

## 第6期末（2024年11月20日）

基準価額	17,373円
純資産総額	30億円
騰落率	18.0%
分配金	0円

### 商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# DCニッセイ 新興国株式インデックス

追加型投信／海外／株式／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6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「DCニッセイ新興国株式インデックス」は、このたび第6期の決算を行いました。

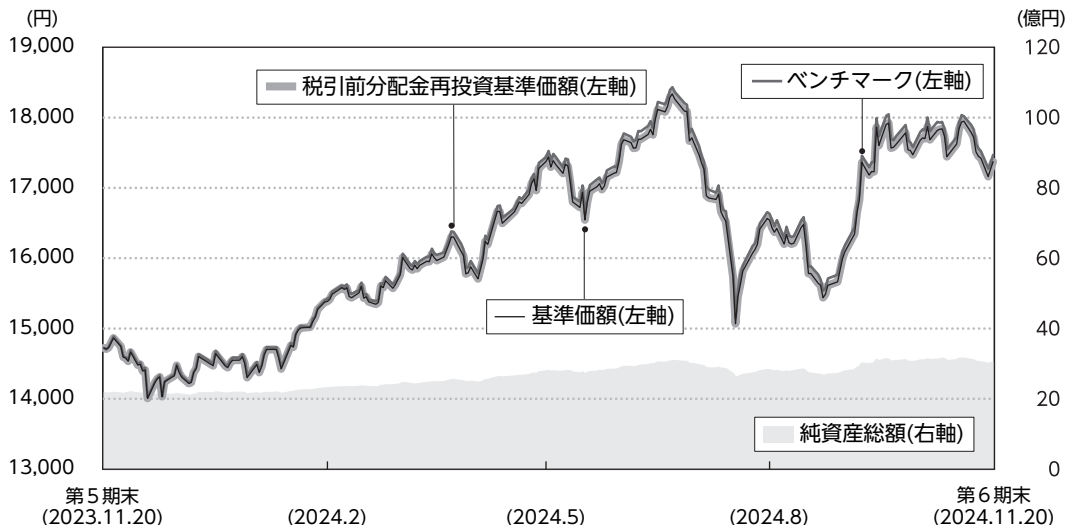
当ファンドは、「ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に新興国の株式等に投資することにより、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

## 運用経過

2023年11月21日～2024年11月20日

## 基準価額等の推移



第6期首	14,724円	既払分配金	0円
第6期末	17,373円	騰落率(分配金再投資ベース)	18.0%

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

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

(注3) ベンチマークは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)で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

## ■基準価額の主な変動要因

## &lt;上昇要因&gt;

- ・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(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が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・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

1万口当たりの費用明細

項目	第6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	45円	0.275%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は16,207円です。</p>
(投信会社)	(21)	(0.126)	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)	(21)	(0.126)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(4)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	4	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)	(2)	(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	24	0.148	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)	(20)	(0.121)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.003)	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)	(4)	(0.025)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	76	0.466	

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

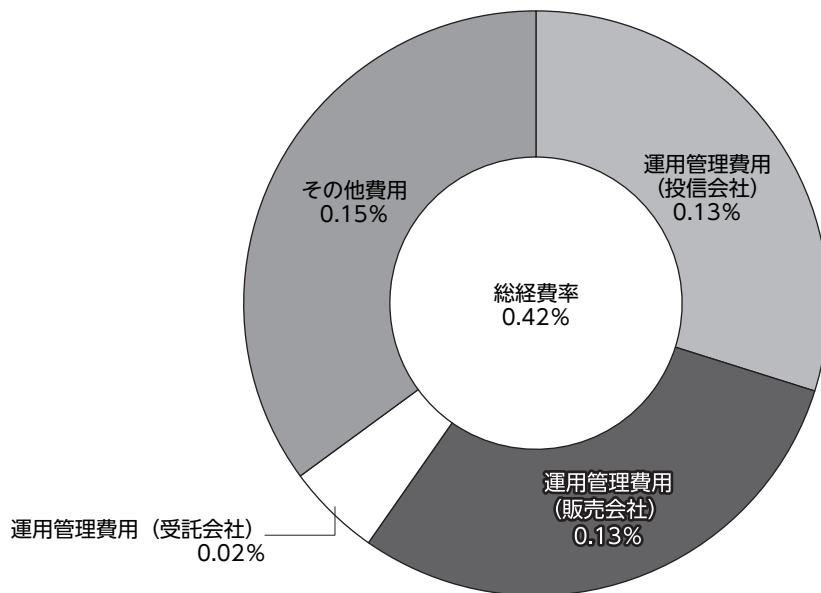
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## (参考情報)

## ■ 総経費率

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

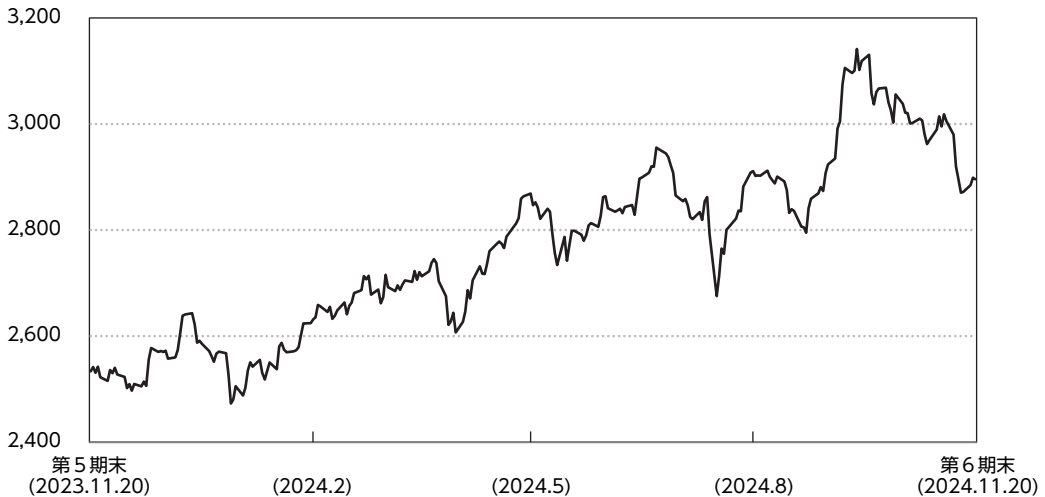
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(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。

## 海外株式市況

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



(注) FactSetのデータを使用しています。

新興国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

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

## ポートフォリオ

### ■当ファンド

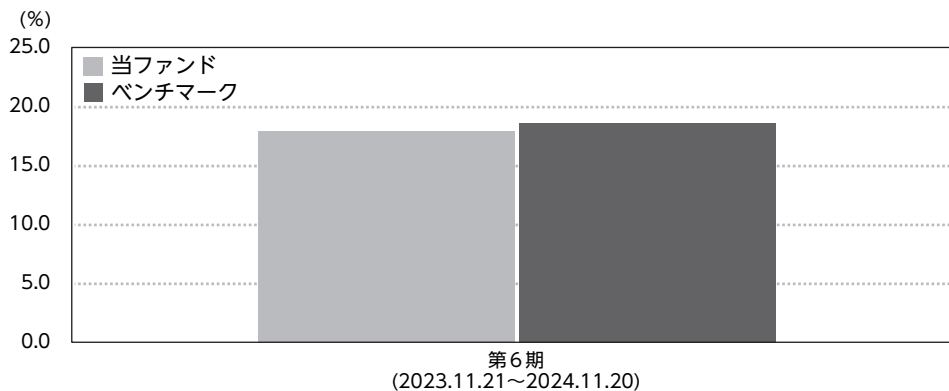
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

### ■マザーファンド

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

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

## ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+18.0%となり、ベンチマーク騰落率（+18.6%）を下回りました。

これはマザーファンドにおける証券保管費用および売買費用等、さらに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によるものです。

(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	7,373円

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

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

## 今後の運用方針

### ■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に新興国の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。

### ■マザーファンド

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

# ファンドデータ

## 当ファンドの組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第6期末 2024年11月20日
ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	100.0%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

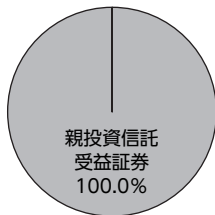
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

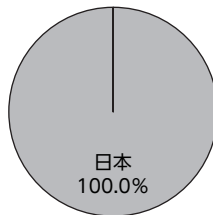
項目	第6期末 2024年11月20日
純資産総額	3,027,565,208円
受益権総口数	1,742,649,103口
1万口当たり基準価額	17,373円

(注) 当期間中における追加設定元本額は828,489,639円、同解約元本額は550,559,017円です。

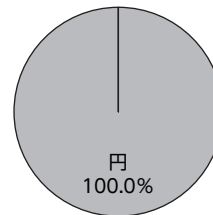
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分

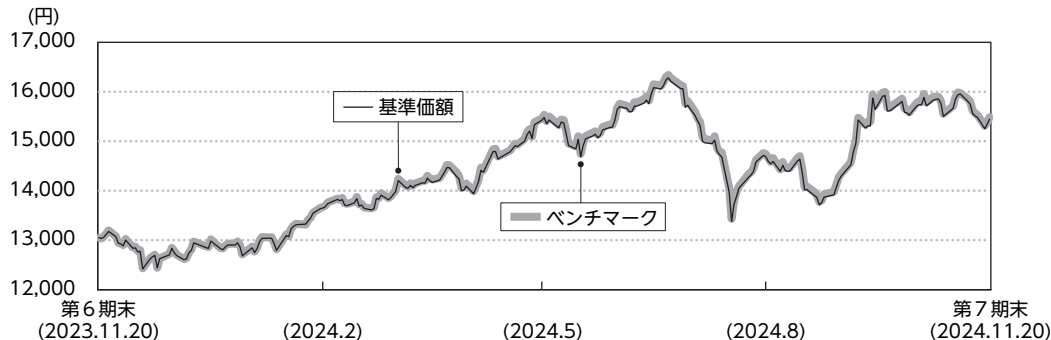


(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。



ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

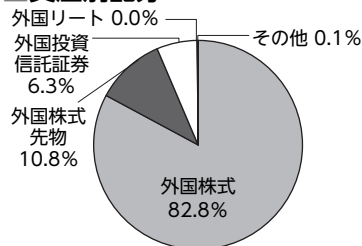
銘柄名	通貨	比率
MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202412 買	米ドル	10.8%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾ドル	9.1
TENCENT HOLDINGS LTD	香港ドル	4.0
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	米ドル	3.6
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国ウォン	2.2
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	香港ドル	1.9
MEITUAN-B	香港ドル	1.3
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	米ドル	1.2
RELIANCE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

■ 1万口当たりの費用明細

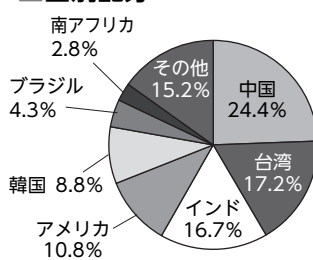
2023.11.21~2024.11.20

項目	金額
売買委託手数料	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

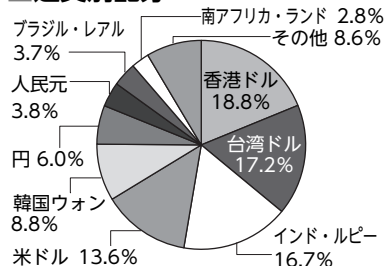
■ 資産別配分



■ 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。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2020年11月20日)	11,847	0	10.8	11,847	11,974	11.1	92.3	3.5	-	4.0	129
3期(2021年11月22日)	13,900	0	17.3	13,900	14,169	18.3	86.1	8.1	0.0	5.6	1,041
4期(2022年11月21日)	12,990	0	△ 6.5	12,990	13,324	△ 6.0	81.4	11.1	-	7.2	1,447
5期(2023年11月20日)	14,724	0	13.3	14,724	15,149	13.7	79.6	13.7	-	6.6	2,156
6期(2024年11月20日)	17,373	0	18.0	17,373	17,973	18.6	82.8	10.8	-	6.3	3,027

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチ マーク	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	14,724	-	15,149	-	79.6	13.7	-	6.6	
11月末	14,535	△ 1.3	14,973	△ 1.2	78.9	14.6	-	6.4	
12月末	14,601	△ 0.8	15,057	△ 0.6	85.5	7.5	-	7.0	
2024年1月末	14,581	△ 1.0	15,032	△ 0.8	82.9	9.9	-	7.1	
2月末	15,453	5.0	15,953	5.3	81.1	11.9	-	6.9	
3月末	15,897	8.0	16,420	8.4	86.7	6.1	-	7.1	
4月末	16,667	13.2	17,224	13.7	84.3	8.8	-	6.7	
5月末	16,798	14.1	17,360	14.6	80.6	13.2	-	6.0	
6月末	17,690	20.1	18,320	20.9	84.4	9.5	-	6.0	
7月末	16,662	13.2	17,260	13.9	81.3	12.4	-	6.1	
8月末	16,213	10.1	16,784	10.8	79.2	14.9	-	5.8	
9月末	17,180	16.7	17,793	17.5	86.6	6.9	-	6.3	
10月末	17,732	20.4	18,352	21.1	84.4	9.3	-	6.3	
(期末)2024年11月20日	17,373	18.0	17,973	18.6	82.8	10.8	-	6.3	

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2023年11月21日～2024年11月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	933,427	1,350,828	625,342	892,451

(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
	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	4,053,634千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,094,196千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.40

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

## 利害関係人との取引状況等

2023年11月21日～2024年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

## 親投資信託残高

2024年11月20日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	1,652,534	1,960,619	3,027,587

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド全体の口数は9,869,975千口です。

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	%
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	3,027,587	98.8
コール・ローン等、その他	35,658	1.2
投資信託財産総額	3,063,246	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) 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。

(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
<b>(A) 資産</b>	<b>3,063,246,194円</b>
コール・ローン等	3,835,774
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	3,027,587,952
未収入金	31,822,468
<b>(B) 負債</b>	<b>35,680,986</b>
未払解約金	31,661,924
未払信託報酬	4,003,140
その他未払費用	15,922
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>3,027,565,208</b>
元本	1,742,649,103
次期繰越損益金	1,284,916,105
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>1,742,649,103口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	17,373円

(注) 期首元本額 1,464,718,481円  
 期中追加設定元本額 828,489,639円  
 期中一部解約元本額 550,559,017円

損益の状況

当期(2023年11月21日~2024年11月20日)

項目	当期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>1,692円</b>
受取利息	1,699
支払利息	7
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>351,047,428</b>
売買益	415,047,049
売買損	△ 63,999,621
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 7,235,853</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>343,813,267</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>128,262,548</b>
(分配準備積立金)	(128,262,801)
(繰越欠損金)	(△ 253)
<b>(F) 追加信託差損益金*</b>	<b>812,840,290</b>
(配当等相当額)	(419,398,599)
(売買損益相当額)	(393,441,691)
<b>(G) 合計(D+E+F)</b>	<b>1,284,916,105</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>1,284,916,105</b>
追加信託差損益金	812,840,290
(配当等相当額)	(419,398,599)
(売買損益相当額)	(393,441,691)
分配準備積立金	472,075,815

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注4) (F)追加信託差損益金\*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

## 分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,692円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	343,811,322円
(c) 信託約款に定める収益調整金	812,840,290円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	128,262,801円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	1,284,916,105円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	7,373.35円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

# 当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に新興国の株式等に投資することにより、MSCIEマーキング・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	DCニッセイ新興国株式インデックス	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）
運用方法	DCニッセイ新興国株式インデックス	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。	

# ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 7 期

(計算期間：2023年11月21日～2024年11月20日)

#### 運用方針

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

#### 主要運用 対象

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）

#### 運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

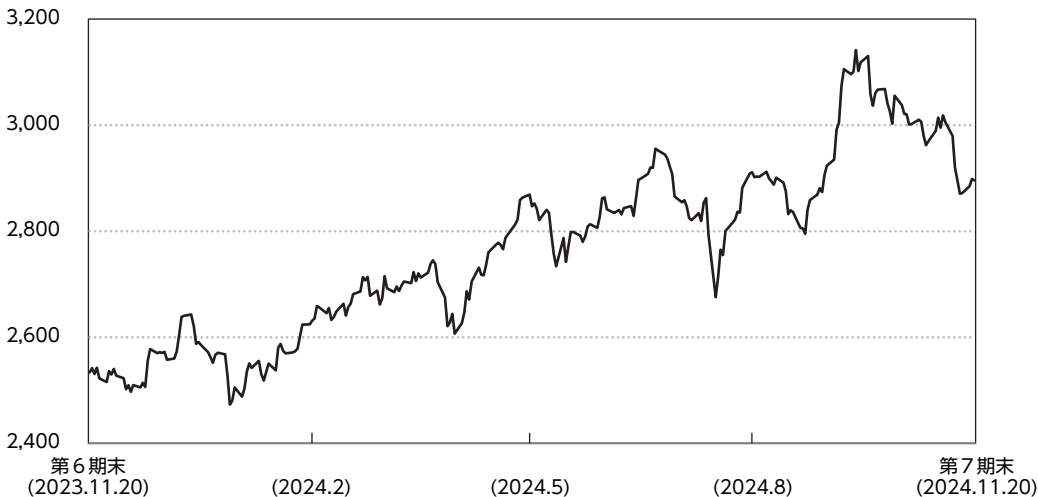
東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2023年11月21日～2024年11月20日

## 海外株式市況

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



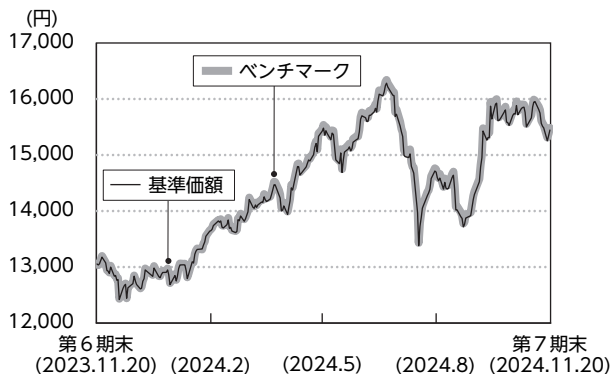
(注) FactSetのデータを使用しています。

新興国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

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



## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

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

#### <下落要因>

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

## ポートフォリオ

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

## ベンチマークとの差異

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

## 今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率					
	円	%		%	%	%	%	%	百万円
3期(2020年11月20日)	10,400	11.2	11,393	11.1	92.3	3.5	-	4.0	2,353
4期(2021年11月22日)	12,243	17.7	13,481	18.3	86.1	8.1	0.0	5.6	4,467
5期(2022年11月21日)	11,479	△ 6.2	12,677	△ 6.0	81.4	11.1	-	7.2	5,428
6期(2023年11月20日)	13,051	13.7	14,414	13.7	79.6	13.7	-	6.6	9,289
7期(2024年11月20日)	15,442	18.3	17,102	18.6	82.8	10.8	-	6.3	15,241

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2023年11月21日～2024年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料	3円	0.023%	
(株式)	(2)	(0.013)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(1)	(0.010)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	3	0.020	
(株式)	(3)	(0.020)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	21	0.145	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(17)	(0.120)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(4)	(0.025)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	27	0.188	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（14,386円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

## 売買および取引の状況

2023年11月21日～2024年11月20日

## (1) 株式

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

(注3) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

## ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

### (2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	26	386	—	—
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	12	219	—	—
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	28	1,171	—	—
ISHARES MSCI KUWAIT ETF	5	170	—	—
外国 (メキシコ)		千メキシコ・ペソ		千メキシコ・ペソ
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	22	513	—	—
PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	8	(△) 20 620	8	528
	(0.191)			
(南アフリカ)		千南アフリカ・ランド		千南アフリカ・ランド
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	—	—	19	207

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

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

### (3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
	7,354	6,961	—	—

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2023年11月21日～2024年11月20日

### 株式

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

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

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

## 組入有価証券明細表

2024年11月20日現在

## (1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AUTOHOME INC-ADR	5	5	14	2,254	メディア・娯楽
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5	22	27	4,313	素材
CREDICORP LTD	4	6	134	20,830	銀行
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4	—	—	—	半導体・半導体製造装置
H WORLD GROUP LIMITED(ADR)	14	22	82	12,851	消費者サービス
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	99	99	21	3,373	エネルギー
INTER & CO INC - CL A	—	33	18	2,862	銀行
IQIYI INC-ADR	32	32	6	1,036	メディア・娯楽
JOYY INC	3	—	—	—	メディア・娯楽
KANZHUN LTD	19	33	44	6,947	メディア・娯楽
KE HOLDINGS INC	52	68	142	22,047	不動産管理・開発
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	5	5	21	3,372	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LUFAX HOLDING LTD	59	—	—	—	金融サービス
LUKOIL PJSC-SPON ADR	18	18	0.000	0.027	エネルギー
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	7	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	29	29	0.000	0.044	電気通信サービス
NIO INC - ADR	113	—	—	—	自動車・自動車部品
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	4	4	0.000	0.006	エネルギー
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	7	7	0.000	0.010	素材
NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	—	340	457	70,893	銀行
OZON HOLDINGS PLC - ADR	3	3	0.000	0.004	一般消費財・サービス流通・小売り
PAGSEGURO DIGITAL LTD-CL A	—	24	18	2,810	金融サービス
PDD HOLDINGS INC(ADR)	47	79	934	144,762	一般消費財・サービス流通・小売り
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	5	5	0.000	0.007	素材
PJSC GAZPROM ADR	279	279	0.003	0.432	エネルギー
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	27	27	0.000	0.041	素材
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	—	19	0.000	0.029	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	4	4	0.000	0.006	素材
QIFU TECHNOLOGY INC(ADR)	5	18	58	9,024	金融サービス
ROSNEFT OJSC-GDR	54	54	0.001	0.083	エネルギー
SBERBANK OF RUSSIA	498	498	0.005	0.771	銀行
SEVERSTAL PAO - GDR REG S	13	13	0.000	0.020	素材
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	43	51	8	1,316	ソフトウェア・サービス
SOUTHERN COPPER CORP	7	11	117	18,279	素材

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	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%>
<b>(香港)</b>			千香港ドル		
3SBIO INC	155	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	35	100	300	5,970	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,170	3,390	1,325	26,377	銀行
AIR CHINA LIMITED-H	100	—	—	—	運輸
AKESO INC	40	80	512	10,204	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,312	1,739	14,824	295,017	一般消費財・サービス流通・小売り
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	520	520	198	3,942	生活必需品流通・小売り
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	240	240	119	2,378	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	115	230	493	9,817	素材
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	7	7	82	1,643	食品・飲料・タバコ
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	108	166	1,342	26,707	耐久消費財・アパレル
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	40	40	16	319	資本財
BAIDU INC-CLASS A	186	248	2,067	41,134	メディア・娯楽
BANK OF CHINA LTD - H	6,180	9,350	3,487	69,402	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	770	1,100	650	12,936	銀行
BEIGENE LTD	58	86	972	19,355	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40	—	—	—	運輸



ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	45	45	111	2,216	公益事業
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	160	160	35	700	公益事業
BILIBILI INC-CLASS Z	19	19	281	5,608	メディア・娯楽
BOC AVIATION LTD	19	19	115	2,308	資本財
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	160	580	255	5,078	耐久消費財・アパレル
BYD CO LTD	80	125	3,357	66,814	自動車・自動車部品
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	65	65	196	3,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	60	60	84	1,690	不動産管理・開発
CGN POWER CO LTD-H	650	1,370	383	7,633	公益事業
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	280	-	-	-	金融サービス
CHINA CITIC BANK	770	1,170	593	11,804	銀行
CHINA COAL ENERGY CO - H	200	200	191	3,812	エネルギー
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	80	80	32	651	資本財
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	85	-	-	-	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	7,690	11,180	6,730	133,934	銀行
CHINA COSCO HOLDINGS-H	301	301	358	7,127	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	120	120	33	663	銀行
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	150	-	-	-	商業・専門サービス
CHINA FEIHE LTD	320	320	183	3,642	食品・飲料・タバコ
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	115	515	385	7,665	金融サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	268	268	171	3,413	公益事業
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	140	380	449	8,953	素材
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132	132	185	3,698	金融サービス
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	560	-	-	-	不動産管理・開発
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	620	870	1,357	27,008	保険
CHINA LITERATURE LTD	36	36	92	1,844	メディア・娯楽
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	320	320	215	4,292	公益事業
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	80	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	20	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA MENGNIU DAIRY CO	280	380	642	12,794	食品・飲料・タバコ
CHINA MERCHANTS BANK - H	335	405	1,474	29,336	銀行
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	100	100	130	2,587	運輸
CHINA MINSHENG BANKING-H	559	559	176	3,515	銀行
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	420	420	140	2,791	素材
CHINA OILFIELD SERVICES-H	120	120	85	1,700	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	355	565	769	15,313	不動産管理・開発
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	50	-	-	-	不動産管理・開発

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	222	328	834	16,611	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,840	2,740	1,145	22,791	エネルギー
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	748	748	387	7,718	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA POWER INTERNATIONAL	330	330	102	2,042	公益事業
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	280	280	109	2,184	資本財
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	140	200	542	10,785	食品・飲料・タバコ
CHINA RESOURCES CEMENT	180	-	-	-	素材
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	82	82	230	4,577	公益事業
CHINA RESOURCES LAND LTD	260	445	1,063	21,164	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	44	100	301	5,989	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	180	180	97	1,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	160	260	474	9,447	公益事業
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	520	520	106	2,121	メディア・娯楽
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	260	415	1,373	27,335	エネルギー
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	140	140	92	1,844	エネルギー
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	240	-	-	-	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	120	120	137	2,741	資本財
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	66	300	378	7,522	保険
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	6	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,020	4,020	410	8,159	電気通信サービス
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	60	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA VANKE CO LTD-H	138	138	90	1,809	不動産管理・開発
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	120	-	-	-	ソフトウェア・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	132	298	216	4,299	一般消費財・サービス流通・小売り
CITIC LTD	500	720	647	12,880	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	165	165	370	7,371	金融サービス
CMOC GROUP LIMITED-H	240	540	328	6,533	素材
COSCO PACIFIC LTD	60	-	-	-	運輸
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	210	-	-	-	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD H	340	790	381	7,593	資本財
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	180	-	-	-	自動車・自動車部品
DONGYUE GROUP	80	-	-	-	素材
EAST BUY HOLDING LIMITED	30	-	-	-	生活必需品流通・小売り
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	58	89	461	9,192	公益事業
FAR EAST HORIZON LTD	70	70	37	749	金融サービス
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	30	-	-	-	半導体・半導体製造装置
FOSUN INTERNATIONAL	170	170	73	1,464	資本財

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	32	80	430	8,557	自動車・自動車部品
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	22	—	—	—	素材
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,700	1,700	243	4,837	半導体・半導体製造装置
GDS HOLDINGS LTD-CL A	57	—	—	—	ソフトウェア・サービス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	570	810	1,101	21,921	自動車・自動車部品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	100	100	106	2,121	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GF SECURITIES CO LTD-H	48	—	—	—	金融サービス
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	—	40	198	3,952	家庭用品・パーソナル用品
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	150	150	204	4,071	自動車・自動車部品
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	115	—	—	—	不動産管理・開発
GUANGDONG INVESTMENT LTD	300	300	144	2,883	公益事業
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	196	196	65	1,294	自動車・自動車部品
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	160	160	250	4,979	消費者サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	180	254	689	13,723	耐久消費財・アパレル
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	50	50	101	2,019	資本財
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	100	100	69	1,385	金融サービス
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	80	200	343	6,829	医薬・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・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	
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港ドル	千円	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	180	180	44	884	一般消費財・サービス流通・小売り
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	100	100	102	2,045	消費者サービス
TRIP.COM GROUP LTD	45	66	3,339	66,458	消費者サービス
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	40	80	395	7,872	食品・飲料・タバコ
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	30	-	-	-	食品・飲料・タバコ
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	280	280	133	2,652	食品・飲料・タバコ
WEICHAI POWER CO LTD-H	120	240	277	5,530	資本財
WUXI 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%>
<b>(台湾)</b>			千台湾ドル		
ACCTON TECHNOLOGY CORP	40	50	3,030	14,484	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC	210	210	798	3,814	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADVANTECH CO LTD	34	54	1,792	8,569	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10	20	1,692	8,088	資本財
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	-	10	2,355	11,257	半導体・半導体製造装置
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	240	360	5,562	26,587	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	160	160	704	3,365	素材

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
<b>(台湾)</b>		百株	百株	千台湾ドル	千円	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI		80	80	725	3,468	半導体・半導体製造装置
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY		10	10	1,905	9,106	資本財
WALSIN LIHWA CORP		240	240	693	3,315	資本財
WAN HAI LINES LIMITED		37	37	354	1,692	運輸
WINBOND ELECTRONICS CORP		170	590	1,062	5,076	半導体・半導体製造装置
WISTRON CORP		220	290	3,306	15,803	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WIWYNN CORP		10	10	2,085	9,966	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD		117	237	1,791	8,563	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YAGEO CORPORATION		23	60	3,234	15,462	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YANG MING MARINE TRANSPORT		90	200	1,494	7,141	運輸
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO		685	1,356	4,590	21,941	金融サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		40	110	1,292	6,178	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	26,807 90	38,482 87	547,472 -	2,617,025 <17.2%>	
<b>(イギリス)</b>				千イギリス・ポンド		
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC		19	-	-	-	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	19 1	- -	- -	- <->	
<b>(トルコ)</b>				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
<b>(トルコ)</b>				千トルコ・リラ	千円		
YAPI VE KREDI BANKASI		百株 392	百株 392	1,046	4,702	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,903 17	3,322 17	18,222 -	81,903 <0.5%>		
<b>(メキシコ)</b>				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%>		
<b>(フィリピン)</b>				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
<b>(フィリピン)</b>		百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
JG SUMMIT HOLDINGS INC		185	185	414	1,092	資本財
JOLLIBEE FOODS CORP		13	73	1,957	5,155	消費者サービス
MANILA ELECTRIC COMPANY		13	13	656	1,728	公益事業
METROPOLITAN BANK & TRUST		151	151	1,116	2,940	銀行
PLDT INC		5	5	779	2,054	電気通信サービス
SM INVESTMENTS CORP		17	31	2,862	7,540	資本財
SM PRIME HOLDINGS INC		1,057	1,057	3,023	7,962	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP		72	72	642	1,691	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,610	2,793	27,521	72,490	
		14	13	-	<0.5%>	
<b>(チリ)</b>				千チリ・ペソ		
BANCO DE CHILE		3,474	5,549	62,219	9,914	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION		6	6	19,465	3,101	銀行
BANCO SANTANDER CHILE		6,273	6,273	29,534	4,706	銀行
CENCOSUD SA		92	92	17,772	2,831	生活必需品流通・小売り
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		2	-	-	-	食品・飲料・タバコ
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES		928	-	-	-	運輸
EMPRESAS CMPC SA		101	101	15,378	2,450	素材
EMPRESAS COPEC SA		30	30	18,416	2,934	一般消費財・サービス流通・小売り
ENEL CHILE SA		904	904	4,976	793	公益事業
ENERSIS SA		2,052	2,052	18,001	2,868	公益事業
FALABELLA SA		75	75	25,392	4,046	一般消費財・サービス流通・小売り
LATAM AIRLINES GROUP SA		-	19,147	26,059	4,152	運輸
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		10	15	59,559	9,490	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,953	34,249	296,776	47,290	
		12	11	-	<0.3%>	
<b>(コロンビア)</b>				千コロンビア・ペソ		
BANCOLOMBIA SA		25	25	98,918	3,487	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		45	45	164,348	5,794	銀行
INTERCONEXION ELECTRICA SA		14	66	113,211	3,991	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	85	137	376,477	13,274	
		3	3	-	<0.1%>	
<b>(インド)</b>				千インド・ルピー		
ABB INDIA LTD		5	5	3,464	6,375	資本財
ADANI ENTERPRISES LTD		15	15	4,407	8,109	資本財
ADANI GREEN ENERGY LTD		27	27	3,913	7,200	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON		38	53	6,844	12,593	運輸

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
ADANI POWER LTD	51	91	4,786	8,806	公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD	50	50	2,793	5,140	素材
APL APOLLO TUBES LTD	—	19	2,825	5,198	素材
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	8	11	7,970	14,666	ヘルスケア機器・サービス
ASHOK LEYLAND LTD	114	196	4,355	8,013	資本財
ASIAN PAINTS LTD	30	45	11,226	20,656	素材
ASTRAL LTD	10	10	1,768	3,254	資本財
AU SMALL FINANCE BANK LTD	11	47	2,819	5,187	銀行
AUROBINDO PHARMA LTD	20	20	2,621	4,823	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVENUE SUPERMARTS LTD	13	18	6,893	12,683	生活必需品流通・小売り
AXIS BANK LTD	186	263	29,907	55,030	銀行
BAJAJ AUTO LTD	5	8	7,741	14,244	自動車・自動車部品
BAJAJ FINANCE LTD	22	32	21,658	39,852	金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD	32	48	7,711	14,190	金融サービス
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	2	2	2,269	4,175	金融サービス
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	3	10	2,802	5,157	自動車・自動車部品
BANDHAN BANK LTD	35	—	—	—	銀行
BANK OF BARODA	94	94	2,252	4,144	銀行
BERGER PAINTS INDIA LTD	23	—	—	—	素材
BHARAT ELECTRONICS LTD	240	409	11,425	21,022	資本財
BHARAT FORGE LTD	17	31	4,176	7,684	自動車・自動車部品
BHARAT HEAVY ELECTROCALCALS	—	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	千インドルピー	千円	
JSW STEEL LTD	52	77	7,347	13,518	素材
JUBILANT FOODWORKS LTD	20	20	1,265	2,329	消費者サービス
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	88	120	20,772	38,221	銀行
LARSEN & TOUBRO LTD	53	72	25,438	46,807	資本財
LTIMINDTREE LIMITED	6	9	5,550	10,212	ソフトウェア・サービス
LUPIN LTD	9	24	4,936	9,083	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MACROTECH DEVELOPERS LTD	-	27	3,433	6,318	不動産管理・開発
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	76	107	31,701	58,330	自動車・自動車部品
MANKIND PHARMA LTD	-	13	3,570	6,570	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARICO LTD	46	46	2,727	5,018	食品・飲料・タバコ
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11	14	16,384	30,146	自動車・自動車部品
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	65	94	9,467	17,419	ヘルスケア機器・サービス
MPHASIS LTD	4	13	3,670	6,754	ソフトウェア・サービス
MRF LTD	0.07	0.24	2,950	5,429	自動車・自動車部品
MUTHOOT FINANCE LTD	4	17	3,288	6,050	金融サービス
NESTLE INDIA LTD	2	34	7,552	13,896	食品・飲料・タバコ
NHPC LTD	-	385	3,081	5,670	公益事業
NMDC LTD	-	116	2,584	4,754	素材
NTPC LTD	382	522	19,160	35,254	公益事業
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	279	355	8,825	16,238	エネルギー
OIL INDIA LTD	-	62	3,056	5,624	エネルギー
ORACLE FINANCIAL SERVICES	-	2	3,093	5,692	ソフトウェア・サービス
PAGE INDUSTRIES LTD	0.55	0.55	2,453	4,514	耐久消費財・アパレル
PB FINTECH LTD	-	34	5,951	10,950	保険
PERSISTENT SYSTEMS LTD	-	11	6,372	11,725	ソフトウェア・サービス
PETRONET LNG LTD	66	66	2,101	3,866	エネルギー
PHOENIX MILLS LTD	-	25	3,721	6,846	不動産管理・開発
PI INDUSTRIES LTD	7	7	2,974	5,473	素材
PIDILITE INDUSTRIES LTD	15	15	4,568	8,406	素材
POLYCAB INDIA LTD	-	5	3,369	6,199	資本財
POWER FINANCE CORPORATION	95	157	7,412	13,639	金融サービス
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	394	555	17,504	32,208	公益事業
PRESTIGE ESTATES PROJECTS	-	18	2,863	5,268	不動産管理・開発
PUNJAB NATIONAL BANK	-	253	2,560	4,711	銀行
RAIL VIKAS NIGAM LTD	-	65	2,830	5,207	資本財
REC LTD	90	142	7,335	13,497	金融サービス
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	244	698	86,679	159,490	エネルギー

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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



## ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ブラジル)</b>		百株	百株	千ブラジル・リアル	千円	
SUZANO S.A.		56	76	460	12,348	素材
TELEFONICA BRASIL S.A.		31	31	161	4,334	電気通信サービス
TIM SA		35	105	171	4,607	電気通信サービス
TOTVS SA		44	44	133	3,592	ソフトウェア・サービス
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA		52	52	95	2,560	エネルギー
VALE SA		275	404	2,333	62,590	素材
VIBRA ENERGIA SA		78	123	268	7,192	一般消費財・サービス流通・小売り
WEG SA		124	197	1,067	28,633	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,030	8,437	20,852	559,340	
		47	47	—	<3.7%>	
<b>(チェコ)</b>				千チェコ・コルナ		
CEZ AS		13	21	2,075	13,481	公益事業
KOMERCNI BANKA AS		6	6	532	3,457	銀行
MONETA MONEY BANK AS		11	11	138	897	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	31	39	2,746	17,836	
		3	3	—	<0.1%>	
<b>(韓国)</b>				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	
<b>(韓国)</b>	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
HANA FINANCIAL GROUP	24	35	212,225	23,641	銀行
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD	5	5	20,284	2,259	自動車・自動車部品
HANMI PHARM CO LTD	0.59	0.60	17,010	1,894	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	3	3	29,653	3,303	半導体・半導体製造装置
HANON SYSTEMS	9	—	—	—	自動車・自動車部品
HANWHA AEROSPACE CO LTD	3	2	113,157	12,605	資本財
HANWHA SOLUTIONS CORP	9	9	16,794	1,870	素材
HD HYUNDAI	3	3	27,760	3,092	エネルギー
HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	—	2	99,395	11,072	資本財
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1	3	70,942	7,902	資本財
HD KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3	5	112,747	12,560	資本財
HLB INC	6	12	87,031	9,695	ヘルスケア機器・サービス
HMM CO LTD	22	22	40,377	4,498	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD	2	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
HYBE CO LTD	1	1	33,912	3,777	メディア・娯楽
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	4	4	13,390	1,491	資本財
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1	2	31,571	3,517	運輸
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2	—	—	—	資本財
HYUNDAI MOBIS	4	6	157,815	17,580	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	10	16	358,376	39,923	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2	4	68,737	7,657	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	1	1	26,724	2,977	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	5	5	11,352	1,264	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	22	51	73,875	8,229	銀行
JYP ENTERTAINMENT CORP	2	—	—	—	メディア・娯楽
KAKAO GAMES CORP	1	—	—	—	メディア・娯楽
KAKAOBANK CORP	16	16	35,237	3,925	銀行
KAKAOPAY CORP	2	—	—	—	金融サービス
KANGWON LAND INC	3	—	—	—	消費者サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	29	42	385,361	42,929	銀行
KIA CORPORATION	20	28	270,652	30,150	自動車・自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5	5	33,629	3,746	資本財
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21	21	50,726	5,650	公益事業
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4	4	35,305	3,933	金融サービス
KOREA ZINC CO LTD	0.53	1	121,242	13,506	素材
KOREAN AIR LINES CO LTD	11	11	29,530	3,289	運輸
KRAFTON INC	2	3	112,729	12,558	メディア・娯楽

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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



ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(タイ)</b>				千タイ・パーツ	千円	
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	70	127	2,495	11,205	素材
	THAI OIL PCL-FRGN	93	93	381	1,712	エネルギー
	TMB BANK PUBLIC CORP-FOREIGN	—	4,284	766	3,443	銀行
	TRUE CORP PCL/NEW-FOREIGN	607	607	717	3,221	電気通信サービス
小計	株数・金額	10,668	13,728	46,828	210,258	
	銘柄数<比率>	40	28	—	<1.4%>	
<b>(ポーランド)</b>				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%>	
<b>(ハンガリー)</b>				千ハンガリー・フォリント		
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	42	42	11,448	4,607	エネルギー
	OTP BANK RT	18	24	51,101	20,564	銀行
	RICHTER GEDEON NYRT	8	18	19,748	7,947	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	69	85	82,297	33,119	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.2%>	
<b>(ユーロ/ギリシャ)</b>				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	
<b>(ユーロ/ギリシャ)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	17	17	25	4,264	電気通信サービス
	JUMBO SA	11	11	27	4,461	一般消費財・サービス流通・小売り
	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5	—	—	—	エネルギー
	MYTILINEOS S.A.	7	14	44	7,332	資本財
	NATIONAL BANK OF GREECE	46	83	57	9,427	銀行
	OPAP SA	20	20	30	5,030	消費者サービス
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	55	129	45	7,539	銀行
	PUBLIC POWER CORP	14	14	16	2,675	公益事業
小計	株数・金額	479	846	345	56,823	
	銘柄数<比率>	11	10	—	<0.4%>	
合計	株数・金額	267,956	361,588	—	12,626,731	
	銘柄数<比率>	1,048	1,007	—	<82.8%>	

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

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

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

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

## ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

### (2) 外国（外貨建）投資信託証券

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

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

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

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
<b>外</b>	百万円	百万円
<b>国</b> MINI MSCI EM INDEX FUTURES	1,639	-

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。



## 投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	12,626,731	82.3
投資信託証券	963,101	6.3
コール・ローン等、その他	1,747,704	11.4
投資信託財産総額	15,337,537	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売相場場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル154.91円、1香港ドル19.90円、1台湾ドル4.78円、1イギリス・ポンド196.60円、1トルコ・リラ4.494円、1メキシコ・ペソ7.701円、1フィリピン・ペソ2.634円、100チリ・ペソ15.934円、100コロンビア・ペソ3.526円、1インド・ルピー1.84円、100インドネシア・ルピア0.98円、1ブラジル・レアル26.823円、1チェコ・コルナ6.494円、100韓国ウォン11.14円、1人民元21.415円、1マレーシア・リンギット34.667円、1南アフリカ・ランド8.58円、1タイ・バーツ4.49円、1ポーランド・ズロチ37.904円、100ハンガリー・フォリント40.243円、1ユーロ164.27円です。

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日現在)

項目		当期末
<b>(A)資産</b>	<b>産</b>	<b>16,228,568,030円</b>
コーポレート債券等		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>(B)負債</b>	<b>債</b>	<b>987,443,698</b>
未払金		924,119,857
未払解約金		63,323,841
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>		<b>15,241,124,332</b>
元本		9,869,975,752
次期繰越損益金		5,371,148,580
<b>(D)受益権総口数</b>		<b>9,869,975,752口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)		<b>15,442円</b>

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

- (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

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

MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同インデックスの内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。