

第7期末（2024年11月20日）

基準価額	18,439円
純資産総額	256百万円
騰落率	17.9%
分配金	0円

ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式／リート)

【愛称】 ファンドパック5

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)」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5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およびリート(不動産投資信託)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。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター 0120-762-506

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



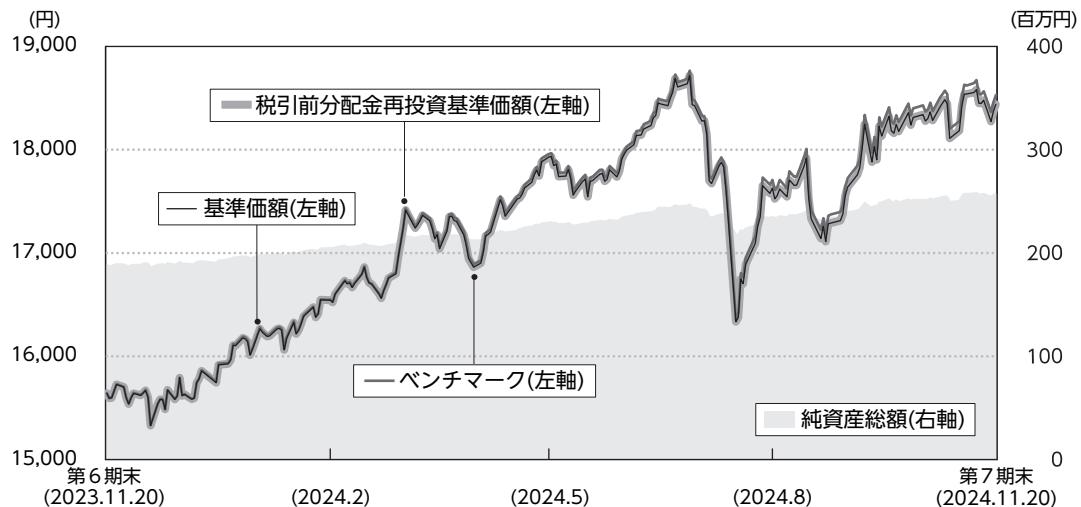
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年11月21日～2024年11月20日

基準価額等の推移



第7期首	15,642円	既払分配金	0円
第7期末	18,439円	騰落率（分配金再投資ベース）	17.9%

(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標化しています。

(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5分の1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標化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指標に関する」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スマザーファンド	5分の1	20.0%	16.4%
ニッセイ外国株式インデックススマザーファンド	5分の1	20.6	32.5
ニッセイ新興国株式インデックススマザーファンド	5分の1	19.6	18.3
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックススマザーファンド	5分の1	19.7	△ 4.0
ニッセイ先進国リートインデックススマザーファンド	5分の1	20.2	28.9

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	61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17,244円です。
(投信会社)	(28)	(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)	(28)	(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)	(5)	(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	2	0.009	
(株式)	(0)	(0.003)	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)	(0.005)	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)	(0.002)	
有価証券取引税	1	0.007	
(株式)	(1)	(0.005)	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)	(0.003)	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	12	0.068	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)	(8)	(0.044)	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)	(2)	(0.012)	<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	76	0.440	

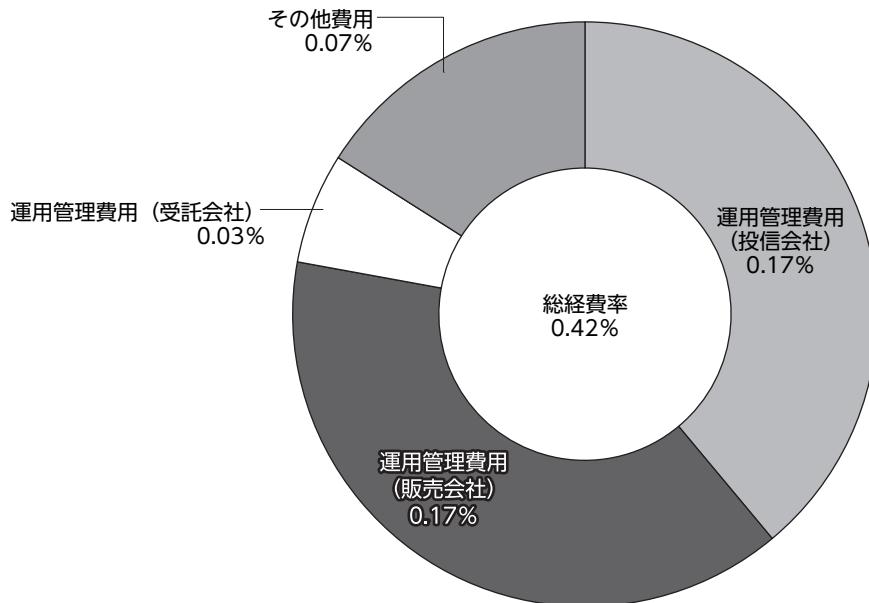
(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(参考情報)**■総経費率**

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）**は0.42%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きました。

■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・バンコーポ（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。

ポートフォリオ

■当ファンド

投資対象の異なる5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およびリート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>

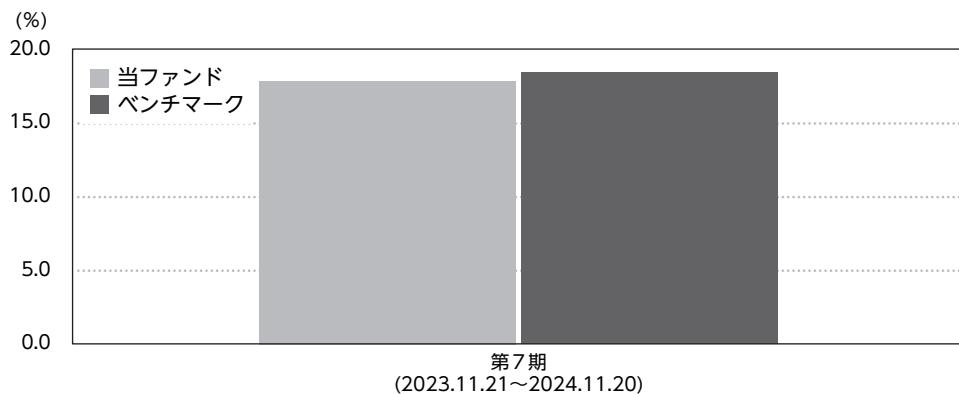
国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークである東証R E I T指數（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<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。

* ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指標について」をご参照ください。

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+17.9%となり、ベンチマーク騰落率 (+18.5%) を下回りました。

当ファンドは投資対象の異なる5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およびリート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	8,439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、ファンドの收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5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およびリート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－R E I T インデックススマザーファンド>

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。

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	20.0%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	20.6
ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	19.6
ニッセイJ－REITインデックス マザーファンド	19.7
ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	20.2

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

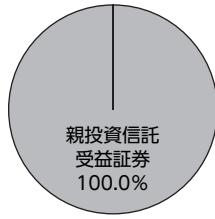
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

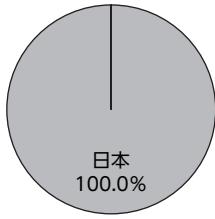
項目	第7期末 2024年11月20日
純資産総額	256,634,643円
受益権総口数	139,179,805口
1万口当たり基準価額	18,439円

(注) 当期間中における追加設定元本額は35,137,696円、同解約元本額は15,975,752円です。

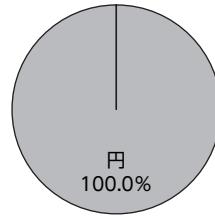
■資産別配分



■国別配分



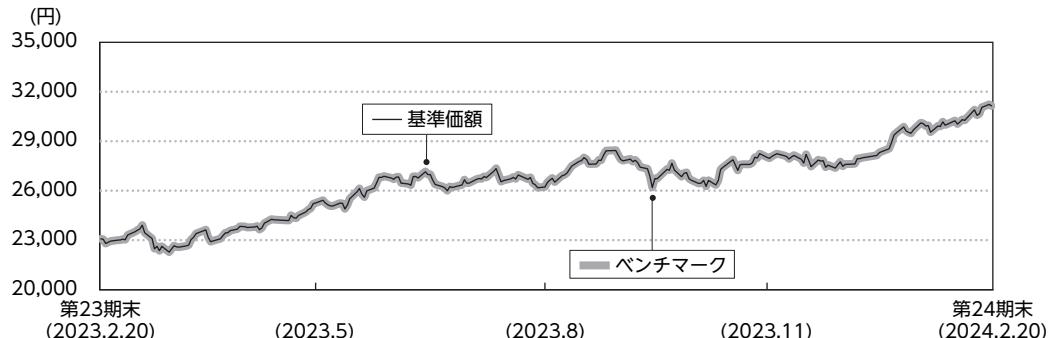
■通貨別配分



(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



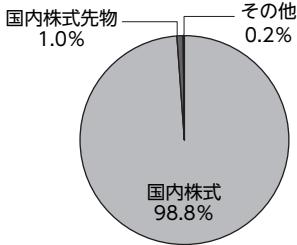
■上位銘柄

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

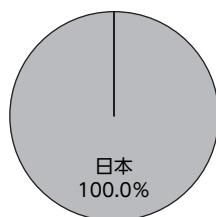
■1万口当たりの費用明細

2023.2.21～2024.2.20	
項目	金額
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)
(先物・オプション)	(0)
その他費用 (その他)	0 (0)
合計	0

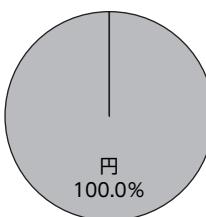
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄・資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（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

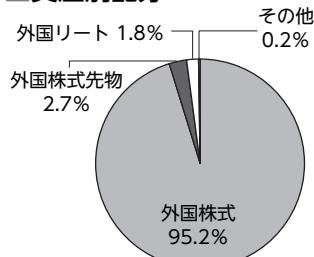
■基準価額の推移



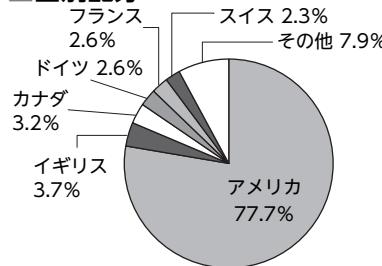
■上位銘柄

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

■資産別配分



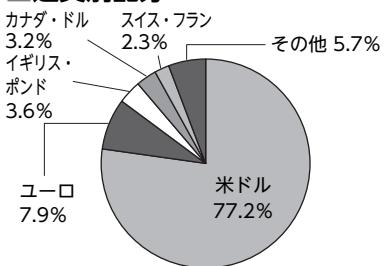
■国別配分



■1万口当たりの費用明細

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

■通貨別配分



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

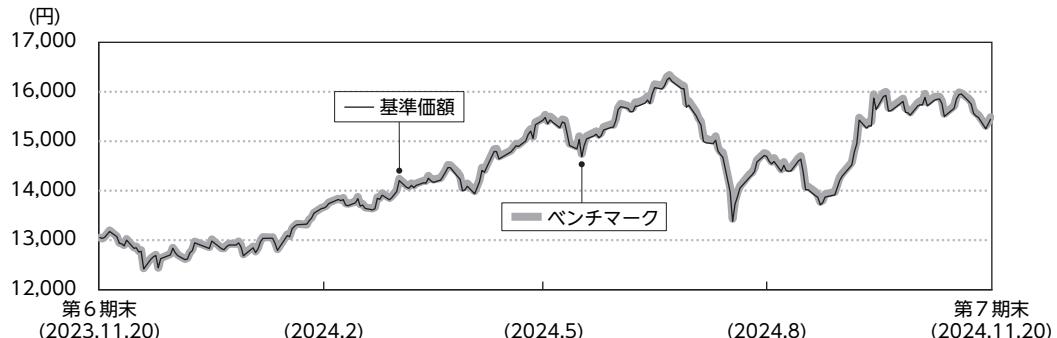
(注2) 上位銘柄・資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2024年11月20日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンドの概要

■基準価額の推移



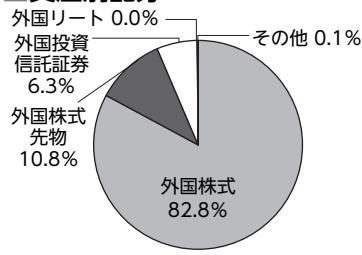
■上位銘柄

銘柄名	通貨	比率
MINI MSCI EM INDEX FUTURE 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

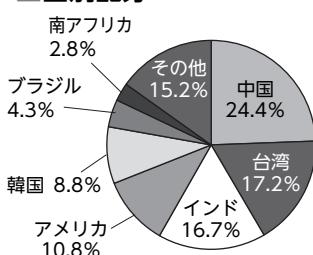
■1万口当たりの費用明細

2023.11.21～2024.11.20	
項目	金額
売買委託手数料	3円
(株式)	(2)
(先物・オプション)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	3
(株式)	(3)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	21
(保管費用)	(17)
(その他)	(4)
合計	27

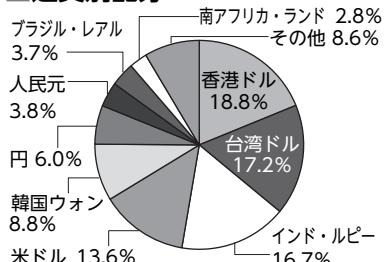
■資産別配分



■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。

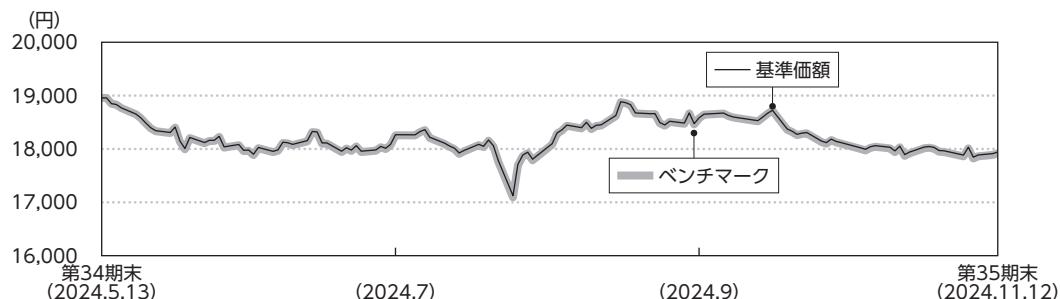
(注2) 上位銘柄・資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2024年11月20日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(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標化しています。

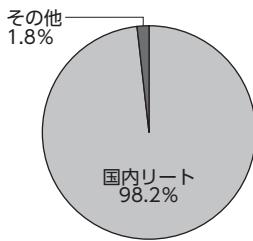
■上位銘柄

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ィート投資法人	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
G L P 投資法人	円	4.4
日本プロジスリート投資法人	円	4.3
K D X 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

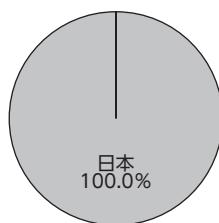
■1万口当たりの費用明細

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。

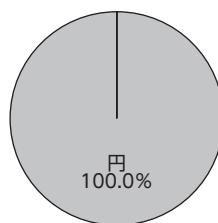
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



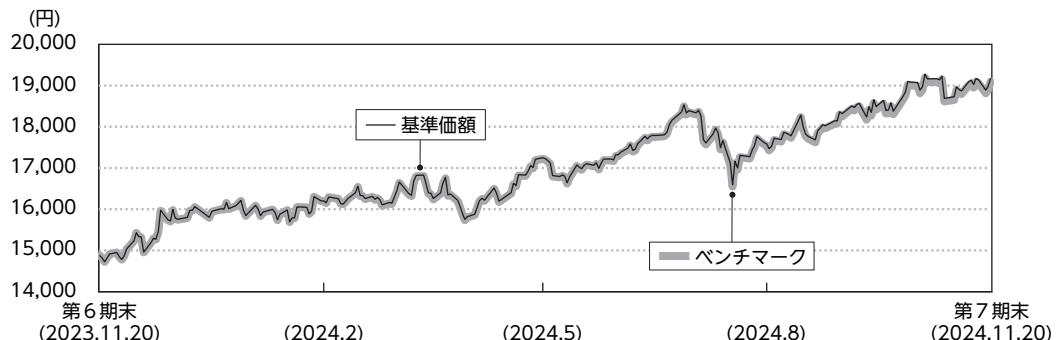
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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



■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

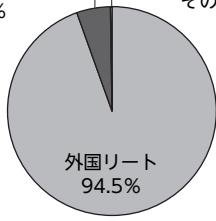
■1万口当たりの費用明細

2023.11.21～2024.11.20

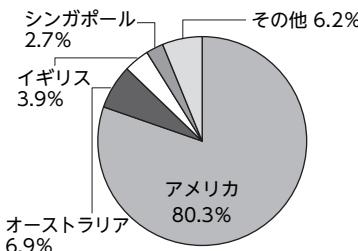
項目	金額
売買委託手数料	3円
(株式)	(0)
(先物・オプション)	(2)
(投資信託証券)	(1)
有価証券取引税	2
(株式)	(0)
(投資信託証券)	(2)
その他費用	21
(保管費用)	(15)
(その他)	(7)
合計	27

■資産別配分

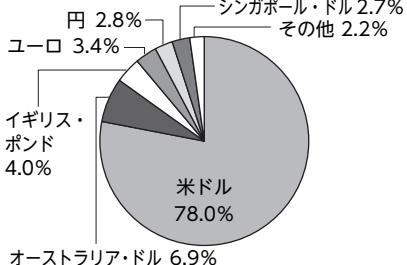
外国株式先物 5.2% その他 0.2%



■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・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配額)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金		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
				円	円							
3期(2020年11月20日)	10,927	0	△ 2.7	10,927		11,276	△ 1.0	57.3	2.0	—	40.0	57
4期(2021年11月22日)	14,174	0	29.7	14,174		14,744	30.8	55.7	2.9	0.0	40.9	107
5期(2022年11月21日)	14,020	0	△ 1.1	14,020		14,702	△ 0.3	54.9	3.4	—	41.0	137
6期(2023年11月20日)	15,642	0	11.6	15,642		16,497	12.2	54.6	4.9	—	40.1	187
7期(2024年11月20日)	18,439	0	17.9	18,439		19,544	18.5	55.2	4.3	—	40.0	256

(注1) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

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

(注3) 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	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	15,642	—	16,497	—	54.6	4.9	—	40.1
11月末	15,595	△ 0.3	16,457	△ 0.2	54.6	4.4	—	40.8
12月末	15,858	1.4	16,735	1.4	55.3	3.4	—	41.0
2024年1月末	16,254	3.9	17,156	4.0	56.3	3.8	—	39.6
2月末	16,665	6.5	17,586	6.6	56.3	4.0	—	39.2
3月末	17,364	11.0	18,336	11.1	55.7	3.2	—	40.6
4月末	17,515	12.0	18,508	12.2	55.3	4.1	—	40.3
5月末	17,599	12.5	18,603	12.8	55.4	4.6	—	39.6
6月末	18,200	16.4	19,244	16.7	55.9	3.7	—	40.0
7月末	17,831	14.0	18,855	14.3	53.7	3.7	—	42.1
8月末	17,656	12.9	18,710	13.4	54.2	5.0	—	40.3
9月末	17,880	14.3	18,954	14.9	56.4	3.5	—	39.8
10月末	18,445	17.9	19,550	18.5	55.7	3.7	—	40.1
(期末) 2024年11月20日	18,439	17.9	19,544	18.5	55.2	4.3	—	40.0

(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。

ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）

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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	千口 5,655	千円 17,730	千口 3,015	千円 9,355
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	3,406	14,893	2,974	13,016
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	11,402	16,252	8,072	11,788
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド	14,756	26,779	5,964	10,896
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	9,171	15,543	8,093	13,536

(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。

ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）

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	13,124	15,765	51,432
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	10,219	10,650	52,838
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	29,170	32,501	50,188
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド	19,278	28,070	50,464
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	25,900	26,978	51,713

(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－ＲＥＩＴ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	51,432	20.0
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	52,838	20.5
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	50,188	19.5
ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド	50,464	19.6
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	51,713	20.1
コール・ローン等、その他	1,061	0.4
投資信託財産総額	257,698	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イスラエル・ペソ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・クローネ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。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）

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	257,698,422円
コール・ローン等	421,577
ニッセイ国内株式インデックス	51,432,456
マザーファンド（評価額）	52,838,929
ニッセイ新興国株式インデックス	50,188,166
マザーファンド（評価額）	50,464,339
ニッセイJ-REITインデックス	51,713,320
マザーファンド（評価額）	639,635
(B)負債	1,063,779
未払解約金	621,616
未払信託報酬	429,005
その他未払費用	13,158
(C)純資産総額(A-B)	256,634,643
元本	139,179,805
次期繰越損益金	117,454,838
(D)受益権総口数	139,179,805口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,439円

(注) 期首元本額 120,017,861円
 期中追加設定元本額 35,137,696円
 期中一部解約元本額 15,975,752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	130円
受取利息	130
(B)有価証券売買損益	34,313,343
売買益	37,747,616
売買損	△ 3,434,273
(C)信託報酬等	814,130
(D)当期損益金(A+B+C)	33,499,343
(E)前期繰越損益金	30,550,289
(分配準備積立金)	(30,550,289)
(F)追加信託差損益金*	53,405,206
(配当等相当額)	(40,934,147)
(売買損益相当額)	(12,471,059)
(G)合計(D+E+F)	117,454,838
次期繰越損益金(G)	117,454,838
追加信託差損益金	53,405,206
(配当等相当額)	(40,934,147)
(売買損益相当額)	(12,471,059)
分配準備積立金	64,049,632

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換算による損益を含みます。
 (注2) (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	130円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	33,499,213円
(c) 信託約款に定める収益調整金	53,405,206円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	30,550,289円
(e) 分配対象額 (a+b+c+d)	117,454,838円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	8,439.07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およびリート（不動産投資信託）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）
	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
運用方法	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）
	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）

運用方法	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－REIT 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。
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。	

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 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。



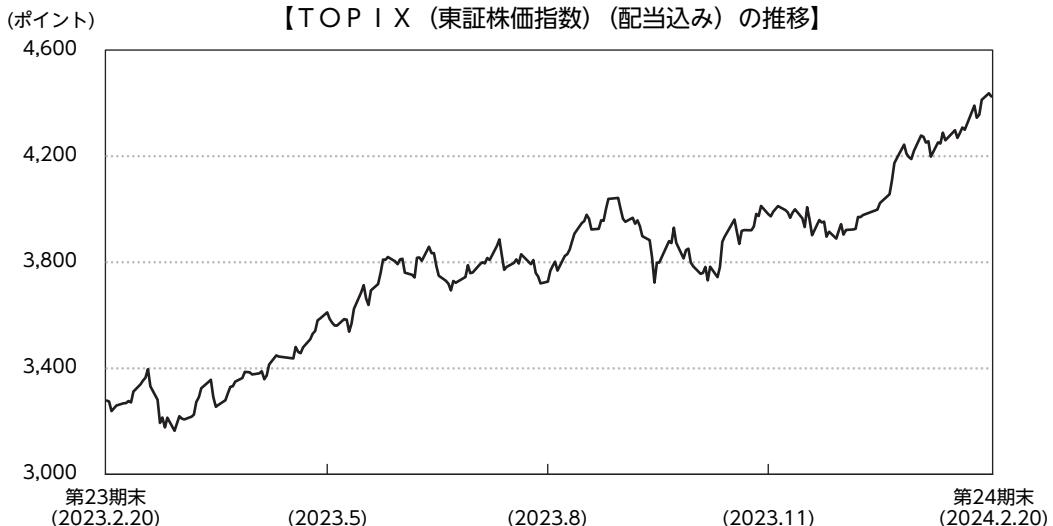
ニッセイアセットマネジメント株式会社

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の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



■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「指標について」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%)にはほぼ連動しました。

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)

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチマーク	期中	株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		騰落率		騰落率			
		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) 謄落率は期首比です。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

1万口当たりの費用明細

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 7,499 (23,418)	千円 15,648,076	千株 14,224	千円 29,977,664

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内 株式先物取引	百万円 37,374	百万円 40,391	百万円 -	百万円 -

(注) 単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

主要な売買銘柄

2023年2月21日～2024年2月20日

株式

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
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			銘柄	期首(前期末)			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	千円		株数	株数	千円	株数	株数	千円
水産・農林業(0.1%)													
極洋	3	3	11,036				ショーボンドホールディングス	12	11	69,935			
ニッスイ	89	83	77,224				ミライ・ワン	31	27	48,413			
マルハニチロ	13	12	35,670				タマホーム	6	5	20,644			
雪国まいたけ	7	7	6,816				ファーストコーポレーション	1	1	1,027			
カネコ種苗	3	2	4,079				安藤・間	51	48	59,237			
サカタのタネ	11	9	35,530				東急建設	25	26	21,060			
ホクト	7	6	12,381				コムシスホールディングス	30	26	88,006			
鉱業(0.3%)													
住石ホールディングス	13	9	20,012				ビーアールホールディングス	14	17	6,446			
日鉄鉱業	3	3	17,028				高松コンストラクショングループ	5	6	16,839			
三井松島ホールディングス	4	5	15,050				東建コーポレーション	2	2	20,139			
I N P E X	330	307	620,640				ソネック	4	1	1,387			
石油資源開発	10	9	58,656				ヤマウラ	4	4	6,300			
K & O エナジーグループ	4	3	9,359				オリエンタル白石	32	30	11,827			
							大成建設	62	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		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千円
大林組	223	208	295,048	ユアテック	13	12	16,166		
清水建設	187	164	147,321	日本リーテック	5	5	6,426		
飛島建設	6	6	8,820	四電工	2	2	9,588		
長谷工コーポレーション	64	53	100,097	中電工	9	9	26,613		
松井建設	8	7	6,650	関電工	34	36	57,002		
錢高組	1	—	—	きんでん	44	40	107,158		
鹿島建設	138	128	359,437	東京エネシス	6	6	7,167		
不動テトラ	4	4	8,844	トーエネット	2	1	10,222		
鉄建建設	4	4	10,378	住友電設	5	5	17,077		
西松建設	10	11	50,727	日本電設工業	10	10	22,781		
三井住友建設	50	43	18,575	エクシオグループ	28	28	88,721		
大豊建設	2	2	6,400	新日本空調	3	3	10,833		
佐田建設	10	2	1,505	九電工	15	12	70,043		
ナカノフードー建設	15	0.100	64	三機工業	13	12	24,330		
奥村組	10	9	47,470	日揮ホールディングス	61	57	80,413		
東鉄工業	8	7	21,888	中外炉工業	3	2	6,782		
淺沼組	5	4	17,909	ヤマト	6	2	2,060		
戸田建設	76	78	75,575	太平電業	3	3	15,444		
熊谷組	10	9	36,912	高砂熱学工業	15	15	68,172		
植木組	3	0.900	1,635	三晃金属工業	1	—	—		
矢作建設工業	8	7	12,624	朝日工業社	2	2	8,235		
ピーエス三菱	7	7	7,784	明星工業	10	11	13,865		
日本ハウスホールディングス	13	21	6,447	大氣社	7	6	32,428		
新日本建設	8	8	10,184	ダイダン	4	7	13,801		
東亜道路工業	1	2	14,858	日比谷総合設備	5	4	10,764		
日本道路	1	6	13,749	テスホールディングス	6	13	6,160		
東亜建設工業	5	4	20,947	インフロニア・ホールディングス	65	67	100,299		
日本国土開発	18	16	8,613	東洋エンジニアリング	—	8	7,021		
若築建設	2	2	6,594	レイズネクスト	9	8	19,832		
東洋建設	20	14	19,213	食料品(3.2%)					
五洋建設	88	82	62,797	ニップン	16	17	41,562		
世紀東急工業	8	7	14,520	日清製粉グループ本社	58	54	114,696		
福田組	2	2	11,726	日東富士製粉	1	1	6,360		
住友林業	47	50	205,374	昭和産業	5	5	19,494		
日本基礎技術	8	8	3,661	中部飼料	8	8	10,214		
巴コーポレーション	10	6	3,960	フィード・ワン	9	8	8,857		
大和ハウス工業	174	160	698,193	日本甜菜製糖	3	3	7,214		
ライト工業	11	12	22,596	DM三井製糖ホールディングス	6	5	18,821		
積水ハウス	195	176	580,356	塩水港精糖	23	—	—		
日特建設	6	5	6,501	ウェルネオシュガー	3	2	6,545		
北陸電気工事	7	5	6,864	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	評価額	千円
	千株	千株	千円		千株	千株	千株	千株	千円	千円	
中村屋	1	2	6,270	カゴメ	29	25	89,908				
江崎グリコ	17	16	77,955	アリアケジャパン	5	5	31,436				
名糖産業	3	3	6,826	エバラ食品工業	1	2	6,410				
井村屋グループ	3	3	8,620	ニチレイ	28	26	101,893				
不二家	4	4	10,040	東洋水産	31	29	248,360				
山崎製パン	42	39	149,401	イートアンドホールディングス	2	3	6,411				
モロゾフ	2	1	7,875	ヨシムラ・フード・ホールディングス	7	6	7,833				
亀田製菓	4	3	14,520	日清食品ホールディングス	22	61	275,598				
寿スピリッツ	6	27	53,889	永谷園ホールディングス	3	2	6,458				
カルビー	28	26	84,078	一正蒲鉾	6	—	—				
森永乳業	11	20	64,912	フジッコ	6	6	11,658				
六甲バター	4	4	6,495	ロック・フィールド	7	7	11,842				
ヤクルト本社	44	83	263,877	日本たばこ産業	412	354	1,385,103				
明治ホールディングス	38	71	244,728	ケンコーマヨネーズ	4	4	8,400				
雪印メグミルク	15	14	31,851	わらべや日洋ホールディングス	4	3	11,056				
プリマハム	8	7	17,924	なとり	3	3	8,025				
日本ハム	24	25	131,975	ファーマフーズ	9	8	8,316				
林兼産業	7	1	1,077	ユーブレナ	40	36	22,905				
丸大食品	6	5	9,817	紀文食品	5	5	6,211				
S Foods	6	6	20,448	ピックルスホールディングス	4	5	6,446				
柿安本店	2	2	6,577	ミヨシ油脂	3	—	—				
伊藤ハム米久ホールディングス	48	8	37,380	理研ビタミン	5	5	11,940				
サッポロホールディングス	20	19	129,196	繊維製品(0.4%)							
アサヒグループホールディングス	144	134	718,342	片倉工業	5	5	10,043				
キリンホールディングス	283	243	523,001	グンゼ	4	4	23,436				
宝ホールディングス	42	39	47,481	東洋紡	27	25	27,935				
オエノンホールディングス	18	17	6,072	富士紡ホールディングス	2	2	11,635				
養命酒製造	2	3	6,351	倉敷紡績	4	4	13,167				
コカ・コーラ ポトラーズジャパンホールディングス	49	45	89,092	日本毛織	16	15	20,550				
サントリー食品インターナショナル	44	41	198,184	帝国繊維	7	6	14,384				
ダイドーグループホールディングス	3	6	20,097	帝人	61	57	71,517				
伊藤園	23	19	83,674	東レ	427	397	274,630				
キーコーヒー	7	6	13,338	日本フェルト	11	5	2,409				
日清オイリオグループ	8	8	41,000	イチカワ	3	3	5,871				
不二製油グループ本社	14	13	32,402	アツギ	10	10	6,099				
J-オイルミルズ	6	6	12,971	セーレン	12	11	28,175				
キッコーマン	41	38	358,400	ソニー	5	5	3,950				
味の素	153	138	802,795	東海染工	1	1	1,318				
ブルドックソース	2	3	6,603	小松マテーレ	9	8	6,776				
キューピー	33	31	85,517	ワコールホールディングス	12	12	44,383				
ハウス食品グループ本社	19	20	63,114	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
T S I ホールディングス	千株	千株	千円			日本カーバイド工業	千株	千株	千円		
マツオカコーポレーション	22	19	13,452			3	4	7,749			
ワールド	4	3	4,937			4	4	8,860			
オンワードホールディングス	8	8	16,615			第一稀元素化学工業	5	6	5,999		
ゴールドワイン	41	35	18,340			エア・ウォーター	60	56	121,912		
デサント	11	10	93,628			日本酸素ホールディングス	61	57	237,542		
ヤマトイターナショナル	11	10	32,908			日本化学工業	2	3	6,905		
パルプ・紙(0.2%)						日本パーカライジング	31	26	33,549		
特種東海製紙	17	14	4,300			高圧ガス工業	9	8	7,585		
王子ホールディングス	2	3	12,192			四国化成ホールディングス	7	7	13,550		
日本製紙	265	247	137,183			ステラ ケミファ	3	3	12,176		
三菱製紙	33	33	38,223			保土谷化学工業	1	1	6,811		
北越コーポレーション	8	4	2,425			日本触媒	9	8	48,753		
大王製紙	40	29	38,164			大日精化工業	4	4	11,291		
阿波製紙	28	26	28,440			カネカ	14	15	55,734		
レンゴー	11	3	1,950			三菱瓦斯化学	47	44	116,287		
トモク	58	54	54,424			三井化学	53	49	198,499		
ザ・パック	3	3	7,871			J S R	4	64	263,911		
化学(5.8%)						東京応化工業	11	28	117,812		
北の達人コーポレーション	4	4	16,786			大阪有機化学工業	4	5	14,925		
クラレ	26	26	6,015			三菱ケミカルグループ	430	434	375,279		
旭化成	101	86	130,139			K Hネオケム	93	76	20,748		
レゾナック・ホールディングス	398	401	422,693			ダイセル	9	8	110,215		
住友化学	61	57	186,779			住友ベーライト	130	119	67,437		
住友精化	473	440	137,498			積水化学工業	38	40	248,800		
日産化学	2	2	14,140			日本ゼオン	16	15	52,340		
ラサ工業	30	27	175,267			アイカ工業	2	28	53,250		
クレハ	2	2	6,320			U B E	9	8	72,815		
多木化学	5	13	34,853			積水樹脂	4	4	22,525		
ティカ	2	2	8,349			タキロンシーアイ	4	4	9,528		
石原産業	4	5	7,089			旭有機材	11	12	16,500		
片倉コーポアグリ	11	9	14,827			二チバン	13	13	6,870		
日本曹達	1	—	—			リケンテクノス	4	3	12,352		
東ソー	6	7	41,510			大倉工業	1	2	8,904		
トクヤマ	85	79	159,868			積水化成品工業	12	12	5,833		
セントラル硝子	20	19	45,100			群栄化学工業	2	1	6,868		
東亞合成	10	6	18,169			ダイキヨーニシカワ	14	13	9,615		
大阪ソーダ	32	28	43,572			森六ホールディングス	3	3	8,559		
関東電化工業	3	4	46,863			恵和	4	4	5,377		
デンカ	12	11	10,683			日本化薬	48	45	58,883		
信越化学工業	23	21	54,496			カーリットホールディングス	6	6	6,534		
	107	538	3,298,851			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	千円	千円
扶桑化学工業	5	6	29,011	小林製薬	18	17	105,547				
トリケミカル研究所	8	7	29,988	荒川化学工業	5	5	6,478				
A D E K A	22	20	60,537	メッツ	5	4	20,653				
日油	19	17	124,655	日本高純度化学	2	2	6,592				
新日本理化	5	5	1,197	タカラバイオ	17	16	17,376				
ハリマ化成グループ	5	7	6,657	J C U	7	6	27,291				
花王	155	134	757,586	新田ゼラチン	0.500	0.500	337				
第一工業製薬	2	3	10,106	O A T アグリオ	2	3	5,440				
石原ケミカル	3	3	5,742	デワセリアルズ	18	14	87,165				
日華化学	5	—	—	アース製薬	5	5	22,815				
三洋化成工業	3	3	15,410	北興化学工業	6	6	6,490				
有機合成薬品工業	15	—	—	大成ラミック	2	2	6,447				
大日本塗料	7	6	7,180	クミアイ化成工業	25	23	19,564				
日本ペイントホールディングス	282	315	353,924	日本農薬	11	10	7,706				
関西ペイント	58	58	134,936	アキレス	4	4	5,912				
中国塗料	11	12	25,498	有沢製作所	10	10	12,053				
藤倉化成	11	14	6,384	日東電工	46	38	529,070				
太陽ホールディングス	9	10	32,393	レック	9	7	8,291				
D I C	24	23	68,440	きもと	5	4	832				
サカタインクス	14	13	18,229	藤森工業	5	4	18,306				
a r t i e n c e	12	12	38,700	前澤化成工業	4	4	6,352				
T & K T O K A	5	5	8,031	未来工業	3	2	10,962				
富士フィルムホールディングス	122	110	1,033,180	J S P	4	4	9,193				
資生堂	133	124	515,181	エフピコ	12	11	31,757				
ライオン	76	77	102,696	天馬	5	4	10,320				
高砂香料工業	4	4	15,615	信越ポリマー	11	12	20,416				
マンダム	13	12	16,960	東リ	20	—	—				
ミルボン	9	8	27,685	ニフコ	23	17	66,429				
ファンケル	27	26	55,770	バルカー	5	5	22,525				
コーワー	13	12	103,733	ユニ・チャーム	133	123	640,810				
コタ	5	5	8,745	医薬品(4.6%)							
シーボン	2	—	—	協和キリン	77	71	207,825				
ポーラ・オルビスホールディングス	32	30	44,606	武田薬品工業	565	526	2,353,166				
ノエビアホールディングス	5	5	27,719	アステラス製薬	612	521	878,896				
アジュバンホールディングス	5	—	—	住友ファーマ	47	44	16,221				
新日本製薬	3	3	6,256	塩野義製薬	81	75	535,800				
エステー	4	4	7,185	わかもと製薬	5	3	657				
アグロ カネショウ	2	4	5,814	日本新薬	15	15	77,220				
コニシ	10	17	23,873	中外製薬	199	186	1,087,196				
長谷川香料	13	11	36,309	科研製薬	10	10	36,556				
星光PMC	8	—	—	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	評価額	千円
ロート製薬	61	57	169,516	藤倉コンポジット	2	4	6,573				
小野薬品工業	123	126	310,136	オカモト	3	2	13,594				
久光製薬	14	13	53,196	フコク	4	3	5,022				
持田製薬	7	6	21,692	ニッタ	6	6	22,290				
参天製薬	120	108	165,255	住友理工	12	9	10,083				
扶桑薬品工業	2	2	6,397	三ツ星ベルト	9	7	35,424				
ツムラ	20	18	51,649	バンドー化学	10	8	15,180				
キッセイ薬品工業	9	9	32,438	ガラス・土石製品(0.7%)							
生化学工業	12	10	7,655	日東紡績	7	7	40,500				
栄研化学	10	10	20,426	A G C	65	53	287,472				
鳥居薬品	3	3	12,928	日本板硝子	32	28	15,307				
J C R ファーマ	21	20	18,632	日本電気硝子	26	24	86,799				
東和薬品	9	9	27,300	オハラ	4	5	6,355				
富士製薬工業	4	4	7,792	住友大阪セメント	9	9	35,630				
ゼリア新薬工業	8	8	17,859	太平洋セメント	40	35	112,464				
そせいグルーブ	—	19	28,060	日本ヒューム	7	7	6,262				
第一三共	556	518	2,550,632	日本コンクリート工業	21	13	6,310				
杏林製薬	13	12	23,013	三谷セキサン	2	2	14,600				
大幸薬品	12	—	—	アジアパイルホールディングス	10	8	6,636				
ダイト	4	4	9,167	東海カーボン	53	54	56,052				
大塚ホールディングス	146	123	687,648	日本カーボン	3	3	16,802				
大正製薬ホールディングス	14	13	113,440	東洋炭素	4	4	30,114				
ペプチドリーム	31	28	46,483	ノリタケカンパニーリミテド	3	3	26,499				
セルソース	—	3	5,062	T O T O	42	39	146,137				
あすか製薬ホールディングス	6	6	12,511	日本碍子	75	69	131,860				
サワイグループホールディングス	14	13	81,681	日本特殊陶業	48	49	214,936				
石油・石炭製品(0.5%)				M A R U W A	2	2	67,980				
日本コーカス工業	57	60	7,066	品川リフラクトリーズ	1	7	14,935				
二チレキ	7	7	18,751	黒崎播磨	1	1	16,584				
ユシロ化学工業	6	3	7,272	ヨータイ	4	4	6,384				
富士石油	18	17	5,863	ニッカトー	5	1	1,105				
M O R E S C O	0.800	—	—	フジミインコーポレーテッド	5	16	53,120				
出光興産	70	330	306,029	クニミネ工業	0.900	0.900	910				
E N E O S ホールディングス	1,154	941	608,520	ニチアス	16	15	56,625				
コスモエネルギーホールディングス	25	17	115,899	ニチハ	8	7	25,567				
ゴム製品(0.7%)				鉄鋼(1.0%)							
横浜ゴム	36	30	120,460	日本製鉄	294	273	988,779				
T O Y O T I R E	36	34	98,872	神戸製鋼所	132	123	251,965				
ブリヂストン	204	174	1,096,830	中山製鋼所	13	14	12,964				
住友ゴム工業	62	58	102,724	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	千円	株数	株数	評価額	株数	千円
J F E ホールディングス	175	170	399,905				アーレスティ	7	-	-	-
東京製鐵	18	17	29,068				A R E ホールディングス	26	23	45,126	
共英製鋼	7	7	16,037				金属製品(0.5%)				
大和工業	10	11	97,520				稻葉製作所	3	4	6,346	
東京鐵鋼	3	2	14,202				宮地エンジニアリンググループ	1	3	12,338	
大阪製鐵	4	2	6,636				トーカロ	18	17	29,339	
淀川製鋼所	7	7	29,925				アルファ	4	-	-	
中部鋼鉄	-	4	10,036				S U M C O	125	108	244,194	
丸一鋼管	20	18	75,255				川田テクノロジーズ	1	1	12,572	
大同特殊鋼	8	38	68,838				R S T e c h n o l o g i e s	4	4	10,869	
日本高周波鋼業	15	-	-				東洋製罐グループホールディングス	43	35	86,626	
日本冶金工業	4	4	20,835				ホッカンホールディングス	3	1	2,390	
山陽特殊製鋼	6	6	13,560				コロナ	5	6	6,428	
愛知製鋼	3	3	12,355				横河ブリッジホールディングス	8	9	26,294	
大平洋金属	4	5	7,316				三和ホールディングス	60	61	159,100	
新日本電工	42	30	9,211				文化シヤッター	18	16	25,360	
栗本鐵工所	3	2	9,352				三協立山	9	7	6,860	
三菱製鋼	4	4	6,498				アルインコ	5	6	6,300	
日亜鋼業	18	10	3,515				L I X I L	95	95	187,036	
日本精線	1	1	6,960				日本フイルコン	9	0.100	54	
エンビプロ・ホールディングス	0.300	10	5,019				ノーリツ	9	10	16,665	
シンニッタン	14	14	3,946				長府製作所	6	6	12,785	
非鉄金属(0.7%)							リンナイ	11	29	103,546	
大紀アルミニウム工業所	9	7	9,509				ダイニチ工業	7	-	-	
日本軽金属ホールディングス	17	17	30,758				日東精工	9	11	6,786	
三井金属鉱業	19	17	78,729				三洋工業	2	-	-	
東邦亜鉛	3	5	5,929				岡部	10	10	8,785	
三菱マテリアル	43	43	114,450				ジーテクト	7	7	15,678	
住友金属鉱山	76	70	294,447				東プレ	11	10	25,164	
DOWAホールディングス	14	15	84,469				高周波熱鍊	10	9	10,105	
古河機械金属	9	8	14,199				東京製綱	5	4	7,256	
大阪チタニウムテクノロジーズ	9	10	28,662				サンコール	2	13	6,264	
東邦チタニウム	11	12	22,037				モリテックスチール	7	0.100	26	
U A C J	9	8	35,862				パイオラックス	9	7	20,580	
C K サンエツ	1	1	6,621				エイチワン	7	7	5,297	
古河電気工業	21	20	57,568				日本発条	58	54	78,363	
住友電気工業	226	228	491,576				中央発條	4	8	6,450	
フジクラ	70	72	125,989				三益半導体工業	5	5	17,160	
S W C C	7	6	22,576				機械(5.4%)				
タツタ電線	13	10	7,575				日本製鋼所	17	16	41,844	
平河ヒューテック	4	4	6,062				三浦工業	26	25	73,475	
リョービ	7	6	16,646				タフマ	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
ツガミ	14	13	15,348			日精エー・エス・ビー機械	3	2	10,572		
オーフマ	6	5	37,398			サトーホールディングス	9	8	19,227		
芝浦機械	6	6	20,730			技研製作所	6	5	11,597		
アマダ	102	95	155,712			日本エアーテック	4	5	5,890		
アイダエンジニアリング	13	13	11,648			カワタ	4	—	—		
TAKISAWA	4	—	—			日精樹脂工業	5	5	6,384		
FUJII	28	28	74,039			ワイエイシホールディングス	—	2	6,047		
牧野フライス製作所	7	6	38,874			小松製作所	301	280	1,212,904		
オーエスジー	30	26	56,403			住友重機械工業	38	35	161,176		
ダイジェット工業	5	—	—			日立建機	25	23	100,650		
旭ダイヤモンド工業	18	13	12,019			日工	9	8	6,861		
DMG森精機	39	36	121,641			巴工業	2	2	8,728		
ソディック	17	14	10,599			井関農機	6	5	5,650		
ディスコ	10	28	1,270,080			TOWA	6	6	52,059		
日東工器	3	3	6,385			北川鉄工所	4	4	6,420		
日進工具	5	6	6,130			ローツエ	3	3	62,806		
パンチ工業	10	0.200	85			タカキタ	9	—	—		
リケンN P R	—	6	18,609			クボタ	340	313	695,173		
東洋機械金属	7	—	—			荏原実業	3	3	9,984		
エンシュウ	5	—	—			三菱化工機	2	2	7,885		
島精機製作所	10	9	13,328			月島ホールディングス	8	8	10,692		
オプトラン	9	9	18,081			帝国電機製作所	4	4	11,537		
N C ホールディングス	2	—	—			新東工業	13	12	14,157		
イワキ	4	4	9,528			澁谷工業	6	5	17,416		
フリュー	6	5	6,944			アイチコーポレーション	9	8	9,121		
ヤマシンフィルタ	15	18	6,730			小森コーポレーション	14	14	19,021		
日阪製作所	6	6	6,396			鶴見製作所	4	4	15,479		
やまびこ	10	9	17,669			酒井重工業	—	0.900	5,796		
野村マイクロ・サイエンス	2	2	29,020			荏原製作所	26	24	277,242		
平田機工	3	2	22,040			石井鐵工所	1	—	—		
PEGASUS	7	14	6,471			西島製作所	5	5	13,140		
マルマエ	3	3	6,354			北越工業	6	6	14,730		
タツモ	3	3	13,626			ダイキン工業	76	71	1,533,675		
ナブテスコ	40	37	93,097			オルガノ	8	7	49,680		
三井海洋開発	8	7	22,298			トヨーカネツ	2	2	8,950		
レオン自動機	6	6	9,853			栗田工業	36	33	197,047		
SMC	20	17	1,554,794			椿本チエイン	9	8	39,992		
ホソカワミクロン	4	3	16,112			大同工業	3	—	—		
ユニオンツール	2	2	10,309			木村化工機	6	8	6,194		
瑞光	—	4	7,576			アネスト岩田	10	9	12,396		
オイレス工業	9	8	16,621			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	評価額	千円
	千株	千株	千円		千株		千株	千株	千円		千円
サムコ	2	1	7,992	I H I	40	44	140,311				
加藤製作所	6	—	—	スター精密	12	11	18,715				
タダノ	33	34	45,816	電気機器(17.5%)							
フジテック	23	14	51,702	日清紡ホールディングス	52	45	56,182				
C K D	17	16	46,297	イビデン	36	31	229,320				
平和	21	17	37,028	コニカミノルタ	143	133	62,945				
理想科学工業	5	4	15,504	プラザー工業	85	80	198,320				
S A N K Y O	12	13	122,875	ミネベアミツミ	111	104	316,142				
日本金錢機械	7	7	10,245	日立製作所	322	287	3,529,867				
マースグループホールディングス	3	3	8,595	東芝	123	—	—				
フクシマガリレイ	4	3	22,581	三菱電機	664	666	1,540,948				
ダイコク電機	3	2	12,325	富士電機	39	36	323,778				
竹内製作所	11	10	56,026	東洋電機製造	5	—	—				
アマノ	18	17	63,563	安川電機	76	65	365,040				
J U K I	10	14	7,128	シンフォニア テクノロジー	7	6	16,929				
ジャノメ	8	9	6,251	明電舎	9	11	29,659				
マックス	7	8	26,334	オリジン	1	1	1,948				
グローリー	16	14	42,055	山洋電気	2	2	15,938				
新晃工業	6	6	18,870	デンヨー	4	4	10,662				
大和冷機工業	9	9	13,671	P H C ホールディングス	8	11	14,515				
セガサミーホールディングス	51	53	96,353	KOKUSAI ELECTRIC	—	23	107,415				
リケン	2	—	—	ソシオネクスト	6	43	165,778				
T P R	7	7	16,058	東芝テック	9	7	23,677				
ツバキ・ナカシマ	15	12	9,360	芝浦メカトロニクス	1	3	22,440				
ホシザキ	41	35	187,548	マブチモーター	16	29	80,423				
大豊工業	7	7	6,240	ニデック	156	132	765,702				
日本精工	118	110	89,451	トレックス・セミコンダクター	3	3	6,566				
N T N	126	129	38,294	東光高岳	3	3	8,604				
ジェイテクト	57	53	73,074	ダブル・スコープ	21	17	13,235				
不二越	4	4	14,894	ダイヘン	5	6	42,900				
日本トムソン	15	16	10,024	ヤーマン	12	11	11,727				
T H K	37	34	110,193	J V C ケンウッド	58	47	33,441				
ユーシン精機	7	9	6,420	I - P E X	4	4	7,728				
前澤給装工業	5	4	6,325	日新電機	15	—	—				
イーグル工業	7	6	11,741	大崎電気工業	15	13	8,868				
日本ピラー工業	6	5	30,576	オムロン	58	45	261,449				
キツツ	23	20	26,420	日東工業	8	8	34,546				
マキタ	80	68	264,867	I D E C	9	8	25,247				
三井E & S	29	29	34,303	不二電機工業	4	0.300	343				
日立造船	52	52	57,129	ジー・エス・ユア コーポレーション	21	23	63,472				
三菱重工業	112	104	1,201,956	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
メルコホールディングス	1	1	6,108			日本航空電子工業	13	14	38,338		
テクノメディカ	2	3	5,676			T O A	7	6	7,677		
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	—	9	6,224			マクセル	14	13	20,922		
日本電気	91	78	766,664			古野電気	8	7	16,793		
富士通	64	55	1,272,534			スミダコーポレーション	5	8	9,624		
沖電気工業	29	27	29,566			アイコム	2	2	8,004		
岩崎通信機	6	—	—			リオン	2	2	7,020		
電気興業	2	2	5,691			横河電機	70	65	198,923		
サンケン電気	6	5	43,568			新電元工業	2	2	7,095		
アイホン	3	3	9,036			アズビル	44	40	186,619		
ルネサスエレクトロニクス	419	390	958,437			東亜ディーケーケー	5	—	—		
セイコーエプソン	85	76	187,238			日本光電工業	29	25	105,384		
ワコム	50	45	29,848			チノー	—	2	6,282		
アルバック	15	13	114,048			共和電業	11	4	1,785		
E I Z O	4	4	22,264			日本電子材料	4	3	7,156		
ジャパンディスプレイ	247	—	—			堀場製作所	14	11	157,578		
日本信号	14	13	13,232			アドバンテスト	50	169	1,142,917		
京三製作所	13	13	6,302			小野測器	11	—	—		
能美防災	8	8	18,103			エスペック	5	4	12,779		
ホーチキ	4	4	10,120			キーエンス	63	59	4,094,072		
星和電機	10	—	—			日置電機	3	2	19,320		
エレコム	15	14	23,208			シスメックス	54	51	409,036		
パナソニック ホールディングス	759	707	1,007,691			日本マイクロニクス	10	10	63,494		
シャープ	77	100	83,262			メガチップス	5	4	19,951		
アンリツ	45	42	49,289			O B A R A G R O U P	3	3	11,904		
富士通ゼネラル	18	17	33,906			澤藤電機	3	3	4,286		
ソニーグループ	450	419	5,584,311			原田工業	5	4	3,420		
T D K	101	94	739,060			コーチル	8	6	9,607		
帝国通信工業	3	3	5,886			イリソ電子工業	5	5	17,270		
タムラ製作所	27	23	13,551			オプテックスグループ	11	10	20,023		
アルプスアルパイン	57	53	56,255			千代田インテグレ	2	2	6,088		
池上通信機	8	—	—			レーザーテック	31	27	1,081,744		
日本電波工業	7	7	9,820			スタンレー電気	45	38	97,755		
鈴木	—	5	6,269			岩崎電気	2	—	—		
マイコー	7	5	26,904			ウシオ電機	33	30	60,967		
ローランド ディー. ジー.	3	3	16,566			岡谷電機産業	0.100	0.100	27		
フォスター電機	6	5	6,310			日本セラミック	6	4	12,451		
S M K	2	2	6,092			遠藤照明	6	—	—		
ヨコオ	5	5	8,379			古河電池	4	7	6,741		
ホシデン	15	13	27,009			山一電機	5	5	11,665		
ヒロセ電機	10	8	141,592			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
日本電子	16	14	96,164			三菱ロジスネクスト	10	9	13,927		
カシオ計算機	47	42	51,039			日産自動車	904	800	453,016		
ファナック	62	289	1,219,423			いすゞ自動車	185	172	371,263		
日本シエムケイ	13	12	7,648			トヨタ自動車	3,497	3,255	11,113,935		
エンプラス	1	1	14,841			日野自動車	82	89	42,200		
大真空	7	8	7,761			三菱自動車工業	248	231	104,478		
ローム	29	109	289,946			エフテック	1	1	987		
浜松ホトニクス	51	47	257,040			武蔵精密工業	15	14	23,519		
三井ハイテック	6	5	41,813			日産車体	11	6	6,220		
新光電気工業	22	21	115,500			新明和工業	20	17	20,366		
京セラ	98	368	816,190			極東開発工業	11	9	23,235		
太陽誘電	31	28	97,942			トピー工業	5	4	14,054		
村田製作所	193	539	1,595,275			ティラド	1	1	6,545		
双葉電子工業	12	12	6,435			曙ブレーキ工業	38	—	—		
北陸電気工業	3	2	3,908			タチエス	10	10	21,952		
ニチコン	13	15	19,141			NOK	24	23	48,024		
日本ケミコン	6	6	8,511			フタバ産業	17	15	16,424		
KOA	9	9	13,599			カヤバ	6	5	28,015		
市光工業	—	10	5,798			大同メタル工業	12	11	6,414		
小糸製作所	76	61	121,050			プレス工業	28	23	15,499		
ミツバ	11	11	14,807			ミクニ	13	3	1,666		
SCREENホールディングス	10	20	374,535			太平洋工業	14	13	19,801		
キヤノン電子	7	6	14,823			アイシン	49	45	249,384		
キヤノン	349	295	1,243,714			マツダ	210	196	339,645		
リコー	159	148	189,167			今仙電機製作所	2	2	1,672		
象印マホービン	19	16	23,151			本田技研工業	517	1,445	2,527,258		
MUTOHホールディングス	2	1	4,132			スズキ	117	108	716,453		
東京エレクトロン	44	125	4,348,575			SUBARU	201	183	617,720		
イノテック	4	3	7,452			ヤマハ発動機	100	256	354,196		
輸送用機器(9.1%)											
トヨタ紡織	26	25	60,700			エクセディ	10	9	27,965		
芦森工業	4	1	4,973			豊田合成	18	17	50,260		
ユニプレス	11	10	11,278			愛三工業	10	9	14,278		
豊田自動織機	46	50	739,519			盟和産業	4	1	1,333		
モリタホールディングス	11	10	16,972			ヨロズ	7	6	6,358		
三櫻工業	9	9	9,564			エフ・シー・シー	11	10	22,218		
デンソー	131	489	1,322,770			シマノ	26	23	483,855		
東海理化電機製作所	18	16	39,245			ティ・エス・テック	29	21	41,387		
川崎重工業	48	48	188,179			ジャムコ	3	4	5,472		
名村造船所	16	14	26,684			精密機器(2.3%)					
日本車輌製造	2	2	6,696			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	千円	株数	株数	評価額	千円	千円
日本エム・ディ・エム	5	8	5,826	7	7	10,048	フランスベッドホールディングス	10	8	32,287	
島津製作所	77	78	302,986	4	—	—	パイロットコーポレーション	12	12	24,300	萩原工業
JMS	9	12	6,168	29	27	62,842	フジシールインターナショナル	4	—	—	タカラトミー
長野計器	4	4	9,520	4	15	10,235	広済堂ホールディングス	5	6	7,448	プロネクサス
ブイ・テクノロジー	3	3	8,258	3	—	—	大建工業	3	—	—	TOP PANホールディングス
東京計器	4	4	10,237	83	72	256,024	大日本印刷	75	64	291,405	マニー
愛知時計電機	3	2	6,669	1	1	5,994	共同印刷	12	10	15,220	ニコン
インターラクション	3	4	4,867	4	3	9,842	N I S S H A	4	3	—	トプコン
オーバル	6	—	—	58	50	295,374	TAKARA & COMPANY	58	50	295,374	オリンパス
東京精密	14	12	116,535	アシックス	2	3	ツツミ	2	3	6,288	理研計器
マニー	28	23	49,059	ローランド	4	4	ローランド	4	4	21,582	タムロン
ニコン	99	85	131,121	小松ウォール工業	2	2	小松ウォール工業	2	2	8,016	HOYA
トプコン	33	28	51,019	ヤマハ	40	37	ヤマハ	40	37	120,428	ノーリツ鋼機
オリンパス	398	364	791,833	河合楽器製作所	1	1	河合楽器製作所	1	1	6,102	A&Dホロンホールディングス
理研計器	4	4	32,886	クリナップ	—	7	クリナップ	—	7	5,306	朝日インテック
タムロン	4	3	22,644	ピジョン	40	37	ピジョン	40	37	60,309	シチズン時計
HOYA	136	116	2,158,366	兼松サステック	0.400	—	兼松サステック	0.400	—	—	リズム
シード	2	—	—	キングジム	5	7	キングジム	5	7	6,424	メニコン
ノーリツ鋼機	6	5	17,024	リンテック	12	11	リンテック	12	11	35,938	A&Dホロンホールディングス
朝日インテック	9	8	18,103	イトーキ	13	12	イトーキ	13	12	24,151	シチズン時計
シチズン時計	84	72	207,356	任天堂	402	374	任天堂	402	374	3,092,840	リズム
リズム	70	54	58,206	三菱鉛筆	9	8	三菱鉛筆	9	8	20,487	メニコン
メニコン	21	20	35,628	タカラスタンダード	12	12	タカラスタンダード	12	12	23,087	松風
松風	2	2	7,238	コクヨ	30	24	コクヨ	30	24	60,130	セイコーグループ
セイコーグループ	9	8	25,564	ナカバヤシ	9	11	ナカバヤシ	9	11	6,236	ニプロ
ニプロ	53	49	62,985	グローブライド	5	5	グローブライド	5	5	10,743	粋美堂
その他製品(2.3%)				オカムラ	19	17	オカムラ	19	17	38,928	二ホンフラッシュ
KYORITSU	25	—	—	美津濃	6	5	美津濃	6	5	30,975	スノーピーク
スノーピーク	10	8	9,673	電気・ガス業(1.3%)			電気・ガス業(1.3%)				パラマウントベッドホールディングス
パラマウントベッドホールディングス	14	12	30,553	東京電力ホールディングス	574	534	東京電力ホールディングス	574	534	424,848	トランザクション
トランザクション	4	3	9,941	中部電力	234	218	中部電力	234	218	418,646	粋美堂
粋美堂	2	—	—	関西電力	245	228	関西電力	245	228	446,126	二ホンフラッシュ
二ホンフラッシュ	6	6	6,500	中国電力	101	103	中国電力	101	103	101,928	前田工織
前田工織	6	5	16,800	北陸電力	60	60	北陸電力	60	60	43,662	永大産業
永大産業	18	—	—	東北電力	155	156	東北電力	155	156	154,367	アートネイチャー
アートネイチャー	6	7	6,233	四国電力	54	55	四国電力	54	55	57,463	フルヤ金属
フルヤ金属	—	1	13,776								パンダイナムコホールディングス
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
アイフィスジャパン	7	—	—								S H O E I
S H O E I	6	13	28,113								

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	評価額	千円
九州電力	千株	千株	千円	ヤマトホールディングス	千株	千株	千円	千円	千円	千円	
北海道電力	146	136	154,197	山九	81	75	182,185	182,185	182,185	182,185	
沖縄電力	61	57	36,408	丸全昭和運輸	16	15	80,830	80,830	80,830	80,830	
電源開発	14	15	16,519	センコーグループホールディングス	3	3	16,391	16,391	16,391	16,391	
エフオン	48	48	120,240	トナミホールディングス	33	31	33,741	33,741	33,741	33,741	
イーレックス	4	14	5,795	ニッコンホールディングス	1	1	4,420	4,420	4,420	4,420	
レノバ	11	10	7,875	日本石油輸送	20	18	59,988	59,988	59,988	59,988	
東京瓦斯	16	15	19,544	福山通運	1	—	—	—	—	—	
大阪瓦斯	134	125	407,099	セイノーホールディングス	4	6	28,662	28,662	28,662	28,662	
東邦瓦斯	129	120	370,988	神奈川中央交通	39	33	74,358	74,358	74,358	74,358	
北海道瓦斯	25	25	76,483	AZ-COM丸和ホールディングス	1	2	6,373	6,373	6,373	6,373	
広島ガス	3	3	7,959	C&Fロジホールディングス	15	15	21,593	21,593	21,593	21,593	
西部ガスホールディングス	14	1	693	九州旅客鉄道	6	5	10,282	10,282	10,282	10,282	
静岡ガス	6	6	11,687	S Gホールディングス	45	41	140,155	140,155	140,155	140,155	
メタウォーター	14	11	10,714	NIPPON EXPRESSホールディングス	122	99	191,345	191,345	191,345	191,345	
陸運業(2.6%)	8	7	15,698		23	20	162,026	162,026	162,026	162,026	
S B S ホールディングス	5	5	12,757	海運業(0.9%)	日本郵船	170	169	818,632	818,632	818,632	818,632
東武鉄道	70	65	251,937	商船三井	21	112	684,134	684,134	684,134	684,134	
相鉄ホールディングス	21	21	57,727	川崎汽船	57	54	339,435	339,435	339,435	339,435	
東急	178	166	294,849	N S ユナイテッド海運	22	3	16,832	16,832	16,832	16,832	
京浜急行電鉄	72	73	95,713	明海グループ	23	6	2,1970	2,1970	2,1970	2,1970	
小田急電鉄	96	98	206,486	飯野海運	24	23	29,251	29,251	29,251	29,251	
京王電鉄	33	28	119,928	共栄タンカー	25	0.600	0.600	678	678	678	
京成電鉄	41	38	284,666	乾汽船	26	8	6	7,258	7,258	7,258	
富士急行	7	7	28,324	空運業(0.4%)	日本航空	27	170	169	818,632	818,632	818,632
東日本旅客鉄道	108	108	974,546	ANAホールディングス	28	112	128	684,134	684,134	684,134	684,134
西日本旅客鉄道	81	70	436,914	パスコ	29	54	47	339,435	339,435	339,435	339,435
東海旅客鉄道	49	228	857,413	倉庫・運輸関連業(0.1%)	トランコム	30	3	16,832	16,832	16,832	16,832
西武ホールディングス	77	71	154,979	日新	31	6	2,1970	2,1970	2,1970	2,1970	
鴻池運輸	10	10	18,200	三菱倉庫	32	23	29,251	29,251	29,251	29,251	
西日本鉄道	17	15	37,983	三井倉庫ホールディングス	33	0.400	0.400	678	678	678	
ハマキヨウレックス	5	5	19,864	住友倉庫	34	1	1	10,778	10,778	10,778	
サカイ引越センター	3	6	17,047	滋澤倉庫	35	4	4	12,847	12,847	12,847	
近鉄グループホールディングス	63	59	266,400	東陽倉庫	36	13	14	66,758	66,758	66,758	
阪急阪神ホールディングス	84	78	339,743	日本トランシティ	37	5	5	25,547	25,547	25,547	
南海電気鉄道	30	26	77,035	中央倉庫	38	17	16	41,760	41,760	41,760	
京阪ホールディングス	26	32	113,252	安田倉庫	39	2	2	8,275	8,275	8,275	
神戸電鉄	1	2	6,272	上組	40	15	—	—	—	—	
名古屋鉄道	70	61	130,295	キユーソー流通システム	41	11	11	7,413	7,413	7,413	
山陽電気鉄道	4	4	9,558		42	5	2	2,633	2,633	2,633	
アルプス物流	5	4	8,930		43	5	5	6,234	6,234	6,234	
					44	30	27	93,993	93,993	93,993	
					45	4	6	6,217	6,217	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
東海運	13	—	—			オプティム	5	6	7,222		
エーアイテイー	4	3	6,867			セレス	5	5	9,036		
内外トランスライン	2	2	6,294			S H I F T	4	4	106,540		
日本コンセプト	3	3	7,059			ティーガイア	6	6	13,181		
情報・通信業(7.6%)						テクマトリックス	11	10	22,279		
N E C ネッツエスアイ	21	23	55,680			ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19	15	35,076		
クロスキャット	3	5	6,534			GMOペイメントゲートウェイ	14	11	101,197		
システナ	107	90	25,650			システムリサーチ	—	2	7,192		
デジタルアーツ	4	3	17,898			インターネットニシアティブ	35	28	83,070		
日鉄ソリューションズ	10	10	50,197			さくらインターネット	9	6	35,443		
キューブシステム	4	5	6,266			GMOグローバル・ホールディングス	1	2	6,083		
コア	3	3	6,436			S R A ホールディングス	3	3	11,865		
手間いらず	1	—	—			朝日ネット	8	10	6,487		
ラクーンホールディングス	6	9	6,403			e B A S E	9	9	6,651		
ソリトンシステムズ	4	4	6,394			アバントグループ	8	7	10,222		
ソフトクリエイトホールディングス	2	4	9,393			アドソル日進	3	4	6,732		
T I S	71	65	218,985			フリービット	4	—	—		
グリー	34	19	10,407			コムチュア	8	8	16,838		
コーエーテクモホールディングス	40	37	69,060			サイバーコム	0.600	—	—		
三菱総合研究所	3	2	14,355			アステリア	6	10	7,008		
A G S	6	—	—			アイル	3	2	10,332		
ファインデックス	10	—	—			マークライズ	3	3	10,576		
ブレインパッド	6	—	—			メディカル・データ・ビジョン	9	9	5,771		
K L a b	12	—	—			g u m i	10	15	6,224		
ポールトゥワインホールディングス	10	12	6,396			テラスカイ	2	4	6,560		
ネクソン	165	133	337,874			デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3	3	7,030		
アイスタイル	20	19	8,885			P R T I M E S	2	—	—		
エムアップホールディングス	7	7	7,519			ラクス	30	28	60,808		
エイチーム	6	11	6,460			ランドコンピュータ	5	—	—		
エニグモ	8	17	6,247			ダブルスタンダード	2	3	7,238		
コロプラ	24	23	13,513			オープンドア	4	7	6,007		
ブロードリーフ	37	28	16,356			アカツキ	3	2	6,890		
クロス・マーケティンググループ	5	—	—			U b i c o m ホールディングス	2	4	6,075		
デジタルハーツホールディングス	4	6	6,522			カナミックネットワーク	9	15	7,910		
システム情報	5	—	—			ノムラシステムコーポレーション	39	—	—		
メディアドウ	2	4	5,987			チェンジホールディングス	15	12	19,569		
じげん	18	17	9,151			シンクロ・フード	0.200	—	—		
ブイキューブ	7	20	6,695			オークネット	3	3	6,258		
サイバーリンクス	3	—	—			キャピタル・アセット・プランニング	7	—	—		
フィックススターズ	7	6	12,187			マクロミル	14	11	9,383		
CARTA HOLDINGS	3	0.200	291			ビーグリー	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	千円	株数	千円
オロ	2	2	5,768	日本オラクル	12	11	132,240				
ユーザーローカル	3	—	—	アルファシステムズ	2	2	7,350				
マネーフォワード	15	13	75,886	フューチャー	15	12	21,043				
プラスアルファ・コンサルティング	—	3	8,879	CAC Holdings	3	3	6,480				
電算システムホールディングス	3	2	6,947	S Bテクノロジー	2	2	5,538				
APP IER GROUP	—	20	38,488	トーセ	6	—	—				
ビジョナル	—	4	43,102	オーピックビジネスコンサルタント	12	8	58,287				
プロトコーコレーション	8	6	8,515	伊藤忠テクノソリューションズ	34	—	—				
ハイマックス	—	4	6,291	アイティフォー	8	7	10,624				
野村総合研究所	131	131	537,599	東計電算	0.900	—	—				
サイバネットシステム	5	—	—	エックスネット	4	—	—				
C E ホールディングス	9	—	—	大塚商会	36	29	191,101				
日本システム技術	—	2	7,414	サイボウズ	8	8	16,637				
インテージホールディングス	8	6	12,106	電通総研	7	7	39,888				
ソースネクスト	32	42	5,837	ACCESS	7	8	7,605				
インフォコム	8	7	17,378	デジタルガレージ	11	9	32,015				
シンプルクス・ホールディングス	10	9	22,968	イーエムシステムズ	10	9	7,375				
H E R O Z	5	3	7,273	ウェザーニューズ	2	1	9,234				
ラクスル	18	14	15,486	C I J	5	9	7,009				
メルカリ	28	28	61,976	日本エンタープライズ	30	—	—				
I P S	2	—	—	WOWOW	3	5	6,344				
F I G	12	—	—	スカラ	6	8	5,942				
イーソル	6	10	11,227	ANY COLOR	—	6	19,593				
アルテリア・ネットワークス	6	—	—	ネットワンシステムズ	23	24	61,860				
ウイングアーク1 s t	6	6	18,724	アルゴグラフィックス	5	5	23,732				
サーバーワークス	2	1	6,876	マーベラス	10	9	7,178				
トビラシステムズ	4	—	—	エイベックス	10	10	13,079				
S a n s a n	23	19	29,523	B I P R O G Y	23	19	90,226				
ギフティ	6	5	7,898	兼松エレクトロニクス	4	—	—				
メドレー	6	8	39,040	都築電気	3	3	7,418				
ベース	2	2	7,570	T B S ホールディングス	32	29	127,194				
J M D C	10	10	37,370	日本テレビホールディングス	56	52	114,931				
フォーカスシステムズ	4	6	6,462	朝日放送グループホールディングス	7	9	6,555				
クレスコ	4	4	9,442	テレビ朝日ホールディングス	15	14	30,182				
フジ・メディア・ホールディングス	61	57	110,774	スカパーJ SATホールディングス	56	46	41,395				
オービック	21	19	441,780	テレビ東京ホールディングス	4	4	12,964				
ジャストシステム	9	8	21,887	日本B S 放送	4	—	—				
T D C ソフト	5	5	11,849	ビジョン	8	9	10,044				
L I N E ヤフー	909	846	357,815	USEN-NEXT HOLDINGS	5	6	30,116				
トレンドマイクロ	36	28	204,258	日本通信	58	58	12,811				
I D ホールディングス	5	4	6,580	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			銘柄	期首(前期末)		当期末					
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	株数	評価額			
K D D I	千株	千株	千円	千株	千株	千円	千株	千株	千円	千株	千円			
ソフトバンク	493	459	2,123,809	5	10	17,258	493	459	2,123,809	5	10	17,258		
光通信	1,026	956	1,884,136	71	69	263,355	1,026	956	1,884,136	71	69	263,355		
エムティーアイ	7	6	152,790	アルフレッサ ホールディングス	67	63	146,097	7	6	152,790	アルフレッサ ホールディングス	67	63	146,097
GMOインターネットグループ	9	10	8,003	横浜冷凍	18	17	18,211	9	10	8,003	横浜冷凍	18	17	18,211
アイドマーケティングコミュニケーション	23	22	56,518	アルコニックス	8	8	11,520	23	22	56,518	アルコニックス	8	8	11,520
K A D O K A W A	16	—	—	神戸物産	52	48	182,505	33	31	98,376	神戸物産	52	48	182,505
学研ホールディングス	10	9	9,850	ハイパー	4	4	1,386	10	9	9,850	ハイパー	4	4	1,386
ゼンリン	10	10	8,680	あい ホールディングス	10	10	24,450	10	10	8,680	あい ホールディングス	10	10	24,450
インプレスホールディングス	22	—	—	ディープイエックス	4	4	4,332	22	—	—	ディープイエックス	4	4	4,332
アイネット	3	3	7,855	ダイワボウホールディングス	27	27	74,337	3	3	7,855	ダイワボウホールディングス	27	27	74,337
松竹	3	3	31,186	マクニカホールディングス	16	14	120,768	3	3	31,186	マクニカホールディングス	16	14	120,768
東宝	40	33	163,845	ラクト・ジャパン	2	2	6,224	40	33	163,845	ラクト・ジャパン	2	2	6,224
東映	1	2	39,820	グリムス	2	3	5,793	1	2	39,820	グリムス	2	3	5,793
N T Tデータグループ	200	155	363,248	パイルケースケ・ホールディングス	9	9	12,331	200	155	363,248	パイルケースケ・ホールディングス	9	9	12,331
ピー・シー・エー	3	5	8,548	八洲電機	5	5	6,803	3	5	8,548	八洲電機	5	5	6,803
ビジネスブレイン太田昭和	2	2	6,652	メディアスホールディングス	7	8	6,158	2	2	6,652	メディアスホールディングス	7	8	6,158
D T S	13	12	48,562	レスターホールディングス	6	5	15,746	13	12	48,562	レスターホールディングス	6	5	15,746
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32	27	179,900	ジオリープグループ	4	—	—	32	27	179,900	ジオリープグループ	4	—	—
シーイーシー	9	7	13,612	O C H I ホールディングス	3	—	—	9	7	13,612	O C H I ホールディングス	3	—	—
カプコン	63	53	312,656	T O K A I ホールディングス	33	34	34,202	63	53	312,656	T O K A I ホールディングス	33	34	34,202
アイ・エス・ビー	4	4	5,612	C o m i n i x	6	—	—	4	4	5,612	C o m i n i x	6	—	—
ジャステック	4	4	6,420	三洋貿易	6	7	9,478	4	4	6,420	三洋貿易	6	7	9,478
S C S K	52	41	112,049	ビューティガレージ	1	2	6,522	52	41	112,049	ビューティガレージ	1	2	6,522
N S W	2	2	7,664	ワイン・パートナーズ	4	5	6,492	2	2	7,664	ワイン・パートナーズ	4	5	6,492
アイネス	4	4	6,844	シップヘルスケアホールディングス	24	22	49,443	4	4	6,844	シップヘルスケアホールディングス	24	22	49,443
T K C	11	9	34,780	明治電機工業	4	4	6,569	11	9	34,780	明治電機工業	4	4	6,569
富士ソフト	7	12	73,680	コメダホールディングス	16	15	42,334	7	12	73,680	コメダホールディングス	16	15	42,334
N S D	22	21	57,452	アセンテック	11	10	6,478	22	21	57,452	アセンテック	11	10	6,478
コナミグループ	27	22	214,035	フルサト・マルカホールディングス	6	5	12,605	27	22	214,035	フルサト・マルカホールディングス	6	5	12,605
福井コンピュータホールディングス	4	3	9,764	ヤマエグループホールディングス	3	3	8,809	4	3	9,764	ヤマエグループホールディングス	3	3	8,809
J B C C ホールディングス	4	3	14,878	小野建	6	6	10,924	4	3	14,878	小野建	6	6	10,924
ミロック情報サービス	5	5	10,767	南陽	2	1	3,441	5	5	10,767	南陽	2	1	3,441
ソフトバンクグループ	369	293	2,504,488	佐鳴電機	4	3	8,970	369	293	2,504,488	佐鳴電機	4	3	8,970
卸売業(7.4%)	2	2	7,860	伯東	3	3	21,420	2	2	7,860	伯東	3	3	21,420
高千穂交易	1	1	10,794	コンドーテック	5	5	6,196	1	1	10,794	コンドーテック	5	5	6,196
伊藤忠食品	6	5	10,074	中山福	14	0.100	36	6	5	10,074	中山福	14	0.100	36
エレマテック	5	9	30,432	ナガイレーベン	8	7	18,675	5	9	30,432	ナガイレーベン	8	7	18,675
あらた	1	1	6,132	三菱食品	6	5	29,174	1	1	6,132	三菱食品	6	5	29,174
トーメンデバイス	2	6	42,651	松田産業	5	4	11,520	2	6	42,651	松田産業	5	4	11,520
東京エレクトロン デバイス	2	6	42,651	第一興商	13	24	46,546	2	6	42,651	第一興商	13	24	46,546
				メディパルホールディングス	69	63	151,237				メディパ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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千円		千株	千株	千円	
S P K	3	3	6,585		東京産業	6	8	6,273			
萩原電気ホールディングス	2	2	13,311		ユアサ商事	6	4	24,745			
アズワン	9	9	51,832		神鋼商事	1	1	11,536			
スズデン	2	2	5,764		阪和興業	12	11	63,506			
シモジマ	5	4	6,134		正栄食品工業	4	4	19,530			
ドウシシャ	7	5	12,342		カナデン	5	4	7,299			
小津産業	2	2	3,852		R Y O D E N	5	5	13,428			
高速	3	3	8,924		岩谷産業	15	14	105,033			
丸文	6	5	8,484		ナイス	2	2	4,640			
ハピネット	5	5	17,357		極東貿易	4	3	7,921			
橋本総業ホールディングス	4	4	6,114		アステナホールディングス	11	13	6,270			
日本ライフライン	19	18	23,404		三愛オブリ	18	15	29,037			
I DOM	20	16	14,740		稻畠産業	13	12	39,184			
進和	4	3	9,226		G S I クレオス	3	3	8,166			
ダイトロン	2	2	7,312		明和産業	9	9	6,726			
シーカス	9	8	14,426		クワザワホールディングス	10	—	—			
田中商事	8	—	—		ワキタ	12	10	16,588			
オーハシテクニカ	3	3	6,249		東邦ホールディングス	16	17	56,306			
白鈴	2	2	6,843		サンゲツ	16	14	51,624			
伊藤忠商事	415	421	2,781,111		ミツウコグループホールディングス	8	8	12,096			
丸紅	532	523	1,287,887		シナネンホールディングス	2	1	7,097			
長瀬産業	31	28	70,660		伊藤忠エネクス	16	15	23,482			
蝶理	3	3	11,649		サンリオ	19	17	133,037			
豊田通商	59	54	503,652		サンワ テクノス	3	3	7,302			
三共生興	10	8	6,690		リヨーサン	7	4	22,660			
兼松	26	26	61,701		新光商事	9	8	10,315			
三井物産	493	472	3,010,462		トーホー	2	2	6,890			
日本紙パルプ商事	3	3	15,060		三信電気	2	2	6,024			
カメイ	7	6	12,582		東陽テクニカ	7	6	9,600			
O U G ホールディングス	1	1	4,515		モスクワードサービス	9	9	31,970			
スターゼン	5	4	11,876		加賀電子	5	5	36,936			
山善	18	19	24,472		ソーダニッカ	—	5	6,238			
椿本興業	1	1	8,931		立花エレテック	4	4	13,062			
住友商事	417	379	1,354,792		P A L T A C	10	8	37,051			
内田洋行	3	2	19,675		三谷産業	15	17	6,776			
三菱商事	421	1,242	3,889,034		西本Wismettacホールディングス	1	1	10,768			
第一実業	2	5	11,693		K P P グループホールディングス	15	16	10,238			
キヤノンマーケティングジャパン	15	14	61,842		ヤマタネ	3	2	7,154			
西華産業	3	2	7,450		丸紅建材リース	2	—	—			
佐藤商事	4	4	7,568		日鉄物産	4	—	—			
菱洋エレクトロ	5	5	23,482		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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	千円	株数	千円
トラスコ中山	14	13	30,874	東京一番フーズ	8	8	4,288				
オートバックスセブン	23	21	35,839	アークランドサービスホールディングス	5	—	—				
モリト	6	4	6,376	J. フロント リテイリング	83	72	112,464				
加藤産業	8	7	37,479	ドトール・日レスホールディングス	11	11	23,110				
イエローハット	11	10	18,910	マツキヨココカラ&カンパニー	40	114	305,388				
J Kホールディングス	5	5	6,082	ブロンコビリー	3	3	12,117				
日伝	4	4	11,743	Z O Z O	44	40	137,040				
北沢産業	23	10	3,403	トレジャー・ファクトリー	2	4	7,156				
杉本商事	3	3	6,768	物語コーポレーション	3	10	48,195				
因幡電機産業	17	16	57,539	三越伊勢丹ホールディングス	113	105	225,931				
東テク	2	2	14,679	H a m e e	7	5	6,241				
ミスミグループ本社	101	94	198,396	ウエルシアホールディングス	35	32	86,043				
蔵王産業	2	—	—	クリエイトSDホールディングス	11	8	28,346				
スズケン	21	23	117,683	丸善CHIホールディングス	12	12	4,132				
ジェコス	5	5	6,739	ミサワ	2	2	1,439				
小売業(4.2%)				ティーライフ	3	—	—				
ローソン	16	13	136,391	シュッピン	5	6	6,362				
サンエー	5	4	21,816	オイシックス・ラ・大地	9	8	11,583				
カワチ薬品	5	4	13,445	ネクステージ	15	14	31,174				
エービーシー・マート	9	27	69,363	ジョイフル本田	21	18	36,618				
ハードオフコーポレーション	2	3	6,004	鳥貴族ホールディングス	2	2	9,372				
アスクル	16	15	30,939	ホットランド	5	4	8,784				
ゲオホールディングス	7	7	14,175	すかいらーくホールディングス	92	85	187,383				
アダストリア	8	7	26,486	S F P ホールディングス	3	3	7,116				
くら寿司	7	7	29,455	綿半ホールディングス	5	4	7,212				
キャンドゥ	2	2	6,535	コナベッド・スマート・マーチン	22	17	17,447				
パルグループホールディングス	6	12	27,355	ゴルフダイジェスト・オンライン	3	—	—				
エディオン	26	24	37,125	B E E N O S	3	4	5,934				
サーラコーポレーション	14	13	10,731	あさひ	5	5	7,412				
ハローズ	3	2	12,012	日本調剤	4	4	6,484				
フジオフードグループ本社	5	7	9,555	コスモス薬品	7	5	79,659				
あみやき亭	1	1	6,517	セブン&アイ・ホールディングス	232	216	1,379,788				
大黒天物産	2	1	16,473	クリエイト・レストランツ・ホールディングス	50	42	46,070				
ハニーズホールディングス	6	5	9,027	ツルハホールディングス	16	13	145,794				
ファーマライズホールディングス	7	—	—	サンマルクホールディングス	5	5	11,040				
アルペン	5	5	10,374	フェリシモ	4	4	4,070				
ワオールホールディングス	9	8	14,155	トリドールホールディングス	16	17	73,057				
ジンズホールディングス	4	3	14,134	TOKYO B A S E	17	19	5,841				
ビックカメラ	44	33	43,420	J M ホールディングス	5	4	11,453				
DCMホールディングス	41	33	46,306	アレンザホールディングス	5	5	6,641				
Mon o t a R O	95	88	136,906	バ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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	千円	株数	千円
クスリのアオキホールディングス	千株	千株	千円	上新電機	千株	千株	千株	千株	千円	千株	千円
力の源ホールディングス	6	18	57,645	日本瓦斯	6	6	14,656	6	6	14,656	14,656
FOOD & LIFE COMPANIES	—	4	7,591	ロイヤルホールディングス	36	33	77,804	36	33	77,804	77,804
メディカルシステムネットワーク	38	33	102,007	東天紅	13	11	26,706	5	—	—	26,706
はるやまホールディングス	11	10	6,375	いなげや	6	6	7,893	6	6	7,893	7,893
ノジマ	11	5	3,169	チヨダ	6	7	6,379	6	7	6,379	6,379
カッパ・クリエイト	22	18	30,212	ライフコーポレーション	5	6	24,519	5	6	24,519	24,519
ライトオン	10	9	16,513	リンガーハット	8	8	19,197	8	8	19,197	19,197
良品計画	6	6	2,725	Mr Max HD	9	10	6,426	9	10	6,426	6,426
アドヴァングループ	86	68	159,262	AOKIホールディングス	12	13	15,436	12	13	15,436	15,436
アルビス	2	2	6,314	オーワワ	10	9	7,812	10	9	7,812	7,812
コナカ	14	—	—	コメリ	10	9	32,204	10	9	32,204	32,204
ハウス オブ ローゼ	2	0.400	651	青山商事	14	13	21,882	14	13	21,882	21,882
G-7ホールディングス	8	6	9,785	しまむら	7	14	120,723	7	14	120,723	120,723
イオン北海道	10	18	17,205	高島屋	50	43	99,125	50	43	99,125	99,125
コジマ	13	10	7,820	松屋	11	10	10,207	11	10	10,207	10,207
ヒマラヤ	4	0.400	377	エイチ・ツー・オー リテイリング	32	27	50,762	32	27	50,762	50,762
コーナン商事	9	7	29,953	近鉄百貨店	2	2	6,812	2	2	6,812	6,812
エコス	2	2	6,162	丸井グループ	49	41	102,960	49	41	102,960	102,960
ワタミ	8	6	6,824	アクシアル リテイリング	4	4	17,350	4	4	17,350	17,350
ハ・ハ・ワ・イ・イ・タ・ナ・ショナルホールディングス	151	126	440,409	イオン	228	212	762,808	228	212	762,808	762,808
西松屋チェーン	14	12	25,682	イズミ	10	11	41,680	10	11	41,680	41,680
ゼンショーホールディングス	36	31	211,433	平和堂	11	10	21,672	11	10	21,672	21,672
サイゼリヤ	11	9	45,942	フジ	10	9	19,046	10	9	19,046	19,046
V T ホールディングス	25	23	12,233	ヤオコー	7	7	58,646	7	7	58,646	58,646
魚力	2	2	6,426	ゼビオホールディングス	9	8	8,228	9	8	8,228	8,228
フジ・コーポレーション	3	3	6,271	ケースホールディングス	53	42	51,972	53	42	51,972	51,972
ユナイテッドアローズ	7	7	13,246	日産東京販売ホールディングス	4	4	2,400	4	4	2,400	2,400
ハイディ日高	10	9	25,212	Genky DrugStores	3	2	16,794	3	2	16,794	16,794
コロワイド	31	27	60,345	ナルミヤ・インターナショナル	5	3	4,098	5	3	4,098	4,098
ピーシーデポコーポレーション	17	—	—	ブックオフグループホールディングス	4	—	—	4	—	—	—
壱番屋	5	5	30,450	ギフトホールディングス	1	2	7,908	1	2	7,908	7,908
スギホールディングス	13	12	91,539	AINホールディングス	9	8	40,402	9	8	40,402	40,402
薬王堂ホールディングス	3	3	8,804	元気寿司	2	3	12,215	2	3	12,215	12,215
スクロール	10	9	8,639	ヤマダホールディングス	276	192	83,602	276	192	83,602	83,602
ヨンドシーホールディングス	5	5	11,487	アークランズ	9	18	30,985	9	18	30,985	30,985
木曽路	10	9	24,595	ニトリホールディングス	27	22	493,734	27	22	493,734	493,734
S R S ホールディングス	11	10	12,133	グルメ杵屋	5	—	—	5	—	—	—
千趣会	12	—	—	愛眼	27	1	257	27	1	257	257
リテールパートナーズ	10	9	16,414	ケーユーホールディングス	3	5	6,382	3	5	6,382	6,382
ケーヨー	10	—	—	吉野家ホールディングス	26	23	75,467	26	23	75,467	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数		株数	株数	評価額	株数	評価額
松屋フーズホールディングス	千株	千株	千円	千株	千株	千円	千株	千株	千円	千株	千円
サガミホールディングス	3	3	16,710	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
関西フードマーケット	10	9	14,043	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
王将フードサービス	6	4	7,145	群馬銀行	121	113	87,977	武蔵野銀行	8	8	22,428
ミニストップ	4	4	35,512	千葉興業銀行	14	11	9,163	筑波銀行	27	—	—
アーツ	4	4	7,502	七十七銀行	20	17	62,645	秋田銀行	4	3	7,983
バローホールディングス	12	11	34,960	山形銀行	7	6	7,143	岩手銀行	4	3	9,335
ベルク	12	12	29,508	東邦銀行	49	46	14,414	東邦銀行	49	46	14,414
大 庄	3	3	20,367	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
ファーストリテイリング	4	4	6,189	八十二銀行	128	125	109,800	八十二銀行	128	125	109,800
サンドラッグ	10	28	1,175,940	山梨中央銀行	6	6	11,147	山梨中央銀行	6	6	11,147
サックスパー ホールディングス	25	21	96,036	大垣共立銀行	141	129	187,286	大垣共立銀行	12	11	22,954
ヤマザワ	6	7	6,520	福井銀行	52	49	55,473	福井銀行	5	5	9,235
やまや	3	3	4,301	清水銀行	—	20	54,099	清水銀行	3	4	6,264
ベルーナ	1	—	—	富山銀行	74	69	75,129	富山銀行	1	1	1,976
銀行業(7.2%)	16	15	9,301	島根銀行	7	—	—	滋賀銀行	10	9	38,363
いよざんホールディングス	16	69	75,129	京都銀行	9	2	1,365	南都銀行	9	8	23,698
しづおかフィナンシャルグループ	141	129	187,286	京都銀行	311	289	127,207	百五銀行	59	54	33,214
ちゅうざんフィナンシャルグループ	52	49	55,473	東京きらぼしフィナンシャルグループ	—	20	54,099	京都銀行	19	—	—
楽天銀行	—	74	186,776	九州フィナンシャルグループ	8	7	30,862	紀陽銀行	110	113	109,011
京都フィナンシャルグループ	—	—	—	ゆうちょ銀行	178	641	985,497	ほくほくフィナンシャルグループ	178	641	985,497
島根銀行	9	—	—	富山第一銀行	15	18	16,058	山陰合同銀行	15	18	16,058
じもとホールディングス	8	2	1,365	コンコルディア・フィナンシャルグループ	345	313	228,395	百十四銀行	39	32	53,396
めぶきフィナンシャルグループ	311	289	127,207	西日本フィナンシャルホールディングス	5	5	10,046	四国銀行	9	9	10,046
東京きらぼしフィナンシャルグループ	8	7	30,862	三十三フィナンシャルグループ	9	9	38,778	阿波銀行	9	8	38,778
九州フィナンシャルグループ	110	113	109,011	第四北越フィナンシャルグループ	81	83	86,174	大分銀行	3	3	86,174
ゆうちょ銀行	110	113	109,011	ひろざんホールディングス	6	5	12,265	宮崎銀行	3	3	12,265
富山第一銀行	178	641	985,497	おきなわフィナンシャルグループ	8	7	32,300	佐賀銀行	15	18	28,731
コンコルディア・フィナンシャルグループ	178	641	985,497	十六フィナンシャルグループ	5	6	12,267	琉球銀行	9	8	32,300
西日本フィナンシャルホールディングス	178	641	985,497	北國フィナンシャルホールディングス	8	9	23,535	セブン銀行	8	9	23,535
三十三フィナンシャルグループ	178	641	985,497	プロクレアホールディングス	8	9	23,535	みずほフィナンシャルグループ	18	19	28,731
第四北越フィナンシャルグループ	178	641	985,497	あいちフィナンシャルグループ	5	6	12,267	山口フィナンシャルグループ	9	8	12,267
ひろざんホールディングス	178	641	985,497	S B I 新生銀行	5	6	12,267	長野銀行	9	8	12,267
おきなわフィナンシャルグループ	178	641	985,497	あおぞら銀行	8	9	23,535	名古屋銀行	9	8	23,535
十六フィナンシャルグループ	178	641	985,497	三菱UFJフィナンシャル・グループ	8	—	—	北洋銀行	18	19	23,535
北國フィナンシャルホールディングス	178	641	985,497	—	—	—	—	18	19	23,535	
プロクレアホールディングス	178	641	985,497	—	—	—	—	19	20	28,731	
あいちフィナンシャルグループ	178	641	985,497	—	—	—	—	20	21	38,778	
S B I 新生銀行	178	641	985,497	—	—	—	—	21	22	53,396	
あおぞら銀行	178	641	985,497	—	—	—	—	22	23	86,174	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	178	641	985,497	—	—	—	—	23	24	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	24	25	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	25	26	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	26	27	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	27	28	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	28	29	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	29	30	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	30	31	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	31	32	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	32	33	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	33	34	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	34	35	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	35	36	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	36	37	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	37	38	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	38	39	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	39	40	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	40	41	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	41	42	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	42	43	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	43	44	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	44	45	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	45	46	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	46	47	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	47	48	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	48	49	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	49	50	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	50	51	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	51	52	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	52	53	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	53	54	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	54	55	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	55	56	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	56	57	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	57	58	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	58	59	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	59	60	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	60	61	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	61	62	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	62	63	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	63	64	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	64	65	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	65	66	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	66	67	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	67	68	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	68	69	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	69	70	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	70	71	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	71	72	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	72	73	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	73	74	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	74	75	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	75	76	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	76	77	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	77	78	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	78	79	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	79	80	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	80	81	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	81	82	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	82	83	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	83	84	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	84	85	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	85	86	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	86	87	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	87	88	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	88	89	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	89	90	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	90	91	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	91	92	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	92	93	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	93	94	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	94	95	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	95	96	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	96	97	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	97	98	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	98	99	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	99	100	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	100	101	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	101	102	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	102	103	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	103	104	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	104	105	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	105	106	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	106	107	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	107	108	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	108	109	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	109	110	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	110	111	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	111	112	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	112	113	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	113	114	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	114	115	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	115	116	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	116	117	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	117	118	109,011	
—	—	—	—	—	—	—	—	118	119		

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
大光銀行	3	1	1,677			ジェイリース	2	1	4,759		
愛媛銀行	8	7	8,769			イントラスト	4	0.100	80		
京葉銀行	29	24	17,419			S B I アルビ	7	7	6,704		
栃木銀行	28	29	8,906			プレミアグループ	10	9	17,385		
北日本銀行	2	2	5,955			ネットプロテクションズホールディングス	20	34	6,747		
東和銀行	11	10	7,051			クレディセゾン	39	37	104,340		
トモニホールディングス	50	55	22,175			芙蓉総合リース	5	5	74,277		
フィデアホールディングス	6	6	9,534			みずほリース	9	9	52,528		
池田泉州ホールディングス	80	81	28,755			東京センチュリー	11	43	69,738		
証券、商品先物取引業(0.9%)						日本証券金融	25	21	35,088		
F P G	25	19	36,287			アイフル	103	86	37,152		
ジャパンインベストメントアドバイザー	5	9	8,531			リコーリース	6	5	28,050		
マーキュリアホールディングス	4	1	1,061			イオンファイナンシャルサービス	36	33	44,957		
S B I ホールディングス	90	85	342,400			アコム	111	104	41,419		
ジャフコ グループ	20	17	30,389			ジャックス	6	6	34,348		
大和証券グループ本社	448	452	489,614			オリエントコーポレーション	16	19	20,398		
野村ホールディングス	1,155	981	816,155			オリックス	419	355	1,096,883		
岡三証券グループ	55	51	37,500			三菱H C キャピタル	244	260	270,868		
丸三証券	20	19	18,876			九州リースサービス	3	—	—		
東洋証券	20	19	6,892			日本取引所グループ	176	152	578,740		
東京海上ホールディングス	68	69	39,847			イー・ギャランティ	10	9	17,917		
光世証券	5	1	715			アサックス	8	—	—		
水戸証券	23	17	8,084			NECキャピタルソリューション	3	2	10,730		
いよし証券	11	10	8,589			不動産業(1.9%)					
松井証券	37	28	24,481			大東建託	23	21	367,545		
マネックスグループ	70	57	50,393			いちご	72	67	27,216		
極東証券	8	8	8,144			日本駐車場開発	74	61	11,185		
岩井コスモホールディングス	7	6	14,632			S R E ホールディングス	3	2	8,650		
アイザワ証券グループ	9	8	9,870			A D ワークスグループ	20	20	4,763		
スパークス・グループ	7	6	11,836			ヒューリック	146	136	206,411		
保険業(2.6%)						三栄建築設計	3	—	—		
かんぽ生命保険	76	59	159,370			野村不動産ホールディングス	39	32	120,412		
F P パートナー	—	1	8,256			三重交通グループホールディングス	13	12	7,550		
S O M P O ホールディングス	107	87	775,537			サムティ	10	9	23,212		
アニコム ホールディングス	21	19	11,840			ディア・ライフ	9	10	9,260		
MS&ADインシュアنسグループホールディングス	127	130	962,082			コーチアーアルレー	6	3	3,307		
第一生命ホールディングス	319	285	970,590			地主	4	4	9,499		
東京海上ホールディングス	631	577	2,534,485			プレサンスコーポレーション	8	9	15,475		
T & D ホールディングス	168	156	396,076			ハウスコム	4	4	3,864		
アドバンスクリエイト	3	3	3,438			J P M C	4	5	6,754		
その他金融業(1.2%)						サンセイランディック	5	2	2,380		
全国保証	16	15	84,165			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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
フージャースホールディングス	千株 9	千株 9	千円 9,585	L I F U L L	千株 22	千株 32	千円 5,377				
オープンハウスグループ	23	21	105,009	M I X I	14	13	31,584				
東急不動産ホールディングス	188	175	171,586	ジェイエイシーリクルートメント	5	22	16,566				
飯田グループホールディングス	54	55	108,222	日本M&Aセンターホールディングス	112	97	101,518				
ムゲンエステート	9	—	—	メンバーズ	2	6	6,009				
And Doホールディングス	6	5	6,165	U T グループ	9	7	26,702				
シーアールイー	4	4	5,821	アイティメディア	3	6	11,796				
ケイアイスター不動産	3	2	10,430	ケアネット	—	9	6,439				
グッドコムアセット	5	8	6,166	E・J ホールディングス	4	3	6,055				
ジェイ・エス・ビー	1	2	7,975	オープアップグループ	23	18	40,205				
ロードスター・キャピタル	3	3	8,329	コシダカホールディングス	19	18	16,580				
霞ヶ関・キャピタル	—	1	21,296	アルトナー	1	—	—				
パーク24	48	37	65,377	パソナグループ	7	7	20,290				
三井不動産	272	270	1,099,440	C D S	2	—	—				
三菱地所	378	381	814,166	リンクアンドモチベーション	18	17	10,710				
平和不動産	10	9	38,190	エス・エム・エス	24	21	55,105				
東京建物	59	51	110,058	サニーサイドアップグループ	7	—	—				
京阪神ビルディング	7	10	17,254	パーソルホールディングス	73	620	137,604				
住友不動産	113	84	387,902	クックパッド	26	53	7,021				
テーオーシー	11	10	7,082	アイ・ケイ・ケイホールディングス	3	—	—				
東京楽天地	1	1	6,700	学情	3	3	6,688				
レオパレス21	70	58	24,703	スタジオアリス	3	3	6,180				
スターツコーポレーション	9	8	25,494	シミックホールディングス	3	—	—				
フジ住宅	8	8	6,327	N J S	2	2	6,249				
空港施設	9	10	6,281	綜合警備保障	24	101	82,702				
ゴールドクレスト	6	4	10,780	カカクコム	48	40	70,101				
エスリード	2	2	9,207	アイロムグループ	2	—	—				
日神グループホールディングス	11	12	6,197	セントケア・ホールディング	5	6	6,157				
日本エスコン	14	10	10,758	ルネサンス	5	6	7,534				
MIRARTHホールディングス	31	26	13,185	デイップ	11	9	25,110				
AVANTIA	5	3	3,122	デジタルホールディングス	5	—	—				
イオンモール	32	30	55,342	新日本科学	6	5	9,025				
ファースト住建	4	1	1,651	ベネフィット・ワン	30	21	45,982				
カチタス	16	15	31,117	エムスリー	129	120	252,840				
トーセイ	10	9	19,962	アウトソーシング	39	39	67,740				
穴吹興産	2	—	—	ウェルネット	7	—	—				
サンフロンティア不動産	10	8	14,706	ワールドホールディングス	2	2	6,750				
F J ネクストホールディングス	6	6	7,198	ディー・エヌ・エー	27	21	27,287				
グランディハウス	8	9	6,295	博報堂DYホールディングス	83	77	112,276				
日本空港ビルディング	22	20	121,157	ぐるなび	12	23	7,120				
サービス業(4.6%)				ジャパンバストレスキューシステム	5	—	—				
日本工営	4	—	—	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			銘柄	期首(前期末)		当期末		
	株数	株数	評価額				株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円				千株	千株	千円		
ライク	2	4	6,581			フルキャストホールディングス	6	5	8,572		
A o b a - B B T	11	—	—			エン・ジャパン	11	9	27,343		
エスプール	18	20	6,457			テクノプロ・ホールディングス	43	35	117,453		
W D B ホールディングス	3	3	7,182			インターワークス	12	—	—		
アドウェイズ	9	12	5,790			アイ・アールジャパンホールディングス	3	4	5,719		
バリューコマース	4	5	6,153			K e e P e r 技研	4	3	25,156		
インフォマート	68	63	24,813			三機サービス	4	—	—		
J P ホールディングス	18	15	7,410			イー・ガーディアン	2	4	5,504		
C L ホールディングス	6	—	—			リブセンス	1	—	—		
プレステージ・インターナショナル	27	28	17,271			ジャパンマテリアル	20	18	49,159		
アミューズ	3	4	6,056			ベクトル	10	7	9,420		
ドリームインキュベータ	2	2	6,468			ウチヤマホールディングス	15	—	—		
ワック	5	4	10,101			チャーム・ケア・コーポレーション	5	5	7,282		
T A C	22	—	—			キャリアリンク	2	2	6,364		
電通グループ	64	59	258,348			I B J	5	9	5,391		
ぴあ	2	2	6,594			アサンテ	3	3	6,399		
イオンファンタジー	2	2	6,220			バリューH R	5	5	7,239		
シーティーエス	7	9	6,880			M & A キャピタルパートナーズ	6	4	12,215		
H. U. グループホールディングス	19	17	48,594			ライドオンエクスプレスホールディングス	4	6	6,502		
アルプラス技研	5	5	17,057			シグマクシス・ホールディングス	9	8	13,587		
日本空調サービス	7	7	6,727			ウィルグループ	5	5	6,079		
オリエンタルランド	69	322	1,738,597			メドピア	5	9	7,443		
ダスキン	14	13	45,954			リクルートホールディングス	484	451	2,657,568		
明光ネットワークジャパン	8	8	6,505			エラン	8	8	7,743		
ファルコホールディングス	3	2	6,664			日本郵政	858	716	1,006,977		
秀英予備校	11	—	—			ベルシステム24ホールディングス	8	6	11,615		
ラウンドワン	54	57	39,835			鎌倉新書	7	10	5,990		
リゾートトラスト	25	26	67,190			S M N	8	—	—		
ビー・エム・エル	8	7	20,580			エアトリ	4	4	7,236		
りらいあコミュニケーションズ	10	—	—			アトラエ	5	9	4,557		
リソー教育	29	31	7,246			ストライク	3	2	13,468		
早稲田アカデミー	4	—	—			ソラスト	18	16	9,021		
ユー・エス・エス	67	68	178,318			インソース	16	13	10,560		
東京個別指導学院	9	14	6,375			ペイカレント・コンサルティング	51	44	142,374		
サイバーエージェント	156	134	141,704			Orchestra Holdings	2	6	7,125		
楽天グループ	302	522	391,643			アイモバイル	4	14	6,570		
クリーク・アンド・リバー社	3	3	6,198			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		
S B I グローバルアセットマネジメント	10	11	8,782			G A M E W I T H	10	—	—		
ティー・オー・ダブリュー	16	18	6,822			ウェルビー	6	—	—		
山田コンサルティンググループ	4	3	6,192			ミダックホールディングス	4	3	6,090		
セントラルスポーツ	2	2	6,357			キューピー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	当期末		
	期首(前期末)	株数	評価額
	千株	千株	千円
R P A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	10	17	6,301
a n d f a c t o r y	11	—	—
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	7	14	4,847
ポピングズ	3	5	8,047
L I T A L I C O	5	4	9,987
リログループ	36	30	39,909
東祥	4	7	5,621
I D & E ホールディングス	—	3	13,764
T R E ホールディングス	13	11	14,402
人・夢・技術グループ	2	3	5,817
大栄環境	—	11	29,403
日本管財ホールディングス	—	6	16,531
M&A総研ホールディングス	—	2	19,633
エイチ・アイ・エス	17	17	29,824
ラックランド	2	2	7,257
共立メンテナンス	11	9	60,537
イチネンホールディングス	6	6	10,809
建設技術研究所	3	3	18,755
スペース	5	6	6,606
燐ホールディングス	2	5	5,916
東京テアトル	4	—	—
タナベコンサルティンググループ	7	—	—
ナガワ	1	1	13,585
東京都競馬	5	5	21,420
カナモト	12	9	27,767
ニシオホールディングス	6	5	21,916
トランス・コスモス	8	7	22,724
乃村工藝社	28	26	23,354
藤田觀光	2	2	15,816
KNT-CTホールディングス	3	—	—

銘柄	当期末		
	期首(前期末)	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
国 内 T O P I X	百万円 2,164	百万円 —

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 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オーブン	5,323,486,715円
ニッセイ国内株式インデックスS.A(適格機関投資家限定)	3,051,320,322円
ニッセイ日本バランス(成長型)(適格機関投資家限定)	3,075,264円
DC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
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,282,848,201円
DC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
DC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(資産均等型)	3,680,342,973円
DCニッセイターゲットデー卜ファンド2055	383,217,945円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	223,827,805円
DCニッセイターゲットデー卜ファンド2045	437,206,012円
DCニッセイターゲットデー卜ファンド2035	600,148,942円
DCニッセイターゲットデー卜ファンド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(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(資産均等型)	26,586,216円
DCニッセイターゲットデー卜ファンド2060	309,317,472円
DCニッセイターゲットデー卜ファンド2050	197,083,804円
DCニッセイターゲットデー卜ファンド2040	372,094,171円
DCニッセイターゲットデー卜ファンド2030	169,589,950円
ニッセイ国内株式市場連動S.Aファンド(適格機関投資家限定)	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/スケット)	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(積積型)	75,807円
FWニッセイ国内株式インデックス	68,973,915円
DCニッセイターゲットデー卜ファンド2065	75,173,314円
DC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
その他の収益	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、期末の評価換算による損益を含みます。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 34 期

(計算期間：2024年5月21日～2024年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。
・株式への投資割合には、制限を設けません。
・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

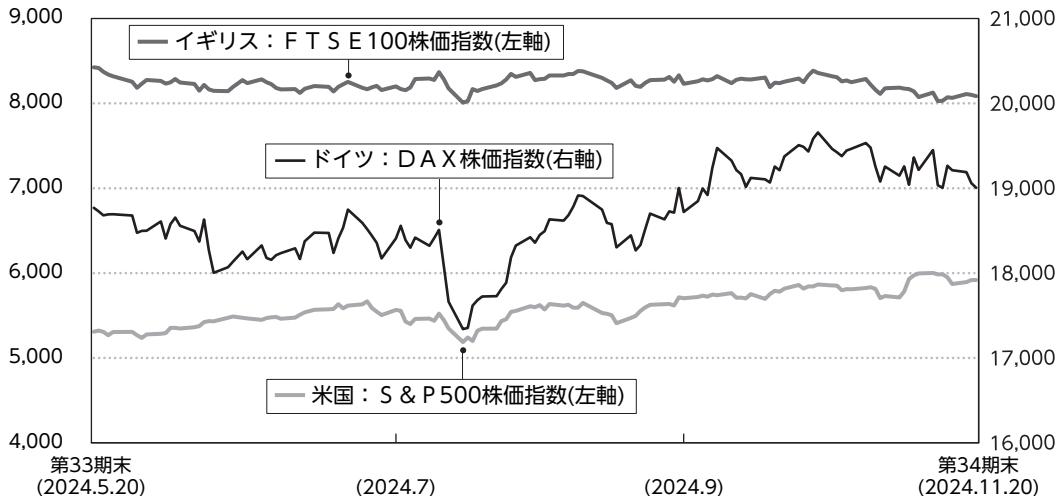
運用経過

2024年5月21日～2024年11月20日

投資環境

■海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



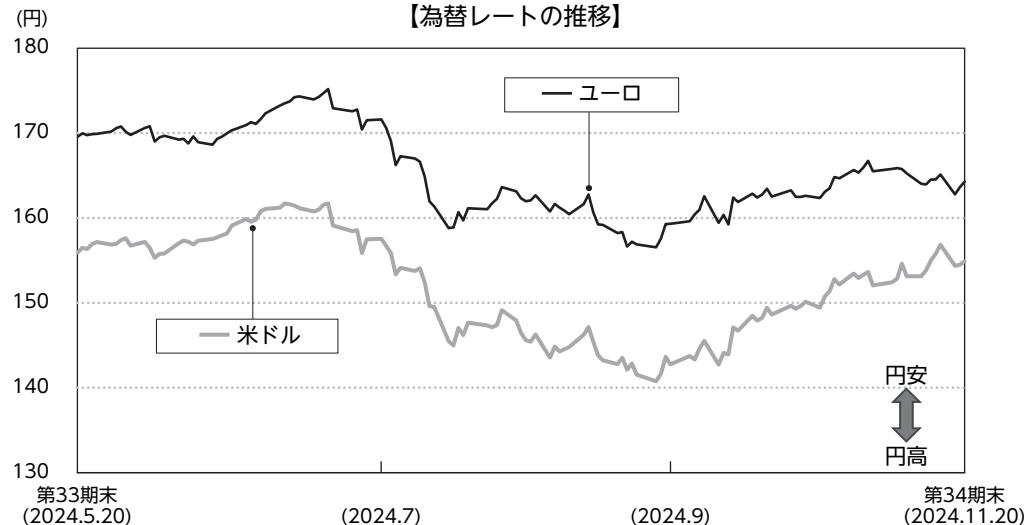
(注) FactSetのデータを使用しています。

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

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

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

■為替市況



(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

基準価額等の推移



（注）ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指標化しています。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

最近5期の運用実績

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

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
			%				
(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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

1万口当たりの費用明細

2024年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)	0.000% (0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税 (株式)	1 (1)	0.002 (0.001)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 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 (3)	0.006 (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)	<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	4	0.008	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

売買および取引の状況

2024年5月21日～2024年11月20日

(1) 株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(3) 先物取引の種類別取引状況

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2024年5月21日～2024年11月20日

株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末			業種等	
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円			
HUBBELL INC	56	59	2,689	416,675	資本財		
HUBSPOT INC	50	53	3,660	567,033	ソフトウェア・サービス		
HUMANA INC	130	133	3,708	574,462	ヘルスケア機器・サービス		
HUNTINGTON Bancshares INC	1,535	1,605	2,816	436,274	銀行		
HUNTINGTON Ingalls 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 INC	185	193	2,940	455,539	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
KIMBERLY-CLARK CORP	358	373	5,059	783,784	家庭用品・パーソナル用品		
KINDER MORGAN INC	2,119	2,212	6,212	962,396	エネルギー		
KKR & CO INC -A	609	687	10,508	1,627,944	金融サービス		
KLA CORPORATION	144	149	9,180	1,422,090	半導体・半導体製造装置		
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	170	179	1,011	156,710	運輸		
KRAFT HEINZ CO/THE	909	1,009	3,086	478,101	食品・飲料・タバコ		
KROGER CO	723	759	4,411	683,453	生活必需品流通・小売り		
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	200	210	5,119	793,071	資本財		
LABCORP HOLDINGS INC	-	93	2,205	341,681	ヘルスケア機器・サービス		
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	89	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス		
LAM RESEARCH CORP	139	1,448	10,160	1,573,981	半導体・半導体製造装置		
LAMB WESTON HOLDING INC	152	160	1,202	186,251	食品・飲料・タバコ		
LAS VEGAS SANDS CORP	399	412	2,029	314,399	消費者サービス		
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	146	-	-	-	半導体・半導体製造装置		
LEAR CORP	61	-	-	-	自動車・自動車部品		
LEIDOS HOLDINGS INC	138	142	2,251	348,733	商業・専門サービス		
LENNAR CORP-CL A	264	267	4,516	699,587	耐久消費財・アパレル		
LENNOX INTERNATIONAL INC	33	35	2,212	342,737	資本財		
LIBERTY BROADBAND-C	126	-	-	-	メディア・娯楽		
LIBERTY GLOBAL LTD-C	201	-	-	-	電気通信サービス		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	173	-	-	-	メディア・娯楽		
LIBERTY MEDIA GROUP-C	209	230	1,871	289,930	メディア・娯楽		
LINDE PLC	513	532	23,641	3,662,275	素材		
LIVE NATION INC	170	178	2,394	370,996	メディア・娯楽		
LKQ CORP	283	295	1,112	172,315	一般消費財・サービス流通・小売り		
LOCKHEED MARTIN CORP	236	239	12,757	1,976,214	資本財		
LOEWS CORP	200	207	1,746	270,615	保険		
LOWE'S COS INC	609	631	16,362	2,534,742	一般消費財・サービス流通・小売り		
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	80	82	2,602	403,189	金融サービス		
LULULEMON ATHLETICA INC	121	126	3,808	590,012	耐久消費財・アパレル		
LYONDELLBASELL INDU-CL A	274	288	2,373	367,606	素材		
M&T BANK CORP	175	184	3,950	611,894	銀行		
MANHATTAN ASSOCIATES INC	65	68	1,845	285,823	ソフトウェア・サービス		

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末			業種等	
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(イギリス)	百株	百株	千円				
RELX PLC	1,997	2,067	7,376	1,450,167	商業・専門サービス		
RENTOKIL INITIAL PLC	2,674	2,797	1,130	222,268	商業・専門サービス		
RIO TINTO PLC	1,192	1,248	6,109	1,201,105	素材		
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	8,917	9,417	4,968	976,804	資本財		
SAGE GROUP PLC	1,079	1,110	1,195	235,054	ソフトウェア・サービス		
SAINSBURY (J) PLC	1,755	1,830	454	89,402	生活必需品流通・小売り		
SCHRODERS PLC	853	896	278	54,784	金融サービス		
SEVERN TRENT PLC	285	299	804	158,126	公益事業		
SHELL PLC-NEW	6,889	6,978	17,951	3,529,249	エネルギー		
SMITH & NEPHEW PLC	925	968	956	188,065	ヘルスケア機器・サービス		
SMITHS GROUP PLC	367	381	645	126,944	資本財		
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	78	81	534	105,008	資本財		
SSE PLC	1,157	1,209	2,071	407,242	公益事業		
ST JAMES'S PLACE PLC	583	—	—	—	金融サービス		
STANDARD CHARTERED PLC	2,398	2,400	2,273	446,987	銀行		
TAYLOR WIMPEY PLC	3,747	3,925	510	100,321	耐久消費財・アパレル		
TESCO PLC	7,469	7,664	2,666	524,235	生活必需品流通・小売り		
UNILEVER PLC	2,649	2,763	12,591	2,475,415	家庭用品・パーソナル用品		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	721	755	828	162,825	公益事業		
VODAFONE GROUP PLC	24,812	25,329	1,790	352,070	電気通信サービス		
WHITBREAD PLC	197	199	575	113,054	消費者サービス		
WISE PLC - A	651	737	617	121,343	金融サービス		
WPP PLC	1,139	1,194	974	191,592	メディア・娯楽		
小計	株数・金額 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・シェケル				
AZRIELI GROUP	45	47	1,362	56,404	不動産管理・開発		
BANK HAPOALIM BM	1,345	1,407	5,892	243,871	銀行		
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,613	1,680	6,821	282,310	銀行		
ELBIT SYSTEMS LTD	28	29	2,743	113,561	資本財		
ICL GROUP LTD	822	860	1,414	58,551	素材		
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	1,309	1,369	3,217	133,185	銀行		
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	164	171	2,733	113,126	銀行		
NICE LTD	67	70	4,595	190,203	ソフトウェア・サービス		
小計	株数・金額 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 銘柄数<比率>	16,016 45	16,612 46	153,467 —	26,936,675 <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 銘柄数<比率>	6,931 15	7,220 16	403,487 —	8,884,801 <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	千スウェーデン・クローナ	千円			
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	157	163	4,463	63,423	資本財		
INVESTOR AB	1,832	1,914	56,636	804,803	金融サービス		
LIFCO AB-B SHS	246	257	8,084	114,877	資本財		
LUNDBERGS AB-B SHS	79	83	4,401	62,545	金融サービス		
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	1,607	1,679	7,978	113,369	資本財		
SAAB AB-B	338	354	8,816	125,288	資本財		
SAGAX AB-B	216	243	5,856	83,213	不動産管理・開発		
SANDVIK AB	1,128	1,180	23,886	339,432	資本財		
SECURITAS AB	519	544	7,229	102,729	商業・専門サービス		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,679	1,756	26,318	373,978	銀行		
SKANSKA AB-B SHS	359	376	8,257	117,346	資本財		
SKF AB	360	377	7,675	109,064	資本財		
SVENSKA CELLULOSA AB	641	670	9,523	135,333	素材		
SVENSKA HANDELSBANKEN	1,543	1,616	17,860	253,796	銀行		
SWEDBANK AB - A SHARES	898	940	20,149	286,322	銀行		
TELE2 AB	591	611	6,869	97,611	電気通信サービス		
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	3,101	3,073	27,234	386,998	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
TELIA CO AB	2,615	2,684	8,409	119,492	電気通信サービス		
TRELLEBORG AB-B SHS	—	235	8,283	117,706	資本財		
VOLVO AB	1,593	1,754	46,802	665,069	資本財		
VOLVO AB-A SHS	216	226	6,068	86,229	資本財		
VOLVO CAR AB-B	788	823	1,886	26,800	自動車・自動車部品		
小計	株数・金額	34,486	36,355	622,248	8,842,145		
	銘柄数<比率>	42	44	—	<0.8%>		
(ユーロ／アイルランド)			千ユーロ				
AIB GROUP PLC	1,664	2,010	1,077	177,036	銀行		
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,119	1,126	984	161,795	銀行		
KERRY GROUP PLC-A	167	171	1,464	240,592	食品・飲料・タバコ		
KINGSPAN GROUP PLC	164	171	1,237	203,222	資本財		
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	275	—	—	—	素材		
小計	株数・金額	3,391	3,479	4,764	782,647		
	銘柄数<比率>	5	4	—	<0.1%>		

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末			業種等	
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ／オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
ABN AMRO BANK NV	503	506	750	123,318	銀行		
ADYEN NV	23	24	2,963	486,778	金融サービス		
AIRBUS SE	628	658	9,033	1,483,909	資本財		
AKZO NOBEL NV	180	189	1,058	173,863	素材		
ASM INTERNATIONAL NV	49	51	2,555	419,760	半導体・半導体製造装置		
ASML HOLDING NV	427	442	27,646	4,541,527	半導体・半導体製造装置		
ASR NEDERLAND NV	167	175	791	130,068	保険		
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	81	85	920	151,141	半導体・半導体製造装置		
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	652	681	386	63,424	食品・飲料・タバコ		
DSM-FIRMENICH AG	197	206	2,140	351,577	素材		
EURONEXT NV	90	88	922	151,619	金融サービス		
EXOR NV	98	109	1,027	168,848	金融サービス		
FERRARI NV	133	139	5,672	931,826	自動車・自動車部品		
HEINEKEN HOLDING NV	136	143	876	144,029	食品・飲料・タバコ		
HEINEKEN NV	304	318	2,270	372,974	食品・飲料・タバコ		
IMCD NV	60	63	877	144,216	資本財		
ING GROEP NV-CVA	3,520	3,657	5,467	898,143	銀行		
INPOST SA	—	221	382	62,906	運輸		
JDE PEET'S BV	102	135	245	40,398	食品・飲料・タバコ		
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,008	1,036	3,376	554,594	生活必需品流通・小売り		
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'ETEREN GROUP	22	23	461	75,825	一般消費財・サービス流通・小売り		
ELIA GROUP SA/NV	31	32	272	44,750	公益事業		
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	92	92	596	98,048	金融サービス		
KBC GROEP NV	265	254	1,790	294,179	銀行		
LOTUS BAKERIES	0.44	0.45	513	84,418	食品・飲料・タバコ		
SOFINA	16	17	369	60,730	金融サービス		
SYENSQO SA	78	81	587	96,584	素材		
UCB SA	133	139	2,300	377,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
UMICORE	221	—	—	—	素材		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,014 12	1,879 11	16,523 —	2,714,348 <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 2	1,040 2	2,151 —	353,477 <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		
BRENNNTAG SE	140	143	839	137,869	資本財		
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	42	44	255	41,991	ヘルスケア機器・サービス		
COMMERZBANK AG	1,114	1,114	1,787	293,694	銀行		
CONTINENTAL AG	116	121	750	123,320	自動車・自動車部品		
COVESTRO AG	200	209	1,199	196,978	素材		
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	—	69	625	102,795	メディア・娯楽		
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	566	546	1,970	323,624	資本財		
DELIVERY HERO SE	187	205	742	121,997	消費者サービス		
DEUTSCHE BANK AG	2,051	2,097	3,334	547,735	金融サービス		
DEUTSCHE BOERSE AG	201	210	4,449	730,855	金融サービス		
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	631	662	414	68,167	運輸		
DEUTSCHE TELEKOM AG	3,451	3,881	11,146	1,831,015	電気通信サービス		
DHL GROUP	1,050	1,129	3,968	651,934	運輸		
DR ING HC F PORSCHE AG	120	126	771	126,735	自動車・自動車部品		
E.ON SE	2,377	2,484	2,896	475,839	公益事業		
EVONIK INDUSTRIES AG	247	285	499	82,057	素材		
FRESENIUS SE & CO KGAA	447	467	1,531	251,639	ヘルスケア機器・サービス		
GEA GROUP AG	173	171	779	128,075	資本財		
HANNOVER RUECK SE	63	66	1,591	261,476	保険		
HEIDELBERG MATERIALS AG	137	150	1,783	292,993	素材		
HENKEL AG & CO KGAA	110	115	816	134,175	家庭用品・パーソナル用品		
HENKEL KGAA-VORZUG	178	186	1,469	241,395	家庭用品・パーソナル用品		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,383	1,446	4,208	691,272	半導体・半導体製造装置		
KNORR-BREMSE AG	76	80	582	95,730	資本財		
LEG IMMOBILIEN SE	78	82	686	112,849	不動産管理・開発		
MERCEDES-BENZ GROUP AG	850	829	4,385	720,330	自動車・自動車部品		
MERCK KGAA	136	143	1,998	328,370	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	57	59	1,838	301,938	資本財		

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末			業種等	
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ／ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	144	148	7,020	1,153,330	保険		
NEMETSCHER SE	61	63	632	103,898	ソフトウェア・サービス		
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	161	169	590	97,001	自動車・自動車部品		
PUMA AG	111	117	537	88,289	耐久消費財・アパレル		
RATIONAL AG	5	5	493	81,079	資本財		
RHEINMETALL AG	46	48	2,916	479,167	資本財		
RWE AG	669	699	2,198	361,130	公益事業		
SAP SE	1,106	1,156	25,429	4,177,296	ソフトウェア・サービス		
SARTORIUS AG-VORZUG	27	29	606	99,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SCOUT24 SE	79	82	697	114,593	メディア・娯楽		
SIEMENS AG	805	841	14,967	2,458,748	資本財		
SIEMENS ENERGY AG	550	707	3,234	531,317	資本財		
SIEMENS HEALTHINEERS AG	298	312	1,540	253,121	ヘルスケア機器・サービス		
SYMRISE AG	140	147	1,536	252,377	素材		
TALANX AG	68	71	556	91,415	保険		
VOLKSWAGEN AG	31	—	—	—	自動車・自動車部品		
VOLKSWAGEN AG	217	228	1,896	311,607	自動車・自動車部品		
VONOVIA SE	777	820	2,381	391,238	不動産管理・開発		
ZALANDO SE	237	248	677	111,259	一般消費財・サービス流通・小売り		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,905 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	50,474	47,658	7,828,783		
		17	17	－	<0.7%>		
(ユーロ／イタリア)							
AMPLIFON SPA	131	137	325	53,472	ヘルスケア機器・サービス		
BANCO BPM SPA	1,282	1,427	959	157,625	銀行		
DIASORIN ITALIA SPA	23	24	258	42,442	ヘルスケア機器・サービス		
ENEL SPA	8,614	9,005	5,982	982,690	公益事業		
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	2,322	2,544	3,494	574,105	エネルギー		
FINECOBANK SPA	647	676	978	160,786	銀行		
GENERALI	1,073	1,128	3,031	498,050	保険		
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	374	392	375	61,628	電気通信サービス		
INTESA SANPAOLO	15,497	16,200	6,016	988,363	銀行		
LEONARDO SPA	427	447	1,128	185,377	資本財		
MEDIOBANCA SPA	540	553	779	128,001	銀行		
MONCLER SPA	218	243	1,152	189,364	耐久消費財・アパレル		
NEXI SPA	625	656	351	57,792	金融サービス		
POSTE ITALIANE SPA	485	506	653	107,396	保険		
PRYSMIAN SPA	278	298	1,791	294,336	資本財		
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	110	115	577	94,889	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SNAM SPA	2,135	2,234	967	158,962	公益事業		
STELLANTIS NV	2,347	2,344	2,904	477,126	自動車・自動車部品		
TELECOM ITALIA SPA	10,801	11,283	258	42,447	電気通信サービス		
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	1,487	1,555	1,204	197,919	公益事業		
UNICREDIT SPA	1,632	1,630	6,321	1,038,475	銀行		
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	51,057	53,406	39,515	6,491,254		
		21	21	－	<0.6%>		

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末			業種等	
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ／フィンランド)							
ELISA OYJ	百株 156	百株 162	千ユーロ 701	千円 115,200	電気通信サービス		
FORTUM OYJ	475	495	686	112,812	公益事業		
KESKO OYJ-B SHS	289	302	578	95,060	生活必需品流通・小売		
KONE OYJ	360	376	1,832	301,046	資本財		
METSO CORPORATION	703	688	555	91,226	資本財		
NESTE OYJ	448	468	640	105,215	エネルギー		
NOKIA OYJ	5,647	5,905	2,344	385,110	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
NORDEA BANK ABP	3,363	3,494	3,747	615,583	銀行		
ORION OYJ-CLASS B	114	119	532	87,445	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SAMPO OYJ	477	499	1,985	326,094	保険		
STORA ENSO OYJ	616	643	614	100,917	素材		
UPM-KYMMENE OYJ	565	591	1,513	248,694	素材		
WARTSILA OYJ	500	555	986	162,040	資本財		
小計	株数・金額 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GICS分類（産業グループ）によるものです。なお、GICSに関する知的財産所有権はS&PおよびMSCI Inc.に帰属します。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	評価額		邦貨換算金額
			外貨建金額	千円	
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	
BOSTON PROPERTIES INC	15	16	1,313	203,441	
CROWN CASTLE INC	45	48	5,029	779,184	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17	17	1,823	282,519	
PROLOGIS INC	97	102	11,806	1,828,904	
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	53	55	1,098	170,125	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	15	15	3,611	559,400	
CAMDEN PROPERTY TRUST	11	11	1,432	221,842	
EQUITY RESIDENTIAL	38	37	2,813	435,907	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6	7	2,145	332,336	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	75	78	1,669	258,678	
WELLTOWER INC	58	66	9,148	1,417,212	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	74	78	1,353	209,720	
KIMCO REALTY CORP	71	74	1,870	289,733	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	12	12	2,046	317,050	
PUBLIC STORAGE	16	17	5,857	907,446	
REGENCY CENTERS CORP	18	19	1,441	223,358	
SIMON PROPERTY GROUP INC	34	36	6,540	1,013,231	
SUN COMMUNITIES INC	13	13	1,749	270,975	
UDR INC	33	34	1,543	239,080	
VENTAS INC	42	44	2,878	445,892	
WP CAREY INC	23	24	1,371	212,503	
REALTY INCOME CORP	88	96	5,520	855,180	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	18	19	1,390	215,391	
EXTRA SPACE STORAGE INC	22	23	3,882	601,443	
DIGITAL REALTY TRUST INC	32	35	6,730	1,042,648	
IRON MOUNTAIN INC	30	32	3,779	585,495	
AMERICAN TOWER REIT INC	49	51	10,404	1,611,727	
EQUINIX INC	9	10	9,701	1,502,883	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	34	36	1,369	212,200	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	28	30	1,513	234,484	
SBA COMMUNICATIONS CORP	11	11	2,612	404,713	
INVITATION HOMES INC	64	67	2,308	357,577	
VICI PROPERTIES INC	109	115	3,726	577,207	
小計	口数・金額	1,276	1,345	121,486	18,819,497
	銘柄数<比率>	33	33	-	<1.6%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(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
未払資金	11,842,837,384
未払解約金	1,745,237,722
(C)純資産額(A-B)	1,175,777,185,325
元本	236,998,387,944
次期繰越損益金	938,778,797,381
(D)受益権総口数	236,998,387,944口
1万口当たり基準価額(C/D)	49,611円

(注1)	期首元本額	228,048,905,816円
	期中追加設定元本額	23,976,725,288円
	期中一部解約元本額	15,024,433,160円
(注2)	当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパーファンド別内訳は、次の通りです。	
	DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	697,438,816円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,470,977,936円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,508,450,010円
	ニッセイ外国株式インデックスA(適格機関投資家限定)	2,320,921,1334円
	ニッセイインテグリラックスA(優先型)	655,727円
	ニッセイインテグリラックス(優先型)A(適格機関投資家限定)	1,365,193円
	ニッセイインテグリラックス(優先型)A(適格機関投資家限定)	4,377,084円
	ニッセイ外債インデックスファンド(優先型)	486,709,861円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	
	DCニッセイ外国株式インデックス	161,391,837,322円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	44,717,793,265円
	DCニッセイワーゲットデュアル2055	3,524,993,735円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	456,141,988円
	DCニッセイワーゲットデュアル2045	170,795,264円
	DCニッセイワーゲットデュアル2035	522,390,715円
	DCニッセイワーゲットデュアル2025	638,505,039円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	8,367,952円
	DCニッセイワーゲットデュアル2060	87,345,461円
	DCニッセイワーゲットデュアル2050	9,376,316円
	DCニッセイワーゲットデュアル2040	10,650,648円
	DCニッセイワーゲットデュアル2030	3,519,880円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	20,246,799円
	DCニッセイワーゲットデュアル2020	379,050,839円
	DCニッセイワーゲットデュアル2050	524,048,022円
	DCニッセイワーゲットデュアル2040	445,049,698円
	DCニッセイワーゲットデュアル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
	ニッセイ先進国式インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)	31,658,672円
	ニッセイ先進国式インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	11,954,174,927円
	FWニッセイ先進国株インデックス	53,058,104円
	DCニッセイワーゲットデュアル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ニッセイ全世界株式インデックスコレクト	373,589,941円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-02(適格機関投資家限定)	77,396,875円
	DCニッセイワーゲットデュアル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)配当受取	8,156,237,986円
取扱利益	7,735,425,708
その他収益	86,586,623
	△ 334,225,655
(B)有価証券売買損益	79,781,133,956
売買益	135,108,083,041
売買損	△ 55,326,949,085
(C)先物取引等損益	1,292,973,123
取引益	2,026,674,224
取引損	△ 733,701,101
(D)信託報酬等	△ 63,179,275
(E)当期損益金(A+B+C+D)	89,167,165,790
(F)前期繰越損益金	817,070,312,459
(G)追加信託差損益金	87,223,067,893
(H)解約差損益金	△ 54,681,748,761
(I)合計(E+F+G+H)	938,778,797,381
次期繰越損益金(I)	938,778,797,381

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

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

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

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

ニッセイ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（D R（預託証券）を含みます）に投資することにより、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す。

主要運用 対象

新興国の株式等（D R（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

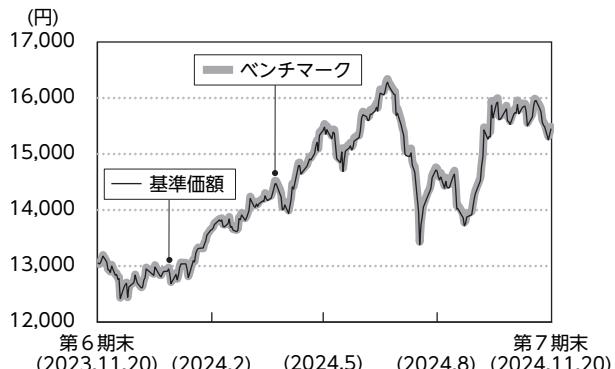


(注) FactSetのデータを使用しています。

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、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



■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中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。

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中 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	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
		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
		円	%	%	%	%	%	%
(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。

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

1万口当たりの費用明細

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)	<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	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。

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

売買および取引の状況

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
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)	千台灣ドル 140,502 (△ 183)	501	千台灣ドル 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
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・フォント 17,965	—	千ハンガリー・フォント —
ユ ー 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	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
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	—	千南アフリカ・ランド	19	千南アフリカ・ランド 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 7,354	百万円 6,961	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

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	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	千株 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 MENGENIU 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	
HAIDLAIQ 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)							
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	百株 180	百株 180	千香港ドル 44	千円 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 APPTEC 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	千台灣ドル	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		
EMMEMORY 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	千台灣ドル	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	26,807	38,482	547,472	2,617,025		
	銘柄数<比率>	90	87	—	<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	19	—	—	—		
	銘柄数<比率>	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) YAPI VE KREDI BANKASI	百株 392	百株 392	千トルコ・リラ 1,046	千円 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	2,610	2,793	27,521	72,490		
	銘柄数<比率>	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	13,953	34,249	296,776	47,290		
	銘柄数<比率>	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	85	137	376,477	13,274		
	銘柄数<比率>	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	千円	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	
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 INVESTMENT	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 ELECTROCALCS	—	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		
LTI/MINDTREE 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		
POLYCARB 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	千インド・ルピー	千円		
SAMVARDHANA MOTHESON 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	
SHIRIRAM 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 銘柄数<比率>	9,581 122	21,674 151	1,379,798 —	2,538,829 <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 INDONESI 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		
SEMENT 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 銘柄数<比率>	101,239 22	112,481 20	21,403,452 —	209,753 <1.4%>		
(ブラジル)			千ブラジル・レアル				
AMBEV SA	365	610	758	20,338	食品・飲料・タバコ		
ATACADAQ 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・レアル	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		
PRIOR 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)							
SUZANO S.A.	百株 56	百株 76	千ブラジル・レアル 460	千円 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 47	8,437 —	20,852 <3.7%>	559,340		
(チェコ)			千チェコ・クロナ				
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 3	39 —	2,746 <0.1%>	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・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		
ASYMCHEM 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	
HENGTON 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	
HUNDSEN 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 DEVELOPM-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 HENGRI 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 TECHNOLOGY-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 PHARMACEUTA	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 BILOGICA-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 PIENTZEHUANG 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 MECHANIA	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	13,991	17,304	27,366	586,081		
	銘柄数<比率>	229	225	—	<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	マレーシアリソット	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	5,913	9,635	5,711	198,011		
	銘柄数<比率>	32	33	—	<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	千萬アフリカ・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・バーツ				
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・バーツ	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		
BUMRUNGAD 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		
KASIKORN BANK 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)	百株	百株	千タイ・バーツ	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・フォリット				
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		
	口数	口数	評価額		邦貨換算金額
	千口	千口	千米ドル	千円	
(アメリカ)					
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	口数・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	口数・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	口数・金額 銘柄数<比率>	19 1	— —	— —	— <->
合計	口数・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) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、口数および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
外 国 MINI MSCI EM INDEX FUTURES	百万円 1,639	百万円 —

(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。

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	16,228,568,030円	
コール・ローン等	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	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	
その他の収益金	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。

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

ニッセイ J-REIT インデックススマザーファンド

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指します。</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>
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

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。
------	--



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

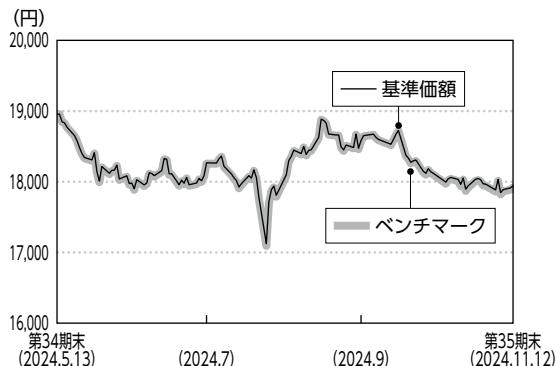


(注) FactSetのデータを使用しています。

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 R E I T 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 R E I T 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。

ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	投資信託証券組入比率	純資産総額
31期 (2022年11月14日)	円 19,056	% 2.2	18,630	% 2.2	98.8	百万円 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	円 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) 謄落率は期首比です。

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
エスコンジャパンリート投資法人	千口 0.079	千円 9,333	千口 0.010	千円 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
SOSIL 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

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
国内	千口	千円	千口	千円
C R E 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 (14)	91,504	0.090	44,964
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
N T T 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
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
K D X 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 (0.630)	14,965	0.025	7,354
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
エスコンジャパンリート投資法人	千口 0.615	千口 0.684	千円 77,565
サンケイリアルエステート投資法人	0.970	0.990	77,715
SOSIL 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
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	1	491,905
G LP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
One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クレジットファンド投資法人	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
	口数	口数	評価額
ジャパンリアルエステイト投資法人	千口 3	千口 3	千円 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
N T T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
K D X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
スターツプロシード投資法人	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	口数・金額 192	221	30,092,546
	銘柄数<比率> 58	57	<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) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、口数および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

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
投資信託証券	千円 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－REIT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－REIT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－REIT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－REIT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－REITインデックスファンドA	3,253,135,672円
DCニッセイJ－REIT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。

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

ニッセイ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

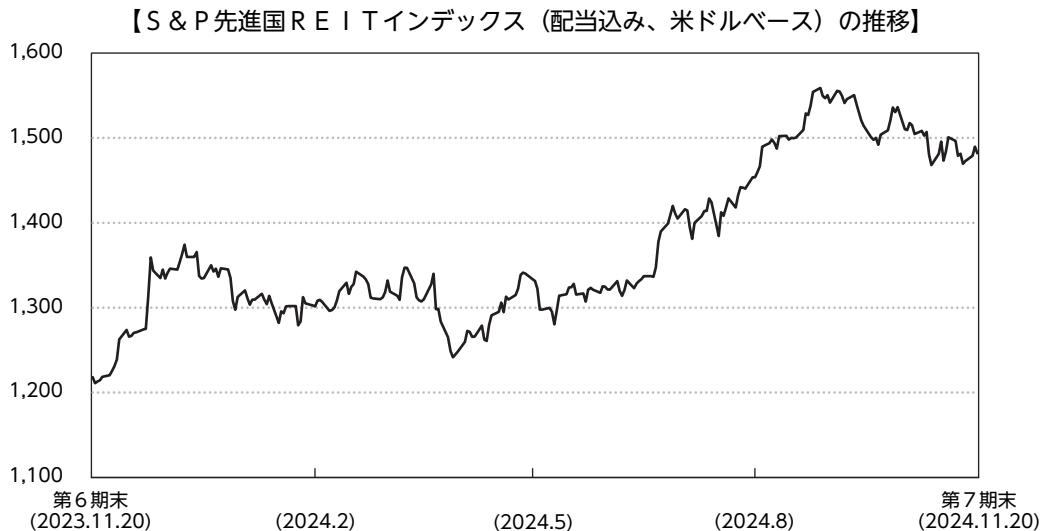
東京都千代田区丸の内1-6-6

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

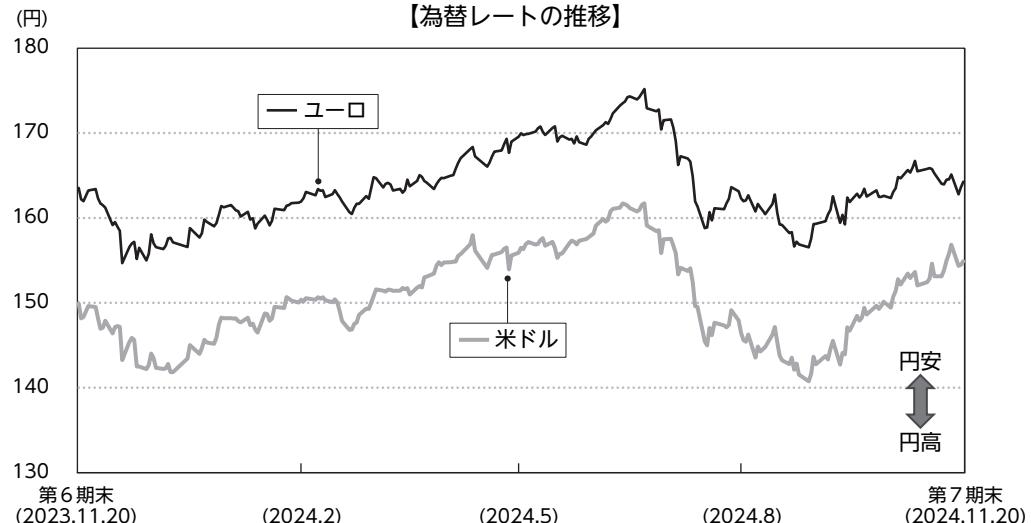


(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

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により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・バンコープ (N Y C B) 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 (C P I) が市場予想以上に減速したことなどからF R B 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たことから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つ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ることになりました。

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（P M I）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（G D P）が市場予想を上回るなど欧州域内の経済指標が堅調であったことなどから再びユーロ高円安推移となり、結局、期を通じて見ると期初と同程度の水準で当期末を迎えることになりました。

基準価額等の推移



■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(FRB)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FRB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い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。

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	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) 謄落率は期首比です。

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

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	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
(株式)	(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
(投資信託証券)	(2)	(0.014)	
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)	<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	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 4	千米ドル 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 INV & 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
外國	EQUITY RESIDENTIAL	7	530	1
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	391	0.140
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	177	0.170
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	3	157	0.273
	GETTY REALTY CORP	1	32	—
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1	20	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	15	303	2
	(8)			
	WELLTOWER INC	16	1,715	1
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	—	—	0.962
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	2	66	0.385
	SERVICE PROPERTIES TRUST	3	18	—
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	16	304	1
	EQUITY COMMONWEALTH	2	49	—
	CENTERSPACE	0.349	22	—
	SAFEHOLD INC	1	33	—
	KILROY REALTY CORP	2	88	—
	KIMCO REALTY CORP	15	312	1
	(2)			
	LXP INDUSTRIAL TRUST	7	65	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 INC	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 INVESTMENT	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 INC	1	13	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	1	20	—	0.002
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	(△ 13)	249	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	0.686	29	—	0.003
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	(△ 7)	37	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIES	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 INC	5	90	0.668	12
PARAMOUNT GROUP INC	5	28	—	—
URBAN EDGE PROPERTIES	2	46	—	—
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	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	—	—

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 PROPERTY	0.111	0.401	—	—
BRT APARTMENTS CORP	0.625	10	—	—
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTY	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 INC	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
PEAKSTONE REALTY TRUST	(0.107)	(0.661)	—	—
UNITI GROUP INC	5	25	—	—
NET LEASE OFFICE PROPERTY-W/I	0.058	1	—	0.023
	(0.006)	(0.166)	—	—

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

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	—	—
HOMEKO 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)		

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	11	16
		(△ 2)		
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	11	7	—	—
		(△0.344)		
OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	181	58	—	—
PARAGON REIT	37	32	98	85
		(△ 1)		
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
HAMMERTON 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・シュケル		千イスラエル・シュケル
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)		

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)			
外 国	(ユーロ／ドイツ)			
	HAMBORNER REIT AG	0.811	5	—
		(△ 1)		
(ユーロ／スペイン)				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI	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。

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

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	4	—	—	—	—	
	銘柄数<比率>	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	
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千米ドル	千円
(アメリカ)				
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 IN	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	
	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
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	
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)			千円	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	1,278	1,582	83,417	12,922,249
銘柄数<比率>	142	137	—	<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		
	口数	口数	評価額		千円
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル		千円
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 —	201,676 <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	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	評価額		千円
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)			千円	千円	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	
HOMEKO 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	1,687	2,395	11,567	1,171,740	
	銘柄数・金額				
	銘柄数<比率>	31	29	—	<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	554	753	7,091	141,121	
	銘柄数・金額				
	銘柄数<比率>	6	5	—	<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	
OUE 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		
	口数	口数	評価額		千円
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)			千円	千円	千円
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	67	138	76	8,918	
EC WORLD REIT	17	17	0.002	0.206	
小計	2,184	3,359	3,969	459,851	
	銘柄数・金額	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	225	74	159	14,643	
	銘柄数・金額	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		
	口数	口数	評価額		千円
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)			千円	千円	千円
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMI	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	
HAMMERSOM PLC	—	31	90	17,731	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,408 38	1,654 34	3,412 —	670,888 <3.9%>
(イスラエル)			千イスラエル・シュケル		
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	口数・金額 銘柄数<比率>	51 3	89 3	489 —	20,254 <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	口数・金額 銘柄数<比率>	21 1	41 1	34 —	5,737 <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	口数・金額 銘柄数<比率>	5 4	6 3	119 —	19,570 <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	口数・金額 銘柄数<比率>	17 8	27 8	921 —	151,445 <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		
	口数	口数	評価額		千円
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ／フランス)			千口	千口	千円
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	口数・金額 銘柄数<比率>	28 8	42 8	1,710 －	281,001 <1.6%>
(ユーロ／ドイツ)			千口	千口	千円
HAMBORNER REIT AG	4	5	32	5,277	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	4 1	5 1	32 －	5,277 <0.0%>
(ユーロ／スペイン)			千口	千口	千円
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI	3	3	32	5,345	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	16	27	274	45,089	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	13	23	127	21,007	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	33 3	54 3	434 －	71,443 <0.4%>
(ユーロ／イタリア)			千口	千口	千円
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1	1	2	422	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1 1	2 1	422 －	422 <0.0%>
ユーロ計	口数・金額 銘柄数<比率>	111 26	179 25	3,256 －	534,898 <3.1%>
合計	口数・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) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、口数および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
外 国	百万円	百万円
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販売相場の仲値により邦貨換算したものであります。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・シユケル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
未払資金	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ベビーファンド別内訳は、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/債券)
 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)配当受取益	489,138,252円
受取利息	474,888,886
その他収益	2,557,108
支払利息	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
売買損	△ 332,985,094
(C)先物取引等損益	74,748,956
取引益	171,559,684
取引損	△ 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。

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 MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同インデックスの内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

・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 MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同インデックスの内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

・東証R E I T指標（配当込み）

東証R E I T指標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R E I T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R E I Tインデックス（除く日本）はS&P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）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S P D J Iに、特定目的での利用を許諾するサプ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、S P D J I、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。