

第7期末（2024年11月20日）

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 14,436円 |
| 純資産総額 | 168百万円 |
| 騰落率 | 10.0% |
| 分配金 | 0円 |

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



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

ニッセイ・ インデックスパッケージ (内外・株式／リート／債券)

【愛称】 ファンドパック7

追加型投信／内外／資産複合／インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2023年11月21日～2024年11月20日

第7期(決算日 2024年11月20日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート／債券）」は、このたび第7期の決算を行いました。

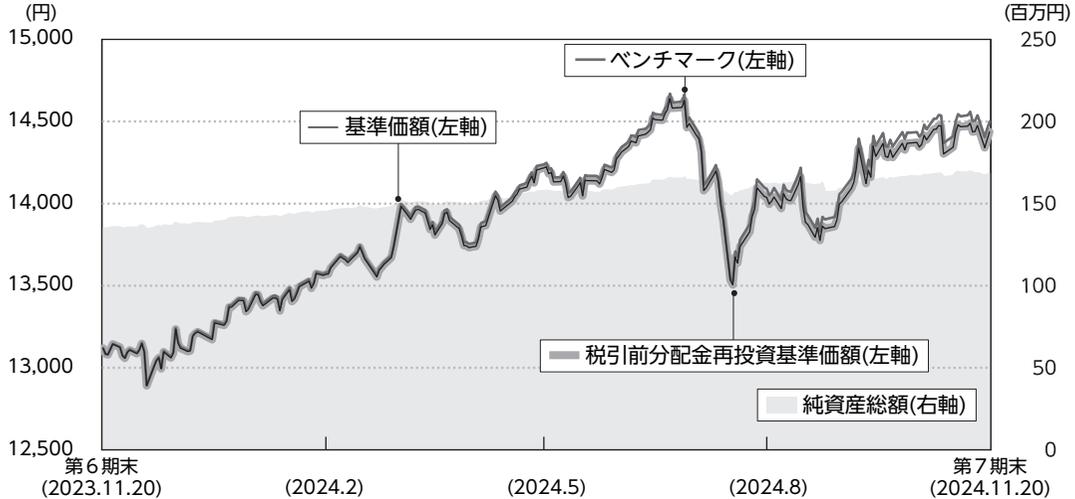
当ファンドは、投資対象の異なる7つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、リート（不動産投資信託）および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

運用経過

2023年11月21日～2024年11月20日

基準価額等の推移



| | | | |
|------|---------|-----------------|-------|
| 第7期首 | 13,119円 | 既払分配金 | 0円 |
| 第7期末 | 14,436円 | 騰落率 (分配金再投資ベース) | 10.0% |

- (注1) 税引前分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかに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) ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)をそれぞれ10%ずつ、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をそれぞれ25%ずつ組み合わせて合成したもので、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は国内外の株式市場上昇と為替市場における米ドル高円安を受け、上昇しました。

期初から2024年7月中旬にかけて、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を背景に国内外で株価が上昇したことから基準価額は上昇しました。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で株価が急落し基準価額も下落しましたが、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国内株価が反発し上昇しました。10月以降は堅調な米景気や為替市場における円安傾向が国内外の株式市場の下支えとなり、前期末を上回る水準で当期末を迎えました。

| 組入マザーファンド | 基本投資割合 | 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 | 10% | 10.1% | 16.4% |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 10 | 10.4 | 32.5 |
| ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド | 10 | 9.9 | 18.3 |
| ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド | 10 | 9.9 | △ 4.0 |
| ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド | 10 | 10.2 | 28.9 |
| ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド | 25 | 24.6 | △ 2.2 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 25 | 25.0 | 8.0 |

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第7期 | | 項目の概要 |
|------------|------|---------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 49円 | 0.356% | 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13,889円です。 |
| (投信会社) | (23) | (0.165) | 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) | (23) | (0.165) | 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) | (4) | (0.026) | 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 | 1 | 0.004 | |
| (株式) | (0) | (0.001) | 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数 |
| (先物・オプション) | (0) | (0.002) | 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) | (0.001) | |
| 有価証券取引税 | 1 | 0.004 | |
| (株式) | (0) | (0.002) | 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) | (0.001) | 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 | 7 | 0.048 | 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) | (4) | (0.031) | 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) | (2) | (0.011) | 公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用 |
| (その他) | (1) | (0.006) | ・ 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 | 57 | 0.412 | |

(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まず。

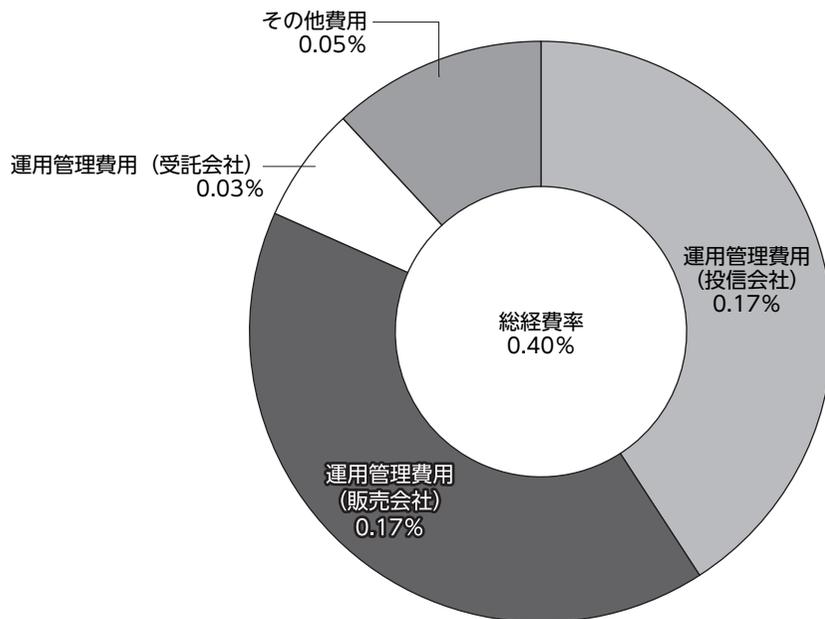
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.40%**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、日銀の金融政策修正への思惑等を背景に株価は軟調に推移しましたが、2023年12月以降は米長期金利のピークアウトや日本企業における2023年度7-9月期決算が総じて良好な内容であったことが好感され上昇に転じました。年明け以降は米金利の上昇による円安の進行、さらに海外投資家の買いや新しい少額投資非課税制度（NISA）に伴う資金流入により日経平均株価がバブル期から約34年ぶりに史上最高値を更新するなど、株価は大幅に上昇しました。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により株価は下落する場面もありましたが、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史上最高値を更新した米国株の上昇を背景におおむね上昇しました。

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、7月11日に日経平均株価は史上最高値を更新しました。7月下旬以降は米国の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たものの、内田日銀副総裁による金融引き締めにも慎重な発言を受けて再び円安になると上昇しました。10月以降は為替市場における円安傾向が下支えとなったものの、衆院選の結果を受けた景気刺激的な経済政策への思惑が交錯して株価は上下する展開となりましたが、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

先進国株式市況

外国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

2023年12月に公表された米連邦公開市場委員会（FOMC）議事録の要旨が金融引き締めにも慎重な姿勢であったことや、過度な金融引き締め長期化への警戒感が和らいだことなどから、年末にかけて株価は上昇しました。

年明け以降は米早期利下げ観測の後退により金利が上昇したことや中東における地政学リスクの高まりから株価は下落する場面があったものの、市場予想を上回る決算を発表した大型ハイテク株が堅調に推移したことなどから、2024年4月末にかけておおむね上昇しました。5月から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する場面がありました。7月中旬から8月上旬にかけては米大統領選を巡る混乱や米政府による対中半導体輸出規制の強化懸念、米景気の先行き懸念が高まり株価は下落しましたが、9月から10月にかけては米連邦準備制度理事会（FRB）や欧州中央銀行（ECB）による利下げ実施等を受けて上昇しました。

その後は米大統領選や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。

新興国株式市況

新興国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、米長期金利の低下見通しを背景に上昇して始まったものの、その後は中国経済の健全性を巡る懸念や堅調な米国労働市場を受けた利下げ観測の後退を背景に株価は一進一退の展開となりました。2024年2月から6月にかけては中国の景気刺激策や米半導体企業的好決算が好感され株価は上昇基調となりました。7月から9月にかけては中国や米国における経済成長減速の懸念等から下落する場面もありましたが、FRBの利下げや中国当局の追加的な金融緩和と不動産・株式市場に対する一連の支援策への期待感を背景に株価は反発しました。10月以降は中国における政策の不透明性や中東情勢の悪化懸念、米国の堅調な雇用統計を受けた大幅利下げ観測の後退による投資家のリスク回避姿勢の高まりから株価は下落基調に転じて当期末を迎えました。

■ Jリート市況

1月下旬以降、日銀金融政策決定会合におけるマイナス金利解除観測の高まりから、金利上昇が過度に懸念されJリート市場は大幅に下落しました。その後、3月中旬以降は日銀金融政策決定会合においてマイナス金利政策の解除やイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、YCC）の撤廃が発表され、金利上昇に対する悪材料の一つが消化されたことにより上昇しました。5月中旬から下旬にかけて、国内長期金利が上昇したことや公募増資の発表が相次いだことによる需給悪化を受けて下落しましたが、その後は横ばい推移しました。8月上旬には円高に伴う投資家のリスク回避姿勢の高まりを受けて、Jリート市場も一時下落しましたが、株式市場と比較して相対的な割安感やディフェンシブ性が着目されたことでその後は急上昇しました。しかし、当期末にかけて日銀の追加利上げへの警戒感の高まりを受けた金利上昇リスクが意識されたことで、前期末と比較すると下落して当期末を迎えました。

■ 先進国リート市況

先進国リート市場は期を通じて見ると大きく上昇しました。

期初以降、米長期金利が低下したことで借入れコストの低減により業績回復の恩恵を受けるとの見方が広がったことなどからリート市場は上昇して始まったものの、年明けから2024年4月中旬にかけては米地銀ニューヨーク・コミュニティ・バンコプ（NYCB）の損失懸念が表面化し地銀の経営不安が報じられたことや、中東における地政学リスクの高まりなどが嫌気され下落しました。しかし、9月中旬にかけては発表された米雇用統計が労働需給の緩和を示したことや米CPIが市場予想以上に減速したことなどからFRBの利下げ観測が高まりリート市場は大きく上昇しました。当期末にかけては米大統領選を控え財政リスクの高まりが意識された結果、米長期金利の上昇が続いたことからリート市場は軟調な展開となりました。

■ 国内債券市況

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、日銀のマイナス金利解除時期への思惑などから金利は上下しつつも低下基調となりました。2024年1月前半には能登半島地震の発生からマイナス金利解除の先送り観測が強まり金利は低下しましたが、その後は米金利の上昇を受けて上昇に転じ、1月下旬には植田日銀総裁の会見などから早期のマイナス金利解除観測が強まったことを背景に急上昇しました。3月には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月以降は堅調な米雇用統計を受けて米金利が上昇したことや衆院選における与党の過半数割れから財政拡張への警戒感が強まったことなどから上昇基調となり、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

■先進国債券市況

当期の米国10年国債金利は、期初から2023年12月末にかけて軟調な米経済指標やFOMCで政策金利の見通しが下方修正されたことを受けて低下しましたが、その後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基調に転じました。2024年5月には米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金利は再び低下基調となりました。10月以降は米大統領選でトランプ氏が勝利するとの見方が強まったことで財政拡張や関税引き上げに伴う物価上昇への懸念が高まったことから金利は上昇し、結局、期を通じて見ると期初と同程度の水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初から2023年12月末にかけてユーロ圏消費者物価指数（HICP）が市場予想を下回ったことから早期利下げ観測が高まり低下しましたが、その後はユーロ圏主要国の購買担当者景気指数（PMI）が市場予想を上回ったことから景気の底堅さが意識され上昇基調となりました。2024年6月以降は欧州議会選において極右政党が議席数を伸ばしたことで投資家のリスク回避姿勢が強まったことや欧州域内の経済指標が鈍化したことなどから再び低下基調となりました。10月以降はHICPが上昇したことや米国金利が上昇したことなどからドイツ金利も上昇に転じ、結局、期を通じて見るとやや低下して当期末を迎えました。

■為替市況

当期の米ドル／円レートは、期初から2023年12月末にかけて日本の財務省による為替介入への警戒感や日銀のマイナス金利解除期待が高まったことで下落しましたが、年明け以降は能登半島地震により日銀のマイナス金利解除期待が後退したことや堅調な米経済指標を背景にFRBの早期利下げ観測が後退したことを受けて米ドル高円安に転じました。2024年5月には日本の財務省による為替介入とみられる動きにより米ドル安円高に振れる場面があったものの、堅調な米経済指標が続いたことや日銀の利上げ観測・FRB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、期を通じて見ると米ドル高円安で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、期初から2023年12月末にかけて日銀のマイナス金利解除期待が高まったことで下落しましたが、年明け以降は能登半島地震により日銀のマイナス金利解除期待が後退したことやユーロ圏主要国のPMIが市場予想を上回ったことからユーロ高円安に転じました。その後も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が続きましたが、7月中旬には日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあったことや米経済指標が弱含んだことなどから大きくユーロ安円高となりました。9月下旬以降は自民党総裁選で石破氏が勝利し10月の衆院選で連立与党が過半数の議席数を確保できなかったことで政治の不透明感が高まったこと、さらにユーロ圏実質域内総生産（GDP）が市場予想を上回るなど欧州域内の経済指標が堅調であったことなどから再びユーロ高円安推移となり、結局、期を通じて見ると期初と同程度の水準で当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

投資対象の異なる7つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、リートおよび債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークである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。

<ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークである東証R E I T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。

<ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド>

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリートに投資することにより、ベンチマークであるS & P先進国R E I Tインデックス（除く日本、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>

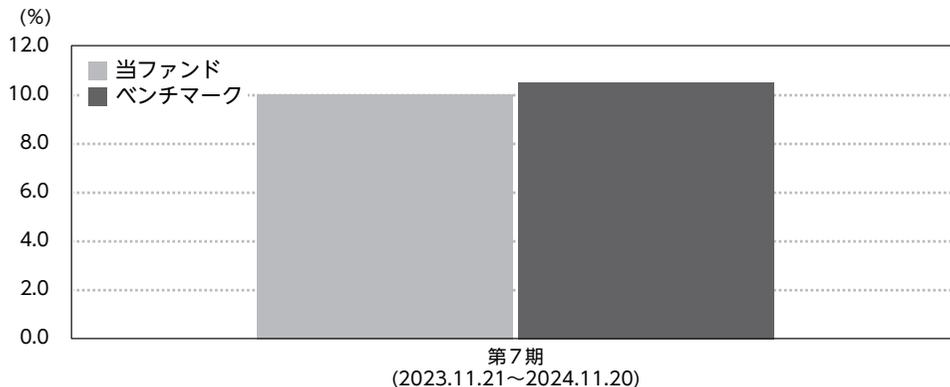
国内の公社債に投資することにより、ベンチマークであるN O M U R A - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<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「指数に関して」をご参照ください。

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+10.0%となり、ベンチマーク騰落率(+10.5%)を下回りました。

当ファンドは投資対象の異なる7つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、リートおよび債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行っています。相場変動による基本投資割合からの変動についてはリバランスを行い基本投資割合に戻しますが、当期の市場変動の中でリバランスに伴って一時的に発生したキャッシュ（未収入金）部分や当ファンドにおいて信託報酬等の費用を控除した影響などがマイナスに働きました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

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

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

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

| 項目 | 当期 2023年11月21日~2024年11月20日 |
|------------|-------------------------------|
| 当期分配金(税引前) | — |
| 対基準価額比率 | — |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 4,435円 |

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

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

今後の運用方針

■当ファンド

投資対象の異なる7つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、リートおよび債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所に上場しているJリート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。

<ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド>

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリート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7期末 2024年11月20日 |
|-----------------------------|---------------------|
| ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド | 10.1% |
| ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド | 10.4 |
| ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド | 9.9 |
| ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド | 9.9 |
| ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド | 10.2 |
| ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド | 24.6 |
| ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド | 25.0 |

(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

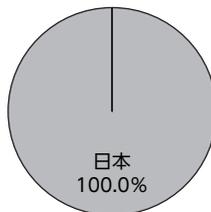
| 項目 | 第7期末 2024年11月20日 |
|------------|---------------------|
| 純資産総額 | 168,121,600円 |
| 受益権総口数 | 116,462,409口 |
| 1万口当たり基準価額 | 14,436円 |

(注) 当期間中における追加設定元本額は31,673,368円、同解約元本額は18,173,644円です。

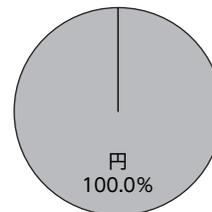
資産別配分



国別配分



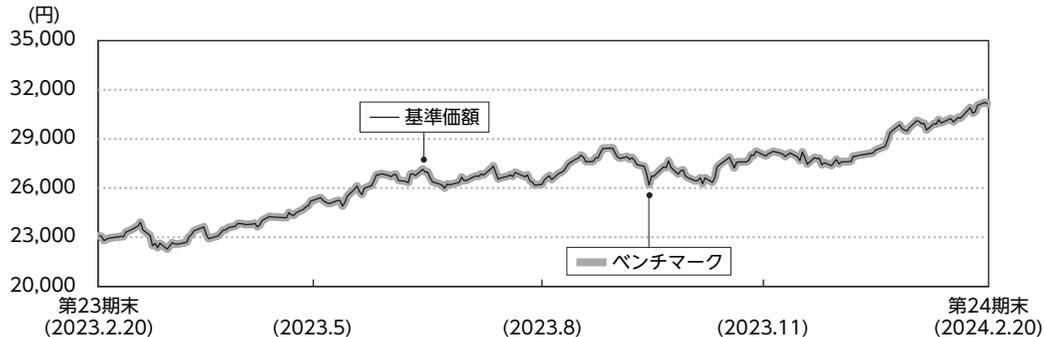
通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

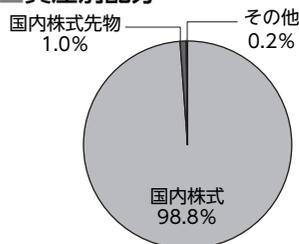
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------|----|-------|
| トヨタ自動車 | 円 | 5.0% |
| ソニーグループ | 円 | 2.5 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 円 | 2.4 |
| 東京エレクトロン | 円 | 1.9 |
| キーエンス | 円 | 1.8 |
| 三菱商事 | 円 | 1.7 |
| 日立製作所 | 円 | 1.6 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 円 | 1.5 |
| 信越化学工業 | 円 | 1.5 |
| 日本電信電話 | 円 | 1.4 |
| 組入銘柄数 | | 1,709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

■ 1万口当たりの費用明細

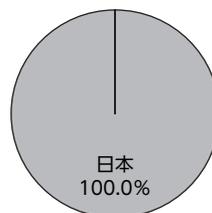
2023.2.21~2024.2.20

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

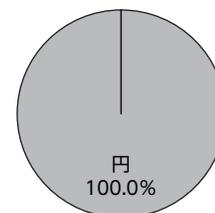
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

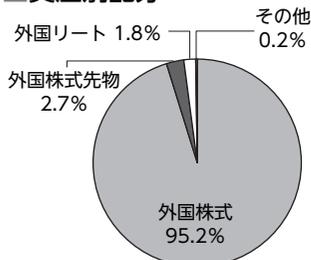
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------------------|-----|-------|
| NVIDIA CORP | 米ドル | 5.3% |
| APPLE INC | 米ドル | 4.9 |
| MICROSOFT CORP | 米ドル | 4.3 |
| AMAZON.COM INC | 米ドル | 2.8 |
| S&P 500 EMINI FUTURE 202412 買 | 米ドル | 2.0 |
| META PLATFORMS INC-A | 米ドル | 1.8 |
| ALPHABET INC-CL A | 米ドル | 1.5 |
|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

■ 1万口当たりの費用明細

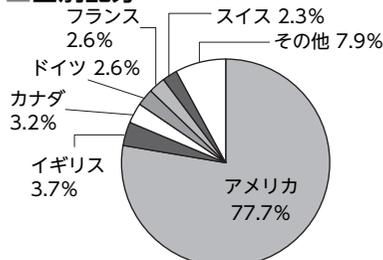
2024.5.21~2024.11.20

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

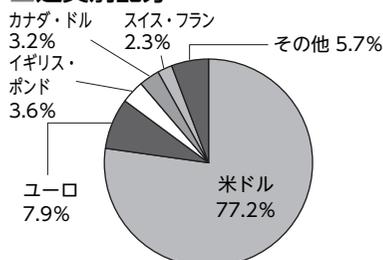
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

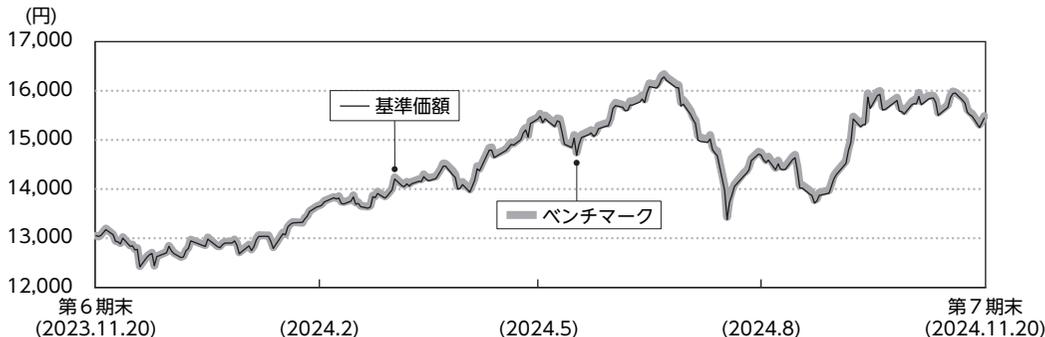
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2024年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

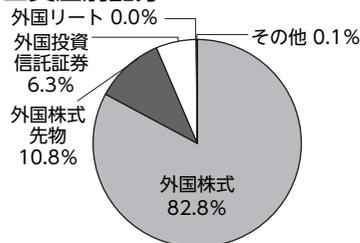
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|------------------------------------|---------|-------|
| MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202412 買 | 米ドル | 10.8% |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 台湾ドル | 9.1 |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 香港ドル | 4.0 |
| ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | 米ドル | 3.6 |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 韓国ウォン | 2.2 |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 香港ドル | 1.9 |
| MEITUAN-B | 香港ドル | 1.3 |
| ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF | 米ドル | 1.2 |
| RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | インド・ルピー | 1.0 |
| HDFC BANK LTD | インド・ルピー | 1.0 |
| 組入銘柄数 | | 1,013 |

■ 1万口当たりの費用明細

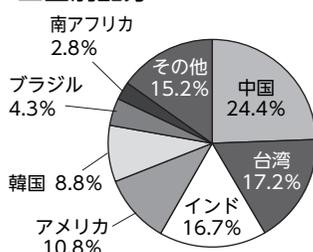
2023.11.21~2024.11.20

| 項目 | 金額 |
|-----------------|------------|
| 売買委託手数料 (株式) | 3円 (2) |
| (先物・オプション) | (1) |
| (投資信託証券) | (0) |
| 有価証券取引税 (株式) | 3 (3) |
| (投資信託証券) | (0) |
| その他費用 (保管費用) | 21 (17) |
| (その他) | (4) |
| 合計 | 27 |

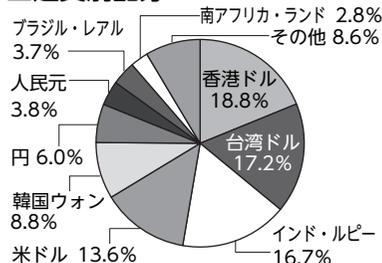
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

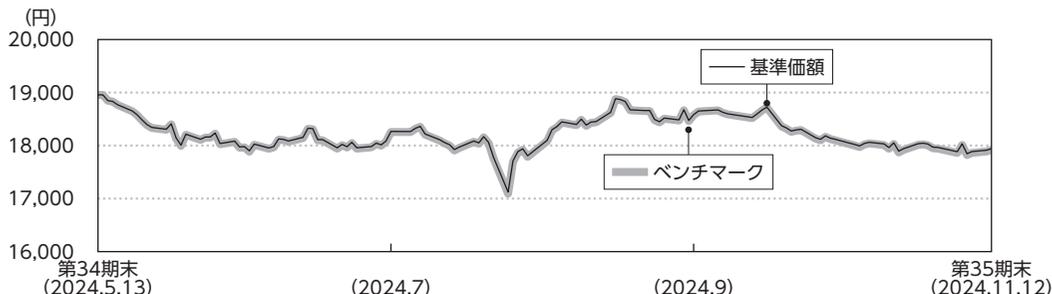
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2024年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

ニッセイJ-REITインデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

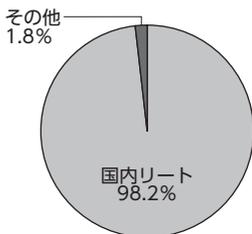
■ 上位銘柄

| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------|----|------|
| 日本ビルファンド投資法人 | 円 | 7.6% |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 円 | 5.9 |
| 日本都市ファンド投資法人 | 円 | 4.8 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 円 | 4.6 |
| GLP投資法人 | 円 | 4.4 |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 円 | 4.3 |
| KDX不動産投資法人 | 円 | 4.2 |
| インヴィンシブル投資法人 | 円 | 3.6 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 円 | 3.5 |
| オリックス不動産投資法人 | 円 | 3.2 |
| 組入銘柄数 | 57 | |

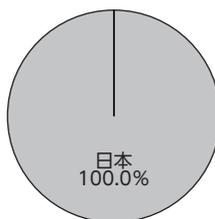
■ 1万口当たりの費用明細

当期 (2024年5月14日~2024年11月12日) における費用はありません。

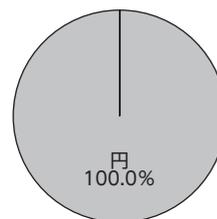
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



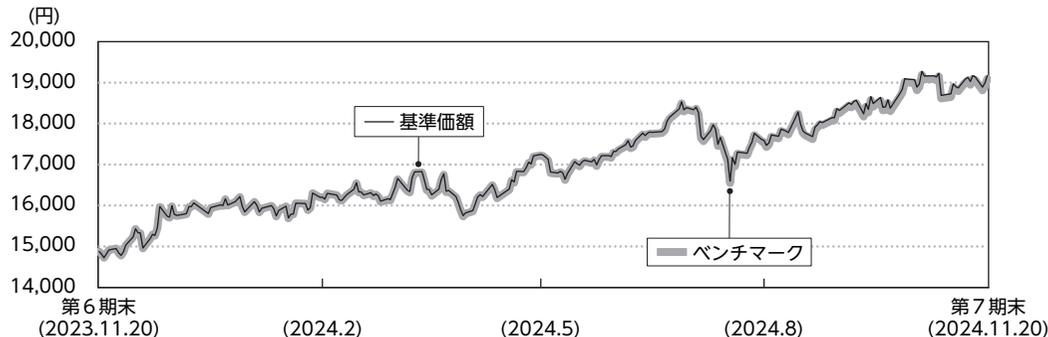
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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12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。

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

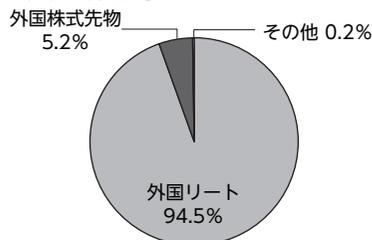
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|---|------------|------|
| PROLOGIS INC | 米ドル | 6.7% |
| EQUINIX INC | 米ドル | 5.5 |
| WELLTOWER INC | 米ドル | 5.0 |
| DOW JONES U.S. REAL ESTATE INDEX FUTURES 202412 買 | 米ドル | 4.6 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 米ドル | 3.6 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 米ドル | 3.5 |
| PUBLIC STORAGE | 米ドル | 3.3 |
| REALTY INCOME CORP | 米ドル | 3.1 |
| GOODMAN GROUP | オーストラリア・ドル | 2.7 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 米ドル | 2.2 |
| 組入銘柄数 | | 279 |

■ 1万口当たりの費用明細

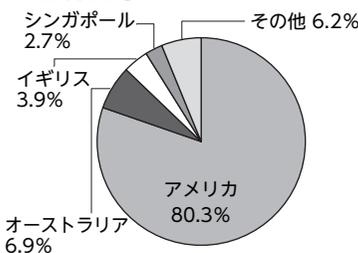
2023.11.21~2024.11.20

| 項目 | 金額 |
|-----------------|------------|
| 売買委託手数料 (株式) | 3円 (0) |
| (先物・オプション) | (2) |
| (投資信託証券) | (1) |
| 有価証券取引税 (株式) | 2 (0) |
| (投資信託証券) | (2) |
| その他費用 (保管費用) | 21 (15) |
| (その他) | (7) |
| 合計 | 27 |

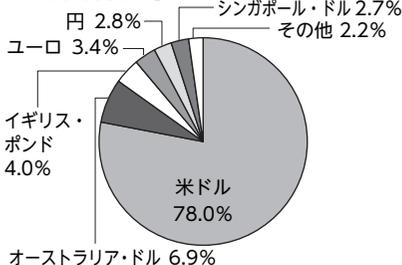
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

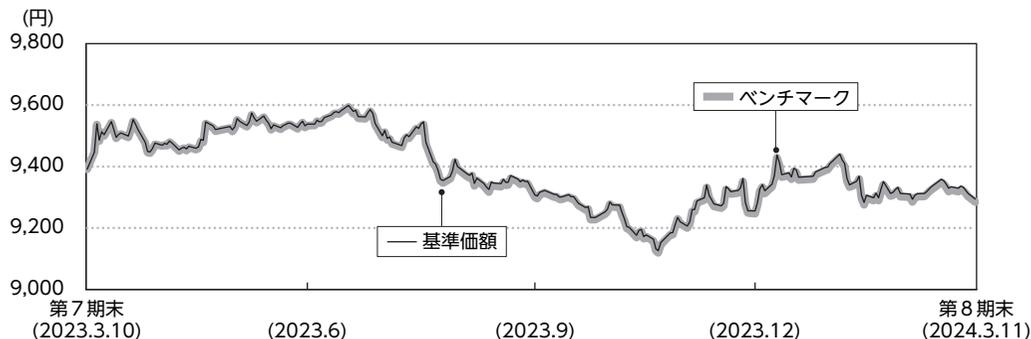
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2024年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

ニッセイ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



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

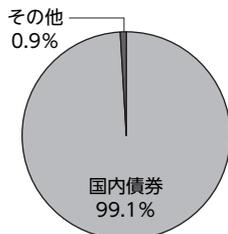
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|------------------|----|------|
| 第372回 利付国債 (10年) | 円 | 0.9% |
| 第340回 利付国債 (10年) | 円 | 0.9 |
| 第341回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 第145回 利付国債 (5年) | 円 | 0.8 |
| 第370回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 第149回 利付国債 (5年) | 円 | 0.8 |
| 第339回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 第350回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 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

■ 1万口当たりの費用明細

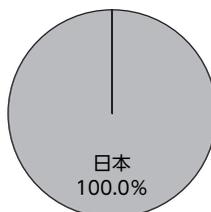
2023.3.11~2024.3.11

| 項目 | 金額 |
|----------------|-----------|
| その他費用 (その他) | 0円 (0) |
| 合計 | 0 |

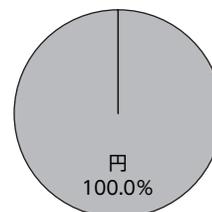
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



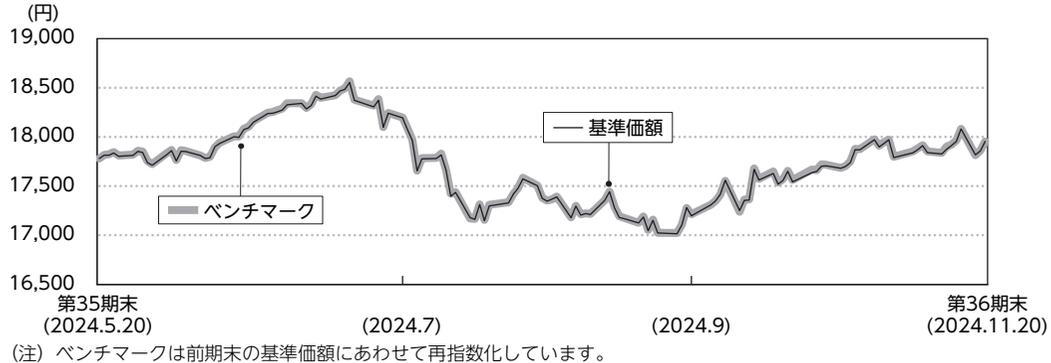
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日 (2024年3月11日現在) のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



■ 上位銘柄

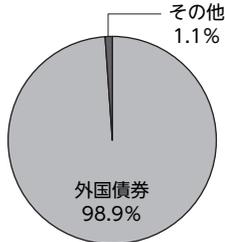
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|------------------------------|-----|------|
| US TREASURY 1.5% 2026/8/15 | 米ドル | 2.4% |
| US TREASURY 1.625% 2026/2/15 | 米ドル | 2.3 |
| US TREASURY 1.625% 2026/5/15 | 米ドル | 1.8 |
| US TREASURY 2.625% 2029/2/15 | 米ドル | 1.5 |
| US TREASURY 2.25% 2025/11/15 | 米ドル | 1.4 |
| US TREASURY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

■ 1万口当たりの費用明細

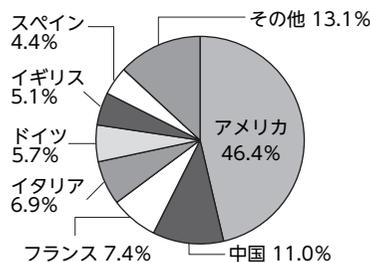
2024.5.21~2024.11.20

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

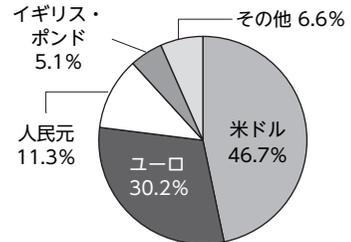
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

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

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

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配後) | 税引前 分配金 | 期中 騰落率 | (ご参考) | ベンチ マーク | 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 | | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | 円 | | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 3期(2020年11月20日) | 10,747 | 0 | 0.4 | 10,747 | 10,945 | 1.2 | 29.4 | 1.0 | 48.2 | 20.5 | 31 |
| 4期(2021年11月22日) | 12,395 | 0 | 15.3 | 12,395 | 12,686 | 15.9 | 27.8 | 1.4 | 49.2 | 20.5 | 80 |
| 5期(2022年11月21日) | 12,237 | 0 | △ 1.3 | 12,237 | 12,604 | △ 0.6 | 27.8 | 1.7 | 48.9 | 20.7 | 116 |
| 6期(2023年11月20日) | 13,119 | 0 | 7.2 | 13,119 | 13,594 | 7.8 | 27.6 | 2.5 | 48.9 | 20.3 | 135 |
| 7期(2024年11月20日) | 14,436 | 0 | 10.0 | 14,436 | 15,025 | 10.5 | 27.9 | 2.2 | 49.0 | 20.2 | 168 |

(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(分配後)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) 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 | | ベンチ マーク | | 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 |
|-----------------|--------|-------|------------|-------|------------|------------|------------|--------------------|
| | 基準価額 | 騰落率 | ベンチ マーク | 騰落率 | | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % | % |
| (期首)2023年11月20日 | 13,119 | - | 13,594 | - | 27.6 | 2.5 | 48.9 | 20.3 |
| 11月末 | 13,093 | △ 0.2 | 13,573 | △ 0.2 | 27.5 | 2.2 | 49.0 | 20.5 |
| 12月末 | 13,219 | 0.8 | 13,706 | 0.8 | 27.8 | 1.7 | 49.3 | 20.6 |
| 2024年1月末 | 13,417 | 2.3 | 13,915 | 2.4 | 28.5 | 1.9 | 48.9 | 20.1 |
| 2月末 | 13,640 | 4.0 | 14,147 | 4.1 | 28.5 | 2.0 | 48.9 | 19.8 |
| 3月末 | 13,965 | 6.4 | 14,488 | 6.6 | 28.3 | 1.6 | 48.8 | 20.6 |
| 4月末 | 14,048 | 7.1 | 14,582 | 7.3 | 27.8 | 2.1 | 49.2 | 20.3 |
| 5月末 | 14,044 | 7.1 | 14,582 | 7.3 | 27.9 | 2.3 | 49.0 | 20.0 |
| 6月末 | 14,412 | 9.9 | 14,971 | 10.1 | 28.1 | 1.9 | 49.2 | 20.2 |
| 7月末 | 14,132 | 7.7 | 14,678 | 8.0 | 26.7 | 1.9 | 49.8 | 20.9 |
| 8月末 | 14,018 | 6.9 | 14,581 | 7.3 | 27.5 | 2.5 | 48.8 | 20.5 |
| 9月末 | 14,122 | 7.6 | 14,694 | 8.1 | 28.5 | 1.7 | 48.9 | 20.1 |
| 10月末 | 14,473 | 10.3 | 15,062 | 10.8 | 28.0 | 1.9 | 49.3 | 20.1 |
| (期末)2024年11月20日 | 14,436 | 10.0 | 15,025 | 10.5 | 27.9 | 2.2 | 49.0 | 20.2 |

(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

2023年11月21日～2024年11月20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 | 2,022 | 6,356 | 1,582 | 5,010 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 1,251 | 5,483 | 1,446 | 6,364 |
| ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド | 4,138 | 5,929 | 3,996 | 5,842 |
| ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド | 4,670 | 8,479 | 2,403 | 4,419 |
| ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド | 2,981 | 5,063 | 3,482 | 5,882 |
| ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド | 19,020 | 17,519 | 9,343 | 8,599 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 7,647 | 13,250 | 4,462 | 7,778 |

(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 | ニッセイ 新興国株式 インデックス マザーファンド | ニッセイ 先進国リート インデックス マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 37,693,866千円 | 119,653,250千円 | 4,053,634千円 | 1,005千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 230,753,404千円 | 950,647,585千円 | 10,094,196千円 | 900千円 |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.16 | 0.12 | 0.40 | 1.11 |

(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

2023年11月21日～2024年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2024年11月20日現在

| 種類 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------------------|---------|--------|--------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 4,769 | 5,209 | 16,994 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 3,714 | 3,519 | 17,462 |
| ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド | 10,602 | 10,744 | 16,591 |
| ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド | 7,006 | 9,273 | 16,671 |
| ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド | 9,414 | 8,914 | 17,086 |
| ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド | 35,730 | 45,406 | 41,288 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 20,223 | 23,409 | 42,029 |

(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78,725,847千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,998,387千口、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンドが9,869,975千口、ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンドが17,100,771千口、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドが8,905,400千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,686,765千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが51,547,252千口です。

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|----------------------------|---------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 16,994 | 10.0 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 17,462 | 10.3 |
| ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド | 16,591 | 9.8 |
| ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド | 16,671 | 9.8 |
| ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド | 17,086 | 10.1 |
| ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド | 41,288 | 24.3 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 42,029 | 24.7 |
| コール・ローン等、その他 | 1,873 | 1.1 |
| 投資信託財産総額 | 169,996 | 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台湾ドル4.78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トルコ・リラ4.494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フィリピン・ペソ2.634円、100チリ・ペソ15.934円、100コロンビア・ペソ3.526円、1インド・ルピー1.84円、100インドネシア・ルピア0.98円、1ブラジル・レアル26.823円、1チェコ・コルナ6.494円、100韓国ウォン11.14円、1人民元21.415円、1マレーシア・リンギット34.667円、1南アフリカ・ランド8.58円、1タイ・バーツ4.49円、1ポーランド・ズロチ37.904円、100ハンガリー・フォリント40.243円、1ユーロ164.27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 (1,160,760,262千円) 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。
ニッセイ新興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 (14,328,023千円) の投資信託財産総額 (15,337,537千円) に対する比率は93.4%です。
ニッセイ先進国リート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 (16,592,508千円) の投資信託財産総額 (17,188,322千円) に対する比率は96.5%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 (92,515,496千円) 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。

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 | 169,996,835円 |
| コール・ローン等 | 285,263 |
| ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額) | 16,994,954 |
| ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額) | 17,462,476 |
| ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド(評価額) | 16,591,187 |
| ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド(評価額) | 16,671,028 |
| ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド(評価額) | 17,086,405 |
| ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額) | 41,288,182 |
| ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額) | 42,029,050 |
| 未収入金 | 1,588,290 |
| (B)負債 | 1,875,235 |
| 未払解約金 | 1,576,462 |
| 未払信託報酬 | 289,912 |
| その他未払費用 | 8,861 |
| (C)純資産総額(A-B) | 168,121,600 |
| 元本 | 116,462,409 |
| 次期繰越損益金 | 51,659,191 |
| (D)受益権総口数 | 116,462,409口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,436円 |

| | |
|-----------|--------------|
| (注) 期首元本額 | 102,962,685円 |
| 期中追加設定元本額 | 31,673,368円 |
| 期中一部解約元本額 | 18,173,644円 |

損益の状況

当期(2023年11月21日~2024年11月20日)

| 項目 | 当期 |
|------------------------|-------------------|
| (A)配当等収益 | 70円 |
| 受取利息 | 70 |
| (B)有価証券売買損益 | 13,558,030 |
| 売買益 | 16,120,511 |
| 売買損 | △ 2,562,481 |
| (C)信託報酬等 | △ 562,593 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | 12,995,507 |
| (E)前期繰越損益金 | 11,324,801 |
| (分配準備積立金) | (11,324,801) |
| (F)追加信託差損益金* | 27,338,883 |
| (配当等相当額) | (17,514,399) |
| (売買損益相当額) | (9,824,484) |
| (G)合計(D+E+F) | 51,659,191 |
| 次期繰越損益金(G) | 51,659,191 |
| 追加信託差損益金 | 27,338,883 |
| (配当等相当額) | (17,514,399) |
| (売買損益相当額) | (9,824,484) |
| 分配準備積立金 | 24,320,308 |

- (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 | 70円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 12,995,437円 |
| (c) 信託約款に定める収益調整金 | 27,338,883円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金 | 11,324,801円 |
| (e) 分配対象額 (a + b + c + d) | 51,659,191円 |
| (f) 分配対象額 (1万口当たり) | 4,435.70円 |
| (g) 分配金 | 0円 |
| (h) 分配金 (1万口当たり) | 0円 |

お知らせ

■関連会社の実質保有比率

2024年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドの信託財産において、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に19.0%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

当ファンドの概要

| | | |
|---------|--|--|
| 商 品 分 類 | 追加型投信／内外／資産複合／インデックス型 | |
| 信 託 期 間 | 無期限 | |
| 運 用 方 針 | 下記マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、リート（不動産投資信託）および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。 | |
| 主要運用対象 | ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式／リート／債券) | 「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド」「ニッセイ先進国リート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」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券 |
| | ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド | 国内の金融商品取引所上場株式等 |
| | ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド | 日本を除く主要先進国の株式 |
| | ニッセイ新興国株式 インデックスマザーファンド | 新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます） |
| | ニッセイJ-REIT インデックスマザーファンド | 国内の金融商品取引所に上場しているJリート |
| | ニッセイ先進国リート インデックスマザーファンド | 各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリート |
| | 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 |
| | 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 |

ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式／リート／債券)

| | | |
|---------|------------------------------------|---|
| | ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式／リート／債券) | 各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、信託財産の純資産総額に対して以下の通りとします。 ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド…10% ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド…10% ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド…10% ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド…10% ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド…10% ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド…25% ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド…25% |
| 運用方法 | ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。 |
| | ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| | ニッセイ新興国株式 インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| | ニッセイJ-R E I T インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 |
| | ニッセイ先進国リート インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%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。 |
| | ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りです。 |
| | ニッセイ外国債券 インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資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。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。 |

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 24 期

(計算期間：2023年2月21日～2024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。



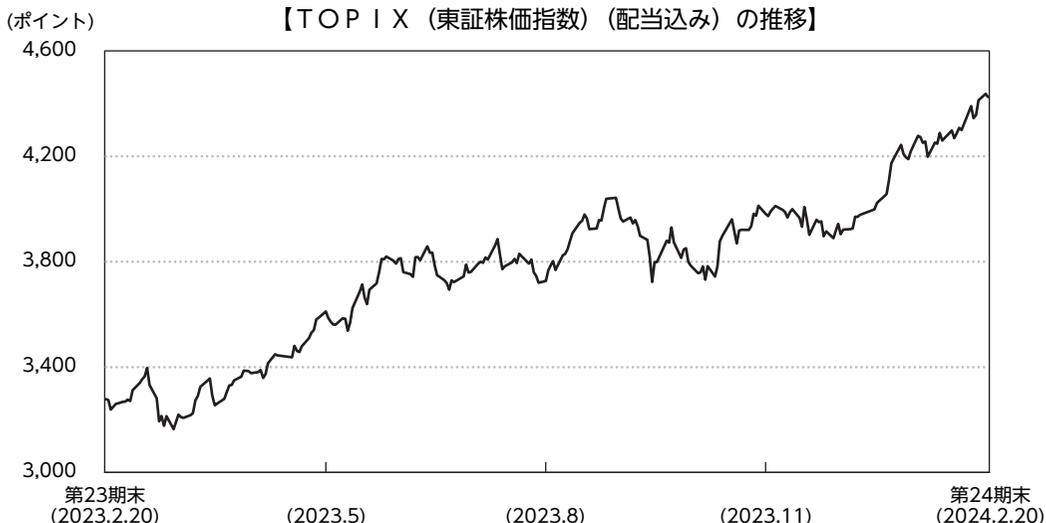
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年2月21日～2024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。

当期の国内株式市場はおおむね上昇基調で推移しました。

期初以降、欧米における金融引き締め長期化懸念が後退したことや、日銀の金融緩和の現状維持により市場に安心感が広がったことから株価は上昇しましたが、2023年3月中旬に米地銀の経営破綻や欧州大手投資銀行の信用不安等に伴う欧米金融システムに対する懸念を受けて下落しました。

3月下旬以降は外国人投資家の買い越しや東京証券取引所が株価純資産倍率（PBR）の低い企業に資本効率や株価を意識した経営を求めたことによる日本企業の資本コスト意識の高まりなど、国内独自のポジティブ要因に加えて、米経済の軟着陸（ソフトランディング）への期待感や人工知能（AI）ブームによる世界同時株高の追い風を受けて株価は上昇基調で推移しました。

7月に入ると米金利の上昇や日銀によるイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、YCC）の運用柔軟化等、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、その後、9月中旬にかけては米追加利上げ観測の後退を背景に上昇しました。9月下旬から10月末にかけては米金利の上昇を受けて株価は下落しましたが、11月に入ると日銀の金融緩和姿勢の継続が示唆されたことや米金利が低下したため株価は上昇する展開となりました。その後は円高の進行などから下落する場面もありましたが、年明け以降は米株高や円安に加えて、海外投資家の買いや新しい少額投資非課税制度（NISA）に伴う資金流入への期待感等を背景に株価は大きく上昇し、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

国内の金融商品取引所上場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。

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。

*ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+34.9%となり、ベンチマーク騰落率（+35.0%）にほぼ連動しました。

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。

お知らせ

■ 約款変更

ベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化しました。

(2023年8月19日)

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 |
| 20期(2020年2月20日) | 18,004 | 6.4 | | 18,182 | 6.4 | | 98.3 | 1.6 | 68,225 |
| 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 |

(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)2023年2月20日 | 23,077 | - | | 23,334 | - | | 97.9 | 2.1 |
| 2月末 | 23,009 | △ | 0.3 | 23,267 | △ | 0.3 | 98.0 | 1.7 |
| 3月末 | 23,396 | 1.4 | | 23,663 | 1.4 | | 97.3 | 2.7 |
| 4月末 | 24,024 | 4.1 | | 24,301 | 4.1 | | 97.1 | 2.7 |
| 5月末 | 24,892 | 7.9 | | 25,180 | 7.9 | | 96.9 | 3.1 |
| 6月末 | 26,770 | 16.0 | | 27,081 | 16.1 | | 97.2 | 2.8 |
| 7月末 | 27,171 | 17.7 | | 27,485 | 17.8 | | 98.3 | 1.8 |
| 8月末 | 27,286 | 18.2 | | 27,604 | 18.3 | | 97.6 | 2.4 |
| 9月末 | 27,429 | 18.9 | | 27,744 | 18.9 | | 96.5 | 3.6 |
| 10月末 | 26,611 | 15.3 | | 26,914 | 15.3 | | 97.4 | 2.5 |
| 11月末 | 28,049 | 21.5 | | 28,374 | 21.6 | | 97.9 | 2.1 |
| 12月末 | 27,989 | 21.3 | | 28,309 | 21.3 | | 97.4 | 2.8 |
| 2024年1月末 | 30,174 | 30.8 | | 30,521 | 30.8 | | 98.2 | 1.8 |
| (期末)2024年2月20日 | 31,139 | 34.9 | | 31,493 | 35.0 | | 98.8 | 1.0 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年2月21日～2024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（26,547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2月21日～2024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 |
| | | 7,499 | 15,648,076 | 14,224 | 29,977,664 |
| | | (23,418) | | | |

(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 | |
| 国内 | 株式先物取引 | 37,374 | 40,391 | - | - |

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2023年2月21日～2024年2月20日

株式

| 銘柄 | 買付 | | | 銘柄 | 売付 | | |
|-------------------|-----|---------|--------|-------------------|-------|---------|--------|
| | 株数 | 金額 | 平均単価 | | 株数 | 金額 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| ゆうちょ銀行 | 488 | 660,469 | 1,352 | トヨタ自動車 | 452 | 822,585 | 1,817 |
| トヨタ自動車 | 211 | 526,041 | 2,491 | ソニーグループ | 58 | 713,686 | 12,241 |
| 三菱商事 | 61 | 354,452 | 5,791 | 日本電信電話 | 1,025 | 586,441 | 572 |
| ソニーグループ | 27 | 352,645 | 12,964 | 東芝 | 127 | 581,911 | 4,574 |
| 信越化学工業 | 75 | 348,046 | 4,616 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 607 | 554,558 | 912 |
| 伊藤忠商事 | 60 | 330,366 | 5,478 | キーエンス | 8 | 517,596 | 62,360 |
| 三井物産 | 55 | 300,804 | 5,400 | ソフトバンクグループ | 94 | 475,014 | 5,015 |
| キーエンス | 3 | 247,194 | 63,383 | 日立製作所 | 49 | 377,010 | 7,585 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 181 | 211,996 | 1,170 | 第一三共 | 72 | 343,238 | 4,767 |
| 東京エレクトロン | 8 | 178,198 | 21,469 | 三井住友フィナンシャルグループ | 59 | 335,202 | 5,633 |

(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

2024年2月20日現在

(1) 国内株式
上場株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|---------------------|---------|-----|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業(0.1%) | | | | |
| 極洋 | 3 | 3 | 3 | 11,036 |
| ニッセイ | 89 | 83 | 83 | 77,224 |
| マルハニチロ | 13 | 12 | 12 | 35,670 |
| 雪国まいたけ | 7 | 7 | 7 | 6,816 |
| カネコ種苗 | 3 | 2 | 2 | 4,079 |
| サカタのタネ | 11 | 9 | 9 | 35,530 |
| ホフト | 7 | 6 | 6 | 12,381 |
| 鉱業(0.3%) | | | | |
| 住石ホールディングス | 13 | 9 | 9 | 20,012 |
| 日鉄鉱業 | 3 | 3 | 3 | 17,028 |
| 三井松島ホールディングス | 4 | 5 | 5 | 15,050 |
| I N P E X | 330 | 307 | 307 | 620,640 |
| 石油資源開発 | 10 | 9 | 9 | 58,656 |
| K&Oエナジーグループ | 4 | 3 | 3 | 9,359 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|------------------|---------|----|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 建設業(2.0%) | | | | |
| ショーボンドホールディングス | 12 | 11 | 11 | 69,935 |
| ミライト・ワン | 31 | 27 | 27 | 48,413 |
| タマホーム | 6 | 5 | 5 | 20,644 |
| ファーストコーポレーション | 1 | 1 | 1 | 1,027 |
| 安藤・間 | 51 | 48 | 48 | 59,237 |
| 東急建設 | 25 | 26 | 26 | 21,060 |
| コムシスホールディングス | 30 | 26 | 26 | 88,006 |
| ピーアールホールディングス | 14 | 17 | 17 | 6,446 |
| 高松コンストラクショングループ | 5 | 6 | 6 | 16,839 |
| 東建コーポレーション | 2 | 2 | 2 | 20,139 |
| ソネット | 4 | 1 | 1 | 1,387 |
| ヤマウラ | 4 | 4 | 4 | 6,300 |
| オリエンタル白石 | 32 | 30 | 30 | 11,827 |
| 大成建設 | 62 | 54 | 54 | 260,902 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 大林組 | 223 | 208 | 295,048 |
| 清水建設 | 187 | 164 | 147,321 |
| 飛鳥建設 | 6 | 6 | 8,820 |
| 長谷工コーポレーション | 64 | 53 | 100,097 |
| 松井建設 | 8 | 7 | 6,650 |
| 銭高組 | 1 | - | - |
| 鹿島建設 | 138 | 128 | 359,437 |
| 不動テトラ | 4 | 4 | 8,844 |
| 鉄建建設 | 4 | 4 | 10,378 |
| 西松建設 | 10 | 11 | 50,727 |
| 三井住友建設 | 50 | 43 | 18,575 |
| 大豊建設 | 2 | 2 | 6,400 |
| 佐田建設 | 10 | 2 | 1,505 |
| ナカノフドー建設 | 15 | 0.100 | 64 |
| 奥村組 | 10 | 9 | 47,470 |
| 東鉄工業 | 8 | 7 | 21,888 |
| 浅沼組 | 5 | 4 | 17,909 |
| 戸田建設 | 76 | 78 | 75,575 |
| 熊谷組 | 10 | 9 | 36,912 |
| 植木組 | 3 | 0.900 | 1,635 |
| 矢作建設工業 | 8 | 7 | 12,624 |
| ピーエス三菱 | 7 | 7 | 7,784 |
| 日本ハウスホールディングス | 13 | 21 | 6,447 |
| 新日本建設 | 8 | 8 | 10,184 |
| 東亜道路工業 | 1 | 2 | 14,858 |
| 日本道路 | 1 | 6 | 13,749 |
| 東亜建設工業 | 5 | 4 | 20,947 |
| 日本国土開発 | 18 | 16 | 8,613 |
| 若築建設 | 2 | 2 | 6,594 |
| 東洋建設 | 20 | 14 | 19,213 |
| 五洋建設 | 88 | 82 | 62,797 |
| 世紀東急工業 | 8 | 7 | 14,520 |
| 福田組 | 2 | 2 | 11,726 |
| 住友林業 | 47 | 50 | 205,374 |
| 日本基礎技術 | 8 | 8 | 3,661 |
| 巴コーポレーション | 10 | 6 | 3,960 |
| 大和ハウス工業 | 174 | 160 | 698,193 |
| ライト工業 | 11 | 12 | 22,596 |
| 積水ハウス | 195 | 176 | 580,356 |
| 日特建設 | 6 | 5 | 6,501 |
| 北陸電気工事 | 7 | 5 | 6,864 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ユアテック | 13 | 12 | 16,166 |
| 日本リーテック | 5 | 5 | 6,426 |
| 四電工 | 2 | 2 | 9,588 |
| 中電工 | 9 | 9 | 26,613 |
| 関電工 | 34 | 36 | 57,002 |
| きんでん | 44 | 40 | 107,158 |
| 東京エネシス | 6 | 6 | 7,167 |
| トーエネック | 2 | 1 | 10,222 |
| 住友電設 | 5 | 5 | 17,077 |
| 日本電設工業 | 10 | 10 | 22,781 |
| エクシオグループ | 28 | 28 | 88,721 |
| 新日本空調 | 3 | 3 | 10,833 |
| 九電工 | 15 | 12 | 70,043 |
| 三機工業 | 13 | 12 | 24,330 |
| 日揮ホールディングス | 61 | 57 | 80,413 |
| 中外炉工業 | 3 | 2 | 6,782 |
| ヤマト | 6 | 2 | 2,060 |
| 太平電業 | 3 | 3 | 15,444 |
| 高砂熱学工業 | 15 | 15 | 68,172 |
| 三晃金属工業 | 1 | - | - |
| 朝日工業社 | 2 | 2 | 8,235 |
| 明星工業 | 10 | 11 | 13,865 |
| 大気社 | 7 | 6 | 32,428 |
| ダイダン | 4 | 7 | 13,801 |
| 日比谷総合設備 | 5 | 4 | 10,764 |
| テスホールディングス | 6 | 13 | 6,160 |
| インフロニア・ホールディングス | 65 | 67 | 100,299 |
| 東洋エンジニアリング | - | 8 | 7,021 |
| レイズネクスト | 9 | 8 | 19,832 |
| 食料品(3.2%) | | | |
| ニッポン | 16 | 17 | 41,562 |
| 日清製粉グループ本社 | 58 | 54 | 114,696 |
| 日東富士製粉 | 1 | 1 | 6,360 |
| 昭和産業 | 5 | 5 | 19,494 |
| 中部飼料 | 8 | 8 | 10,214 |
| フィード・ワン | 9 | 8 | 8,857 |
| 日本甜菜製糖 | 3 | 3 | 7,214 |
| DM三井製糖ホールディングス | 6 | 5 | 18,821 |
| 塩水港精糖 | 23 | - | - |
| ウェルネオシュガー | 3 | 2 | 6,545 |
| 森永製菓 | 11 | 25 | 67,525 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 中村屋 | 1 | 2 | 6,270 |
| 江崎グリコ | 17 | 16 | 77,955 |
| 名糖産業 | 3 | 3 | 6,826 |
| 井村屋グループ | 3 | 3 | 8,620 |
| 不二家 | 4 | 4 | 10,040 |
| 山崎製パン | 42 | 39 | 149,401 |
| モロゾフ | 2 | 1 | 7,875 |
| 亀田製菓 | 4 | 3 | 14,520 |
| 寿スピリッツ | 6 | 27 | 53,889 |
| カルビー | 28 | 26 | 84,078 |
| 森永乳業 | 11 | 20 | 64,912 |
| 六甲バター | 4 | 4 | 6,495 |
| ヤクルト本社 | 44 | 83 | 263,877 |
| 明治ホールディングス | 38 | 71 | 244,728 |
| 雪印メグミルク | 15 | 14 | 31,851 |
| プリマハム | 8 | 7 | 17,924 |
| 日本ハム | 24 | 25 | 131,975 |
| 林兼産業 | 7 | 1 | 1,077 |
| 丸大食品 | 6 | 5 | 9,817 |
| S Foods | 6 | 6 | 20,448 |
| 柿安本店 | 2 | 2 | 6,577 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 48 | 8 | 37,380 |
| サッポロホールディングス | 20 | 19 | 129,196 |
| アサヒグループホールディングス | 144 | 134 | 718,342 |
| キリンホールディングス | 283 | 243 | 523,001 |
| 宝ホールディングス | 42 | 39 | 47,481 |
| オエノンホールディングス | 18 | 17 | 6,072 |
| 養命酒製造 | 2 | 3 | 6,351 |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 49 | 45 | 89,092 |
| サントリー食品インターナショナル | 44 | 41 | 198,184 |
| ガイドグループホールディングス | 3 | 6 | 20,097 |
| 伊藤園 | 23 | 19 | 83,674 |
| キーコーヒー | 7 | 6 | 13,338 |
| 日清オイリオグループ | 8 | 8 | 41,000 |
| 不二製油グループ本社 | 14 | 13 | 32,402 |
| J-オイルミルズ | 6 | 6 | 12,971 |
| キッコーマン | 41 | 38 | 358,400 |
| 味の素 | 153 | 138 | 802,795 |
| ブルドックソース | 2 | 3 | 6,603 |
| キューピー | 33 | 31 | 85,517 |
| ハウス食品グループ本社 | 19 | 20 | 63,114 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| カゴメ | 29 | 25 | 89,908 |
| アリアケジャパン | 5 | 5 | 31,436 |
| エバラ食品工業 | 1 | 2 | 6,410 |
| ニチレイ | 28 | 26 | 101,893 |
| 東洋水産 | 31 | 29 | 248,360 |
| イートアンドホールディングス | 2 | 3 | 6,411 |
| ヨムラ・フード・ホールディングス | 7 | 6 | 7,833 |
| 日清食品ホールディングス | 22 | 61 | 275,598 |
| 永谷園ホールディングス | 3 | 2 | 6,458 |
| 一正蒲鉾 | 6 | - | - |
| フジッコ | 6 | 6 | 11,658 |
| ロック・フィールド | 7 | 7 | 11,842 |
| 日本たばこ産業 | 412 | 354 | 1,385,103 |
| ケンコーマヨネーズ | 4 | 4 | 8,400 |
| わらべや日洋ホールディングス | 4 | 3 | 11,056 |
| なとり | 3 | 3 | 8,025 |
| ファーマフーズ | 9 | 8 | 8,316 |
| ユーグレナ | 40 | 36 | 22,905 |
| 紀文食品 | 5 | 5 | 6,211 |
| ピックルスホールディングス | 4 | 5 | 6,446 |
| ミヨシ油脂 | 3 | - | - |
| 理研ビタミン | 5 | 5 | 11,940 |
| 繊維製品(0.4%) | | | |
| 片倉工業 | 5 | 5 | 10,043 |
| グンゼ | 4 | 4 | 23,436 |
| 東洋紡 | 27 | 25 | 27,935 |
| 富士紡ホールディングス | 2 | 2 | 11,635 |
| 倉敷紡績 | 4 | 4 | 13,167 |
| 日本毛織 | 16 | 15 | 20,550 |
| 帝国繊維 | 7 | 6 | 14,384 |
| 帝人 | 61 | 57 | 71,517 |
| 東レ | 427 | 397 | 274,630 |
| 日本フェルト | 11 | 5 | 2,409 |
| イチカワ | 3 | 3 | 5,871 |
| アツギ | 10 | 10 | 6,099 |
| セーレン | 12 | 11 | 28,175 |
| ソトー | 5 | 5 | 3,950 |
| 東海染工 | 1 | 1 | 1,318 |
| 小松マテーレ | 9 | 8 | 6,776 |
| ワコールホールディングス | 12 | 12 | 44,383 |
| ホギメディカル | 8 | 7 | 27,768 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| T S Iホールディングス | 22 | 19 | 13,452 |
| マツオカコーポレーション | 4 | 3 | 4,937 |
| ワールド | 8 | 8 | 16,615 |
| オンワードホールディングス | 41 | 35 | 18,340 |
| ゴールドウイン | 11 | 10 | 93,628 |
| デサント | 11 | 10 | 32,908 |
| ヤマトインターナショナル | 17 | 14 | 4,300 |
| パルプ・紙(0.2%) | | | |
| 特種東海製紙 | 2 | 3 | 12,192 |
| 王子ホールディングス | 265 | 247 | 137,183 |
| 日本製紙 | 33 | 33 | 38,223 |
| 三菱製紙 | 8 | 4 | 2,425 |
| 北越コーポレーション | 40 | 29 | 38,164 |
| 大王製紙 | 28 | 26 | 28,440 |
| 阿波製紙 | 11 | 3 | 1,950 |
| レンゴー | 58 | 54 | 54,424 |
| トーモク | 3 | 3 | 7,871 |
| ザ・パック | 4 | 4 | 16,786 |
| 化学(5.8%) | | | |
| 北の達人コーポレーション | 26 | 26 | 6,015 |
| クラレ | 101 | 86 | 130,139 |
| 旭化成 | 398 | 401 | 422,693 |
| レゾナック・ホールディングス | 61 | 57 | 186,779 |
| 住友化学 | 473 | 440 | 137,498 |
| 住友精化 | 2 | 2 | 14,140 |
| 日産化学 | 30 | 27 | 175,267 |
| ラサ工業 | 2 | 2 | 6,320 |
| クレハ | 5 | 13 | 34,853 |
| 多木化学 | 2 | 2 | 8,349 |
| テイカ | 4 | 5 | 7,089 |
| 石原産業 | 11 | 9 | 14,827 |
| 片倉コープアグリ | 1 | - | - |
| 日本曹達 | 6 | 7 | 41,510 |
| 東ソー | 85 | 79 | 159,868 |
| トクヤマ | 20 | 19 | 45,100 |
| セントラル硝子 | 10 | 6 | 18,169 |
| 東亜合成 | 32 | 28 | 43,572 |
| 大阪ソーダ | 3 | 4 | 46,863 |
| 関東電化工業 | 12 | 11 | 10,683 |
| デンカ | 23 | 21 | 54,496 |
| 信越化学工業 | 107 | 538 | 3,298,851 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本カーバイド工業 | 3 | 4 | 7,749 |
| 堺化学工業 | 4 | 4 | 8,860 |
| 第一稀元素化学工業 | 5 | 6 | 5,999 |
| エア・ウォーター | 60 | 56 | 121,912 |
| 日本酸素ホールディングス | 61 | 57 | 237,542 |
| 日本化学工業 | 2 | 3 | 6,905 |
| 日本パーカラライジング | 31 | 26 | 33,549 |
| 高压ガス工業 | 9 | 8 | 7,585 |
| 四国化成ホールディングス | 7 | 7 | 13,550 |
| ステラ ケミファ | 3 | 3 | 12,176 |
| 保土谷化学工業 | 1 | 1 | 6,811 |
| 日本触媒 | 9 | 8 | 48,753 |
| 大日精化工業 | 4 | 4 | 11,291 |
| カネカ | 14 | 15 | 55,734 |
| 三菱瓦斯化学 | 47 | 44 | 116,287 |
| 三井化学 | 53 | 49 | 198,499 |
| J S R | 59 | 64 | 263,911 |
| 東京応化工業 | 11 | 28 | 117,812 |
| 大阪有機化学工業 | 4 | 5 | 14,925 |
| 三菱ケミカルグループ | 430 | 434 | 375,279 |
| K Hネオケム | 10 | 9 | 20,748 |
| ダイセル | 93 | 76 | 110,215 |
| 住友ベークライト | 9 | 8 | 67,437 |
| 積水化学工業 | 130 | 119 | 248,800 |
| 日本ゼオン | 38 | 40 | 52,340 |
| アイカ工業 | 16 | 15 | 53,250 |
| UBE | 32 | 28 | 72,815 |
| 積水樹脂 | 9 | 8 | 22,525 |
| タキロンシーアイ | 13 | 15 | 9,528 |
| 旭有機材 | 4 | 4 | 16,500 |
| ニチバン | 4 | 3 | 6,870 |
| リケンテクノス | 13 | 12 | 12,352 |
| 大倉工業 | 3 | 2 | 8,904 |
| 積水化成成品工業 | 12 | 12 | 5,833 |
| 群栄化学工業 | 2 | 1 | 6,868 |
| ダイキョーニシカワ | 14 | 13 | 9,615 |
| 森六ホールディングス | 3 | 3 | 8,559 |
| 恵和 | 4 | 4 | 5,377 |
| 日本化薬 | 48 | 45 | 58,883 |
| カーリットホールディングス | 6 | 6 | 6,534 |
| 日本精化 | 3 | 3 | 10,276 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 扶桑化学工業 | 5 | 6 | 29,011 |
| トリケミカル研究所 | 8 | 7 | 29,988 |
| A D E K A | 22 | 20 | 60,537 |
| 日油 | 19 | 17 | 124,655 |
| 新日本理化 | 5 | 5 | 1,197 |
| ハリマ化成グループ | 5 | 7 | 6,657 |
| 花王 | 155 | 134 | 757,586 |
| 第一工業製薬 | 2 | 3 | 10,106 |
| 石原ケミカル | 3 | 3 | 5,742 |
| 日華化学 | 5 | - | - |
| 三洋化成工業 | 3 | 3 | 15,410 |
| 有機合成薬品工業 | 15 | - | - |
| 大日本塗料 | 7 | 6 | 7,180 |
| 日本ペイントホールディングス | 282 | 315 | 353,924 |
| 関西ペイント | 58 | 58 | 134,936 |
| 中国塗料 | 11 | 12 | 25,498 |
| 藤倉化成 | 11 | 14 | 6,384 |
| 太陽ホールディングス | 9 | 10 | 32,393 |
| D I C | 24 | 23 | 68,440 |
| サカタインクス | 14 | 13 | 18,229 |
| a r t i e n c e | 12 | 12 | 38,700 |
| T & K T O K A | 5 | 5 | 8,031 |
| 富士フィルムホールディングス | 122 | 110 | 1,033,180 |
| 資生堂 | 133 | 124 | 515,181 |
| ライオン | 76 | 77 | 102,696 |
| 高砂香料工業 | 4 | 4 | 15,615 |
| マンダム | 13 | 12 | 16,960 |
| ミルボン | 9 | 8 | 27,685 |
| ファンケル | 27 | 26 | 55,770 |
| コーセー | 13 | 12 | 103,733 |
| コタ | 5 | 5 | 8,745 |
| シーボン | 2 | - | - |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 32 | 30 | 44,606 |
| ノエビアホールディングス | 5 | 5 | 27,719 |
| アジュバンホールディングス | 5 | - | - |
| 新日本製薬 | 3 | 3 | 6,256 |
| エステー | 4 | 4 | 7,185 |
| アグロ カネショウ | 2 | 4 | 5,814 |
| コニシ | 10 | 17 | 23,873 |
| 長谷川香料 | 13 | 11 | 36,309 |
| 星光PMC | 8 | - | - |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 小林製薬 | 18 | 17 | 105,547 |
| 荒川化学工業 | 5 | 5 | 6,478 |
| メック | 5 | 4 | 20,653 |
| 日本高純度化学 | 2 | 2 | 6,592 |
| タカラバイオ | 17 | 16 | 17,376 |
| J C U | 7 | 6 | 27,291 |
| 新田ゼラチン | 0.500 | 0.500 | 337 |
| O A T アグリオ | 2 | 3 | 5,440 |
| デクセリアルズ | 18 | 14 | 87,165 |
| アース製薬 | 5 | 5 | 22,815 |
| 北興化学工業 | 6 | 6 | 6,490 |
| 大成ラミック | 2 | 2 | 6,447 |
| クミアイ化学工業 | 25 | 23 | 19,564 |
| 日本農薬 | 11 | 10 | 7,706 |
| アキレス | 4 | 4 | 5,912 |
| 有沢製作所 | 10 | 10 | 12,053 |
| 日東電工 | 46 | 38 | 529,070 |
| レック | 9 | 7 | 8,291 |
| きもと | 5 | 4 | 832 |
| 藤森工業 | 5 | 4 | 18,306 |
| 前澤化成工業 | 4 | 4 | 6,352 |
| 未来工業 | 3 | 2 | 10,962 |
| J S P | 4 | 4 | 9,193 |
| エフピコ | 12 | 11 | 31,757 |
| 天馬 | 5 | 4 | 10,320 |
| 信越ポリマー | 11 | 12 | 20,416 |
| 東リ | 20 | - | - |
| ニフコ | 23 | 17 | 66,429 |
| バルカー | 5 | 5 | 22,525 |
| ユニ・チャーム | 133 | 123 | 640,810 |
| 医薬品(4.6%) | | | |
| 協和キリン | 77 | 71 | 207,825 |
| 武田薬品工業 | 565 | 526 | 2,353,166 |
| アステラス製薬 | 612 | 521 | 878,896 |
| 住友ファーマ | 47 | 44 | 16,221 |
| 塩野義製薬 | 81 | 75 | 535,800 |
| わかもと製薬 | 5 | 3 | 657 |
| 日本新薬 | 15 | 15 | 77,220 |
| 中外製薬 | 199 | 186 | 1,087,196 |
| 科研製薬 | 10 | 10 | 36,556 |
| エーザイ | 77 | 72 | 453,176 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|----------------------|---------|-----|-----------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| ロート製薬 | 61 | 57 | 169,516 | |
| 小野薬品工業 | 123 | 126 | 310,136 | |
| 久光製薬 | 14 | 13 | 53,196 | |
| 持田製薬 | 7 | 6 | 21,692 | |
| 参天製薬 | 120 | 108 | 165,255 | |
| 扶桑薬品工業 | 2 | 2 | 6,397 | |
| ツムラ | 20 | 18 | 51,649 | |
| キッセイ薬品工業 | 9 | 9 | 32,438 | |
| 生化学工業 | 12 | 10 | 7,655 | |
| 栄研化学 | 10 | 10 | 20,426 | |
| 鳥居薬品 | 3 | 3 | 12,928 | |
| JCRファーマ | 21 | 20 | 18,632 | |
| 東和薬品 | 9 | 9 | 27,300 | |
| 富士製薬工業 | 4 | 4 | 7,792 | |
| ゼリア新薬工業 | 8 | 8 | 17,859 | |
| そーせいグループ | - | 19 | 28,060 | |
| 第一三共 | 556 | 518 | 2,550,632 | |
| 杏林製薬 | 13 | 12 | 23,013 | |
| 大幸薬品 | 12 | - | - | |
| ダイト | 4 | 4 | 9,167 | |
| 大塚ホールディングス | 146 | 123 | 687,648 | |
| 大正製薬ホールディングス | 14 | 13 | 113,440 | |
| ペプチドリーム | 31 | 28 | 46,483 | |
| セルソース | - | 3 | 5,062 | |
| あすか製薬ホールディングス | 6 | 6 | 12,511 | |
| サワイグループホールディングス | 14 | 13 | 81,681 | |
| 石油・石炭製品(0.5%) | | | | |
| 日本コークス工業 | 57 | 60 | 7,066 | |
| ニチレキ | 7 | 7 | 18,751 | |
| ユシロ化学工業 | 6 | 3 | 7,272 | |
| 富士石油 | 18 | 17 | 5,863 | |
| MORESCO | 0.800 | - | - | |
| 出光興産 | 70 | 330 | 306,029 | |
| ENEOSホールディングス | 1,154 | 941 | 608,520 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 25 | 17 | 115,899 | |
| ゴム製品(0.7%) | | | | |
| 横浜ゴム | 36 | 30 | 120,460 | |
| TOYO TIRE | 36 | 34 | 98,872 | |
| ブリヂストン | 204 | 174 | 1,096,830 | |
| 住友ゴム工業 | 62 | 58 | 102,724 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-------|---------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 藤倉コンポジット | 2 | 4 | 6,573 | |
| オカモト | 3 | 2 | 13,594 | |
| フコク | 4 | 3 | 5,022 | |
| ニッタ | 6 | 6 | 22,290 | |
| 住友理工 | 12 | 9 | 10,083 | |
| 三ツ星ベルト | 9 | 7 | 35,424 | |
| バンドー化学 | 10 | 8 | 15,180 | |
| ガラス・土石製品(0.7%) | | | | |
| 日東紡績 | 7 | 7 | 40,500 | |
| AGC | 65 | 53 | 287,472 | |
| 日本板硝子 | 32 | 28 | 15,307 | |
| 日本電気硝子 | 26 | 24 | 86,799 | |
| オハラ | 4 | 5 | 6,355 | |
| 住友大阪セメント | 9 | 9 | 35,630 | |
| 太平洋セメント | 40 | 35 | 112,464 | |
| 日本ヒューム | 7 | 7 | 6,262 | |
| 日本コンクリート工業 | 21 | 13 | 6,310 | |
| 三谷セキサン | 2 | 2 | 14,600 | |
| アジアパイルホールディングス | 10 | 8 | 6,636 | |
| 東海カーボン | 53 | 54 | 56,052 | |
| 日本カーボン | 3 | 3 | 16,802 | |
| 東洋炭素 | 4 | 4 | 30,114 | |
| ノリタケカンパニーリミテド | 3 | 3 | 26,499 | |
| TOTO | 42 | 39 | 146,137 | |
| 日本碍子 | 75 | 69 | 131,860 | |
| 日本特殊陶業 | 48 | 49 | 214,936 | |
| MARUWA | 2 | 2 | 67,980 | |
| 品川リフラクトリーズ | 1 | 7 | 14,935 | |
| 黒崎播磨 | 1 | 1 | 16,584 | |
| ヨータイ | 4 | 4 | 6,384 | |
| ニッカトー | 5 | 1 | 1,105 | |
| フジインコーポレーテッド | 5 | 16 | 53,120 | |
| クニミネ工業 | 0.900 | 0.900 | 910 | |
| ニチアス | 16 | 15 | 56,625 | |
| ニチハ | 8 | 7 | 25,567 | |
| 鉄鋼(1.0%) | | | | |
| 日本製鉄 | 294 | 273 | 988,779 | |
| 神戸製鋼所 | 132 | 123 | 251,965 | |
| 中山製鋼所 | 13 | 14 | 12,964 | |
| 合同製鐵 | 3 | 3 | 20,128 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|---------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| J F Eホールディングス | 175 | 170 | 399,905 | |
| 東京製鐵 | 18 | 17 | 29,068 | |
| 共英製鋼 | 7 | 7 | 16,037 | |
| 大和工業 | 10 | 11 | 97,520 | |
| 東京鐵鋼 | 3 | 2 | 14,202 | |
| 大阪製鐵 | 4 | 2 | 6,636 | |
| 淀川製鋼所 | 7 | 7 | 29,925 | |
| 中部鋼鉄 | - | 4 | 10,036 | |
| 丸一鋼管 | 20 | 18 | 75,255 | |
| 大同特殊鋼 | 8 | 38 | 68,838 | |
| 日本高周波鋼業 | 15 | - | - | |
| 日本冶金工業 | 4 | 4 | 20,835 | |
| 山陽特殊製鋼 | 6 | 6 | 13,560 | |
| 愛知製鋼 | 3 | 3 | 12,355 | |
| 大太平洋金属 | 4 | 5 | 7,316 | |
| 新日本電工 | 42 | 30 | 9,211 | |
| 栗本鐵工所 | 3 | 2 | 9,352 | |
| 三菱製鋼 | 4 | 4 | 6,498 | |
| 日亜鋼業 | 18 | 10 | 3,515 | |
| 日本精線 | 1 | 1 | 6,960 | |
| エンビプロ・ホールディングス | 0.300 | 10 | 5,019 | |
| シンニッタン | 14 | 14 | 3,946 | |
| 非鉄金属(0.7%) | | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 9 | 7 | 9,509 | |
| 日本軽金属ホールディングス | 17 | 17 | 30,758 | |
| 三井金属鉱業 | 19 | 17 | 78,729 | |
| 東邦亜鉛 | 3 | 5 | 5,929 | |
| 三菱マテリアル | 43 | 43 | 114,450 | |
| 住友金属鉱山 | 76 | 70 | 294,447 | |
| DOWAホールディングス | 14 | 15 | 84,469 | |
| 古河機械金属 | 9 | 8 | 14,199 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 9 | 10 | 28,662 | |
| 東邦チタニウム | 11 | 12 | 22,037 | |
| U A C J | 9 | 8 | 35,862 | |
| C Kサンエツ | 1 | 1 | 6,621 | |
| 古河電気工業 | 21 | 20 | 57,568 | |
| 住友電気工業 | 226 | 228 | 491,576 | |
| フジクラ | 70 | 72 | 125,989 | |
| S W C C | 7 | 6 | 22,576 | |
| タツタ電線 | 13 | 10 | 7,575 | |
| 平河ヒューテック | 4 | 4 | 6,062 | |
| リヨービ | 7 | 6 | 16,646 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-------|---------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| アーレスティ | 7 | - | - | |
| A R Eホールディングス | 26 | 23 | 45,126 | |
| 金属製品(0.5%) | | | | |
| 稲葉製作所 | 3 | 4 | 6,346 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 1 | 3 | 12,338 | |
| トーカロ | 18 | 17 | 29,339 | |
| アルファ | 4 | - | - | |
| S U M C O | 125 | 108 | 244,194 | |
| 川田テクノロジーズ | 1 | 1 | 12,572 | |
| R S Technologies | 4 | 4 | 10,869 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 43 | 35 | 86,626 | |
| ホッカンホールディングス | 3 | 1 | 2,390 | |
| コロナ | 5 | 6 | 6,428 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 8 | 9 | 26,294 | |
| 三和ホールディングス | 60 | 61 | 159,100 | |
| 文化シャッター | 18 | 16 | 25,360 | |
| 三協立山 | 9 | 7 | 6,860 | |
| アルインコ | 5 | 6 | 6,300 | |
| L I X I L | 95 | 95 | 187,036 | |
| 日本ファイルコン | 9 | 0.100 | 54 | |
| ノーリツ | 9 | 10 | 16,665 | |
| 長府製作所 | 6 | 6 | 12,785 | |
| リンナイ | 11 | 29 | 103,546 | |
| ダイニチ工業 | 7 | - | - | |
| 日東精工 | 9 | 11 | 6,786 | |
| 三洋工業 | 2 | - | - | |
| 岡部 | 10 | 10 | 8,785 | |
| ジーテクト | 7 | 7 | 15,678 | |
| 東プレ | 11 | 10 | 25,164 | |
| 高周波熱錬 | 10 | 9 | 10,105 | |
| 東京製鋼 | 5 | 4 | 7,256 | |
| サンコール | 2 | 13 | 6,264 | |
| モリテックスチール | 7 | 0.100 | 26 | |
| パイオラックス | 9 | 7 | 20,580 | |
| エイチワン | 7 | 7 | 5,297 | |
| 日本発条 | 58 | 54 | 78,363 | |
| 中央発条 | 4 | 8 | 6,450 | |
| 三益半導体工業 | 5 | 5 | 17,160 | |
| 機械(5.4%) | | | | |
| 日本製鋼所 | 17 | 16 | 41,844 | |
| 三浦工業 | 26 | 25 | 73,475 | |
| タクマ | 19 | 20 | 38,117 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ツガミ | 14 | 13 | 15,348 |
| オークマ | 6 | 5 | 37,398 |
| 芝浦機械 | 6 | 6 | 20,730 |
| アマダ | 102 | 95 | 155,712 |
| アイダエンジニアリング | 13 | 13 | 11,648 |
| TAKISAWA | 4 | - | - |
| FUJI | 28 | 28 | 74,039 |
| 牧野フライス製作所 | 7 | 6 | 38,874 |
| オーエスジー | 30 | 26 | 56,403 |
| ダイジェット工業 | 5 | - | - |
| 旭ダイヤモンド工業 | 18 | 13 | 12,019 |
| DMG森精機 | 39 | 36 | 121,641 |
| ソディック | 17 | 14 | 10,599 |
| ディスコ | 10 | 28 | 1,270,080 |
| 日東工器 | 3 | 3 | 6,385 |
| 日進工具 | 5 | 6 | 6,130 |
| パンチ工業 | 10 | 0.200 | 85 |
| リケンNPR | - | 6 | 18,609 |
| 東洋機械金属 | 7 | - | - |
| エンシュウ | 5 | - | - |
| 島精機製作所 | 10 | 9 | 13,328 |
| オプトラン | 9 | 9 | 18,081 |
| NCホールディングス | 2 | - | - |
| イワキ | 4 | 4 | 9,528 |
| フリュー | 6 | 5 | 6,944 |
| ヤマシンフィルタ | 15 | 18 | 6,730 |
| 日阪製作所 | 6 | 6 | 6,396 |
| やまびこ | 10 | 9 | 17,669 |
| 野村マイクロ・サイエンス | 2 | 2 | 29,020 |
| 平田機工 | 3 | 2 | 22,040 |
| PEGASUS | 7 | 14 | 6,471 |
| マルマエ | 3 | 3 | 6,354 |
| タツモ | 3 | 3 | 13,626 |
| ナブテスコ | 40 | 37 | 93,097 |
| 三井海洋開発 | 8 | 7 | 22,298 |
| レオン自動機 | 6 | 6 | 9,853 |
| SMC | 20 | 17 | 1,554,794 |
| ホソカワミクロン | 4 | 3 | 16,112 |
| ユニオンツール | 2 | 2 | 10,309 |
| 瑞光 | - | 4 | 7,576 |
| オイレス工業 | 9 | 8 | 16,621 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日精工エー・エス・ビー機械 | 3 | 2 | 10,572 |
| サトーホールディングス | 9 | 8 | 19,227 |
| 技研製作所 | 6 | 5 | 11,597 |
| 日本エアテック | 4 | 5 | 5,890 |
| カワタ | 4 | - | - |
| 日精樹脂工業 | 5 | 5 | 6,384 |
| ワイエイシイホールディングス | - | 2 | 6,047 |
| 小松製作所 | 301 | 280 | 1,212,904 |
| 住友重機械工業 | 38 | 35 | 161,176 |
| 日立建機 | 25 | 23 | 100,650 |
| 日工 | 9 | 8 | 6,861 |
| 巴工業 | 2 | 2 | 8,728 |
| 井関農機 | 6 | 5 | 5,650 |
| TOWA | 6 | 6 | 52,059 |
| 北川鉄工所 | 4 | 4 | 6,420 |
| ローツェ | 3 | 3 | 62,806 |
| タカキタ | 9 | - | - |
| クボタ | 340 | 313 | 695,173 |
| 荏原実業 | 3 | 3 | 9,984 |
| 三菱化工機 | 2 | 2 | 7,885 |
| 月島ホールディングス | 8 | 8 | 10,692 |
| 帝国電機製作所 | 4 | 4 | 11,537 |
| 新東工業 | 13 | 12 | 14,157 |
| 澁谷工業 | 6 | 5 | 17,416 |
| アイチコーポレーション | 9 | 8 | 9,121 |
| 小森コーポレーション | 14 | 14 | 19,021 |
| 鶴見製作所 | 4 | 4 | 15,479 |
| 酒井重工業 | - | 0.900 | 5,796 |
| 荏原製作所 | 26 | 24 | 277,242 |
| 石井鐵工所 | 1 | - | - |
| 西島製作所 | 5 | 5 | 13,140 |
| 北越工業 | 6 | 6 | 14,730 |
| ダイキン工業 | 76 | 71 | 1,533,675 |
| オルガノ | 8 | 7 | 49,680 |
| トーヨーカネツ | 2 | 2 | 8,950 |
| 栗田工業 | 36 | 33 | 197,047 |
| 椿本チエイン | 9 | 8 | 39,992 |
| 大同工業 | 3 | - | - |
| 木村化工機 | 6 | 8 | 6,194 |
| アネスト岩田 | 10 | 9 | 12,396 |
| ダイフク | 33 | 101 | 341,414 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| サムコ | 2 | 1 | 7,992 |
| 加藤製作所 | 6 | - | - |
| タダノ | 33 | 34 | 45,816 |
| フジテック | 23 | 14 | 51,702 |
| CKD | 17 | 16 | 46,297 |
| 平和 | 21 | 17 | 37,028 |
| 理想科学工業 | 5 | 4 | 15,504 |
| SANKYO | 12 | 13 | 122,875 |
| 日本金銭機械 | 7 | 7 | 10,245 |
| マースグループホールディングス | 3 | 3 | 8,595 |
| フクシマガリレイ | 4 | 3 | 22,581 |
| ダイコク電機 | 3 | 2 | 12,325 |
| 竹内製作所 | 11 | 10 | 56,026 |
| アマノ | 18 | 17 | 63,563 |
| JUKI | 10 | 14 | 7,128 |
| ジャノメ | 8 | 9 | 6,251 |
| マックス | 7 | 8 | 26,334 |
| グローリー | 16 | 14 | 42,055 |
| 新晃工業 | 6 | 6 | 18,870 |
| 大和冷機工業 | 9 | 9 | 13,671 |
| セガサミーホールディングス | 51 | 53 | 96,353 |
| リケン | 2 | - | - |
| TPR | 7 | 7 | 16,058 |
| ツバキ・ナカシマ | 15 | 12 | 9,360 |
| ホシザキ | 41 | 35 | 187,548 |
| 大豊工業 | 7 | 7 | 6,240 |
| 日本精工 | 118 | 110 | 89,451 |
| NTN | 126 | 129 | 38,294 |
| ジェイテクト | 57 | 53 | 73,074 |
| 不二越 | 4 | 4 | 14,894 |
| 日本トムソン | 15 | 16 | 10,024 |
| THK | 37 | 34 | 110,193 |
| ユーシン精機 | 7 | 9 | 6,420 |
| 前澤給装工業 | 5 | 4 | 6,325 |
| イーグル工業 | 7 | 6 | 11,741 |
| 日本ピラー工業 | 6 | 5 | 30,576 |
| キッツ | 23 | 20 | 26,420 |
| マキタ | 80 | 68 | 264,867 |
| 三井E&S | 29 | 29 | 34,303 |
| 日立造船 | 52 | 52 | 57,129 |
| 三菱重工業 | 112 | 104 | 1,201,956 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| IHI | 40 | 44 | 140,311 |
| スター精密 | 12 | 11 | 18,715 |
| 電気機器(17.5%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | 52 | 45 | 56,182 |
| イビデン | 36 | 31 | 229,320 |
| コニカミノルタ | 143 | 133 | 62,945 |
| ブラザー工業 | 85 | 80 | 198,320 |
| ミネベアミツミ | 111 | 104 | 316,142 |
| 日立製作所 | 322 | 287 | 3,529,867 |
| 東芝 | 123 | - | - |
| 三菱電機 | 664 | 666 | 1,540,948 |
| 富士電機 | 39 | 36 | 323,778 |
| 東洋電機製造 | 5 | - | - |
| 安川電機 | 76 | 65 | 365,040 |
| シンフォニア テクノロジー | 7 | 6 | 16,929 |
| 明電舎 | 9 | 11 | 29,659 |
| オリジン | 1 | 1 | 1,948 |
| 山洋電気 | 2 | 2 | 15,938 |
| デンヨー | 4 | 4 | 10,662 |
| PHCホールディングス | 8 | 11 | 14,515 |
| KOKUSAI ELECTRIC | - | 23 | 107,415 |
| ソシオネクスト | 6 | 43 | 165,778 |
| 東芝テック | 9 | 7 | 23,677 |
| 芝浦メカトロニクス | 1 | 3 | 22,440 |
| マブチモーター | 16 | 29 | 80,423 |
| ニデック | 156 | 132 | 765,702 |
| トレックス・セミコンダクター | 3 | 3 | 6,566 |
| 東光高岳 | 3 | 3 | 8,604 |
| ダブル・スコープ | 21 | 17 | 13,235 |
| ダイヘン | 5 | 6 | 42,900 |
| ヤーマン | 12 | 11 | 11,727 |
| JVCケンウッド | 58 | 47 | 33,441 |
| IPEX | 4 | 4 | 7,728 |
| 日新電機 | 15 | - | - |
| 大崎電気工業 | 15 | 13 | 8,868 |
| オムロン | 58 | 45 | 261,449 |
| 日東工業 | 8 | 8 | 34,546 |
| IDEC | 9 | 8 | 25,247 |
| 不二電機工業 | 4 | 0.300 | 343 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 21 | 23 | 63,472 |
| サクサホールディングス | 3 | - | - |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| メルコホールディングス | 1 | 1 | 6,108 |
| テクノメディア | 2 | 3 | 5,676 |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディングス | - | 9 | 6,224 |
| 日本電気 | 91 | 78 | 766,664 |
| 富士通 | 64 | 55 | 1,272,534 |
| 沖電気工業 | 29 | 27 | 29,566 |
| 岩崎通信機 | 6 | - | - |
| 電気興業 | 2 | 2 | 5,691 |
| サンケン電気 | 6 | 5 | 43,568 |
| アイホン | 3 | 3 | 9,036 |
| ルネサスエレクトロニクス | 419 | 390 | 958,437 |
| セイコーエプソン | 85 | 76 | 187,238 |
| ワコム | 50 | 45 | 29,848 |
| アルバック | 15 | 13 | 114,048 |
| EIZO | 4 | 4 | 22,264 |
| ジャパンディスプレイ | 247 | - | - |
| 日本信号 | 14 | 13 | 13,232 |
| 京三製作所 | 13 | 13 | 6,302 |
| 能美防災 | 8 | 8 | 18,103 |
| ホーチキ | 4 | 4 | 10,120 |
| 星和電機 | 10 | - | - |
| エレコム | 15 | 14 | 23,208 |
| パナソニック ホールディングス | 759 | 707 | 1,007,691 |
| シャープ | 77 | 100 | 83,262 |
| アンリツ | 45 | 42 | 49,289 |
| 富士通ゼネラル | 18 | 17 | 33,906 |
| ソニーグループ | 450 | 419 | 5,584,311 |
| TDK | 101 | 94 | 739,060 |
| 帝国通信工業 | 3 | 3 | 5,886 |
| タムラ製作所 | 27 | 23 | 13,551 |
| アルプスアルパイン | 57 | 53 | 56,255 |
| 池上通信機 | 8 | - | - |
| 日本電波工業 | 7 | 7 | 9,820 |
| 鈴木 | - | 5 | 6,269 |
| メイコー | 7 | 5 | 26,904 |
| ローランド ディー. ジー. | 3 | 3 | 16,566 |
| フォスター電機 | 6 | 5 | 6,310 |
| SMK | 2 | 2 | 6,092 |
| ヨコオ | 5 | 5 | 8,379 |
| ホシデン | 15 | 13 | 27,009 |
| ヒロセ電機 | 10 | 8 | 141,592 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本航空電子工業 | 13 | 14 | 38,338 |
| TOA | 7 | 6 | 7,677 |
| マクセル | 14 | 13 | 20,922 |
| 古野電気 | 8 | 7 | 16,793 |
| スミダコーポレーション | 5 | 8 | 9,624 |
| アイコム | 2 | 2 | 8,004 |
| リオン | 2 | 2 | 7,020 |
| 横河電機 | 70 | 65 | 198,923 |
| 新元元工業 | 2 | 2 | 7,095 |
| アズビル | 44 | 40 | 186,619 |
| 東亜ディーケーケー | 5 | - | - |
| 日本光電工業 | 29 | 25 | 105,384 |
| チノー | - | 2 | 6,282 |
| 共和電業 | 11 | 4 | 1,785 |
| 日本電子材料 | 4 | 3 | 7,156 |
| 堀場製作所 | 14 | 11 | 157,578 |
| アドバンテスト | 50 | 169 | 1,142,917 |
| 小野測器 | 11 | - | - |
| エスベック | 5 | 4 | 12,779 |
| キーエンス | 63 | 59 | 4,094,072 |
| 日置電機 | 3 | 2 | 19,320 |
| シスメックス | 54 | 51 | 409,036 |
| 日本マイクロニクス | 10 | 10 | 63,494 |
| メガチップス | 5 | 4 | 19,951 |
| OBARA GROUP | 3 | 3 | 11,904 |
| 澤藤電機 | 3 | 3 | 4,286 |
| 原田工業 | 5 | 4 | 3,420 |
| コーセル | 8 | 6 | 9,607 |
| イリソ電子工業 | 5 | 5 | 17,270 |
| オプテックスグループ | 11 | 10 | 20,023 |
| 千代田インテグレ | 2 | 2 | 6,088 |
| レーザーテック | 31 | 27 | 1,081,744 |
| スタンレー電気 | 45 | 38 | 97,755 |
| 岩崎電気 | 2 | - | - |
| ウシオ電機 | 33 | 30 | 60,967 |
| 岡谷電機産業 | 0.100 | 0.100 | 27 |
| 日本セラミック | 6 | 4 | 12,451 |
| 遠藤照明 | 6 | - | - |
| 古河電池 | 4 | 7 | 6,741 |
| 山一電機 | 5 | 5 | 11,665 |
| 図研 | 5 | 5 | 22,828 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本電子 | 16 | 14 | 96,164 |
| カシオ計算機 | 47 | 42 | 51,039 |
| ファナック | 62 | 289 | 1,219,423 |
| 日本シイエムケイ | 13 | 12 | 7,648 |
| エンプラス | 1 | 1 | 14,841 |
| 大真空 | 7 | 8 | 7,761 |
| ローム | 29 | 109 | 289,946 |
| 浜松ホトニクス | 51 | 47 | 257,040 |
| 三井ハイテック | 6 | 5 | 41,813 |
| 新光電気工業 | 22 | 21 | 115,500 |
| 京セラ | 98 | 368 | 816,190 |
| 太陽誘電 | 31 | 28 | 97,942 |
| 村田製作所 | 193 | 539 | 1,595,275 |
| 双葉電子工業 | 12 | 12 | 6,435 |
| 北陸電気工業 | 3 | 2 | 3,908 |
| ニチコン | 13 | 15 | 19,141 |
| 日本ケミコン | 6 | 6 | 8,511 |
| KOA | 9 | 9 | 13,599 |
| 市光工業 | - | 10 | 5,798 |
| 小糸製作所 | 76 | 61 | 121,050 |
| ミツバ | 11 | 11 | 14,807 |
| SCREENホールディングス | 10 | 20 | 374,535 |
| キャノン電子 | 7 | 6 | 14,823 |
| キャノン | 349 | 295 | 1,243,714 |
| リコー | 159 | 148 | 189,167 |
| 象印マホービン | 19 | 16 | 23,151 |
| MUTOHホールディングス | 2 | 1 | 4,132 |
| 東京エレクトロン | 44 | 125 | 4,348,575 |
| イノテック | 4 | 3 | 7,452 |
| 輸送用機器(9.1%) | | | |
| トヨタ紡織 | 26 | 25 | 60,700 |
| 芦森工業 | 4 | 1 | 4,973 |
| ユニプレス | 11 | 10 | 11,278 |
| 豊田自動織機 | 46 | 50 | 739,519 |
| モリタホールディングス | 11 | 10 | 16,972 |
| 三櫻工業 | 9 | 9 | 9,564 |
| デンソー | 131 | 489 | 1,322,770 |
| 東海理化電機製作所 | 18 | 16 | 39,245 |
| 川崎重工業 | 48 | 48 | 188,179 |
| 名村造船所 | 16 | 14 | 26,684 |
| 日本車輛製造 | 2 | 2 | 6,696 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-------|------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三菱ロジスネクスト | 10 | 9 | 13,927 |
| 日産自動車 | 904 | 800 | 453,016 |
| いすゞ自動車 | 185 | 172 | 371,263 |
| トヨタ自動車 | 3,497 | 3,255 | 11,113,935 |
| 日野自動車 | 82 | 89 | 42,200 |
| 三菱自動車工業 | 248 | 231 | 104,478 |
| エフテック | 1 | 1 | 987 |
| 武蔵精密工業 | 15 | 14 | 23,519 |
| 日産車体 | 11 | 6 | 6,220 |
| 新明和工業 | 20 | 17 | 20,366 |
| 極東開発工業 | 11 | 9 | 23,235 |
| トピー工業 | 5 | 4 | 14,054 |
| ティラド | 1 | 1 | 6,545 |
| 曙ブレーキ工業 | 38 | - | - |
| タチエス | 10 | 10 | 21,952 |
| NOK | 24 | 23 | 48,024 |
| フタバ産業 | 17 | 15 | 16,424 |
| カヤバ | 6 | 5 | 28,015 |
| 大同メタル工業 | 12 | 11 | 6,414 |
| プレス工業 | 28 | 23 | 15,499 |
| ミクニ | 13 | 3 | 1,666 |
| 太平洋工業 | 14 | 13 | 19,801 |
| アイシン | 49 | 45 | 249,384 |
| マツダ | 210 | 196 | 339,645 |
| 今仙電機製作所 | 2 | 2 | 1,672 |
| 本田技研工業 | 517 | 1,445 | 2,527,258 |
| スズキ | 117 | 108 | 716,453 |
| SUBARU | 201 | 183 | 617,720 |
| ヤマハ発動機 | 100 | 256 | 354,196 |
| エクセディ | 10 | 9 | 27,965 |
| 豊田合成 | 18 | 17 | 50,260 |
| 愛三工業 | 10 | 9 | 14,278 |
| 盟和産業 | 4 | 1 | 1,333 |
| ヨロズ | 7 | 6 | 6,358 |
| エフ・シー・シー | 11 | 10 | 22,218 |
| シマノ | 26 | 23 | 483,855 |
| テイ・エス テック | 29 | 21 | 41,387 |
| ジャムコ | 3 | 4 | 5,472 |
| 精密機器(2.3%) | | | |
| テルモ | 199 | 165 | 929,806 |
| 日機装 | 15 | 13 | 16,325 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本エム・ディ・エム | 5 | 8 | 5,826 |
| 島津製作所 | 77 | 78 | 302,986 |
| JMS | 9 | 12 | 6,168 |
| 長野計器 | 4 | 4 | 9,520 |
| ブイ・テクノロジー | 3 | 3 | 8,258 |
| 東京計器 | 4 | 4 | 10,237 |
| 愛知時計電機 | 3 | 2 | 6,669 |
| インターアクション | 3 | 4 | 4,867 |
| オーバル | 6 | - | - |
| 東京精密 | 14 | 12 | 116,535 |
| マニー | 28 | 23 | 49,059 |
| ニコン | 99 | 85 | 131,121 |
| トプコン | 33 | 28 | 51,019 |
| オリンパス | 398 | 364 | 791,833 |
| 理研計器 | 4 | 4 | 32,886 |
| タムロン | 4 | 3 | 22,644 |
| HOYA | 136 | 116 | 2,158,366 |
| シード | 2 | - | - |
| ノーリツ鋼機 | 6 | 5 | 17,024 |
| A&Dホロンホールディングス | 9 | 8 | 18,103 |
| 朝日インテック | 84 | 72 | 207,356 |
| シチズン時計 | 70 | 54 | 58,206 |
| リズム | 1 | - | - |
| メニコン | 21 | 20 | 35,628 |
| 松風 | 2 | 2 | 7,238 |
| セイコーグループ | 9 | 8 | 25,564 |
| ニプロ | 53 | 49 | 62,985 |
| その他製品(2.3%) | | | |
| KYORITSU | 25 | - | - |
| スノーピーク | 10 | 8 | 9,673 |
| パラマウントベッドホールディングス | 14 | 12 | 30,553 |
| トランザクション | 4 | 3 | 9,941 |
| 粧美堂 | 2 | - | - |
| ニホンフラッシュ | 6 | 6 | 6,500 |
| 前田工織 | 6 | 5 | 16,800 |
| 永大産業 | 18 | - | - |
| アートネイチャー | 6 | 7 | 6,233 |
| フルヤ金属 | - | 1 | 13,776 |
| パンダイナムコホールディングス | 58 | 162 | 474,045 |
| アイフィスジャパン | 7 | - | - |
| SHOEI | 6 | 13 | 28,113 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フランスベッドホールディングス | 7 | 7 | 10,048 |
| パイロットコーポレーション | 10 | 8 | 32,287 |
| 萩原工業 | 4 | - | - |
| フジシールインターナショナル | 12 | 12 | 24,300 |
| タカラトミー | 29 | 27 | 62,842 |
| 広済堂ホールディングス | 4 | 15 | 10,235 |
| プロネクサス | 5 | 6 | 7,448 |
| 大建工業 | 3 | - | - |
| TOPPANホールディングス | 83 | 72 | 256,024 |
| 大日本印刷 | 75 | 64 | 291,405 |
| 共同印刷 | 1 | 1 | 5,994 |
| NISSHA | 12 | 10 | 15,220 |
| TAKARA & COMPANY | 4 | 3 | 9,842 |
| アシックス | 58 | 50 | 295,374 |
| ツツミ | 2 | 3 | 6,288 |
| ローランド | 4 | 4 | 21,582 |
| 小松ウオール工業 | 2 | 2 | 8,016 |
| ヤマハ | 40 | 37 | 120,428 |
| 河合楽器製作所 | 1 | 1 | 6,102 |
| クリナップ | - | 7 | 5,306 |
| ピジョン | 40 | 37 | 60,309 |
| 兼松サステック | 0,400 | - | - |
| キングジム | 5 | 7 | 6,424 |
| リンテック | 12 | 11 | 35,938 |
| イトーキ | 13 | 12 | 24,151 |
| 任天堂 | 402 | 374 | 3,092,840 |
| 三菱鉛筆 | 9 | 8 | 20,487 |
| タカラスタンダード | 12 | 12 | 23,087 |
| コクヨ | 30 | 24 | 60,130 |
| ナカバヤシ | 9 | 11 | 6,236 |
| グローブライド | 5 | 5 | 10,743 |
| オカムラ | 19 | 17 | 38,928 |
| 美津濃 | 6 | 5 | 30,975 |
| 電気・ガス業(1.3%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 574 | 534 | 424,848 |
| 中部電力 | 234 | 218 | 418,646 |
| 関西電力 | 245 | 228 | 446,126 |
| 中国電力 | 101 | 103 | 101,928 |
| 北陸電力 | 60 | 60 | 43,662 |
| 東北電力 | 155 | 156 | 154,367 |
| 四国電力 | 54 | 55 | 57,463 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 九州電力 | 146 | 136 | 154,197 |
| 北海道電力 | 61 | 57 | 36,408 |
| 沖縄電力 | 14 | 15 | 16,519 |
| 電源開発 | 48 | 48 | 120,240 |
| エフオン | 4 | 14 | 5,795 |
| イーレックス | 11 | 10 | 7,875 |
| レノバ | 16 | 15 | 19,544 |
| 東京瓦斯 | 134 | 125 | 407,099 |
| 大阪瓦斯 | 129 | 120 | 370,988 |
| 東邦瓦斯 | 25 | 25 | 76,483 |
| 北海道瓦斯 | 3 | 3 | 7,959 |
| 広島ガス | 14 | 1 | 693 |
| 西部ガスホールディングス | 6 | 6 | 11,687 |
| 静岡ガス | 14 | 11 | 10,714 |
| メタウォーター | 8 | 7 | 15,698 |
| 陸運業(2.6%) | | | |
| SBSホールディングス | 5 | 5 | 12,757 |
| 東武鉄道 | 70 | 65 | 251,937 |
| 相鉄ホールディングス | 21 | 21 | 57,727 |
| 東急 | 178 | 166 | 294,849 |
| 京浜急行電鉄 | 72 | 73 | 95,713 |
| 小田急電鉄 | 96 | 98 | 206,486 |
| 京王電鉄 | 33 | 28 | 119,928 |
| 京成電鉄 | 41 | 38 | 284,666 |
| 富士急行 | 7 | 7 | 28,324 |
| 東日本旅客鉄道 | 108 | 108 | 974,546 |
| 西日本旅客鉄道 | 81 | 70 | 436,914 |
| 東海旅客鉄道 | 49 | 228 | 857,413 |
| 西武ホールディングス | 77 | 71 | 154,979 |
| 鴻池運輸 | 10 | 10 | 18,200 |
| 西日本鉄道 | 17 | 15 | 37,983 |
| ハマキョウレックス | 5 | 5 | 19,864 |
| サカイ引越センター | 3 | 6 | 17,047 |
| 近鉄グループホールディングス | 63 | 59 | 266,400 |
| 阪急阪神ホールディングス | 84 | 78 | 339,743 |
| 南海電気鉄道 | 30 | 26 | 77,035 |
| 京阪ホールディングス | 26 | 32 | 113,252 |
| 神戸電鉄 | 1 | 2 | 6,272 |
| 名古屋鉄道 | 70 | 61 | 130,295 |
| 山陽電気鉄道 | 4 | 4 | 9,558 |
| アルプス物流 | 5 | 4 | 8,930 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ヤマトホールディングス | 81 | 75 | 182,185 |
| 山九 | 16 | 15 | 80,830 |
| 丸全昭和運輸 | 3 | 3 | 16,391 |
| センコーグループホールディングス | 33 | 31 | 33,741 |
| トナミホールディングス | 1 | 1 | 4,420 |
| ニッコンホールディングス | 20 | 18 | 59,988 |
| 日本石油輸送 | 1 | - | - |
| 福山通運 | 4 | 6 | 28,662 |
| セイノーホールディングス | 39 | 33 | 74,358 |
| 神奈川中央交通 | 1 | 2 | 6,373 |
| AZ-COM和ホールディングス | 15 | 15 | 21,593 |
| C&Fロジホールディングス | 6 | 5 | 10,282 |
| 九州旅客鉄道 | 45 | 41 | 140,155 |
| S Gホールディングス | 122 | 99 | 191,345 |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 23 | 20 | 162,026 |
| 海運業(0.9%) | | | |
| 日本郵船 | 170 | 169 | 818,632 |
| 商船三井 | 112 | 128 | 684,134 |
| 川崎汽船 | 54 | 47 | 339,435 |
| N Sユナイテッド海運 | 3 | 3 | 16,832 |
| 明海グループ | 6 | 2 | 1,970 |
| 飯野海運 | 23 | 21 | 29,251 |
| 共栄タンカー | 0.600 | 0.600 | 678 |
| 乾汽船 | 8 | 6 | 7,258 |
| 空運業(0.4%) | | | |
| 日本航空 | 156 | 145 | 405,666 |
| ANAホールディングス | 173 | 161 | 520,191 |
| パスコ | 1 | 0.400 | 744 |
| 倉庫・運輸関連業(0.1%) | | | |
| トランコム | 1 | 1 | 10,778 |
| 日新 | 4 | 4 | 12,847 |
| 三菱倉庫 | 13 | 14 | 66,758 |
| 三井倉庫ホールディングス | 5 | 5 | 25,547 |
| 住友倉庫 | 17 | 16 | 41,760 |
| 澁澤倉庫 | 2 | 2 | 8,275 |
| 東陽倉庫 | 15 | - | - |
| 日本トランスシティ | 12 | 11 | 7,413 |
| 中央倉庫 | 5 | 2 | 2,633 |
| 安田倉庫 | 5 | 5 | 6,234 |
| 上組 | 30 | 27 | 93,993 |
| キューソー流通システム | 4 | 6 | 6,217 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東海運 | 13 | — | — |
| エーアイティ | 4 | 3 | 6,867 |
| 内外トランスライン | 2 | 2 | 6,294 |
| 日本コンセプト | 3 | 3 | 7,059 |
| 情報・通信業(7.6%) | | | |
| NECネットエスアイ | 21 | 23 | 55,680 |
| クロスキャット | 3 | 5 | 6,534 |
| システナ | 107 | 90 | 25,650 |
| デジタルアーツ | 4 | 3 | 17,898 |
| 日鉄ソリューションズ | 10 | 10 | 50,197 |
| キューブシステム | 4 | 5 | 6,266 |
| コア | 3 | 3 | 6,436 |
| 手間いらず | 1 | — | — |
| ラクーンホールディングス | 6 | 9 | 6,403 |
| ソリトンシステムズ | 4 | 4 | 6,394 |
| ソフトクリエイティブホールディングス | 2 | 4 | 9,393 |
| T I S | 71 | 65 | 218,985 |
| グリーン | 34 | 19 | 10,407 |
| コーエーテックホールディングス | 40 | 37 | 69,060 |
| 三菱総合研究所 | 3 | 2 | 14,355 |
| AGS | 6 | — | — |
| ファインデックス | 10 | — | — |
| ブレインパッド | 6 | — | — |
| K L a b | 12 | — | — |
| ポルトゥウィンホールディングス | 10 | 12 | 6,396 |
| ネクソン | 165 | 133 | 337,874 |
| アイスタイル | 20 | 19 | 8,885 |
| エムアップホールディングス | 7 | 7 | 7,519 |
| エイチーム | 6 | 11 | 6,460 |
| エニグモ | 8 | 17 | 6,247 |
| コロプラ | 24 | 23 | 13,513 |
| ブロードリーフ | 37 | 28 | 16,356 |
| クロス・マーケティンググループ | 5 | — | — |
| デジタルハーツホールディングス | 4 | 6 | 6,522 |
| システム情報 | 5 | — | — |
| メディアドゥ | 2 | 4 | 5,987 |
| じげん | 18 | 17 | 9,151 |
| ブイキューブ | 7 | 20 | 6,695 |
| サイバーリンクス | 3 | — | — |
| フィックスターズ | 7 | 6 | 12,187 |
| CARTA HOLDINGS | 3 | 0.200 | 291 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| オプティム | 5 | 6 | 7,222 |
| セレス | 5 | 5 | 9,036 |
| S H I F T | 4 | 4 | 106,540 |
| ティーガイア | 6 | 6 | 13,181 |
| テクマトリックス | 11 | 10 | 22,279 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 19 | 15 | 35,076 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 14 | 11 | 101,197 |
| システムリサーチ | — | 2 | 7,192 |
| インターネットイニシアティブ | 35 | 28 | 83,070 |
| ざくらインターネット | 9 | 6 | 35,443 |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 1 | 2 | 6,083 |
| S R Aホールディングス | 3 | 3 | 11,865 |
| 朝日ネット | 8 | 10 | 6,487 |
| e B A S E | 9 | 9 | 6,651 |
| アバントグループ | 8 | 7 | 10,222 |
| アドソル日進 | 3 | 4 | 6,732 |
| フリービット | 4 | — | — |
| コムチュア | 8 | 8 | 16,838 |
| サイバーコム | 0.600 | — | — |
| アステリア | 6 | 10 | 7,008 |
| アイル | 3 | 2 | 10,332 |
| マークライNZ | 3 | 3 | 10,576 |
| メディカル・データ・ビジョン | 9 | 9 | 5,771 |
| g u m i | 10 | 15 | 6,224 |
| テラスカイ | 2 | 4 | 6,560 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 3 | 3 | 7,030 |
| P R T I M E S | 2 | — | — |
| ラクス | 30 | 28 | 60,808 |
| ランドコンピュータ | 5 | — | — |
| ダブルスタンダード | 2 | 3 | 7,238 |
| オーブントア | 4 | 7 | 6,007 |
| アカツキ | 3 | 2 | 6,890 |
| Ubicomホールディングス | 2 | 4 | 6,075 |
| カナミックネットワーク | 9 | 15 | 7,910 |
| ノムラシステムコーポレーション | 39 | — | — |
| チェンジホールディングス | 15 | 12 | 19,569 |
| シンクロ・フード | 0.200 | — | — |
| オークネット | 3 | 3 | 6,258 |
| キャピタル・アセット・プランニング | 7 | — | — |
| マクロミル | 14 | 11 | 9,383 |
| ビーグリーン | 3 | — | — |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| オロ | 2 | 2 | 5,768 |
| ユーザーローカル | 3 | - | - |
| マネーフォワード | 15 | 13 | 75,886 |
| プラスアルファ・コンサルティング | - | 3 | 8,879 |
| 電算システムホールディングス | 3 | 2 | 6,947 |
| APPIER GROUP | - | 20 | 38,488 |
| ビジョナル | - | 4 | 43,102 |
| プロトコーポレーション | 8 | 6 | 8,515 |
| ハイマックス | - | 4 | 6,291 |
| 野村総合研究所 | 131 | 131 | 537,599 |
| サイバネットシステム | 5 | - | - |
| CEホールディングス | 9 | - | - |
| 日本システム技術 | - | 2 | 7,414 |
| インテージホールディングス | 8 | 6 | 12,106 |
| ソースネクスト | 32 | 42 | 5,837 |
| インフォコム | 8 | 7 | 17,378 |
| シンプレクス・ホールディングス | 10 | 9 | 22,968 |
| HEROZ | 5 | 3 | 7,273 |
| ラクスル | 18 | 14 | 15,486 |
| メルカリ | 28 | 28 | 61,976 |
| I P S | 2 | - | - |
| F I G | 12 | - | - |
| イーソル | 6 | 10 | 11,227 |
| アルテリア・ネットワークス | 6 | - | - |
| ウイングアーク1 s t | 6 | 6 | 18,724 |
| サーバーワークス | 2 | 1 | 6,876 |
| トピラシステムズ | 4 | - | - |
| Sansan | 23 | 19 | 29,523 |
| ギフト | 6 | 5 | 7,898 |
| メドレー | 6 | 8 | 39,040 |
| ベース | 2 | 2 | 7,570 |
| JMDC | 10 | 10 | 37,370 |
| フォーカスシステムズ | 4 | 6 | 6,462 |
| クレスコ | 4 | 4 | 9,442 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 61 | 57 | 110,774 |
| オービック | 21 | 19 | 441,780 |
| ジャストシステム | 9 | 8 | 21,887 |
| TDCソフト | 5 | 5 | 11,849 |
| LINEヤフー | 909 | 846 | 357,815 |
| トレンドマイクロ | 36 | 28 | 204,258 |
| IDホールディングス | 5 | 4 | 6,580 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|--------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本オラクル | 12 | 11 | 132,240 |
| アルファシステムズ | 2 | 2 | 7,350 |
| フューチャー | 15 | 12 | 21,043 |
| CAC Holdings | 3 | 3 | 6,480 |
| S Bテクノロジー | 2 | 2 | 5,538 |
| トーセ | 6 | - | - |
| オービックビジネスコンサルタント | 12 | 8 | 58,287 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 34 | - | - |
| アイティフォー | 8 | 7 | 10,624 |
| 東計電算 | 0.900 | - | - |
| エクスネット | 4 | - | - |
| 大塚商会 | 36 | 29 | 191,101 |
| サイボウズ | 8 | 8 | 16,637 |
| 電通総研 | 7 | 7 | 39,888 |
| ACCESS | 7 | 8 | 7,605 |
| デジタルガレージ | 11 | 9 | 32,015 |
| イーエムシステムズ | 10 | 9 | 7,375 |
| ウェザーニューズ | 2 | 1 | 9,234 |
| C I J | 5 | 9 | 7,009 |
| 日本エンタープライズ | 30 | - | - |
| WOWOW | 3 | 5 | 6,344 |
| スカラ | 6 | 8 | 5,942 |
| ANYCOLOR | - | 6 | 19,593 |
| ネットワンシステムズ | 23 | 24 | 61,860 |
| アルゴグラフィックス | 5 | 5 | 23,732 |
| マーベラス | 10 | 9 | 7,178 |
| エイベックス | 10 | 10 | 13,079 |
| B I P R O G Y | 23 | 19 | 90,226 |
| 兼松エレクトロニクス | 4 | - | - |
| 都築電気 | 3 | 3 | 7,418 |
| T B Sホールディングス | 32 | 29 | 127,194 |
| 日本テレビホールディングス | 56 | 52 | 114,931 |
| 朝日放送グループホールディングス | 7 | 9 | 6,555 |
| テレビ朝日ホールディングス | 15 | 14 | 30,182 |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 56 | 46 | 41,395 |
| テレビ東京ホールディングス | 4 | 4 | 12,964 |
| 日本BS放送 | 4 | - | - |
| ビジョン | 8 | 9 | 10,044 |
| USEN-NEXT HOLDINGS | 5 | 6 | 30,116 |
| 日本通信 | 58 | 58 | 12,811 |
| 日本電信電話 | 818 | 17,686 | 3,211,941 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|----------------------|---------|-----|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| KDDI | 493 | 459 | 2,123,809 | |
| ソフトバンク | 1,026 | 956 | 1,884,136 | |
| 光通信 | 7 | 6 | 152,790 | |
| エムティーアイ | 9 | 10 | 8,003 | |
| GMOインターネットグループ | 23 | 22 | 56,518 | |
| アドマーケティングコミュニケーション | 16 | - | - | |
| KADOKAWA | 33 | 31 | 98,376 | |
| 学研ホールディングス | 10 | 9 | 9,850 | |
| ゼンリン | 10 | 10 | 8,680 | |
| インプレスホールディングス | 22 | - | - | |
| アイネット | 3 | 3 | 7,855 | |
| 松竹 | 3 | 3 | 31,186 | |
| 東宝 | 40 | 33 | 163,845 | |
| 東映 | 1 | 2 | 39,820 | |
| NTTデータグループ | 200 | 155 | 363,248 | |
| ピー・シー・エー | 3 | 5 | 8,548 | |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 2 | 2 | 6,652 | |
| DT S | 13 | 12 | 48,562 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 32 | 27 | 179,900 | |
| シーイーシー | 9 | 7 | 13,612 | |
| カプコン | 63 | 53 | 312,656 | |
| アイ・エス・ビー | 4 | 4 | 5,612 | |
| ジャステック | 4 | 4 | 6,420 | |
| S C S K | 52 | 41 | 112,049 | |
| NSW | 2 | 2 | 7,664 | |
| アイネス | 4 | 4 | 6,844 | |
| T K C | 11 | 9 | 34,780 | |
| 富士ソフト | 7 | 12 | 73,680 | |
| NSD | 22 | 21 | 57,452 | |
| コナミグループ | 27 | 22 | 214,035 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 4 | 3 | 9,764 | |
| J B C Cホールディングス | 4 | 3 | 14,878 | |
| ミロク情報サービス | 5 | 5 | 10,767 | |
| ソフトバンクグループ | 369 | 293 | 2,504,488 | |
| 卸売業(7.4%) | | | | |
| 高千穂交易 | 2 | 2 | 7,860 | |
| 伊藤忠食品 | 1 | 1 | 10,794 | |
| エレマテック | 6 | 5 | 10,074 | |
| あらた | 5 | 9 | 30,432 | |
| トーメンデバイス | 1 | 1 | 6,132 | |
| 東京エレクトロン デバイス | 2 | 6 | 42,651 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 円谷フィールズホールディングス | 5 | 10 | 17,258 | |
| 双日 | 71 | 69 | 263,355 | |
| アルフレッサ ホールディングス | 67 | 63 | 146,097 | |
| 横浜冷凍 | 18 | 17 | 18,211 | |
| アルコニックス | 8 | 8 | 11,520 | |
| 神戸物産 | 52 | 48 | 182,505 | |
| ハイパー | 4 | 4 | 1,386 | |
| あい ホールディングス | 10 | 10 | 24,450 | |
| ディーブイエックス | 4 | 4 | 4,332 | |
| ダイワボウホールディングス | 27 | 27 | 74,337 | |
| マクニカホールディングス | 16 | 14 | 120,768 | |
| ラクト・ジャパン | 2 | 2 | 6,224 | |
| グリムス | 2 | 3 | 5,793 | |
| パイタルケーエスケー・ホールディングス | 9 | 9 | 12,331 | |
| 八洲電機 | 5 | 5 | 6,803 | |
| メディアスホールディングス | 7 | 8 | 6,158 | |
| レスターホールディングス | 6 | 5 | 15,746 | |
| ジオリーブグループ | 4 | - | - | |
| OCHIホールディングス | 3 | - | - | |
| TOKAIホールディングス | 33 | 34 | 34,202 | |
| Cominix | 6 | - | - | |
| 三洋貿易 | 6 | 7 | 9,478 | |
| ビューティガレージ | 1 | 2 | 6,522 | |
| ウイン・パートナーズ | 4 | 5 | 6,492 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 24 | 22 | 49,443 | |
| 明治電機工業 | 4 | 4 | 6,569 | |
| コメダホールディングス | 16 | 15 | 42,334 | |
| アセンテック | 11 | 10 | 6,478 | |
| フルサト・マルカホールディングス | 6 | 5 | 12,605 | |
| ヤマエグループホールディングス | 3 | 3 | 8,809 | |
| 小野建 | 6 | 6 | 10,924 | |
| 南陽 | 2 | 1 | 3,441 | |
| 佐鳥電機 | 4 | 3 | 8,970 | |
| 伯東 | 3 | 3 | 21,420 | |
| コンドーテック | 5 | 5 | 6,196 | |
| 中山福 | 14 | 0.100 | 36 | |
| ナガイレーベン | 8 | 7 | 18,675 | |
| 三菱食品 | 6 | 5 | 29,174 | |
| 松田産業 | 5 | 4 | 11,520 | |
| 第一興商 | 13 | 24 | 46,546 | |
| メディバルホールディングス | 69 | 63 | 151,237 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| S P K | 3 | 3 | 6,585 |
| 萩原電気ホールディングス | 2 | 2 | 13,311 |
| アズワン | 9 | 9 | 51,832 |
| スズデン | 2 | 2 | 5,764 |
| シモジマ | 5 | 4 | 6,134 |
| ドウシシャ | 7 | 5 | 12,342 |
| 小津産業 | 2 | 2 | 3,852 |
| 高速 | 3 | 3 | 8,924 |
| 丸文 | 6 | 5 | 8,484 |
| ハピネット | 5 | 5 | 17,357 |
| 橋本総業ホールディングス | 4 | 4 | 6,114 |
| 日本ライフライン | 19 | 18 | 23,404 |
| I D O M | 20 | 16 | 14,740 |
| 進和 | 4 | 3 | 9,226 |
| ダイトロン | 2 | 2 | 7,312 |
| シークス | 9 | 8 | 14,426 |
| 田中商事 | 8 | - | - |
| オーハシテクニカ | 3 | 3 | 6,249 |
| 白銅 | 2 | 2 | 6,843 |
| 伊藤忠商事 | 415 | 421 | 2,781,111 |
| 丸紅 | 532 | 523 | 1,287,887 |
| 長瀬産業 | 31 | 28 | 70,660 |
| 蝶理 | 3 | 3 | 11,649 |
| 豊田通商 | 59 | 54 | 503,652 |
| 三共生興 | 10 | 8 | 6,690 |
| 兼松 | 26 | 26 | 61,701 |
| 三井物産 | 493 | 472 | 3,010,462 |
| 日本紙パルプ商事 | 3 | 3 | 15,060 |
| カメイ | 7 | 6 | 12,582 |
| O U Gホールディングス | 1 | 1 | 4,515 |
| スターゼン | 5 | 4 | 11,876 |
| 山善 | 18 | 19 | 24,472 |
| 椿本興業 | 1 | 1 | 8,931 |
| 住友商事 | 417 | 379 | 1,354,792 |
| 内田洋行 | 3 | 2 | 19,675 |
| 三菱商事 | 421 | 1,242 | 3,889,034 |
| 第一実業 | 2 | 5 | 11,693 |
| キャノンマーケティングジャパン | 15 | 14 | 61,842 |
| 西華産業 | 3 | 2 | 7,450 |
| 佐藤商事 | 4 | 4 | 7,568 |
| 菱洋エレクトロ | 5 | 5 | 23,482 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東京産業 | 6 | 8 | 6,273 |
| ユアサ商事 | 6 | 4 | 24,745 |
| 神鋼商事 | 1 | 1 | 11,536 |
| 阪和興業 | 12 | 11 | 63,506 |
| 正栄食品工業 | 4 | 4 | 19,530 |
| カナデン | 5 | 4 | 7,299 |
| R Y O D E N | 5 | 5 | 13,428 |
| 岩谷産業 | 15 | 14 | 105,033 |
| ナイス | 2 | 2 | 4,640 |
| 極東貿易 | 4 | 3 | 7,921 |
| アステナホールディングス | 11 | 13 | 6,270 |
| 三愛オプリー | 18 | 15 | 29,037 |
| 稲畑産業 | 13 | 12 | 39,184 |
| G S Iクレオス | 3 | 3 | 8,166 |
| 明和産業 | 9 | 9 | 6,726 |
| クワザワホールディングス | 10 | - | - |
| ワキタ | 12 | 10 | 16,588 |
| 東邦ホールディングス | 16 | 17 | 56,306 |
| サンゲツ | 16 | 14 | 51,624 |
| ミツロコグループホールディングス | 8 | 8 | 12,096 |
| シナネンホールディングス | 2 | 1 | 7,097 |
| 伊藤忠エネクス | 16 | 15 | 23,482 |
| サンリオ | 19 | 17 | 133,037 |
| サンワ テクノス | 3 | 3 | 7,302 |
| リョーサン | 7 | 4 | 22,660 |
| 新光商事 | 9 | 8 | 10,315 |
| トーホー | 2 | 2 | 6,890 |
| 三信電気 | 2 | 2 | 6,024 |
| 東陽テクニカ | 7 | 6 | 9,600 |
| モスフードサービス | 9 | 9 | 31,970 |
| 加賀電子 | 5 | 5 | 36,936 |
| ソーダニッカ | - | 5 | 6,238 |
| 立花エレテック | 4 | 4 | 13,062 |
| P A L T A C | 10 | 8 | 37,051 |
| 三谷産業 | 15 | 17 | 6,776 |
| 西本Wismettacホールディングス | 1 | 1 | 10,768 |
| K P Pグループホールディングス | 15 | 16 | 10,238 |
| ヤマタネ | 3 | 2 | 7,154 |
| 丸紅建材リース | 2 | - | - |
| 日鉄物産 | 4 | - | - |
| 泉州電業 | 3 | 2 | 10,904 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| トラスコ中山 | 14 | 13 | 30,874 |
| オートバックスセブン | 23 | 21 | 35,839 |
| モリト | 6 | 4 | 6,376 |
| 加藤産業 | 8 | 7 | 37,479 |
| イエローハット | 11 | 10 | 18,910 |
| J Kホールディングス | 5 | 5 | 6,082 |
| 日伝 | 4 | 4 | 11,743 |
| 北沢産業 | 23 | 10 | 3,403 |
| 杉本商事 | 3 | 3 | 6,768 |
| 因幡電機産業 | 17 | 16 | 57,539 |
| 東テク | 2 | 2 | 14,679 |
| ミスミグループ本社 | 101 | 94 | 198,396 |
| 蔵王産業 | 2 | - | - |
| スズケン | 21 | 23 | 117,683 |
| ジェコス | 5 | 5 | 6,739 |
| 小売業(4.2%) | | | |
| ローソン | 16 | 13 | 136,391 |
| サンエー | 5 | 4 | 21,816 |
| カワチ薬品 | 5 | 4 | 13,445 |
| エービーシー・マート | 9 | 27 | 69,363 |
| ハードオフコーポレーション | 2 | 3 | 6,004 |
| アスクル | 16 | 15 | 30,939 |
| ゲオホールディングス | 7 | 7 | 14,175 |
| アダストリア | 8 | 7 | 26,486 |
| くら寿司 | 7 | 7 | 29,455 |
| キャンドゥ | 2 | 2 | 6,535 |
| パルグループホールディングス | 6 | 12 | 27,355 |
| エディオン | 26 | 24 | 37,125 |
| サーラコーポレーション | 14 | 13 | 10,731 |
| ハローズ | 3 | 2 | 12,012 |
| フジオフードグループ本社 | 5 | 7 | 9,555 |
| あみやき亭 | 1 | 1 | 6,517 |
| 大黒天物産 | 2 | 1 | 16,473 |
| ハニーズホールディングス | 6 | 5 | 9,027 |
| ファーマライズホールディングス | 7 | - | - |
| アルペン | 5 | 5 | 10,374 |
| クオールホールディングス | 9 | 8 | 14,155 |
| ジンズホールディングス | 4 | 3 | 14,134 |
| ビックカメラ | 44 | 33 | 43,420 |
| DCMホールディングス | 41 | 33 | 46,306 |
| MonotaRO | 95 | 88 | 136,906 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東京一番フーズ | 8 | 8 | 4,288 |
| アークランドサービスホールディングス | 5 | - | - |
| J. フロント リテイリング | 83 | 72 | 112,464 |
| ドトール・日レスホールディングス | 11 | 11 | 23,110 |
| マツキヨココカラ&カンパニー | 40 | 114 | 305,388 |
| ブロンコビリー | 3 | 3 | 12,117 |
| ZOZO | 44 | 40 | 137,040 |
| トレジャー・ファクトリー | 2 | 4 | 7,156 |
| 物語コーポレーション | 3 | 10 | 48,195 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 113 | 105 | 225,931 |
| Hamee | 7 | 5 | 6,241 |
| ウエルシアホールディングス | 35 | 32 | 86,043 |
| クリエイトSDホールディングス | 11 | 8 | 28,346 |
| 丸善CHIホールディングス | 12 | 12 | 4,132 |
| ミサワ | 2 | 2 | 1,439 |
| ティーライフ | 3 | - | - |
| シュッピン | 5 | 6 | 6,362 |
| オイシックス・ラ・大地 | 9 | 8 | 11,583 |
| ネクステージ | 15 | 14 | 31,174 |
| ジョイフル本田 | 21 | 18 | 36,618 |
| 鳥貴族ホールディングス | 2 | 2 | 9,372 |
| ホットランド | 5 | 4 | 8,784 |
| すかいらーくホールディングス | 92 | 85 | 187,383 |
| SFPホールディングス | 3 | 3 | 7,116 |
| 綿半ホールディングス | 5 | 4 | 7,212 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 22 | 17 | 17,447 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 3 | - | - |
| B E E N O S | 3 | 4 | 5,934 |
| あさひ | 5 | 5 | 7,412 |
| 日本調剤 | 4 | 4 | 6,484 |
| コスモス薬品 | 7 | 5 | 79,659 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 232 | 216 | 1,379,788 |
| クリエイトレストランツ・ホールディングス | 50 | 42 | 46,070 |
| ツルハホールディングス | 16 | 13 | 145,794 |
| サンマルクホールディングス | 5 | 5 | 11,040 |
| フェリシモ | 4 | 4 | 4,070 |
| トリドールホールディングス | 16 | 17 | 73,057 |
| T O K Y O B A S E | 17 | 19 | 5,841 |
| J Mホールディングス | 5 | 4 | 11,453 |
| アレンザホールディングス | 5 | 5 | 6,641 |
| パロックジャパンリミテッド | 5 | 7 | 6,337 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| クスリのアオキホールディングス | 6 | 18 | 57,645 |
| 力の源ホールディングス | — | 4 | 7,591 |
| FOOD & LIFE COMPANIES | 38 | 33 | 102,007 |
| メディカルシステムネットワーク | 11 | 10 | 6,375 |
| はるやまホールディングス | 11 | 5 | 3,169 |
| ノジマ | 22 | 18 | 30,212 |
| カップ・クリエイト | 10 | 9 | 16,513 |
| ライトオン | 6 | 6 | 2,725 |
| 良品計画 | 86 | 68 | 159,262 |
| アドヴァングループ | 6 | 6 | 6,996 |
| アルビス | 2 | 2 | 6,314 |
| コナカ | 14 | — | — |
| ハウス オブ ローゼ | 2 | 0.400 | 651 |
| G-7ホールディングス | 8 | 6 | 9,785 |
| イオン北海道 | 10 | 18 | 17,205 |
| コジマ | 13 | 10 | 7,820 |
| ヒマラヤ | 4 | 0.400 | 377 |
| コーナン商事 | 9 | 7 | 29,953 |
| エコス | 2 | 2 | 6,162 |
| ワタミ | 8 | 6 | 6,824 |
| パ・パフィック・インターナショナルホールディングス | 151 | 126 | 440,409 |
| 西松屋チェーン | 14 | 12 | 25,682 |
| ゼンショーホールディングス | 36 | 31 | 211,433 |
| サイゼリヤ | 11 | 9 | 45,942 |
| V Tホールディングス | 25 | 23 | 12,233 |
| 魚力 | 2 | 2 | 6,426 |
| フジ・コーポレーション | 3 | 3 | 6,271 |
| ユナイテッドアローズ | 7 | 7 | 13,246 |
| ハイデイ日高 | 10 | 9 | 25,212 |
| コロワイド | 31 | 27 | 60,345 |
| ピーシーデポコーポレーション | 17 | — | — |
| 壱番屋 | 5 | 5 | 30,450 |
| スギホールディングス | 13 | 12 | 91,539 |
| 薬王堂ホールディングス | 3 | 3 | 8,804 |
| スクロール | 10 | 9 | 8,639 |
| ヨンドシーホールディングス | 5 | 5 | 11,487 |
| 木曽路 | 10 | 9 | 24,595 |
| S R Sホールディングス | 11 | 10 | 12,133 |
| 千趣会 | 12 | — | — |
| リテールパートナーズ | 10 | 9 | 16,414 |
| ケーヨー | 10 | — | — |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 上新電機 | 6 | 6 | 14,656 |
| 日本瓦斯 | 36 | 33 | 77,804 |
| ロイヤルホールディングス | 13 | 11 | 26,706 |
| 東天紅 | 5 | — | — |
| いなげや | 6 | 6 | 7,893 |
| チヨダ | 6 | 7 | 6,379 |
| ライフコーポレーション | 5 | 6 | 24,519 |
| リンガーハット | 8 | 8 | 19,197 |
| MrMaxHD | 9 | 10 | 6,426 |
| AOKIホールディングス | 12 | 13 | 15,436 |
| オークワ | 10 | 9 | 7,812 |
| コメリ | 10 | 9 | 32,204 |
| 青山商事 | 14 | 13 | 21,882 |
| しまむら | 7 | 14 | 120,723 |
| 高島屋 | 50 | 43 | 99,125 |
| 松屋 | 11 | 10 | 10,207 |
| イチ・ツー・オー リテイリング | 32 | 27 | 50,762 |
| 近鉄百貨店 | 2 | 2 | 6,812 |
| 丸井グループ | 49 | 41 | 102,960 |
| アクシアル リテイリング | 4 | 4 | 17,350 |
| イオン | 228 | 212 | 762,808 |
| イズミ | 10 | 11 | 41,680 |
| 平和堂 | 11 | 10 | 21,672 |
| フジ | 10 | 9 | 19,046 |
| ヤオコー | 7 | 7 | 58,646 |
| ゼビオホールディングス | 9 | 8 | 8,228 |
| ケーズホールディングス | 53 | 42 | 51,972 |
| 日産東京販売ホールディングス | 4 | 4 | 2,400 |
| Genky DrugStores | 3 | 2 | 16,794 |
| ナルミヤ・インターナショナル | 5 | 3 | 4,098 |
| ブックオフグループホールディングス | 4 | — | — |
| ギフトホールディングス | 1 | 2 | 7,908 |
| アインホールディングス | 9 | 8 | 40,402 |
| 元氣寿司 | 2 | 3 | 12,215 |
| ヤマダホールディングス | 276 | 192 | 83,602 |
| アークランズ | 9 | 18 | 30,985 |
| ニトリホールディングス | 27 | 22 | 493,734 |
| グルメ杵屋 | 5 | — | — |
| 愛眼 | 27 | 1 | 257 |
| ケーユーホールディングス | 3 | 5 | 6,382 |
| 吉野家ホールディングス | 26 | 23 | 75,467 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | 千円 |
| 松屋フーズホールディングス | 3 | 3 | 16,710 | |
| サガミホールディングス | 10 | 9 | 14,043 | |
| 関西フードマーケット | 6 | 4 | 7,145 | |
| 王将フードサービス | 4 | 4 | 35,512 | |
| ミニストップ | 4 | 4 | 7,502 | |
| アークス | 12 | 11 | 34,960 | |
| パローホールディングス | 12 | 12 | 29,508 | |
| ベルク | 3 | 3 | 20,367 | |
| 大 庄 | 4 | 4 | 6,189 | |
| ファーストリテイリング | 10 | 28 | 1,175,940 | |
| サンドラッグ | 25 | 21 | 96,036 | |
| サックスパー ホールディングス | 6 | 7 | 6,520 | |
| ヤマザワ | 3 | 3 | 4,301 | |
| やまや | 1 | - | - | |
| ペルーナ | 16 | 15 | 9,301 | |
| 銀行業(7.2%) | | | | |
| いよぎんホールディングス | 74 | 69 | 75,129 | |
| しずおかフィナンシャルグループ | 141 | 129 | 187,286 | |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 52 | 49 | 55,473 | |
| 楽天銀行 | - | 20 | 54,099 | |
| 京都フィナンシャルグループ | - | 74 | 186,776 | |
| 島根銀行 | 9 | - | - | |
| じもとホールディングス | 8 | 2 | 1,365 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 311 | 289 | 127,207 | |
| 東京さらぼしフィナンシャルグループ | 8 | 7 | 30,862 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 110 | 113 | 109,011 | |
| ゆうちょ銀行 | 178 | 641 | 985,497 | |
| 富山第一銀行 | 15 | 18 | 16,058 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 345 | 313 | 228,395 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 39 | 32 | 53,396 | |
| 三十三フィナンシャルグループ | 5 | 5 | 10,046 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 9 | 9 | 38,778 | |
| ひろぎんホールディングス | 81 | 83 | 86,174 | |
| おきなわフィナンシャルグループ | 6 | 5 | 12,265 | |
| 十六フィナンシャルグループ | 8 | 7 | 32,300 | |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 5 | 6 | 28,731 | |
| プロクレアホールディングス | 7 | 6 | 12,267 | |
| あいちフィナンシャルグループ | 8 | 9 | 23,535 | |
| S B I 新生銀行 | 18 | - | - | |
| あおぞら銀行 | 39 | 42 | 93,030 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 3,982 | 3,555 | 5,289,401 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | 千円 |
| りそなホールディングス | 800 | 680 | 556,771 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 114 | 209 | 623,001 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 458 | 415 | 3,349,833 | |
| 千葉銀行 | 174 | 162 | 191,335 | |
| 群馬銀行 | 121 | 113 | 87,977 | |
| 武蔵野銀行 | 8 | 8 | 22,428 | |
| 千葉興業銀行 | 14 | 11 | 9,163 | |
| 筑波銀行 | 27 | - | - | |
| 七十七銀行 | 20 | 17 | 62,645 | |
| 秋田銀行 | 4 | 3 | 7,983 | |
| 山形銀行 | 7 | 6 | 7,143 | |
| 岩手銀行 | 4 | 3 | 9,335 | |
| 東邦銀行 | 49 | 46 | 14,414 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 50 | 50 | 186,904 | |
| スルガ銀行 | 55 | 51 | 40,067 | |
| 八十二銀行 | 128 | 125 | 109,800 | |
| 山梨中央銀行 | 6 | 6 | 11,147 | |
| 大垣共立銀行 | 12 | 11 | 22,954 | |
| 福井銀行 | 5 | 5 | 9,235 | |
| 清水銀行 | 3 | 4 | 6,264 | |
| 富山銀行 | 1 | 1 | 1,976 | |
| 滋賀銀行 | 10 | 9 | 38,363 | |
| 南都銀行 | 9 | 8 | 23,698 | |
| 百五銀行 | 59 | 54 | 33,214 | |
| 京都銀行 | 19 | - | - | |
| 紀陽銀行 | 22 | 20 | 38,769 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 39 | 36 | 60,611 | |
| 山陰合同銀行 | 39 | 36 | 37,047 | |
| 百十四銀行 | 5 | 5 | 15,378 | |
| 四国銀行 | 10 | 8 | 9,116 | |
| 阿波銀行 | 9 | 8 | 19,983 | |
| 大分銀行 | 3 | 3 | 9,198 | |
| 宮崎銀行 | 4 | 3 | 9,534 | |
| 佐賀銀行 | 3 | 3 | 6,480 | |
| 琉球銀行 | 14 | 12 | 14,012 | |
| セブン銀行 | 224 | 183 | 54,717 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 907 | 788 | 2,156,241 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 69 | 57 | 85,835 | |
| 長野銀行 | 3 | - | - | |
| 名古屋銀行 | 4 | 3 | 22,382 | |
| 北洋銀行 | 95 | 88 | 30,621 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 大光銀行 | 3 | 1 | 1,677 |
| 愛媛銀行 | 8 | 7 | 8,769 |
| 京葉銀行 | 29 | 24 | 17,419 |
| 栃木銀行 | 28 | 29 | 8,906 |
| 北日本銀行 | 2 | 2 | 5,955 |
| 東和銀行 | 11 | 10 | 7,051 |
| トモニホールディングス | 50 | 55 | 22,175 |
| フィデアホールディングス | 6 | 6 | 9,534 |
| 池田泉州ホールディングス | 80 | 81 | 28,755 |
| 証券・商品先物取引業(0.9%) | | | |
| F P G | 25 | 19 | 36,287 |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 5 | 9 | 8,531 |
| マーキュリアホールディングス | 4 | 1 | 1,061 |
| S B I ホールディングス | 90 | 85 | 342,400 |
| ジャフコ グループ | 20 | 17 | 30,389 |
| 大和証券グループ本社 | 448 | 452 | 489,614 |
| 野村ホールディングス | 1,155 | 981 | 816,155 |
| 岡三証券グループ | 55 | 51 | 37,500 |
| 丸三証券 | 20 | 19 | 18,876 |
| 東洋証券 | 20 | 19 | 6,892 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 68 | 69 | 39,847 |
| 光世証券 | 5 | 1 | 715 |
| 水戸証券 | 23 | 17 | 8,084 |
| いちよし証券 | 11 | 10 | 8,589 |
| 松井証券 | 37 | 28 | 24,481 |
| マネックスグループ | 70 | 57 | 50,393 |
| 極東証券 | 8 | 8 | 8,144 |
| 岩井コスモホールディングス | 7 | 6 | 14,632 |
| アイザワ証券グループ | 9 | 8 | 9,870 |
| スパークス・グループ | 7 | 6 | 11,836 |
| 保険業(2.6%) | | | |
| かんぽ生命保険 | 76 | 59 | 159,370 |
| F P パートナー | - | 1 | 8,256 |
| S O M P O ホールディングス | 107 | 87 | 775,537 |
| アニコム ホールディングス | 21 | 19 | 11,840 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 127 | 130 | 962,082 |
| 第一生命ホールディングス | 319 | 285 | 970,590 |
| 東京海上ホールディングス | 631 | 577 | 2,534,485 |
| T & D ホールディングス | 168 | 156 | 396,076 |
| アドバンスクリエイト | 3 | 3 | 3,438 |
| その他金融業(1.2%) | | | |
| 全国保証 | 16 | 15 | 84,165 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ジェイリース | 2 | 1 | 4,759 |
| イントラスト | 4 | 0.100 | 80 |
| S B I アルヒ | 7 | 7 | 6,704 |
| プレミアグループ | 10 | 9 | 17,385 |
| ネットプロテクションズホールディングス | 20 | 34 | 6,747 |
| クレディセゾン | 39 | 37 | 104,340 |
| 芙蓉総合リース | 5 | 5 | 74,277 |
| みずほリース | 9 | 9 | 52,528 |
| 東京センチュリー | 11 | 43 | 69,738 |
| 日本証券金融 | 25 | 21 | 35,088 |
| アイフル | 103 | 86 | 37,152 |
| リコーリース | 6 | 5 | 28,050 |
| イオンフィナンシャルサービス | 36 | 33 | 44,957 |
| アコム | 111 | 104 | 41,419 |
| ジャックス | 6 | 6 | 34,348 |
| オリエントコーポレーション | 16 | 19 | 20,398 |
| オリックス | 419 | 355 | 1,096,883 |
| 三菱HCキャピタル | 244 | 260 | 270,868 |
| 九州リースサービス | 3 | - | - |
| 日本取引所グループ | 176 | 152 | 578,740 |
| イー・ギャランティ | 10 | 9 | 17,917 |
| アサックス | 8 | - | - |
| NECキャピタルソリューション | 3 | 2 | 10,730 |
| 不動産業(1.9%) | | | |
| 大東建託 | 23 | 21 | 367,545 |
| いちご | 72 | 67 | 27,216 |
| 日本駐車場開発 | 74 | 61 | 11,185 |
| S R E ホールディングス | 3 | 2 | 8,650 |
| ADワークスグループ | 20 | 20 | 4,763 |
| ヒューリック | 146 | 136 | 206,411 |
| 三栄建築設計 | 3 | - | - |
| 野村不動産ホールディングス | 39 | 32 | 120,412 |
| 三重交通グループホールディングス | 13 | 12 | 7,550 |
| サムティ | 10 | 9 | 23,212 |
| ディア・ライフ | 9 | 10 | 9,260 |
| コーセーアールイー | 6 | 3 | 3,307 |
| 地主 | 4 | 4 | 9,499 |
| プレサンスコーポレーション | 8 | 9 | 15,475 |
| ハウスコム | 4 | 4 | 3,864 |
| J P M C | 4 | 5 | 6,754 |
| サンセイランディック | 5 | 2 | 2,380 |
| エストラスト | 8 | 7 | 4,920 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フージャースホールディングス | 9 | 9 | 9,585 |
| オープンハウスグループ | 23 | 21 | 105,009 |
| 東急不動産ホールディングス | 188 | 175 | 171,586 |
| 飯田グループホールディングス | 54 | 55 | 108,222 |
| ムゲンエステート | 9 | - | - |
| And Doホールディングス | 6 | 5 | 6,165 |
| シーアールイー | 4 | 4 | 5,821 |
| ケイアイスター不動産 | 3 | 2 | 10,430 |
| グッドコムアセット | 5 | 8 | 6,166 |
| ジェイ・エス・ビー | 1 | 2 | 7,975 |
| ロードスターキャピタル | 3 | 3 | 8,329 |
| 霞ヶ関キャピタル | - | 1 | 21,296 |
| パーク24 | 48 | 37 | 65,377 |
| 三井不動産 | 272 | 270 | 1,099,440 |
| 三菱地所 | 378 | 381 | 814,166 |
| 平和不動産 | 10 | 9 | 38,190 |
| 東京建物 | 59 | 51 | 110,058 |
| 京阪神ビルディング | 7 | 10 | 17,254 |
| 住友不動産 | 113 | 84 | 387,902 |
| テーオーシー | 11 | 10 | 7,082 |
| 東京楽天地 | 1 | 1 | 6,700 |
| レオパレス21 | 70 | 58 | 24,703 |
| スターツコーポレーション | 9 | 8 | 25,494 |
| フジ住宅 | 8 | 8 | 6,327 |
| 空港施設 | 9 | 10 | 6,281 |
| ゴールドクレスト | 6 | 4 | 10,780 |
| エスリード | 2 | 2 | 9,207 |
| 日神グループホールディングス | 11 | 12 | 6,197 |
| 日本エスコン | 14 | 10 | 10,758 |
| MIRARTHホールディングス | 31 | 26 | 13,185 |
| AVANTIA | 5 | 3 | 3,122 |
| イオンモール | 32 | 30 | 55,342 |
| ファースト住建 | 4 | 1 | 1,651 |
| カチタス | 16 | 15 | 31,117 |
| トーセイ | 10 | 9 | 19,962 |
| 穴吹興産 | 2 | - | - |
| サンフロンティア不動産 | 10 | 8 | 14,706 |
| FJネクストホールディングス | 6 | 6 | 7,198 |
| グランディハウス | 8 | 9 | 6,295 |
| 日本空港ビルデング | 22 | 20 | 121,157 |
| サービス業(4.6%) | | | |
| 日本工営 | 4 | - | - |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| LIFULL | 22 | 32 | 5,377 |
| MIXI | 14 | 13 | 31,584 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 5 | 22 | 16,566 |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 112 | 97 | 101,518 |
| メンバーズ | 2 | 6 | 6,009 |
| UTグループ | 9 | 7 | 26,702 |
| アイティメディア | 3 | 6 | 11,796 |
| ケアネット | - | 9 | 6,439 |
| E・Jホールディングス | 4 | 3 | 6,055 |
| オープンアップグループ | 23 | 18 | 40,205 |
| コシダカホールディングス | 19 | 18 | 16,580 |
| アルトナー | 1 | - | - |
| パソナグループ | 7 | 7 | 20,290 |
| CDS | 2 | - | - |
| リンクアンドモチベーション | 18 | 17 | 10,710 |
| エス・エム・エス | 24 | 21 | 55,105 |
| サニーサイドアップグループ | 7 | - | - |
| パーソルホールディングス | 73 | 620 | 137,604 |
| クックパッド | 26 | 53 | 7,021 |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス | 3 | - | - |
| 学情 | 3 | 3 | 6,688 |
| スタジオアリス | 3 | 3 | 6,180 |
| シミックホールディングス | 3 | - | - |
| NJS | 2 | 2 | 6,249 |
| 総合警備保障 | 24 | 101 | 82,702 |
| カカクコム | 48 | 40 | 70,101 |
| アイロムグループ | 2 | - | - |
| セントケア・ホールディング | 5 | 6 | 6,157 |
| ルネサンス | 5 | 6 | 7,534 |
| ディップ | 11 | 9 | 25,110 |
| デジタルホールディングス | 5 | - | - |
| 新日本科学 | 6 | 5 | 9,025 |
| ベネフィット・ワン | 30 | 21 | 45,982 |
| エムスリー | 129 | 120 | 252,840 |
| アウトソーシング | 39 | 39 | 67,740 |
| ウエルネット | 7 | - | - |
| ワールドホールディングス | 2 | 2 | 6,750 |
| ディー・エヌ・エー | 27 | 21 | 27,287 |
| 博報堂DYホールディングス | 83 | 77 | 112,276 |
| ぐるなび | 12 | 23 | 7,120 |
| ジャパンバストレスキューシステム | 5 | - | - |
| ファンコミュニケーションズ | 12 | 15 | 6,455 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ライク | 2 | 4 | 6,581 |
| A o b a - B B T | 11 | - | - |
| エスプール | 18 | 20 | 6,457 |
| WDBホールディングス | 3 | 3 | 7,182 |
| アドウェイズ | 9 | 12 | 5,790 |
| バリューコマース | 4 | 5 | 6,153 |
| インフォマート | 68 | 63 | 24,813 |
| J Pホールディングス | 18 | 15 | 7,410 |
| C Lホールディングス | 6 | - | - |
| プレステージ・インターナショナル | 27 | 28 | 17,271 |
| アミューズ | 3 | 4 | 6,056 |
| ドリームインキュベータ | 2 | 2 | 6,468 |
| クイック | 5 | 4 | 10,101 |
| T A C | 22 | - | - |
| 電通グループ | 64 | 59 | 258,348 |
| びあ | 2 | 2 | 6,594 |
| イオンファンタジー | 2 | 2 | 6,220 |
| シーティーエス | 7 | 9 | 6,880 |
| H. U. グループホールディングス | 19 | 17 | 48,594 |
| アルプス技研 | 5 | 5 | 17,057 |
| 日本空調サービス | 7 | 7 | 6,727 |
| オリエンタルランド | 69 | 322 | 1,738,597 |
| ダスキン | 14 | 13 | 45,954 |
| 明光ネットワークジャパン | 8 | 8 | 6,505 |
| ファルコホールディングス | 3 | 2 | 6,664 |
| 秀英予備校 | 11 | - | - |
| ラウンドワン | 54 | 57 | 39,835 |
| リゾートトラスト | 25 | 26 | 67,190 |
| ビー・エム・エル | 8 | 7 | 20,580 |
| りらいあコミュニケーションズ | 10 | - | - |
| リソー教育 | 29 | 31 | 7,246 |
| 早稲田アカデミー | 4 | - | - |
| ユー・エス・エス | 67 | 68 | 178,318 |
| 東京個別指導学院 | 9 | 14 | 6,375 |
| サイバーエージェント | 156 | 134 | 141,704 |
| 楽天グループ | 302 | 522 | 391,643 |
| クリーク・アンド・リバー社 | 3 | 3 | 6,198 |
| S B グローバルアセットマネジメント | 10 | 11 | 8,782 |
| テー・オー・ダブリュー | 16 | 18 | 6,822 |
| 山田コンサルティンググループ | 4 | 3 | 6,192 |
| セントラルスポーツ | 2 | 2 | 6,357 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フルキャストホールディングス | 6 | 5 | 8,572 |
| エン・ジャパン | 11 | 9 | 27,343 |
| テクノプロ・ホールディングス | 43 | 35 | 117,453 |
| インターワークス | 12 | - | - |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 3 | 4 | 5,719 |
| K e e P e r 技研 | 4 | 3 | 25,156 |
| 三機サービス | 4 | - | - |
| イー・ガーディアン | 2 | 4 | 5,504 |
| リブセンス | 1 | - | - |
| ジャパンマテリアル | 20 | 18 | 49,159 |
| ベクトル | 10 | 7 | 9,420 |
| ウチヤマホールディングス | 15 | - | - |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 5 | 5 | 7,282 |
| キャリアリンク | 2 | 2 | 6,364 |
| I B J | 5 | 9 | 5,391 |
| アサンテ | 3 | 3 | 6,399 |
| バリューHR | 5 | 5 | 7,239 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 6 | 4 | 12,215 |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 4 | 6 | 6,502 |
| シグマクシス・ホールディングス | 9 | 8 | 13,587 |
| ウィルグループ | 5 | 5 | 6,079 |
| メドピア | 5 | 9 | 7,443 |
| リクルートホールディングス | 484 | 451 | 2,657,568 |
| エラン | 8 | 8 | 7,743 |
| 日本郵政 | 858 | 716 | 1,006,977 |
| ベルシステム24ホールディングス | 8 | 6 | 11,615 |
| 鎌倉新書 | 7 | 10 | 5,990 |
| SMN | 8 | - | - |
| エアトリ | 4 | 4 | 7,236 |
| アトラエ | 5 | 9 | 4,557 |
| ストライク | 3 | 2 | 13,468 |
| ソラスト | 18 | 16 | 9,021 |
| インソース | 16 | 13 | 10,560 |
| バイカレント・コンサルティング | 51 | 44 | 142,374 |
| Orchestra Holdings | 2 | 6 | 7,125 |
| アイモバイル | 4 | 14 | 6,570 |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 23 | 19 | 44,837 |
| G A M E W I T H | 10 | - | - |
| ウェルビー | 6 | - | - |
| ミダックホールディングス | 4 | 3 | 6,090 |
| キュービネットホールディングス | 3 | 4 | 5,636 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------------------|---------|-----|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| RPAホールディングス | 18 | 24 | 6,548 |
| マネジメントソリューションズ | 3 | 2 | 7,774 |
| プロレド・パートナーズ and factory | 10 | 17 | 6,301 |
| アンビスホールディングス | – | 6 | 16,932 |
| カーブスホールディングス | 20 | 16 | 12,267 |
| フォーラムエンジニアリング | 5 | 8 | 7,984 |
| ダイレクトマーケティングミックス ポピンズ | 7 | 14 | 4,847 |
| LITALICO | 3 | 5 | 8,047 |
| リログループ | 5 | 4 | 9,987 |
| 東祥 | 36 | 30 | 39,909 |
| ID&E ホールディングス | 4 | 7 | 5,621 |
| TREホールディングス | – | 3 | 13,764 |
| 人・夢・技術グループ | 13 | 11 | 14,402 |
| 大栄環境 | 2 | 3 | 5,817 |
| 日本管財ホールディングス | – | 11 | 29,403 |
| M&A総研ホールディングス | – | 6 | 16,531 |
| エイチ・アイ・エス | – | 2 | 19,633 |
| ラックランド | 17 | 17 | 29,824 |
| 共立メンテナンス | 2 | 2 | 7,257 |
| イチネンホールディングス | 11 | 9 | 60,537 |
| 建設技術研究所 | 6 | 6 | 10,809 |
| スペース | 3 | 3 | 18,755 |
| 燦ホールディングス | 5 | 6 | 6,606 |
| 東京テアトル | 2 | 5 | 5,916 |
| タナベコンサルティンググループ | 4 | – | – |
| ナガワ | 7 | – | – |
| 東京都競馬 | 1 | 1 | 13,585 |
| カナモト | 5 | 5 | 21,420 |
| ニシオホールディングス | 12 | 9 | 27,767 |
| トランス・コスモス | 6 | 5 | 21,916 |
| 乃村工藝社 | 8 | 7 | 22,724 |
| 藤田観光 | 28 | 26 | 23,354 |
| KNT-CTホールディングス | 2 | 2 | 15,816 |
| | 3 | – | – |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|--------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本管財 | 6 | – | – |
| トーカイ | 5 | 5 | 11,545 |
| セコム | 66 | 62 | 686,205 |
| セントラル警備保障 | 3 | 3 | 8,619 |
| 丹青社 | 12 | 11 | 9,428 |
| メイテックグループホールディングス | 26 | 21 | 66,269 |
| 応用地質 | 6 | 5 | 13,366 |
| 船井総研ホールディングス | 13 | 12 | 33,794 |
| 進学会ホールディングス | 14 | – | – |
| 学究社 | 2 | 3 | 6,479 |
| ベネッセホールディングス | 24 | 20 | 53,207 |
| イオンディライト | 7 | 6 | 22,977 |
| ナック | 5 | 12 | 6,348 |
| ダイセキ | 13 | 12 | 49,662 |
| ステップ | 2 | 1 | 2,059 |
| 合計 | 株数・金額 | 74,409 | 91,102 221,415,671 |
| | 銘柄数<比率> | 1,821 | 1,708 <98.8%> |

(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 |
| | 百万円 | 百万円 |
| 国内 TOPIX | 2,164 | – |

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年2月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 221,415,671 | 98.5 |
| コール・ローン等、その他 | 3,408,070 | 1.5 |
| 投資信託財産総額 | 224,823,742 | 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

(2024年2月20日現在)

| 項目 | 当期末 |
|----------------------|-------------------------|
| (A)資産 | 224,657,797,609円 |
| コール・ローン等 | 2,826,521,934 |
| 株式(評価額) | 221,415,671,790 |
| 未収入金 | 160,569,900 |
| 未収配当金 | 313,885,151 |
| 差入委託証拠金 | △ 58,851,166 |
| (B)負債 | 655,207,961 |
| 未払解約金 | 655,205,252 |
| その他未払費用 | 2,709 |
| (C)純資産総額(A-B) | 224,002,589,648 |
| 元本 | 71,936,737,810 |
| 次期繰越損益金 | 152,065,851,838 |
| (D)受益権総口数 | 71,936,737,810口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 31,139円 |

(注1) 期首元本額 81,219,744,591円
 期中追加設定元本額 19,799,367,159円
 期中一部解約元本額 29,082,373,940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 | 5,323,486,715円 |
| ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定) | 3,051,320,322円 |
| ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定) | 3,075,264円 |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) | 1,981,344,929円 |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型) | 7,282,848,201円 |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) | 6,199,571,181円 |
| ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定) | 2,308,680円 |
| ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定) | 3,096,064円 |
| ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定) | 9,707,823円 |
| D Cニッセイ国内株式インデックス | 3,111,356,570円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド | 24,329,146,106円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型) | 3,680,342,973円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2055 | 383,217,945円 |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 223,827,805円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2045 | 437,206,012円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2035 | 600,148,942円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2025 | 32,113,164円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型) | 118,398,630円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式) | 10,306,061円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート) | 13,314,440円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券) | 4,770,388円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券) | 9,699,744円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型) | 26,586,216円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2060 | 309,317,472円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2050 | 197,083,804円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2040 | 372,094,171円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2030 | 169,589,950円 |
| ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定) | 13,880,206,106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) | 25,302,789円 |
| ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(安定型) | 34,366円 |
| ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(積極型) | 75,807円 |
| F Wニッセイ国内株インデックス | 68,973,915円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2065 | 75,173,314円 |
| D Cニッセイ全世界株式インデックスコレクト | 1,691,941円 |

損益の状況

当期 (2023年2月21日~2024年2月20日)

| 項目 | 当期 |
|--------------------------|-------------------------|
| (A)配当等収益 | 4,707,912,660円 |
| 受取配当金 | 4,701,904,210 |
| 受取利息 | 101,590 |
| その他収益 | 7,843,432 |
| 支払利息 | △ 1,936,572 |
| (B)有価証券売買損益 | 52,294,376,005 |
| 売買益 | 56,656,806,815 |
| 売買損 | △ 4,362,430,810 |
| (C)先物取引等損益 | 1,223,645,000 |
| 取引益 | 1,532,014,850 |
| 取引損 | △ 308,369,850 |
| (D)信託報酬等 | △ 86,233 |
| (E)当期損益金(A+B+C+D) | 58,225,847,432 |
| (F)前期繰越損益金 | 106,208,290,354 |
| (G)追加信託差損益金 | 33,039,622,448 |
| (H)解約差損益金 | △ 45,407,908,396 |
| (I)合計(E+F+G+H) | 152,065,851,838 |
| 次期繰越損益金(I) | 152,065,851,838 |

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 34 期

(計算期間：2024年5月21日～2024年11月20日)

運用方針

主に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・ 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

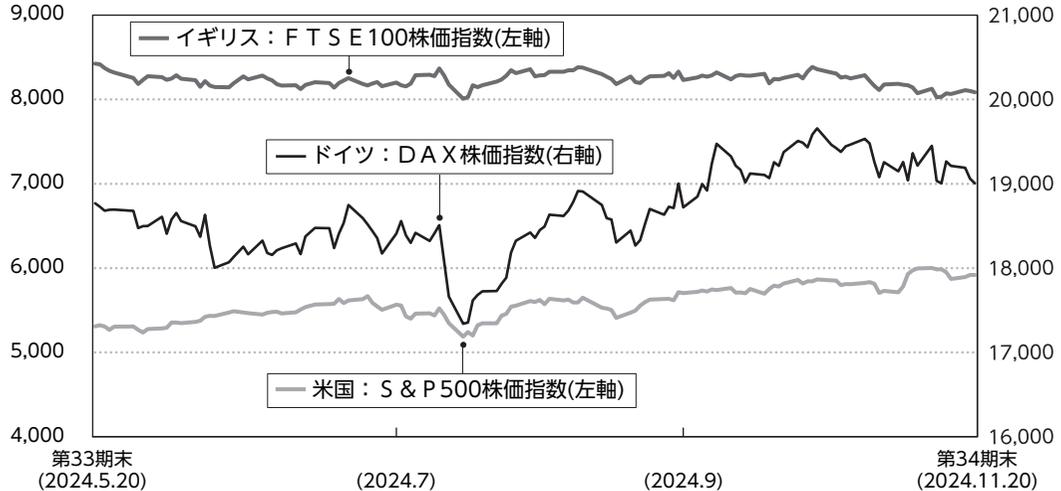
運用経過

2024年5月21日～2024年11月20日

投資環境

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



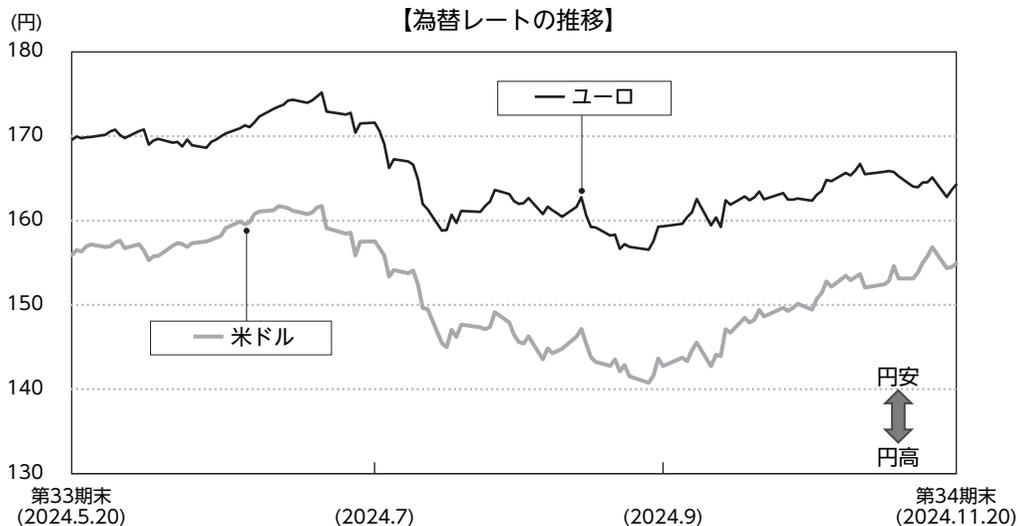
(注) FactSetのデータを使用しています。

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

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

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

■為替市況



(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、期初以降、堅調な米経済指標が続いたことや日銀の利上げ観測・FRB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、大きく米ドル高円安に転じました。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高円安となりました。9月下旬以降は自民党総裁選で石破氏が勝利し10月の衆院選で連立与党が過半数の議席数を確保できなかったことで政治の不透明感が高まったこと、さらにユーロ圏実質域内総生産（GDP）が市場予想を上回るなど欧州域内の経済指標が堅調であったことなどから再びユーロ高円安推移となり、結局、期を通じて見るとややユーロ高円安で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 期中 | 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 |
|-----------------|--------|------|------------|------|------------|------------|--------------------|
| | | % | | % | | | |
| (期首)2024年5月20日 | 45,829 | — | 44,477 | — | 95.8 | 2.1 | 1.8 |
| 5月末 | 45,403 | △0.9 | 44,062 | △0.9 | 95.2 | 2.8 | 1.7 |
| 6月末 | 48,165 | 5.1 | 46,742 | 5.1 | 95.0 | 3.1 | 1.7 |
| 7月末 | 45,492 | △0.7 | 44,140 | △0.8 | 96.0 | 2.0 | 1.9 |
| 8月末 | 44,712 | △2.4 | 43,368 | △2.5 | 94.9 | 3.1 | 1.9 |
| 9月末 | 45,237 | △1.3 | 43,869 | △1.4 | 95.8 | 2.2 | 1.9 |
| 10月末 | 48,661 | 6.2 | 47,195 | 6.1 | 95.3 | 2.8 | 1.9 |
| (期末)2024年11月20日 | 49,611 | 8.3 | 48,122 | 8.2 | 95.2 | 2.7 | 1.8 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2024年5月21日～2024年11月20日

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-----------------|-----|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 売買委託手数料 (株式) | 0円 | 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 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 |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| 有価証券取引税 (株式) | 1 | 0.002 | 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 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 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| その他費用 (保管費用) | 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 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| | | | ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 4 | 0.008 | |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（46,488円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2024年5月21日～2024年11月20日

(1) 株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

(2) 投資信託証券

| 銘柄 | 買付 | | 売付 | |
|------------------------------|-------|------|-------|------|
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| (アメリカ) | 千□ | 千米ドル | 千□ | 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 | — | — |
| 外国 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 | — | — |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 32 | (△ 3) 66 | — | — |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | — | (△0.591) — | 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 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| MICROSOFT CORP | 33 | 2,137,129 | 63,148 | CRH PLC | 73 | 914,769 | 12,448 |
| APPLE INC | 56 | 1,862,757 | 32,713 | FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 19 | 599,094 | 30,946 |
| NVIDIA CORP | 59 | 1,829,603 | 30,515 | SMURFIT WESTROCK PLC | 27 | 191,430 | 6,859 |
| AMAZON.COM INC | 51 | 1,409,990 | 27,214 | RTX CORPORATION | 10 | 178,017 | 17,364 |
| CRH PLC | 76 | 1,001,264 | 13,158 | GENERAL MOTORS CO | 21 | 157,366 | 7,246 |
| META PLATFORMS INC-A | 8 | 615,447 | 72,277 | BORGWARNER INC | 24 | 143,047 | 5,743 |
| ALPHABET INC-CL A | 24 | 608,792 | 25,363 | HASBRO INC | 13 | 134,739 | 9,628 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 19 | 596,710 | 30,317 | GLOBE LIFE INC | 9 | 132,536 | 13,329 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 7 | 525,284 | 67,499 | FMC CORP | 13 | 130,121 | 9,816 |
| ELI LILLY & CO | 3 | 510,535 | 128,598 | CAESARS ENTERTAINMENT INC | 23 | 126,895 | 5,372 |

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

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

組入有価証券明細表

2024年11月20日現在

(1) 外国株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|--------------------------------|---------|--------|-------------|-----------|------------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | | |
| THOMSON REUTERS CORP | 168 | 174 | 3,925 | 435,674 | 商業・専門サービス | |
| TMX GROUP LTD | 297 | 309 | 1,345 | 149,355 | 金融サービス | |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | 88 | 92 | 1,067 | 118,437 | 資本財 | |
| TORONTO-DOMINION BANK | 1,882 | 1,938 | 15,113 | 1,677,317 | 銀行 | |
| TOURMALINE OIL CORP | 354 | 371 | 2,327 | 258,320 | エネルギー | |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 59 | 61 | 796 | 88,343 | 素材 | |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 480 | 502 | 4,389 | 487,165 | 素材 | |
| WSP GLOBAL INC | 133 | 138 | 3,323 | 368,887 | 資本財 | |
| 小計 | 株数・金額 | 42,218 | 45,163 | 335,896 | 37,277,832 | |
| | 銘柄数<比率> | 84 | 83 | - | <3.2%> | |
| (オーストラリア) | | | 千オーストラリア・ドル | | | |
| AMPOL LTD | 251 | 263 | 771 | 78,173 | エネルギー | |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 3,186 | 3,332 | 10,778 | 1,091,878 | 銀行 | |
| APA GROUP | 1,362 | 1,427 | 1,021 | 103,507 | 公益事業 | |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 613 | 628 | 4,334 | 439,045 | 消費者サービス | |
| ASX LTD | 205 | 214 | 1,438 | 145,713 | 金融サービス | |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 1,946 | - | - | - | 運輸 | |
| BHP GROUP LIMITED | 5,370 | 5,616 | 22,640 | 2,293,471 | 素材 | |
| BLUESCOPE STEEL LTD | 471 | 486 | 1,026 | 104,018 | 素材 | |
| BRAMBLES LTD | 1,472 | 1,542 | 3,023 | 306,270 | 商業・専門サービス | |
| CARSALLES.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 銘柄数<比率> | 76,494 26 | 74,545 23 | 255,024 — | 5,074,996 <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 | |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 942 | 983 | 510 | 59,109 | 公益事業 | |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 1,575 | 1,648 | 1,046 | 121,245 | 運輸 | |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 907 | 949 | 1,147 | 132,930 | 金融サービス | |
| SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD | 1,654 | 1,729 | 791 | 91,747 | 資本財 | |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 8,858 | 8,308 | 2,683 | 310,908 | 電気通信サービス | |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 1,339 | 1,400 | 5,100 | 590,909 | 銀行 | |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|------------------------------|------------------|---------------|---------------|--------------|----------------------|--------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| (イギリス) | | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| RELX PLC | | 1,997 | 2,067 | 7,376 | 1,450,167 | 商業・専門サービス |
| RENTOKIL INITIAL PLC | | 2,674 | 2,797 | 1,130 | 222,268 | 商業・専門サービス |
| RIO TINTO PLC | | 1,192 | 1,248 | 6,109 | 1,201,105 | 素材 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | | 8,917 | 9,417 | 4,968 | 976,804 | 資本財 |
| SAGE GROUP PLC | | 1,079 | 1,110 | 1,195 | 235,054 | ソフトウェア・サービス |
| SAINSBURY (J) PLC | | 1,755 | 1,830 | 454 | 89,402 | 生活必需品流通・小売り |
| SCHRODERS PLC | | 853 | 896 | 278 | 54,784 | 金融サービス |
| SEVERN TRENT PLC | | 285 | 299 | 804 | 158,126 | 公益事業 |
| SHELL PLC-NEW | | 6,889 | 6,978 | 17,951 | 3,529,249 | エネルギー |
| SMITH & NEPHEW PLC | | 925 | 968 | 956 | 188,065 | ヘルスケア機器・サービス |
| SMITHS GROUP PLC | | 367 | 381 | 645 | 126,944 | 資本財 |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | | 78 | 81 | 534 | 105,008 | 資本財 |
| SSE PLC | | 1,157 | 1,209 | 2,071 | 407,242 | 公益事業 |
| ST JAMES'S PLACE PLC | | 583 | - | - | - | 金融サービス |
| STANDARD CHARTERED PLC | | 2,398 | 2,400 | 2,273 | 446,987 | 銀行 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | | 3,747 | 3,925 | 510 | 100,321 | 耐久消費財・アパレル |
| TESCO PLC | | 7,469 | 7,664 | 2,666 | 524,235 | 生活必需品流通・小売り |
| UNILEVER PLC | | 2,649 | 2,763 | 12,591 | 2,475,415 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | | 721 | 755 | 828 | 162,825 | 公益事業 |
| VODAFONE GROUP PLC | | 24,812 | 25,329 | 1,790 | 352,070 | 電気通信サービス |
| WHITBREAD PLC | | 197 | 199 | 575 | 113,054 | 消費者サービス |
| WISE PLC - A | | 651 | 737 | 617 | 121,343 | 金融サービス |
| WPP PLC | | 1,139 | 1,194 | 974 | 191,592 | メディア・娯楽 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 290,402 82 | 298,493 76 | 208,589 - | 41,008,667 <3.5%> | |
| (イスラエル) | | | | 千イスラエル・シケル | | |
| AZRIELI GROUP | | 45 | 47 | 1,362 | 56,404 | 不動産管理・開発 |
| BANK 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 銘柄数<比率> | 5,395 8 | 5,636 8 | 28,781 - | 1,191,214 <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 |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | 139 | 142 | 5,069 | 72,036 | 金融サービス |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 153 | 167 | 5,936 | 84,360 | 金融サービス |
| INDUTRADE AB | 289 | 302 | 8,252 | 117,272 | 資本財 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|-----------------------------|------------------|-------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| (ユーロ/ベルギー) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| D'IETTEREN GROUP | | 22 | 23 | 461 | 75,825 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ELIA GROUP SA/NV | | 31 | 32 | 272 | 44,750 | 公益事業 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | | 92 | 92 | 596 | 98,048 | 金融サービス |
| KBC GROEP NV | | 265 | 254 | 1,790 | 294,179 | 銀行 |
| LOTUS BAKERIES | | 0.44 | 0.45 | 513 | 84,418 | 食品・飲料・タバコ |
| SOFINA | | 16 | 17 | 369 | 60,730 | 金融サービス |
| 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 銘柄数<比率> | 2,014 | 1,879 | 16,523 | 2,714,348 | |
| | | 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 銘柄数<比率> | 1,039 | 1,040 | 2,151 | 353,477 | |
| | | 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 |
| WORLDLINE 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 |
| BRENNTAG SE | 140 | 143 | 839 | 137,869 | 資本財 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 42 | 44 | 255 | 41,991 | ヘルスケア機器・サービス |
| COMMERZBANK AG | 1,114 | 1,114 | 1,787 | 293,694 | 銀行 |
| CONTINENTAL AG | 116 | 121 | 750 | 123,320 | 自動車・自動車部品 |
| COVESTRO AG | 200 | 209 | 1,199 | 196,978 | 素材 |
| CTS EVENTIM AG & CO KGAA | - | 69 | 625 | 102,795 | メディア・娯楽 |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 566 | 546 | 1,970 | 323,624 | 資本財 |
| DELIVERY HERO SE | 187 | 205 | 742 | 121,997 | 消費者サービス |
| DEUTSCHE BANK AG | 2,051 | 2,097 | 3,334 | 547,735 | 金融サービス |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 201 | 210 | 4,449 | 730,855 | 金融サービス |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG | 631 | 662 | 414 | 68,167 | 運輸 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG | 3,451 | 3,881 | 11,146 | 1,831,015 | 電気通信サービス |
| DHL GROUP | 1,050 | 1,129 | 3,968 | 651,934 | 運輸 |
| DR ING HC F PORSCHE AG | 120 | 126 | 771 | 126,735 | 自動車・自動車部品 |
| E.ON SE | 2,377 | 2,484 | 2,896 | 475,839 | 公益事業 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 247 | 285 | 499 | 82,057 | 素材 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 447 | 467 | 1,531 | 251,639 | ヘルスケア機器・サービス |
| GEA GROUP AG | 173 | 171 | 779 | 128,075 | 資本財 |
| HANNOVER RUECK SE | 63 | 66 | 1,591 | 261,476 | 保険 |
| HEIDELBERG MATERIALS AG | 137 | 150 | 1,783 | 292,993 | 素材 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 110 | 115 | 816 | 134,175 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HENKEL KGAA-VORZUG | 178 | 186 | 1,469 | 241,395 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 1,383 | 1,446 | 4,208 | 691,272 | 半導体・半導体製造装置 |
| KNORR-BREMSE AG | 76 | 80 | 582 | 95,730 | 資本財 |
| LEG IMMOBILIEN SE | 78 | 82 | 686 | 112,849 | 不動産管理・開発 |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 850 | 829 | 4,385 | 720,330 | 自動車・自動車部品 |
| MERCK KGAA | 136 | 143 | 1,998 | 328,370 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG | 57 | 59 | 1,838 | 301,938 | 資本財 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|-----------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (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 | |
| NEMETSCHKE 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 54 | 26,338 54 | 152,357 - | 25,027,791 <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 5 | 4,651 4 | 2,912 - | 478,426 <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 17 | 50,474 17 | 47,658 - | 7,828,783 <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 21 | 53,406 21 | 39,515 - | 6,491,254 <0.6%> |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|---------------------------------------|------------------|--------------------|--------------------|--------------|--------------------------|------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| (ユーロ/フィンランド) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ELISA OYJ | | 156 | 162 | 701 | 115,200 | 電気通信サービス |
| FORTUM OYJ | | 475 | 495 | 686 | 112,812 | 公益事業 |
| KESKO OYJ-B SHS | | 289 | 302 | 578 | 95,060 | 生活必需品流通・小売り |
| KONE OYJ | | 360 | 376 | 1,832 | 301,046 | 資本財 |
| METSO CORPORATION | | 703 | 688 | 555 | 91,226 | 資本財 |
| NESTE OYJ | | 448 | 468 | 640 | 105,215 | エネルギー |
| NOKIA OYJ | | 5,647 | 5,905 | 2,344 | 385,110 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| NORDEA BANK ABP | | 3,363 | 3,494 | 3,747 | 615,583 | 銀行 |
| ORION OYJ-CLASS B | | 114 | 119 | 532 | 87,445 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SAMPO OYJ | | 477 | 499 | 1,985 | 326,094 | 保険 |
| STORA ENSO OYJ | | 616 | 643 | 614 | 100,917 | 素材 |
| UPM-KYMMENE OYJ | | 565 | 591 | 1,513 | 248,694 | 素材 |
| WARTSILA OYJ | | 500 | 555 | 986 | 162,040 | 資本財 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 13,717 13 | 14,303 13 | 16,719 - | 2,746,447 <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 銘柄数<比率> | 715 4 | 731 4 | 3,336 - | 548,008 <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 銘柄数<比率> | 1,755 2 | 1,719 2 | 1,840 - | 302,275 <0.0%> | |
| ユーロ計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 190,048 218 | 202,361 213 | 549,634 - | 90,288,523 <7.7%> | |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,146,347 1,194 | 1,215,858 1,160 | - - | 1,119,567,964 <95.2%> | |

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

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

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

(注4) 業種はG I C S分類（産業グループ）によるものです。なお、G I C Sに関する知的財産所有権はS & PおよびMSCI Inc.に帰属します。

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 | | |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------|
| | □数 | □数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (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 | □数・金額 | 1,276 | 1,345 | 121,486 | 18,819,497 |
| | 銘柄数<比率> | 33 | 33 | - | <1.6%> |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | | 期首(前期末) | | 当期末 | | |
|----------------------------------|---------|---------|-------|--------|-----------|-------------|
| | | □数 | □数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | | | 千□ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千円 |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | | 8 | 9 | 414 | 46,043 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | | 16 | — | — | — | |
| 小計 | □数・金額 | 25 | 9 | 414 | 46,043 | |
| | 銘柄数<比率> | 2 | 1 | — | <0.0%> | |
| (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 | □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 | □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 | □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 | □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 | □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 | |
|---------------------------|---------|---------|-------|-------|------------|
| | | □数 | □数 | 評価額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (ユーロ/フランス) | | 千□ | 千□ | 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 | □数・金額 | 45 | 48 | 2,463 | 404,652 |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 4 | — | <0.0%> |
| ユーロ計 | □数・金額 | 64 | 67 | 2,869 | 471,373 |
| | 銘柄数<比率> | 5 | 5 | — | <0.0%> |
| 合計 | □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) □数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、□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 |
| | 百万円 | 百万円 |
| 外国 S&P 500 EMINI FUTURE | 23,827 | — |
| FTSE 100 | 2,331 | — |
| DJ EURO STOXX 50 | 5,797 | — |

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日現在)

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

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

損益の状況

当期 (2024年5月21日~2024年11月20日)

| 項目 | 当期 |
|-------------------------|------------------|
| (A)配 当 等 収 益 | 8,156,237,986円 |
| 受 取 配 当 金 | 7,735,425,708 |
| 受 取 そ の 他 利 益 | 86,586,623 |
| 受 取 そ の 他 収 益 | 334,225,655 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 79,781,133,956 |
| 売 買 損 益 | 135,108,083,041 |
| 売 買 損 益 | △ 55,326,949,085 |
| (C)先 物 取 引 等 損 益 | 1,292,973,123 |
| 取 引 損 益 | 2,026,674,224 |
| 取 引 損 益 | △ 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) (E)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。
- (注3) (H)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 7 期

(計算期間：2023年11月21日～2024年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）

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

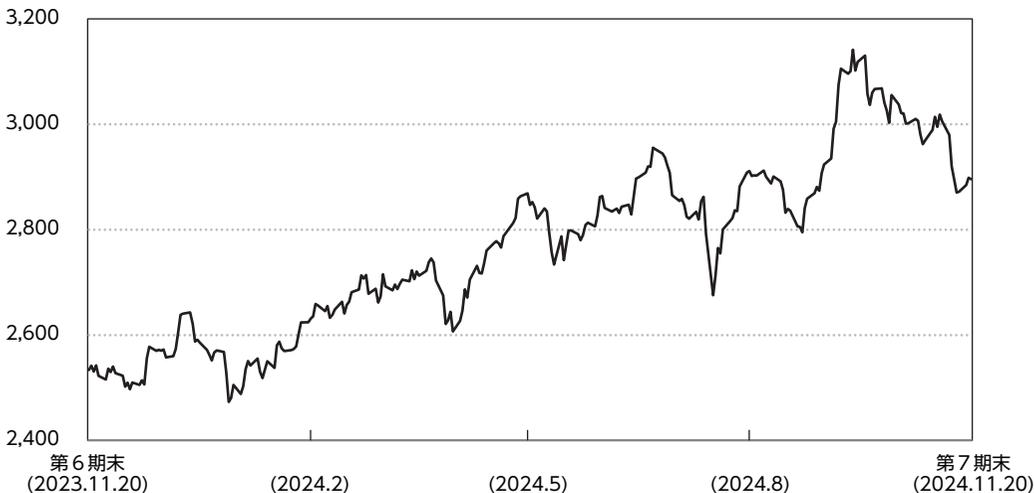
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年11月21日～2024年11月20日

海外株式市況

【MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】

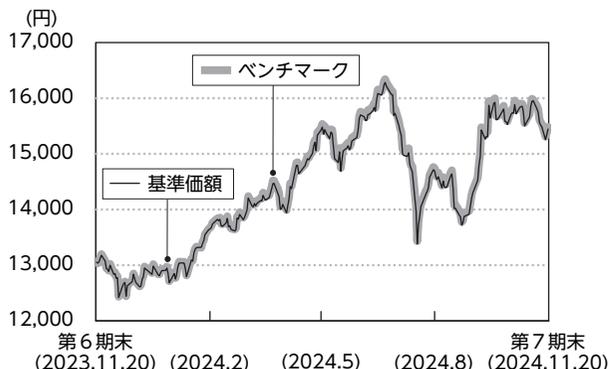


(注) FactSetのデータを使用しています。

新興国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、米長期金利の低下見通しを背景に上昇して始まったものの、その後は中国経済の健全性を巡る懸念や堅調な米国労働市場を受けた利下げ観測の後退を背景に株価は一進一退の展開となりました。2024年2月から6月にかけては中国の景気刺激策や米半導体企業の好決算が好感され株価は上昇基調となりました。7月から9月にかけては中国や米国における経済成長減速の懸念等から下落する場面もありましたが、FRBの利下げや中国当局の追加的な金融緩和と不動産・株式市場に対する一連の支援策への期待感を背景に株価は反発しました。10月以降は中国における政策の不透明性や中東情勢の悪化懸念、米国の堅調な雇用統計を受けた大幅利下げ観測の後退による投資家のリスク回避姿勢の高まりから株価は下落基調に転じて当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・ 2024年2月から7月上旬にかけて、インドの経済成長への期待感や台湾の半導体需要拡大による堅調な業績を背景に株価が上昇したこと
- ・ 9月中旬から下旬にかけて、米連邦準備制度理事会（F R B）の利下げや中国当局の追加的な金融緩和と不動産・株式市場に対する一連の支援策への期待感を背景に株価が上昇したこと

<下落要因>

- ・ 2024年7月中旬から8月上旬にかけて、予想を下回る経済指標を受けた中国経済への懸念の再燃や米国の対半導体規制強化の検討によるハイテク銘柄の下落が重な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
- ・ 9月上旬に中国や米国の市場予想より軟調な経済指標の公表を受けた経済成長減速に対する懸念の高まりから株価が下落したこと

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+18.3%となり、ベンチマーク騰落率（+18.6%）におおむね連動しました。

今後の運用方針

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

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 | 債券 組入比率 | 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 |
| 3期(2020年11月20日) | 10,400 | 11.2 | 11,393 | 11.1 | 92.3 | 3.5 | - | 4.0 | 2,353 |
| 4期(2021年11月22日) | 12,243 | 17.7 | 13,481 | 18.3 | 86.1 | 8.1 | 0.0 | 5.6 | 4,467 |
| 5期(2022年11月21日) | 11,479 | △ 6.2 | 12,677 | △ 6.0 | 81.4 | 11.1 | - | 7.2 | 5,428 |
| 6期(2023年11月20日) | 13,051 | 13.7 | 14,414 | 13.7 | 79.6 | 13.7 | - | 6.6 | 9,289 |
| 7期(2024年11月20日) | 15,442 | 18.3 | 17,102 | 18.6 | 82.8 | 10.8 | - | 6.3 | 15,241 |

(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 | 債券 組入比率 | 投資信託 証券 組入比率 |
|------------------|--------|-------|------------|-------|------------|------------|------------|--------------------|
| | | % | | % | | | | |
| (期首) 2023年11月20日 | 13,051 | - | 14,414 | - | 79.6 | 13.7 | - | 6.6 |
| 11月末 | 12,884 | △ 1.3 | 14,247 | △ 1.2 | 78.9 | 14.6 | - | 6.4 |
| 12月末 | 12,946 | △ 0.8 | 14,327 | △ 0.6 | 85.5 | 7.5 | - | 7.0 |
| 2024年 1月末 | 12,931 | △ 0.9 | 14,303 | △ 0.8 | 82.9 | 9.9 | - | 7.1 |
| 2月末 | 13,708 | 5.0 | 15,179 | 5.3 | 81.1 | 11.9 | - | 6.9 |
| 3月末 | 14,105 | 8.1 | 15,624 | 8.4 | 86.7 | 6.1 | - | 7.1 |
| 4月末 | 14,791 | 13.3 | 16,389 | 13.7 | 84.3 | 8.8 | - | 6.7 |
| 5月末 | 14,911 | 14.3 | 16,518 | 14.6 | 80.6 | 13.2 | - | 6.0 |
| 6月末 | 15,706 | 20.3 | 17,432 | 20.9 | 84.4 | 9.5 | - | 6.0 |
| 7月末 | 14,797 | 13.4 | 16,423 | 13.9 | 81.3 | 12.4 | - | 6.1 |
| 8月末 | 14,402 | 10.4 | 15,970 | 10.8 | 79.2 | 14.9 | - | 5.8 |
| 9月末 | 15,264 | 17.0 | 16,930 | 17.5 | 86.6 | 6.9 | - | 6.3 |
| 10月末 | 15,758 | 20.7 | 17,462 | 21.1 | 84.4 | 9.3 | - | 6.3 |
| (期末) 2024年11月20日 | 15,442 | 18.3 | 17,102 | 18.6 | 82.8 | 10.8 | - | 6.3 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年11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 | 3円 | 0.023% | |
| (株式) | (2) | (0.013) | 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) | (1) | (0.010) | 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) | (0.001) | |
| 有価証券取引税 | 3 | 0.020 | |
| (株式) | (3) | (0.020) | 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 | 21 | 0.145 | 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) | (17) | (0.120) | 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) | (4) | (0.025) | ・ 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 | 27 | 0.188 | |

(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（14,386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11月21日～2024年11月20日

(1) 株式

| | 買付 | | 売付 | | |
|----|--------|---------------------|------------------------------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 | |
| 外国 | アメリカ | 百株 715 (△ 16) | 千米ドル 1,431 (0.000) | 百株 262 | 千米ドル 241 |
| | 香港 | 27,358 (68) | 千香港ドル 38,949 (△ 6) | 7,123 | 千香港ドル 2,505 |
| | 台湾 | 11,890 (286) | 千台湾ドル 140,502 (△ 183) | 501 | 千台湾ドル 3,486 |
| | イギリス | — (△ 19) | 千イギリス・ポンド — (△ 0.000) | — | 千イギリス・ポンド — |
| | トルコ | 274 (1,235) | 千トルコ・リラ 5,555 | 91 | 千トルコ・リラ 174 |
| | メキシコ | 1,827 | 千メキシコ・ペソ 10,586 (△ 30) | 140 | 千メキシコ・ペソ 154 |
| | フィリピン | 245 | 千フィリピン・ペソ 7,233 | 63 | 千フィリピン・ペソ 219 |
| | チリ | 21,227 | 千チリ・ペソ 69,659 | 931 | 千チリ・ペソ 6,611 |
| | コロンビア | 52 | 千コロンビア・ペソ 100,102 | — | 千コロンビア・ペソ — |
| | インド | 11,571 (619) | 千インド・ルピー 507,917 | 98 | 千インド・ルピー 3,369 |
| | インドネシア | 13,671 (3) | 千インドネシア・ルピア 7,348,130 | 2,433 | 千インドネシア・ルピア 299,872 |

ニッセイ新興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 | ブラジル | 百株 2,648 (47) | 千ブラジル・レアル 7,018 (△ 2) | 百株 288 | 千ブラジル・レアル 442 |
| | チェコ | 8 | 千チェコ・コルナ 643 | — | 千チェコ・コルナ — |
| | 韓国 | 542 (12) | 千韓国ウォン 4,164,657 (△ 435) | 67 | 千韓国ウォン 158,308 |
| | 中国 | 5,165 (38) | 千人民元 7,348 | 1,891 | 千人民元 1,058 |
| | マレーシア | 3,875 (15) | 千マレーシア・リンギット 2,044 | 168 | 千マレーシア・リンギット 63 |
| | 南アフリカ | 770 | 千南アフリカ・ランド 13,468 (△ 60) | 6 | 千南アフリカ・ランド 118 |
| | タイ | 7,639 (△ 2) | 千タイ・バーツ 13,813 | 4,577 | 千タイ・バーツ 3,879 |
| | ポーランド | 145 | 千ポーランド・ズロチ 968 | 25 | 千ポーランド・ズロチ 48 |
| | ハンガリー | 16 | 千ハンガリー・フォリント 17,965 | — | 千ハンガリー・フォリント — |
| | ユーロ ギリシャ | 372 | 千ユーロ 119 (△ 0.516) | 5 | 千ユーロ 12 |

(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。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。

ニッセイ新興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 |
| ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF | 26 | 386 | — | — |
| ISHARES MSCI QATAR CP ETF | 12 | 219 | — | — |
| ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | 28 | 1,171 | — | — |
| ISHARES MSCI KUWAIT ETF | 5 | 170 | — | — |
| 外国 (メキシコ) | | 千メキシコ・ペソ | | 千メキシコ・ペソ |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 22 | 513 | — | — |
| PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA | 8 | (△) 20 620 | 8 | 528 |
| | (0.191) | | | |
| (南アフリカ) | | 千南アフリカ・ランド | | 千南アフリカ・ランド |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | — | — | 19 | 207 |

(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。

(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 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | 7,354 | 6,961 | — | — |

(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

2023年11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 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 83 | 297,334 | 3,582 | ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 4 | 14,522 | 3,059 |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 21 | 136,350 | 6,462 | NIO INC - ADR | 16 | 9,766 | 576 |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 16 | 132,552 | 8,237 | LOJAS RENNER S.A. | 13 | 5,962 | 446 |
| HDFC BANK LTD | 26 | 73,888 | 2,801 | CGN POWER CO LTD-A | 49 | 4,799 | 96 |
| NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A | 34 | 72,664 | 2,137 | LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG | 154 | 4,522 | 29 |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 42 | 60,769 | 1,423 | CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A | 38 | 4,407 | 115 |
| PDD HOLDINGS INC(ADR) | 3 | 54,959 | 17,174 | CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 276 | 4,264 | 15 |
| RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | 10 | 52,760 | 5,026 | YANDEX NV-A | 1 | 4,218 | 3,208 |
| ICICI BANK LTD | 17 | 34,401 | 1,936 | POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU | 32 | 3,927 | 122 |
| SK HYNIX INC | 1 | 34,367 | 18,212 | PARADE TECHNOLOGIES LTD | 1 | 3,790 | 3,790 |

(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 | |
| AUTOHOME INC-ADR | 5 | 5 | 14 | 2,254 | メディア・娯楽 |
| CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 5 | 22 | 27 | 4,313 | 素材 |
| CREDICORP LTD | 4 | 6 | 134 | 20,830 | 銀行 |
| DAQO NEW ENERGY CORP-ADR | 4 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| H WORLD GROUP LIMITED(ADR) | 14 | 22 | 82 | 12,851 | 消費者サービス |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL-B | 99 | 99 | 21 | 3,373 | エネルギー |
| INTER & CO INC - CL A | — | 33 | 18 | 2,862 | 銀行 |
| IQIYI INC-ADR | 32 | 32 | 6 | 1,036 | メディア・娯楽 |
| JOYY INC | 3 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| KANZHUN LTD | 19 | 33 | 44 | 6,947 | メディア・娯楽 |
| KE HOLDINGS INC | 52 | 68 | 142 | 22,047 | 不動産管理・開発 |
| LEGEND BIOTECH CORP-ADR | 5 | 5 | 21 | 3,372 | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LUFAX HOLDING LTD | 59 | — | — | — | 金融サービス |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR | 18 | 18 | 0.000 | 0.027 | エネルギー |
| MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR | 7 | — | — | — | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO | 29 | 29 | 0.000 | 0.044 | 電気通信サービス |
| NIO INC - ADR | 113 | — | — | — | 自動車・自動車部品 |
| NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S | 4 | 4 | 0.000 | 0.006 | エネルギー |
| NOVOLIPET STEEL-GDR REG S | 7 | 7 | 0.000 | 0.010 | 素材 |
| NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A | — | 340 | 457 | 70,893 | 銀行 |
| OZON HOLDINGS PLC - ADR | 3 | 3 | 0.000 | 0.004 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| PAGSEGURO DIGITAL LTD-CL A | — | 24 | 18 | 2,810 | 金融サービス |
| PDD HOLDINGS INC(ADR) | 47 | 79 | 934 | 144,762 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| PHOSAGRO PJSC-GDR REG S | 5 | 5 | 0.000 | 0.007 | 素材 |
| PJSC GAZPROM ADR | 279 | 279 | 0.003 | 0.432 | エネルギー |
| PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR | 27 | 27 | 0.000 | 0.041 | 素材 |
| POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | — | 19 | 0.000 | 0.029 | 素材 |
| POLYUS PJSC-REG S-GDR | 4 | 4 | 0.000 | 0.006 | 素材 |
| QIFU TECHNOLOGY INC(ADR) | 5 | 18 | 58 | 9,024 | 金融サービス |
| ROSNEFT OJSC-GDR | 54 | 54 | 0.001 | 0.083 | エネルギー |
| SBERBANK OF RUSSIA | 498 | 498 | 0.005 | 0.771 | 銀行 |
| SEVERSTAL PAO - GDR REG S | 13 | 13 | 0.000 | 0.020 | 素材 |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B | 43 | 51 | 8 | 1,316 | ソフトウェア・サービス |
| SOUTHERN COPPER CORP | 7 | 11 | 117 | 18,279 | 素材 |

ニッセイ新興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 | |
| STONECO LTD-A | — | 30 | 27 | 4,312 | 金融サービス |
| SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR | 51 | 51 | 0.001 | 0.079 | エネルギー |
| TAL EDUCATION GROUP- ADR | 28 | 45 | 44 | 6,945 | 消費者サービス |
| TATNEFT-SPONSORED ADR | 12 | 12 | 0.000 | 0.018 | エネルギー |
| TCS GROUP HOLDING-GDR REG S | 5 | 5 | 0.000 | 0.007 | 銀行 |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 59 | 85 | 95 | 14,807 | メディア・娯楽 |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR | 26 | 43 | 57 | 8,884 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| VK COMPANY LTD-GDR | 3 | 3 | 0.000 | 0.004 | メディア・娯楽 |
| VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI | 66 | 66 | 0.001 | 0.102 | 銀行 |
| WEIBO CORP-SPON ADR | 3 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | 4 | 4 | 0.000 | 0.006 | 生活必需品流通・小売り |
| XP INC - CLASS A | — | 45 | 75 | 11,627 | 金融サービス |
| YANDEX NV-A | 13 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| YUM CHINA HOLDINGS INC | 34 | 41 | 195 | 30,308 | 消費者サービス |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 33 | — | — | — | 運輸 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,818 43 | 2,254 41 | 2,607 — | 403,864 <2.6%> |
| (香港) | | | 千香港ドル | | |
| 3SBIO INC | 155 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 35 | 100 | 300 | 5,970 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 2,170 | 3,390 | 1,325 | 26,377 | 銀行 |
| AIR CHINA LIMITED-H | 100 | — | — | — | 運輸 |
| AKESO INC | 40 | 80 | 512 | 10,204 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 1,312 | 1,739 | 14,824 | 295,017 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 520 | 520 | 198 | 3,942 | 生活必需品流通・小売り |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 240 | 240 | 119 | 2,378 | 素材 |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 115 | 230 | 493 | 9,817 | 素材 |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 7 | 7 | 82 | 1,643 | 食品・飲料・タバコ |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 108 | 166 | 1,342 | 26,707 | 耐久消費財・アパレル |
| AVICHINA INDUSTRY & TECH-H | 40 | 40 | 16 | 319 | 資本財 |
| BAIDU INC-CLASS A | 186 | 248 | 2,067 | 41,134 | メディア・娯楽 |
| BANK OF CHINA LTD - H | 6,180 | 9,350 | 3,487 | 69,402 | 銀行 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 770 | 1,100 | 650 | 12,936 | 銀行 |
| BEIGENE LTD | 58 | 86 | 972 | 19,355 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H | 40 | — | — | — | 運輸 |

ニッセイ新興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 | |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS | 45 | 45 | 111 | 2,216 | 公益事業 |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 160 | 160 | 35 | 700 | 公益事業 |
| BILIBILI INC-CLASS Z | 19 | 19 | 281 | 5,608 | メディア・娯楽 |
| BOC AVIATION LTD | 19 | 19 | 115 | 2,308 | 資本財 |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD | 160 | 580 | 255 | 5,078 | 耐久消費財・アパレル |
| BYD CO LTD | 80 | 125 | 3,357 | 66,814 | 自動車・自動車部品 |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 65 | 65 | 196 | 3,912 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| C&D INTERNATIONAL INVESTMENT | 60 | 60 | 84 | 1,690 | 不動産管理・開発 |
| CGN POWER CO LTD-H | 650 | 1,370 | 383 | 7,633 | 公益事業 |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 280 | - | - | - | 金融サービス |
| CHINA CITIC BANK | 770 | 1,170 | 593 | 11,804 | 銀行 |
| CHINA COAL ENERGY CO - H | 200 | 200 | 191 | 3,812 | エネルギー |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 80 | 80 | 32 | 651 | 資本財 |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 85 | - | - | - | 資本財 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 7,690 | 11,180 | 6,730 | 133,934 | 銀行 |
| CHINA COSCO HOLDINGS-H | 301 | 301 | 358 | 7,127 | 運輸 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 120 | 120 | 33 | 663 | 銀行 |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD | 150 | - | - | - | 商業・専門サービス |
| CHINA FEIHE LTD | 320 | 320 | 183 | 3,642 | 食品・飲料・タバコ |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 115 | 515 | 385 | 7,665 | 金融サービス |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 268 | 268 | 171 | 3,413 | 公益事業 |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 140 | 380 | 449 | 8,953 | 素材 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 132 | 132 | 185 | 3,698 | 金融サービス |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP | 560 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 620 | 870 | 1,357 | 27,008 | 保険 |
| CHINA LITERATURE LTD | 36 | 36 | 92 | 1,844 | メディア・娯楽 |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 320 | 320 | 215 | 4,292 | 公益事業 |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 80 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS | 20 | - | - | - | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 280 | 380 | 642 | 12,794 | 食品・飲料・タバコ |
| CHINA MERCHANTS BANK - H | 335 | 405 | 1,474 | 29,336 | 銀行 |
| CHINA MERCHANTS HLDGS INTL | 100 | 100 | 130 | 2,587 | 運輸 |
| CHINA MINSHENG BANKING-H | 559 | 559 | 176 | 3,515 | 銀行 |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 420 | 420 | 140 | 2,791 | 素材 |
| CHINA OILFIELD SERVICES-H | 120 | 120 | 85 | 1,700 | エネルギー |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 355 | 565 | 769 | 15,313 | 不動産管理・開発 |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD | 50 | - | - | - | 不動産管理・開発 |

ニッセイ新興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 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 222 | 328 | 834 | 16,611 | 保険 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 1,840 | 2,740 | 1,145 | 22,791 | エネルギー |
| CHINA PHARMACEUTICAL GROUP | 748 | 748 | 387 | 7,718 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 330 | 330 | 102 | 2,042 | 公益事業 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD - H | 280 | 280 | 109 | 2,184 | 資本財 |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS | 140 | 200 | 542 | 10,785 | 食品・飲料・タバコ |
| CHINA RESOURCES CEMENT | 180 | - | - | - | 素材 |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 82 | 82 | 230 | 4,577 | 公益事業 |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 260 | 445 | 1,063 | 21,164 | 不動産管理・開発 |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY | 44 | 100 | 301 | 5,989 | 不動産管理・開発 |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 180 | 180 | 97 | 1,941 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD | 160 | 260 | 474 | 9,447 | 公益事業 |
| CHINA RUYI HOLDINGS LTD | 520 | 520 | 106 | 2,121 | メディア・娯楽 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO - H | 260 | 415 | 1,373 | 27,335 | エネルギー |
| CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H | 140 | 140 | 92 | 1,844 | エネルギー |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 240 | - | - | - | 運輸 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 120 | 120 | 137 | 2,741 | 資本財 |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 66 | 300 | 378 | 7,522 | 保険 |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H | 6 | - | - | - | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CHINA TOWER CORP LTD-H | 4,020 | 4,020 | 410 | 8,159 | 電気通信サービス |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 60 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 138 | 138 | 90 | 1,809 | 不動産管理・開発 |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LTD | 120 | - | - | - | ソフトウェア・サービス |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 132 | 298 | 216 | 4,299 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CITIC LTD | 500 | 720 | 647 | 12,880 | 資本財 |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 165 | 165 | 370 | 7,371 | 金融サービス |
| CMOC GROUP LIMITED-H | 240 | 540 | 328 | 6,533 | 素材 |
| COSCO PACIFIC LTD | 60 | - | - | - | 運輸 |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 210 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| CRRC CORP LTD H | 340 | 790 | 381 | 7,593 | 資本財 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 180 | - | - | - | 自動車・自動車部品 |
| DONGYUE GROUP | 80 | - | - | - | 素材 |
| EAST BUY HOLDING LIMITED | 30 | - | - | - | 生活必需品流通・小売り |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 58 | 89 | 461 | 9,192 | 公益事業 |
| FAR EAST HORIZON LTD | 70 | 70 | 37 | 749 | 金融サービス |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD-H | 30 | - | - | - | 半導体・半導体製造装置 |
| FOSUN INTERNATIONAL | 170 | 170 | 73 | 1,464 | 資本財 |

ニッセイ新興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 | |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 32 | 80 | 430 | 8,557 | 自動車・自動車部品 |
| GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H | 22 | — | — | — | 素材 |
| GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD | 1,700 | 1,700 | 243 | 4,837 | 半導体・半導体製造装置 |
| GDS HOLDINGS LTD-CL A | 57 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 570 | 810 | 1,101 | 21,921 | 自動車・自動車部品 |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 100 | 100 | 106 | 2,121 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 48 | — | — | — | 金融サービス |
| GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD | — | 40 | 198 | 3,952 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 150 | 150 | 204 | 4,071 | 自動車・自動車部品 |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS | 115 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| GUANGDONG INVESTMENT LTD | 300 | 300 | 144 | 2,883 | 公益事業 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 196 | 196 | 65 | 1,294 | 自動車・自動車部品 |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 160 | 160 | 250 | 4,979 | 消費者サービス |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H | 180 | 254 | 689 | 13,723 | 耐久消費財・アパレル |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS | 50 | 50 | 101 | 2,019 | 資本財 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 100 | 100 | 69 | 1,385 | 金融サービス |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 80 | 200 | 343 | 6,829 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 45 | 45 | 101 | 2,023 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HISENSE HOME APPLIANCES GR-H | — | 60 | 141 | 2,823 | 耐久消費財・アパレル |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 30 | 30 | 62 | 1,250 | 半導体・半導体製造装置 |
| HUANENG POWER INTL INC-H | 140 | 500 | 208 | 4,139 | 公益事業 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 54 | 54 | 73 | 1,461 | 金融サービス |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C | 20 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| IND & COMM BK OF CHINA - H | 5,150 | 8,080 | 3,829 | 76,215 | 銀行 |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 90 | 125 | 448 | 8,930 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | 105 | 207 | 594 | 11,830 | 生活必需品流通・小売り |
| JD LOGISTICS INC | 221 | 221 | 322 | 6,420 | 運輸 |
| JD.COM INC - CL A | 191 | 294 | 4,041 | 80,425 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | 20 | 20 | 15 | 310 | 運輸 |
| JIANGXI COPPER CO LTD-H | 90 | 90 | 115 | 2,306 | 素材 |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD | 90 | — | — | — | 消費者サービス |
| KINGBOARD HOLDINGS LIMITED | 40 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING | 25 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR | 230 | 230 | 191 | 3,808 | ソフトウェア・サービス |
| KINGSOFT CORP LTD | 80 | 80 | 233 | 4,648 | メディア・娯楽 |
| KUAISHOU TECHNOLOGY | 197 | 250 | 1,290 | 25,671 | メディア・娯楽 |
| KUNLUN ENERGY CO LTD | 360 | 360 | 275 | 5,480 | 公益事業 |

ニッセイ新興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 | |
| LEGEND GROUP LTD | 580 | 860 | 776 | 15,453 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LI AUTO INC-CLASS A | 91 | 142 | 1,290 | 25,672 | 自動車・自動車部品 |
| LI NING CO LTD | 205 | 300 | 481 | 9,587 | 耐久消費財・アパレル |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 155 | 155 | 176 | 3,516 | 不動産管理・開発 |
| MEITUAN-B | 407 | 577 | 9,928 | 197,585 | 消費者サービス |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP | 53 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| MINISO GROUP HOLDING LTD | — | 42 | 145 | 2,900 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| MINTH GROUP LTD | 40 | — | — | — | 自動車・自動車部品 |
| NETEASE INC | 156 | 228 | 3,080 | 61,297 | メディア・娯楽 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 60 | 188 | 466 | 9,278 | 保険 |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC | 111 | 181 | 774 | 15,416 | 消費者サービス |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 30 | — | — | — | 素材 |
| NIO INC-CLASS A | — | 172 | 650 | 12,945 | 自動車・自動車部品 |
| NONGFU SPRING CO LTD-H | 150 | 278 | 893 | 17,786 | 食品・飲料・タバコ |
| ORIENT OVERSEAS INTL LTD | 10 | 10 | 107 | 2,145 | 運輸 |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 230 | 1,050 | 402 | 8,002 | 保険 |
| PETROCHINA CO LTD-H | 1,380 | 2,140 | 1,206 | 24,018 | エネルギー |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H | 470 | 690 | 840 | 16,724 | 保険 |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | 16 | — | — | — | 生活必需品流通・小売り |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 550 | 790 | 3,645 | 72,552 | 保険 |
| POP MART INTERNATIONAL GROUP | 38 | 38 | 289 | 5,769 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 670 | 1,060 | 485 | 9,661 | 銀行 |
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTL | 110 | — | — | — | 資本財 |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 57 | 57 | 80 | 1,604 | 素材 |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 164 | 164 | 74 | 1,475 | ヘルスケア機器・サービス |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 30 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 27 | 27 | 34 | 686 | ヘルスケア機器・サービス |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS | 15 | — | — | — | 運輸 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 68 | 94 | 543 | 10,812 | 耐久消費財・アパレル |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 940 | 940 | 307 | 6,116 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 100 | 100 | 207 | 4,119 | ヘルスケア機器・サービス |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 60 | 60 | 128 | 2,555 | 資本財 |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 210 | 210 | 231 | 4,596 | 食品・飲料・タバコ |
| SUNNY OPTICAL TECH | 60 | 60 | 342 | 6,823 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 535 | 746 | 30,302 | 603,020 | メディア・娯楽 |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 120 | 120 | 131 | 2,617 | 食品・飲料・タバコ |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD | 80 | 80 | 141 | 2,817 | 消費者サービス |

ニッセイ新興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 | |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 180 | 180 | 44 | 884 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 100 | 100 | 102 | 2,045 | 消費者サービス |
| TRIP.COM GROUP LTD | 45 | 66 | 3,339 | 66,458 | 消費者サービス |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 40 | 80 | 395 | 7,872 | 食品・飲料・タバコ |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 30 | - | - | - | 食品・飲料・タバコ |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 280 | 280 | 133 | 2,652 | 食品・飲料・タバコ |
| WEICHAI POWER CO LTD-H | 120 | 240 | 277 | 5,530 | 資本財 |
| WUXI APTEC CO LTD-H | 28 | 28 | 142 | 2,837 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 325 | 365 | 554 | 11,040 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| XIAOMI CORP-CLASS B | 1,294 | 1,804 | 5,105 | 101,595 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 440 | 440 | 145 | 2,898 | 半導体・半導体製造装置 |
| XPENG INC - CLASS A SHARES | 74 | 97 | 503 | 10,027 | 自動車・自動車部品 |
| XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS | 90 | - | - | - | 耐久消費財・アパレル |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD | 100 | 100 | 134 | 2,678 | 自動車・自動車部品 |
| YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD | 150 | 415 | 395 | 7,878 | エネルギー |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING | 20 | - | - | - | 食品・飲料・タバコ |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD | 172 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| ZAI LAB LTD | 78 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H | 125 | 125 | 144 | 2,880 | 素材 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 20 | 20 | 10 | 210 | 運輸 |
| ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG | - | 59 | 177 | 3,539 | 自動車・自動車部品 |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 77 | - | - | - | 保険 |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 65 | 65 | 114 | 2,284 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H | 39 | 39 | 111 | 2,211 | 資本財 |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 480 | 680 | 1,059 | 21,082 | 素材 |
| ZTE CORP-H | 62 | 62 | 121 | 2,425 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC | - | 56 | 936 | 18,630 | 運輸 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 63,715 186 | 84,018 150 | 144,027 - | 2,866,152 <18.8%> |
| (台湾) | | | 千台湾ドル | | |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | 40 | 50 | 3,030 | 14,484 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ACER INC | 210 | 210 | 798 | 3,814 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ADVANTECH CO LTD | 34 | 54 | 1,792 | 8,569 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 10 | 20 | 1,692 | 8,088 | 資本財 |
| ALCHIP TECHNOLOGIES LTD | - | 10 | 2,355 | 11,257 | 半導体・半導体製造装置 |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD | 240 | 360 | 5,562 | 26,587 | 半導体・半導体製造装置 |
| ASIA CEMENT CORP | 160 | 160 | 704 | 3,365 | 素材 |

ニッセイ新興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 | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千台湾ドル | 千円 | |
| ASIA VITAL COMPONENTS | – | 40 | 2,592 | 12,390 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 60 | 80 | 4,976 | 23,786 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| AUO CORPORATION | 518 | 518 | 826 | 3,949 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 40 | 90 | 1,845 | 8,819 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 830 | 1,050 | 7,108 | 33,980 | 保険 |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 130 | 174 | 2,158 | 10,318 | 金融サービス |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 204 | 737 | 1,316 | 6,291 | 銀行 |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 130 | 130 | 700 | 3,349 | 自動車・自動車部品 |
| CHINA AIRLINES LTD | 200 | 200 | 483 | 2,308 | 運輸 |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 1,270 | 2,080 | 3,568 | 17,058 | 保険 |
| CHINA STEEL CORP | 990 | 1,340 | 2,994 | 14,316 | 素材 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 280 | 450 | 5,557 | 26,565 | 電気通信サービス |
| COMPAL ELECTRONICS | 360 | 360 | 1,330 | 6,358 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | 1,510 | 1,820 | 6,706 | 32,059 | 銀行 |
| DELTA ELECTRONICS INC | 150 | 220 | 8,536 | 40,803 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| E INK HOLDINGS INC | 60 | 100 | 2,915 | 13,934 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO | 1,191 | 1,643 | 4,454 | 21,292 | 銀行 |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 10 | 30 | 1,632 | 7,801 | 耐久消費財・アパレル |
| EMEMORY TECHNOLOGY INC | 10 | 10 | 2,900 | 13,862 | 半導体・半導体製造装置 |
| EVA AIRWAYS CORP | 180 | 180 | 747 | 3,575 | 運輸 |
| EVERGREEN MARINE | 56 | 106 | 2,515 | 12,025 | 運輸 |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 210 | 210 | 778 | 3,719 | 資本財 |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 80 | 170 | 1,497 | 7,159 | 電気通信サービス |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 37 | 37 | 501 | 2,399 | 耐久消費財・アパレル |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 865 | 1,210 | 3,383 | 16,172 | 銀行 |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 270 | 390 | 1,421 | 6,795 | 素材 |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 120 | – | – | – | エネルギー |
| FORMOSA PLASTICS CORP | 330 | 450 | 2,058 | 9,841 | 素材 |
| FORTUNE ELECTRIC CO LTD | – | 11 | 635 | 3,039 | 資本財 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 606 | 983 | 8,984 | 42,949 | 保険 |
| GIANT MANUFACTURING | 20 | – | – | – | 耐久消費財・アパレル |
| GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD | 40 | 40 | 1,130 | 5,401 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| GLOBAL UNICHIP CORP | 10 | 10 | 1,245 | 5,951 | 半導体・半導体製造装置 |
| GLOBALWAFERS CO LTD | 20 | 40 | 1,718 | 8,212 | 半導体・半導体製造装置 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 1,002 | 1,442 | 29,344 | 140,273 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 20 | 30 | 1,951 | 9,329 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 703 | 1,053 | 2,681 | 12,817 | 銀行 |

ニッセイ新興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 | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千台湾ドル | 千円 | |
| INNOLUX CORPORATION | 755 | 664 | 1,013 | 4,847 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| INVENTEC CO LTD | 230 | 230 | 1,131 | 5,409 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 10 | 10 | 2,385 | 11,400 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 160 | 230 | 2,357 | 11,269 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MEDIATEK INC | 120 | 180 | 23,130 | 110,566 | 半導体・半導体製造装置 |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 941 | 1,238 | 4,945 | 23,642 | 銀行 |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 50 | 90 | 1,552 | 7,421 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MOMO.COM INC | 11 | - | - | - | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| NAN YA PLASTICS CORP | 410 | 560 | 2,321 | 11,095 | 素材 |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD | 20 | - | - | - | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| NANYA TECHNOLOGY CORP | 80 | 80 | 296 | 1,416 | 半導体・半導体製造装置 |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 10 | 10 | 419 | 2,005 | 耐久消費財・アパレル |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD | 50 | 60 | 2,913 | 13,924 | 半導体・半導体製造装置 |
| PARADE TECHNOLOGIES LTD | 10 | - | - | - | 半導体・半導体製造装置 |
| PEGATRON CORP | 160 | 240 | 2,347 | 11,220 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| PHARMAESSENTIA CORP | 20 | 20 | 1,134 | 5,420 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| POU CHEN | 70 | 70 | 304 | 1,453 | 耐久消費財・アパレル |
| POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU | 320 | - | - | - | 半導体・半導体製造装置 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 50 | 50 | 1,345 | 6,429 | 生活必需品流通・小売り |
| QUANTA COMPUTER INC | 210 | 290 | 8,410 | 40,201 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 40 | 60 | 3,018 | 14,426 | 半導体・半導体製造装置 |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 88 | 88 | 409 | 1,958 | 不動産管理・開発 |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING | 562 | 1,502 | 1,742 | 8,331 | 保険 |
| SILERGY CORP | 30 | 30 | 1,324 | 6,331 | 半導体・半導体製造装置 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 694 | 1,131 | 2,620 | 12,526 | 銀行 |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 80 | 210 | 1,596 | 7,629 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 911 | 1,587 | 2,770 | 13,243 | 銀行 |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 471 | 525 | 816 | 3,903 | 銀行 |
| TAIWAN CEMENT | 500 | 710 | 2,381 | 11,384 | 素材 |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 895 | 1,299 | 3,306 | 15,804 | 銀行 |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 60 | 60 | 173 | 828 | 運輸 |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 140 | 230 | 2,587 | 12,368 | 電気通信サービス |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 1,970 | 2,800 | 291,200 | 1,391,994 | 半導体・半導体製造装置 |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 350 | 600 | 2,355 | 11,257 | 銀行 |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | 110 | 150 | 2,392 | 11,436 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 350 | 580 | 4,912 | 23,483 | 食品・飲料・タバコ |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 930 | 1,370 | 6,192 | 29,600 | 半導体・半導体製造装置 |

ニッセイ新興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 | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千台湾ドル | 千円 | |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMI | 80 | 80 | 725 | 3,468 | 半導体・半導体製造装置 |
| VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY | 10 | 10 | 1,905 | 9,106 | 資本財 |
| WALSIN LIHWA CORP | 240 | 240 | 693 | 3,315 | 資本財 |
| WAN HAI LINES LIMITED | 37 | 37 | 354 | 1,692 | 運輸 |
| WINBOND ELECTRONICS CORP | 170 | 590 | 1,062 | 5,076 | 半導体・半導体製造装置 |
| WISTRON CORP | 220 | 290 | 3,306 | 15,803 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WIWYNN CORP | 10 | 10 | 2,085 | 9,966 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WPG HOLDINGS LTD | 117 | 237 | 1,791 | 8,563 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| YAGEO CORPORATION | 23 | 60 | 3,234 | 15,462 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| YANG MING MARINE TRANSPORT | 90 | 200 | 1,494 | 7,141 | 運輸 |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 685 | 1,356 | 4,590 | 21,941 | 金融サービス |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 40 | 110 | 1,292 | 6,178 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 26,807 90 | 38,482 87 | 547,472 - | 2,617,025 <17.2%> |
| (イギリス) | | | 千イギリス・ポンド | | |
| POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 19 | - | - | - | 素材 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 19 1 | - - | - - | - <-> |
| (トルコ) | | | 千トルコ・リラ | | |
| AKBANK T.A.S. | 293 | 293 | 1,569 | 7,054 | 銀行 |
| ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 116 | 116 | 791 | 3,559 | 資本財 |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 25 | 47 | 2,176 | 9,783 | 生活必需品流通・小売り |
| COCA-COLA ICECEK AS | - | 165 | 800 | 3,597 | 食品・飲料・タバコ |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 81 | 81 | 403 | 1,811 | 素材 |
| FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 5 | 5 | 622 | 2,798 | 自動車・自動車部品 |
| HACI OMER SABANCI HOLDING | 68 | 151 | 1,254 | 5,638 | 銀行 |
| HEKTAS TICARET T.A.S | 91 | - | - | - | 素材 |
| KOC HOLDING AS | 58 | 98 | 1,834 | 8,247 | 資本財 |
| PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS | 4 | 20 | 470 | 2,116 | 運輸 |
| SASA POLYESTER SANAYI | 82 | 663 | 254 | 1,142 | 素材 |
| TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA | 10 | 10 | 213 | 957 | 自動車・自動車部品 |
| TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 85 | 176 | 2,532 | 11,380 | エネルギー |
| TURK HAVA YOLLARI AO | 37 | 61 | 1,706 | 7,668 | 運輸 |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 105 | 105 | 419 | 1,884 | 資本財 |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 118 | 118 | 1,093 | 4,917 | 電気通信サービス |
| TURKIYE IS BANKASI-C | 325 | 814 | 1,032 | 4,642 | 銀行 |

ニッセイ新興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 | |
| (トルコ) | | 百株 | 百株 | 千トルコ・リラ | 千円 | |
| YAPI VE KREDI BANKASI | | 392 | 392 | 1,046 | 4,702 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,903 17 | 3,322 17 | 18,222 - | 81,903 <0.5%> | |
| (メキシコ) | | | | 千メキシコ・ペソ | | |
| ALFA S.A.B.-A | | 179 | 179 | 266 | 2,055 | 資本財 |
| AMERICA MOVIL SAB DE CV | | 1,586 | 2,286 | 3,461 | 26,655 | 電気通信サービス |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | | 40 | 67 | 1,168 | 9,001 | 食品・飲料・タバコ |
| BANCO DEL BAJIO SA | | 59 | 59 | 243 | 1,873 | 銀行 |
| CEMEX SAB-CPO | | 1,254 | 1,611 | 1,760 | 13,561 | 素材 |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | | 32 | 64 | 1,022 | 7,873 | 食品・飲料・タバコ |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | | 150 | 209 | 3,747 | 28,864 | 食品・飲料・タバコ |
| GRUMA S.A.B.-B | | 12 | 26 | 923 | 7,111 | 食品・飲料・タバコ |
| GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B | | 15 | 15 | 863 | 6,652 | 運輸 |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT | | - | 38 | 616 | 4,751 | 運輸 |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH | | 28 | 44 | 1,660 | 12,788 | 運輸 |
| GRUPO BIMBO SAB- SERIES A | | 101 | 164 | 1,005 | 7,741 | 食品・飲料・タバコ |
| GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | | 53 | 53 | 615 | 4,738 | 資本財 |
| GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA | | - | 37 | 467 | 3,599 | 生活必需品流通・小売り |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | | 212 | 321 | 4,539 | 34,960 | 銀行 |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA-O | | 166 | 276 | 1,236 | 9,520 | 銀行 |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | | 243 | 356 | 3,690 | 28,424 | 素材 |
| GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO | | 140 | - | - | - | メディア・娯楽 |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | | 11 | 11 | 353 | 2,723 | 素材 |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | | 100 | 100 | 282 | 2,173 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| OPERADORA DE SITES MEX- A-1 | | 120 | 120 | 173 | 1,335 | 電気通信サービス |
| ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | | 125 | 125 | 222 | 1,715 | 素材 |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | | 17 | 17 | 315 | 2,431 | 運輸 |
| WALMART DE MEXICO-SER V | | 427 | 579 | 3,112 | 23,973 | 生活必需品流通・小売り |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 5,072 22 | 6,760 23 | 31,749 - | 244,530 <1.6%> | |
| (フィリピン) | | | | 千フィリピン・ペソ | | |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | | 63 | - | - | - | 資本財 |
| AYALA CORPORATION | | 17 | 36 | 2,359 | 6,215 | 資本財 |
| AYALA LAND INC | | 553 | 553 | 1,617 | 4,260 | 不動産管理・開発 |
| BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN | | 152 | 152 | 2,099 | 5,530 | 銀行 |
| BDO UNIBANK INC | | 214 | 328 | 4,773 | 12,573 | 銀行 |
| INTL CONTAINER TERM SVCS INC | | 92 | 132 | 5,217 | 13,743 | 運輸 |

ニッセイ新興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 |
| (フィリピン) | | 百株 | 百株 | 千フィリピン・ペソ | 千円 | |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC | | 185 | 185 | 414 | 1,092 | 資本財 |
| JOLLIBEE FOODS CORP | | 13 | 73 | 1,957 | 5,155 | 消費者サービス |
| MANILA ELECTRIC COMPANY | | 13 | 13 | 656 | 1,728 | 公益事業 |
| METROPOLITAN BANK & TRUST | | 151 | 151 | 1,116 | 2,940 | 銀行 |
| PLDT INC | | 5 | 5 | 779 | 2,054 | 電気通信サービス |
| SM INVESTMENTS CORP | | 17 | 31 | 2,862 | 7,540 | 資本財 |
| SM PRIME HOLDINGS INC | | 1,057 | 1,057 | 3,023 | 7,962 | 不動産管理・開発 |
| UNIVERSAL ROBINA CORP | | 72 | 72 | 642 | 1,691 | 食品・飲料・タバコ |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,610 | 2,793 | 27,521 | 72,490 | |
| | | 14 | 13 | - | <0.5%> | |
| (チリ) | | | | 千チリ・ペソ | | |
| BANCO DE CHILE | | 3,474 | 5,549 | 62,219 | 9,914 | 銀行 |
| BANCO DE CREDITO E INVERSION | | 6 | 6 | 19,465 | 3,101 | 銀行 |
| BANCO SANTANDER CHILE | | 6,273 | 6,273 | 29,534 | 4,706 | 銀行 |
| CENCOSUD SA | | 92 | 92 | 17,772 | 2,831 | 生活必需品流通・小売り |
| CIA CERVECERIAS UNIDAS SA | | 2 | - | - | - | 食品・飲料・タバコ |
| CIA SUD AMERICANA DE VAPORES | | 928 | - | - | - | 運輸 |
| EMPRESAS CMPC SA | | 101 | 101 | 15,378 | 2,450 | 素材 |
| EMPRESAS COPEC SA | | 30 | 30 | 18,416 | 2,934 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ENEL CHILE SA | | 904 | 904 | 4,976 | 793 | 公益事業 |
| ENERSIS SA | | 2,052 | 2,052 | 18,001 | 2,868 | 公益事業 |
| FALABELLA SA | | 75 | 75 | 25,392 | 4,046 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| LATAM AIRLINES GROUP SA | | - | 19,147 | 26,059 | 4,152 | 運輸 |
| SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | | 10 | 15 | 59,559 | 9,490 | 素材 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 13,953 | 34,249 | 296,776 | 47,290 | |
| | | 12 | 11 | - | <0.3%> | |
| (コロンビア) | | | | 千コロンビア・ペソ | | |
| BANCOLOMBIA SA | | 25 | 25 | 98,918 | 3,487 | 銀行 |
| BANCOLOMBIA SA-PREF | | 45 | 45 | 164,348 | 5,794 | 銀行 |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA | | 14 | 66 | 113,211 | 3,991 | 公益事業 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 85 | 137 | 376,477 | 13,274 | |
| | | 3 | 3 | - | <0.1%> | |
| (インド) | | | | 千インド・ルピー | | |
| ABB INDIA LTD | | 5 | 5 | 3,464 | 6,375 | 資本財 |
| ADANI ENTERPRISES LTD | | 15 | 15 | 4,407 | 8,109 | 資本財 |
| ADANI GREEN ENERGY LTD | | 27 | 27 | 3,913 | 7,200 | 公益事業 |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | | 38 | 53 | 6,844 | 12,593 | 運輸 |

ニッセイ新興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 | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インド・ルピー | 千円 | |
| ADANI POWER LTD | 51 | 91 | 4,786 | 8,806 | 公益事業 |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 50 | 50 | 2,793 | 5,140 | 素材 |
| APL APOLLO TUBES LTD | — | 19 | 2,825 | 5,198 | 素材 |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE | 8 | 11 | 7,970 | 14,666 | ヘルスケア機器・サービス |
| ASHOK LEYLAND LTD | 114 | 196 | 4,355 | 8,013 | 資本財 |
| ASIAN PAINTS LTD | 30 | 45 | 11,226 | 20,656 | 素材 |
| ASTRAL LTD | 10 | 10 | 1,768 | 3,254 | 資本財 |
| AU SMALL FINANCE BANK LTD | 11 | 47 | 2,819 | 5,187 | 銀行 |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 20 | 20 | 2,621 | 4,823 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 13 | 18 | 6,893 | 12,683 | 生活必需品流通・小売り |
| AXIS BANK LTD | 186 | 263 | 29,907 | 55,030 | 銀行 |
| BAJAJ AUTO LTD | 5 | 8 | 7,741 | 14,244 | 自動車・自動車部品 |
| BAJAJ FINANCE LTD | 22 | 32 | 21,658 | 39,852 | 金融サービス |
| BAJAJ FINSERV LTD | 32 | 48 | 7,711 | 14,190 | 金融サービス |
| BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN | 2 | 2 | 2,269 | 4,175 | 金融サービス |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD | 3 | 10 | 2,802 | 5,157 | 自動車・自動車部品 |
| BANDHAN BANK LTD | 35 | — | — | — | 銀行 |
| BANK OF BARODA | 94 | 94 | 2,252 | 4,144 | 銀行 |
| BERGER PAINTS INDIA LTD | 23 | — | — | — | 素材 |
| BHARAT ELECTRONICS LTD | 240 | 409 | 11,425 | 21,022 | 資本財 |
| BHARAT FORGE LTD | 17 | 31 | 4,176 | 7,684 | 自動車・自動車部品 |
| BHARAT HEAVY ELECTROCALC | — | 120 | 2,729 | 5,022 | 資本財 |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 50 | 161 | 4,649 | 8,554 | エネルギー |
| BHARTI AIRTEL LTD | 181 | 293 | 44,832 | 82,492 | 電気通信サービス |
| BOSCH LTD | — | 1 | 3,430 | 6,311 | 自動車・自動車部品 |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 8 | 8 | 4,295 | 7,904 | 食品・飲料・タバコ |
| CADILA HEALTHCARE LTD | — | 35 | 3,376 | 6,212 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CANARA BANK | — | 255 | 2,500 | 4,601 | 銀行 |
| CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LIMITED | 47 | 75 | 5,449 | 10,027 | 資本財 |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND | 36 | 36 | 4,548 | 8,369 | 金融サービス |
| CIPLA LIMITED | 43 | 60 | 8,932 | 16,435 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COAL INDIA LTD | 136 | 192 | 7,916 | 14,566 | エネルギー |
| COLGATE PALMOLIVE (INDIA) | 7 | 14 | 4,018 | 7,393 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 16 | 16 | 1,331 | 2,449 | 運輸 |
| CUMMINS INDIA LTD | 10 | 17 | 5,704 | 10,496 | 資本財 |
| DABUR INDIA LTD | 42 | 79 | 4,057 | 7,466 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 8 | 12 | 7,505 | 13,810 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

ニッセイ新興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 | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インドルピー | 千円 | |
| DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD | － | 4 | 6,203 | 11,414 | 耐久消費財・アパレル |
| DLF LTD | 45 | 77 | 5,886 | 10,830 | 不動産管理・開発 |
| DR. REDDY'S LABORATORIES | 8 | 59 | 7,189 | 13,229 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EICHER MOTORS LTD | 11 | 15 | 7,825 | 14,399 | 自動車・自動車部品 |
| GAIL INDIA LTD | 148 | 262 | 4,897 | 9,012 | 公益事業 |
| GMR INFRASTRUCTURE LTD | － | 269 | 2,168 | 3,990 | 運輸 |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 29 | 46 | 5,471 | 10,067 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| GODREJ PROPERTIES LTD | 6 | 13 | 3,756 | 6,911 | 不動産管理・開発 |
| GRASIM INDUSTRIES LTD | 16 | 28 | 7,185 | 13,221 | 素材 |
| HAVELLS INDIA LTD | 16 | 29 | 4,814 | 8,859 | 資本財 |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 77 | 110 | 20,111 | 37,005 | ソフトウェア・サービス |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 7 | 12 | 5,401 | 9,938 | 金融サービス |
| HDFC BANK LTD | 225 | 489 | 85,199 | 156,767 | 銀行 |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 82 | 121 | 8,234 | 15,152 | 保険 |
| HERO MOTOCORP LTD | 8 | 12 | 6,156 | 11,327 | 自動車・自動車部品 |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD | 100 | 146 | 9,352 | 17,209 | 素材 |
| HINDUSTAN AERONAUTICS LTD | 14 | 21 | 8,621 | 15,863 | 資本財 |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 19 | 95 | 3,449 | 6,347 | エネルギー |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 68 | 89 | 21,661 | 39,857 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| ICICI BANK LTD | 415 | 593 | 74,150 | 136,436 | 銀行 |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 16 | 29 | 5,485 | 10,094 | 保険 |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 23 | 23 | 1,607 | 2,957 | 保険 |
| IDFC BANK LTD | 262 | 568 | 3,673 | 6,759 | 銀行 |
| INDIAN HOTELS CO LTD | 77 | 77 | 5,829 | 10,725 | 消費者サービス |
| INDIAN OIL CORPORATION LTD | 256 | 256 | 3,416 | 6,286 | エネルギー |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TO | 13 | 43 | 3,462 | 6,370 | 商業・専門サービス |
| INDRAPRASTHA GAS LTD | 10 | － | － | － | 公益事業 |
| INDUS TOWERS LTD | － | 148 | 4,869 | 8,959 | 電気通信サービス |
| INDUSIND BANK LTD | － | 31 | 3,140 | 5,778 | 銀行 |
| INFO EDGE INDIA LTD | 5 | 9 | 6,969 | 12,823 | メディア・娯楽 |
| INFOSYS TECHNOLOGIES LTD | 267 | 377 | 68,953 | 126,874 | ソフトウェア・サービス |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 10 | 18 | 7,638 | 14,055 | 運輸 |
| ITC LTD | 235 | 348 | 16,272 | 29,940 | 食品・飲料・タバコ |
| JINDAL STAINLESS LTD | － | 43 | 2,981 | 5,485 | 素材 |
| JINDAL STEEL & POWER LTD | 27 | 27 | 2,417 | 4,447 | 素材 |
| JIO FINANCIAL SERVICES LTD | 215 | 313 | 10,022 | 18,441 | 金融サービス |
| JSW ENERGY LTD | － | 48 | 3,418 | 6,289 | 公益事業 |

ニッセイ新興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 | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千ドル・ピー | 千円 | |
| JSW STEEL LTD | 52 | 77 | 7,347 | 13,518 | 素材 |
| JUBILANT FOODWORKS LTD | 20 | 20 | 1,265 | 2,329 | 消費者サービス |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD | 88 | 120 | 20,772 | 38,221 | 銀行 |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 53 | 72 | 25,438 | 46,807 | 資本財 |
| LTIMINDTREE LIMITED | 6 | 9 | 5,550 | 10,212 | ソフトウェア・サービス |
| LUPIN LTD | 9 | 24 | 4,936 | 9,083 | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MACROTECH DEVELOPERS LTD | - | 27 | 3,433 | 6,318 | 不動産管理・開発 |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 76 | 107 | 31,701 | 58,330 | 自動車・自動車部品 |
| MANKIND PHARMA LTD | - | 13 | 3,570 | 6,570 | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MARICO LTD | 46 | 46 | 2,727 | 5,018 | 食品・飲料・タバコ |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 11 | 14 | 16,384 | 30,146 | 自動車・自動車部品 |
| MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD | 65 | 94 | 9,467 | 17,419 | ヘルスケア機器・サービス |
| MPHASIS LTD | 4 | 13 | 3,670 | 6,754 | ソフトウェア・サービス |
| MRF LTD | 0.07 | 0.24 | 2,950 | 5,429 | 自動車・自動車部品 |
| MUTHOOT FINANCE LTD | 4 | 17 | 3,288 | 6,050 | 金融サービス |
| NESTLE INDIA LTD | 2 | 34 | 7,552 | 13,896 | 食品・飲料・タバコ |
| NHPC LTD | - | 385 | 3,081 | 5,670 | 公益事業 |
| NMDC LTD | - | 116 | 2,584 | 4,754 | 素材 |
| NTPC LTD | 382 | 522 | 19,160 | 35,254 | 公益事業 |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 279 | 355 | 8,825 | 16,238 | エネルギー |
| OIL INDIA LTD | - | 62 | 3,056 | 5,624 | エネルギー |
| ORACLE FINANCIAL SERVICES | - | 2 | 3,093 | 5,692 | ソフトウェア・サービス |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 0.55 | 0.55 | 2,453 | 4,514 | 耐久消費財・アパレル |
| PB FINTECH LTD | - | 34 | 5,951 | 10,950 | 保険 |
| PERSISTENT SYSTEMS LTD | - | 11 | 6,372 | 11,725 | ソフトウェア・サービス |
| PETRONET LNG LTD | 66 | 66 | 2,101 | 3,866 | エネルギー |
| PHOENIX MILLS LTD | - | 25 | 3,721 | 6,846 | 不動産管理・開発 |
| PI INDUSTRIES LTD | 7 | 7 | 2,974 | 5,473 | 素材 |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD | 15 | 15 | 4,568 | 8,406 | 素材 |
| POLYCAB INDIA LTD | - | 5 | 3,369 | 6,199 | 資本財 |
| POWER FINANCE CORPORATION | 95 | 157 | 7,412 | 13,639 | 金融サービス |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 394 | 555 | 17,504 | 32,208 | 公益事業 |
| PRESTIGE ESTATES PROJECTS | - | 18 | 2,863 | 5,268 | 不動産管理・開発 |
| PUNJAB NATIONAL BANK | - | 253 | 2,560 | 4,711 | 銀行 |
| RAIL VIKAS NIGAM LTD | - | 65 | 2,830 | 5,207 | 資本財 |
| REC LTD | 90 | 142 | 7,335 | 13,497 | 金融サービス |
| RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | 244 | 698 | 86,679 | 159,490 | エネルギー |

ニッセイ新興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 | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千ドル・ルピー | 千円 | |
| SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD | 244 | 244 | 4,050 | 7,452 | 自動車・自動車部品 |
| SBI CARDS & PAYMENT SERVICES | 27 | 27 | 1,910 | 3,515 | 金融サービス |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 36 | 49 | 7,535 | 13,864 | 保険 |
| SHREE CEMENT LTD | 0.75 | 0.75 | 1,807 | 3,326 | 素材 |
| SHRIRAM FINANCE LIMITED | 22 | 32 | 9,259 | 17,037 | 金融サービス |
| SIEMENS LTD | 6 | 10 | 6,891 | 12,680 | 資本財 |
| SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD | - | 3 | 3,494 | 6,429 | 素材 |
| SONA BLW PRECISION FORGINGS | 39 | 39 | 2,659 | 4,893 | 自動車・自動車部品 |
| SRF LTD | 13 | 13 | 2,934 | 5,398 | 素材 |
| STATE BANK OF INDIA | 148 | 211 | 17,001 | 31,283 | 銀行 |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 71 | 106 | 18,840 | 34,666 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SUNDARAM FINANCE LTD | - | 8 | 3,547 | 6,527 | 金融サービス |
| SUPREME INDUSTRIES LTD | 5 | 5 | 2,339 | 4,303 | 素材 |
| SUZLON ENERGY LTD | - | 906 | 5,641 | 10,379 | 資本財 |
| TATA COMMUNICATIONS LTD | - | 14 | 2,457 | 4,521 | 電気通信サービス |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 73 | 103 | 41,829 | 76,966 | ソフトウェア・サービス |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | 38 | 61 | 5,645 | 10,388 | 食品・飲料・タバコ |
| TATA ELXSI LTD | 2 | 4 | 3,248 | 5,976 | ソフトウェア・サービス |
| TATA MOTORS LTD | 139 | 227 | 17,779 | 32,714 | 自動車・自動車部品 |
| TATA POWER CO LTD | 138 | 138 | 5,652 | 10,400 | 公益事業 |
| TATA STEEL LTD | 598 | 949 | 13,245 | 24,371 | 素材 |
| TECH MAHINDRA LTD | 47 | 64 | 10,891 | 20,040 | ソフトウェア・サービス |
| THERMAX LTD | - | 5 | 2,589 | 4,764 | 資本財 |
| TITAN CO LTD | 26 | 42 | 13,698 | 25,205 | 耐久消費財・アパレル |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | 5 | 14 | 4,413 | 8,120 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TORRENT POWER LTD | - | 22 | 3,541 | 6,516 | 公益事業 |
| TRENT LTD | 12 | 19 | 12,218 | 22,481 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT | 8 | 8 | 3,242 | 5,967 | 自動車・自動車部品 |
| TVS MOTOR CO LTD | 20 | 28 | 7,013 | 12,904 | 自動車・自動車部品 |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 9 | 13 | 15,066 | 27,722 | 素材 |
| UNION BANK OF INDIA | - | 179 | 2,079 | 3,826 | 銀行 |
| UNITED SPIRITS LTD | 18 | 37 | 5,539 | 10,191 | 食品・飲料・タバコ |
| UPL LTD | 46 | 46 | 2,546 | 4,686 | 素材 |
| VARUN BEVERAGES LTD | 40 | 139 | 8,818 | 16,226 | 食品・飲料・タバコ |
| VEDANTA LTD | 47 | 181 | 8,069 | 14,848 | 素材 |
| VODAFONE IDEA LTD | - | 3,012 | 2,138 | 3,935 | 電気通信サービス |
| WIPRO LTD | 106 | 156 | 8,814 | 16,219 | ソフトウェア・サービス |

ニッセイ新興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 | |
| (インド) | | 百株 | 百株 | 千インドルピー | 千円 | |
| YES BANK LTD | | 925 | 1,867 | 3,651 | 6,719 | 銀行 |
| ZOMATO LTD | | 260 | 711 | 19,317 | 35,544 | 消費者サービス |
| 小計 | 株数・金額 | 9,581 | 21,674 | 1,379,798 | 2,538,829 | |
| | 銘柄数<比率> | 122 | 151 | — | <16.7%> | |
| (インドネシア) | | | | 千インドネシア・ルピア | | |
| ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT | | 842 | 2,200 | 816,200 | 7,998 | エネルギー |
| AMMAN MINERAL INTERNASIONAL | | — | 753 | 720,997 | 7,065 | 素材 |
| ANEKA TAMBANG TBK | | 532 | — | — | — | 素材 |
| ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | | 1,734 | 2,890 | 1,436,330 | 14,076 | 資本財 |
| BANK CENTRAL ASIA TBK PT | | 4,642 | 6,304 | 6,256,720 | 61,315 | 銀行 |
| BANK MANDIRI TBK | | 3,107 | 4,353 | 2,720,625 | 26,662 | 銀行 |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSER | | 1,104 | 1,852 | 898,220 | 8,802 | 銀行 |
| BANK RAKYAT INDONESIA | | 5,757 | 7,920 | 3,453,120 | 33,840 | 銀行 |
| BARITO PACIFIC TBK PT | | 2,725 | 2,729 | 232,004 | 2,273 | 素材 |
| CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT | | — | 896 | 589,120 | 5,773 | 素材 |
| CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | | 455 | 455 | 216,125 | 2,118 | 食品・飲料・タバコ |
| GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT | | 69,688 | 69,688 | 515,691 | 5,053 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | | 60 | 60 | 42,900 | 420 | 素材 |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | | 96 | 96 | 114,240 | 1,119 | 食品・飲料・タバコ |
| INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT | | 104 | 104 | 81,120 | 794 | 食品・飲料・タバコ |
| INTERNATIONAL NICKEL INDONES | | 181 | — | — | — | 素材 |
| KALBE FARMA TBK PT | | 1,761 | 1,761 | 250,942 | 2,459 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | | 1,136 | 1,136 | 236,288 | 2,315 | 素材 |
| SARANA MENARA NUSANTARA PT | | 1,626 | — | — | — | 電気通信サービス |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK | | 94 | — | — | — | 素材 |
| SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P | | 998 | 2,216 | 655,936 | 6,428 | 生活必需品流通・小売り |
| TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT | | 4,000 | 6,471 | 1,798,938 | 17,629 | 電気通信サービス |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT | | 491 | 491 | 88,625 | 868 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| UNITED TRACTORS TBK PT | | 106 | 106 | 279,310 | 2,737 | エネルギー |
| 小計 | 株数・金額 | 101,239 | 112,481 | 21,403,452 | 209,753 | |
| | 銘柄数<比率> | 22 | 20 | — | <1.4%> | |
| (ブラジル) | | | | 千ブラジル・リアル | | |
| AMBEV SA | | 365 | 610 | 758 | 20,338 | 食品・飲料・タバコ |
| ATACADAO SA | | 19 | 19 | 12 | 328 | 生活必需品流通・小売り |
| BANCO BRADESCO S.A. | | 172 | 331 | 402 | 10,806 | 銀行 |
| BANCO BRADESCO SA-PREF | | 413 | 484 | 669 | 17,971 | 銀行 |
| BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | | 92 | 129 | 440 | 11,809 | 金融サービス |

ニッセイ新興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 | |
| (ブラジル) | 百株 | 百株 | 千ブラジル・リアル | 千円 | |
| BANCO DO BRASIL SA | 65 | 176 | 454 | 12,203 | 銀行 |
| BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL | 30 | - | - | - | 銀行 |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 44 | 79 | 270 | 7,247 | 保険 |
| BM&FBOVESPA SA | 477 | 685 | 686 | 18,411 | 金融サービス |
| BRF SA | - | 76 | 185 | 4,976 | 食品・飲料・タバコ |
| CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO | - | 91 | 129 | 3,480 | 保険 |
| CCR SA | 68 | 68 | 81 | 2,187 | 運輸 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 101 | 152 | 541 | 14,527 | 公益事業 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 26 | 26 | 105 | 2,824 | 公益事業 |
| CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 84 | 239 | 285 | 7,666 | 公益事業 |
| CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB | - | 139 | 133 | 3,568 | 公益事業 |
| CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 25 | 53 | 519 | 13,946 | 公益事業 |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 51 | 51 | 59 | 1,593 | 素材 |
| COSAN SA | 104 | 104 | 114 | 3,068 | エネルギー |
| CPFL ENERGIA SA | 30 | 30 | 97 | 2,615 | 公益事業 |
| EMBRAER SA | - | 85 | 462 | 12,412 | 資本財 |
| ENERGISA SA-UNITS | 23 | 23 | 96 | 2,588 | 公益事業 |
| ENEVA SA | 83 | - | - | - | 公益事業 |
| ENGIE BRASIL ENERGIA SA | 6 | 45 | 179 | 4,814 | 公益事業 |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 86 | 141 | 466 | 12,526 | 公益事業 |
| GERDAU SA-PREF | 100 | 120 | 236 | 6,331 | 素材 |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 435 | 435 | 131 | 3,524 | ヘルスケア機器・サービス |
| HYPERA S.A | 29 | 29 | 59 | 1,594 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 406 | 545 | 1,887 | 50,642 | 銀行 |
| ITAUSA SA | 413 | 581 | 605 | 16,230 | 銀行 |
| JBS SA | 71 | 71 | 247 | 6,637 | 食品・飲料・タバコ |
| KLABIN SA - UNIT | 40 | 44 | 90 | 2,430 | 素材 |
| LOCALIZA RENT A CAR | 73 | 99 | 438 | 11,767 | 運輸 |
| LOJAS RENNER S.A. | 59 | - | - | - | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| MAGAZINE LUIZA SA | 152 | - | - | - | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| NATURA &CO HOLDING SA | 73 | 73 | 104 | 2,798 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 320 | 451 | 1,850 | 49,624 | エネルギー |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 366 | 497 | 1,878 | 50,392 | エネルギー |
| PRIO S.A. | 67 | 100 | 397 | 10,667 | エネルギー |
| RAIA DROGASIL SA | 109 | 162 | 418 | 11,227 | 生活必需品流通・小売り |
| REDE D'OR SAO LUIZ SA | 53 | 105 | 302 | 8,117 | ヘルスケア機器・サービス |
| RUMO SA | 82 | 135 | 275 | 7,390 | 運輸 |
| SENDAS DISTRIBUIDORA SA | 117 | 117 | 81 | 2,187 | 生活必需品流通・小売り |

ニッセイ新興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 | |
| (ブラジル) | | 百株 | 百株 | 千ブラジル・リアル | 千円 | |
| SUZANO S.A. | | 56 | 76 | 460 | 12,348 | 素材 |
| TELEFONICA BRASIL S.A. | | 31 | 31 | 161 | 4,334 | 電気通信サービス |
| TIM SA | | 35 | 105 | 171 | 4,607 | 電気通信サービス |
| TOTVS SA | | 44 | 44 | 133 | 3,592 | ソフトウェア・サービス |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | | 52 | 52 | 95 | 2,560 | エネルギー |
| VALE SA | | 275 | 404 | 2,333 | 62,590 | 素材 |
| VIBRA ENERGIA SA | | 78 | 123 | 268 | 7,192 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| WEG SA | | 124 | 197 | 1,067 | 28,633 | 資本財 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 6,030 | 8,437 | 20,852 | 559,340 | |
| (チェコ) | | | | 千チェコ・コルナ | | |
| CEZ AS | | 13 | 21 | 2,075 | 13,481 | 公益事業 |
| KOMERCNI BANKA AS | | 6 | 6 | 532 | 3,457 | 銀行 |
| MONETA MONEY BANK AS | | 11 | 11 | 138 | 897 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 31 | 39 | 2,746 | 17,836 | |
| (韓国) | | | | 千韓国ウォン | | |
| ALTEOGEN INC | | — | 4 | 172,584 | 19,225 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMOREPACIFIC CORP | | 3 | 3 | 38,830 | 4,325 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| BGF RETAIL CO LTD/NEW | | 0.15 | — | — | — | 生活必需品流通・小売り |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | | 9 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス |
| CELLTRION INC | | 9 | 18 | 317,066 | 35,321 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CELLTRION PHARM INC | | 1 | 1 | 10,449 | 1,164 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CJ CHEILJEDANG CORP | | 0.61 | 0.61 | 16,500 | 1,838 | 食品・飲料・タバコ |
| COSMOAM&T CO LTD | | 2 | 2 | 13,448 | 1,498 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| COWAY CO LTD | | 3 | 3 | 19,593 | 2,182 | 耐久消費財・アパレル |
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE | | — | 13 | 48,943 | 5,452 | 資本財 |
| DAUM COMMUNICATIONS CORP | | 24 | 32 | 116,906 | 13,023 | メディア・娯楽 |
| DB INSURANCE CO LTD | | 3 | 3 | 38,877 | 4,330 | 保険 |
| DOOSAN BOBCAT INC | | 2 | 2 | 10,336 | 1,151 | 資本財 |
| DOOSAN HEAVY INDUSTRIES | | 33 | 52 | 117,712 | 13,113 | 資本財 |
| ECOPRO BM CO LTD | | 4 | 6 | 81,408 | 9,068 | 資本財 |
| ECOPRO CO LTD | | 1 | 10 | 71,791 | 7,997 | 資本財 |
| ECOPRO MATERIALS CO LTD | | — | 1 | 15,334 | 1,708 | 資本財 |
| ENCHEM CO LTD | | — | 1 | 19,866 | 2,213 | 素材 |
| F&F CO LTD / NEW | | 0.90 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| GS HOLDINGS CORP | | 4 | 4 | 16,971 | 1,890 | 資本財 |

ニッセイ新興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 | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国ウォン | 千円 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 24 | 35 | 212,225 | 23,641 | 銀行 |
| HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD | 5 | 5 | 20,284 | 2,259 | 自動車・自動車部品 |
| HANMI PHARM CO LTD | 0.59 | 0.60 | 17,010 | 1,894 | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD | 3 | 3 | 29,653 | 3,303 | 半導体・半導体製造装置 |
| HANON SYSTEMS | 9 | — | — | — | 自動車・自動車部品 |
| HANWHA AEROSPACE CO LTD | 3 | 2 | 113,157 | 12,605 | 資本財 |
| HANWHA SOLUTIONS CORP | 9 | 9 | 16,794 | 1,870 | 素材 |
| HD HYUNDAI | 3 | 3 | 27,760 | 3,092 | エネルギー |
| HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD | — | 2 | 99,395 | 11,072 | 資本財 |
| HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD | 1 | 3 | 70,942 | 7,902 | 資本財 |
| HD KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD | 3 | 5 | 112,747 | 12,560 | 資本財 |
| HLB INC | 6 | 12 | 87,031 | 9,695 | ヘルスケア機器・サービス |
| HMM CO LTD | 22 | 22 | 40,377 | 4,498 | 運輸 |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 2 | — | — | — | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| HYBE CO LTD | 1 | 1 | 33,912 | 3,777 | メディア・娯楽 |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONST | 4 | 4 | 13,390 | 1,491 | 資本財 |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 1 | 2 | 31,571 | 3,517 | 運輸 |
| HYUNDAI MIPO DOCKYARD | 2 | — | — | — | 資本財 |
| HYUNDAI MOBIS | 4 | 6 | 157,815 | 17,580 | 自動車・自動車部品 |
| HYUNDAI MOTOR CO | 10 | 16 | 358,376 | 39,923 | 自動車・自動車部品 |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF | 2 | 4 | 68,737 | 7,657 | 自動車・自動車部品 |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF | 1 | 1 | 26,724 | 2,977 | 自動車・自動車部品 |
| HYUNDAI STEEL CO | 5 | 5 | 11,352 | 1,264 | 素材 |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 22 | 51 | 73,875 | 8,229 | 銀行 |
| JYP ENTERTAINMENT CORP | 2 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| KAKAO GAMES CORP | 1 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| KAKAOBANK CORP | 16 | 16 | 35,237 | 3,925 | 銀行 |
| KAKAOPAY CORP | 2 | — | — | — | 金融サービス |
| KANGWON LAND INC | 3 | — | — | — | 消費者サービス |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 29 | 42 | 385,361 | 42,929 | 銀行 |
| KIA CORPORATION | 20 | 28 | 270,652 | 30,150 | 自動車・自動車部品 |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES | 5 | 5 | 33,629 | 3,746 | 資本財 |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP | 21 | 21 | 50,726 | 5,650 | 公益事業 |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 4 | 4 | 35,305 | 3,933 | 金融サービス |
| KOREA ZINC CO LTD | 0.53 | 1 | 121,242 | 13,506 | 素材 |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 11 | 11 | 29,530 | 3,289 | 運輸 |
| KRAFTON INC | 2 | 3 | 112,729 | 12,558 | メディア・娯楽 |

ニッセイ新興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 | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国ウォン | 千円 | |
| KT CORP | 7 | — | — | — | 電気通信サービス |
| KT&G CORP | 7 | 11 | 132,357 | 14,744 | 食品・飲料・タバコ |
| KUM YANG CO LTD | — | 3 | 10,080 | 1,122 | 素材 |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD | 1 | 1 | 10,786 | 1,201 | 素材 |
| L&F CO LTD | 1 | 1 | 19,877 | 2,214 | 資本財 |
| LG CHEM LTD | 4 | 5 | 172,811 | 19,251 | 素材 |
| LG CHEM LTD-PREFERENCE | 0.56 | 0.56 | 11,312 | 1,260 | 素材 |
| LG CORP | 8 | 14 | 104,020 | 11,587 | 資本財 |
| LG DISPLAY CO LTD | 13 | 42 | 42,072 | 4,686 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LG ELECTRONICS INC | 9 | 13 | 118,948 | 13,250 | 耐久消費財・アパレル |
| LG ENERGY SOLUTION | 3 | 5 | 228,230 | 25,424 | 資本財 |
| LG H AND H CO LTD | 1 | 1 | 33,400 | 3,720 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| LG INNOTEK CO LTD | 0.83 | 2 | 40,430 | 4,503 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD | 13 | 13 | 17,808 | 1,983 | 金融サービス |
| LG UPLUS CORP | 8 | 8 | 8,313 | 926 | 電気通信サービス |
| LOTTE CHEMICAL CORP | 1 | 1 | 7,593 | 845 | 素材 |
| LOTTE ENERGY MATERIALS CORPORATION | 1 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LS ELECTRIC CO LTD | — | 2 | 31,945 | 3,558 | 資本財 |
| MERITZ FINANCIAL GROUP INC | 8 | 11 | 124,096 | 13,824 | 金融サービス |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD | 13 | 13 | 11,348 | 1,264 | 金融サービス |
| NAVER CORP | 10 | 14 | 280,622 | 31,261 | メディア・娯楽 |
| NCSOFT CORPORATION | 1 | 1 | 28,496 | 3,174 | メディア・娯楽 |
| NETMARBLE CORPORATION | 0.58 | 0.58 | 2,868 | 319 | メディア・娯楽 |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 2 | 2 | 22,885 | 2,549 | 食品・飲料・タバコ |
| PEARL ABYSS CORP | 1 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| POSCO DX CO LTD | — | 5 | 12,892 | 1,436 | ソフトウェア・サービス |
| POSCO FUTURE M CO LTD | 2 | 4 | 73,916 | 8,234 | 資本財 |
| POSCO HOLDINGS INC | 5 | 7 | 230,763 | 25,706 | 素材 |
| POSCO INTERNATIONAL CORPORATION | 4 | 4 | 20,895 | 2,327 | 資本財 |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 1 | 1 | 175,529 | 19,553 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SAMSUNG C&T CORP | 7 | 9 | 112,659 | 12,550 | 資本財 |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 5 | 8 | 89,657 | 9,987 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 379 | 540 | 3,042,170 | 338,897 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PFD | 67 | 102 | 492,700 | 54,886 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 12 | 12 | 21,328 | 2,375 | 資本財 |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD | 2 | 3 | 121,743 | 13,562 | 保険 |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES | 51 | 87 | 102,836 | 11,455 | 資本財 |

ニッセイ新興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 | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国ウォン | 千円 | |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD | 4 | 8 | 93,481 | 10,413 | 保険 |
| SAMSUNG SDI CO LTD | 4 | 6 | 163,947 | 18,263 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SAMSUNG SDS CO LTD | 3 | 6 | 92,390 | 10,292 | ソフトウェア・サービス |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 4 | — | — | — | 金融サービス |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD | 35 | 52 | 280,421 | 31,238 | 銀行 |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 1 | 4 | 45,825 | 5,104 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SK BIOSCIENCE CO LTD | 1 | 1 | 5,324 | 593 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SK HYNIX INC | 43 | 62 | 1,071,538 | 119,369 | 半導体・半導体製造装置 |
| SK IE TECHNOLOGY CO LTD | 1 | — | — | — | 資本財 |
| SK INC | 3 | 3 | 47,006 | 5,236 | 資本財 |
| SK INNOVATION CO LTD | 4 | 7 | 81,827 | 9,115 | エネルギー |
| SK SQUARE CO LTD | 5 | 11 | 89,893 | 10,014 | 資本財 |
| SK TELECOM CO LTD | — | 7 | 39,960 | 4,451 | 電気通信サービス |
| SKC CO LTD | 1 | 1 | 13,545 | 1,508 | 素材 |
| S-OIL CORPORATION | 3 | 9 | 59,082 | 6,581 | エネルギー |
| STX PAN OCEAN CO LTD | 18 | — | — | — | 運輸 |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 43 | 68 | 112,533 | 12,536 | 銀行 |
| YUHAN CORP | 4 | 4 | 55,178 | 6,146 | 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 銘柄数<比率> | 1,227 103 | 1,714 96 | 12,033,514 — | 1,340,533 <8.8%> |
| (中国) | | | 千人民元 | | |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A | 45 | 45 | 49 | 1,057 | ソフトウェア・サービス |
| ADVANCED MICRO-FABRICATION-A | 5 | 5 | 113 | 2,432 | 半導体・半導体製造装置 |
| AECC AVIATION POWER CO-A | 31 | 31 | 130 | 2,798 | 資本財 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 718 | 718 | 341 | 7,303 | 銀行 |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 46 | 46 | 70 | 1,515 | ヘルスケア機器・サービス |
| AIR CHINA LTD-A | 101 | 101 | 78 | 1,682 | 運輸 |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 148 | 148 | 117 | 2,516 | 素材 |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A | 10 | 10 | 25 | 556 | 素材 |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A | 3 | 3 | 58 | 1,249 | 食品・飲料・タバコ |
| ASYMCHM LABORATORIES TIAN-A | 1 | 1 | 11 | 256 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS | 92 | — | — | — | 金融サービス |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A | 86 | 86 | 49 | 1,057 | 銀行 |
| BANK OF CHINA LTD-A | 321 | 321 | 159 | 3,423 | 銀行 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A | 222 | 222 | 160 | 3,442 | 銀行 |
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A | 78 | 78 | 70 | 1,513 | 銀行 |
| BANK OF NANJING CO LTD -A | 88 | 88 | 90 | 1,948 | 銀行 |

ニッセイ新興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 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千人民元 | 千円 | |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A | 43 | 43 | 106 | 2,287 | 銀行 |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A | 45 | 45 | 36 | 778 | 銀行 |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO-A | 57 | 332 | 223 | 4,785 | 素材 |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A | 2 | 2 | 60 | 1,302 | ソフトウェア・サービス |
| BEIJING TONGRENTANG CO-A | 20 | 20 | 82 | 1,776 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BEIJING UNITED INFORMATION-A | 13 | - | - | - | 資本財 |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A | 5 | 5 | 40 | 865 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A | 242 | 242 | 136 | 2,922 | 運輸 |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 454 | 454 | 199 | 4,278 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| BYD CO LTD -A | 13 | 13 | 374 | 8,017 | 自動車・自動車部品 |
| CAITONG SECURITIES CO LTD-A | 75 | 75 | 63 | 1,355 | 金融サービス |
| CGN POWER CO LTD-A | - | 174 | 71 | 1,527 | 公益事業 |
| CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A | 1 | 1 | 11 | 241 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHANGJIANG SECURITIES CO L-A | 123 | 123 | 85 | 1,841 | 金融サービス |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A | 96 | 96 | 76 | 1,634 | 銀行 |
| CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A | 32 | 32 | 116 | 2,484 | 資本財 |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A | 68 | 68 | 27 | 579 | 運輸 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A | 370 | 370 | 133 | 2,860 | 銀行 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-A | 69 | 69 | 107 | 2,309 | 金融サービス |
| CHINA GREAT WALL SECURITIE-A | - | 419 | 361 | 7,734 | 金融サービス |
| CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A | 24 | 24 | 86 | 1,859 | 金融サービス |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A | 10 | 10 | 44 | 948 | 保険 |
| CHINA MERCHANTS BANK-A | 108 | 175 | 660 | 14,136 | 銀行 |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 105 | 105 | 208 | 4,468 | 金融サービス |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 19 | 19 | 20 | 444 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MINSHENG BANKING-A | 212 | 212 | 88 | 1,888 | 銀行 |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A | 106 | 106 | 105 | 2,254 | 公益事業 |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH -A | 16 | 115 | 266 | 5,716 | 素材 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 40 | 40 | 140 | 3,009 | 保険 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A | 259 | 259 | 162 | 3,488 | エネルギー |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-A | 88 | 392 | 264 | 5,666 | 資本財 |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A | 108 | 108 | 72 | 1,562 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CHINA RESOURCES MICROELECT-A | 14 | 14 | 78 | 1,682 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-A | 48 | 48 | 197 | 4,225 | エネルギー |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A | 47 | 47 | 29 | 639 | 運輸 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A | 229 | 229 | 139 | 2,991 | 資本財 |
| CHINA THREE GORGES RENEWAB-A | 128 | 571 | 270 | 5,784 | 公益事業 |

ニッセイ新興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 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千人民元 | 千円 | |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD | 8 | 28 | 196 | 4,216 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CHINA VANKE CO LTD -A | 81 | 81 | 70 | 1,517 | 不動産管理・開発 |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 134 | 226 | 618 | 13,246 | 公益事業 |
| CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A | 5 | - | - | - | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A | 246 | 246 | 72 | 1,554 | 銀行 |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A | 58 | 58 | 87 | 1,865 | 自動車・自動車部品 |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A | 6 | 32 | 95 | 2,053 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CITIC SECURITIES CO-A | 67 | 67 | 209 | 4,491 | 金融サービス |
| CMOC GROUP LTD-A | 113 | 113 | 86 | 1,848 | 素材 |
| CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A | 13 | 18 | 75 | 1,624 | 資本財 |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 22 | 34 | 935 | 20,026 | 資本財 |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A | 50 | 50 | 73 | 1,572 | 運輸 |
| CSC FINANCIAL CO LTD-A | 26 | 137 | 387 | 8,300 | 金融サービス |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A | 42 | 42 | 66 | 1,430 | 資本財 |
| EAST MONEY INFORMATION CO-A | 60 | 288 | 777 | 16,641 | 金融サービス |
| EVE ENERGY CO LTD-A | 9 | 9 | 45 | 982 | 資本財 |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A | 59 | 59 | 42 | 908 | メディア・娯楽 |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A | 25 | 25 | 115 | 2,483 | 食品・飲料・タバコ |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD-A | 116 | 116 | 101 | 2,173 | 金融サービス |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A | 63 | 63 | 149 | 3,200 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A | 28 | 28 | 160 | 3,439 | 自動車・自動車部品 |
| GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A | 28 | 28 | 116 | 2,495 | 素材 |
| GD POWER DEVELOPMENT CO -A | 132 | 132 | 62 | 1,348 | 公益事業 |
| GEM CO LTD-A | 133 | 133 | 94 | 2,030 | 資本財 |
| GF SECURITIES CO LTD-A | 37 | 37 | 62 | 1,329 | 金融サービス |
| GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A | 1 | 1 | 17 | 372 | 半導体・半導体製造装置 |
| GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A | 2 | 2 | 14 | 307 | 資本財 |
| GOERTEK INC -A | 10 | 10 | 24 | 522 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| GOLDWIND SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A | 39 | 39 | 41 | 886 | 資本財 |
| GONGNIU GROUP CO LTD-A | 7 | 10 | 74 | 1,591 | 資本財 |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD-A | 18 | 18 | 43 | 924 | 資本財 |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-A | 35 | 35 | 96 | 2,065 | 自動車・自動車部品 |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A | 32 | 32 | 137 | 2,942 | 耐久消費財・アパレル |
| GUANGDONG HAID GROUP CO-A | 10 | 10 | 46 | 993 | 食品・飲料・タバコ |
| GUANGHUI ENERGY CO LTD-A | 54 | 54 | 40 | 871 | エネルギー |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A | 87 | 87 | 78 | 1,671 | 自動車・自動車部品 |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A | 13 | 13 | 37 | 800 | ヘルスケア機器・サービス |

ニッセイ新興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 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千人民元 | 千円 | |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A | 10 | 10 | 22 | 490 | 素材 |
| GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL HOLDINGS GROUP CO LTD-A | 98 | - | - | - | 金融サービス |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD-A | 112 | 112 | 133 | 2,851 | 金融サービス |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 33 | 204 | 400 | 8,580 | 金融サービス |
| HAIER SMART HOME CO LTD-A | 55 | 55 | 159 | 3,409 | 耐久消費財・アパレル |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-A | 126 | 126 | 147 | 3,159 | 金融サービス |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A | 11 | 16 | 28 | 609 | 半導体・半導体製造装置 |
| HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A | - | 113 | 331 | 7,095 | 半導体・半導体製造装置 |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 8 | 8 | 19 | 423 | 食品・飲料・タバコ |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A | 79 | 79 | 118 | 2,539 | 素材 |
| HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A | 28 | 28 | 49 | 1,055 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO -A | 57 | 57 | 36 | 786 | 素材 |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A | 7 | 7 | 202 | 4,332 | 金融サービス |
| HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A | 4 | 4 | 23 | 507 | 素材 |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A | 13 | 13 | 45 | 981 | ヘルスケア機器・サービス |
| HUANENG POWER INTL INC-A | 77 | 77 | 54 | 1,172 | 公益事業 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A | 85 | 85 | 157 | 3,363 | 金融サービス |
| HUAXI SECURITIES CO LTD-A | 41 | - | - | - | 金融サービス |
| HUAXIA BANK CO LTD-A | 62 | 62 | 46 | 998 | 銀行 |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A | 14 | 14 | 23 | 507 | 自動車・自動車部品 |
| HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A | 5 | 5 | 66 | 1,413 | 自動車・自動車部品 |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A | 11 | 11 | 35 | 760 | ソフトウェア・サービス |
| HYGON INFORMATION TECHNOLO-A | - | 18 | 239 | 5,137 | 半導体・半導体製造装置 |
| IFLYTEK CO LTD - A | 12 | 12 | 57 | 1,227 | ソフトウェア・サービス |
| IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A | 1 | 1 | 30 | 646 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| IND & COMM BK OF CHINA-A | 544 | 544 | 334 | 7,164 | 銀行 |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A | 140 | 140 | 256 | 5,495 | 銀行 |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO-A | - | 428 | 279 | 5,985 | 金融サービス |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A | 324 | 324 | 62 | 1,332 | 素材 |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A | 21 | 21 | 10 | 229 | 素材 |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A | 28 | 28 | 80 | 1,731 | 食品・飲料・タバコ |
| JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A | 13 | 13 | 23 | 500 | 半導体・半導体製造装置 |
| JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A | 29 | 29 | 26 | 558 | 素材 |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A | 10 | 10 | 55 | 1,184 | 資本財 |
| JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS CO LTD-A | 33 | 33 | 160 | 3,437 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A | 13 | 13 | 59 | 1,266 | 食品・飲料・タバコ |
| JIANGSU YANGHE BREWERY -A | 9 | 9 | 78 | 1,680 | 食品・飲料・タバコ |

ニッセイ新興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 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千人民元 | 千円 | |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A | 22 | 22 | 35 | 762 | 資本財 |
| JIANGXI COPPER CO LTD-A | 20 | 20 | 44 | 942 | 素材 |
| JINKO SOLAR CO LTD-A | 60 | 60 | 52 | 1,125 | 半導体・半導体製造装置 |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A | 66 | 66 | 256 | 5,499 | 資本財 |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A | 6 | 9 | 1,387 | 29,719 | 食品・飲料・タバコ |
| LB GROUP CO LTD-A | 29 | 29 | 55 | 1,180 | 素材 |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD-A | 24 | 24 | 52 | 1,114 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A | 139 | 139 | 115 | 2,470 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 64 | 64 | 120 | 2,586 | 半導体・半導体製造装置 |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A | 30 | 30 | 119 | 2,548 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A | 9 | 9 | 127 | 2,730 | 食品・飲料・タバコ |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A | 13 | 13 | 35 | 762 | メディア・娯楽 |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS -A | 4 | 4 | 46 | 988 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 205 | 205 | 71 | 1,523 | 資本財 |
| MIDEA GROUP CO LTD-A | - | 33 | 235 | 5,039 | 耐久消費財・アパレル |
| MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A | 9 | 9 | 66 | 1,421 | 半導体・半導体製造装置 |
| MUYUAN FOODS CO LTD-A | 21 | 21 | 92 | 1,970 | 食品・飲料・タバコ |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | 31 | 31 | 82 | 1,757 | 資本財 |
| NATIONAL SILICON INDUSTRY -A | - | 126 | 293 | 6,281 | 半導体・半導体製造装置 |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A | 2 | 2 | 87 | 1,863 | 半導体・半導体製造装置 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 9 | 9 | 44 | 948 | 保険 |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A | 18 | 18 | 17 | 378 | 食品・飲料・タバコ |
| NINESTAR CORP-A | 17 | 17 | 46 | 1,006 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| NINGBO SHANSHAN CO LTD-A | 54 | - | - | - | 素材 |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A | 7 | 10 | 54 | 1,158 | 自動車・自動車部品 |
| NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A | 44 | 44 | 71 | 1,527 | 素材 |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A | 45 | 45 | 48 | 1,038 | 金融サービス |
| PETROCHINA CO LTD-A | 297 | 297 | 241 | 5,171 | エネルギー |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-A | 6 | 6 | 18 | 406 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PICC HOLDING CO-A | 149 | 149 | 109 | 2,354 | 保険 |
| PING AN BANK CO LTD-A | 97 | 97 | 113 | 2,426 | 銀行 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 49 | 99 | 550 | 11,790 | 保険 |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 27 | 27 | 27 | 588 | 不動産管理・開発 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A | 122 | 122 | 64 | 1,384 | 銀行 |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 100 | 100 | 58 | 1,252 | 資本財 |
| QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A | 27 | 197 | 374 | 8,011 | 素材 |
| RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A | 30 | 30 | 30 | 647 | 素材 |

ニッセイ新興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 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千人民元 | 千円 | |
| S F HOLDING CO LTD-A | 22 | 73 | 308 | 6,616 | 運輸 |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A | 80 | 80 | 132 | 2,830 | 自動車・自動車部品 |
| SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A | 51 | 51 | 69 | 1,489 | 半導体・半導体製造装置 |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 30 | 30 | 53 | 1,149 | 資本財 |
| SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A | 46 | 46 | 84 | 1,819 | 素材 |
| SDIC CAPITAL CO LTD-A | 137 | 137 | 109 | 2,335 | 金融サービス |
| SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A | — | 129 | 199 | 4,262 | 公益事業 |
| SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A | 23 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 47 | 47 | 111 | 2,386 | エネルギー |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 4 | 4 | 11 | 248 | 素材 |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG-A | 19 | 19 | 43 | 923 | 素材 |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A | 302 | 302 | 125 | 2,696 | 素材 |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A | 15 | 18 | 52 | 1,122 | ソフトウェア・サービス |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A | 63 | 63 | 59 | 1,265 | 資本財 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A | 36 | 36 | 96 | 2,070 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A | 86 | 86 | 51 | 1,099 | 運輸 |
| SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A | 51 | 51 | 55 | 1,190 | 不動産管理・開発 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A | 55 | 55 | 115 | 2,462 | ヘルスケア機器・サービス |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 189 | 189 | 185 | 3,962 | 銀行 |
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A | 11 | 11 | 22 | 471 | 素材 |
| SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A | 148 | 148 | 118 | 2,538 | 銀行 |
| SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A | — | 12 | 177 | 3,807 | ヘルスケア機器・サービス |
| SHANXI SECURITIES CO LTD-A | 56 | — | — | — | 金融サービス |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 4 | 12 | 267 | 5,731 | 食品・飲料・タバコ |
| SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A | 79 | — | — | — | 素材 |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A | 1 | 1 | 14 | 312 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A | 110 | 110 | 60 | 1,298 | 金融サービス |
| SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A | 1 | — | — | — | 素材 |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A | 15 | 15 | 88 | 1,891 | 資本財 |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A | 4 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | 5 | 13 | 350 | 7,513 | ヘルスケア機器・サービス |
| SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A | 3 | 4 | 44 | 958 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A | 18 | 18 | 31 | 665 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | 5 | 7 | 59 | 1,275 | 資本財 |
| SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A | 1 | 1 | 21 | 455 | 半導体・半導体製造装置 |
| TBEA CO LTD-A | 28 | 28 | 39 | 852 | 資本財 |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A | 44 | 44 | 21 | 456 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A | 18 | 18 | 20 | 433 | 半導体・半導体製造装置 |

ニッセイ新興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 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千人民元 | 千円 | |
| TIANMA MICROELECTRONICS-A | 72 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TIANQI LITHIUM CORP-A | 13 | 13 | 53 | 1,147 | 素材 |
| TONGWEI CO LTD-A | 39 | 39 | 106 | 2,289 | 半導体・半導体製造装置 |
| TRINA SOLAR CO LTD-A | 10 | 10 | 26 | 566 | 半導体・半導体製造装置 |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-A | 6 | 6 | 43 | 926 | 食品・飲料・タバコ |
| UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A | 4 | 4 | 28 | 607 | 半導体・半導体製造装置 |
| UNISPLENDOUR CORP LTD-A | 9 | 9 | 25 | 546 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A | 15 | 44 | 339 | 7,267 | 素材 |
| WEICHAI POWER CO LTD-A | 34 | 34 | 47 | 1,009 | 資本財 |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A | 18 | 18 | 32 | 692 | 食品・飲料・タバコ |
| WESTERN SECURITIES CO LTD-A | 97 | 97 | 87 | 1,863 | 金融サービス |
| WILL SEMICONDUCTOR LTD-A | 4 | 4 | 43 | 922 | 半導体・半導体製造装置 |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A | 2 | 2 | 8 | 185 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A | 51 | — | — | — | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A | 52 | 52 | 43 | 926 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A | 23 | 41 | 608 | 13,034 | 食品・飲料・タバコ |
| WUXI APPTec CO LTD-A | 18 | 18 | 97 | 2,087 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A | 26 | 26 | 20 | 433 | 資本財 |
| XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A | 47 | 47 | 99 | 2,126 | 素材 |
| YANKUANG ENERGY GROUP CO-A | 52 | 67 | 105 | 2,254 | エネルギー |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A | 13 | 13 | 45 | 964 | 食品・飲料・タバコ |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A | 16 | 16 | 20 | 444 | ソフトウェア・サービス |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A | 25 | 25 | 41 | 880 | 運輸 |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A | 7 | 7 | 41 | 888 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A | 3 | 3 | 11 | 256 | 素材 |
| ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A | 3 | 3 | 74 | 1,591 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A | 11 | 11 | 25 | 539 | 資本財 |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A | 30 | 30 | 51 | 1,094 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A | 6 | 6 | 22 | 480 | 資本財 |
| ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A | 8 | 8 | 28 | 618 | 半導体・半導体製造装置 |
| ZHEJIANG NHU CO LTD-A | 10 | 10 | 22 | 481 | 素材 |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A | 20 | 20 | 25 | 540 | 金融サービス |
| ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A | 124 | 124 | 85 | 1,834 | 金融サービス |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A | 71 | 211 | 342 | 7,324 | 素材 |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A | 94 | 94 | 66 | 1,419 | 資本財 |
| ZTE CORP-A | 7 | 92 | 299 | 6,403 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 13,991 229 | 17,304 225 | 27,366 — | 586,081 <3.8%> |

ニッセイ新興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 | |
| (マレーシア) | 百株 | 百株 | マレーシア・リンギット | 千円 | |
| AMBANK HOLDINGS BHD | 97 | 356 | 185 | 6,430 | 銀行 |
| AXIATA GROUP BERHAD | 205 | 205 | 46 | 1,599 | 電気通信サービス |
| CELCOMDIGI BERHAD | 225 | 518 | 176 | 6,105 | 電気通信サービス |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 593 | 829 | 683 | 23,681 | 銀行 |
| DIALOG GROUP BHD | 149 | — | — | — | エネルギー |
| GAMUDA BHD | 188 | 188 | 167 | 5,794 | 資本財 |
| GENTING BHD | 67 | 333 | 128 | 4,456 | 消費者サービス |
| GENTING MALAYSIA BHD | 113 | 113 | 24 | 854 | 消費者サービス |
| HONG LEONG BANK BERHAD | 45 | 100 | 206 | 7,141 | 銀行 |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP | 19 | — | — | — | 銀行 |
| IHH HEALTHCARE BHD | 172 | 172 | 124 | 4,329 | ヘルスケア機器・サービス |
| INARI AMERTRON BHD | 166 | 166 | 48 | 1,674 | 半導体・半導体製造装置 |
| IOI CORPORATION BHD | 197 | 197 | 77 | 2,690 | 食品・飲料・タバコ |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 34 | 34 | 74 | 2,581 | 食品・飲料・タバコ |
| MALAYAN BANKING BHD | 465 | 688 | 704 | 24,423 | 銀行 |
| MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 49 | 49 | 51 | 1,800 | 運輸 |
| MAXIS BHD | 196 | 531 | 193 | 6,719 | 電気通信サービス |
| MISC BHD | 50 | 210 | 159 | 5,532 | 運輸 |
| MR DIY GROUP M BHD | 163 | 163 | 30 | 1,045 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 6 | 6 | 59 | 2,065 | 食品・飲料・タバコ |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 285 | 496 | 226 | 7,858 | 素材 |
| PETRONAS DAGANGAN BHD | 33 | 33 | 58 | 2,040 | エネルギー |
| PETRONAS GAS BHD | 54 | 54 | 95 | 3,302 | 公益事業 |
| PPB GROUP BERHAD | 56 | 56 | 79 | 2,756 | 食品・飲料・タバコ |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 261 | 548 | 252 | 8,758 | 素材 |
| PUBLIC BANK BHD | 1,226 | 1,597 | 709 | 24,581 | 銀行 |
| QL RESOURCES BHD | 30 | 45 | 21 | 741 | 食品・飲料・タバコ |
| RHB BANK BHD | 170 | 170 | 110 | 3,824 | 銀行 |
| SIME DARBY BERHAD | 48 | 48 | 10 | 371 | 資本財 |
| SIME DARBY PLANTATION BHD | 190 | 190 | 92 | 3,220 | 食品・飲料・タバコ |
| SUNWAY BHD | — | 343 | 166 | 5,767 | 資本財 |
| TELEKOM MALAYSIA BHD | 125 | 125 | 80 | 2,773 | 電気通信サービス |
| TENAGA NASIONAL BHD | 236 | 335 | 483 | 16,746 | 公益事業 |
| YTL CORPORATION BERHAD | — | 428 | 85 | 2,967 | 公益事業 |
| YTL POWER INTERNATIONAL BHD | — | 309 | 97 | 3,374 | 公益事業 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 5,913 32 | 9,635 33 | 5,711 — | 198,011 <1.3%> |

ニッセイ新興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 | | |
| (南アフリカ) | 百株 | 百株 | 千南アフリカ・ランド | 千円 | | |
| ABSA GROUP LTD | 68 | 103 | 1,728 | 14,833 | 銀行 | |
| AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | 6 | — | — | — | 素材 | |
| ANGLO PLATINUM LTD | 7 | 7 | 476 | 4,088 | 素材 | |
| ANGLOGOLD ASHANTI PLC | 31 | 50 | 2,296 | 19,703 | 素材 | |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 22 | 46 | 796 | 6,833 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| BID CORP LTD | 26 | 37 | 1,677 | 14,394 | 生活必需品流通・小売り | |
| BIDVEST GROUP LTD | 19 | 44 | 1,217 | 10,445 | 資本財 | |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 8 | 10 | 3,392 | 29,105 | 銀行 | |
| CLICKS GROUP LTD | 20 | 20 | 769 | 6,601 | 生活必需品流通・小売り | |
| DISCOVERY HOLDINGS LIMITED | 50 | 50 | 976 | 8,381 | 保険 | |
| EXXARO RESOURCES LTD | 15 | 15 | 251 | 2,157 | エネルギー | |
| FIRSTRAND LTD | 392 | 585 | 4,482 | 38,461 | 金融サービス | |
| GOLD FIELDS LTD | 73 | 102 | 2,772 | 23,783 | 素材 | |
| HARMONY GOLD MINING CO LTD | 38 | 72 | 1,269 | 10,890 | 素材 | |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 66 | 118 | 1,332 | 11,433 | 素材 | |
| KUMBA IRON ORE LTD | 4 | 4 | 145 | 1,246 | 素材 | |
| MTN GROUP LTD | 133 | 192 | 1,601 | 13,743 | 電気通信サービス | |
| NASPERS LTD-N SHS | 15 | 20 | 8,269 | 70,953 | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| NEDBANK GROUP LTD | 38 | 58 | 1,702 | 14,608 | 銀行 | |
| NEPI ROCKCASTLE S.A. | 33 | 79 | 1,098 | 9,424 | 不動産管理・開発 | |
| NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT | 36 | 36 | 436 | 3,746 | 素材 | |
| OLD MUTUAL LTD | 287 | 287 | 367 | 3,156 | 保険 | |
| OUTSURANCE GROUP LTD | 66 | 66 | 429 | 3,683 | 保険 | |
| PEPKOR HOLDINGS LTD | 145 | 145 | 332 | 2,848 | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| REINET INVESTMENTS SCA | 7 | 18 | 903 | 7,748 | 金融サービス | |
| REMGRO LTD | 31 | 64 | 951 | 8,164 | 金融サービス | |
| SANLAM LIMITED | 142 | 233 | 2,067 | 17,740 | 保険 | |
| SASOL LTD | 42 | 75 | 698 | 5,990 | 素材 | |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD | 39 | 57 | 1,703 | 14,619 | 生活必需品流通・小売り | |
| SIBANYE STILLWATER LTD | 249 | 249 | 472 | 4,052 | 素材 | |
| STANDARD BANK GROUP LTD | 121 | 152 | 3,642 | 31,256 | 銀行 | |
| VODACOM GROUP LTD | 66 | 66 | 689 | 5,911 | 電気通信サービス | |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 68 | 68 | 456 | 3,915 | 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> | 2,378 33 | 3,142 32 | 49,408 — | 423,927 <2.8%> | |
| (タイ) | | | 千タイ・パーツ | | | |
| ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG | | 112 | 173 | 4,913 | 22,060 | 電気通信サービス |

ニッセイ新興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 | |
| (タイ) | 百株 | 百株 | 千タイ・パーツ | 千円 | |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR | 380 | 594 | 3,638 | 16,335 | 運輸 |
| ASSET WORLD CORP PCL-FOREIGN | 881 | — | — | — | 消費者サービス |
| B GRIMM POWER PCL-FOREIGN | 31 | — | — | — | 公益事業 |
| BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F | 934 | 1,291 | 3,453 | 15,505 | ヘルスケア機器・サービス |
| BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN | 713 | 713 | 541 | 2,433 | 運輸 |
| BANPU PUBLIC CO LTD-FOR REG | 856 | — | — | — | エネルギー |
| BERLI JUCKER PUB CO-FORGN | 60 | — | — | — | 生活必需品流通・小売り |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL | 574 | — | — | — | 運輸 |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN | 44 | 44 | 919 | 4,129 | ヘルスケア機器・サービス |
| CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI | 143 | 319 | 1,969 | 8,844 | 不動産管理・開発 |
| CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN | 157 | 157 | 529 | 2,379 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN | 268 | 268 | 653 | 2,936 | 食品・飲料・タバコ |
| CP ALL PCL-FOREIGN | 505 | 688 | 4,386 | 19,693 | 生活必需品流通・小売り |
| CP AXTRA PCL-FOREIGN | — | 196 | 681 | 3,060 | 生活必需品流通・小売り |
| CP AXTRA PUBLIC COMPANY LIMITED (F) | 199 | — | — | — | 生活必需品流通・小売り |
| DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN | 255 | 384 | 6,355 | 28,534 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R | 10 | — | — | — | 公益事業 |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN | 192 | — | — | — | 公益事業 |
| GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F | 88 | — | — | — | 公益事業 |
| GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN | 196 | 424 | 2,660 | 11,946 | 公益事業 |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR | 444 | 444 | 428 | 1,923 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| INDORAMA VENTURES-FOREIGN | 122 | — | — | — | 素材 |
| INTOUCH HOLDINGS PCL-F | 63 | 63 | 622 | 2,793 | 電気通信サービス |
| KASIKORNBANK PCL-FOREIGN | 49 | 49 | 732 | 3,289 | 銀行 |
| KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI | 323 | 323 | 662 | 2,973 | 銀行 |
| KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN | 155 | 155 | 716 | 3,218 | 金融サービス |
| LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG | 285 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR | 185 | 534 | 1,441 | 6,473 | 消費者サービス |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG | 21 | — | — | — | 金融サービス |
| OSOTSPA PCL-FOREIGN | 32 | — | — | — | 食品・飲料・タバコ |
| PTT EXPLORATION & PROD-FOR | 90 | 158 | 2,014 | 9,045 | エネルギー |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR | 143 | 143 | 364 | 1,637 | 素材 |
| PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN | 329 | 329 | 490 | 2,201 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| PTT PCL/FOREIGN | 753 | 1,026 | 3,334 | 14,971 | エネルギー |
| RATCH GROUP PCL-FOREIGN | 165 | — | — | — | 公益事業 |
| SCB X PCL-FOREIGN | 68 | 68 | 778 | 3,495 | 銀行 |
| SCG PACKAGING PCL-FOREIGN | 73 | 73 | 177 | 796 | 素材 |

ニッセイ新興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 | |
| (タイ) | | | | 千タイ・パーツ | 千円 | |
| | SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG | 70 | 127 | 2,495 | 11,205 | 素材 |
| | THAI OIL PCL-FRGN | 93 | 93 | 381 | 1,712 | エネルギー |
| | TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN | — | 4,284 | 766 | 3,443 | 銀行 |
| | TRUE CORP PCL/NEW-FOREIGN | 607 | 607 | 717 | 3,221 | 電気通信サービス |
| 小計 | 株数・金額 | 10,668 | 13,728 | 46,828 | 210,258 | |
| | 銘柄数<比率> | 40 | 28 | — | <1.4%> | |
| (ポーランド) | | | | 千ポーランド・ズロチ | | |
| | ALIOR BANK SA | — | 14 | 124 | 4,731 | 銀行 |
| | ALLEGRO.EU SA | 34 | 69 | 194 | 7,361 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| | BANK PEKAO SA | 13 | 23 | 326 | 12,370 | 銀行 |
| | BUDIMEX | 0.97 | 0.97 | 46 | 1,751 | 資本財 |
| | CD PROJEKT SA | 4 | 4 | 65 | 2,486 | メディア・娯楽 |
| | CYFROWY POLSAT SA | 10 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| | DINO POLSKA SA | 3 | 5 | 196 | 7,462 | 生活必需品流通・小売り |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 15 | 15 | 200 | 7,614 | 素材 |
| | LPP SA | 0.09 | 0.09 | 126 | 4,775 | 耐久消費財・アパレル |
| | MBANK SA | 1 | 1 | 60 | 2,307 | 銀行 |
| | ORLEN SA | 46 | 61 | 319 | 12,099 | エネルギー |
| | PEPCO GROUP NV | 15 | — | — | — | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| | PGE SA | 88 | 88 | 59 | 2,254 | 公益事業 |
| | PKO BANK POLSKI SA | 71 | 108 | 586 | 22,211 | 銀行 |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 49 | 80 | 323 | 12,253 | 保険 |
| | SANTANDER BANK POLSKA S.A. | 3 | 3 | 158 | 6,002 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 | 358 | 478 | 2,788 | 105,684 | |
| | 銘柄数<比率> | 15 | 14 | — | <0.7%> | |
| (ハンガリー) | | | | 千ハンガリー・フォリント | | |
| | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL | 42 | 42 | 11,448 | 4,607 | エネルギー |
| | OTP BANK RT | 18 | 24 | 51,101 | 20,564 | 銀行 |
| | RICHTER GEDEON NYRT | 8 | 18 | 19,748 | 7,947 | 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 | 69 | 85 | 82,297 | 33,119 | |
| | 銘柄数<比率> | 3 | 3 | — | <0.2%> | |
| (ユーロ/ギリシャ) | | | | 千ユーロ | | |
| | ALPHA SERVICES AND HOLDINGS | 126 | 259 | 39 | 6,555 | 銀行 |
| | EUROBANK ERGASIAS SERVICES A | 173 | 293 | 58 | 9,536 | 銀行 |
| | FF GROUP | 1 | 1 | 0.000 | 0.001 | 耐久消費財・アパレル |

ニッセイ新興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/ギリシャ) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| | HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION | 17 | 17 | 25 | 4,264 | 電気通信サービス |
| | JUMBO SA | 11 | 11 | 27 | 4,461 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| | MOTOR OIL (HELLAS) SA | 5 | — | — | — | エネルギー |
| | MYTILINEOS S.A. | 7 | 14 | 44 | 7,332 | 資本財 |
| | NATIONAL BANK OF GREECE | 46 | 83 | 57 | 9,427 | 銀行 |
| | OPAP SA | 20 | 20 | 30 | 5,030 | 消費者サービス |
| | PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S | 55 | 129 | 45 | 7,539 | 銀行 |
| | PUBLIC POWER CORP | 14 | 14 | 16 | 2,675 | 公益事業 |
| 小計 | 株数・金額 | 479 | 846 | 345 | 56,823 | |
| | 銘柄数<比率> | 11 | 10 | — | <0.4%> | |
| 合計 | 株数・金額 | 267,956 | 361,588 | — | 12,626,731 | |
| | 銘柄数<比率> | 1,048 | 1,007 | — | <82.8%> | |

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

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

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

(注4) 業種はG I C S分類（産業グループ）によるものです。なお、G I C Sに関する知的財産所有権はS & PおよびMSCI Inc.に帰属します。

ニッセイ新興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 | | |
|-------------------------------|------------------|----------|----------|------------|-------------------|
| | □数 | □数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | 千□ | 千□ | 千米ドル | 千円 |
| ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF | | 51 | 77 | 1,200 | 186,014 |
| ISHARES MSCI QATAR CP ETF | | 29 | 41 | 769 | 119,230 |
| ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF | | 57 | 85 | 3,538 | 548,177 |
| ISHARES MSCI KUWAIT ETF | | 14 | 20 | 660 | 102,348 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 152 4 | 224 4 | 6,169 - | 955,771 <6.3%> |
| (メキシコ) | | | | 千メキシコ・ペソ | |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | | 21 | 43 | 951 | 7,330 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 21 1 | 43 1 | 951 - | 7,330 <0.0%> |
| (南アフリカ) | | | | 千南アフリカ・ランド | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | | 19 | - | - | - |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 19 1 | - - | - - | - <-> |
| 合計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 193 6 | 267 5 | - - | 963,101 <6.3%> |

(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) □数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、□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 | 百万円 | 百万円 |
| 国 MINI MSCI EM INDEX FUTURES | 1,639 | - |

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 12,626,731 | 82.3 |
| 投資信託証券 | 963,101 | 6.3 |
| コール・ローン等、その他 | 1,747,704 | 11.4 |
| 投資信託財産総額 | 15,337,537 | 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相場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香港ドル19.90円、1台湾ドル4.78円、1イギリス・ポンド196.60円、1トルコ・リラ4.494円、1メキシコ・ペソ7.701円、1フィリピン・ペソ2.634円、100チリ・ペソ15.934円、100コロンビア・ペソ3.526円、1インド・ルピー1.84円、100インドネシア・ルピア0.98円、1ブラジル・レアル26.823円、1チェコ・コルナ6.494円、100韓国ウォン11.14円、1人民元21.415円、1マレーシア・リンギット34.667円、1南アフリカ・ランド8.58円、1タイ・バーツ4.49円、1ポーランド・ズロチ37.904円、100ハンガリー・フォリント40.243円、1ユーロ164.27円です。

(注2) 外貨建純資産（14,328,023千円）の投資信託財産総額（15,337,537千円）に対する比率は93.4%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日現在)

| 項目 | | 当期末 |
|----------------------|----------|------------------------|
| (A)資産 | 産 | 16,228,568,030円 |
| コーポレート債 | | 1,196,248,713 |
| 株式(評価額) | | 12,626,731,684 |
| 投資信託証券(評価額) | | 963,101,498 |
| 未収入金 | | 917,861,683 |
| 未収配当金 | | 14,836,346 |
| 差入委託証拠金 | | 509,788,106 |
| (B)負債 | 債 | 987,443,698 |
| 未払金 | | 924,119,857 |
| 未払解約金 | | 63,323,841 |
| (C)純資産総額(A-B) | | 15,241,124,332 |
| 元本 | | 9,869,975,752 |
| 次期繰越損益金 | | 5,371,148,580 |
| (D)受益権総口数 | | 9,869,975,752口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | | 15,442円 |

- (注1) 期首元本額 7,117,768,792円
 期中追加設定元本額 4,516,824,358円
 期中一部解約元本額 1,764,617,398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。
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド 2,990,171,043円
 ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式) 28,622,608円
 ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート) 32,501,079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) 10,744,196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) 61,819,779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) 669,354,692円
 ニッセイ新興国株式インデックス(ラップ専用) 3,935,867,448円
 FWニッセイ新興国株インデックス 40,342,588円
 DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト 139,933,259円
 DCニッセイ新興国株式インデックス 1,960,619,060円

損益の状況

当期(2023年11月21日~2024年11月20日)

| 項目 | 当期 |
|--------------------------|----------------------|
| (A)配当等収益 | 308,504,978円 |
| 受取配当金 | 283,435,933 |
| 受取利息 | 7,569,910 |
| その他収益金 | 17,526,465 |
| 支払利息 | △ 27,330 |
| (B)有価証券売買損益 | 1,632,478,406 |
| 売買益 | 2,687,257,880 |
| 売買損 | △ 1,054,779,474 |
| (C)先物取引等損益 | 28,462,208 |
| 取引益 | 84,123,152 |
| 取引損 | △ 55,660,944 |
| (D)信託報酬等 | △ 17,595,386 |
| (E)当期損益金(A+B+C+D) | 1,951,850,206 |
| (F)前期繰越損益金 | 2,171,334,880 |
| (G)追加信託差損益金 | 2,007,526,742 |
| (H)解約差損益金 | △ 759,563,248 |
| (I)合計(E+F+G+H) | 5,371,148,580 |
| 次期繰越損益金(I) | 5,371,148,580 |

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

ニッセイJ-REIT インデックスマザーファンド

運用報告書

第 35 期

(計算期間：2024年5月14日～2024年11月12日)

| | | | |
|---------------|--|-------------|--|
| 運用方針 | <p>①国内の金融商品取引所に上場しているJリート（不動産投資信託）を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標とします。</p> <p>②Jリートへの投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄（採用予定を含みます）に投資を行うものとします。なお、東証REIT指数の採用銘柄の追加・変更があった場合は、適宜追加・見直しを行います。</p> | 運用方法 | <p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none">・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える投資信託証券がある場合には、当該投資信託証券を東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。・外貨建資産への投資は行いません。 |
| 主要運用対象 | 国内の金融商品取引所に上場しているJリート | | |



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14日～2024年11月12日

Jリート市況

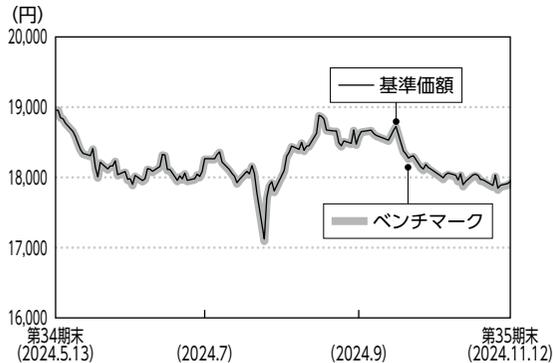


(注) FactSetのデータを使用しています。

Jリート市場は期を通じて見ると下落しました。

期初から5月下旬にかけて、国内長期金利の上昇や公募増資の発表が頻発したことによる需給悪化を受けて下落しましたが、その後は横ばい推移しました。8月上旬には円高に伴う投資家のリスク回避姿勢の高まりを受けてJリート市場は一時下落しましたが、Jリートの相対的な割安感やディフェンシブ性が着目されたことでその後は急上昇しました。しかし、当期末にかけて日銀の追加利上げへの警戒感の高まりを受けて金利上昇リスクが意識されたことで、前期末と比較すると下落して当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

国内の金融商品取引所に上場しているＪリートを主要投資対象とし、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った結果、当期の基準価額は下落しました。詳しくは前掲の「Ｊリート市場」をご参照ください。

ポートフォリオ

国内の金融商品取引所に上場しているＪリートを主要投資対象とし、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。

ポートフォリオの構築・運用は、東証ＲＥＩＴ指数採用全銘柄を投資対象とし、市場での時価総額比率をベースに完全法を用いて行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は－5.3%となり、ベンチマーク騰落率（－5.5%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

東証ＲＥＩＴ指数採用全銘柄について完全法にて投資を行い、ベンチマークの動きに連動する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 | ベンチマーク | 期中 | 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 |
| 31期 (2022年11月14日) | 19,056 | 2.2 | 18,630 | 2.2 | 98.8 | 32,174 |
| 32期 (2023年 5月12日) | 18,527 | △2.8 | 18,108 | △2.8 | 98.4 | 31,880 |
| 33期 (2023年11月13日) | 18,433 | △0.5 | 17,993 | △0.6 | 98.3 | 30,812 |
| 34期 (2024年 5月13日) | 18,956 | 2.8 | 18,519 | 2.9 | 98.5 | 31,981 |
| 35期 (2024年11月12日) | 17,942 | △5.3 | 17,505 | △5.5 | 98.2 | 30,644 |

(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 | 投資信託証券 組入比率 |
|------------------|--------|------|--------|------|----------------|
| | | % | | % | |
| (期首) 2024年 5月13日 | 18,956 | － | 18,519 | － | 98.5 |
| 5月末 | 18,215 | △3.9 | 17,784 | △4.0 | 98.4 |
| 6月末 | 18,113 | △4.4 | 17,682 | △4.5 | 98.5 |
| 7月末 | 18,168 | △4.2 | 17,737 | △4.2 | 98.1 |
| 8月末 | 18,675 | △1.5 | 18,236 | △1.5 | 98.3 |
| 9月末 | 18,375 | △3.1 | 17,938 | △3.1 | 98.1 |
| 10月末 | 17,971 | △5.2 | 17,535 | △5.3 | 98.1 |
| (期末) 2024年11月12日 | 17,942 | △5.3 | 17,505 | △5.5 | 98.2 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2024年5月14日～2024年11月12日

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|---------|----|----|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 売買委託手数料 | －円 | －% | 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 |
| 有価証券取引税 | － | － | 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 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 | － | － | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| 合計 | － | － | |

(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（18,232円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2024年5月14日～2024年11月12日

投資信託証券

| 銘柄 | 買付 | | 売付 | |
|-----------------------|------------------|---------|-------|--------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| エスコンジャパンリート投資法人 | 0.079 | 9,333 | 0.010 | 1,197 |
| サンケイリアルエステート投資法人 | 0.041 | 3,400 | 0.021 | 1,752 |
| S O S I L A 物流リート投資法人 | 0.067 | 7,664 | 0.035 | 4,020 |
| 東海道リート投資法人 | 0.021 | 2,432 | 0.010 | 1,193 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 0.044 | 27,673 | 0.022 | 14,128 |
| 森ヒルズリート投資法人 | 0.151 | 19,534 | 0.076 | 9,825 |
| 産業ファンド投資法人 | 0.233 | 28,139 | 0.088 | 10,938 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | 0.127 | 40,467 | 0.060 | 19,428 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 0.064 | 22,437 | 0.150 | 52,941 |
| G L P 投資法人 | 0.431 | 57,021 | 0.217 | 28,637 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 0.104 | 32,845 | 0.027 | 8,497 |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 0.223 | 55,805 | 0.112 | 28,221 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 0.108 (0.650) | 54,839 | 0.009 | 4,535 |
| One リート投資法人 | 0.021 | 5,193 | 0.010 | 2,527 |
| イオンリート投資法人 | 0.158 | 20,716 | 0.080 | 10,557 |
| ヒューリックリート投資法人 | 0.119 | 16,647 | 0.220 | 31,196 |
| 日本リート投資法人 | 0.042 | 13,748 | 0.021 | 6,857 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 0.385 | 29,925 | 0.194 | 15,493 |
| トーセイ・リート投資法人 | 0.046 | 6,292 | 0.011 | 1,507 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | 0.032 | 3,851 | 0.016 | 1,988 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | 0.034 | 3,411 | 0.017 | 1,749 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 0.412 | 59,342 | 0.307 | 44,602 |
| いちごホテルリート投資法人 | 0.020 | 2,410 | 0.010 | 1,132 |
| ラサールロジポート投資法人 | 0.164 | 24,048 | 0.076 | 11,106 |
| スターアジア不動産投資法人 | 1 | 62,277 | 0.070 | 3,951 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 0.103 | 12,081 | 0.009 | 1,122 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 0.471 (5) | 183,291 | 0.022 | 9,473 |
| 日本ホテル&レジデンシャル投資法人 | 0.043 | 3,234 | 0.007 | 506 |
| 投資法人みらい | 0.176 | 7,628 | 0.074 | 3,271 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 0.044 | 16,364 | 0.022 | 8,317 |

国内

ニッセイＪ－ＲＥＩＴ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 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | 0.056 | 8,007 | 0.029 | 4,198 |
| ザイマックス・リート投資法人 | 0.046 | 5,421 | 0.008 | 938 |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 0.434 | 39,705 | 0.028 | 2,645 |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 0.050 | 5,971 | 1 | 159,682 |
| 日本ビルファンド投資法人 | 0.401 | 91,504 | 0.090 | 44,964 |
| | (14) | | | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 0.131 | 70,635 | 0.066 | 35,481 |
| 日本都市ファンド投資法人 | 1 | 162,054 | 0.217 | 20,287 |
| オリックス不動産投資法人 | 0.254 | 39,898 | 0.127 | 19,781 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 0.087 | 29,049 | 0.044 | 14,457 |
| NTT都市開発リート投資法人 | 0.129 | 14,761 | 0.057 | 6,579 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 0.086 | 13,397 | 0.043 | 6,566 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 0.084 | 8,445 | 0.081 | 8,140 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 0.287 | 40,300 | 0.145 | 20,613 |
| 国内 森トラストリート投資法人 | 0.247 | 16,379 | 0.124 | 8,448 |
| インヴィンシブル投資法人 | 2 | 173,155 | 0.244 | 15,659 |
| フロンティア不動産投資法人 | 0.047 | 20,229 | 0.023 | 9,964 |
| 平和不動産リート投資法人 | 0.177 | 23,063 | 0.172 | 22,543 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 0.175 | 45,943 | 0.031 | 8,237 |
| 福岡リート投資法人 | 0.214 | 32,052 | 0.035 | 5,379 |
| KDX不動産投資法人 | 0.316 | 47,654 | 0.381 | 58,477 |
| いちごオフィスリート投資法人 | 0.100 | 8,158 | 0.325 | 26,522 |
| 大和証券オフィス投資法人 | 0.048 | 14,965 | 0.025 | 7,354 |
| | (0.630) | | | |
| 阪急阪神リート投資法人 | 0.059 | 7,537 | 0.029 | 3,773 |
| スターツプロシード投資法人 | 0.023 | 4,364 | 0.012 | 2,339 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 0.193 | 46,375 | 0.121 | 29,010 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 1 | 111,270 | 0.211 | 15,870 |
| 大和証券リビング投資法人 | 0.189 | 18,603 | 0.082 | 8,366 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 0.111 | 13,321 | 0.088 | 10,540 |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()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3) 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。

組入有価証券明細表

2024年11月12日現在

国内投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-------|-----------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| エスコンジャパンリート投資法人 | 0.615 | 0.684 | 77,565 |
| サンケイリアルエステート投資法人 | 0.970 | 0.990 | 77,715 |
| S O S I L A 物流リート投資法人 | 1 | 1 | 167,152 |
| 東海道リート投資法人 | 0.517 | 0.528 | 56,284 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 1 | 1 | 630,597 |
| 森ヒルズリート投資法人 | 3 | 3 | 463,335 |
| 産業ファンド投資法人 | 5 | 5 | 650,670 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | 2 | 3 | 918,692 |
| アクティブ・プロパティーズ投資法人 | 1 | 1 | 491,905 |
| G L P 投資法人 | 10 | 10 | 1,345,377 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 1 | 1 | 459,014 |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 5 | 5 | 1,332,540 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 0.558 | 1 | 297,211 |
| O n e リート投資法人 | 0.528 | 0.539 | 122,406 |
| イオンリート投資法人 | 3 | 3 | 478,424 |
| ヒューリックリート投資法人 | 2 | 2 | 361,311 |
| 日本リート投資法人 | 0.983 | 1 | 317,264 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 9 | 9 | 679,735 |
| トーセイ・リート投資法人 | 0.637 | 0.672 | 83,596 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | 0.746 | 0.762 | 80,619 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | 0.825 | 0.842 | 77,716 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 9 | 9 | 1,405,795 |
| いちごホテルリート投資法人 | 0.501 | 0.511 | 69,547 |
| ラサールロジポート投資法人 | 3 | 3 | 571,786 |
| スターアジア不動産投資法人 | 4 | 5 | 287,028 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 0.467 | 0.561 | 61,878 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 1 | 6 | 674,947 |
| 日本ホテル&レジデンシャル投資法人 | 0.463 | 0.499 | 35,279 |
| 投資法人みらい | 4 | 4 | 170,240 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 1 | 1 | 377,718 |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人 | 1 | 1 | 186,599 |
| ザイマックス・リート投資法人 | 0.491 | 0.529 | 57,555 |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 1 | 2 | 172,942 |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 1 | — | — |
| 日本ビルファンド投資法人 | 3 | 18 | 2,337,972 |

ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|------------------|-----------|------------------------------------|
| | □数 | □数 | 評価額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 3 | 3 | 1,796,484 |
| 日本都市ファンド投資法人 | 14 | 16 | 1,471,095 |
| オリックス不動産投資法人 | 6 | 6 | 987,127 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 2 | 2 | 707,855 |
| ＮＴＴ都市開発リート投資法人 | 3 | 3 | 344,881 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 2 | 2 | 322,817 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 2 | 2 | 222,904 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 6 | 6 | 960,907 |
| 森トラストリート投資法人 | 5 | 5 | 366,355 |
| インヴィンシブル投資法人 | 14 | 17 | 1,088,025 |
| フロンティア不動産投資法人 | 1 | 1 | 462,814 |
| 平和不動産リート投資法人 | 2 | 2 | 273,053 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 1 | 2 | 567,993 |
| 福岡リート投資法人 | 1 | 1 | 248,520 |
| KDX不動産投資法人 | 8 | 8 | 1,271,826 |
| いちごオフィスリート投資法人 | 2 | 2 | 176,566 |
| 大和証券オフィス投資法人 | 0.627 | 1 | 389,760 |
| 阪急阪神リート投資法人 | 1 | 1 | 177,201 |
| スタートアップシード投資法人 | 0.525 | 0.536 | 92,728 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 4 | 4 | 1,076,247 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 10 | 11 | 777,680 |
| 大和証券リビング投資法人 | 4 | 4 | 419,431 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 2 | 2 | 311,845 |
| 合計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 192 58 | 221 57 30,092,546 <98.2%> |

(注1) 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2) □数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、□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。

投資信託財産の構成

2024年11月12日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託証券 | 30,092,546 | 97.4 |
| コール・ローン等、その他 | 790,281 | 2.6 |
| 投資信託財産総額 | 30,882,828 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ J-R E I T 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12日現在)

| 項目 | 当期末 |
|------------------------|------------------------|
| (A) 資産 | 30,882,828,126円 |
| コール・ローン等 | 444,959,753 |
| 投資信託証券(評価額) | 30,092,546,500 |
| 未収入金 | 3,287,493 |
| 未収配当金 | 342,034,380 |
| (B) 負債 | 238,174,996 |
| 未払金 | 145,973,772 |
| 未払解約金 | 92,201,224 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 30,644,653,130 |
| 元本 | 17,080,129,684 |
| 次期繰越損益金 | 13,564,523,446 |
| (D) 受益権総口数 | 17,080,129,684口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 17,942円 |

(注1) 期首元本額 16,871,045,108円
 期中追加設定元本額 2,727,360,812円
 期中一部解約元本額 2,518,276,236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 J-R E I T インデックス ファンド (適格機関投資家限定) 54,806,284円
 DCニッセイ J-R E I T インデックス ファンド 854,345,938円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ Jリート インデックス ファンド 9,001,652,627円
 ニッセイ J-R E I T インデックス ファンド 2013-02 (適格機関投資家限定) 1,576,442,715円
 DCニッセイ J-R E I T インデックス ファンド A 3,253,135,672円
 DCニッセイ J-R E I T インデックス ファンド B 2,001,376,641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) 225,121,146円
 ニッセイ・インデックス パッケージ (内外・株式/リート) 27,520,309円
 ニッセイ・インデックス パッケージ (内外・株式/リート/債券) 9,134,493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) 20,040,471円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス バランス ファンド (8資産均等型) 52,228,727円
 ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランス ファンド (安定型) 112,378円
 ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランス ファンド (積極型) 250,447円
 FWニッセイ 国内リート インデックス 3,961,836円

損益の状況

当期 (2024年5月14日~2024年11月12日)

| 項目 | 当期 |
|------------------------|------------------------|
| (A) 配当等収益 | 715,281,568円 |
| 受取配当金 | 715,048,865 |
| 受取利息 | 232,703 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 2,429,127,442 |
| 売買益 | 300,711,336 |
| 売買損 | △ 2,729,838,778 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 1,713,845,874 |
| (D) 前期繰越損益金 | 15,110,066,870 |
| (E) 追加信託差損益金 | 2,239,261,825 |
| (F) 解約差損益金 | △ 2,070,959,375 |
| (G) 合計(C+D+E+F) | 13,564,523,446 |
| 次期繰越損益金(G) | 13,564,523,446 |

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

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

運用報告書

第 7 期

(計算期間：2023年11月21日～2024年11月20日)

運用方針

主に各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国のリート（不動産投資信託）に投資することにより、S & P先進国REITインデックス（除く日本、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す。

主要運用対象

各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国のリート

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ・株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%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

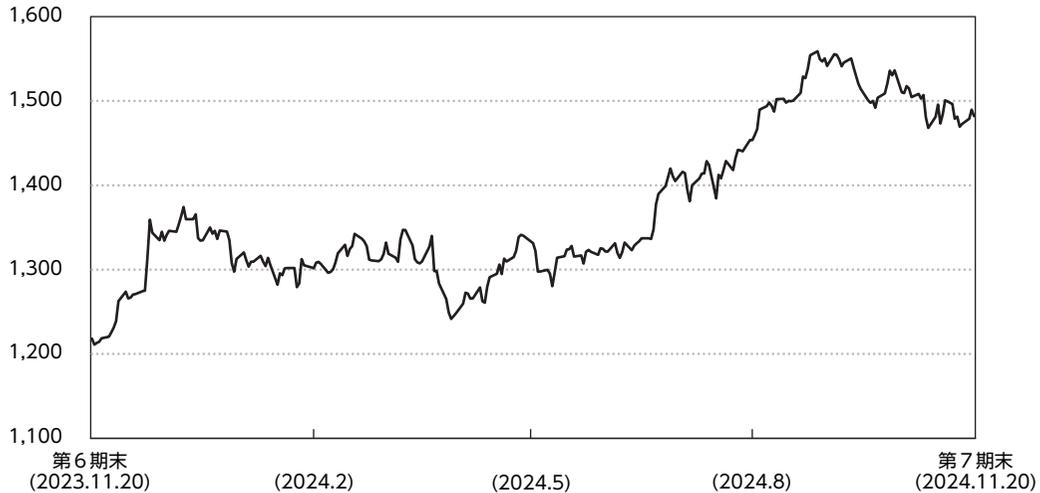
運用経過

2023年11月21日～2024年11月20日

投資環境

■先進国リート市況

【S & P先進国REITインデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】

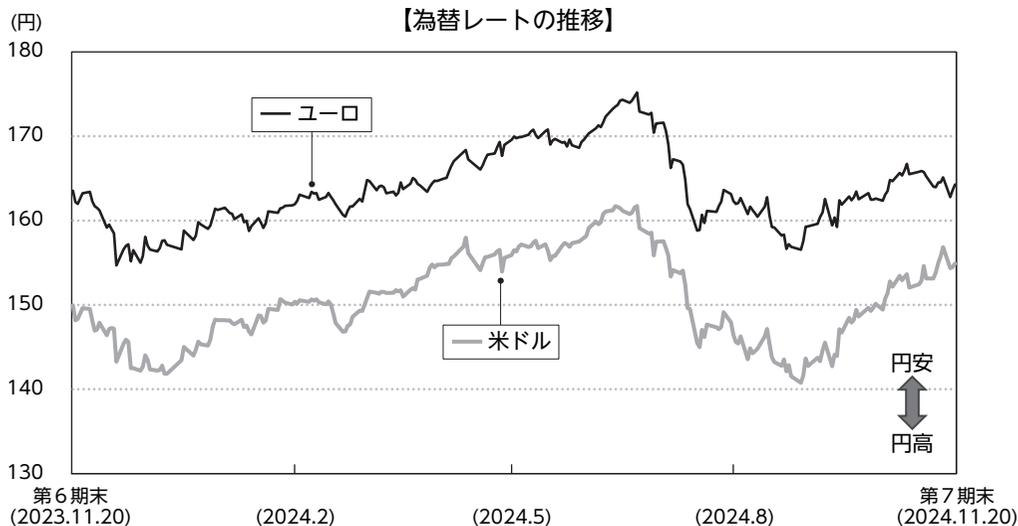


(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

先進国リート市場は期を通じて見ると大きく上昇しました。

期初以降、米長期金利が低下したことで借り入れコストの低減により業績回復の恩恵を受けるとの見方が広がったことなどからリート市場は上昇して始まったものの、年明けから2024年4月中旬にかけては米地銀ニューヨーク・コミュニティ・バンコプ（NYCB）の損失懸念が表面化し地銀の経営不安が報じられたことや、中東における地政学リスクの高まりなどが嫌気され下落しました。しかし、9月中旬にかけては発表された米雇用統計が労働需給の緩和を示したことや米消費者物価指数（CPI）が市場予想以上に減速したことなどからFRBの利下げ観測が高まりリート市場は大きく上昇しました。当期末にかけては米大統領選を控え財政リスクの高まりが意識された結果、米長期金利の上昇が続いたことからリート市場は軟調な展開となりました。

■為替市況

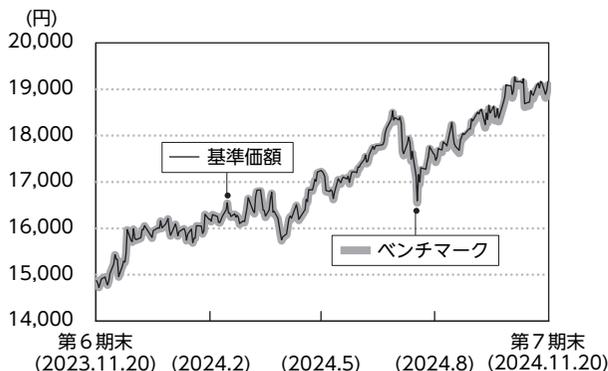


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、期初から2023年12月末にかけて日本の財務省による為替介入への警戒感や日銀のマイナス金利解除期待が高まったことで下落しましたが、年明け以降は能登半島地震により日銀のマイナス金利解除期待が後退したことや堅調な米経済指標を背景にF R Bの早期利下げ観測が後退したことを受けて米ドル高円安に転じました。2024年5月には日本の財務省による為替介入とみられる動きにより米ドル安円高に振れる場面があったものの、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、期を通じて見ると米ドル高円安で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、期初から2023年12月末にかけて日銀のマイナス金利解除期待が高まったことで下落しましたが、年明け以降は能登半島地震により日銀のマイナス金利解除期待が後退したことやユーロ圏主要国の購買担当者景気指数(PMI)が市場予想を上回ったことからユーロ高円安に転じました。その後も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が続きましたが、7月中旬には日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあったことや米経済指標が弱含んだことなどから大きくユーロ安円高となりました。9月下旬以降は自民党総裁選で石破氏が勝利し10月の衆院選で連立与党が過半数の議席数を確保できなかったことで政治の不透明感が高まったこと、さらにユーロ圏実質域内総生産(GDP)が市場予想を上回るなど欧州域内の経済指標が堅調であったことなどから再びユーロ高円安推移となり、結局、期を通じて見ると期初と同程度の水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・ 期初から2023年12月中旬にかけて、米長期金利が低下したことで借り入れコストの低減により業績回復の恩恵を受けるとの見方が広がったことなどからリート市場が上昇したこと
- ・ 2024年5月から7月中旬にかけて、発表された軟調な米経済指標等を背景に米連邦準備制度理事会（F R B）の利下げ観測が高まりリート市場が上昇したこと
- ・ 8月中旬から当期末にかけて、インフレ鈍化を示す米経済指標が続き再びF R Bによる利下げ観測が投資家心理を下支えしたことや、日銀の追加利上げのタイミングが遅れるとの見方が広がったことなどから米ドル高円安が進行したこと

<下落要因>

- ・ 2024年4月中旬に米国のインフレ懸念や中東における地政学リスクの高まりなどが嫌気されリート市場が下落したこと

- ・ 7月下旬から8月上旬にかけて、日銀金融政策決定会合において追加利上げと国債買入れ減額が決定されたことや、米景気減速懸念が高まり急速に米ドル安円高が進行したこと

ポートフォリオ

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリート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+28.9%となり、ベンチマーク騰落率（+28.3%）を上回りました。これは配当課税要因等によるものです。

今後の運用方針

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリート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 | 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 |
| 3期(2020年11月20日) | 9,969 | △13.7 | 9,745 | △14.9 | — | — | 98.4 | 2,497 |
| 4期(2021年11月22日) | 14,373 | 44.2 | 14,056 | 44.2 | — | — | 98.9 | 4,519 |
| 5期(2022年11月21日) | 14,227 | △ 1.0 | 13,816 | △ 1.7 | — | — | 99.3 | 5,896 |
| 6期(2023年11月20日) | 14,874 | 4.5 | 14,372 | 4.0 | 0.0 | 4.9 | 94.9 | 9,294 |
| 7期(2024年11月20日) | 19,168 | 28.9 | 18,446 | 28.3 | — | 5.2 | 94.5 | 17,069 |

(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)2023年11月20日 | 14,874 | — | 14,372 | — | 0.0 | 4.9 | 94.9 |
| 11月末 | 14,865 | △ 0.1 | 14,358 | △ 0.1 | 0.0 | 3.0 | 96.8 |
| 12月末 | 16,060 | 8.0 | 15,506 | 7.9 | — | 4.5 | 95.2 |
| 2024年 1 月末 | 15,915 | 7.0 | 15,370 | 6.9 | — | 4.5 | 95.3 |
| 2 月末 | 16,194 | 8.9 | 15,637 | 8.8 | — | 2.6 | 97.2 |
| 3 月末 | 16,819 | 13.1 | 16,227 | 12.9 | — | 4.9 | 94.8 |
| 4 月末 | 16,512 | 11.0 | 15,936 | 10.9 | — | 5.7 | 94.7 |
| 5 月末 | 16,781 | 12.8 | 16,194 | 12.7 | — | 4.3 | 95.6 |
| 6 月末 | 17,587 | 18.2 | 16,965 | 18.0 | — | 3.5 | 96.2 |
| 7 月末 | 17,859 | 20.1 | 17,216 | 19.8 | — | 3.0 | 97.2 |
| 8 月末 | 17,777 | 19.5 | 17,133 | 19.2 | — | 5.0 | 94.6 |
| 9 月末 | 18,236 | 22.6 | 17,555 | 22.2 | — | 4.4 | 95.5 |
| 10月末 | 19,224 | 29.2 | 18,503 | 28.7 | — | 3.9 | 95.9 |
| (期末)2024年11月20日 | 19,168 | 28.9 | 18,446 | 28.3 | — | 5.2 | 94.5 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年11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 | 3円 | 0.019% | |
| (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) | (2) | (0.011) | 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) | (1) | (0.008) | |
| 有価証券取引税 | 2 | 0.014 | |
| (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) | (2) | (0.014) | 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 | 21 | 0.124 | 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) | (15) | (0.086) | 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) | (7) | (0.038) | ・ 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 | 27 | 0.157 | |

(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（17,045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11月21日～2024年11月20日

(1) 株式

| | | 買付 | | 売付 | |
|----|------|----|------|----|------|
| | | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 |
| 外国 | アメリカ | 百株 | 千米ドル | 百株 | 千米ドル |
| | | — | — | 4 | 7 |

(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。

ニッセイ先進国リート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 | 3 | 225 | 0.172 | 13 |
| ACADIA REALTY TRUST | 2 | 53 | — | — |
| AGREE REALTY CORP | 2 | 160 | 0.183 | 13 |
| ALEXANDER'S INC | 0.035 | 7 | — | — |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 3 | 438 | 0.433 | 51 |
| PROLOGIS INC | 21 | 2,569 | 1 | 239 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 2 | 24 | — | — |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 3 | 650 | 0.347 | 71 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 3 | 16 | — | — |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 2 | 261 | 0.188 | 20 |
| NNN REIT INC | 4 | 182 | 0.407 | 17 |
| COPT DEFENSE PROPERTIES | 2 | 65 | — | — |
| COUSINS PROPERTIES INC | 3 | 87 | — | — |
| SITE CENTERS CORP | 3 | 55 | 0.611 | 8 |
| | (△ 8) | | | |
| EASTGROUP PROPERTIES | 1 | 191 | — | — |
| EPR PROPERTIES | 1 | 78 | 0.398 | 19 |
| 外国 EQUITY RESIDENTIAL | 7 | 530 | 1 | 79 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 1 | 391 | 0.140 | 40 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 1 | 177 | 0.170 | 17 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 3 | 157 | 0.273 | 12 |
| GETTY REALTY CORP | 1 | 32 | — | — |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 1 | 20 | — | — |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 15 | 303 | 2 | 45 |
| | (8) | | | |
| WELLTOWER INC | 16 | 1,715 | 1 | 216 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | — | — | 0.962 | 9 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 2 | 66 | 0.385 | 9 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 3 | 18 | — | — |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 16 | 304 | 1 | 26 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 2 | 49 | — | — |
| CENTERSPACE | 0.349 | 22 | — | — |
| SAFEHOLD INC | 1 | 33 | — | — |
| KILROY REALTY CORP | 2 | 88 | — | — |
| KIMCO REALTY CORP | 15 | 312 | 1 | 33 |
| | (2) | | | |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 7 | 65 | 1 | 12 |

ニッセイ先進国リート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 |
| (アメリカ) | 千口 | 千米ドル | 千口 | 千米ドル |
| LTC PROPERTIES INC | 0.970 | 32 | – | – |
| MACERICH CO/THE | 5 | 79 | – | – |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 1 | 24 | – | – |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 2 | 376 | 0.382 | 54 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 1 | 67 | 0.148 | 12 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 6 | 215 | 0.314 | 10 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 0.612 | 13 | – | – |
| PUBLIC STORAGE | 3 | 1,085 | 0.377 | 119 |
| RPT REALTY | 0.096 | 1 | – | 0.019 |
| | (△ 4) | | | |
| REGENCY CENTERS CORP | 3 | 241 | 0.714 | 47 |
| SAUL CENTERS INC | 0.147 | 5 | – | – |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 2 | 7 | – | – |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 7 | 1,124 | 2 | 329 |
| SL GREEN REALTY CORP | 1 | 80 | – | – |
| SUN COMMUNITIES INC | 2 | 365 | 0.730 | 99 |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 2 | 70 | – | – |
| UDR INC | 7 | 278 | 1 | 42 |
| UMH PROPERTIES INC | 1 | 21 | – | – |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 0.340 | 15 | – | – |
| VENTAS INC | 9 | 497 | 0.337 | 16 |
| VORNADO REALTY TRUST | 3 | 106 | – | – |
| WP CAREY INC | 5 | 299 | 0.289 | 17 |
| ELME COMMUNITIES | 1 | 30 | – | – |
| REALTY INCOME CORP | 21 | 1,183 | 0.871 | 50 |
| | (5) | | | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 4 | 289 | 0.321 | 21 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 5 | 117 | 0.420 | 8 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 4 | 750 | 0.382 | 61 |
| CUBESMART | 5 | 237 | 0.312 | 14 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 8 | 1,205 | 1 | 241 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 4 | 42 | – | – |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 14 | 63 | – | – |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 4 | 50 | – | – |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 0.186 | 0.290 | – | – |
| DOUGLAS EMMETT INC | 4 | 57 | 0.676 | 8 |
| IRON MOUNTAIN INC | 6 | 586 | 0.515 | 48 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 2 | 20 | – | – |

外国

ニッセイ先進国リート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 |
| (アメリカ) | 千口 | 千米ドル | 千口 | 千米ドル |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 2 | 14 | — | — |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 2 | 37 | — | — |
| TERRENO REALTY CORP | 2 | 164 | — | — |
| RLJ LODGING TRUST | 3 | 38 | 0.830 | 9 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 0.843 | 19 | — | — |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 3 | 40 | — | — |
| CHATHAM LODGING TRUST | 1 | 13 | — | — |
| STAG INDUSTRIAL INC | 4 | 157 | 0.350 | 13 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 2 | 16 | — | — |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 0.094 | 0.198 | — | — |
| EQUINIX INC | 2 | 1,740 | 0.139 | 116 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A | 8 | 145 | 1 | 34 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 5 | 84 | — | — |
| WHITESTONE REIT | 1 | 20 | — | — |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 1 | 149 | 0.097 | 11 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 7 | 271 | 0.880 | 34 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 1 | 13 | — | — |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 1 | 20 | — | 0.002 |
| | (△ 13) | | | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 5 | 249 | — | — |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 0.686 | 29 | — | 0.003 |
| | (△ 7) | | | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN | 3 | 37 | — | — |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 6 | 291 | — | — |
| BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC | 0.122 | 0.306 | — | — |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 6 | 164 | 0.489 | 10 |
| CARETRUST REIT INC | 5 | 149 | — | — |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 5 | 90 | 0.668 | 12 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 5 | 28 | — | — |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 2 | 46 | — | — |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 3 | 40 | — | — |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 2 | 34 | — | — |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 1 | 69 | 0.900 | 37 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 0.525 | 22 | — | — |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 5 | 78 | — | — |
| CITY OFFICE REIT INC | 0.092 | 0.443 | — | — |
| GLOBAL NET LEASE INC | 4 | 35 | — | — |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 2 | 51 | — | — |

外国

ニッセイ先進国リート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 |
| (アメリカ) | 千口 | 千米ドル | 千口 | 千米ドル |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 0.837 | 19 | – | – |
| FARMLAND PARTNERS INC | 0.364 | 4 | – | – |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | – | – | 76 | 6 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC-WI | 4 | 74 | – | – |
| INVITATION HOMES INC | 13 | 462 | 1 | 68 |
| OUTFRONT MEDIA INC | 9 | 175 | – | – |
| JBG SMITH PROPERTIES | 2 | 34 | 0.883 | 14 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 1 | 30 | – | – |
| CLIPPER REALTY INC | 0.005 | 0.018 | 0.098 | 0.517 |
| GLADSTONE LAND CORP | 1 | 14 | – | – |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 1 | 15 | – | – |
| VICI PROPERTIES INC | 24 | 740 | 1 | 31 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 6 | 182 | 0.938 | 26 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 0.111 | 0.401 | – | – |
| BRT APARTMENTS CORP | 0.625 | 10 | – | – |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 0.662 | 71 | – | – |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 5 | 139 | – | – |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 1 | 27 | – | – |
| PRIME US REIT | – | – | 33 | 6 |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | – | – | 39 | 13 |
| APARTMENT INCOME REIT CO | 1 | 64 | 9 | 359 |
| NETSTREIT CORP | 2 | 38 | – | – |
| CTO REALTY GROWTH INC | 0.108 | 1 | – | – |
| BROADSTONE NET LEASE INC-A | 4 | 73 | 0.784 | 14 |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 0.741 | 11 | – | – |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 0.069 | 0.061 | 1 | 1 |
| POSTAL REALTY TRUST INC- A | 0.064 | 0.839 | – | – |
| ORION OFFICE REIT INC | 0.126 | 0.426 | – | – |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 2 | 96 | – | – |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 0.197 | 4 | – | – |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 1 | 39 | – | – |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | – | – | 39 | 24 |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES | 2 | 12 | – | 0.015 |
| | (0.107) | (0.661) | | |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 0.278 | 3 | – | – |
| UNITI GROUP INC | 5 | 25 | – | – |
| NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I | 0.058 | 1 | – | 0.023 |
| | (0.006) | (0.166) | | |

外国

ニッセイ先進国リート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 |
| (アメリカ) | 千口 | 千米ドル | 千口 | 千米ドル |
| AMERICAN HEALTHCARE REIT INC | 9 | 187 | — | — |
| LINEAGE INC | 4 | 331 | — | — |
| LAMAR ADVERTISING CO-A | 6 | 812 | — | — |
| MODIV INDUSTRIAL INC | 0.808 | 12 | — | — |
| CURBLINE PROPERTIES CORP | 0.191 | 4 | — | — |
| | (6) | | | |
| (カナダ) | | 千カナダ・ドル | | 千カナダ・ドル |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 0.707 | 53 | — | — |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1 | 39 | — | — |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 1 | 93 | — | — |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT | 0.025 | 0.447 | — | — |
| | (△0.500) | | | |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 3 | 31 | — | — |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 3 | 63 | — | — |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 1 | 21 | — | — |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 3 | 25 | — | — |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 0.731 | 9 | — | — |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 0.822 | 4 | — | — |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 0.862 | 10 | — | — |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 0.058 | 4 | 1 | 124 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 6 | 82 | — | — |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 0.073 | 1 | — | — |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 0.523 | 7 | — | — |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 3 | 40 | — | — |
| SLATE GROCERY REIT | 0.088 | 0.962 | — | — |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 2 | 38 | — | — |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 0.008 | 0.068 | 0.164 | 2 |
| | (△0.744) | | | |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 0.068 | 0.993 | — | — |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 3 | 54 | — | — |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | 0.353 | 1 | 7 | 26 |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | 2 | 18 | — | — |
| PRIMARIS REIT | 1 | 23 | — | — |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT T | 0.131 | 0.626 | 2 | 15 |
| (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 | 45 | 198 | — | — |
| GOODMAN GROUP | 40 | 1,275 | 1 | 58 |
| STOCKLAND | 55 | 252 | 3 | 18 |

外
国

ニッセイ先進国リート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 |
| (オーストラリア) | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千口 | 千オーストラリア・ドル |
| BWP TRUST | 12 | 43 | — | — |
| MIRVAC GROUP | 93 | 194 | — | — |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 12 | 44 | 4 | 16 |
| ABACUS GROUP | 13 | 16 | — | — |
| VICINITY CENTRES | 90 | 180 | 9 | 20 |
| CHARTER HALL GROUP | 11 | 139 | 1 | 18 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 12 | 5 | — | — |
| REGION RE LTD | 29 | 64 | — | — |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 10 | 29 | — | — |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 7 | 37 | — | — |
| GDI PROPERTY GROUP | 22 | 13 | 36 | 22 |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 0.558 | 1 | — | — |
| NATIONAL STORAGE REIT | 30 | 69 | — | — |
| SCENTRE GROUP | 120 | 384 | 17 | 56 |
| ARENA REIT | 10 | 42 | — | — |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE | 8 | 23 | — | — |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L | 1 | 4 | — | — |
| WAYPOINT REIT LTD | 17 | 42 | — | — |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 17 | 61 | 4 | 19 |
| RURAL FUNDS TRUST | 11 | 24 | — | — |
| CENTURIA OFFICE REIT | 0.928 | 1 | — | — |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 10 | 35 | — | — |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 26 | 45 | — | — |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 45 | 55 | — | — |
| DEXUS/AU | 25 | 180 | 2 | 17 |
| HMC CAPITAL LTD | 4 | 34 | 17 | 138 |
| HEALTHCO REIT | 1 | 1 | — | — |
| ABACUS STORAGE KING | 17 | 19 | — | — |
| (香港) | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| CHAMPION REIT | 71 | 115 | — | — |
| LINK REIT | 59 | 2,132 | 3 | 95 |
| PROSPERITY REIT | 5 | 6 | 103 | 131 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 117 | 114 | — | — |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 3 | 5 | — | — |
| FORTUNE REIT | 49 | 197 | — | — |
| (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 | 84 | 228 | 7 | 19 |
| | | (△ 4) | | |

外国

ニッセイ先進国リート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 |
| (シンガポール) | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千口 | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 131 | 262 (△0.894) | — | — |
| KEPPEL REIT | 70 | 63 | — | — |
| SUNTEC REIT | 52 | 60 (△0.233) | — | — |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 80 | 114 (△ 7) | — | — |
| STARHILL GLOBAL REIT | 15 | 7 | — | — |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | 75 | 70 (△ 3) | — | — |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 26 | 57 | — | — |
| ESR-LOGOS REIT | 159 | 46 (△ 1) | — | — |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 8 | 7 (△0.547) | — | — |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 35 | 26 (△0.737) | — | — |
| AIMS APAC REIT | 10 | 13 (△0.883) | — | — |
| PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 7 | 27 (△ 1) | — | — |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 55 | 129 (△0.735) | — | — |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST | 70 | 96 (△ 2) | 11 | 16 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 11 | 7 (△0.344) | — | — |
| OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 181 | 58 | — | — |
| PARAGON REIT | 37 | 32 (△ 1) | 98 | 85 |
| KEPPEL DC REIT | 33 | 62 (△ 1) | — | — |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 70 | 73 (△ 4) | — | — |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 3 | 2 (△0.654) | — | — |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 71 | 43 | — | — |

ニッセイ先進国リート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 |
| (ニュージーランド) | 千口 | 千ニュージーランド・ドル | 千口 | 千ニュージーランド・ドル |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 17 | 14 | 92 | 83 |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 44 | 53 | 106 | 131 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 24 | 52 | — | — |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 23 | 25 | 62 | 65 |
| (イギリス) | | 千イギリス・ポンド | | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 21 | 87 | 2 | 10 |
| HAMMERSON PLC | 126 | 37 | — | — |
| | (△ 309) | | | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 17 | 113 | 2 | 16 |
| SEGRO PLC | 35 | 310 | 3 | 29 |
| WORKSPACE GROUP PLC | 3 | 20 | — | — |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 32 | 31 | — | — |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 16 | 58 | — | — |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 5 | 67 | — | — |
| DERWENT LONDON PLC | 3 | 70 | — | — |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 52 | 72 | — | — |
| INVISTA FOUNDATION PROPERTY | 1 | 0.674 | — | — |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 40 | 80 | — | — |
| | (55) | | | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 58 | 92 | — | — |
| | (21) | | | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 5 | 42 | — | — |
| ASSURA PLC | 69 | 29 | — | — |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 8 | 7 | — | — |
| REGIONAL REIT LTD | — | — | 23 | 7 |
| NEWRIVER REIT PLC | 0.720 | 0.543 | — | — |
| UNITE GROUP PLC | 9 | 87 | 0.889 | 8 |
| LXI REIT PLC | 12 | 12 | — | — |
| | (△ 100) | | | |
| CARE REIT PLC | 16 | 14 | — | — |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 18 | 11 | — | — |
| | (△ 48) | | | |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 0.600 | 0.347 | — | — |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 16 | 12 | — | — |
| AEW UK REIT PLC | 0.573 | 0.487 | — | — |
| BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 18 | 14 | 46 | 44 |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 32 | 24 | — | — |
| CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC | 3 | 2 | — | — |

外国

ニッセイ先進国リート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 |
| (イギリス) | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千口 | 千イギリス・ポンド |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED | 1 | 0.530 | — | — |
| PRS REIT PLC/THE | 17 | 16 | — | — |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | 15 | 19 | — | — |
| WAREHOUSE REIT PLC | 0.885 | 0.720 | — | — |
| CLS HOLDINGS PLC | 0.440 | 0.405 | — | — |
| HELICAL PLC | 0.276 | 0.659 | — | — |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 9 | 7 | — | — |
| LIFE SCIENCE REIT PLC | 1 | 0.375 | — | — |
| GREAT PORTLAND ESTATES -NIL | — | — | 8 | 9 |
| | (8) | | | |
| HAMMERSON PLC | 0.982 | 3 | — | — |
| | (30) | | | |
| (イスラエル) | | 千イスラエル・シケル | | 千イスラエル・シケル |
| REIT 1 LTD | 5 | 80 | — | — |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT | 0.881 | 6 | — | — |
| MENIVIM- THE NEW REIT LTD | 31 | 48 | — | — |
| (ユーロ/アイルランド) | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 19 | 17 | — | — |
| (ユーロ/オランダ) | | | | |
| WERELDHAVE NV | 0.217 | 3 | — | — |
| VASTNED RETAIL NV | 0.612 | 12 | 1 | 26 |
| NSI NV | 0.093 | 1 | — | — |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 1 | 26 | — | — |
| (ユーロ/ベルギー) | | | | |
| COFINIMMO | 1 | 69 | — | — |
| RETAIL ESTATES | 0.388 | 24 | — | — |
| INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES | 0.928 | 19 | 1 | 35 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 4 | 113 | — | — |
| AEDIFICA | 1 | 68 | 0.203 | 12 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 0.751 | 22 | — | — |
| MONTEA NV | 0.531 | 41 | — | — |
| CARE PROPERTY INVEST | 1 | 18 | — | — |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD | 2 | 89 | — | — |
| MONTEA NV-RTS | — | — | 1 | 1 |
| | (1) | | | |
| (ユーロ/フランス) | | | | |
| KLEPIERRE | 5 | 157 | 0.537 | 12 |
| | | (△ 1) | | |

外国

ニッセイ先進国リート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 |
| (ユーロ/フランス) | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| GECINA SA | 1 | 117 | – | – |
| COVIVIO | 1 | 55 | – | – |
| MERCIALYS | 2 | 22 | – | – |
| ICADE | 0.646 | 17 | – | – |
| ALTAREA | 0.178 | 18 | – | – |
| | | (△ 1) | | |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 2 | 170 | 0.500 | 34 |
| | | (△ 14) | | |
| CARMILA | 1 | 20 | – | – |
| | | (△ 3) | | |
| (ユーロ/ドイツ) | | | | |
| HAMBORNER REIT AG | 0.811 | 5 | – | – |
| | | (△ 1) | | |
| (ユーロ/スペイン) | | | | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 0.564 | 4 | – | – |
| | | (△0.180) | | |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 11 | 127 | 1 | 11 |
| | | (△ 4) | | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 10 | 59 | – | – |
| (ユーロ/イタリア) | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 0.057 | 0.099 | – | – |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()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3) 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4) 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。

(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 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | 6,983 | 6,652 | – | – |

(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

2023年11月21日～2024年11月20日

株式

| 買付 | | | | 売付 | | | |
|----|----|----|------|---------------|-------|-------|-------|
| 銘柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 | 銘柄 | 株数 | 金額 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| — | — | — | — | STAR HOLDINGS | 0.498 | 1,005 | 2,019 |

(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 | |
| STAR HOLDINGS | 4 | — | — | — | エクイティ不動産投資信託 (REIT) |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 4 | — | — | — |
| | | 1 | — | — | <—> |

(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。

(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。

ニッセイ先進国リート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 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千米ドル | 千円 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 6 | 10 | 798 | 123,620 |
| ACADIA REALTY TRUST | 4 | 7 | 175 | 27,137 |
| AGREE REALTY CORP | 4 | 6 | 538 | 83,483 |
| ALEXANDER'S INC | 0.148 | 0.183 | 40 | 6,267 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 7 | 10 | 1,125 | 174,329 |
| PROLOGIS INC | 44 | 64 | 7,375 | 1,142,567 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 6 | 9 | 86 | 13,436 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 6 | 9 | 2,244 | 347,763 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 9 | 13 | 69 | 10,767 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 5 | 7 | 896 | 138,926 |
| NNN REIT INC | 8 | 12 | 553 | 85,798 |
| COPT DEFENSE PROPERTIES | 5 | 7 | 233 | 36,160 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 7 | 10 | 335 | 51,981 |
| SITE CENTERS CORP | 8 | 3 | 50 | 7,782 |
| EASTGROUP PROPERTIES | 2 | 3 | 576 | 89,329 |
| EPR PROPERTIES | 3 | 5 | 225 | 34,970 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 16 | 23 | 1,750 | 271,093 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 3 | 4 | 1,334 | 206,676 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 3 | 5 | 585 | 90,709 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 6 | 9 | 489 | 75,766 |
| GETTY REALTY CORP | 2 | 3 | 112 | 17,372 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 1 | 3 | 52 | 8,080 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 27 | 48 | 1,045 | 162,004 |
| WELLTOWER INC | 25 | 40 | 5,534 | 857,395 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 0.962 | — | — | — |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 5 | 7 | 234 | 36,292 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 7 | 10 | 26 | 4,114 |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 34 | 49 | 854 | 132,363 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 5 | 7 | 156 | 24,318 |
| CENTERSPACE | 0.800 | 1 | 84 | 13,069 |
| SAFEHOLD INC | 1 | 3 | 68 | 10,674 |
| KILROY REALTY CORP | 5 | 7 | 290 | 45,023 |
| KIMCO REALTY CORP | 30 | 46 | 1,163 | 180,241 |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 14 | 20 | 186 | 28,839 |
| LTC PROPERTIES INC | 1 | 2 | 113 | 17,584 |
| MACERICH CO/THE | 10 | 15 | 301 | 46,767 |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 3 | 5 | 95 | 14,752 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 5 | 8 | 1,272 | 197,192 |

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------------------|---------|-------|-------|---------|
| | □数 | □数 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) | 千□ | 千□ | 千米ドル | 千円 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 2 | 2 | 231 | 35,846 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 11 | 17 | 716 | 110,927 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 0.420 | 1 | 29 | 4,612 |
| PUBLIC STORAGE | 7 | 10 | 3,641 | 564,051 |
| RPT REALTY | 4 | — | — | — |
| REGENCY CENTERS CORP | 8 | 11 | 827 | 128,144 |
| SAUL CENTERS INC | 0.777 | 0.924 | 37 | 5,735 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 10 | 13 | 32 | 5,004 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 15 | 21 | 3,837 | 594,520 |
| SL GREEN REALTY CORP | 2 | 4 | 345 | 53,457 |
| SUN COMMUNITIES INC | 5 | 8 | 1,026 | 159,062 |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 5 | 7 | 275 | 42,706 |
| UDR INC | 14 | 20 | 919 | 142,371 |
| UMH PROPERTIES INC | 3 | 4 | 87 | 13,620 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 0.616 | 0.956 | 38 | 5,999 |
| VENTAS INC | 19 | 28 | 1,830 | 283,629 |
| VORNADO REALTY TRUST | 7 | 11 | 468 | 72,542 |
| WP CAREY INC | 10 | 15 | 852 | 132,079 |
| ELME COMMUNITIES | 4 | 6 | 95 | 14,806 |
| REALTY INCOME CORP | 34 | 60 | 3,444 | 533,617 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 8 | 12 | 920 | 142,581 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 10 | 15 | 426 | 66,020 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 10 | 14 | 2,429 | 376,357 |
| CUBESMART | 10 | 15 | 769 | 119,207 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 14 | 21 | 3,987 | 617,709 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 9 | 14 | 130 | 20,261 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 28 | 42 | 185 | 28,804 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 9 | 14 | 146 | 22,768 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 3 | 3 | 7 | 1,115 |
| DOUGLAS EMMETT INC | 8 | 11 | 220 | 34,168 |
| IRON MOUNTAIN INC | 14 | 20 | 2,367 | 366,800 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 6 | 9 | 87 | 13,512 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 6 | 9 | 30 | 4,725 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 5 | 7 | 98 | 15,204 |
| TERRENO REALTY CORP | 4 | 6 | 410 | 63,610 |
| RLJ LODGING TRUST | 8 | 10 | 104 | 16,192 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 2 | 2 | 82 | 12,735 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 6 | 9 | 160 | 24,817 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 1 | 3 | 26 | 4,064 |
| STAG INDUSTRIAL INC | 8 | 12 | 466 | 72,208 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 4 | 7 | 43 | 6,778 |

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|----------------------------------|---------|----|-------|---------|
| | □数 | □数 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) | 千□ | 千□ | 千米ドル | 千円 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 1 | 1 | 2 | 351 |
| EQUINIX INC | 4 | 6 | 6,061 | 938,962 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPOR | 18 | 25 | 446 | 69,145 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 11 | 16 | 310 | 48,135 |
| WHITESTONE REIT | 1 | 3 | 50 | 7,844 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 2 | 4 | 473 | 73,405 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 15 | 21 | 815 | 126,257 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 3 | 4 | 52 | 8,120 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 11 | — | — | — |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 10 | 15 | 651 | 100,971 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 6 | — | — | — |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN | 5 | 9 | 102 | 15,863 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 12 | 18 | 950 | 147,199 |
| BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC | 2 | 2 | 8 | 1,324 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 14 | 20 | 620 | 96,097 |
| CARETRUST REIT INC | 4 | 10 | 331 | 51,338 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 11 | 15 | 334 | 51,873 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 6 | 11 | 56 | 8,717 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 5 | 7 | 179 | 27,846 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 4 | 7 | 91 | 14,189 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 5 | 7 | 111 | 17,310 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 4 | 4 | 217 | 33,649 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 1 | 1 | 73 | 11,423 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 10 | 15 | 240 | 37,307 |
| CITY OFFICE REIT INC | 1 | 1 | 9 | 1,458 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 9 | 13 | 98 | 15,322 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 4 | 6 | 180 | 28,030 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 1 | 1 | 36 | 5,616 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 2 | 2 | 34 | 5,292 |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 76 | — | — | — |
| PARK HOTELS & RESORTS INC-WI | 9 | 14 | 210 | 32,594 |
| INVITATION HOMES INC | 27 | 39 | 1,335 | 206,941 |
| OUTFRONT MEDIA INC | — | 9 | 180 | 27,935 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 4 | 6 | 93 | 14,411 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 3 | 5 | 102 | 15,852 |
| CLIPPER REALTY INC | 0.093 | — | — | — |
| GLADSTONE LAND CORP | 1 | 2 | 31 | 4,926 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 2 | 4 | 36 | 5,657 |
| VICI PROPERTIES INC | 48 | 72 | 2,333 | 361,497 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 12 | 18 | 402 | 62,352 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 2 | 2 | 8 | 1,374 |

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|----------------------------------|------------------|--------------|--------------|------------------------|
| | □数 | □数 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (アメリカ) | 千□ | 千□ | 千米ドル | 千円 |
| BRT APARTMENTS CORP | 0.345 | 0,970 | 19 | 2,961 |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 1 | 2 | 213 | 33,050 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 7 | 12 | 415 | 64,381 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 1 | 2 | 47 | 7,303 |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 20 | 20 | 0.020 | 3 |
| PRIME US REIT | 33 | — | — | — |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 39 | — | — | — |
| APARTMENT INCOME REIT CO | 7 | — | — | — |
| NETSTREIT CORP | 3 | 5 | 84 | 13,015 |
| CTO REALTY GROWTH INC | 1 | 1 | 27 | 4,250 |
| BROADSTONE NET LEASE INC-A | 9 | 12 | 221 | 34,288 |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 0.337 | 1 | 19 | 2,955 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 1 | — | — | — |
| POSTAL REALTY TRUST INC- A | 1 | 1 | 18 | 2,900 |
| ORION OFFICE REIT INC | 2 | 2 | 10 | 1,589 |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 5 | 8 | 331 | 51,304 |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 1 | 1 | 39 | 6,117 |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 3 | 4 | 143 | 22,301 |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 39 | — | — | — |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES | 1 | 3 | 18 | 2,890 |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 1 | 2 | 27 | 4,205 |
| UNITI GROUP INC | 12 | 17 | 101 | 15,698 |
| NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I | 0.688 | 0.752 | 23 | 3,608 |
| AMERICAN HEALTHCARE REIT INC | — | 9 | 259 | 40,182 |
| LINEAGE INC | — | 4 | 260 | 40,285 |
| LAMAR ADVERTISING CO-A | — | 6 | 775 | 120,176 |
| MODIV INDUSTRIAL INC | — | 0.808 | 13 | 2,028 |
| CURBLINE PROPERTIES CORP | — | 6 | 149 | 23,113 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 1,278 142 | 1,582 137 | 83,417 — <75.7%> |
| (カナダ) | | | 千カナダ・ドル | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 1 | 1 | 122 | 13,581 |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM | 3 | 5 | 129 | 14,316 |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 4 | 5 | 267 | 29,707 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTM | 1 | 0.525 | 10 | 1,132 |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 5 | 8 | 87 | 9,668 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 7 | 10 | 200 | 22,255 |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 3 | 4 | 80 | 8,965 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 2 | 5 | 42 | 4,718 |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 3 | 3 | 54 | 6,092 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 6 | 7 | 35 | 3,932 |

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|----------------------------------|------------------|----------|-------------|----------------------|
| | □数 | □数 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (カナダ) | 千□ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千円 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 3 | 4 | 48 | 5,424 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 1 | — | — | — |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 6 | 12 | 179 | 19,939 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 1 | 1 | 28 | 3,120 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 2 | 3 | 49 | 5,525 |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 6 | 9 | 120 | 13,408 |
| SLATE GROCERY REIT | 1 | 1 | 26 | 2,964 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 2 | 4 | 80 | 8,911 |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 0.900 | — | — | — |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 1 | 1 | 19 | 2,215 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 4 | 8 | 146 | 16,241 |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | 7 | — | — | — |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | 0.800 | 3 | 25 | 2,857 |
| PRIMARIS REIT | 2 | 3 | 60 | 6,695 |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT T | 2 | — | — | — |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 82 25 | 108 21 | 1,817 — <1.2%> |
| (オーストラリア) | | | 千オーストラリア・ドル | |
| GPT GROUP | 91 | 136 | 638 | 64,723 |
| GOODMAN GROUP | 82 | 120 | 4,530 | 458,902 |
| STOCKLAND | 115 | 166 | 857 | 86,868 |
| BWP TRUST | 24 | 36 | 128 | 12,980 |
| MIRVAC GROUP | 190 | 283 | 604 | 61,254 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 28 | 36 | 124 | 12,629 |
| ABACUS GROUP | 14 | 27 | 33 | 3,383 |
| VICINITY CENTRES | 190 | 270 | 582 | 59,017 |
| CHARTER HALL GROUP | 23 | 32 | 514 | 52,075 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 100 | 113 | 45 | 4,588 |
| REGION RE LTD | 59 | 88 | 192 | 19,519 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 11 | 22 | 56 | 5,722 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 17 | 25 | 127 | 12,916 |
| GDI PROPERTY GROUP | 14 | — | — | — |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 11 | 11 | 31 | 3,166 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 61 | 91 | 228 | 23,140 |
| SCENTRE GROUP | 256 | 359 | 1,273 | 128,970 |
| ARENA REIT | 17 | 27 | 114 | 11,580 |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU | 12 | 20 | 55 | 5,623 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L | 10 | 11 | 41 | 4,253 |
| WAYPOINT REIT LTD | 35 | 53 | 134 | 13,661 |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 35 | 47 | 188 | 19,145 |
| RURAL FUNDS TRUST | 14 | 26 | 50 | 5,095 |

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

| 銘柄 | □数 | 当期末 | | |
|----------------------------------|------------------|-------------|-------------|-----------------------|
| | | □数 | 評価額 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (オーストラリア) | 千口 | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 |
| CENTURIA OFFICE REIT | 18 | 19 | 23 | 2,348 |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 24 | 35 | 108 | 11,021 |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 31 | 58 | 110 | 11,197 |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 92 | 137 | 173 | 17,531 |
| DEXUS/AU | 52 | 76 | 531 | 53,850 |
| HMC CAPITAL LTD | 12 | — | — | — |
| HEALTHCO REIT | 22 | 23 | 26 | 2,679 |
| ABACUS STORAGE KING | 14 | 31 | 38 | 3,892 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 1,687 31 | 2,395 29 | 11,567 — <6.9%> |
| (香港) | | | 千香港ドル | |
| CHAMPION REIT | 89 | 160 | 270 | 5,380 |
| LINK REIT | 122 | 179 | 5,994 | 119,285 |
| PROSPERITY REIT | 98 | — | — | — |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR | 113 | 230 | 230 | 4,577 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 60 | 63 | 115 | 2,294 |
| FORTUNE REIT | 72 | 121 | 481 | 9,583 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 554 6 | 753 5 | 7,091 — <0.8%> |
| (シンガポール) | | | 千シンガポール・ドル | |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT | 174 | 250 | 641 | 74,298 |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | 247 | 379 | 739 | 85,655 |
| KEPPEL REIT | 100 | 171 | 147 | 17,038 |
| SUNTEC REIT | 107 | 159 | 182 | 21,106 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 163 | 243 | 307 | 35,590 |
| STARHILL GLOBAL REIT | 82 | 98 | 48 | 5,643 |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | 112 | 187 | 165 | 19,141 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 53 | 79 | 168 | 19,527 |
| ESR-LOGOS REIT | 323 | 482 | 125 | 14,523 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 42 | 50 | 44 | 5,110 |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 56 | 91 | 67 | 7,808 |
| AIMS APAC REIT | 37 | 48 | 60 | 6,966 |
| PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 18 | 26 | 94 | 10,988 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 96 | 152 | 345 | 39,976 |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR | 107 | 166 | 205 | 23,784 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 60 | 71 | 44 | 5,101 |
| OUÉ REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | — | 181 | 50 | 5,878 |
| PARAGON REIT | 60 | — | — | — |
| KEPPEL DC REIT | 67 | 100 | 219 | 25,373 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T | 144 | 215 | 204 | 23,676 |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 43 | 47 | 32 | 3,742 |

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

| 銘柄 | | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|----------------------------------|---------|---------|-------|--------------|---------|
| | | □数 | □数 | 評価額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (シンガポール) | | 千□ | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千円 |
| LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL | | 67 | 138 | 76 | 8,918 |
| EC WORLD REIT | | 17 | 17 | 0.002 | 0.206 |
| 小計 | □数・金額 | 2,184 | 3,359 | 3,969 | 459,851 |
| | 銘柄数<比率> | 22 | 22 | — | <2.7%> |
| (ニュージーランド) | | | | 千ニュージーランド・ドル | |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | | 74 | — | — | — |
| PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | | 61 | — | — | — |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | | 50 | 74 | 159 | 14,643 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | | 39 | — | — | — |
| 小計 | □数・金額 | 225 | 74 | 159 | 14,643 |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 1 | — | <0.1%> |
| (イギリス) | | | | 千イギリス・ポンド | |
| BRITISH LAND CO PLC | | 44 | 63 | 245 | 48,314 |
| HAMMERSON PLC | | 182 | — | — | — |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 36 | 51 | 305 | 59,983 |
| SEGRO PLC | | 60 | 92 | 708 | 139,235 |
| WORKSPACE GROUP PLC | | 5 | 9 | 49 | 9,796 |
| INTU PROPERTIES PLC | | 19 | 19 | 0.020 | 3 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | | 66 | 99 | 92 | 18,264 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | | 11 | 28 | 84 | 16,516 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | | 8 | 14 | 155 | 30,646 |
| DERWENT LONDON PLC | | 4 | 8 | 170 | 33,429 |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC | | 86 | 138 | 180 | 35,416 |
| INVISTA FOUNDATION PROPERTY | | 30 | 31 | 15 | 3,094 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | | 48 | 144 | 271 | 53,430 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | | 90 | 170 | 229 | 45,126 |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | | 10 | 15 | 120 | 23,687 |
| ASSURA PLC | | 142 | 211 | 81 | 16,114 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | | 31 | 39 | 34 | 6,779 |
| REGIONAL REIT LTD | | 23 | — | — | — |
| NEWRIVER REIT PLC | | 14 | 15 | 11 | 2,232 |
| UNITE GROUP PLC | | 19 | 27 | 233 | 45,910 |
| LXI REIT PLC | | 87 | — | — | — |
| CARE REIT PLC | | 10 | 26 | 21 | 4,236 |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | | 30 | — | — | — |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | | 11 | 12 | 7 | 1,518 |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | | 26 | 42 | 29 | 5,741 |
| AEW UK REIT PLC | | 11 | 11 | 11 | 2,239 |
| BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU | | 28 | — | — | — |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | | 66 | 98 | 67 | 13,296 |
| CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT P | | 23 | 26 | 21 | 4,146 |

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

| 銘柄 | | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|----------------------------------|------------------|---------|-------|------------|---------|
| | | □数 | □数 | 評価額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (イギリス) | | 千□ | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千円 |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIM1 | | 20 | 21 | 13 | 2,590 |
| HOME REIT PLC | | 24 | 24 | 0.002 | 0.481 |
| PRS REIT PLC/THE | | 24 | 41 | 42 | 8,325 |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | | 18 | 33 | 36 | 7,248 |
| WAREHOUSE REIT PLC | | 17 | 18 | 15 | 3,070 |
| CLS HOLDINGS PLC | | 8 | 9 | 7 | 1,517 |
| HELICAL PLC | | 5 | 5 | 10 | 2,127 |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC | | 34 | 43 | 37 | 7,302 |
| LIFE SCIENCE REIT PLC | | 22 | 23 | 9 | 1,810 |
| HAMMERSON PLC | | — | 31 | 90 | 17,731 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 1,408 | 1,654 | 3,412 | 670,888 |
| (イスラエル) | | 38 | 34 | — | <3.9%> |
| | | | | 千イスラエル・シケル | |
| REIT 1 LTD | | 9 | 14 | 267 | 11,064 |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT | | 10 | 11 | 97 | 4,031 |
| MENIVIM- THE NEW REIT LTD | | 32 | 63 | 124 | 5,158 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 51 | 89 | 489 | 20,254 |
| | | 3 | 3 | — | <0.1%> |
| (ユーロ/アイルランド) | | | | 千ユーロ | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | | 21 | 41 | 34 | 5,737 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 21 | 41 | 34 | 5,737 |
| | | 1 | 1 | — | <0.0%> |
| (ユーロ/オランダ) | | | | | |
| WERELDHAVE NV | | 1 | 1 | 26 | 4,388 |
| VASTNED RETAIL NV | | 0.513 | — | — | — |
| NSI NV | | 1 | 1 | 23 | 3,893 |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | | 1 | 3 | 68 | 11,288 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 5 | 6 | 119 | 19,570 |
| | | 4 | 3 | — | <0.1%> |
| (ユーロ/ベルギー) | | | | | |
| COFINIMMO | | 1 | 2 | 154 | 25,410 |
| RETAIL ESTATES | | 0.499 | 0.887 | 51 | 8,523 |
| INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES | | 0.799 | — | — | — |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | | 7 | 12 | 249 | 41,019 |
| AEDIFICA | | 2 | 3 | 186 | 30,610 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | | 1 | 2 | 68 | 11,306 |
| MONTEA NV | | 0.751 | 1 | 82 | 13,604 |
| CARE PROPERTY INVEST | | 1 | 3 | 37 | 6,162 |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD | | — | 2 | 90 | 14,808 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 17 | 27 | 921 | 151,445 |
| | | 8 | 8 | — | <0.9%> |

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

| 銘柄 | | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|------------------------------|------------------|--------------|---------------|------------|-----------------------|
| | | □数 | □数 | 評価額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| | | 千□ | 千□ | 千ユーロ | 千円 |
| (ユーロ/フランス) | | | | | |
| KLEPIERRE | | 9 | 15 | 435 | 71,546 |
| GECINA SA | | 2 | 3 | 345 | 56,770 |
| COVIVIO | | 2 | 3 | 180 | 29,700 |
| MERCIALYS | | 4 | 6 | 71 | 11,727 |
| ICADE | | 1 | 2 | 49 | 8,210 |
| ALTAREA | | 0.208 | 0.386 | 38 | 6,302 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | | 5 | 7 | 521 | 85,592 |
| CARMILA | | 2 | 4 | 67 | 11,150 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 28 8 | 42 8 | 1,710 - | 281,001 <1.6%> |
| (ユーロ/ドイツ) | | | | | |
| HAMBORNER REIT AG | | 4 | 5 | 32 | 5,277 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 4 1 | 5 1 | 32 - | 5,277 <0.0%> |
| (ユーロ/スペイン) | | | | | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | | 3 | 3 | 32 | 5,345 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 16 | 27 | 274 | 45,089 |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | | 13 | 23 | 127 | 21,007 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 33 3 | 54 3 | 434 - | 71,443 <0.4%> |
| (ユーロ/イタリア) | | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | | 1 | 1 | 2 | 422 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 1 1 | 1 1 | 2 - | 422 <0.0%> |
| ユーロ計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 111 26 | 179 25 | 3,256 - | 534,898 <3.1%> |
| 合計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 7,584 297 | 10,196 277 | - | 16,137,324 <94.5%> |

(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。

(注2) 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3) □数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、□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 |
| | | 百万円 | 百万円 |
| 外国 | DOW JONES U.S. REAL ESTATE INDEX | 788 | - |
| | THE STOXX 600 REAL ESTATE INDEX | 105 | - |

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託証券 | 16,137,324 | 93.9 |
| コール・ローン等、その他 | 1,050,997 | 6.1 |
| 投資信託財産総額 | 17,188,322 | 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・シケル41.387円、1ユーロ164.27円です。

(注2) 外貨建純資産 (16,592,508千円) の投資信託財産総額 (17,188,322千円) に対する比率は96.5%です。

(注3) 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11月20日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|-----------------|
| (A)資産 | 17,646,293,565円 |
| コール・ローン等 | 622,333,019 |
| 投資信託証券(評価額) | 16,137,324,279 |
| 未収入金 | 493,643,894 |
| 未収配当金 | 21,051,631 |
| 差入委託証拠金 | 371,940,742 |
| (B)負債 | 576,540,986 |
| 未払金 | 491,923,494 |
| 未払解約金 | 84,617,492 |
| (C)純資産総額(A-B) | 17,069,752,579 |
| 元本 | 8,905,400,978 |
| 次期繰越損益金 | 8,164,351,601 |
| (D)受益権総口数 | 8,905,400,978口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 19,168円 |

(注1) 期首元本額 6,248,675,491円

期中追加設定元本額 4,041,339,553円

期中一部解約元本額 1,384,614,066円

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

ニッセイ先進国リートインデックスファンド

(適格機関投資家限定) 1,631,116,444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) 221,947,014円

ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)

26,978,986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)

8,914,026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) 51,284,509円

ニッセイ海外リートインデックス(為替ヘッジあり)

(ラップ専用) 52,075,369円

ニッセイ海外リートインデックス(為替ヘッジなし)

(ラップ専用) 4,186,353,050円

FWニッセイ先進国リートインデックス 25,035,157円

DCニッセイ先進国リートインデックス 2,701,696,423円

損益の状況

当期(2023年11月21日~2024年11月20日)

| 項目 | 当期 |
|-------------------|---------------|
| (A)配当等収益 | 489,138,252円 |
| 受取配当金 | 474,888,886 |
| 受取の他利益 | 2,557,108 |
| 支払の利息 | 11,705,275 |
| △ | 13,017 |
| (B)有価証券売買損益 | 2,701,351,887 |
| 売買益 | 3,034,336,981 |
| △ | 332,985,094 |
| (C)先物取引等損益 | 74,748,956 |
| 取引利益 | 171,559,684 |
| △ | 96,810,728 |
| (D)信託報酬等 | △ 16,040,168 |
| (E)当期損益金(A+B+C+D) | 3,249,198,927 |
| (F)前期繰越損益金 | 3,045,601,686 |
| (G)追加信託差損益金 | 2,844,461,932 |
| (H)解約差損益金 | △ 974,910,944 |
| (I)合計(E+F+G+H) | 8,164,351,601 |
| 次期繰越損益金(I) | 8,164,351,601 |

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

運用報告書

第 8 期

(計算期間：2023年3月11日～2024年3月11日)

運用方針

- ① 国内の公社債に投資し、NOMURA – B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

主要運用 対象

国内の公社債

運用方法

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年3月11日～2024年3月11日

国内債券市況



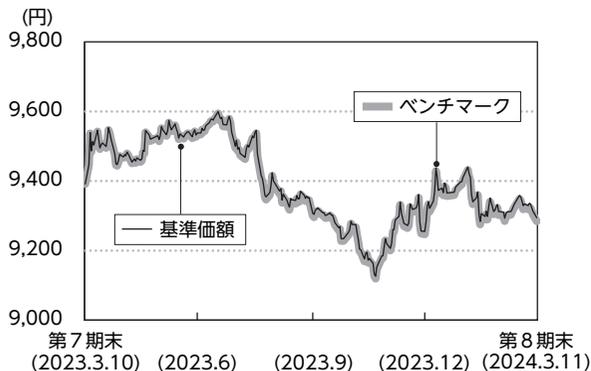
(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

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

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用して、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比等を調整し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

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

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

引き続き、クオンツモデルに基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

最近5期の運用実績

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年3月11日～2024年3月11日

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

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（9,394円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2023年3月11日～2024年3月11日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

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

主要な売買銘柄

2023年3月11日～2024年3月11日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2024年3月11日現在

国内(邦貨建)公社債

| 区分 | 当期末 | | | | | | |
|------------------|--------------|--------------|--------|-----------------|-----------|--------|-------|
| | 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 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 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 | 千円 |
| 国債証券 | 第 12 回 利付国債 (40年) | 0.5000 | 2059/ 3 /20 | 106,000 | 70,076 |
| | 第 13 回 利付国債 (40年) | 0.5000 | 2060/ 3 /20 | 170,000 | 110,918 |
| | 第 14 回 利付国債 (40年) | 0.7000 | 2061/ 3 /20 | 196,000 | 136,012 |
| | 第 15 回 利付国債 (40年) | 1.0000 | 2062/ 3 /20 | 220,000 | 168,126 |
| | 第 16 回 利付国債 (40年) | 1.3000 | 2063/ 3 /20 | 179,000 | 149,570 |
| | 第339回 利付国債 (10年) | 0.4000 | 2025/ 6 /20 | 444,000 | 445,776 |
| | 第340回 利付国債 (10年) | 0.4000 | 2025/ 9 /20 | 493,000 | 495,026 |
| | 第341回 利付国債 (10年) | 0.3000 | 2025/12/20 | 465,000 | 466,106 |
| | 第342回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2026/ 3 /20 | 395,000 | 394,281 |
| | 第343回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2026/ 6 /20 | 328,000 | 327,291 |
| | 第344回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2026/ 9 /20 | 322,000 | 321,188 |
| | 第345回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2026/12/20 | 358,000 | 356,961 |
| | 第346回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2027/ 3 /20 | 333,000 | 331,897 |
| | 第347回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2027/ 6 /20 | 269,000 | 267,819 |
| | 第348回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2027/ 9 /20 | 335,000 | 333,124 |
| | 第349回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2027/12/20 | 337,000 | 334,731 |
| | 第350回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2028/ 3 /20 | 431,000 | 427,487 |
| | 第351回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2028/ 6 /20 | 341,000 | 337,763 |
| | 第352回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2028/ 9 /20 | 288,000 | 284,791 |
| | 第353回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2028/12/20 | 275,000 | 271,515 |
| | 第354回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2029/ 3 /20 | 310,000 | 305,722 |
| | 第355回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2029/ 6 /20 | 318,000 | 313,312 |
| | 第356回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2029/ 9 /20 | 250,000 | 246,077 |
| | 第357回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2029/12/20 | 284,000 | 279,268 |
| | 第358回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2030/ 3 /20 | 245,000 | 240,675 |
| | 第359回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2030/ 6 /20 | 304,000 | 298,233 |
| | 第360回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2030/ 9 /20 | 363,000 | 355,282 |
| | 第361回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2030/12/20 | 373,000 | 364,174 |
| | 第362回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2031/ 3 /20 | 384,000 | 374,085 |
| | 第363回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2031/ 6 /20 | 384,000 | 372,956 |
| | 第364回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2031/ 9 /20 | 392,000 | 379,385 |
| | 第365回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2031/12/20 | 398,000 | 384,070 |
| | 第366回 利付国債 (10年) | 0.2000 | 2032/ 3 /20 | 439,000 | 425,882 |
| | 第367回 利付国債 (10年) | 0.2000 | 2032/ 6 /20 | 136,000 | 131,555 |
| | 第368回 利付国債 (10年) | 0.2000 | 2032/ 9 /20 | 413,000 | 398,466 |
| | 第369回 利付国債 (10年) | 0.5000 | 2032/12/20 | 432,000 | 426,617 |
| | 第370回 利付国債 (10年) | 0.5000 | 2033/ 3 /20 | 470,000 | 463,001 |
| 第371回 利付国債 (10年) | 0.4000 | 2033/ 6 /20 | 147,000 | 143,097 | |
| 第372回 利付国債 (10年) | 0.8000 | 2033/ 9 /20 | 495,000 | 498,306 | |

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|------------------|---|---------------|-------------|------------|---------|-----------|
| | | % | | 千円 | 千円 | |
| 特殊債券 (除く金融債券) | 第 36 回 地方公共団体金融機構債券 (20年) | 1.5660 | 2034/ 4 /28 | 100,000 | 105,029 | |
| | 第 1 回 地方公共団体金融機構債券 (30年) | 1.8640 | 2044/ 6 /28 | 100,000 | 101,358 | |
| | 第 83 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.0200 | 2026/ 4 /17 | 103,000 | 102,473 | |
| | 第116回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.0950 | 2029/ 1 /22 | 138,000 | 135,733 | |
| | 第120回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.0010 | 2029/ 7 /13 | 100,000 | 97,578 | |
| | 第136回 地方公共団体金融機構債券 | 0.1450 | 2030/ 9 /27 | 200,000 | 193,187 | |
| | 第 72 回 日本政策金融公庫債券 | 0.2550 | 2028/ 8 / 9 | 100,000 | 98,971 | |
| | 第 97 回 都市再生債券 | 1.0170 | 2029/ 9 /20 | 100,000 | 102,588 | |
| | 第 33 回 政保中部国際空港債券 | 0.2600 | 2028/ 3 /17 | 100,000 | 99,559 | |
| | 第 59 回 住宅金融支援機構債券 | 1.9500 | 2030/10/22 | 200,000 | 217,563 | |
| | 第143回 住宅金融支援機構債券 | 1.1920 | 2028/10/20 | 100,000 | 103,141 | |
| | 第 37 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.7100 | 2045/ 6 /10 | 17,734 | 18,356 | |
| | 第 42 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.4300 | 2045/11/10 | 44,608 | 45,928 | |
| | 第 46 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.8500 | 2046/ 3 /10 | 51,141 | 53,120 | |
| | 第 54 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.4700 | 2046/11/10 | 43,062 | 44,379 | |
| | 第 55 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.4100 | 2046/12/10 | 48,430 | 49,815 | |
| | 第 60 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.3400 | 2047/ 5 /10 | 49,720 | 51,017 | |
| | 第 61 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.2600 | 2047/ 6 /10 | 25,093 | 25,660 | |
| | 第 62 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.2100 | 2047/ 7 /10 | 226,928 | 231,262 | |
| | 第 63 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.1100 | 2047/ 8 /10 | 139,590 | 141,600 | |
| | 第 73 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.3000 | 2048/ 6 /10 | 99,432 | 101,619 | |
| | 第 78 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.0800 | 2048/11/10 | 86,481 | 87,691 | |
| | 第109回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.3600 | 2051/ 6 /10 | 189,573 | 180,871 | |
| | 第 66 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 1.0860 | 2029/ 5 /29 | 100,000 | 102,818 | |
| | | 小計 | - | - | - | 3,928,347 |
| | 金融債券 | い第845号 利付商工債券 | 0.1200 | 2025/10/27 | 200,000 | 199,458 |
| い第854号 利付商工債券 | | 0.0800 | 2026/ 7 /27 | 200,000 | 198,651 | |
| い第862号 利付商工債券 | | 0.1800 | 2027/ 3 /26 | 100,000 | 99,293 | |
| 第394回 利付信金中金債券 | | 0.1500 | 2027/ 9 /27 | 100,000 | 99,094 | |
| | | 小計 | - | - | - | 596,497 |
| 社債券 | 第 36 回 フランス相互信用連合銀行 (B F C M) 円債社債 (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 プリヂェストン | 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 | 千円 |
| 社債券 | 第 18 回 NTTファイナンス | 0.3800 | 2030/ 9 /20 | 100,000 | 97,418 |
| | 第 78 回 トヨタファイナンス | 0.2650 | 2027/ 7 /23 | 100,000 | 99,283 |
| | 第 55 回 日立キャピタル | 0.9630 | 2026/ 9 /18 | 100,000 | 101,158 |
| | 第 17 回 三井住友ファイナンス&リース | 0.4500 | 2028/ 2 / 8 | 100,000 | 99,235 |
| | 第 2 回 三菱HCキャピタル | 0.1900 | 2027/ 3 / 1 | 100,000 | 98,970 |
| | 第132回 三菱地所 | 0.4300 | 2030/ 4 /16 | 100,000 | 98,260 |
| | 第 7 回 野村不動産オフィスファンド投資法人 | 2.9000 | 2028/ 3 /17 | 200,000 | 216,468 |
| | 第 11 回 ジャパンエクセレント投資法人 | 0.6500 | 2027/ 4 /23 | 100,000 | 99,708 |
| | 第106回 東日本旅客鉄道 | 0.9810 | 2035/ 1 /29 | 100,000 | 98,412 |
| | 第 3 回 東日本旅客鉄道(サステナビリティボンド) | 0.2640 | 2032/ 1 /21 | 100,000 | 95,566 |
| | 第510回 関西電力 | 0.4900 | 2027/ 7 /23 | 100,000 | 99,830 |
| | 第494回 東北電力 | 0.4250 | 2027/ 6 /25 | 100,000 | 99,658 |
| | 第451回 九州電力 | 0.4500 | 2027/ 5 /25 | 100,000 | 99,790 |
| | 第 47 回 大阪瓦斯(トランジションボンド) | 0.5290 | 2032/ 9 / 1 | 100,000 | 96,789 |
| | | 小計 | - | - | - |
| | 合計 | - | - | - | 55,869,880 |

投資信託財産の構成

2024年3月11日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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ットファンド2055 | 350,854,103円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 8,816,046,964円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2045 | 642,290,762円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2035 | 3,586,989,645円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2025 | 1,208,005,642円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス | |
| バランスファンド(6資産均等型) | 384,915,856円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券) | 38,635,807円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券) | 149,044,598円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス | |
| バランスファンド(8資産均等型) | 86,288,489円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2060 | 211,978,736円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2050 | 229,582,939円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2040 | 824,409,138円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2030 | 3,471,043,373円 |
| FWニッセイ国内債インデックス | 47,391,415円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2065 | 38,651,602円 |

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

損益の状況

当期(2023年3月11日~2024年3月11日)

| 項目 | 当期 |
|------------------------|------------------------|
| (A)配当等収益 | 503,773,289円 |
| 受取利息 | 504,044,208 |
| 支払利息 | △ 270,919 |
| (B)有価証券売買損益 | △ 992,732,040 |
| 売買益 | 145,539,080 |
| 売買損 | △ 1,138,271,120 |
| (C)信託報酬等 | △ 11,481 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | △ 488,970,232 |
| (E)前期繰越損益金 | △ 4,292,419,196 |
| (F)追加信託差損益金 | △ 962,123,954 |
| (G)解約差損益金 | 1,456,877,572 |
| (H)合計(D+E+F+G) | △ 4,286,635,810 |
| 次期繰越損益金(H) | △ 4,286,635,810 |

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 36 期

(計算期間：2024年5月21日～2024年11月20日)

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 主に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| | 以下のような投資制限のもと運用を行います。 <ul style="list-style-type: none">・ 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。 |
| 主要運用対象 | 日本を除く主要国の国債 |



ニッセイアセットマネジメント株式会社

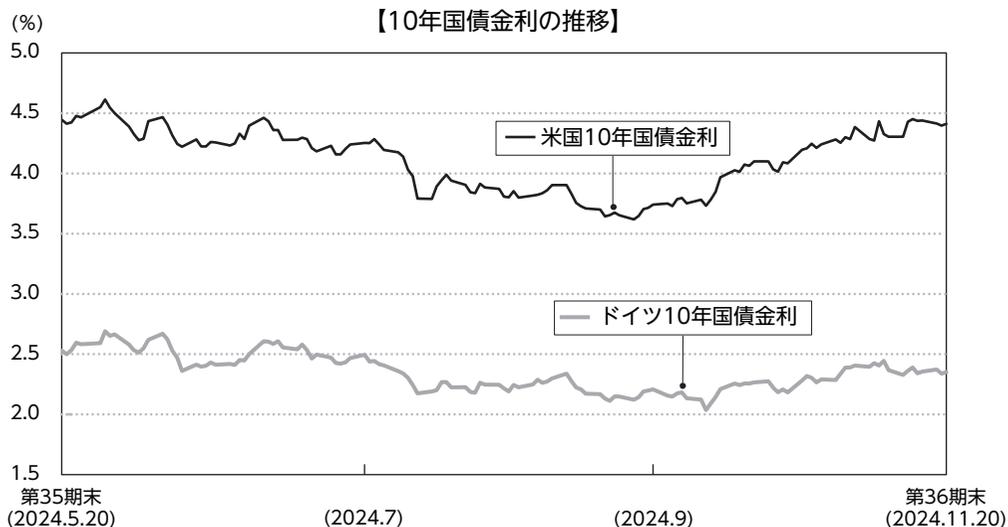
東京都千代田区丸の内1-6-6

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

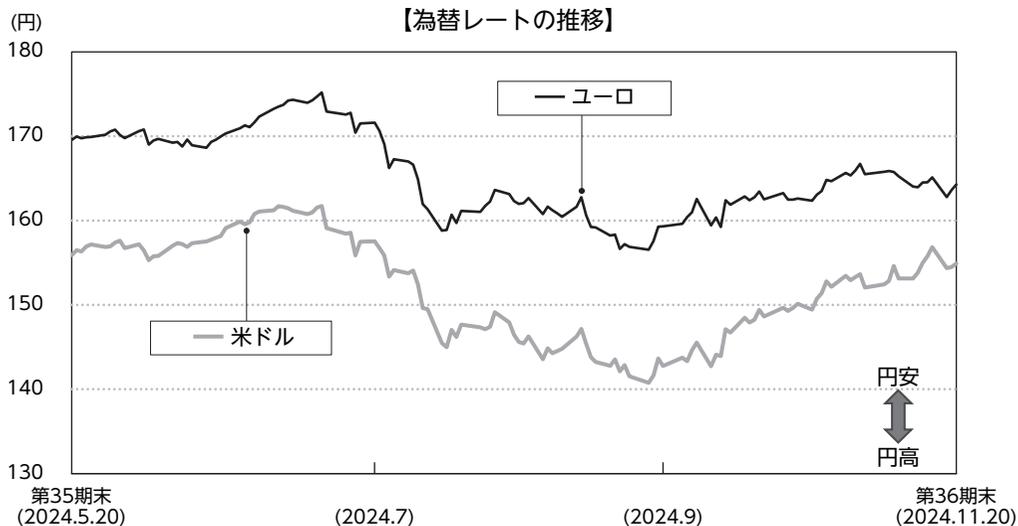


(注) プルームバーグのデータを使用しています。

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ったことで財政拡張や関税引き上げに伴う物価上昇への懸念が高まったことから金利は上昇し、結局、期を通じて見ると期初と同程度の水準で当期末を迎えました。

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

■為替市況

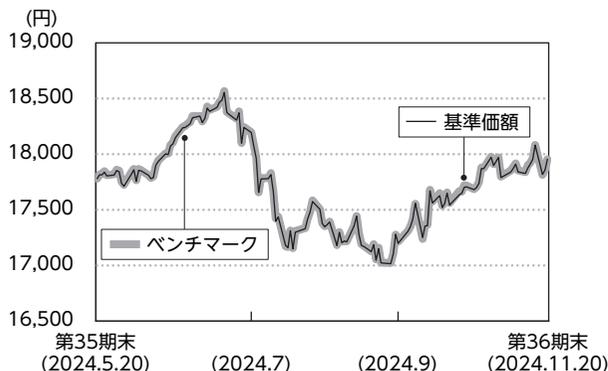


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

日本を除く主要国の国債に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2024年5月21日～2024年11月20日

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|--------|-----|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| その他費用 | 3円 | 0.017% | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (3) | (0.017) | 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | <ul style="list-style-type: none"> ・ 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。

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 | 千米ドル 75,686 | 千米ドル 53,863 | |
| | カナダ | 千カナダ・ドル 3,235 | 千カナダ・ドル 2,402 | |
| | オーストラリア | 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 | 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 | 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 | 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 | 千イスラエル・シケル 1,246 | 千イスラエル・シケル 1,191 | |
| | デンマーク | 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 | 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 | 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 | 千メキシコ・ペソ 13,845 | 千メキシコ・ペソ 2,890 | |
| | 中国 | 千人民元 153,187 | 千人民元 49,615 | |
| | マレーシア | 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 | 千ポーランド・ズロチ 3,073 | 千ポーランド・ズロチ 2,117 | |
| | ユーロ | アイルランド | 千ユーロ 224 | 千ユーロ 176 |
| | | オランダ | 848 | 1,030 |
| | | ベルギー | 1,082 | 1,175 |
| | | フランス | 6,001 | 4,023 |
| | | ドイツ | 5,128 | 3,941 |
| | | ポルトガル | 3,293 | – |
| スペイン | | 3,454 | 3,016 | |
| イタリア | | 5,674 | 3,749 | |
| フィンランド | | 516 | 434 | |
| オーストリア | | 928 | 664 | |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2024年5月21日～2024年11月20日

公社債

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

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2024年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

| 区分 | 当期末 | | | | | | | |
|-----------|---------------|---------------|------------|------|-----------------|-----------|------|------|
| | 額面金額 | 評価額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 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 |
| | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | | | | | | |
| カナダ | 17,000 | 16,090 | 1,785,768 | 1.9 | — | 1.1 | 0.4 | 0.4 |
| | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | | | | | | |
| オーストラリア | 13,040 | 11,591 | 1,174,220 | 1.3 | — | 0.9 | 0.3 | 0.2 |
| | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | | | | | | |
| シンガポール | 3,330 | 3,253 | 376,940 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 |
| | 千ニューージーランド・ドル | 千ニューージーランド・ドル | | | | | | |
| ニューージーランド | 3,090 | 2,788 | 255,684 | 0.3 | — | 0.2 | 0.1 | 0.0 |
| | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | | | | | | |
| イギリス | 29,260 | 23,951 | 4,708,844 | 5.1 | — | 3.6 | 1.2 | 0.3 |
| | 千イスラエル・シケル | 千イスラエル・シケル | | | | | | |
| 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BB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 | |
| デンマーク | 千デンマーク・クローネ 11,120 | 千デンマーク・クローネ 10,937 | 千円 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 10,860 | 千ノルウェー・クローネ 10,135 | 143,211 | 0.2 | - | 0.1 | 0.0 | 0.0 | |
| スウェーデン | 千スウェーデン・クローナ 10,850 | 千スウェーデン・クローナ 10,648 | 151,309 | 0.2 | - | 0.1 | 0.1 | 0.0 | |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ 98,250 | 千メキシコ・ペソ 88,369 | 680,605 | 0.7 | - | 0.4 | 0.2 | 0.1 | |
| 中国 | 千人民元 455,770 | 千人民元 475,936 | 10,192,509 | 11.0 | - | 5.0 | 3.9 | 2.1 | |
| マレーシア | 千マレーシア・リンギット 12,970 | 千マレーシア・リンギット 13,267 | 459,964 | 0.5 | - | 0.3 | 0.1 | 0.0 | |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 13,120 | 千ポーランド・ズロチ 12,320 | 467,006 | 0.5 | - | 0.1 | 0.3 | 0.1 | |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | | |
| | アイルランド | 2,920 | 2,644 | 434,358 | 0.5 | - | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| | オランダ | 7,930 | 7,376 | 1,211,691 | 1.3 | - | 0.8 | 0.4 | 0.1 |
| | ベルギー | 9,390 | 8,766 | 1,440,099 | 1.6 | - | 1.1 | 0.4 | 0.1 |
| | フランス | 45,110 | 41,594 | 6,832,706 | 7.4 | - | 4.3 | 2.2 | 0.9 |
| | ドイツ | 34,030 | 32,221 | 5,293,058 | 5.7 | - | 3.2 | 1.8 | 0.7 |
| | ポルトガル | 3,430 | 3,292 | 540,935 | 0.6 | - | 0.4 | 0.2 | 0.0 |
| | スペイン | 25,970 | 25,036 | 4,112,782 | 4.4 | - | 2.5 | 1.4 | 0.6 |
| | イタリア | 39,390 | 38,759 | 6,366,971 | 6.9 | - | 3.9 | 1.9 | 1.0 |
| | フィンランド | 3,070 | 2,763 | 453,927 | 0.5 | - | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| オーストリア | 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 | 17.9 | |

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|------|-------------|--------|------------|--------|--------|-----------|
| | | | | | 千米ドル | 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 | |
|------|-------------|--------|------------|-------|-------|---------|
| | | | | | 千円 | 千円 |
| アメリカ | | % | | 千円ドル | 千円ドル | 千円 |
| 国債証券 | US TREASURY | 1.7500 | 2029/11/15 | 3,300 | 2,936 | 454,909 |
| | US TREASURY | 1.5000 | 2030/02/15 | 3,890 | 3,386 | 524,635 |
| | US TREASURY | 0.6250 | 2030/08/15 | 5,110 | 4,165 | 645,201 |
| | US TREASURY | 0.8750 | 2030/11/15 | 5,440 | 4,473 | 693,061 |
| | US TREASURY | 1.1250 | 2031/02/15 | 5,550 | 4,606 | 713,592 |
| | US TREASURY | 1.6250 | 2031/05/15 | 5,630 | 4,781 | 740,632 |
| | US TREASURY | 1.2500 | 2031/08/15 | 5,910 | 4,858 | 752,583 |
| | US TREASURY | 1.3750 | 2031/11/15 | 2,550 | 2,099 | 325,271 |
| | US TREASURY | 1.8750 | 2032/02/15 | 2,390 | 2,027 | 314,003 |
| | US TREASURY | 2.8750 | 2032/05/15 | 2,290 | 2,076 | 321,720 |
| | US TREASURY | 2.7500 | 2032/08/15 | 2,260 | 2,024 | 313,567 |
| | US TREASURY | 4.1250 | 2032/11/15 | 2,280 | 2,247 | 348,129 |
| | US TREASURY | 3.5000 | 2033/02/15 | 2,220 | 2,088 | 323,599 |
| | US TREASURY | 3.3750 | 2033/05/15 | 2,280 | 2,120 | 328,524 |
| | US TREASURY | 3.8750 | 2033/08/15 | 2,480 | 2,390 | 370,308 |
| | US TREASURY | 4.5000 | 2033/11/15 | 2,620 | 2,643 | 409,525 |
| | US TREASURY | 4.0000 | 2034/02/15 | 2,760 | 2,679 | 415,058 |
| | US TREASURY | 4.3750 | 2034/05/15 | 2,740 | 2,737 | 424,118 |
| | US TREASURY | 3.8750 | 2034/08/15 | 2,550 | 2,447 | 379,093 |
| | US TREASURY | 4.5000 | 2036/02/15 | 180 | 183 | 28,373 |
| | US TREASURY | 5.0000 | 2037/05/15 | 160 | 169 | 26,235 |
| | US TREASURY | 4.3750 | 2038/02/15 | 150 | 149 | 23,121 |
| | US TREASURY | 4.5000 | 2038/05/15 | 190 | 191 | 29,608 |
| | US TREASURY | 3.5000 | 2039/02/15 | 190 | 170 | 26,457 |
| | US TREASURY | 4.2500 | 2039/05/15 | 270 | 262 | 40,737 |
| | US TREASURY | 4.5000 | 2039/08/15 | 280 | 279 | 43,334 |
| | US TREASURY | 4.3750 | 2039/11/15 | 300 | 295 | 45,754 |
| | US TREASURY | 4.6250 | 2040/02/15 | 320 | 323 | 50,130 |
| | US TREASURY | 1.1250 | 2040/05/15 | 920 | 568 | 88,092 |
| | US TREASURY | 1.1250 | 2040/08/15 | 1,100 | 673 | 104,297 |
| | US TREASURY | 3.8750 | 2040/08/15 | 290 | 268 | 41,582 |
| | US TREASURY | 1.3750 | 2040/11/15 | 1,260 | 800 | 123,980 |
| | US TREASURY | 4.2500 | 2040/11/15 | 300 | 290 | 44,940 |
| | US TREASURY | 1.8750 | 2041/02/15 | 1,500 | 1,031 | 159,785 |
| | US TREASURY | 4.7500 | 2041/02/15 | 320 | 327 | 50,765 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2041/05/15 | 1,260 | 917 | 142,074 |
| | US TREASURY | 1.7500 | 2041/08/15 | 1,720 | 1,143 | 177,090 |
| | US TREASURY | 2.0000 | 2041/11/15 | 1,460 | 1,006 | 155,959 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------|--------------------|--------|------------|-------|-------|-----------|
| | | | | | 千円 | 千円 |
| イギリス | | % | | 千円 | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | UK TREASURY | 0.6250 | 2050/10/22 | 470 | 182 | 35,916 |
| | UK TREASURY | 1.2500 | 2051/07/31 | 620 | 290 | 57,045 |
| | UK TREASURY | 3.7500 | 2052/07/22 | 300 | 249 | 49,142 |
| | UK TREASURY | 1.5000 | 2053/07/31 | 520 | 253 | 49,858 |
| | UK TREASURY | 3.7500 | 2053/10/22 | 650 | 538 | 105,835 |
| | UK TREASURY | 4.3750 | 2054/07/31 | 450 | 415 | 81,763 |
| | UK TREASURY | 1.6250 | 2054/10/22 | 330 | 164 | 32,413 |
| | UK TREASURY | 4.2500 | 2055/12/07 | 410 | 371 | 73,069 |
| | UK TREASURY | 1.7500 | 2057/07/22 | 490 | 248 | 48,759 |
| | UK TREASURY | 4.0000 | 2060/01/22 | 310 | 268 | 52,742 |
| | UK TREASURY | 0.5000 | 2061/10/22 | 600 | 174 | 34,231 |
| | UK TREASURY | 4.0000 | 2063/10/22 | 330 | 283 | 55,827 |
| | UK TREASURY | 2.5000 | 2065/07/22 | 370 | 222 | 43,710 |
| | UK TREASURY | 3.5000 | 2068/07/22 | 390 | 302 | 59,512 |
| | UK TREASURY | 1.6250 | 2071/10/22 | 440 | 191 | 37,715 |
| | UK TREASURY | 1.1250 | 2073/10/22 | 250 | 87 | 17,261 |
| 小計 | | - | - | - | - | 4,708,844 |
| イスラエル | | | | 千円 | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | ISRAEL FIXED BOND | 0.5000 | 2026/02/27 | 660 | 631 | 26,154 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 6.2500 | 2026/10/30 | 330 | 342 | 14,180 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 2.0000 | 2027/03/31 | 580 | 556 | 23,043 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 3.7500 | 2027/09/30 | 420 | 414 | 17,151 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 2.2500 | 2028/09/28 | 740 | 685 | 28,375 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 3.7500 | 2029/02/28 | 800 | 799 | 33,090 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.0000 | 2030/03/31 | 880 | 740 | 30,657 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.3000 | 2032/04/30 | 690 | 553 | 22,911 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 4.0000 | 2035/03/30 | 390 | 377 | 15,631 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.5000 | 2037/05/31 | 740 | 517 | 21,437 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 5.5000 | 2042/01/31 | 520 | 576 | 23,878 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 3.7500 | 2047/03/31 | 600 | 512 | 21,190 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 2.8000 | 2052/11/29 | 400 | 274 | 11,355 |
| 小計 | | - | - | - | - | 289,059 |
| デンマーク | | | | 千円 | 千円 | 千円 |
| 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 | | % | | 千円マーク・クロネ | 千円マーク・クロネ | 千円 |
| 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK | 2.2500 | 2033/11/15 | 1,330 | 1,352 | 29,774 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 4.5000 | 2039/11/15 | 2,390 | 3,067 | 67,547 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.2500 | 2052/11/15 | 1,490 | 877 | 19,327 |
| | 小計 | - | - | - | - | 240,845 |
| ノルウェー | | | | 千円ノルウェー・クロネ | 千円ノルウェー・クロネ | |
| 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2026/02/19 | 1,360 | 1,319 | 18,642 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2027/02/17 | 1,240 | 1,186 | 16,760 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0000 | 2028/04/26 | 1,060 | 1,003 | 14,174 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2029/09/06 | 970 | 890 | 12,580 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.3750 | 2030/08/19 | 1,280 | 1,131 | 15,983 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2031/09/17 | 1,060 | 908 | 12,832 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.1250 | 2032/05/18 | 1,070 | 963 | 13,616 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2033/08/15 | 1,340 | 1,269 | 17,941 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.6250 | 2034/04/13 | 1,010 | 1,002 | 14,161 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.5000 | 2042/10/06 | 470 | 461 | 6,518 |
| 小計 | | - | - | - | - | 143,211 |
| スウェーデン | | | | 千円スウェーデン・クロナ | 千円スウェーデン・クロナ | |
| 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT | 1.0000 | 2026/11/12 | 2,020 | 1,988 | 28,256 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.7500 | 2028/05/12 | 1,740 | 1,675 | 23,808 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.7500 | 2029/11/12 | 1,750 | 1,653 | 23,497 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.1250 | 2031/05/12 | 1,300 | 1,154 | 16,399 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 2.2500 | 2032/06/01 | 1,070 | 1,086 | 15,434 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.7500 | 2033/11/11 | 1,360 | 1,324 | 18,815 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 2.2500 | 2035/05/11 | 600 | 606 | 8,616 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5000 | 2039/03/30 | 1,010 | 1,159 | 16,480 |
| 小計 | | - | - | - | - | 151,309 |
| メキシコ | | | | 千円メキシコ・ペソ | 千円メキシコ・ペソ | |
| 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.7500 | 2026/03/05 | 9,150 | 8,697 | 66,988 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.0000 | 2026/09/03 | 7,100 | 6,773 | 52,171 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.5000 | 2027/03/04 | 9,220 | 8,411 | 64,782 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5000 | 2027/06/03 | 7,720 | 7,361 | 56,696 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2029/03/01 | 6,650 | 6,355 | 48,952 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2029/05/31 | 7,440 | 7,116 | 54,811 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500 | 2031/05/29 | 9,280 | 8,434 | 64,963 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5000 | 2033/05/26 | 7,250 | 6,288 | 48,434 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500 | 2034/11/23 | 5,320 | 4,625 | 35,621 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000 | 2035/05/24 | 600 | 529 | 4,076 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------|-----------------------|--------|------------|--------|--------|------------|
| | | | | | 千人民元 | 千円 |
| 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 | | | | 千人民元 | 千人民元 | |
| 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 | |
|---------------------|------------------------|------------|------------|-------|--------|---------|
| | | | | | 千円 | 邦貨換算金額 |
| マレーシア | | % | | 千円 | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.7330 | 2028/06/15 | 550 | 552 | 19,161 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.5040 | 2029/04/30 | 230 | 238 | 8,262 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8850 | 2029/08/15 | 640 | 646 | 22,425 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.4980 | 2030/04/15 | 610 | 633 | 21,959 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 2.6320 | 2031/04/15 | 680 | 635 | 22,028 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.2320 | 2031/06/30 | 380 | 389 | 13,494 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.5820 | 2032/07/15 | 390 | 383 | 13,288 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8440 | 2033/04/15 | 410 | 408 | 14,176 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.6420 | 2033/11/07 | 570 | 603 | 20,914 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8280 | 2034/07/05 | 460 | 458 | 15,912 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.2540 | 2035/05/31 | 350 | 359 | 12,468 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.7620 | 2037/04/07 | 590 | 635 | 22,028 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.8930 | 2038/06/08 | 550 | 601 | 20,863 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.0540 | 2039/04/18 | 250 | 252 | 8,750 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.7570 | 2040/05/22 | 540 | 523 | 18,157 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.6960 | 2042/10/15 | 560 | 603 | 20,932 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.9350 | 2043/09/30 | 190 | 210 | 7,306 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.1800 | 2044/05/16 | 220 | 223 | 7,733 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.7360 | 2046/03/15 | 240 | 260 | 9,038 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.9210 | 2048/07/06 | 410 | 458 | 15,883 |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.0650 | 2050/06/15 | 640 | 631 | 21,892 | |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 4.4570 | 2053/03/31 | 500 | 522 | 18,126 | |
| MALAYSIA GOVERNMENT | 3.5020 | 2027/05/31 | 340 | 340 | 11,788 | |
| 小計 | | - | - | - | - | 459,964 |
| ポーランド | | | | 千円 | 千円 | |
| 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 | | - | - | - | - |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 91,538,259 | 98.4 |
| コール・ローン等、その他 | 1,482,788 | 1.6 |
| 投資信託財産総額 | 93,021,048 | 100.0 |

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル154.91円、1カナダ・ドル110.98円、1オーストラリア・ドル101.30円、1シンガポール・ドル115.86円、1ニュージーランド・ドル91.69円、1イギリス・ポンド196.60円、1イスラエル・シケル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 |
| コーポレート債(評価額) | 857,912,337 |
| 未収入金 | 91,538,259,497 |
| 未収入利息 | 57,322,000 |
| 前払費用 | 555,900,675 |
| | 58,052,373 |
| (B)負債 | 517,514,897 |
| 未払金 | 243,166,837 |
| 未払解約金 | 274,348,060 |
| (C)純資産総額(A-B) | 92,549,931,985 |
| 元本 | 51,547,252,121 |
| 次期繰越損益金 | 41,002,679,864 |
| (D)受益権総口数 | 51,547,252,121口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 17,954円 |

(注1) 期首元本額 47,657,979,877円
 期中追加設定元本額 9,522,485,855円
 期中一部解約元本額 5,633,213,611円

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

| | |
|---|-----------------|
| DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) | 3,719,554,724円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) | 6,943,025,077円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) | 3,119,770,989円 |
| ニッセイ外国債券インデックスS A(適格機関投資家限定) | 948,516,964円 |
| ニッセイインデックスバランス(債券重視型) | |
| S A(適格機関投資家限定) | 1,748,607円 |
| ニッセイインデックスバランス(標準型) | |
| S A(適格機関投資家限定) | 1,820,511円 |
| ニッセイインデックスバランス(成長型) | |
| S A(適格機関投資家限定) | 4,169,717円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド | 16,419,568,826円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型) | 9,407,607,078円 |
| DCニッセイ外国債券インデックス | 5,312,167,039円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2055 | 415,696,244円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 2,277,794,873円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2045 | 481,210,463円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2035 | 658,843,100円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2025 | 47,605,942円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型) | 232,962,464円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券) | 23,409,296円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型) | 53,877,032円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2060 | 343,759,203円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2050 | 233,207,795円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2040 | 418,890,043円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2030 | 229,579,308円 |
| FWニッセイ外国債券インデックス | 87,499,591円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2065 | 161,963,647円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2070 | 3,003,588円 |

損益の状況

当期(2024年5月21日~2024年11月20日)

| 項目 | 当期 |
|------------------------|------------------------|
| (A)配当等収益 | 1,111,665,457円 |
| 受取利息 | 1,111,656,322 |
| その他収益金 | 9,135 |
| (B)有価証券売買損益 | △ 183,191,904 |
| 売買益 | 1,521,544,924 |
| 売買損 | △ 1,704,736,828 |
| (C)信託報酬等 | △ 14,988,773 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | 913,484,780 |
| (E)前期繰越損益金 | 37,079,358,443 |
| (F)追加信託差損益金 | 7,310,657,552 |
| (G)解約差損益金 | △ 4,300,820,911 |
| (H)合計(D+E+F+G) | 41,002,679,864 |
| 次期繰越損益金(H) | 41,002,679,864 |

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

・ 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）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。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。

・ 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 M S C I 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。

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

M S C I エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. が公表しているインデックスです。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 M S C I 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。

・ 東証 R E I T 指数（配当込み）

東証 R E I T 指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。J P X は、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。J P X は、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。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ありません。J P X は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。J P X は、ニッセイアセットマネジメント株式会社または当ファンドの購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、J P X は当ファンドの設定、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責任を有しません。

- ・ S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）
S & P先進国REITインデックス（除く日本）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、同インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。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。
- ・ NOMURA－BPI総合
NOMURA－BPI総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。
- ・ FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）
FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。