673		
ナルミヤ・インターナショナル	3	—	—			ひろぎんホールディングス	83	101	121,531		
ブックオフグループホールディングス	—	5	7,431			おきなわフィナンシャルグループ	5	5	14,398		
ギフトホールディングス	2	3	14,250			十六フィナンシャルグループ	7	10	46,716		
AINホールディングス	8	7	34,476			北國フィナンシャルホールディングス	6	7	37,914		
GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS	3	4	13,926			プロクレアホールディングス	6	8	14,574		
ヤマダホールディングス	192	238	103,419			あいちフィナンシャルグループ	9	13	37,624		
アークランズ	18	23	37,306			あおぞら銀行	42	49	109,480		
ニトリホールディングス	22	28	443,178			三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,555	4,638	9,149,441		
愛眼	1	—	—			りそなホールディングス	680	893	1,111,016		
ケーユーホールディングス	5	6	6,851			三井住友トラストグループ	209	257	1,007,082		
吉野家ホールディングス	23	30	88,616			三井住友フィナンシャルグループ	415	1,508	5,908,794		
松屋フーズホールディングス	3	3	21,238			千葉銀行	162	223	300,809		
サガミホールディングス	9	12	22,112			群馬銀行	113	125	132,068		
関西フードマーケット	4	—	—			武蔵野銀行	8	11	35,090		
王将フードサービス	4	15	46,053			千葉興業銀行	11	17	26,077		
ミニストップ	4	6	11,089			筑波銀行	—	31	7,956		
アーツ	11	13	35,186			七十七銀行	17	23	104,028		
バローホールディングス	12	14	32,944			秋田銀行	3	4	10,848		
ベルク	3	3	24,765			山形銀行	6	8	11,344		
大 庄	4	6	6,867			岩手銀行	3	4	14,398		
ファーストリテイリング	28	43	2,077,061			東邦銀行	46	62	19,718		
サンドラッグ	21	26	112,660			ふくおかフィナンシャルグループ	50	63	252,693		
サックスパー ホールディングス	7	—	—			スルガ銀行	51	48	64,722		
ヤマザワ	3	—	—			八十二銀行	125	169	165,473		
ベルーナ	15	18	17,017			山梨中央銀行	6	8	16,799		
銀行業(9.3%)						大垣共立銀行	11	13	30,718		
いよぎんホールディングス	69	94	150,573			福井銀行	5	6	12,148		
しづおかフィナンシャルグループ	129	159	245,322			清水銀行	4	2	3,171		
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	49	60	95,856			富山銀行	1	—	—		
楽天銀行	20	33	196,310			滋賀銀行	9	10	52,320		
京都フィナンシャルグループ	74	91	194,148			南都銀行	8	10	38,913		
じもとホールディングス	2	—	—			百五銀行	54	68	48,280		
めぶきフィナンシャルグループ	289	363	228,000			紀陽銀行	20	25	57,135		
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7	9	47,988			ほくほくフィナンシャルグループ	36	40	87,505		
九州フィナンシャルグループ	113	127	95,501			山陰合同銀行	36	45	57,032		
ゆうちょ銀行	641	595	915,004			百十四銀行	5	7	23,714		
富山第一銀行	18	23	23,230			四国銀行	8	10	12,529		
コンコルディア・フィナンシャルグループ	313	384	351,269			阿波銀行	8	10	27,966		
西日本フィナンシャルホールディングス	32	44	90,468			大分銀行	3	4	14,512		
三十三フィナンシャルグループ	5	6	15,320			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
佐賀銀行	3	4	9,349			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		
琉球銀行	12	16	19,090			第一生命ホールディングス	285	340	1,532,720		
セブン銀行	183	259	78,062			東京海上ホールディングス	577	706	3,581,538		
みずほフィナンシャルグループ	788	976	4,255,360			T & Dホールディングス	156	194	613,477		
山口フィナンシャルグループ	57	70	118,048			アドバンスクリエイト	3	5	3,051		
名古屋銀行	3	4	33,660			その他金融業(1.1%)					
北洋銀行	88	98	50,088			全国保証	15	18	103,269		
大光銀行	1	—	—			ジェイリース	1	5	7,101		
愛媛銀行	7	10	11,691			イントラスト	0.100	—	—		
京葉銀行	24	32	26,845			S B I アルヒ	7	7	5,971		
栃木銀行	29	33	9,996			プレミアグループ	9	12	27,218		
北日本銀行	2	2	8,800			ネットプロテクションズホールディングス	34	24	11,809		
東和銀行	10	13	8,684			クレディセゾン	37	45	164,193		
トモニホールディングス	55	69	34,638			芙蓉総合リース	5	6	74,437		
フィデアホールディングス	6	7	11,490			みずほリース	9	54	55,494		
池田泉州ホールディングス	81	100	41,825			東京センチュリー	43	54	77,139		
証券、商品先物取引業(1.0%)						日本証券金融	21	26	47,720		
F P G	19	25	62,924			アイフル	86	119	41,775		
ジャパンインベストメントアドバイザー	9	11	20,545			リコーリース	5	6	36,225		
マーキュリアホールディングス	1	—	—			イオンフィナンシャルサービス	33	41	51,252		
S B I ホールディングス	85	116	529,969			アコム	104	172	66,942		
ジャフコ グループ	17	21	49,256			ジャックス	6	8	33,886		
大和証券グループ本社	452	517	542,591			オリエントコーポレーション	19	23	19,092		
野村ホールディングス	981	1,216	1,220,864			オリックス	355	433	1,322,913		
岡三証券グループ	51	57	35,120			三菱H Cキャピタル	260	362	363,587		
丸三証券	19	24	23,834			日本取引所グループ	152	430	678,855		
東洋証券	19	21	12,441			イー・ギャランティ	9	11	20,709		
東洋証券	69	85	42,778			NECキャピタルソリューション	2	3	13,510		
光世証券	1	—	—			不動産業(1.8%)					
水戸証券	17	19	10,890			r o b o t h o m e	—	42	7,679		
いちよし証券	10	14	11,315			大東建託	21	24	385,073		
松井証券	28	49	39,939			いちご	67	61	21,726		
マネックスグループ	57	70	58,551			日本駐車場開発	61	86	17,306		
極東証券	8	9	14,670			S R E ホールディングス	2	2	8,613		
岩井コスモホールディングス	6	8	20,778			A Dワークスグループ	20	—	—		
アイザワ証券グループ	8	10	18,740			ヒューリック	136	168	227,491		
スパークス・グループ	6	8	12,676			野村不動産ホールディングス	32	45	184,869		
保険業(3.2%)						三重交通グループホールディングス	12	15	8,013		
かんぽ生命保険	59	84	240,054			サムティ	9	—	—		
F P パートナー	1	3	7,462			ディア・ライフ	10	12	13,001		
S O M P O ホールディングス	87	353	1,510,152			コーチアールティー	3	—	—		
アニコム ホールディングス	19	24	13,210			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
千株	千株	千円				千株	千株	千円			
プレサンスコーポレーション	9	9	22,924			F Jネクストホールディングス	6	7	8,823		
ハウスコム	4	—	—			グランディハウス	9	11	6,926		
J PMC	5	6	7,006			日本空港ビルディング	20	25	117,734		
サンセイランディック	2	—	—			サービス業(5.0%)					
エストラスト	7	—	—			L I F U L L	32	38	6,400		
フージャースホールディングス	9	11	12,032			M I X I	13	14	50,268		
オープンハウスグループ	21	26	140,155			ジェイエイシーリクルートメント	22	27	21,621		
東急不動産ホールディングス	175	217	209,877			日本M&Aセンターホールディングス	97	111	67,754		
飯田グループホールディングス	55	69	154,504			メンバーズ	6	—	—		
And Doホールディングス	5	5	6,805			U Tグループ	7	9	22,618		
シーアールイー	4	3	6,452			アイテイメディア	6	4	6,696		
ケイアイスター不動産	2	3	17,452			ケアネット	9	15	11,257		
グッドコムアセット	8	—	—			E・Jホールディングス	3	4	7,110		
ジェイ・エス・ビー	2	3	9,465			オープンアップグループ	18	25	46,368		
ロードスターキャピタル	3	4	10,172			コシダカホールディングス	18	23	24,909		
霞ヶ関キャピタル	1	3	42,960			パソナグループ	7	9	18,952		
パーク24	37	56	114,689			リンクアンドモチベーション	17	18	10,260		
パラカ	—	3	6,851			エス・エム・エス	21	28	34,992		
三井不動産	270	993	1,258,627			パーソルホールディングス	620	688	157,024		
三菱地所	381	412	889,311			フックパッド	53	—	—		
平和不動産	9	11	55,696			学情	3	3	7,862		
東京建物	51	63	150,416			スタジオアリス	3	3	8,033		
京阪神ビルディング	10	12	17,946			N J S	2	1	8,759		
住友不動産	84	117	586,706			綜合警備保障	101	126	132,531		
テーオーシー	10	12	8,552			カカクコム	40	54	126,044		
東京楽天地	1	—	—			アイロムグループ	—	3	8,382		
レオパレス21	58	63	37,536			セントケア・ホールディング	6	9	6,947		
スターツコーポレーション	8	11	47,600			ルネサンス	6	—	—		
フジ住宅	8	9	6,742			ディップ	9	13	29,132		
空港施設	10	11	6,925			デジタルホールディングス	—	4	7,035		
明和地所	—	6	6,910			新日本科学	5	8	12,576		
ゴールドクレスト	4	4	14,896			ベネフィット・ワン	21	—	—		
エスリード	2	3	14,943			エムスリー	120	149	291,089		
日神グループホールディングス	12	12	6,835			アウトソーシング	39	—	—		
日本エスコン	10	18	19,315			ワールドホールディングス	2	3	6,897		
MIRARTHホールディングス	26	42	21,454			ディー・エヌ・エー	21	30	106,726		
AVANTIA	3	—	—			博報堂DYホールディングス	77	85	90,136		
イオンモール	30	43	83,969			ぐるなび	23	20	7,011		
ファースト住建	1	—	—			ファンコミュニケーションズ	15	17	6,954		
カチタス	15	19	39,964			ライク	4	4	6,967		
トーセイ	9	12	28,992			エスプール	20	23	7,456		
サンフロンティア不動産	8	12	23,400			W D 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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
アドウェイズ	12	24	7,167			ベクトル	7	10	10,042		
バリューコマース	5	9	7,709			チャーム・ケア・コーポレーション	5	6	8,064		
インフォマート	63	71	29,405			キャリアリンク	2	2	6,454		
J P ホールディングス	15	19	10,306			I B J	9	10	7,207		
プレステージ・インターナショナル	28	35	25,063			アサンテ	3	4	6,900		
プロトコーコレーション	6	8	17,577			バリューH R	5	6	9,764		
アミューズ	4	4	7,107			M&Aキャピタルパートナーズ	4	6	18,208		
ドリームインキュベータ	2	1	7,200			ライドオンエクスプレスホールディングス	6	6	7,072		
ワイック	4	5	9,843			シグマクシス・ホールディングス	8	22	21,296		
電通グループ	59	80	246,119			ウィルグループ	5	6	6,865		
ぴあ	2	2	8,242			メドピア	9	—	—		
イオンファンタジー	2	3	9,880			リクルートホールディングス	451	588	5,815,387		
シーティーエス	9	10	8,528			エラン	8	10	7,780		
H. U. グループホールディングス	17	22	57,636			日本郵政	716	845	1,344,872		
アルプス技研	5	6	16,513			ベルシステム24ホールディングス	6	8	10,238		
日本空調サービス	7	8	8,035			鎌倉新書	10	13	6,716		
オリエンタルランド	322	444	1,359,614			エアトリ	4	5	6,336		
ダスキン	13	16	60,555			アトラエ	9	8	6,638		
明光ネットワークジャパン	8	9	7,003			ストライク	2	3	11,858		
ファルコホールディングス	2	3	7,023			ソラスト	16	20	9,817		
ラウンドワン	57	71	84,134			インソース	13	16	16,170		
リゾートトラスト	26	29	90,294			ペイカレント	44	55	371,683		
ビー・エム・エル	7	9	26,439			Orchestra Holdings	6	8	6,994		
リソー教育	31	47	12,980			アイモバイル	14	14	6,824		
早稻田アカデミー	—	4	8,400			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		
ユー・エス・エス	68	155	213,167			ミダックホールディングス	3	4	8,675		
東京個別指導学院	14	19	6,860			キューピーネットホールディングス	4	6	6,758		
サイバーエージェント	134	166	194,572			オープングループ	24	—	—		
楽天グループ	522	532	518,717			マネジメントソリューションズ	2	—	—		
クリーク・アンド・リバー社	3	4	7,236			プロレド・パートナーズ	17	16	7,040		
SB グローバルアセットマネジメント	11	14	10,345			アンビスホールディングス	6	16	11,242		
ティー・オー・ダブリュー	18	21	6,748			カーブスホールディングス	16	20	13,843		
山田コンサルティンググループ	3	3	6,669			フォーラムエンジニアリング	8	8	9,460		
セントラルスポーツ	2	2	7,015			Macbee Planet	—	2	6,930		
フルキャストホールディングス	5	6	10,031			ダイレクトマーケティングミックス	14	25	7,467		
エン・ジャパン	9	12	20,651			ポピinz	5	—	—		
テクノプロ・ホールディングス	35	45	140,454			L I T A L I C O	4	6	7,990		
アイ・アールジャパンホールディングス	4	9	6,826			リログループ	30	42	80,262		
K e e P e r 技研	3	4	18,494			東祥	7	9	6,586		
イー・ガーディアン	4	3	6,966			I D & E ホールディングス	3	5	32,350		
ジャパンマテリアル	18	23	34,881			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	当期末		
	期首(前期末)	株数	評価額
	千株	千株	千円
TR E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
燐ホールディングス	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
マ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	当期末		
	期首(前期末)	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 TOPIX	百万円 5,007	百万円 —

(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SA(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)SA(適格機関投資家限定)	1,695,602円
DC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
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,712,843,045円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	7,033,375,199円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	1,875,300円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	4,278,822円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	8,462,278円
DCニッセイ国内株式インデックス	5,466,408,010円
<購入・換出手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	25,528,690,186円
<購入・換出手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(資本形成等型)	5,567,777,230円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2055	496,392,826円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	255,226,405円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2045	566,641,796円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2035	652,057,583円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2025	19,968,293円
<購入・換出手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(資本形成等型)	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・換出手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(資本形成等型)	31,016,873円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2060	412,435,105円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2050	280,460,887円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2040	484,713,992円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2030	170,684,612円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(株式機関投資家限定)	22,690,721,624円
<購入・換出手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型パッケージ)	30,778,514円
FWニッセイ国内株式インデックス	79,143,003円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2065	221,277,879円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	44,088,651円
DCニッセイセイターゲットデートファンド2070	8,855,412円
ニッセイインデックスバランス(外債株式重視型)SA(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SA(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
売買益	31,612,789,155
売買損	△ 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。

【受益者の皆様へ】 法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

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-BP 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



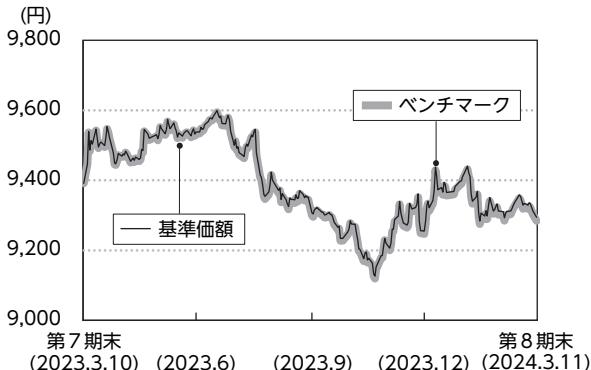
(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

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標化しています。

■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ある中立となるよう、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。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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) 謄落率は期首比です。

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
	国債証券	20,791,252	25,555,631
国 内	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。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

主要な売買銘柄

2023年3月11日～2024年3月11日

公社債

銘柄	買付 金額 千円	売付	
		銘柄	金額 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						
	額面金額 千円	評価額 千円	組入比率 %	うちBB格以下 組入比率 %	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	46,161,000	45,473,230	80.6	—	53.9	16.9	9.8
	(20,622,000)	(19,388,594)	(34.4)		(23.3)	(5.2)	(5.9)
地方債証券	3,118,000	3,185,487	5.6	—	4.6	1.1	—
	(3,118,000)	(3,185,487)	(5.6)		(4.6)	(1.1)	
特殊債券 (除く金融債券)	3,862,792	3,928,347	7.0	—	5.5	1.5	—
	(3,862,792)	(3,928,347)	(7.0)		(5.5)	(1.5)	
金融債券	600,000	596,497	1.1	—	—	0.7	0.4
	(600,000)	(596,497)	(1.1)			(0.7)	(0.4)
社債券	2,700,000	2,686,317	4.8	—	1.2	3.6	—
	(2,700,000)	(2,686,317)	(4.8)		(1.2)	(3.6)	
合計	56,441,792	55,869,880	99.1	—	65.2	23.8	10.1
	(30,902,792)	(29,785,244)	(52.8)		(34.5)	(12.0)	(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	
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	
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	
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関債券(20年)	1.5660	2034/ 4 /28	100,000	105,029
	第 1 回 地方公共団体金融機関債券(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関債券	0.0200	2026/ 4 /17	103,000	102,473
	第 116 回 政保地方公共団体金融機関債券	0.0950	2029/ 1 /22	138,000	135,733
	第 120 回 政保地方公共団体金融機関債券	0.0010	2029/ 7 /13	100,000	97,578
	第 136 回 地方公共団体金融機関債券	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 フランス相互通貨連合銀行(BFCM)円貨社債(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 ブリヂストン	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	
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(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
公社債	千円 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DB (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ートファンド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ートファンド2045 642,290,762円
 DCニッセイターゲットデートファンド2035 3,586,989,645円
 DCニッセイターゲットデートファンド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ートファンド2060 211,978,736円
 DCニッセイターゲットデートファンド2050 229,582,939円
 DCニッセイターゲットデートファンド2040 824,409,138円
 DCニッセイターゲットデートファンド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ートファンド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、期末の評価換算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。

【受益者の皆様へ】 法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

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

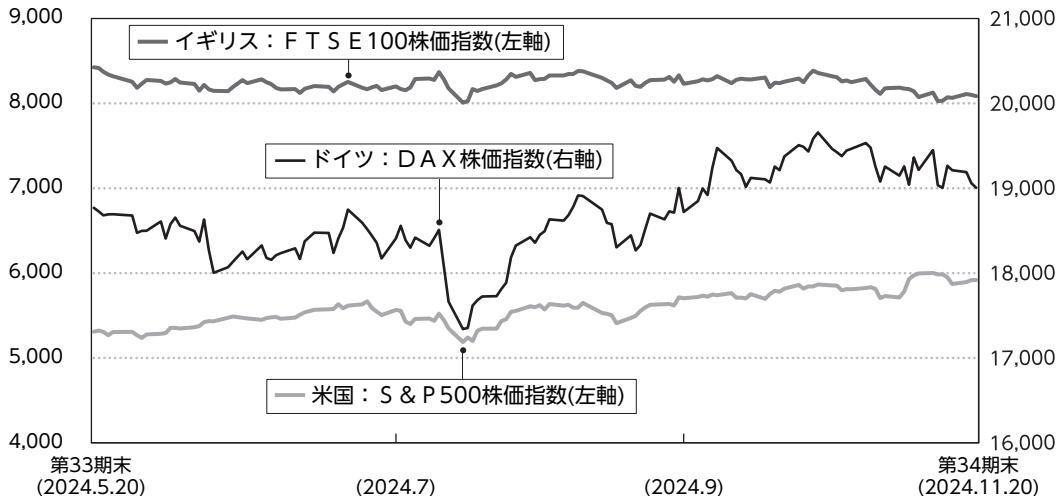
運用経過

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】



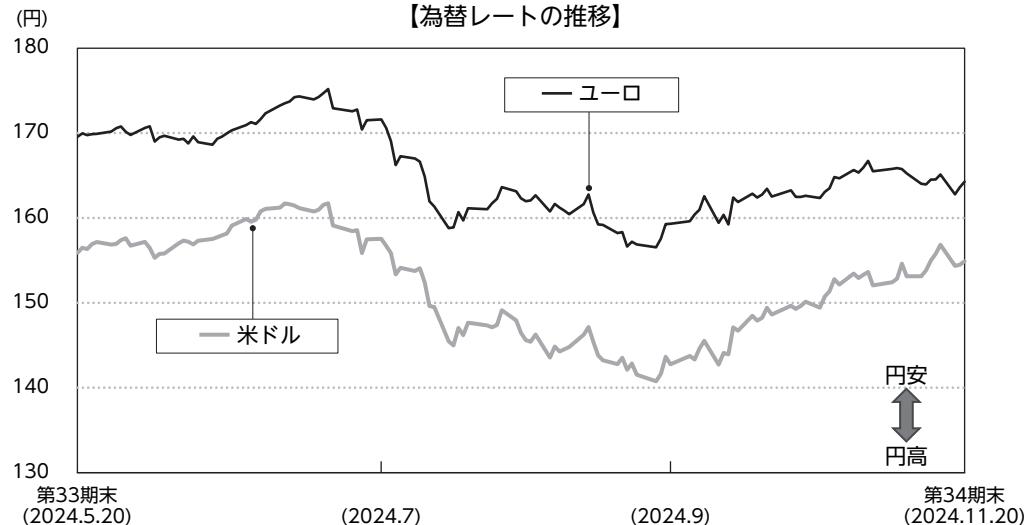
(注) FactSetのデータを使用しています。

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（FED）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（G D P）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標化しています。

■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、F R BやE C B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つ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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチマーク	期中	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
		騰落率		騰落率				
		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) 謄落率は期首比です。

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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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
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		千カナダ・ドル 2,134 (1,377)	567	千カナダ・ドル 1,622
オーストラリア		千オーストラリア・ドル 3,366	2,332	千オーストラリア・ドル 1,165
香港		千香港ドル 3,077	5,026	千香港ドル 5,382
シンガポール		千シンガポール・ドル 1,347	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・シュケル 1,071	—	千イスラエル・シュケル —
スイス	697	千スイス・フラン (△ 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・クローネ 48,376	229	千スウェーデン・クローネ 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 ニ コ	アイルランド	百株 382 (△ 279)	千ユーロ 312 (△ 1,236)	百株 15	千ユーロ 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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	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	—	—

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
(カナダ)	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
(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
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	—	—
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	10	356	—	—
(シンガポール)		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
CAPITALAND ASCENDAS REIT	19	52	—	—
		(△ 3)		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	32	66	—	—
		(△0.591)		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	—	—	369	490
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	—	—	251	307
(イギリス)		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	—	—
(ユーロ/ベルギー)		千ユーロ		千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW SCA	1	30	—	—
(ユーロ/フランス)				
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

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

(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		
APTV 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 SOLUTIONS INC	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		
FREEPORT-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 VEROVA 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 INDUSTRIES INC	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 INC	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			
REVIVITY 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 銘柄数<比率>	42,218 84	45,163 83	335,896 - <3.2%>	37,277,832		
(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	オーストラリア・ドル	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			
(香港)	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	76,494	255,024	5,074,996			
	銘柄数<比率>	26	23	<0.4%>			
(シンガポール)			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		
SEATRIUM LTD	2,347	—	—	—	資本財		
SEMCORP 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	千円				
WILMAR INTERNATIONAL LTD	2,034	2,132	76,574	660	食品・飲料・タバコ		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	36,684 15	34,015 12	29,838 -	3,457,093 <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	101,513	1,107	運輸		
EBOS GROUP LTD	162	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス		
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	618	648	226,256	2,467	ヘルスケア機器・サービス		
MERCURY NZ LTD	732	770	48,622	530	公益事業		
MERIDIAN ENERGY LTD	1,365	1,430	78,582	857	公益事業		
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,968	2,061	58,319	636	電気通信サービス		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,246 6	6,381 5	5,598 -	513,294 <0.0%>		
(イギリス)			千イギリス・ポンド				
3I GROUP PLC	1,029	1,076	733,864	3,732	金融サービス		
ABRDN PLC	1,960	-	-	-	金融サービス		
ADMIRAL GROUP PLC	275	288	142,132	722	保険		
ANGLO AMERICAN PLC	1,346	1,407	637,529	3,242	素材		
ANTOFAGASTA PLC	417	435	143,461	729	素材		
ASHTEAD GROUP PLC	463	484	585,036	2,975	資本財		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	361	371	158,090	804	食品・飲料・タバコ		
ASTRAZENECA PLC	1,642	1,717	3,383,782	17,211	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	156,129	794	メディア・娯楽		
AVIVA PLC	2,907	2,965	283,244	1,440	保険		
BAE SYSTEMS PLC	3,212	3,355	865,953	4,404	資本財		
BARCLAYS PLC	16,051	16,342	821,880	4,180	銀行		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,033	1,527	122,527	623	耐久消費財・アパレル		
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	112	112	96,842	492	耐久消費財・アパレル		
BP PLC	18,128	18,307	1,377,799	7,008	エネルギー		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,134	2,213	1,264,478	6,431	食品・飲料・タバコ		
BT GROUP PLC	6,928	7,222	212,715	1,081	電気通信サービス		
BUNZL PLC	357	374	253,262	1,288	資本財		
BURBERRY GROUP PLC	380	-	-	-	耐久消費財・アパレル		
CENTRICA PLC	5,708	5,794	137,831	701	公益事業		
COCA-COLA HBC AG-CDI	232	241	130,686	664	食品・飲料・タバコ		
COMPASS GROUP PLC	1,810	1,883	973,446	4,951	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・シェケル				
AZRIELI GROUP	45	47	1,362	56,404	不動産管理・開発		
BANK HAPOALIM 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	千ノルウェー・クローネ	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 銘柄数<比率>	6,136 11	6,380 11	119,051 —	1,682,202 <0.1%>		
(スウェーデン)			千スウェーデン・クローナ				
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		
INDSTRIVARDEN AB-A SHS	139	142	5,069	72,036	金融サービス		
INDSTRIVARDEN 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	千スウェーデン・クローナ	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		
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		
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			
(ユーロ／ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円			
D'ETEREN 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		
SYENSQO 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%>		
(ユーロ／ルクセンブルグ)							
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%>		
(ユーロ／フランス)							
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		
WORLDSLNE SA	254	—	—	—	金融サービス		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,996 54	25,913 52	171,969 —	28,249,352 <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		
BRENNNTAG 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			
(ユーロ／ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	144	148	7,020	1,153,330	保険		
NEMETSCHER 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 銘柄数<比率>	24,905	26,338	152,357	25,027,791		
		54	54	—	<2.1%>		
(ユーロ／ポルトガル)							
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 銘柄数<比率>	4,763	4,651	2,912	478,426		
		5	4	—	<0.0%>		
(ユーロ／スペイン)							
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 銘柄数<比率>	44,690	50,474	47,658	7,828,783		
		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 銘柄数<比率>	51,057	53,406	39,515	6,491,254		
		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)							
ELISA OYJ	百株	百株	千ユーロ	千円			
	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	
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GICS分類(産業グループ)によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国(外貨建)投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	評価額		邦貨換算金額
			外貨建金額	千円	
(アメリカ)	千口	千口	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	口数・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		
	口数	口数	評価額		千円
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	千口	千口	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	口数・金額	25	9	414	46,043
	銘柄数<比率>	2	1	—	<0.0%>
(オーストラリア)			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	口数・金額	2,127	2,224	14,167	1,435,186
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	272	283	9,475		188,560
小計	口数・金額	272	283	9,475	188,560
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>
(シンガポール)			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	口数・金額	1,579	1,010	2,222	257,458
	銘柄数<比率>	4	2	—	<0.0%>
(イギリス)			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	口数・金額	198	220	1,553	305,460
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>
(ユーロ/ベルギー)			千ユーロ		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	18	19	406		66,720
小計	口数・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		千円
			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
株式	千円	%
	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・クローネ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

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	228,048,905,816円
	期中追加設定元本額	23,976,725,288円
	期中一部解約元本額	15,024,433,160円
(注2)	当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパ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(標準型)	697,438,816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A(適格機関投資家認定)	2,320,921,1334円
	ニッセイインテグリラックス(標準型)	655,727円
	ニッセイインテグリラックス(標準型)	1,365,193円
	ニッセイインテグリラックス(適格機関投資家認定)	4,377,084円
	ニッセイ外債インデックスファンド(適格機関投資家認定)	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	
	DCニッセイ外国株式インデックス(6資産均等型)	161,391,837,322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)	44,717,793,265円
	DCニッセイワードセレクトファンド2055	3,524,993,735円
	DCニッセイワードセレクトファンド(安定型)	456,141,988円
	DCニッセイワードセレクトファンド2045	170,795,264円
	DCニッセイワードセレクトファンド2035	522,390,715円
	DCニッセイワードセレクトファンド2025	638,505,039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)	8,367,952円
	DCニッセイワードセレクトファンド2020	87,345,461円
	DCニッセイワードセレクトファンド2050	9,376,316円
	DCニッセイワードセレクトファンド2040	10,650,648円
	DCニッセイワードセレクトファンド2030	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ニッセイワードセレクトファンド2020	379,050,839円
	DCニッセイワードセレクトファンド2050	524,048,022円
	DCニッセイワードセレクトファンド2040	445,049,698円
	DCニッセイワードセレクトファンド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(適格機関投資家認定)	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)バスケット	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(適格機関投資家認定)	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(適格機関投資家認定)	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(適格機関投資家認定)	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(適格機関投資家認定)	109,534,576円
	ニッセイ先進国式インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)	31,658,672円
	ニッセイ先進国式インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	11,954,174,927円
	FWニッセイ先進国株式インデックス	53,058,104円
	DCニッセイワードセレクトファンド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(適格機関投資家認定)	79,189,559円
	DCニッセイ全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(適格機関投資家認定)	77,396,875円
	DCニッセイワードセレクトファンド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(適格機関投資家認定)	73,129,442円

損益の状況

項目		当期 (2024年5月21日～2024年11月20日)	
(A)配当	受取	益	8,156,237,986円
	受取	利	7,735,425,708
	その他	益	86,586,623
			334,225,655
(B)有価証券売買損益	売買益	79,781,133,956	
	売買益	135,108,083,041	
	売買損	△ 55,326,949,085	
(C)先物取引等損益	取引益	1,292,973,123	
	取引損	2,026,674,224	
		△ 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。

【受益者の皆様へ】 法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

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、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。
・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。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

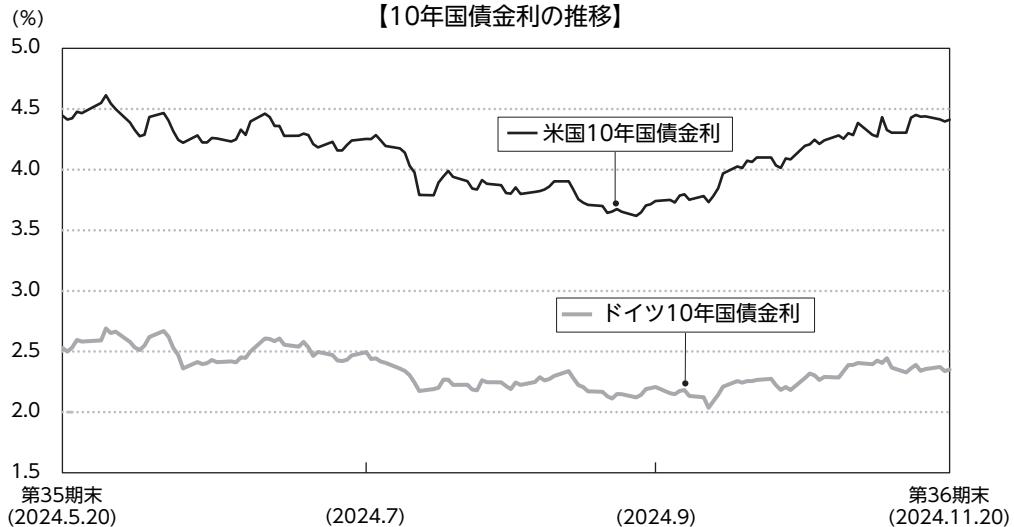
東京都千代田区丸の内1-6-6

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

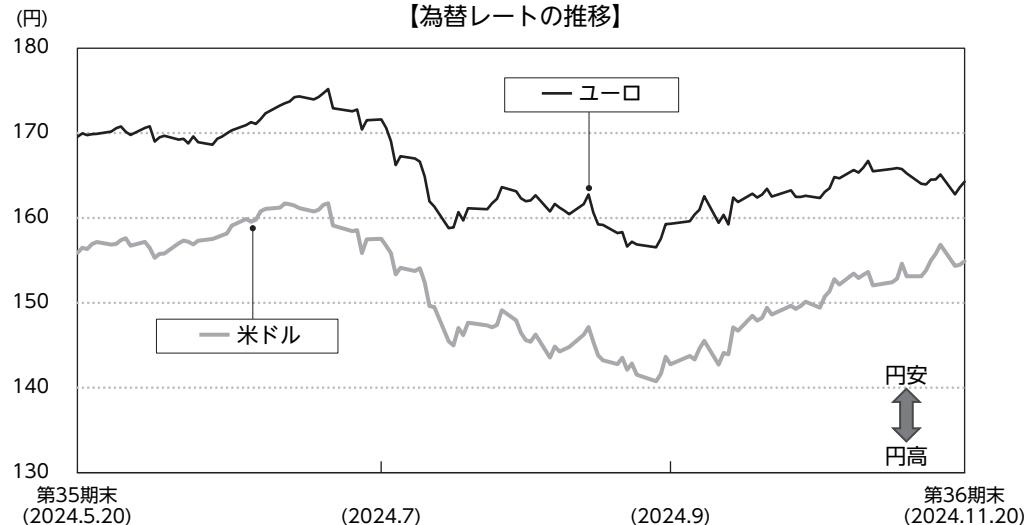


(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

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る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るました。

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る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るました。

■為替市況

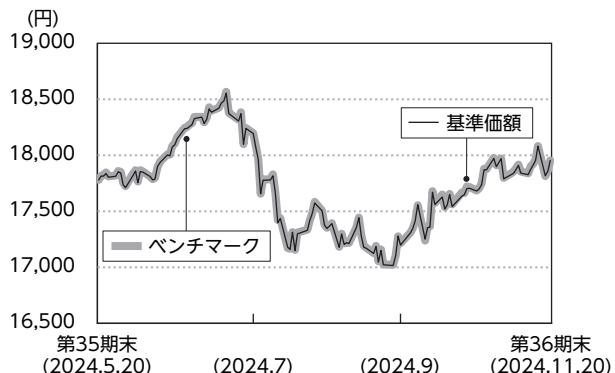


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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ること、さらに米大統領選でトランプ氏優位との見方が強まる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る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きました。

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ること、さらにユーロ圏実質域内総生産（G D P）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標化しています。

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) 謄落率は期首比です。

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"> ・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	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。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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・シュケル 1,246	千イスラエル・シュケル 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
	アイルランド	国債証券 千ユーロ 224	千ユーロ 176
ユ ー ロ	オランダ	国債証券 848	1,030
	ベルギー	国債証券 1,082	1,175
	フランス	国債証券 6,001	4,023
	ドイツ	国債証券 5,128	3,941
	ポルトガル	国債証券 3,293	—
	スペイン	国債証券 3,454	3,016
	イタリア	国債証券 5,674	3,749
	フィンランド	国債証券 516	434
	オーストリア	国債証券 928	664

(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) 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。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

主要な売買銘柄

2024年5月21日～2024年11月20日

公社債

銘柄	買付 金額	売付 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
千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%	%
アメリカ	310,860	277,039	42,916,152	46.4	—	19.0	16.7	10.7
カナダ	17,000	16,090	1,785,768	1.9	—	1.1	0.4	0.4
オーストラリア	13,040	11,591	1,174,220	1.3	—	0.9	0.3	0.2
シンガポール	3,330	3,253	376,940	0.4	—	0.2	0.1	0.1
ニュージーランド	3,090	2,788	255,684	0.3	—	0.2	0.1	0.0
イギリス	29,260	23,951	4,708,844	5.1	—	3.6	1.2	0.3
イスラエル	7,750	6,984	289,059	0.3	—	0.2	0.1	0.0

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B B格以下組入比率	残存期間別組入比率		
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	千円	0.2	—	0.1	0.0	0.0
	10,860	10,135	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	千円	0.2	—	0.1	0.1	0.0
	10,850	10,648	151,309					
メキシコ	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	0.7	—	0.4	0.2	0.1
	98,250	88,369	680,605					
中国	千人民元	千人民元	千円	11.0	—	5.0	3.9	2.1
	455,770	475,936	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	千円	0.5	—	0.3	0.1	0.0
	12,970	13,267	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	千円	0.5	—	0.1	0.3	0.1
	13,120	12,320	467,006					
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円	—	—	—	—	—
	2,920	2,644	434,358	0.5	—	0.3	0.1	0.0
	7,930	7,376	1,211,691	1.3	—	0.8	0.4	0.1
	9,390	8,766	1,440,099	1.6	—	1.1	0.4	0.1
	45,110	41,594	6,832,706	7.4	—	4.3	2.2	0.9
	34,030	32,221	5,293,058	5.7	—	3.2	1.8	0.7
	3,430	3,292	540,935	0.6	—	0.4	0.2	0.0
	25,970	25,036	4,112,782	4.4	—	2.5	1.4	0.6
	39,390	38,759	6,366,971	6.9	—	3.9	1.9	1.0
	3,070	2,763	453,927	0.5	—	0.3	0.1	0.0
	6,740	6,146	1,009,605	1.1	—	0.7	0.3	0.1
	合計	—	—	91,538,259	98.9	—	48.5	32.4

(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	
				千米ドル	千円
アメリカ	%		千米ドル	千米ドル	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	
				千米ドル	千円
アメリカ	%		千米ドル	千米ドル	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	
				千米ドル	千円
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	
				邦貨換算金額	千円
アメリカ	%		千米ドル	千米ドル	
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	
				千カナダ・ドル	邦貨換算金額
カナダ		%		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				オーストラリア・ドル	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	
				オーストラリア・ドル	邦貨換算金額
オーストラリア					
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					
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					
		%		千シングガポール・ドル	千円
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	200	200
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.6250	2031/07/01	140	129
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2032/08/01	120	117
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	200	207
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2034/05/01	60	62
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	200	187
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2039/07/01	140	130
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	140	136
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	200	196
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2050/03/01	160	133
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2051/10/01	130	107
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.2500	2054/06/01	60	65
	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
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5000	2027/04/15	190	192
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	0.2500	2028/05/15	330	289
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.0000	2029/04/20	250	238
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5000	2030/05/15	300	303
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.5000	2031/05/15	220	184
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.0000	2032/05/15	230	193
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.5000	2033/04/14	340	315
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.2500	2034/05/15	170	165
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5000	2035/05/15	120	118
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.2500	2036/05/15	150	143
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2037/04/15	150	120
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.7500	2041/05/15	130	82
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2051/05/15	150	98
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	5.0000	2054/05/15	100	97
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
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	380	363
	UK TREASURY	0.3750	2026/10/22	630	586
	UK TREASURY	4.1250	2027/01/29	740	735
	UK TREASURY	3.7500	2027/03/07	850	837
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	410	379

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	
				チイギリス・ポンド	邦貨換算金額
イギリス	%			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	
				チイギリス・ポンド	邦貨換算金額
イギリス	%				
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				チイスラエル・シェケル	チイスラエル・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				チデンマーク・クローネ	チデンマーク・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	
					千円	邦貨換算金額
デンマーク		%		千円	千円	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				千円	千円	千円
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				千円	千円	千円
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				千円	千円	千円
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	
				千メキシコ・ペソ	邦貨換算金額
メキシコ	%				
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	
				千人民元	邦貨換算金額
中国	%		千人民元	千人民元	千円
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				マレーシア・リntaggt;	マレーシア・リntaggt;
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	
				マレーシア・リソルト	邦貨換算金額
マレーシア					
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					
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	千円
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	千円	
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	千円	
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		
				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	千円	
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	
				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		
				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	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		
					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	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	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	
				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	千円
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	千円
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
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/06/20	210	214
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/02/20	230	175
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.8500	2049/05/23	150	121
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2051/03/20	240	143
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2053/10/20	120	122
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/01/26	100	117
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7000	2071/04/20	140	65
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2086/11/02	80	49
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1000	2117/09/20	130	101
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.8500	2120/06/30	120	54
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	
その他の収益	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。

■ファンドのベンチマーク等について

・T O P I X (東証株価指数) (配当込み)

T O P I X (東証株価指数) の指數値および同指數にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）の知的財産であり、指數の算出、指數値の公表、利用など同指數に関するすべての権利・ノウハウおよび同指數にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指數の指數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、J P X 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 J P X は責任を負いません。

・N O M U R A - B P I 総合

N O M U R A - B P I 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數であり、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。"

・M S C I コクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)

M S C I 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。

・F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)

F T S E 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。