

DCニッセイターゲットデートファンド 2025/2030/2035/2040/2045/ 2050/2055/2060/2065/2070

追加型投信／内外／資産複合

運用報告書(全体版)

作成対象期間：2023年12月21日～2024年12月20日

<2025/2035/2045>

第8期(決算日 2024年12月20日)

<2055>

第9期(決算日 2024年12月20日)

<2030/2040/2050/2060>

第6期(決算日 2024年12月20日)

<2065>

第3期(決算日 2024年12月20日)

作成対象期間：2024年4月30日～2024年12月20日

<2070>

第1期(決算日 2024年12月20日)

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

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ニッセイターゲットデートファンド 2025/2030/2035/2040/2045/2050/2055/2060/2065/2070」は、2024年12月20日に決算を行いました。

各ファンドは、複数のマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を含む各国の株式（リート（不動産投資信託）を含みます）、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<2025>

第 8 期末 (2024年12月20日)	
基準価額	10,790円
純資産総額	26億円
騰落率	△0.2%
分配金	0円

<2035>

第 8 期末 (2024年12月20日)	
基準価額	17,530円
純資産総額	109億円
騰落率	12.0%
分配金	0円

<2045>

第 8 期末 (2024年12月20日)	
基準価額	20,297円
純資産総額	61億円
騰落率	18.8%
分配金	0円

<2055>

第 9 期末 (2024年12月20日)	
基準価額	25,298円
純資産総額	50億円
騰落率	20.0%
分配金	0円

<2065>

第 3 期末 (2024年12月20日)	
基準価額	14,710円
純資産総額	20億円
騰落率	21.1%
分配金	0円

<2030>

第 6 期末 (2024年12月20日)	
基準価額	13,715円
純資産総額	61億円
騰落率	3.7%
分配金	0円

<2040>

第 6 期末 (2024年12月20日)	
基準価額	19,853円
純資産総額	56億円
騰落率	17.2%
分配金	0円

<2050>

第 6 期末 (2024年12月20日)	
基準価額	20,997円
純資産総額	29億円
騰落率	19.4%
分配金	0円

<2060>

第 6 期末 (2024年12月20日)	
基準価額	21,815円
純資産総額	41億円
騰落率	20.6%
分配金	0円

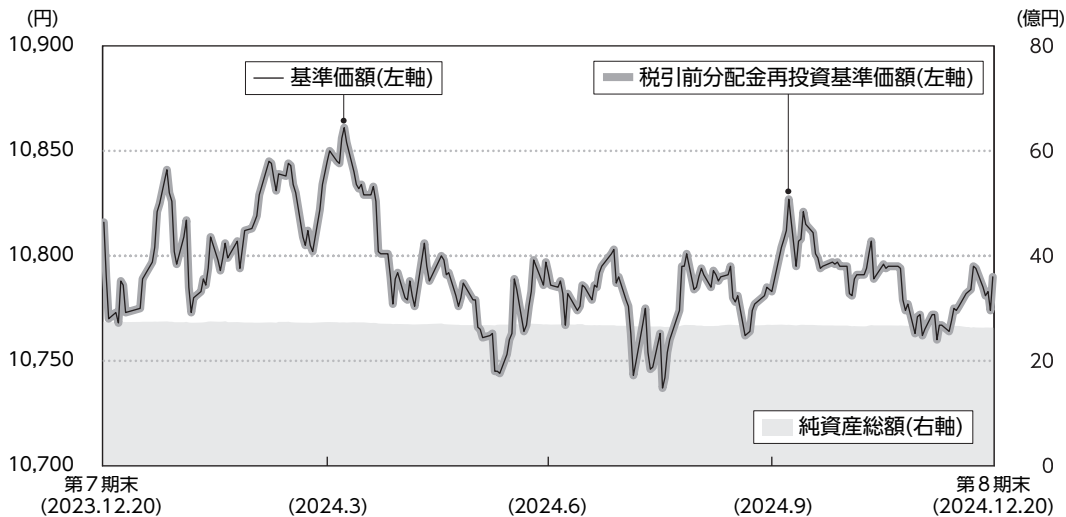
<2070>

第 1 期末 (2024年12月20日)	
基準価額	10,797円
純資産総額	47百万円
騰落率	8.0%
分配金	0円

運用経過

2023年12月21日～2024年12月20日

基準価額等の推移



第8期首	10,816円	既払分配金	0円
第8期末	10,790円	騰落率 (分配金再投資ベース)	△0.2%

(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) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2024年1月下旬から3月下旬にかけて、企業の堅調な業績などを受けて内外株式市場が上昇したことに加えて、主要通貨に対して円安が進行したこと

<下落要因>

- ・2024年4月から5月にかけて、日銀の金融政策早期正常化への警戒感などを背景に国内長期金利が大幅に上昇(債券価格は下落)したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	3.5%	17.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1.5	31.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	41.7	△ 3.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	3.3	8.7
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	49.8	0.1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

項目	第8期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	17円	0.154%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,792円です。
(投信会社)	(7)	(0.066)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(7)	(0.066)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(2)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.000	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.000	
(株式)	(0)	(0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	0	0.004	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)	(0)	(0.001)	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)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	17	0.158	

(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。

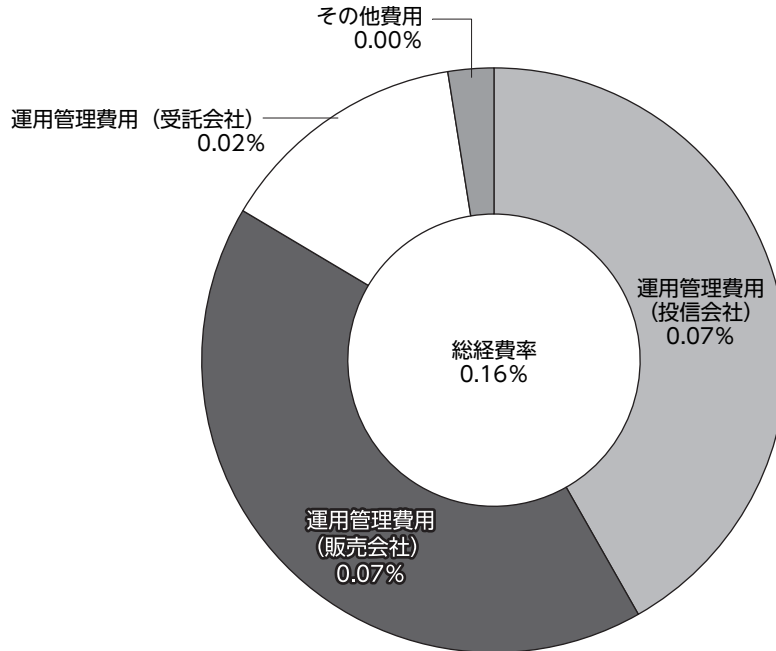
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.16%**です。



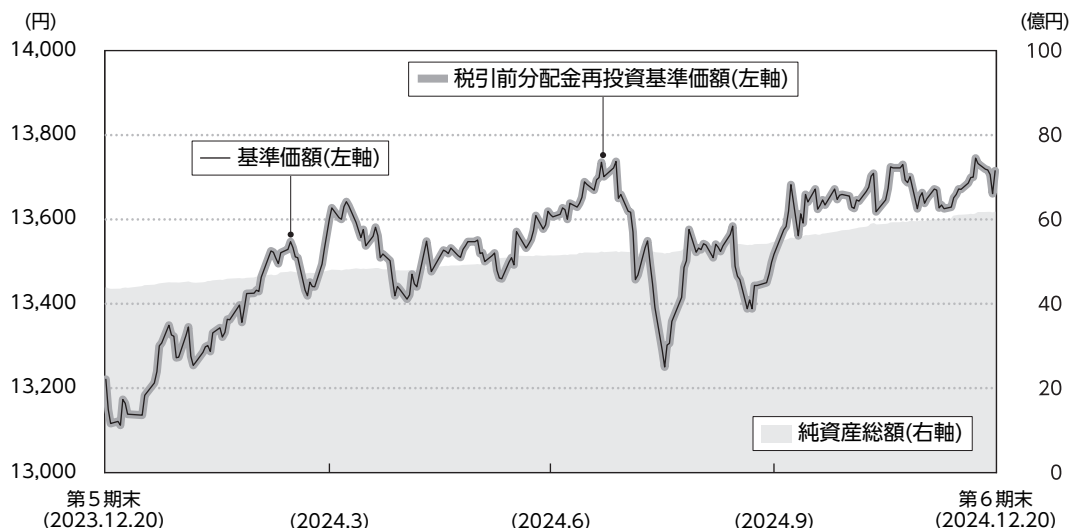
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

基準価額等の推移



第6期首	13,221円	既払分配金	0円
第6期末	13,715円	騰落率 (分配金再投資ベース)	3.7%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2024年1月から7月上旬にかけて、企業の堅調な業績などを受けて内外株式市場が上昇したことに加えて、主要通貨に対して円安が進行したこと
- ・9月中旬から当期末にかけて、米国の堅調な経済指標や米大統領選でのトランプ氏勝利などにより物価上昇に対する懸念がくすぶる中、米連邦準備制度理事会 (F R B) の利下げペースが緩やかになるとの観測が台頭したことを受けて主要通貨に対して円安が進行し、外貨建資産 (外国株式・外国債券) 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、米国の景気減速懸念や対中半導体輸出規制の強化懸念の高まり、日銀の追加利上げに積極的な姿勢などを背景に内外株式市場が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が急速に進行したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	11.0%	17.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	12.5	31.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	69.4	△ 3.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	7.1	8.7

(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6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	33円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は13,523円です。
(投信会社)	(15)	(0.110)	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)	(15)	(0.110)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.000	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.000	
(株式)	(0)	(0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.007	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.004)	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)	(0)	(0.000)	・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	34	0.249	

(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。

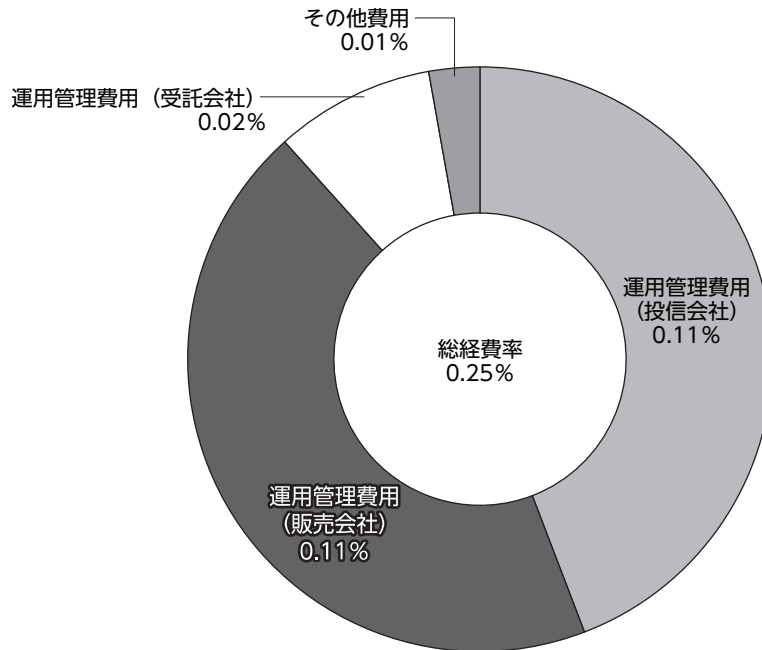
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.25%**です。



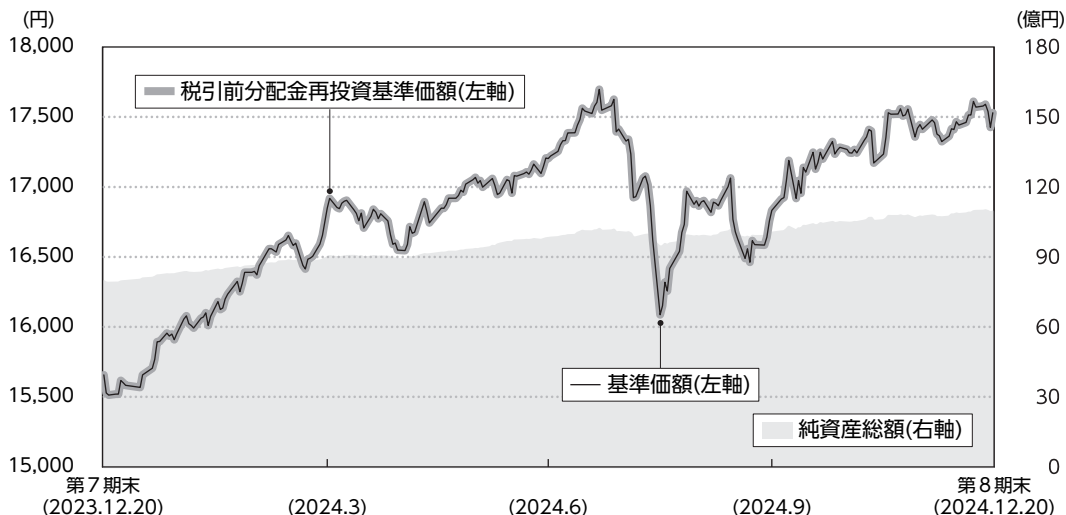
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

基準価額等の推移



第8期首	15,656円	既払分配金	0円
第8期末	17,530円	騰落率 (分配金再投資ベース)	12.0%

(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) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2024年1月から7月上旬にかけて、企業の堅調な業績などを受けて内外株式市場が上昇したことに加えて、主要通貨に対して円安が進行したこと
- ・9月中旬から当期末にかけて、米国の堅調な経済指標や米大統領選でのトランプ氏勝利などにより物価上昇に対する懸念がくすぶる中、FRBの利下げペースが緩やかになるとの観測が台頭したことを受けて主要通貨に対して円安が進行し、外貨建資産（外国株式・外国債券）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、米国の景気減速懸念や対中半導体輸出規制の強化懸念の高まり、日銀の追加利上げに積極的な姿勢などを背景に内外株式市場が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が急速に進行したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	21.0%	17.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	28.9	31.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	38.8	△ 3.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	11.4	8.7

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

項目	第8期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	41円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は16,857円です。
(投信会社)	(19)	(0.110)	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)	(19)	(0.110)	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	0	0.000	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	2	0.010	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.007)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ 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	43	0.253	

(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。

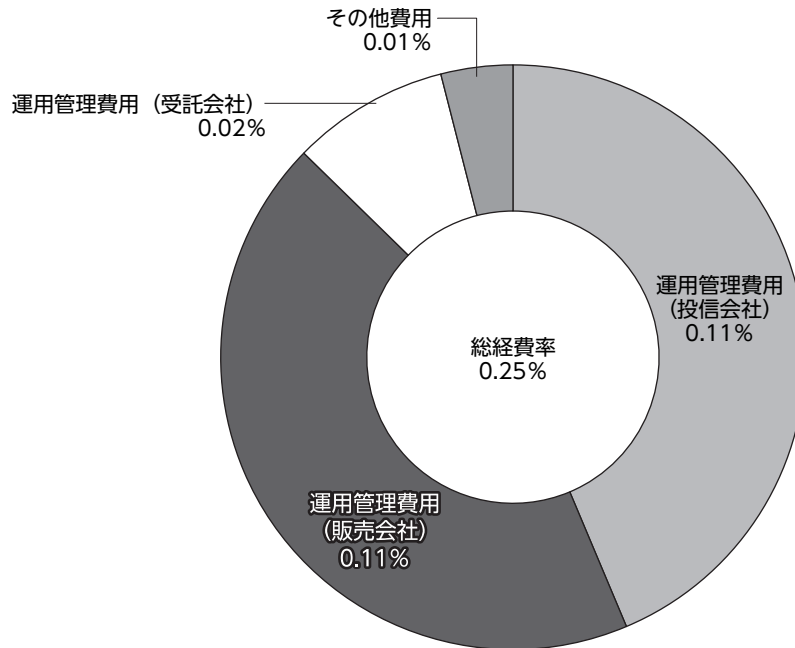
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.25%**です。



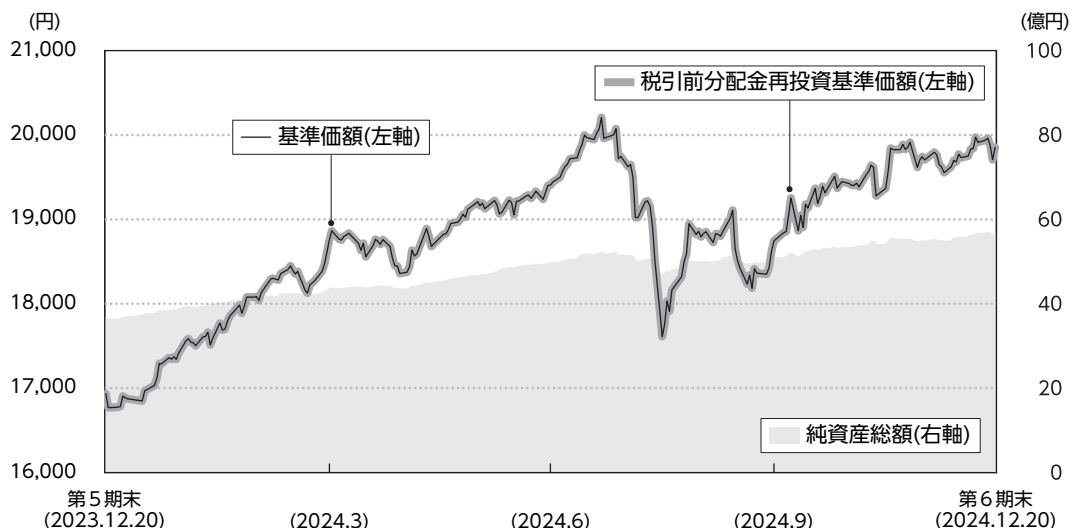
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

基準価額等の推移



第6期首	16,933円	既払分配金	0円
第6期末	19,853円	騰落率 (分配金再投資ベース)	17.2%

(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) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2024年1月から7月上旬にかけて、企業の堅調な業績などを受けて内外株式市場が上昇したことに加えて、主要通貨に対して円安が進行したこと
- ・9月中旬から当期末にかけて、米国の堅調な経済指標や米大統領選でのトランプ氏勝利などにより物価上昇に対する懸念がくすぶる中、FRBの利下げペースが緩やかになるとの観測が台頭したことを受けて主要通貨に対して円安が進行し、外貨建資産（外国株式・外国債券）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、米国の景気減速懸念や対中半導体輸出規制の強化懸念の高まり、日銀の追加利上げに積極的な姿勢などを背景に内外株式市場が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が急速に進行したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	27.4%	17.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	39.6	31.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	18.8	△ 3.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	14.2	8.7

(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6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	46円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は18,826円です。
(投信会社)	(21)	(0.110)	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)	(0.110)	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	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	2	0.012	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)	(2)	(0.009)	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)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	48	0.256	

(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。

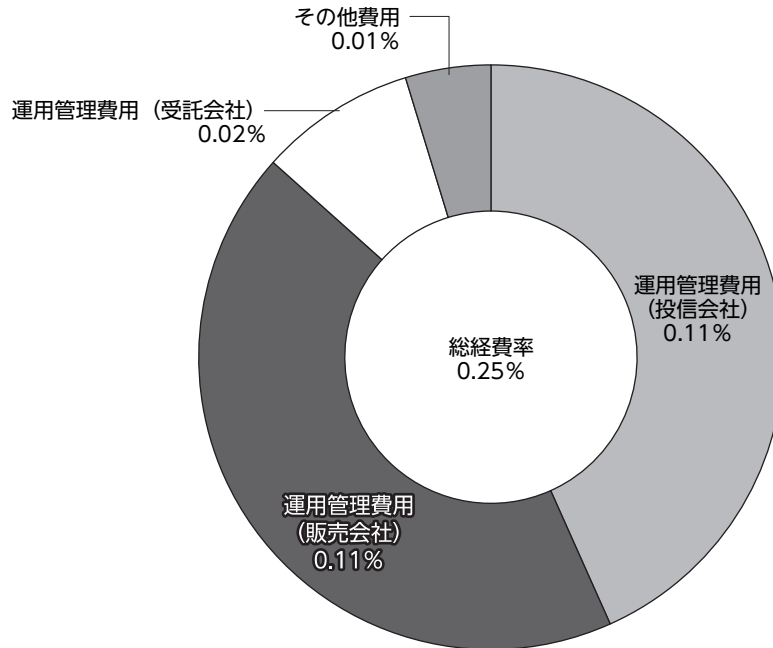
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.25%**です。



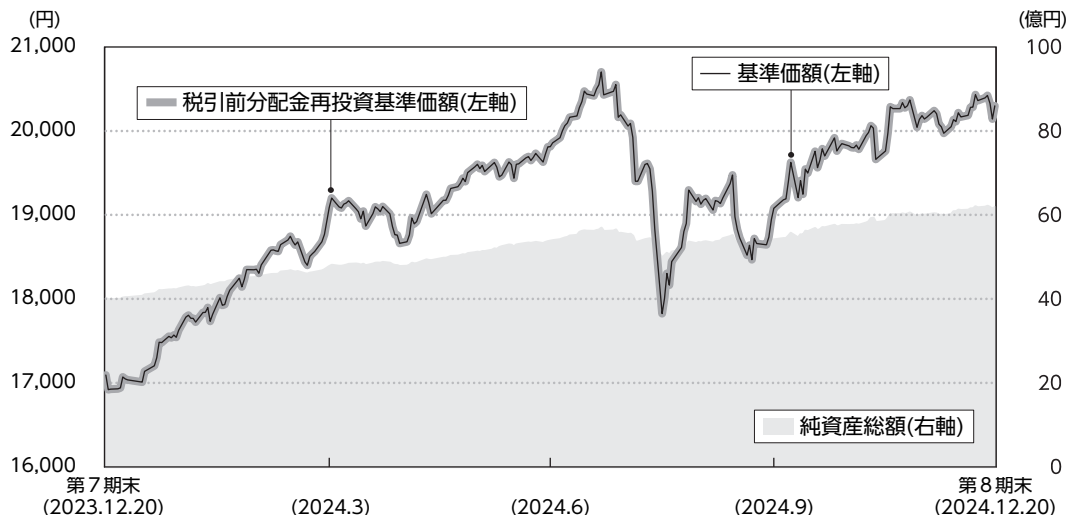
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

基準価額等の推移



第8期首	17,092円	既払分配金	0円
第8期末	20,297円	騰落率 (分配金再投資ベース)	18.8%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2024年1月から7月上旬にかけて、企業の堅調な業績などを受けて内外株式市場が上昇したことに加えて、主要通貨に対して円安が進行したこと
- ・9月中旬から当期末にかけて、米国の堅調な経済指標や米大統領選でのトランプ氏勝利などにより物価上昇に対する懸念がくすぶる中、F R Bの利下げペースが緩やかになるとの観測が台頭したことを受けて主要通貨に対して円安が進行し、外貨建資産(外国株式・外国債券)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、米国の景気減速懸念や対中半導体輸出規制の強化懸念の高まり、日銀の追加利上げに積極的な姿勢などを背景に内外株式市場が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が急速に進行したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	29.2%	17.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	42.5	31.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	13.3	△ 3.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	14.9	8.7

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

項目	第8期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	46円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は19,172円です。
(投信会社)	(21)	(0.110)	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)	(0.110)	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	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	2	0.013	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)	(2)	(0.010)	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)	(1)	(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)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	49	0.256	

(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。

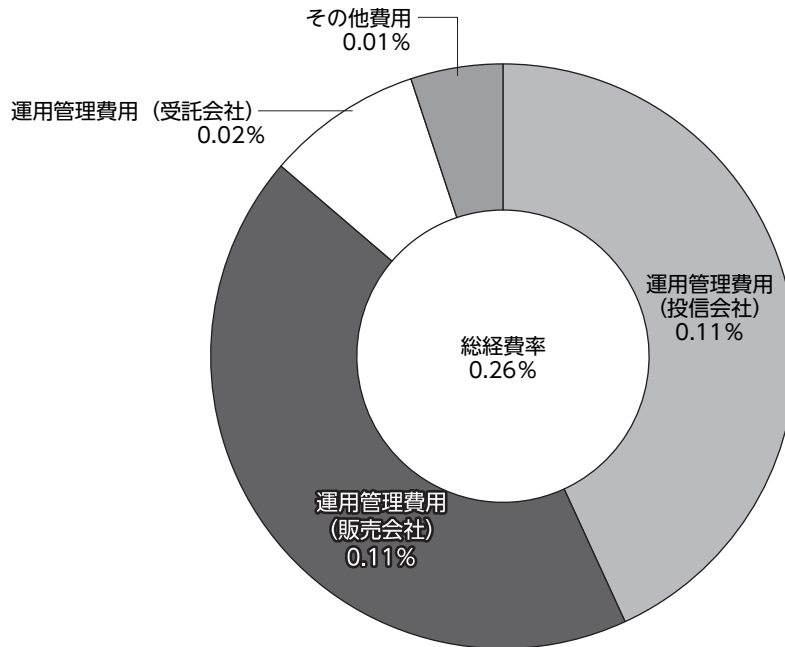
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.26%**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。

基準価額等の推移



第6期首	17,581円	既払分配金	0円
第6期末	20,997円	騰落率 (分配金再投資ベース)	19.4%

(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) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2024年1月から7月上旬にかけて、企業の堅調な業績などを受けて内外株式市場が上昇したことに加えて、主要通貨に対して円安が進行したこと
- ・9月中旬から当期末にかけて、米国の堅調な経済指標や米大統領選でのトランプ氏勝利などにより物価上昇に対する懸念がくすぶる中、F R Bの利下げペースが緩やかになるとの観測が台頭したことを受けて主要通貨に対して円安が進行し、外貨建資産(外国株式・外国債券)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、米国の景気減速懸念や対中半導体輸出規制の強化懸念の高まり、日銀の追加利上げに積極的な姿勢などを背景に内外株式市場が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が急速に進行したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	30.0%	17.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	43.8	31.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	10.8	△ 3.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15.4	8.7

(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6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	48円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は19,799円です。
(投信会社)	(22)	(0.110)	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)	(22)	(0.110)	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	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	3	0.013	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)	(2)	(0.010)	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)	(1)	(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)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	51	0.257	

(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。

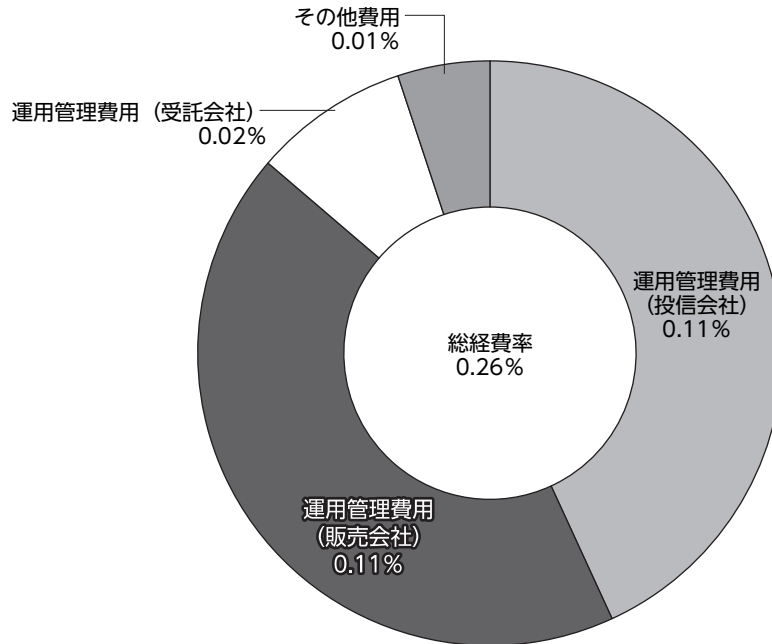
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.26%**です。



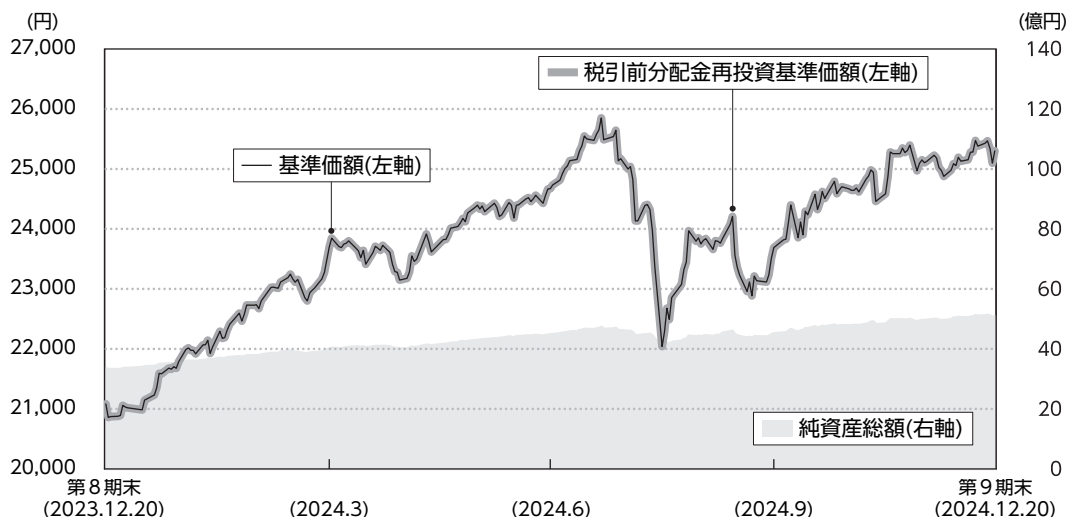
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

基準価額等の推移



第9期首	21,081円	既払分配金	0円
第9期末	25,298円	騰落率 (分配金再投資ベース)	20.0%

(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) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2024年1月から7月上旬にかけて、企業の堅調な業績などを受けて内外株式市場が上昇したことに加えて、主要通貨に対して円安が進行したこと
- ・9月中旬から当期末にかけて、米国の堅調な経済指標や米大統領選でのトランプ氏勝利などにより物価上昇に対する懸念がくすぶる中、F R Bの利下げペースが緩やかになるとの観測が台頭したことを受けて主要通貨に対して円安が進行し、外貨建資産（外国株式・外国債券）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、米国の景気減速懸念や対中半導体輸出規制の強化懸念の高まり、日銀の追加利上げに積極的な姿勢などを背景に内外株式市場が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が急速に進行したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	30.6%	17.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	45.0	31.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	8.7	△ 3.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15.7	8.7

(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9期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	58円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は23,819円です。
(投信会社)	(26)	(0.110)	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)	(26)	(0.110)	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)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	3	0.013	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.010)	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)	(1)	(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)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	61	0.257	

(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。

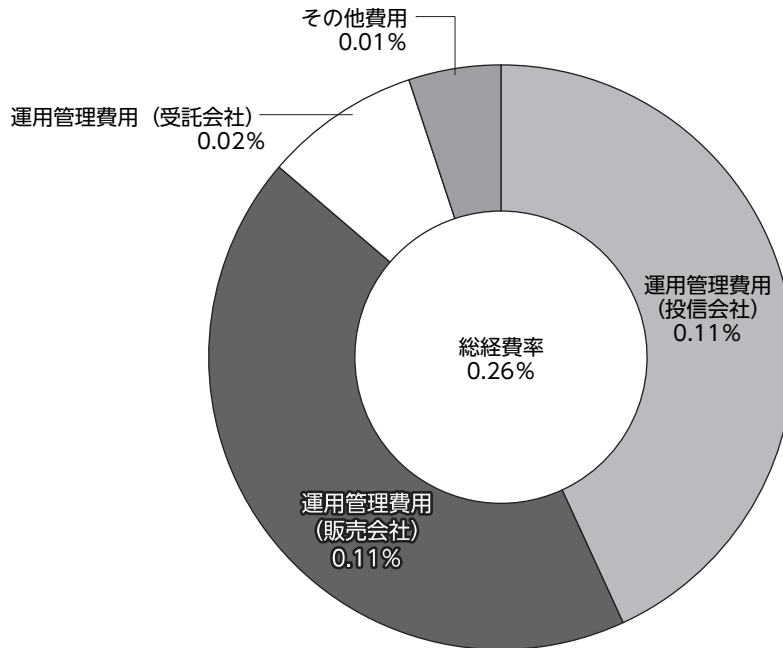
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.26%**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。

基準価額等の推移



第6期首	18,090円	既払分配金	0円
第6期末	21,815円	騰落率 (分配金再投資ベース)	20.6%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2024年1月から7月上旬にかけて、企業の堅調な業績などを受けて内外株式市場が上昇したことに加えて、主要通貨に対して円安が進行したこと
- ・9月中旬から当期末にかけて、米国の堅調な経済指標や米大統領選でのトランプ氏勝利などにより物価上昇に対する懸念がくすぶる中、FRBの利下げペースが緩やかになるとの観測が台頭したことを受けて主要通貨に対して円安が進行し、外貨建資産(外国株式・外国債券)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、米国の景気減速懸念や対中半導体輸出規制の強化懸念の高まり、日銀の追加利上げに積極的な姿勢などを背景に内外株式市場が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が急速に進行したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	31.4%	17.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	46.1	31.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	6.5	△ 3.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	16.0	8.7

(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6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	50円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は20,511円です。
(投信会社)	(23)	(0.110)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(23)	(0.110)	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)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	3	0.013	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)	(2)	(0.011)	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)	(1)	(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)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	53	0.257	

(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。

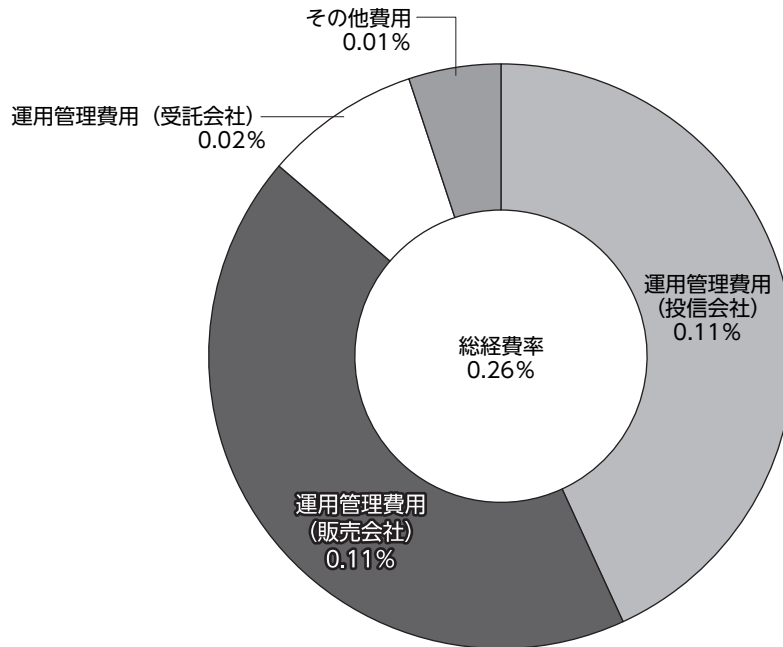
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.26%**です。



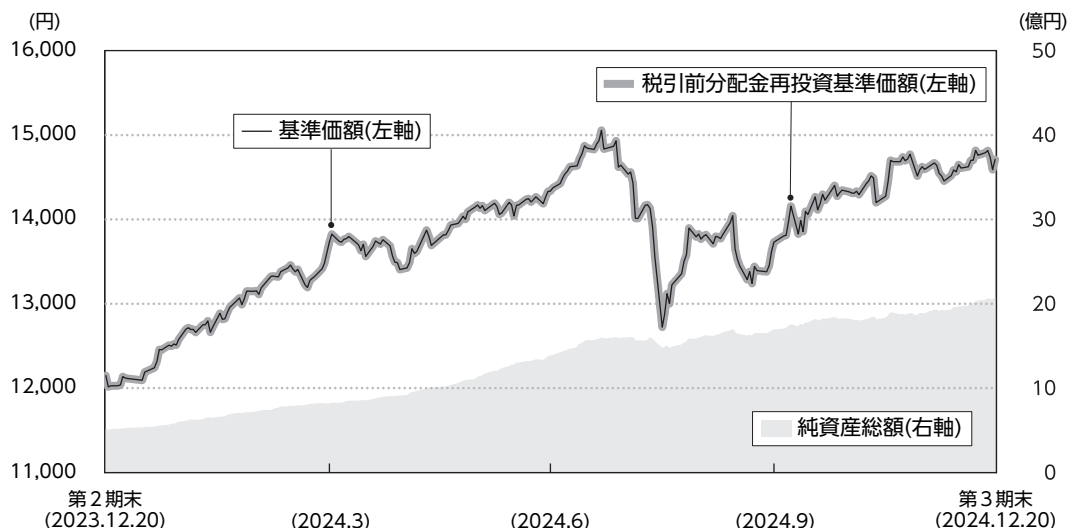
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

基準価額等の推移



第3期首	12,148円	既払分配金	0円
第3期末	14,710円	騰落率 (分配金再投資ベース)	21.1%

(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) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2024年1月から7月上旬にかけて、企業の堅調な業績などを受けて内外株式市場が上昇したことに加えて、主要通貨に対して円安が進行したこと
- ・9月中旬から当期末にかけて、米国の堅調な経済指標や米大統領選でのトランプ氏勝利などにより物価上昇に対する懸念がくすぶる中、FRBの利下げペースが緩やかになるとの観測が台頭したことを受けて主要通貨に対して円安が進行し、外貨建資産(外国株式・外国債券)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、米国の景気減速懸念や対中半導体輸出規制の強化懸念の高まり、日銀の追加利上げに積極的な姿勢などを背景に内外株式市場が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が急速に進行したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	32.0%	17.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	47.1	31.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	4.7	△ 3.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	16.2	8.7

(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3期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	33円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は13,813円です。
(投信会社)	(15)	(0.110)	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)	(15)	(0.110)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.002)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	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	2	0.013	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.011)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ 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	36	0.257	

(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。

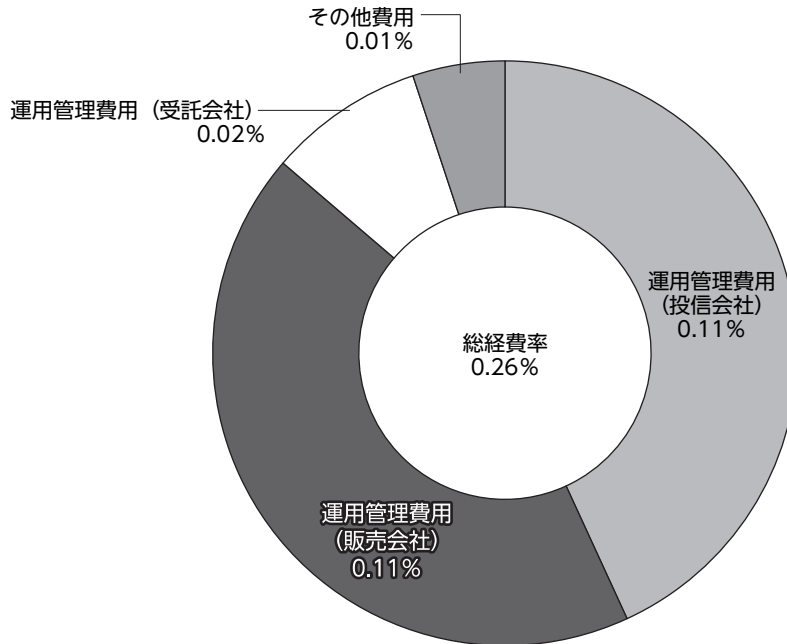
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.26%**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。

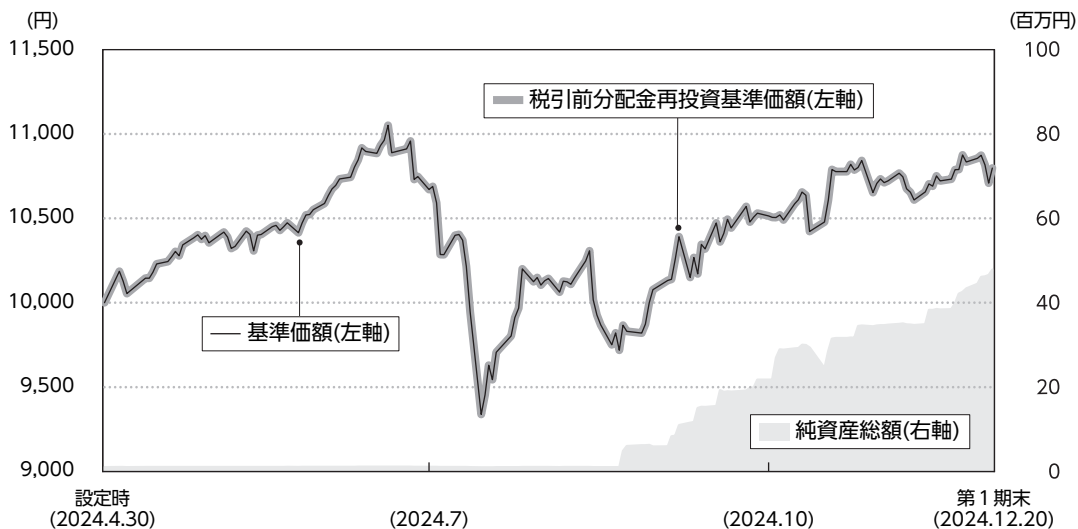
(注3) 各比率は年率換算した値です。

(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。

運用経過

2024年4月30日～2024年12月20日

基準価額等の推移



設定時	10,000円	既払分配金	0円
第1期末	10,797円	騰落率(分配金再投資ベース)	8.0%

(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、設定時の基準価額にあわせて指数化しています。

(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) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・設定時から2024年7月上旬にかけて、企業の堅調な業績などを受けて内外株式市場が上昇したことに加えて、主要通貨に対して円安が進行したこと
- ・9月中旬から当期末にかけて、米国の堅調な経済指標や米大統領選でのトランプ氏勝利などにより物価上昇に対する懸念がくすぶる中、FRBの利下げペースが緩やかになるとの観測が台頭したことを受けて主要通貨に対して円安が進行し、外貨建資産(外国株式・外国債券)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、米国の景気減速懸念や対中半導体輸出規制の強化懸念の高まり、日銀の追加利上げに積極的な姿勢などを背景に内外株式市場が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が急速に進行したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	32.0%	1.8%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	47.1	15.1
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	4.7	△ 0.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	16.2	4.1

(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1期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	16円	0.156%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,419円です。
(投信会社)	(7)	(0.071)	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)	(7)	(0.071)	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)	(1)	(0.014)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.000	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.006	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.006)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.000)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ 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	17	0.163	

(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。

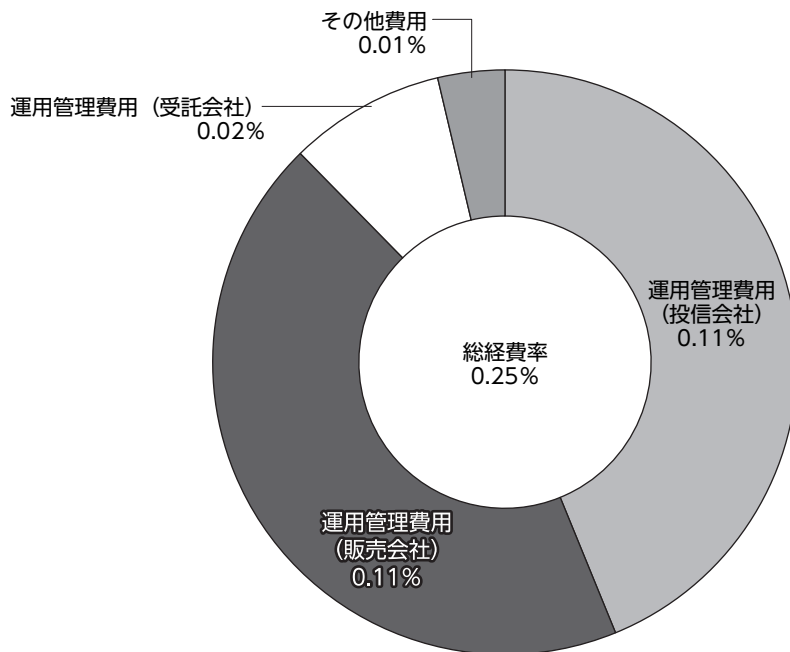
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.25%**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

当期の国内株式市場は国内の企業業績や米景気が好調であることなどから前期末と比較すると上昇しました。

期初は世界的な景気動向の下押し圧力となっていた物価の上昇が抑制され、先進国における金利が低下し、経済成長見通しが安定したことを背景に上昇しました。景気の不透明感が払しょくされるとともに円安進行を受けて企業業績の見通しが改善しました。特に2024年1－3月期に上昇幅が大きく、日経平均は最高値を更新し3月には4万円台に到達しました。

その後、米国や欧州と比較して運行していた物価上昇が円安による輸入物価の上昇を通じて高止まりし、4－6月期以降の国内景気は一進一退の状況となりました。また、物価上昇を控除した実質の賃金上昇は限定的となり、消費に力強さが欠ける状態が継続しました。日銀はこの状況に対し、政策金利の引き上げを行いました。米金融政策の転換点とも重なったことで急激に円高が進行し、8月は一日の株価の下落幅と上昇幅が過去最大を記録するなど、株価は大きく変動しました。

その後、円安へ推移するとともに株式市場は落ち着きを取り戻し、堅調な企業業績見通しも継続したことから、狭いレンジ内での動きに終始しました。

■海外株式市況

海外株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2024年3月にかけては、欧米のインフレ鈍化を受けて欧米主要中央銀行の利下げ期待が高まったことや、人工知能（AI）分野への成長期待を背景に大型ハイテク銘柄を中心に買われたことから上昇基調となりました。4月上旬から中旬にかけては、米国の堅調なマクロ経済指標の発表によりインフレ懸念が再燃したことから利下げ観測が後退したことや、イランとイスラエルの対立激化など中東情勢が緊迫化したことによる原油価格の押し上げによって下落しました。その後は、おおむね堅調な企業業績への安心感により、米インフレ再燃を受けたFRBの利下げ開始時期の後ずれ懸念やイギリス・フランスの総選挙による政治不安をこなし、7月上旬まで上昇を続けました。7月中旬から8月上旬に、大型ハイテク銘柄の業績懸念や軟調な米雇用統計を受けた世界的な景気後退懸念から大きく調整する場面があったものの、一時的にとどまりました。当期末にかけては、米経済の急減速を伴うハードランディング（強行着陸）回避の見方が広がる中、米利下げ開始が好感されたほか、米大統領選でのトランプ氏勝利を受けた減税や規制緩和への期待も相まって騰勢を維持し、高値圏で終えました。

■国内債券市況

前期末を0.56%近辺でスタートした10年国債金利は、2024年3月の日銀金融政策決定会合でマイナス金利が解除されるなど、金利正常化への思惑が広がり上昇基調をたどりました。4月以降も、国債買い入れの減額や追加利上げ観測が高まったことから長期金利は上昇を強め、5月末には1.08%程度まで上昇しました。その後、6月には米景気指標の悪化を受けた海外金利の低下や日銀の国債買い入れの減額が先送されたことなどから、一時的に金利低下圧力が強まる局面もありましたが、円安進行によりふたたび上昇傾向を強め、7月上旬には1.10%程度まで上昇しました。8月上旬には、7月末の日銀金融政策決定会合において市場想定よりも早

く追加利上げが決定されたことにより急激な円高進行と株式市場の下落により、0.8%を下回る水準まで急落しました。その後、9月まで0.8%台を中心にもみ合う展開となりましたが、10月以降は、衆院選で与党が過半数を下回ったことや米大統領選でトランプ元大統領が勝利し、上下院において共和党が勝利したことを受けて、財政拡大やインフレ懸念等から米金利が上昇したことによりふたたび上昇基調となり、結局、10年国債金利は1.06%近辺で当期末を迎えました。

■海外債券市況

当期の米国10年国債金利は期を通じてみると上昇しました。

期初から2024年5月下旬にかけては、堅調な米経済指標を受けてF R Bの利下げ期待が後退したことなどを背景に金利は上昇しました。6月上旬から9月中旬にかけては、米消費者物価指数（C P I）や米生産者物価指数（P P I）がインフレ鈍化の傾向を示したことから、利下げ開始観測が強まり、金利は低下しました。9月中旬から当期末にかけては、米大統領選でトランプ氏が勝利し、関税引き上げや財政支出拡大への思惑からインフレの長期化や国債発行の増加が意識されたことなどから、米金利は上昇しました。

当期のドイツ10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2024年5月下旬にかけては、欧州中央銀行（E C B）高官の早期利下げけん制発言やE C Bのインフレ見通しが上方修正されたことを受けて、金利は上昇しました。その後、7月中旬から9月末にかけて米国の軟調な経済指標を受けて、米金利に連動する形で欧州金利も低下しました。10月上旬から当期末にかけては、ユーロ圏の景気減速懸念が後退したことや、インフレ長期化の懸念が高まったことなどから、欧州金利は上昇しました。

■為替市況

米ドル／円レートは期を通じて見ると上昇しました。

期初から2024年7月上旬にかけては、日銀が金融引き締めに慎重な姿勢を示したことなどから日米金利差が高水準にとどまるとの見方が強まり、米ドル高円安基調で推移しました。その後、7月中旬から9月中旬にかけては米C P Iがインフレ鈍化の傾向を示し、米金利が低下したことなどから、米ドル安円高基調となりました。9月下旬から当期末にかけては、米大統領選でトランプ氏が勝利し、関税引き上げや財政支出拡大に伴うインフレ再燃が意識され米金利が上昇したことなどから、おおむね米ドル高円安となりました。

ユーロ／円レートは期を通じて見ると上昇しました。

期初から2024年7月上旬にかけては、E C Bの早期利下げ観測が後退したことや日銀の金融引き締めに慎重な姿勢などからユーロ高円安基調で推移しました。7月中旬から9月中旬にかけては、米経済指標が弱含んだことを受けて欧米の金利が低下したことなどから、ユーロ安円高となりました。9月下旬から当期末にかけては、日本の衆院選の結果から政治の不確実性が高まったことやユーロ圏消費者物価指数（H I C P）の伸び率が前月から加速してインフレ長期化の懸念が高まったことなどから、おおむねユーロ高円安となりました。

《2070》の当期の運用期間は2024年4月30日～2024年12月20日です。

ポートフォリオ

■各ファンド

当期の基本資産配分に則って、複数のマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を含む各国の株式、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。

<当期の基本資産配分>

	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
2025	3.6%	1.5%	41.7%	3.2%	50.0%
2030	11.2	12.4	69.5	6.9	0.0
2035	21.4	28.7	38.8	11.1	0.0
2040	27.9	39.4	18.8	13.9	0.0
2045	29.8	42.3	13.3	14.6	0.0
2050	30.6	43.6	10.8	15.0	0.0
2055	31.2	44.8	8.7	15.3	0.0
2060	32.0	45.9	6.5	15.6	0.0
2065	32.6	46.9	4.7	15.8	0.0
2070	32.6	46.9	4.7	15.8	0.0

(注1) ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンドは国内株式、ニッセイグローバルリートマザーファンドは外国株式の資産配分に含まれます。以下同じです。

(注2) 基本資産配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合です。以下同じです。

■マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークであるＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

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

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く主要国の国債に投資することにより、ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド>

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

<ニッセイグローバルリートマザーファンド>

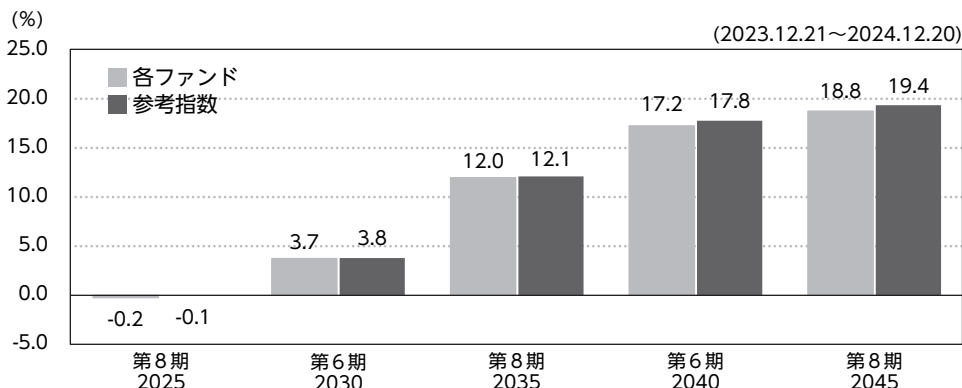
日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）しているリートを主要投資対象とし、ベンチマークであるＳ＆Ｐグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイマネーマーケットマザーファンド>

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざしました。

* ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。なお、期中において一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

参考指数との差異



各ファンドはベンチマークを設けていません。各ファンドとも参考指数は、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）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）、S&Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）、無担保コール翌日物の収益率に基本資産配分比率を乗じて合成したものです。

信託報酬等を控除した関係などから、各ファンドとも参考指数騰落率を下回る結果となりました。

■2025

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は－0.2%となり、参考指数騰落率（－0.1%）を下回りました。

■2030

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は＋3.7%となり、参考指数騰落率（＋3.8%）を下回りました。

■2035

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は＋12.0%となり、参考指数騰落率（＋12.1%）を下回りました。

■2040

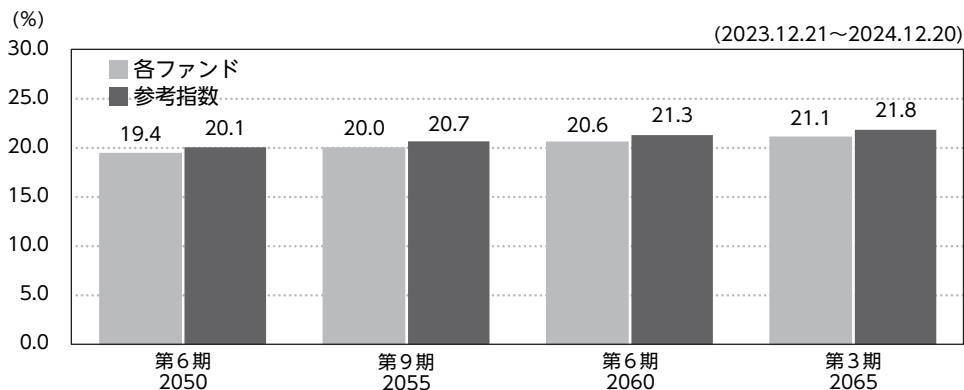
当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は＋17.2%となり、参考指数騰落率（＋17.8%）を下回りました。

■2045

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は＋18.8%となり、参考指数騰落率（＋19.4%）を下回りました。

（注1）基準価額の騰落率は分配金込みです。

（注2）参考指数の詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。



各ファンドはベンチマークを設けていません。各ファンドとも参考指数は、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）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）、S&Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）、無担保コール翌日物の収益率に基本資産配分比率を乗じて合成したものです。

信託報酬等を控除した関係などから、各ファンドとも参考指数騰落率を下回る結果となりました。

■2050

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+19.4%となり、参考指数騰落率(+20.1%)を下回りました。

■2055

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+20.0%となり、参考指数騰落率(+20.7%)を下回りました。

■2060

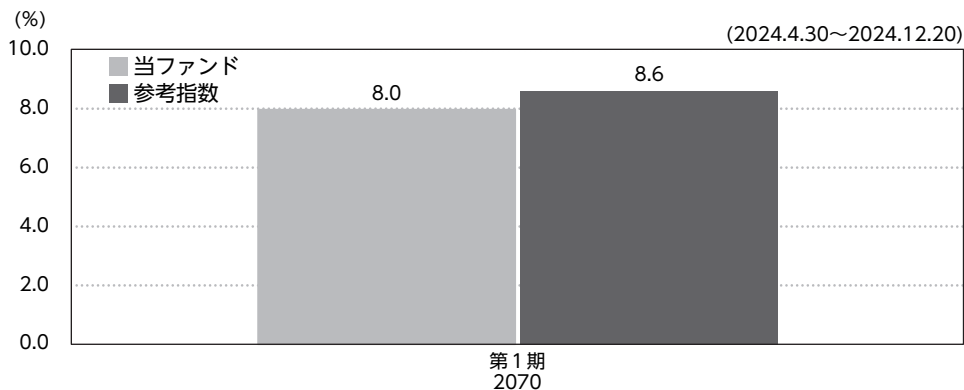
当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+20.6%となり、参考指数騰落率(+21.3%)を下回りました。

■2065

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+21.1%となり、参考指数騰落率(+21.8%)を下回りました。

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 参考指数の詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。



当ファンドはベンチマークを設けていません。参考指数は、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）、S&Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）、無担保コール翌日物の収益率に基本資産配分比率を乗じて合成したものです。

信託報酬等を控除した関係などから、参考指数騰落率を下回る結果となりました。

■2070

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+8.0%となり、参考指数騰落率（+8.6%）を下回りました。

（注1）基準価額の騰落率は分配金込みです。

（注2）参考指数の詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

分配金

当期の分配金は、各ファンドとも基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案した結果、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	2023年12月21日～2024年12月20日				
	第 8 期	第 6 期	第 8 期	第 6 期	第 8 期
	2025	2030	2035	2040	2045
当期分配金（税引前）	－	－	－	－	－
対基準価額比率	－	－	－	－	－
当期の収益	－	－	－	－	－
当期の収益以外	－	－	－	－	－
翌期繰越分配対象額	1,076円	3,715円	7,530円	9,852円	10,297円

項目	2023年12月21日～2024年12月20日			
	第 6 期	第 9 期	第 6 期	第 3 期
	2050	2055	2060	2065
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	10,996円	15,298円	11,815円	4,709円

項目	2024年 4 月30日～2024年12月20日	
	第 1 期	
	2070	
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	796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

■各ファンド

来期の基本資産配分に則り、複数のマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を含む各国の株式（リートを含みます）、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

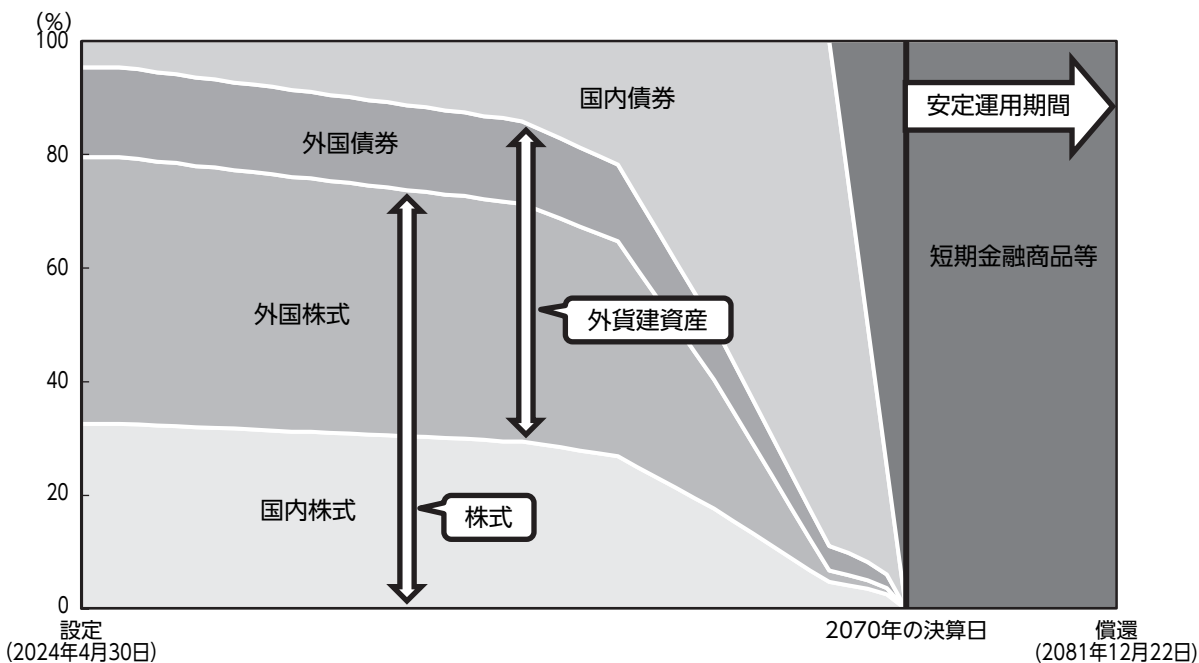
今後も、安定運用開始時期（ターゲットデート）に近づくにしたがって株式の組み入れを漸減させ、国内債券や短期金融商品等の組み入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを低減させていく運用を行います。

<来期の基本資産配分>

	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
2025	2.6%	1.1%	18.9%	2.4%	75.0%
2030	9.0	8.9	76.0	6.1	0.0
2035	19.5	25.7 (0.5)	44.4	10.4	0.0
2040	27.4	38.6 (0.8)	20.3	13.7	0.0
2045	29.5	42.2 (0.8)	13.6	14.7	0.0
2050	30.4	43.3 (0.9)	11.4	14.9	0.0
2055	31.2	44.6 (0.9)	9.0	15.2	0.0
2060	31.9	45.8 (0.9)	6.8	15.5	0.0
2065	32.6	46.9 (0.9)	4.7	15.8	0.0
2070	32.6	46.9 (0.9)	4.7	15.8	0.0

（注）外国株式欄の括弧内数値は、外国株式の資産配分に含まれているニッセイグローバルリートマザーファンドの基本配分です。

<基本資産配分のイメージ（例：DCニッセイターゲットデートファンド2070）>



（注1）上図は当初設定時における基本資産配分のイメージ図であり、実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。

（注2）上記の基本資産配分比率は、市況動向などにより変更となる場合があります。

■マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

国内の公社債に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所に上場しているＪリートに投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイグローバルリートマザーファンド>

日本を除く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す。

<ニッセイマネーマーケットマザーファンド>

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。

ファンドデータ

DCニッセイターゲットデートファンド2025の組入資産の内容

■組入ファンド

	第8期末 2024年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	3.5%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	1.5
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	41.7
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	3.3
ニッセイマネーマーケット マザーファンド	49.8

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

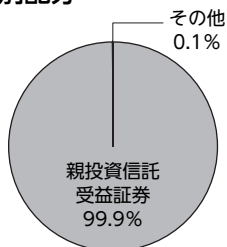
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

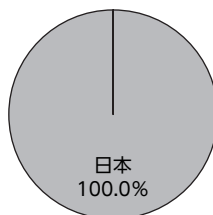
項目	第8期末 2024年12月20日
純資産総額	2,610,049,355円
受益権総口数	2,418,865,951口
1万口当たり基準価額	10,790円

(注) 当期間中における追加設定元本額は451,052,176円、同解約元本額は549,177,988円です。

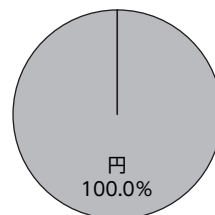
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年12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。

DCニッセイターゲットデートファンド2030の組入資産の内容

■組入ファンド

	第6期末 2024年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	11.0%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	12.5
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	69.4
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	7.1

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

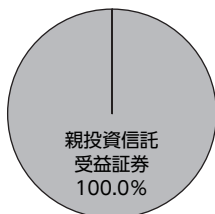
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

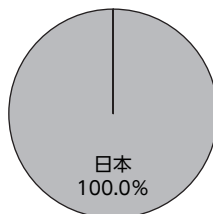
項目	第6期末 2024年12月20日
純資産総額	6,155,072,806円
受益権総口数	4,487,747,889口
1万口当たり基準価額	13,715円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,750,142,123円、同解約元本額は560,360,884円です。

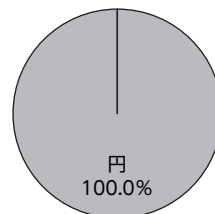
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年12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。

DCニッセイターゲットデートファンド2035の組入資産の内容

■組入ファンド

	第8期末 2024年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	21.0%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	28.9
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	38.8
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	11.4

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

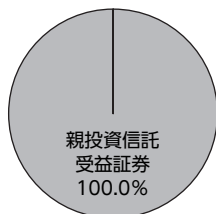
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

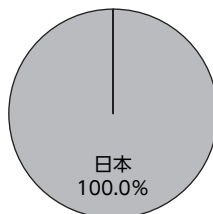
項目	第8期末 2024年12月20日
純資産総額	10,936,527,791円
受益権総口数	6,238,691,261口
1万口当たり基準価額	17,530円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,764,760,109円、同解約元本額は603,790,781円です。

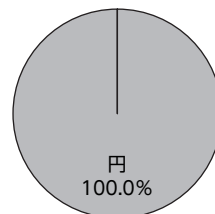
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年12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。

DCニッセイターゲットデートファンド2040の組入資産の内容

■組入ファンド

	第6期末 2024年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	27.4%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	39.6
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	18.8
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	14.2

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

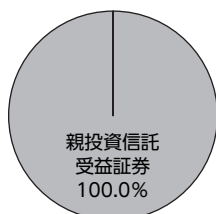
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

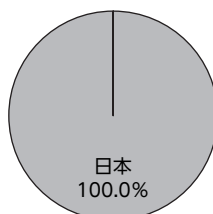
項目	第6期末 2024年12月20日
純資産総額	5,654,927,682円
受益権総口数	2,848,453,757口
1万口当たり基準価額	19,853円

(注) 当期間中における追加設定元本額は984,970,150円、同解約元本額は291,886,098円です。

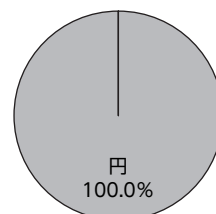
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年12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。

DCニッセイターゲットデートファンド2045の組入資産の内容

■組入ファンド

	第8期末 2024年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	29.2%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	42.5
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	13.3
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	14.9

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

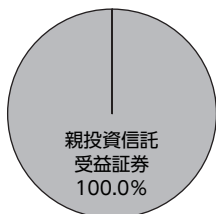
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

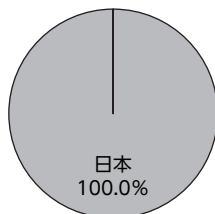
項目	第8期末 2024年12月20日
純資産総額	6,185,525,393円
受益権総口数	3,047,478,507口
1万口当たり基準価額	20,297円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,028,845,334円、同解約元本額は333,703,656円です。

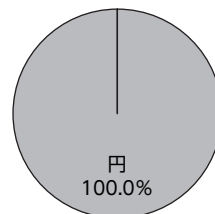
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年12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。

DCニッセイターゲットデートファンド2050の組入資産の内容

■組入ファンド

	第6期末 2024年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	30.0%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	43.8
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	10.8
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	15.4

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

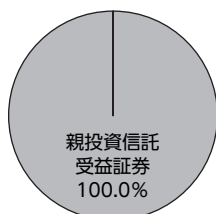
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

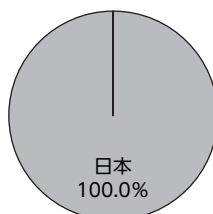
項目	第6期末 2024年12月20日
純資産総額	2,926,738,518円
受益権総口数	1,393,903,382口
1万口当たり基準価額	20,997円

(注) 当期間中における追加設定元本額は606,770,616円、同解約元本額は198,454,861円です。

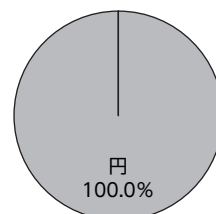
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年12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。

DCニッセイターゲットデートファンド2055の組入資産の内容

■組入ファンド

	第9期末 2024年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	30.6%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	45.0
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	8.7
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	15.7

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

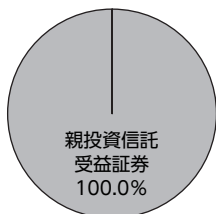
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

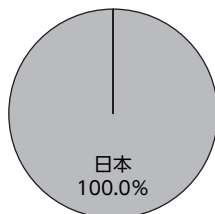
項目	第9期末 2024年12月20日
純資産総額	5,094,536,547円
受益権総口数	2,013,776,401口
1万口当たり基準価額	25,298円

(注) 当期間中における追加設定元本額は784,421,983円、同解約元本額は365,027,677円です。

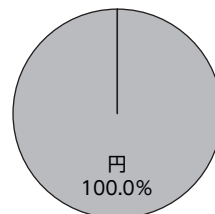
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年12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。

DCニッセイターゲットデートファンド2060の組入資産の内容

■組入ファンド

	第6期末 2024年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	31.4%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	46.1
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	6.5
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	16.0

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

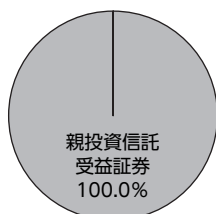
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

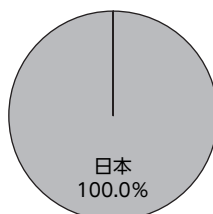
項目	第6期末 2024年12月20日
純資産総額	4,150,487,357円
受益権総口数	1,902,549,561口
1万口当たり基準価額	21,815円

(注) 当期間中における追加設定元本額は974,266,359円、同解約元本額は492,904,277円です。

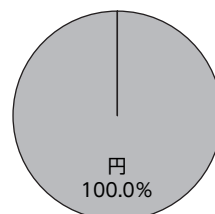
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年12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。

DCニッセイターゲットデートファンド2065の組入資産の内容

■組入ファンド

	第3期末 2024年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	32.0%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	47.1
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	4.7
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	16.2

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

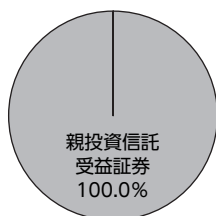
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

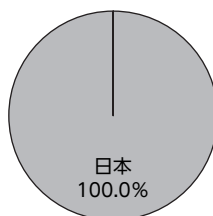
項目	第3期末 2024年12月20日
純資産総額	2,059,989,533円
受益権総口数	1,400,422,243口
1万口当たり基準価額	14,710円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,582,495,991円、同解約元本額は593,526,099円です。

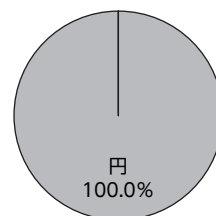
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年12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。

DCニッセイターゲットデートファンド2070の組入資産の内容

■組入ファンド

	第1期末 2024年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	32.0%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	47.1
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	4.7
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	16.2

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

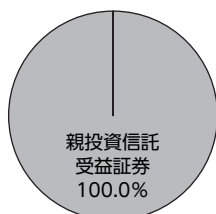
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

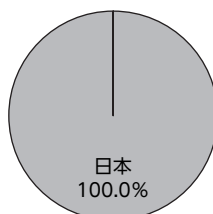
項目	第1期末 2024年12月20日
純資産総額	47,816,376円
受益権総口数	44,288,062口
1万口当たり基準価額	10,797円

(注) 当期間中における追加設定元本額は52,670,866円、同解約元本額は9,382,804円です。

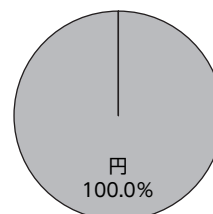
■資産別配分



■国別配分



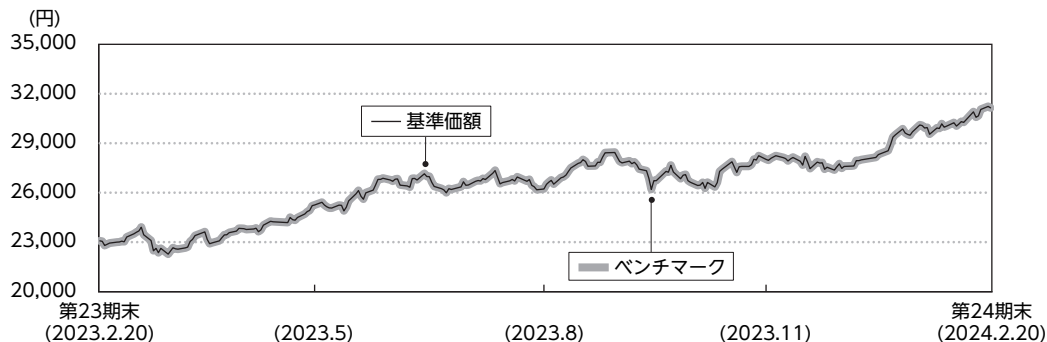
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年12月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

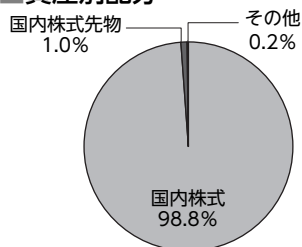
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	5.0%
ソニーグループ	円	2.5
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	2.4
東京エレクトロン	円	1.9
キーエンス	円	1.8
三菱商事	円	1.7
日立製作所	円	1.6
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.5
信越化学工業	円	1.5
日本電信電話	円	1.4
組入銘柄数	1,709	

■ 1万口当たりの費用明細

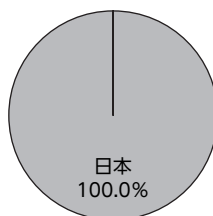
2023.2.21～2024.2.20

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

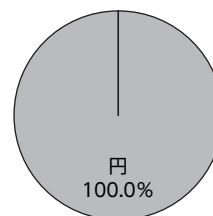
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



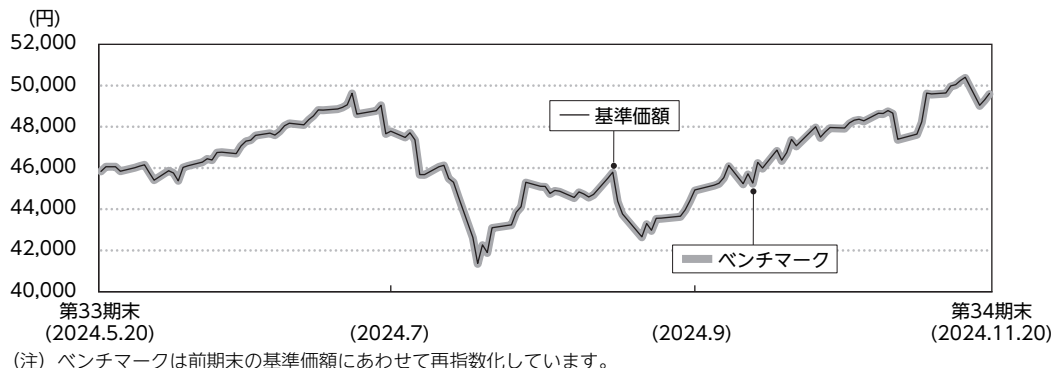
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



■ 上位銘柄

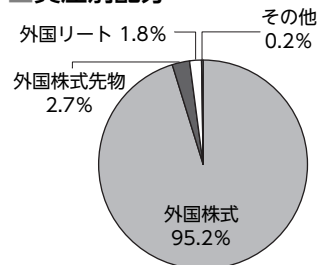
銘柄名	通貨	比率
NVIDIA CORP	米ドル	5.3%
APPLE INC	米ドル	4.9
MICROSOFT CORP	米ドル	4.3
AMAZON.COM INC	米ドル	2.8
S&P 500 EMINI FUTURE 202412 買	米ドル	2.0
META PLATFORMS INC-A	米ドル	1.8
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.5
TESLA, INC.	米ドル	1.4
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.3
BROADCOM INC	米ドル	1.1
組入銘柄数		1,214

■ 1万口当たりの費用明細

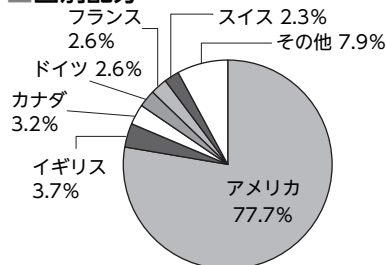
2024.5.21～2024.11.20

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

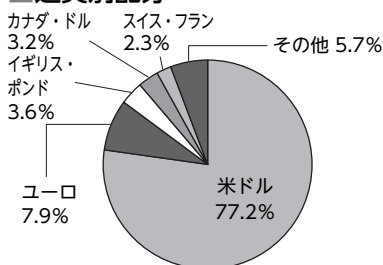
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

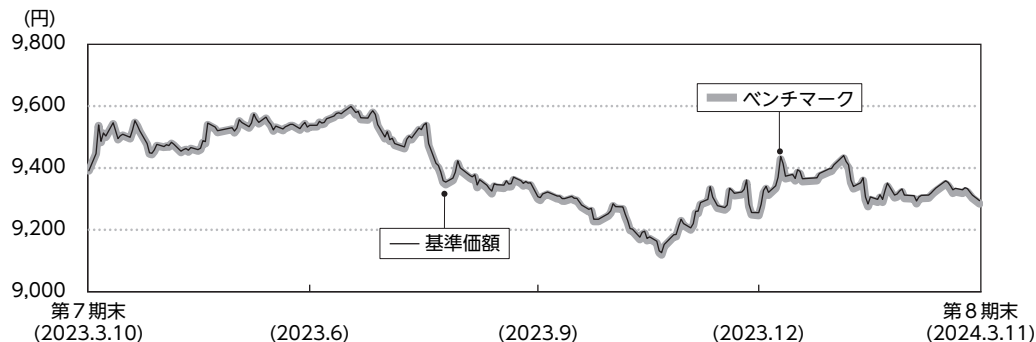
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2024年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

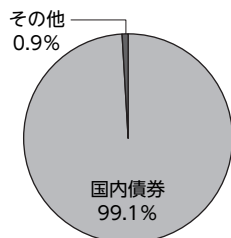
銘柄名	通貨	比率
第372回 利付国債 (10年)	円	0.9%
第340回 利付国債 (10年)	円	0.9
第341回 利付国債 (10年)	円	0.8
第145回 利付国債 (5年)	円	0.8
第370回 利付国債 (10年)	円	0.8
第149回 利付国債 (5年)	円	0.8
第339回 利付国債 (10年)	円	0.8
第350回 利付国債 (10年)	円	0.8
第369回 利付国債 (10年)	円	0.8
第366回 利付国債 (10年)	円	0.8
組入銘柄数		357

■ 1万口当たりの費用明細

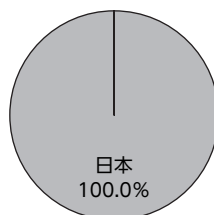
2023.3.11～2024.3.11

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

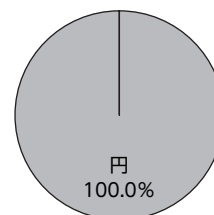
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(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

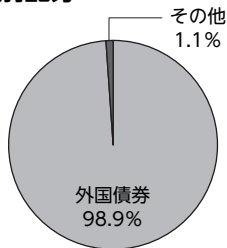
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 1.5% 2026/8/15	米ドル	2.4%
US TREASURY 1.625% 2026/2/15	米ドル	2.3
US TREASURY 1.625% 2026/5/15	米ドル	1.8
US TREASURY 2.625% 2029/2/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.25% 2025/11/15	米ドル	1.4
US TREASURY 2.375% 2029/5/15	米ドル	1.4
US TREASURY 2.375% 2027/5/15	米ドル	1.4
US TREASURY 2.0% 2026/11/15	米ドル	1.3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

■ 1万口当たりの費用明細

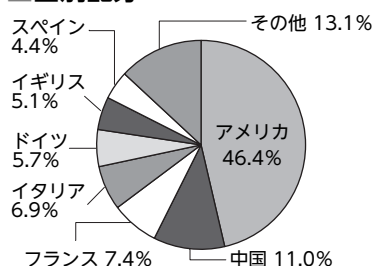
2024.5.21～2024.11.20

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

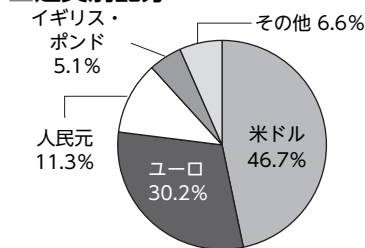
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



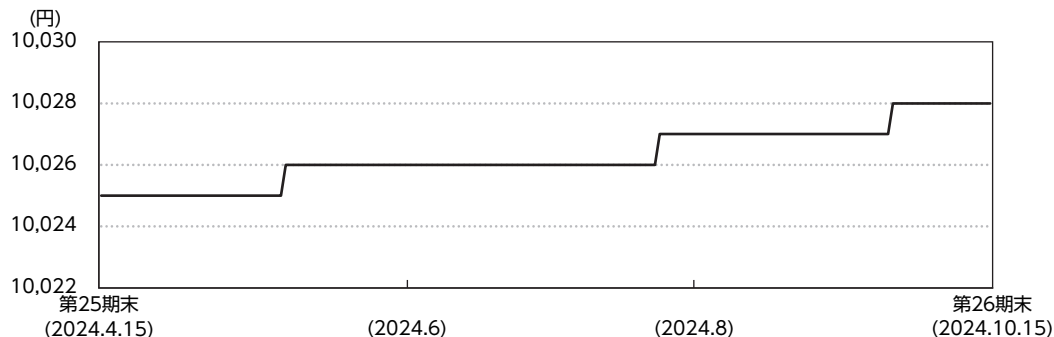
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

ニッセイマネーマーケットマザーファンドの概要

■基準価額の推移



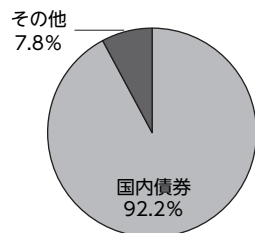
■上位銘柄

銘柄名	通貨	比率
平成26年度第1回 滋賀県公募公債	円	14.6%
令和元年度第8回 神戸市公募公債（5年）	円	14.5
第146回 共同発行市場公募地方債	円	12.8
第213回 神奈川県公募公債	円	12.7
令和元年度第1回 鹿児島県公募公債（5年）	円	12.7
第69回 政保地方公共団体金融機構債券	円	6.4
第147回 共同発行市場公募地方債	円	6.3
第748回 東京都公募公債	円	6.3
第231回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	円	5.7
組入銘柄数	9	

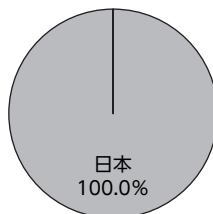
■1万口当たりの費用明細

当期（2024年4月16日～2024年10月15日）における費用はありません。

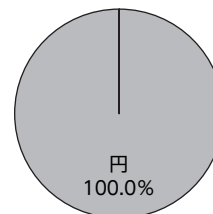
■資産別配分



■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10月15日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
4期(2020年12月21日)	10,837	0	2.0	10,837	10,931	2.0	18.9	0.6	79.8	0.2	1,301
5期(2021年12月20日)	11,106	0	2.5	11,106	11,241	2.8	11.8	0.3	87.1	0.1	2,216
6期(2022年12月20日)	10,578	0	△4.8	10,578	10,743	△4.4	6.4	0.2	92.4	—	2,533
7期(2023年12月20日)	10,816	0	2.2	10,816	11,007	2.5	5.8	0.2	87.6	—	2,722
8期(2024年12月20日)	10,790	0	△0.2	10,790	11,000	△0.1	4.9	0.1	87.5	—	2,610

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2023年12月20日	10,816	—	11,007	—	5.8	0.2	87.6	—
12月末	10,773	△0.4	10,964	△0.4	5.0	0.1	78.7	—
2024年1月末	10,786	△0.3	10,977	△0.3	5.3	0.1	84.5	—
2月末	10,831	0.1	11,024	0.2	5.2	0.1	84.9	—
3月末	10,854	0.4	11,048	0.4	5.1	0.1	85.7	—
4月末	10,806	△0.1	11,001	△0.1	5.0	0.1	86.0	—
5月末	10,744	△0.7	10,938	△0.6	5.1	0.1	86.0	—
6月末	10,782	△0.3	10,979	△0.3	5.1	0.1	87.0	—
7月末	10,754	△0.6	10,951	△0.5	4.8	0.1	87.6	—
8月末	10,790	△0.2	10,990	△0.2	5.6	0.2	86.6	—
9月末	10,795	△0.2	11,002	△0.0	5.0	0.2	87.4	—
10月末	10,807	△0.1	11,014	0.1	5.0	0.1	76.8	—
11月末	10,767	△0.5	10,975	△0.3	5.0	0.1	80.5	—
(期末)2024年12月20日	10,790	△0.2	11,000	△0.1	4.9	0.1	87.5	—

(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12月21日～2024年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	12,768	39,791	25,459	78,550
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	2,786	12,226	7,905	34,038
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	289,549	266,303	978,974	915,182
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	12,646	22,028	29,070	49,970
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	936,667	939,043	313,609	314,440

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,582,214千円	114,352,720千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	235,088,359千円	977,996,782千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年12月21日～2024年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2025

親投資信託残高

2024年12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	40,986	28,294	92,433
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	13,006	7,887	39,474
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,883,785	1,194,360	1,089,376
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	63,772	47,347	85,741
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	673,364	1,296,422	1,300,441

(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78,631,231千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,877,475千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,192,059千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが52,655,680千口、ニッセイマネーマーケットマザーファンドが1,346,696千口です。

投資信託財産の構成

2024年12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	92,433	3.5
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	39,474	1.5
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,089,376	41.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	85,741	3.3
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	1,300,441	49.8
コール・ローン等、その他	6,314	0.2
投資信託財産総額	2,613,781	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.95円、1カナダ・ドル109.52円、1オーストラリア・ドル98.36円、1香港ドル20.33円、1シンガポール・ドル116.02円、1ニュージーランド・ドル88.77円、1イギリス・ポンド197.28円、1イスラエル・シェケル43,247円、1スイス・フラン175.77円、1デンマーク・クローネ21.94円、1ノルウェー・クローネ13.79円、1スウェーデン・クローナ14.32円、1メキシコ・ペソ7.766円、1人民元21.598円、1マレーシア・リンギット35.028円、1南アフリカ・ランド8.56円、1ポーランド・ズロチ38.459円、1ユーロ163.70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（1,179,768,735千円）の投資信託財産総額（1,190,543,898千円）に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（95,324,044千円）の投資信託財産総額（95,746,756千円）に対する比率は99.6%です。
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（14,186,297千円）の投資信託財産総額（14,371,903千円）に対する比率は98.7%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12月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	2,613,781,333円
コール・ローン等	4,602,687
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	92,433,697
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	39,474,125
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	1,089,376,083
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	85,741,500
ニッセイマネーマーケット マザーファンド(評価額)	1,300,441,465
未収入金	1,711,776
(B)負債	3,731,978
未払解約金	1,680,358
未払信託報酬	2,037,164
その他未払費用	14,456
(C)純資産総額(A-B)	2,610,049,355
元本	2,418,865,951
次期繰越損益金	191,183,404
(D)受益権総口数	2,418,865,951口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,790円

(注) 期首元本額 2,516,991,763円
期中追加設定元本額 451,052,176円
期中一部解約元本額 549,177,988円

損益の状況

当期(2023年12月21日~2024年12月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	3,711円
受取利息	3,799
支払利息	△ 88
(B)有価証券売買損益	△ 867,531
売買益	38,939,288
売買損	△ 39,806,819
(C)信託報酬等	△ 4,193,671
(D)当期損益金(A+B+C)	△ 5,057,491
(E)前期繰越損益金	8,768,841
(分配準備積立金)	(38,164,824)
(繰越欠損金)	(△ 29,395,983)
(F)追加信託差損益金*	187,472,054
(配当等相当額)	(222,141,136)
(売買損益相当額)	(△ 34,669,082)
(G)合計(D+E+F)	191,183,404
次期繰越損益金(G)	191,183,404
追加信託差損益金	187,472,054
(配当等相当額)	(222,141,136)
(売買損益相当額)	(△ 34,669,082)
分配準備積立金	38,164,824
繰越欠損金	△ 34,453,474

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

分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	222,141,136円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	38,164,824円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	260,305,960円
(f) 分配対象額 (1 万口当たり)	1,076.15円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1 万口当たり)	0円

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2020年12月21日)	11,535	0	4.4	11,535	11,603	4.8	43.8	1.4	54.0	0.4	1,170
3期(2021年12月20日)	12,486	0	8.2	12,486	12,612	8.7	38.8	1.0	59.1	0.5	2,832
4期(2022年12月20日)	12,115	0	△3.0	12,115	12,294	△2.5	32.6	1.0	65.3	0.4	3,415
5期(2023年12月20日)	13,221	0	9.1	13,221	13,475	9.6	28.2	0.7	70.0	0.3	4,360
6期(2024年12月20日)	13,715	0	3.7	13,715	13,986	3.8	22.8	0.5	75.8	0.2	6,155

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2023年12月20日	13,221	—	13,475	—	28.2	0.7	70.0	0.3
12月末	13,138	△0.6	13,388	△0.6	23.1	0.6	75.5	0.3
2024年1月末	13,301	0.6	13,551	0.6	24.0	0.6	74.5	0.2
2月末	13,495	2.1	13,748	2.0	23.4	0.6	75.0	0.2
3月末	13,632	3.1	13,888	3.1	23.3	0.6	75.2	0.2
4月末	13,548	2.5	13,807	2.5	23.2	0.7	75.2	0.2
5月末	13,459	1.8	13,717	1.8	23.5	0.6	74.9	0.2
6月末	13,638	3.2	13,901	3.2	23.5	0.6	75.2	0.2
7月末	13,495	2.1	13,753	2.1	22.1	0.4	76.6	0.2
8月末	13,537	2.4	13,795	2.4	22.7	0.7	75.6	0.2
9月末	13,561	2.6	13,825	2.6	23.2	0.7	75.3	0.2
10月末	13,709	3.7	13,974	3.7	23.3	0.6	75.2	0.2
11月末	13,625	3.1	13,892	3.1	23.3	0.5	75.3	0.2
(期末)2024年12月20日	13,715	3.7	13,986	3.8	22.8	0.5	75.8	0.2

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2023年12月21日～2024年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	126,868	399,345	128,365	396,267
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	84,023	375,422	112,841	482,038
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,604,730	2,399,215	828,656	762,223
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	108,788	190,242	72,101	124,596

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,582,214千円	114,352,720千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	235,088,359千円	977,996,782千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年12月21日～2024年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2030

親投資信託残高

2024年12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	208,751	207,254	677,060
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	182,312	153,495	768,196
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,910,510	4,686,584	4,274,633
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	203,647	240,334	435,222

(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78,631,231千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,877,475千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,192,059千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが52,655,680千口です。

投資信託財産の構成

2024年12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	677,060	11.0
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	768,196	12.4
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	4,274,633	69.2
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	435,222	7.0
コール・ローン等、その他	21,632	0.4
投資信託財産総額	6,176,746	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.95円、1カナダ・ドル109.52円、1オーストラリア・ドル98.36円、1香港ドル20.33円、1シンガポール・ドル116.02円、1ニュージーランド・ドル88.77円、1イギリス・ポンド197.28円、1イスラエル・シェケル43.247円、1スイス・フラン175.77円、1デンマーク・クローネ21.94円、1ノルウェー・クローネ13.79円、1スウェーデン・クローナ14.32円、1メキシコ・ペソ7.766円、1人民元21.598円、1マレーシア・リンギット35.028円、1南アフリカ・ランド8.56円、1ポーランド・ズロチ38.459円、1ユーロ163.70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（1,179,768,735千円）の投資信託財産総額（1,190,543,898千円）に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（95,324,044千円）の投資信託財産総額（95,746,756千円）に対する比率は99.6%です。
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（14,186,297千円）の投資信託財産総額（14,371,903千円）に対する比率は98.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

DCニッセイターゲットファンド2030

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年12月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	6,176,746,493円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,564,523
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	677,060,571
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	768,196,621
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	4,274,633,727
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	435,222,580
未 収 入 金	15,068,471
(B)負債	21,673,687
未 払 解 約 金	14,945,991
未 払 信 託 報 酬	6,697,345
そ の 他 未 払 費 用	30,351
(C)純 資 産 総 額 (A－B)	6,155,072,806
元 本	4,487,747,889
次 期 繰 越 損 益 金	1,667,324,917
(D)受 益 権 総 口 数	4,487,747,889口
1万口当たり基準価額 (C／D)	13,715円

(注) 期首元本額 3,297,966,650円
 期中追加設定元本額 1,750,142,123円
 期中一部解約元本額 560,360,884円

損益の状況

当期 (2023年12月21日～2024年12月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	3,609円
受 取 利 息	3,611
支 払 利 息	△ 2
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	181,424,474
売 買 益	305,836,023
売 買 損	△ 124,411,549
(C)信 託 報 酬 等	△ 12,534,003
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	168,894,080
(E)前 期 繰 越 損 益 金	298,692,646
(配 分 準 備 積 立 金) (	298,693,281)
(繰 越 欠 損 金) (△	635)
(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *	1,199,738,191
(配 当 等 相 当 額) (	710,218,938)
(売 買 損 益 相 当 額) (	489,519,253)
(G)合 計 (D + E + F)	1,667,324,917
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	1,667,324,917
追 加 信 託 差 損 益 金	1,199,738,191
(配 当 等 相 当 額) (	710,218,938)
(売 買 損 益 相 当 額) (	489,519,253)
分 配 準 備 積 立 金	467,586,726

(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	3,609円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	168,889,836円
(c) 信託約款に定める収益調整金	1,199,738,191円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	298,693,281円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	1,667,324,917円
(f) 分配対象額 (1 万口当たり)	3,715.28円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1 万口当たり)	0円

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
4期(2020年12月21日)	11,936	0	6.1	11,936	12,123	6.8	63.7	2.0	33.4	0.6	1,687
5期(2021年12月20日)	13,568	0	13.7	13,568	13,848	14.2	62.2	1.7	35.0	0.9	3,957
6期(2022年12月20日)	13,354	0	△ 1.6	13,354	13,704	△ 1.0	56.4	1.8	40.6	0.7	5,290
7期(2023年12月20日)	15,656	0	17.2	15,656	16,143	17.8	53.0	1.4	44.5	0.6	7,949
8期(2024年12月20日)	17,530	0	12.0	17,530	18,098	12.1	48.4	1.0	49.6	0.5	10,936

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2023年12月20日	15,656	—	16,143	—	53.0	1.4	44.5	0.6
12月末	15,582	△ 0.5	16,063	△ 0.5	48.7	1.2	49.1	0.6
2024年1月末	16,100	2.8	16,593	2.8	49.9	1.2	47.9	0.5
2月末	16,535	5.6	17,041	5.6	49.1	1.4	48.5	0.5
3月末	16,904	8.0	17,423	7.9	49.0	1.2	48.8	0.5
4月末	16,894	7.9	17,419	7.9	48.7	1.5	48.8	0.5
5月末	16,955	8.3	17,483	8.3	49.2	1.4	48.4	0.5
6月末	17,385	11.0	17,927	11.0	49.1	1.4	48.6	0.5
7月末	17,014	8.7	17,541	8.7	47.5	0.9	50.6	0.5
8月末	16,903	8.0	17,430	8.0	49.3	1.4	48.2	0.5
9月末	16,918	8.1	17,461	8.2	48.8	1.4	48.8	0.6
10月末	17,399	11.1	17,956	11.2	49.0	1.4	48.6	0.6
11月末	17,324	10.7	17,883	10.8	49.1	1.1	48.8	0.5
(期末)2024年12月20日	17,530	12.0	18,098	12.1	48.4	1.0	49.6	0.5

(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12月21日～2024年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	319,582	1,005,696	274,819	854,164
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	229,283	1,020,553	267,024	1,164,680
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,760,356	2,545,762	900,242	828,375
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	250,865	437,717	130,433	224,444

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,582,214千円	114,352,720千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	235,088,359千円	977,996,782千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年12月21日～2024年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2035

親投資信託残高

2024年12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	658,540	703,303	2,297,552
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	668,670	630,930	3,157,616
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,786,417	4,646,530	4,238,100
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	566,150	686,581	1,243,330

(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78,631,231千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,877,475千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,192,059千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが52,655,680千口です。

投資信託財産の構成

2024年12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	2,297,552	20.9
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	3,157,616	28.8
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	4,238,100	38.6
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,243,330	11.3
コール・ローン等、その他	34,533	0.3
投資信託財産総額	10,971,133	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.95円、1カナダ・ドル109.52円、1オーストラリア・ドル98.36円、1香港ドル20.33円、1シンガポール・ドル116.02円、1ニュージーランド・ドル88.77円、1イギリス・ポンド197.28円、1イスラエル・シェケル43.247円、1スイス・フラン175.77円、1デンマーク・クローネ21.94円、1ノルウェー・クローネ13.79円、1スウェーデン・クローナ14.32円、1メキシコ・ペソ7.766円、1人民元21.598円、1マレーシア・リンギット35.028円、1南アフリカ・ランド8.56円、1ポーランド・ズロチ38.459円、1ユーロ163.70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（1,179,768,735千円）の投資信託財産総額（1,190,543,898千円）に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（95,324,044千円）の投資信託財産総額（95,746,756千円）に対する比率は99.6%です。
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（14,186,297千円）の投資信託財産総額（14,371,903千円）に対する比率は98.7%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12月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	10,971,133,256円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	12,149,735
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,297,552,546
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	3,157,616,006
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	4,238,100,851
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,243,330,715
未 収 入 金	22,383,403
(B)負債	34,605,465
未 払 解 約 金	22,164,809
未 払 信 託 報 酬	12,384,445
そ の 他 未 払 費 用	56,211
(C)純 資 産 総 額 (A－B)	10,936,527,791
元 本	6,238,691,261
次 期 繰 越 損 益 金	4,697,836,530
(D)受 益 権 総 口 数	6,238,691,261口
1万口当たり基準価額 (C／D)	17,530円

(注) 期首元本額 5,077,721,933円
期中追加設定元本額 1,764,760,109円
期中一部解約元本額 603,790,781円

損益の状況

当期 (2023年12月21日～2024年12月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	7,086円
受 取 利 息	7,100
支 払 利 息	△ 14
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	988,746,120
売 買 益	1,157,173,342
売 買 損	△ 168,427,222
(C)信 託 報 酬 等	△ 23,278,053
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	965,475,153
(E)前 期 繰 越 損 益 金	1,097,844,164
(配 分 準 備 積 立 金)	(1,097,845,380)
(繰 越 欠 損 金)	(△ 1,216)
(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *	2,634,517,213
(配 当 等 相 当 額)	(2,071,505,531)
(売 買 損 益 相 当 額)	(563,011,682)
(G)合 計 (D + E + F)	4,697,836,530
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	4,697,836,530
追 加 信 託 差 損 益 金	2,634,517,213
(配 当 等 相 当 額)	(2,071,505,531)
(売 買 損 益 相 当 額)	(563,011,682)
分 配 準 備 積 立 金	2,063,319,317

(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	7,086円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	965,466,851円
(c) 信託約款に定める収益調整金	2,634,517,213円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	1,097,845,380円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	4,697,836,530円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	7,530.16円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2020年12月21日)	12,197	0	6.4	12,197	12,329	7.3	69.0	2.1	27.9	0.6	520
3期(2021年12月20日)	14,045	0	15.2	14,045	14,268	15.7	68.5	1.8	28.4	1.0	1,600
4期(2022年12月20日)	13,899	0	△ 1.0	13,899	14,198	△ 0.5	66.3	2.1	30.4	0.9	2,233
5期(2023年12月20日)	16,933	0	21.8	16,933	17,375	22.4	66.2	1.7	30.9	0.8	3,649
6期(2024年12月20日)	19,853	0	17.2	19,853	20,462	17.8	65.0	1.4	32.7	0.7	5,654

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2023年12月20日	16,933	—	17,375	—	66.2	1.7	30.9	0.8
12月末	16,872	△ 0.4	17,312	△ 0.4	65.1	1.6	32.1	0.8
2024年1月末	17,662	4.3	18,119	4.3	66.2	1.6	31.1	0.7
2月末	18,281	8.0	18,756	7.9	65.4	1.9	31.6	0.7
3月末	18,835	11.2	19,325	11.2	65.4	1.6	31.8	0.7
4月末	18,891	11.6	19,391	11.6	64.9	2.0	31.9	0.7
5月末	19,083	12.7	19,592	12.8	65.5	1.8	31.6	0.7
6月末	19,718	16.4	20,244	16.5	65.4	1.8	31.7	0.7
7月末	19,153	13.1	19,663	13.2	64.4	1.3	33.2	0.7
8月末	18,858	11.4	19,407	11.7	66.4	2.0	30.5	0.7
9月末	18,864	11.4	19,435	11.9	65.3	1.9	31.8	0.8
10月末	19,616	15.8	20,210	16.3	65.3	1.8	31.8	0.8
11月末	19,553	15.5	20,151	16.0	65.7	1.5	31.8	0.8
(期末)2024年12月20日	19,853	17.2	20,462	17.8	65.0	1.4	32.7	0.7

(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12月21日～2024年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	230,216	732,008	127,531	395,408
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	184,153	822,548	124,443	562,420
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	766,449	705,556	267,300	246,196
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	211,987	370,374	75,526	131,193

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,582,214千円	114,352,720千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	235,088,359千円	977,996,782千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年12月21日～2024年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2040

親投資信託残高

2024年12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	371,277	473,962	1,548,339
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	387,978	447,688	2,240,548
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	664,546	1,163,695	1,061,406
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	307,887	444,348	804,670

(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78,631,231千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,877,475千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,192,059千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが52,655,680千口です。

投資信託財産の構成

2024年12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	1,548,339	27.3
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	2,240,548	39.6
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,061,406	18.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	804,670	14.2
コール・ローン等、その他	8,354	0.1
投資信託財産総額	5,663,319	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.95円、1カナダ・ドル109.52円、1オーストラリア・ドル98.36円、1香港ドル20.33円、1シンガポール・ドル116.02円、1ニュージーランド・ドル88.77円、1イギリス・ポンド197.28円、1イスラエル・シェケル43.247円、1スイス・フラン175.77円、1デンマーク・クローネ21.94円、1ノルウェー・クローネ13.79円、1スウェーデン・クローナ14.32円、1メキシコ・ペソ7.766円、1人民元21.598円、1マレーシア・リンギット35.028円、1南アフリカ・ランド8.56円、1ポーランド・ズロチ38.459円、1ユーロ163.70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（1,179,768,735千円）の投資信託財産総額（1,190,543,898千円）に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（95,324,044千円）の投資信託財産総額（95,746,756千円）に対する比率は99.6%です。
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（14,186,297千円）の投資信託財産総額（14,371,903千円）に対する比率は98.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

DCニッセイターゲットデットファンド2040

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年12月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	5,663,319,209円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,165,796
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,548,339,554
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,240,548,492
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	1,061,406,442
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	804,670,445
未 収 入 金	2,188,480
(B)負債	8,391,527
未 払 解 約 金	2,075,597
未 払 信 託 報 酬	6,287,451
そ の 他 未 払 費 用	28,479
(C)純 資 産 総 額 (A－B)	5,654,927,682
元 本	2,848,453,757
次 期 繰 越 損 益 金	2,806,473,925
(D)受 益 権 総 口 数	2,848,453,757口
1万口当たり基準価額 (C／D)	19,853円

(注) 期首元本額	2,155,369,705円
期中追加設定元本額	984,970,150円
期中一部解約元本額	291,886,098円

損益の状況

当期 (2023年12月21日～2024年12月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	3,520円
受 取 利 息	3,522
支 払 利 息	△ 2
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	662,503,718
売 買 益	732,085,793
売 買 損	△ 69,582,075
(C)信 託 報 酬 等	△ 11,562,203
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	650,945,035
(E)前 期 繰 越 損 益 金	543,220,475
(配 分 準 備 積 立 金) (	543,220,965)
(繰 越 欠 損 金) (△	490)
(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *	1,612,308,415
(配 当 等 相 当 額) (	882,873,266)
(売 買 損 益 相 当 額) (	729,435,149)
(G)合 計 (D + E + F)	2,806,473,925
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	2,806,473,925
追 加 信 託 差 損 益 金	1,612,308,415
(配 当 等 相 当 額) (	882,873,266)
(売 買 損 益 相 当 額) (	729,435,149)
分 配 準 備 積 立 金	1,194,165,510

- (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	3,520円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	650,941,025円
(c) 信託約款に定める収益調整金	1,612,308,415円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	543,220,965円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	2,806,473,925円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	9,852.62円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
4期(2020年12月21日)	12,107	0	6.7	12,107	12,302	7.4	71.1	2.2	25.8	0.6	682
5期(2021年12月20日)	13,997	0	15.6	13,997	14,297	16.2	70.5	1.9	26.4	1.0	1,665
6期(2022年12月20日)	13,874	0	△ 0.9	13,874	14,248	△ 0.3	69.1	2.2	27.5	0.9	2,343
7期(2023年12月20日)	17,092	0	23.2	17,092	17,630	23.7	70.1	1.8	27.0	0.9	4,020
8期(2024年12月20日)	20,297	0	18.8	20,297	21,041	19.4	69.6	1.5	27.9	0.7	6,185

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2023年12月20日	17,092	—	17,630	—	70.1	1.8	27.0	0.9
12月末	17,036	△ 0.3	17,572	△ 0.3	69.7	1.7	27.4	0.8
2024年1月末	17,897	4.7	18,459	4.7	70.7	1.7	26.5	0.8
2月末	18,565	8.6	19,149	8.6	70.0	2.0	26.9	0.8
3月末	19,168	12.1	19,773	12.2	70.0	1.8	27.1	0.8
4月末	19,244	12.6	19,859	12.6	69.4	2.1	27.3	0.7
5月末	19,473	13.9	20,101	14.0	70.0	1.9	26.9	0.8
6月末	20,163	18.0	20,814	18.1	69.9	2.0	27.1	0.7
7月末	19,546	14.4	20,176	14.4	69.2	1.4	28.3	0.8
8月末	19,200	12.3	19,875	12.7	70.8	2.1	25.9	0.8
9月末	19,206	12.4	19,900	12.9	69.8	2.0	27.1	0.8
10月末	20,032	17.2	20,756	17.7	69.8	1.9	27.1	0.8
11月末	19,972	16.8	20,702	17.4	70.3	1.6	27.0	0.8
(期末)2024年12月20日	20,297	18.8	21,041	19.4	69.6	1.5	27.9	0.7

(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12月21日～2024年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	260,086	826,515	136,863	424,876
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	207,153	924,895	135,403	610,890
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	582,599	536,133	218,398	201,222
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	247,658	432,301	90,741	157,349

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,582,214千円	114,352,720千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	235,088,359千円	977,996,782千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年12月21日～2024年12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12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	430,491	553,715	1,808,877
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	453,949	525,699	2,630,966
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	536,236	900,438	821,289
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	353,565	510,482	924,432

(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78,631,231千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,877,475千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,192,059千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが52,655,680千口です。

投資信託財産の構成

2024年12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	1,808,877	29.2
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	2,630,966	42.4
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	821,289	13.2
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	924,432	14.9
コール・ローン等、その他	17,934	0.3
投資信託財産総額	6,203,500	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.95円、1カナダ・ドル109.52円、1オーストラリア・ドル98.36円、1香港ドル20.33円、1シンガポール・ドル116.02円、1ニュージーランド・ドル88.77円、1イギリス・ポンド197.28円、1イスラエル・シェケル43.247円、1スイス・フラン175.77円、1デンマーク・クローネ21.94円、1ノルウェー・クローネ13.79円、1スウェーデン・クローナ14.32円、1メキシコ・ペソ7.766円、1人民元21.598円、1マレーシア・リンギット35.028円、1南アフリカ・ランド8.56円、1ポーランド・ズロチ38.459円、1ユーロ163.70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（1,179,768,735千円）の投資信託財産総額（1,190,543,898千円）に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（95,324,044千円）の投資信託財産総額（95,746,756千円）に対する比率は99.6%です。
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（14,186,297千円）の投資信託財産総額（14,371,903千円）に対する比率は98.7%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12月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	6,203,500,358円
コール・ローン等	6,673,185
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,808,877,520
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,630,966,310
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	821,289,787
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	924,432,538
未収入金	11,261,018
(B)負債	17,974,965
未払解約金	11,137,582
未払信託報酬	6,806,542
その他未払費用	30,841
(C)純資産総額(A-B)	6,185,525,393
元本	3,047,478,507
次期繰越損益金	3,138,046,886
(D)受益権総口数	3,047,478,507口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,297円

(注) 期首元本額	2,352,336,829円
期中追加設定元本額	1,028,845,334円
期中一部解約元本額	333,703,656円

損益の状況

当期(2023年12月21日～2024年12月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	3,816円
受取利息	3,818
支払利息	△ 2
(B)有価証券売買損益	784,036,043
売買益	855,149,971
売買損	△ 71,113,928
(C)信託報酬等	△ 12,603,406
(D)当期損益金(A+B+C)	771,436,453
(E)前期繰越損益金	640,973,600
(分配準備積立金)	(640,974,121)
(繰越欠損金)	(△ 521)
(F)追加信託差損益金*	1,725,636,833
(配当等相当額)	(1,218,689,985)
(売買損益相当額)	(506,946,848)
(G)合計(D+E+F)	3,138,046,886
次期繰越損益金(G)	3,138,046,886
追加信託差損益金	1,725,636,833
(配当等相当額)	(1,218,689,985)
(売買損益相当額)	(506,946,848)
分配準備積立金	1,412,410,053

- (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	3,816円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	771,432,116円
(c) 信託約款に定める収益調整金	1,725,636,833円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	640,974,121円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	3,138,046,886円
(f) 分配対象額 (1 万口当たり)	10,297.19円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1 万口当たり)	0円

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2020年12月21日)	12,328	0	6.8	12,328	12,455	7.6	73.0	2.2	23.8	0.7	146
3期(2021年12月20日)	14,312	0	16.1	14,312	14,533	16.7	72.3	1.9	24.5	1.0	680
4期(2022年12月20日)	14,202	0	△ 0.8	14,202	14,498	△ 0.2	71.1	2.2	25.4	0.9	961
5期(2023年12月20日)	17,581	0	23.8	17,581	18,027	24.3	71.8	1.9	25.2	0.9	1,732
6期(2024年12月20日)	20,997	0	19.4	20,997	21,644	20.1	71.6	1.5	25.9	0.7	2,926

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2023年12月20日	17,581	—	18,027	—	71.8	1.9	25.2	0.9
12月末	17,526	△ 0.3	17,970	△ 0.3	71.7	1.8	25.4	0.9
2024年1月末	18,442	4.9	18,909	4.9	72.6	1.8	24.5	0.8
2月末	19,148	8.9	19,635	8.9	71.9	2.1	24.9	0.8
3月末	19,789	12.6	20,293	12.6	71.9	1.8	25.1	0.8
4月末	19,876	13.1	20,391	13.1	71.4	2.2	25.2	0.8
5月末	20,129	14.5	20,657	14.6	71.9	2.0	24.9	0.8
6月末	20,861	18.7	21,409	18.8	71.9	2.0	25.1	0.8
7月末	20,203	14.9	20,734	15.0	71.3	1.4	26.1	0.8
8月末	19,825	12.8	20,406	13.2	72.8	2.1	23.9	0.8
9月末	19,830	12.8	20,431	13.3	71.8	2.0	25.0	0.8
10月末	20,711	17.8	21,339	18.4	71.8	2.0	25.1	0.8
11月末	20,652	17.5	21,286	18.1	72.3	1.6	25.0	0.8
(期末)2024年12月20日	20,997	19.4	21,644	20.1	71.6	1.5	25.9	0.7

(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12月21日～2024年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	151,520	483,626	72,391	226,183
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	127,167	569,754	71,467	325,278
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	249,274	229,148	95,915	88,301
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	144,464	252,594	51,797	90,210

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,582,214千円	114,352,720千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	235,088,359千円	977,996,782千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年12月21日～2024年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2050

親投資信託残高

2024年12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	189,855	268,984	878,719
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	200,686	256,386	1,283,135
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	192,579	345,937	315,529
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	155,482	248,148	449,372

(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78,631,231千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,877,475千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,192,059千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが52,655,680千口です。

投資信託財産の構成

2024年12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	878,719	29.8
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,283,135	43.5
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	315,529	10.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	449,372	15.2
コール・ローン等、その他	23,049	0.8
投資信託財産総額	2,949,807	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.95円、1カナダ・ドル109.52円、1オーストラリア・ドル98.36円、1香港ドル20.33円、1シンガポール・ドル116.02円、1ニュージーランド・ドル88.77円、1イギリス・ポンド197.28円、1イスラエル・シェケル43.247円、1スイス・フラン175.77円、1デンマーク・クローネ21.94円、1ノルウェー・クローネ13.79円、1スウェーデン・クローナ14.32円、1メキシコ・ペソ7.766円、1人民元21.598円、1マレーシア・リンギット35.028円、1南アフリカ・ランド8.56円、1ポーランド・ズロチ38.459円、1ユーロ163.70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（1,179,768,735千円）の投資信託財産総額（1,190,543,898千円）に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（95,324,044千円）の投資信託財産総額（95,746,756千円）に対する比率は99.6%です。
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（14,186,297千円）の投資信託財産総額（14,371,903千円）に対する比率は98.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

DCニッセイターゲットファンド2050

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年12月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	2,949,807,499円
コール・ローン等	3,143,311
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	878,719,743
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,283,135,264
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	315,529,810
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	449,372,969
未収入金	19,906,402
(B)負債	23,068,981
未払解約金	19,847,748
未払信託報酬	3,206,743
その他未払費用	14,490
(C)純資産総額(A-B)	2,926,738,518
元本	1,393,903,382
次期繰越損益金	1,532,835,136
(D)受益権総口数	1,393,903,382口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,997円
(注) 期首元本額	985,587,627円
期中追加設定元本額	606,770,616円
期中一部解約元本額	198,454,861円

損益の状況

当期(2023年12月21日~2024年12月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,698円
受取利息	1,699
支払利息	△ 1
(B)有価証券売買損益	352,376,683
売買益	392,741,290
売買損	△ 40,364,607
(C)信託報酬等	△ 5,777,759
(D)当期損益金(A+B+C)	346,600,622
(E)前期繰越損益金	227,185,098
(分配準備積立金)	(227,185,264)
(繰越欠損金)	(△ 166)
(F)追加信託差損益金*	959,049,416
(配当等相当額)	(459,195,457)
(売買損益相当額)	(499,853,959)
(G)合計(D+E+F)	1,532,835,136
次期繰越損益金(G)	1,532,835,136
追加信託差損益金	959,049,416
(配当等相当額)	(459,195,457)
(売買損益相当額)	(499,853,959)
分配準備積立金	573,785,720

- (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	1,698円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	346,598,758円
(c) 信託約款に定める収益調整金	959,049,416円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	227,185,264円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	1,532,835,136円
(f) 分配対象額 (1 万口当たり)	10,996.71円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1 万口当たり)	0円

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
5期(2020年12月21日)	14,629	0	6.9	14,629	14,964	7.8	75.0	2.3	21.8	0.7	653
6期(2021年12月20日)	17,047	0	16.5	17,047	17,528	17.1	74.1	2.0	22.6	1.0	1,303
7期(2022年12月20日)	16,932	0	△ 0.7	16,932	17,503	△ 0.1	73.0	2.3	23.4	1.0	1,936
8期(2023年12月20日)	21,081	0	24.5	21,081	21,885	25.0	73.7	1.9	23.2	0.9	3,361
9期(2024年12月20日)	25,298	0	20.0	25,298	26,410	20.7	73.4	1.5	24.1	0.8	5,094

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2023年12月20日	21,081	—	21,885	—	73.7	1.9	23.2	0.9
12月末	21,016	△ 0.3	21,818	△ 0.3	73.5	1.8	23.6	0.9
2024年1月末	22,144	5.0	22,988	5.0	74.3	1.8	22.8	0.8
2月末	23,010	9.2	23,890	9.2	73.6	2.1	23.1	0.8
3月末	23,799	12.9	24,712	12.9	73.6	1.9	23.3	0.8
4月末	23,914	13.4	24,840	13.5	73.1	2.3	23.5	0.8
5月末	24,234	15.0	25,182	15.1	73.6	2.0	23.2	0.8
6月末	25,137	19.2	26,121	19.4	73.5	2.1	23.3	0.8
7月末	24,324	15.4	25,276	15.5	73.1	1.5	24.3	0.8
8月末	23,846	13.1	24,858	13.6	74.4	2.2	22.2	0.8
9月末	23,853	13.1	24,887	13.7	73.5	2.1	23.2	0.9
10月末	24,942	18.3	26,025	18.9	73.5	2.0	23.4	0.9
11月末	24,874	18.0	25,963	18.6	74.0	1.6	23.2	0.9
(期末)2024年12月20日	25,298	20.0	26,410	20.7	73.4	1.5	24.1	0.8

(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12月21日～2024年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	247,633	788,948	146,852	459,797
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	206,312	918,813	148,597	669,782
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	351,426	323,505	154,506	142,259
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	242,118	422,595	111,188	193,493

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,582,214千円	114,352,720千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	235,088,359千円	977,996,782千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年12月21日～2024年12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12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	376,620	477,401	1,559,575
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	400,803	458,519	2,294,750
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	288,149	485,069	442,431
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	309,631	440,561	797,812

(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78,631,231千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,877,475千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,192,059千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが52,655,680千口です。

投資信託財産の構成

2024年12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	1,559,575	30.5
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	2,294,750	44.9
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	442,431	8.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	797,812	15.6
コール・ローン等、その他	17,220	0.3
投資信託財産総額	5,111,790	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.95円、1カナダ・ドル109.52円、1オーストラリア・ドル98.36円、1香港ドル20.33円、1シンガポール・ドル116.02円、1ニュージーランド・ドル88.77円、1イギリス・ポンド197.28円、1イスラエル・シェケル43.247円、1スイス・フラン175.77円、1デンマーク・クローネ21.94円、1ノルウェー・クローネ13.79円、1スウェーデン・クローナ14.32円、1メキシコ・ペソ7.766円、1人民元21.598円、1マレーシア・リンギット35.028円、1南アフリカ・ランド8.56円、1ポーランド・ズロチ38.459円、1ユーロ163.70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（1,179,768,735千円）の投資信託財産総額（1,190,543,898千円）に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（95,324,044千円）の投資信託財産総額（95,746,756千円）に対する比率は99.6%です。
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（14,186,297千円）の投資信託財産総額（14,371,903千円）に対する比率は98.7%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12月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	5,111,790,532円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,544,020
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,559,575,354
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,294,750,414
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	442,431,729
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	797,812,646
未 収 入 金	11,676,369
(B)負債	17,253,985
未 払 解 約 金	11,574,331
未 払 信 託 報 酬	5,654,043
そ の 他 未 払 費 用	25,611
(C)純 資 産 総 額 (A－B)	5,094,536,547
元 本	2,013,776,401
次 期 繰 越 損 益 金	3,080,760,146
(D)受 益 権 総 口 数	2,013,776,401口
1万口当たり基準価額 (C／D)	25,298円

(注) 期首元本額 1,594,382,095円
期中追加設定元本額 784,421,983円
期中一部解約元本額 365,027,677円

損益の状況

当期 (2023年12月21日～2024年12月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	3,118円
受 取 利 息	3,119
支 払 利 息	△ 1
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	661,879,843
売 買 益	747,803,714
売 買 損	△ 85,923,871
(C)信 託 報 酬 等	△ 10,516,439
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	651,366,522
(E)前 期 繰 越 損 益 金	483,647,755
(配 分 準 備 積 立 金) (483,648,148)	
(繰 越 欠 損 金) (△ 393)	
(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *	1,945,745,869
(配 当 等 相 当 額) (1,294,520,347)	
(売 買 損 益 相 当 額) (651,225,522)	
(G)合 計 (D + E + F)	3,080,760,146
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	3,080,760,146
追 加 信 託 差 損 益 金	1,945,745,869
(配 当 等 相 当 額) (1,294,520,347)	
(売 買 損 益 相 当 額) (651,225,522)	
分 配 準 備 積 立 金	1,135,014,277

(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	3,118円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	651,363,011円
(c) 信託約款に定める収益調整金	1,945,745,869円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	483,648,148円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	3,080,760,146円
(f) 分配対象額 (1 万口当たり)	15,298.42円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1 万口当たり)	0円

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2020年12月21日)	12,428	0	7.1	12,428	12,568	8.0	76.7	2.4	20.0	0.7	175
3期(2021年12月20日)	14,537	0	17.0	14,537	14,778	17.6	76.0	2.0	20.6	1.1	855
4期(2022年12月20日)	14,453	0	△ 0.6	14,453	14,770	△ 0.1	74.7	2.3	21.6	1.0	1,380
5期(2023年12月20日)	18,090	0	25.2	18,090	18,565	25.7	75.6	2.0	21.2	0.9	2,570
6期(2024年12月20日)	21,815	0	20.6	21,815	22,520	21.3	75.2	1.6	22.2	0.8	4,150

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2023年12月20日	18,090	—	18,565	—	75.6	2.0	21.2	0.9
12月末	18,037	△ 0.3	18,510	△ 0.3	75.3	1.8	21.7	0.9
2024年1月末	19,032	5.2	19,531	5.2	76.0	1.9	21.0	0.9
2月末	19,793	9.4	20,316	9.4	75.4	2.2	21.3	0.8
3月末	20,489	13.3	21,032	13.3	75.4	1.9	21.5	0.8
4月末	20,595	13.8	21,149	13.9	74.9	2.3	21.7	0.8
5月末	20,886	15.5	21,456	15.6	75.4	2.1	21.3	0.8
6月末	21,682	19.9	22,274	20.0	75.3	2.1	21.5	0.8
7月末	20,963	15.9	21,537	16.0	75.0	1.5	22.3	0.8
8月末	20,530	13.5	21,163	14.0	76.2	2.2	20.4	0.9
9月末	20,535	13.5	21,186	14.1	75.3	2.1	21.4	0.9
10月末	21,498	18.8	22,181	19.5	75.3	2.1	21.5	0.9
11月末	21,442	18.5	22,131	19.2	75.8	1.7	21.4	0.9
(期末)2024年12月20日	21,815	20.6	22,520	21.3	75.2	1.6	22.2	0.8

(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12月21日～2024年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	254,475	811,070	150,991	473,258
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	222,064	984,501	154,071	690,689
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	251,626	231,780	116,916	107,691
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	245,652	428,306	119,617	207,926

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,582,214千円	114,352,720千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	235,088,359千円	977,996,782千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年12月21日～2024年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイターゲットデートファンド2060

親投資信託残高

2024年12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	295,427	398,911	1,303,162
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	314,718	382,711	1,915,355
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	160,539	295,249	269,296
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	239,915	365,950	662,699

(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78,631,231千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,877,475千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,192,059千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが52,655,680千口です。

投資信託財産の構成

2024年12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	1,303,162	31.3
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,915,355	46.0
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	269,296	6.5
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	662,699	15.9
コール・ローン等、その他	17,075	0.4
投資信託財産総額	4,167,590	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.95円、1カナダ・ドル109.52円、1オーストラリア・ドル98.36円、1香港ドル20.33円、1シンガポール・ドル116.02円、1ニュージーランド・ドル88.77円、1イギリス・ポンド197.28円、1イスラエル・シェケル43.247円、1スイス・フラン175.77円、1デンマーク・クローネ21.94円、1ノルウェー・クローネ13.79円、1スウェーデン・クローナ14.32円、1メキシコ・ペソ7.766円、1人民元21.598円、1マレーシア・リンギット35.028円、1南アフリカ・ランド8.56円、1ポーランド・ズロチ38.459円、1ユーロ163.70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（1,179,768,735千円）の投資信託財産総額（1,190,543,898千円）に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（95,324,044千円）の投資信託財産総額（95,746,756千円）に対する比率は99.6%です。
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（14,186,297千円）の投資信託財産総額（14,371,903千円）に対する比率は98.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

DCニッセイターゲットファンド2060

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年12月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	4,167,590,305円
コール・ローン等	4,542,253
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,303,162,872
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,915,355,878
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	269,296,777
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	662,699,177
未収入金	12,533,348
(B)負債	17,102,948
未払解約金	12,450,374
未払信託報酬	4,631,606
その他未払費用	20,968
(C)純資産総額(A-B)	4,150,487,357
元本	1,902,549,561
次期繰越損益金	2,247,937,796
(D)受益権総口数	1,902,549,561口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,815円

(注) 期首元本額	1,421,187,479円
期中追加設定元本額	974,266,359円
期中一部解約元本額	492,904,277円

損益の状況

当期(2023年12月21日~2024年12月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	2,491円
受取利息	2,492
支払利息	△ 1
(B)有価証券売買損益	514,078,586
売買益	599,237,192
売買損	△ 85,158,606
(C)信託報酬等	△ 8,491,094
(D)当期損益金(A+B+C)	505,589,983
(E)前期繰越損益金	277,794,660
(分配準備積立金)	(277,794,881)
(繰越欠損金)	(△ 221)
(F)追加信託差損益金*	1,464,553,153
(配当等相当額)	(636,723,073)
(売買損益相当額)	(827,830,080)
(G)合計(D+E+F)	2,247,937,796
次期繰越損益金(G)	2,247,937,796
追加信託差損益金	1,464,553,153
(配当等相当額)	(636,723,073)
(売買損益相当額)	(827,830,080)
分配準備積立金	783,384,643

- (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	2,491円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	505,587,271円
(c) 信託約款に定める収益調整金	1,464,553,153円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	277,794,881円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	2,247,937,796円
(f) 分配対象額 (1 万口当たり)	11,815.40円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1 万口当たり)	0円

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2022年1月11日	10,000	—	—	10,000	10,000	—	—	—	—	—	1
1期(2022年12月20日)	9,679	0	△ 3.2	9,679	9,730	△ 2.7	75.5	2.4	20.8	1.0	101
2期(2023年12月20日)	12,148	0	25.5	12,148	12,264	26.0	76.6	2.0	20.2	0.9	499
3期(2024年12月20日)	14,710	0	21.1	14,710	14,942	21.8	76.7	1.6	20.7	0.8	2,059

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注3) 「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4) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注5) 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6) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注7) 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。

(注8) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

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	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2023年12月20日	12,148	—	12,264	—	76.6	2.0	20.2	0.9
12月末	12,114	△ 0.3	12,229	△ 0.3	76.8	1.9	20.2	0.9
2024年1月末	12,796	5.3	12,920	5.3	77.4	1.9	19.5	0.9
2月末	13,318	9.6	13,448	9.7	76.9	2.2	19.8	0.8
3月末	13,796	13.6	13,932	13.6	76.9	1.9	19.9	0.9
4月末	13,872	14.2	14,014	14.3	76.4	2.4	20.1	0.8
5月末	14,076	15.9	14,226	16.0	76.8	2.1	19.8	0.8
6月末	14,622	20.4	14,779	20.5	76.8	2.2	20.0	0.8
7月末	14,127	16.3	14,280	16.4	76.7	1.5	20.6	0.9
8月末	13,823	13.8	14,023	14.3	77.6	2.3	19.0	0.9
9月末	13,827	13.8	14,038	14.5	76.8	2.2	19.8	0.9
10月末	14,490	19.3	14,712	20.0	76.7	2.1	20.0	0.9
11月末	14,454	19.0	14,680	19.7	77.3	1.7	19.8	0.9
(期末)2024年12月20日	14,710	21.1	14,942	21.8	76.7	1.6	20.7	0.8

(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12月21日～2024年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	245,772	790,185	102,187	323,707
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	235,292	1,062,419	103,196	468,375
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	137,646	126,355	56,533	51,982
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	223,835	392,945	87,171	152,286

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,582,214千円	114,352,720千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	235,088,359千円	977,996,782千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17	0.11

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年12月21日～2024年12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12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	58,157	201,742	659,052
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	61,971	194,066	971,245
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	24,857	105,970	96,655
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	47,249	183,913	333,049

(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78,631,231千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,877,475千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,192,059千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが52,655,680千口です。

投資信託財産の構成

2024年12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	659,052	31.9
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	971,245	47.0
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	96,655	4.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	333,049	16.1
コール・ローン等、その他	7,945	0.4
投資信託財産総額	2,067,948	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.95円、1カナダ・ドル109.52円、1オーストラリア・ドル98.36円、1香港ドル20.33円、1シンガポール・ドル116.02円、1ニュージーランド・ドル88.77円、1イギリス・ポンド197.28円、1イスラエル・シェケル43.247円、1スイス・フラン175.77円、1デンマーク・クローネ21.94円、1ノルウェー・クローネ13.79円、1スウェーデン・クローナ14.32円、1メキシコ・ペソ7.766円、1人民元21.598円、1マレーシア・リンギット35.028円、1南アフリカ・ランド8.56円、1ポーランド・ズロチ38.459円、1ユーロ163.70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（1,179,768,735千円）の投資信託財産総額（1,190,543,898千円）に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（95,324,044千円）の投資信託財産総額（95,746,756千円）に対する比率は99.6%です。
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（14,186,297千円）の投資信託財産総額（14,371,903千円）に対する比率は98.7%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12月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	2,067,948,310円
コール・ローン等	2,013,920
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	659,052,245
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	971,245,758
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	96,655,688
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	333,049,313
未収入金	5,931,386
(B)負債	7,958,777
未払解約金	5,890,729
未払信託報酬	2,058,778
その他未払費用	9,270
(C)純資産総額(A-B)	2,059,989,533
元本	1,400,422,243
次期繰越損益金	659,567,290
(D)受益権総口数	1,400,422,243口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,710円

(注) 期首元本額 411,452,351円
期中追加設定元本額 1,582,495,991円
期中一部解約元本額 593,526,099円

損益の状況

当期(2023年12月21日～2024年12月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	909円
受取利息	909
(B)有価証券売買損益	141,667,783
売買益	186,253,185
売買損	△ 44,585,402
(C)信託報酬等	△ 3,101,463
(D)当期損益金(A+B+C)	138,567,229
(E)前期繰越損益金 (分配準備積立金)	19,540,715 (19,540,715)
(F)追加信託差損益金* (配当等相当額) (売買損益相当額)	501,459,346 (111,377,065) (390,082,281)
(G)合計(D+E+F)	659,567,290
次期繰越損益金(G)	659,567,290
追加信託差損益金 (配当等相当額) (売買損益相当額) 分配準備積立金	501,459,346 (111,377,065) (390,082,281) 158,107,944

(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	909円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	138,566,320円
(c) 信託約款に定める収益調整金	501,459,346円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	19,540,715円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	659,567,290円
(f) 分配対象額 (1 万口当たり)	4,709.77円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1 万口当たり)	0円

設定以来の運用実績

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	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2024年4月30日	10,000	－	－	10,000	10,000	－	－	－	－	－	1
1期(2024年12月20日)	10,797	0	8.0	10,797	10,860	8.6	76.7	1.6	20.6	0.8	47

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。以下同じです。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

(注3) 「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4) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注5) 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6) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

(注7) 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。

(注8) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

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	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(設定日)2024年4月30日	10,000	－	10,000	－	－	－	－	－
4月末	10,186	1.9	10,185	1.9	76.4	2.4	20.1	0.8
5月末	10,334	3.3	10,339	3.4	76.9	2.1	19.8	0.8
6月末	10,733	7.3	10,741	7.4	76.7	2.2	20.0	0.8
7月末	10,370	3.7	10,378	3.8	76.6	1.5	20.7	0.9
8月末	10,146	1.5	10,191	1.9	77.6	2.3	18.9	0.9
9月末	10,150	1.5	10,202	2.0	76.8	2.2	19.9	0.9
10月末	10,636	6.4	10,692	6.9	76.6	2.1	20.1	0.9
11月末	10,609	6.1	10,669	6.7	77.3	1.7	19.9	0.9
(期末)2024年12月20日	10,797	8.0	10,860	8.6	76.7	1.6	20.6	0.8

(注) 期末基準価額は分配金（税引前）込み、騰落率は設定日比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2024年4月30日～2024年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	5,709	18,493	1,022	3,289
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	5,552	26,356	1,050	5,015
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,975	2,725	515	471
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	5,163	9,102	897	1,594

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	32,106,824千円	91,884,383千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	243,977,221千円	1,032,134,512千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.13	0.08

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2024年4月30日～2024年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイターゲットデットファンド2070

親投資信託残高

2024年12月20日現在

種類	当期末	
	口数	評価額
	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	4,687	15,311
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	4,502	22,535
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,460	2,244
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	4,266	7,725

(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78,631,231千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが236,877,475千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,192,059千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが52,655,680千口です。

投資信託財産の構成

2024年12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	15,311	32.0
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	22,535	47.1
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,244	4.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	7,725	16.2
コール・ローン等、その他	11	0.0
投資信託財産総額	47,828	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.95円、1カナダ・ドル109.52円、1オーストラリア・ドル98.36円、1香港ドル20.33円、1シンガポール・ドル116.02円、1ニュージーランド・ドル88.77円、1イギリス・ポンド197.28円、1イスラエル・シェケル43.247円、1スイス・フラン175.77円、1デンマーク・クローネ21.94円、1ノルウェー・クローネ13.79円、1スウェーデン・クローナ14.32円、1メキシコ・ペソ7.766円、1人民元21.598円、1マレーシア・リンギット35.028円、1南アフリカ・ランド8.56円、1ポーランド・ズロチ38.459円、1ユーロ163.70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（1,179,768,735千円）の投資信託財産総額（1,190,543,898千円）に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（95,324,044千円）の投資信託財産総額（95,746,756千円）に対する比率は99.6%です。
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（14,186,297千円）の投資信託財産総額（14,371,903千円）に対する比率は98.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

DCニッセイターゲットファンド2070

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年12月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	47,828,623円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	11,030
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	15,311,886
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	22,535,033
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	2,244,243
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	7,725,523
未 収 入 金	908
(B)負債	12,247
未 払 信 託 報 酬	12,211
そ の 他 未 払 費 用	36
(C)純 資 産 総 額 (A－B)	47,816,376
元 本	44,288,062
次 期 繰 越 損 益 金	3,528,314
(D)受 益 権 総 口 数	44,288,062口
1万口当たり基準価額 (C／D)	10,797円

(注) 設定元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	52,670,866円
期中一部解約元本額	9,382,804円

損益の状況

当期 (2024年4月30日～2024年12月20日)

項目	当期
(A)有 価 証 券 売 買 損 益	1,295,467円
売 買 益	1,511,694
売 買 損	△ 216,227
(B)信 託 報 酬 等	△ 17,796
(C)当 期 損 益 金 (A + B)	1,277,671
(D)追 加 信 託 差 損 益 金 *	2,250,643
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,250,643)
(E)合 計 (C + D)	3,528,314
次 期 繰 越 損 益 金 (E)	3,528,314
追 加 信 託 差 損 益 金	2,250,643
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,250,643)
分 配 準 備 積 立 金	1,277,671

- (注1) (A)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) (B)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) (D)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。設定時の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,277,671円
(c) 信託約款に定める収益調整金	2,250,643円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	0円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	3,528,314円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	796.67円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■ 自社による<2070>の設定解約状況

当期 設定元本	当期 解約元本	当期末残高			取引の理由
		元本	評価額	比率	
百万円	百万円	百万円	百万円	%	
1	－	1	1	2.3	当初設定時における取得

(注) 元本および評価額の単位未満は切り捨てています。なお当社は自社による当ファンドの保有分を解約することがあります。

各ファンドの概要

商 品 分 類				追加型投信／内外／資産複合	
信 託 期 間				2025：2017年7月31日～2036年12月22日	2030：2019年1月10日～2041年12月20日
				2035：2017年7月31日～2046年12月20日	2040：2019年1月10日～2051年12月20日
				2045：2017年7月31日～2056年12月20日	2050：2019年1月10日～2061年12月20日
				2055：2016年7月29日～2066年12月20日	2060：2019年1月10日～2071年12月21日
				2065：2022年1月11日～2076年12月21日	2070：2024年4月30日～2081年12月22日
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、実質的に日本を含む各国の株式（リート（不動産投資信託）を含みます）、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。	
主要運用対象	DCニッセイターゲット デ ー ト フ ァ ン ド 2 0 2 5 / 2 0 3 0 / 2 0 3 5 / 2 0 4 0 / 2 0 4 5 / 2 0 5 0 / 2 0 5 5 / 2 0 6 0 / 2 0 6 5 / 2 0 7 0			「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」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」「ニッセイＪ－ＲＥＩＴインデックスマザーファンド」「ニッセイグローバルリートマザーファンド」「ニッセイマネーマーケットマザーファンド」 受益証券 ※将来の市場構造の変化などによっては、マザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。	
	ニ ッ セ イ 国 内 株 式 インデックスマザーファンド			国内の金融商品取引所上場株式等	
	ニ ッ セ イ 外 国 株 式 インデックスマザーファンド			日本を除く主要先進国の株式	
	ニ ッ セ イ 国 内 債 券 パッシブマザーファンド			国内の公社債	
	ニ ッ セ イ 外 国 債 券 インデックスマザーファンド			日本を除く主要国の国債	
	ニッセイＪ－ＲＥＩＴ インデックスマザーファンド			国内の金融商品取引所に上場しているＪリート	
	ニッセイグローバル リートマザーファンド			日本を除く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）しているリート	
	ニッセイマネーマーケット マザ ー フ ァ ン ド			円建ての短期公社債および短期金融商品	

運用方法	DCニッセイターゲット デットファンド 2025/2030/ 2035/2040/ 2045/2050/ 2055/2060/ 2065/2070	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに 限ります。
	ニッセイ外国債券 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得 に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とし ます。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	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。
	ニッセイグローバル リートマザーファンド	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。ただし、S & Pグローバルリートインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース)における時価の構成割合が 30%を超えるリートがある場合には、当該リートを同インデックス 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割合には、制限を設けません。
	ニッセイマネーマーケット 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。 ・外貨建資産への投資は行いません。
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、残存信託期間等を勘案し て決定します。

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 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。



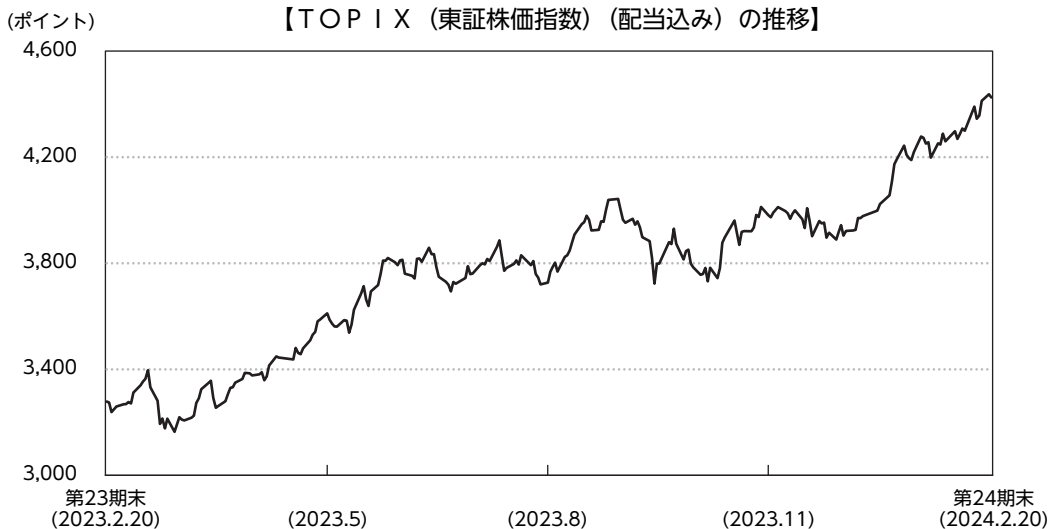
ニッセイアセットマネジメント株式会社

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。

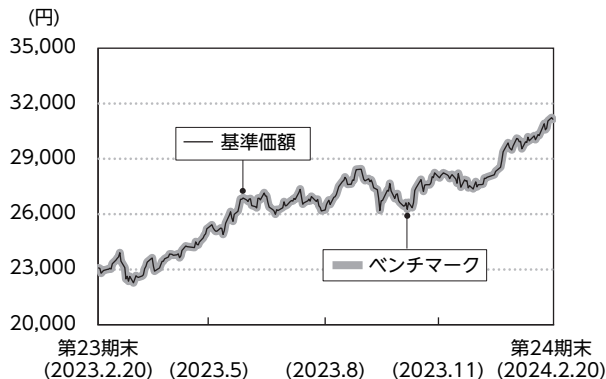
当期の国内株式市場はおおむね上昇基調で推移しました。

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。

(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

ポートフォリオ

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

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

お知らせ

■約款変更

ベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化しました。

(2023年8月19日)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	%		%	%	%	百万円
20期(2020年 2月20日)	18,004	6.4	18,182	6.4	98.3	1.6	68,225
21期(2021年 2月22日)	21,336	18.5	21,558	18.6	99.3	0.7	170,293
22期(2022年 2月21日)	21,482	0.7	21,702	0.7	96.1	3.7	117,060
23期(2023年 2月20日)	23,077	7.4	23,334	7.5	97.9	2.1	187,428
24期(2024年 2月20日)	31,139	34.9	31,493	35.0	98.8	1.0	224,002

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率
	円	%		%	%	%
(期首)2023年 2月20日	23,077	—	23,334	—	97.9	2.1
2月末	23,009	△ 0.3	23,267	△ 0.3	98.0	1.7
3月末	23,396	1.4	23,663	1.4	97.3	2.7
4月末	24,024	4.1	24,301	4.1	97.1	2.7
5月末	24,892	7.9	25,180	7.9	96.9	3.1
6月末	26,770	16.0	27,081	16.1	97.2	2.8
7月末	27,171	17.7	27,485	17.8	98.3	1.8
8月末	27,286	18.2	27,604	18.3	97.6	2.4
9月末	27,429	18.9	27,744	18.9	96.5	3.6
10月末	26,611	15.3	26,914	15.3	97.4	2.5
11月末	28,049	21.5	28,374	21.6	97.9	2.1
12月末	27,989	21.3	28,309	21.3	97.4	2.8
2024年 1月末	30,174	30.8	30,521	30.8	98.2	1.8
(期末)2024年 2月20日	31,139	34.9	31,493	35.0	98.8	1.0

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2023年2月21日～2024年2月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	0	0.001	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（26,547円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2023年2月21日～2024年2月20日

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		7,499	15,648,076	14,224	29,977,664
		(23,418)			

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

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

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2023年2月21日～2024年2月20日

株式

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

組入有価証券明細表

2024年2月20日現在

(1) 国内株式
上場株式

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
建設業(2.0%)			
ショーボンドホールディングス	12	11	69,935
ミライト・ワン	31	27	48,413
タマホーム	6	5	20,644
ファーストコーポレーション	1	1	1,027
安藤・間	51	48	59,237
東急建設	25	26	21,060
コムシスホールディングス	30	26	88,006
ビーアールホールディングス	14	17	6,446
高松コンストラクショングループ	5	6	16,839
東建コーポレーション	2	2	20,139
ソネック	4	1	1,387
ヤマウラ	4	4	6,300
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	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大林組	223	208	295,048
清水建設	187	164	147,321
飛島建設	6	6	8,820
長谷工コーポレーション	64	53	100,097
松井建設	8	7	6,650
銭高組	1	—	—
鹿島建設	138	128	359,437
不動テトラ	4	4	8,844
鉄建建設	4	4	10,378
西松建設	10	11	50,727
三井住友建設	50	43	18,575
大豊建設	2	2	6,400
佐田建設	10	2	1,505
ナカノフドー建設	15	0.100	64
奥村組	10	9	47,470
東鉄工業	8	7	21,888
浅沼組	5	4	17,909
戸田建設	76	78	75,575
熊谷組	10	9	36,912
植木組	3	0.900	1,635
矢作建設工業	8	7	12,624
ピーエス三菱	7	7	7,784
日本ハウスホールディングス	13	21	6,447
新日本建設	8	8	10,184
東亜道路工業	1	2	14,858
日本道路	1	6	13,749
東亜建設工業	5	4	20,947
日本国土開発	18	16	8,613
若築建設	2	2	6,594
東洋建設	20	14	19,213
五洋建設	88	82	62,797
世紀東急工業	8	7	14,520
福田組	2	2	11,726
住友林業	47	50	205,374
日本基礎技術	8	8	3,661
巴コーポレーション	10	6	3,960
大和ハウス工業	174	160	698,193
ライト工業	11	12	22,596
積水ハウス	195	176	580,356
日特建設	6	5	6,501
北陸電気工事	7	5	6,864

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フランスベッドホールディングス	7	7	10,048
パイロットコーポレーション	10	8	32,287
萩原工業	4	—	—
フジシールインターナショナル	12	12	24,300
タカラトミー	29	27	62,842
広済堂ホールディングス	4	15	10,235
プロネクサス	5	6	7,448
大建工業	3	—	—
TOPPANホールディングス	83	72	256,024
大日本印刷	75	64	291,405
共同印刷	1	1	5,994
NISSHA	12	10	15,220
TAKARA & COMPANY	4	3	9,842
アシックス	58	50	295,374
ツツミ	2	3	6,288
ローランド	4	4	21,582
小松ウオール工業	2	2	8,016
ヤマハ	40	37	120,428
河合楽器製作所	1	1	6,102
クリナップ	—	7	5,306
ピジョン	40	37	60,309
兼松サステック	0.400	—	—
キングジム	5	7	6,424
リンテック	12	11	35,938
イトーキ	13	12	24,151
任天堂	402	374	3,092,840
三菱鉛筆	9	8	20,487
タカラスタANDARD	12	12	23,087
コクヨ	30	24	60,130
ナカバヤシ	9	11	6,236
グローブライド	5	5	10,743
オカムラ	19	17	38,928
美津濃	6	5	30,975
電気・ガス業(1.3%)			
東京電力ホールディングス	574	534	424,848
中部電力	234	218	418,646
関西電力	245	228	446,126
中国電力	101	103	101,928
北陸電力	60	60	43,662
東北電力	155	156	154,367
四国電力	54	55	57,463

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
円谷フィールズホールディングス	5	10	17,258
双日	71	69	263,355
アルフレッサ ホールディングス	67	63	146,097
横浜冷凍	18	17	18,211
アルコニックス	8	8	11,520
神戸物産	52	48	182,505
ハイパー	4	4	1,386
あい ホールディングス	10	10	24,450
ディーブイエックス	4	4	4,332
ダイワボウホールディングス	27	27	74,337
マクニカホールディングス	16	14	120,768
ラクト・ジャパン	2	2	6,224
グリムス	2	3	5,793
パイタルケー・エスケー・ホールディングス	9	9	12,331
八洲電機	5	5	6,803
メディアスホールディングス	7	8	6,158
レスターホールディングス	6	5	15,746
ジオリーグループ	4	—	—
OCHIホールディングス	3	—	—
TOKAIホールディングス	33	34	34,202
Cominix	6	—	—
三洋貿易	6	7	9,478
ビューティガレージ	1	2	6,522
ウイン・パートナーズ	4	5	6,492
シップヘルスケアホールディングス	24	22	49,443
明治電機工業	4	4	6,569
コメダホールディングス	16	15	42,334
アセンテック	11	10	6,478
フルサト・マルカホールディングス	6	5	12,605
ヤマエグループホールディングス	3	3	8,809
小野建	6	6	10,924
南陽	2	1	3,441
佐島電機	4	3	8,970
伯東	3	3	21,420
コンドーテック	5	5	6,196
中山福	14	0.100	36
ナガイレーベン	8	7	18,675
三菱食品	6	5	29,174
松田産業	5	4	11,520
第一興商	13	24	46,546
メディ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	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
S P K	3	3	6,585
萩原電気ホールディングス	2	2	13,311
アズワン	9	9	51,832
スズデン	2	2	5,764
シモジマ	5	4	6,134
ドウシシャ	7	5	12,342
小津産業	2	2	3,852
高速	3	3	8,924
丸文	6	5	8,484
ハピネット	5	5	17,357
橋本総業ホールディングス	4	4	6,114
日本ライフライン	19	18	23,404
I D O M	20	16	14,740
進和	4	3	9,226
ダイترون	2	2	7,312
シークス	9	8	14,426
田中商事	8	—	—
オーハシテクニカ	3	3	6,249
白銅	2	2	6,843
伊藤忠商事	415	421	2,781,111
丸紅	532	523	1,287,887
長瀬産業	31	28	70,660
蝶理	3	3	11,649
豊田通商	59	54	503,652
三共生興	10	8	6,690
兼松	26	26	61,701
三井物産	493	472	3,010,462
日本紙パルプ商事	3	3	15,060
カメイ	7	6	12,582
OUGホールディングス	1	1	4,515
スターゼン	5	4	11,876
山善	18	19	24,472
椿本興業	1	1	8,931
住友商事	417	379	1,354,792
内田洋行	3	2	19,675
三菱商事	421	1,242	3,889,034
第一実業	2	5	11,693
キャノンマーケティングジャパン	15	14	61,842
西華産業	3	2	7,450
佐藤商事	4	4	7,568
菱洋エレクトロ	5	5	23,482

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京産業	6	8	6,273
ユアサ商事	6	4	24,745
神鋼商事	1	1	11,536
阪和興業	12	11	63,506
正栄食品工業	4	4	19,530
カナデン	5	4	7,299
R Y O D E N	5	5	13,428
岩谷産業	15	14	105,033
ナイス	2	2	4,640
極東貿易	4	3	7,921
アステナホールディングス	11	13	6,270
三愛オブリ	18	15	29,037
稲畑産業	13	12	39,184
G S I クレオス	3	3	8,166
明和産業	9	9	6,726
クワザワホールディングス	10	—	—
ワキタ	12	10	16,588
東邦ホールディングス	16	17	56,306
サンゲツ	16	14	51,624
ミツウロコグループホールディングス	8	8	12,096
シナネンホールディングス	2	1	7,097
伊藤忠エネクス	16	15	23,482
サンリオ	19	17	133,037
サンワ テクノス	3	3	7,302
リョーサン	7	4	22,660
新光商事	9	8	10,315
トーホー	2	2	6,890
三信電気	2	2	6,024
東陽テクニカ	7	6	9,600
モスフードサービス	9	9	31,970
加賀電子	5	5	36,936
ソーダニッカ	—	5	6,238
立花エレテック	4	4	13,062
P A L T A C	10	8	37,051
三谷産業	15	17	6,776
西本Wismettacホールディングス	1	1	10,768
K P P グループホールディングス	15	16	10,238
ヤマタネ	3	2	7,154
丸紅建材'リース	2	—	—
日鉄物産	4	—	—
泉州電業	3	2	10,904

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フルキャストホールディングス	6	5	8,572
エン・ジャパン	11	9	27,343
テクノプロ・ホールディングス	43	35	117,453
インターワークス	12	—	—
アイ・アールジャパンホールディングス	3	4	5,719
K e e P e r 技研	4	3	25,156
三機サービス	4	—	—
イー・ガーディアン	2	4	5,504
リブセンス	1	—	—
ジャパンマテリアル	20	18	49,159
ベクトル	10	7	9,420
ウチヤマホールディングス	15	—	—
チャーム・ケア・コーポレーション	5	5	7,282
キャリアリンク	2	2	6,364
I B J	5	9	5,391
アサンテ	3	3	6,399
バリューHR	5	5	7,239
M&Aキャピタルパートナーズ	6	4	12,215
ライドオンエクスプレスホールディングス	4	6	6,502
シグマシス・ホールディングス	9	8	13,587
ウィルグループ	5	5	6,079
メドピア	5	9	7,443
リクルートホールディングス	484	451	2,657,568
エラン	8	8	7,743
日本郵政	858	716	1,006,977
ベルシステム24ホールディングス	8	6	11,615
鎌倉新書	7	10	5,990
SMN	8	—	—
エアトリ	4	4	7,236
アトラエ	5	9	4,557
ストライク	3	2	13,468
ソラスト	18	16	9,021
インソース	16	13	10,560
バイカレント・コンサルティング	51	44	142,374
Orchestra Holdings	2	6	7,125
アイモバイル	4	14	6,570
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	23	19	44,837
GAMEWITH	10	—	—
ウェルビー	6	—	—
ミダックホールディングス	4	3	6,090
キュービ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	期首(前期末)	当期末	
	株数	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
and factory	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
燦ホールディングス	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
藤田観光	2	2	15,816
K N T - C Tホールディングス	3	—	—

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本管財	6	—	—
トーカイ	5	5	11,545
セコム	66	62	686,205
セントラル警備保障	3	3	8,619
丹青社	12	11	9,428
メイテックグループホールディングス	26	21	66,269
応用地質	6	5	13,366
船井総研ホールディングス	13	12	33,794
進学会ホールディングス	14	—	—
学究社	2	3	6,479
ベネッセホールディングス	24	20	53,207
イオンディライト	7	6	22,977
ナック	5	12	6,348
ダイセキ	13	12	49,662
ステップ	2	1	2,059
合計	株数・金額	74,409	91,102
	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	百万円	百万円
国内 TOPIX	2,164	—

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	221,415,671	98.5
コール・ローン等、その他	3,408,070	1.5
投資信託財産総額	224,823,742	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月20日現在)

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

(注1) 期首元本額 81,219,744,591円
期中追加設定元本額 19,799,367,159円
期中一部解約元本額 29,082,373,940円

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

ニッセイTOPIXオープン	5,323,486,715円
ニッセイ国内株式インデックス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)S A (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)S A (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)S A (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)S A (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(4資産均等型)	3,680,342,973円
DCニッセイターゲットデットファンド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ットファンド2045	437,206,012円
DCニッセイターゲットデットファンド2035	600,148,942円
DCニッセイターゲットデットファンド2025	32,113,164円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	118,398,630円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	10,306,061円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	13,314,440円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	4,770,388円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	9,699,744円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	26,586,216円
DCニッセイターゲットデットファンド2060	309,317,472円
DCニッセイターゲットデットファンド2050	197,083,804円
DCニッセイターゲットデットファンド2040	372,094,171円
DCニッセイターゲットデットファンド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/バスケツト)	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(積極型)	75,807円
FWニッセイ国内株インデックス	68,973,915円
DCニッセイターゲットデットファンド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
売却益	56,656,806,815
売却損	△ 4,362,430,810
(C)先物取引等損益	1,223,645,000
取引益	1,532,014,850
取引損	△ 308,369,850
(D)信託報酬等	△ 86,233
(E)当期損益金(A+B+C+D)	58,225,847,432
(F)前期繰越損益金	106,208,290,354
(G)追加信託差損益金	33,039,622,448
(H)解約差損益金	△ 45,407,908,396
(I)合計(E+F+G+H)	152,065,851,838
次期繰越損益金(I)	152,065,851,838

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 34 期

(計算期間：2024年5月21日～2024年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

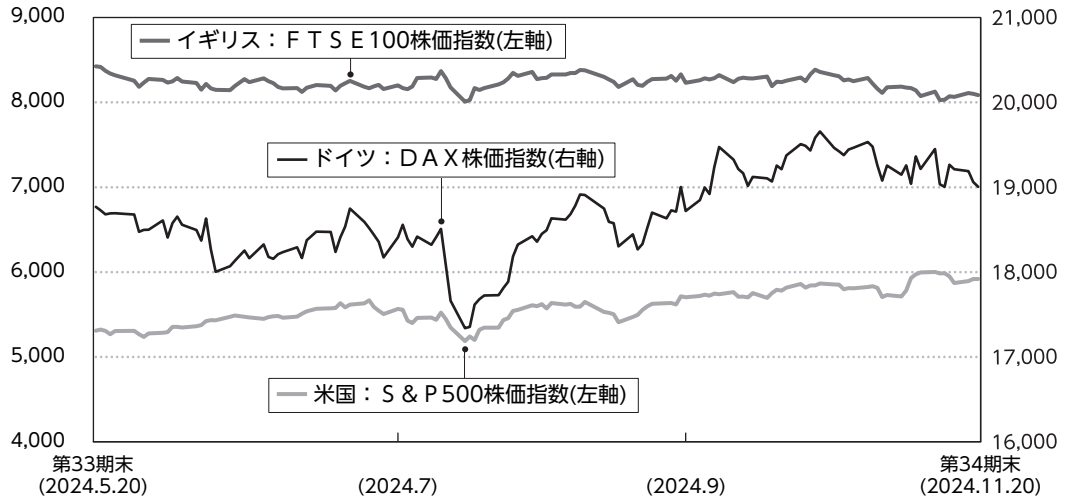
運用経過

2024年5月21日～2024年11月20日

投資環境

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



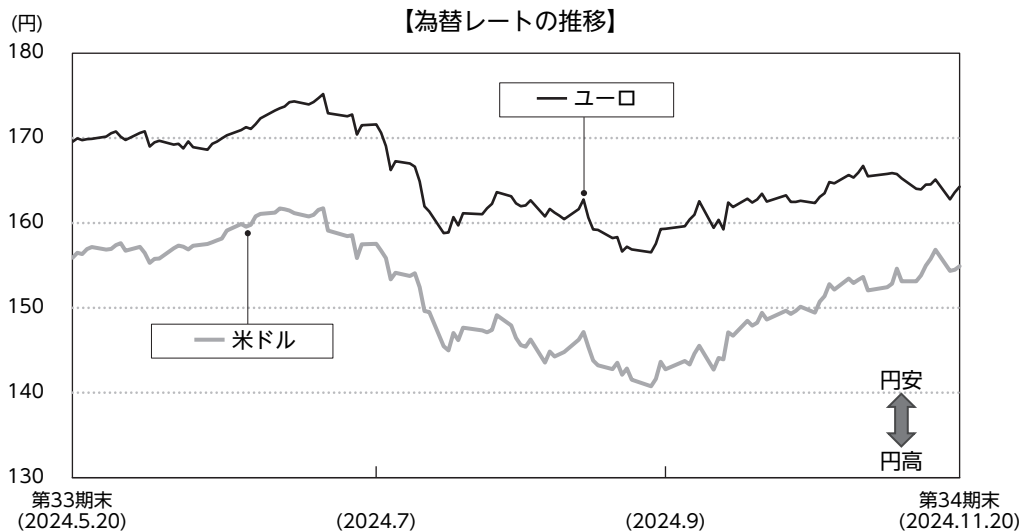
(注) FactSetのデータを使用しています。

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

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

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

■為替市況

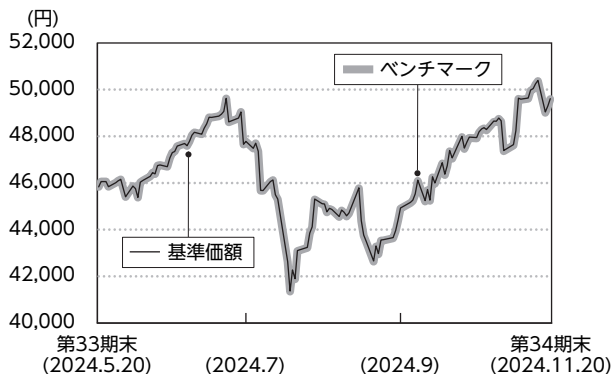


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

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

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2024年5月21日～2024年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料	0円	0.000%	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.002	
(株式)	(1)	(0.001)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	3	0.006	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.006)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	4	0.008	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

売買および取引の状況

2024年5月21日～2024年11月20日

(1) 株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

(2) 投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2024年5月21日～2024年11月20日

株式

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

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

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

組入有価証券明細表

2024年11月20日現在

(1) 外国株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(オーストラリア)		百株	百株	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	73,224	74,258	205,774	20,844,997		
	銘柄数<比率>	51	50	－	<1.8%>		
(香港)				千香港ドル			
AIA GROUP LTD		12,038	12,338	70,577	1,404,495	保険	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		3,915	4,095	10,402	207,005	銀行	
CK ASSET HOLDINGS LTD		2,064	2,129	6,770	134,733	不動産管理・開発	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,839	2,969	11,965	238,112	資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED		670	695	3,763	74,892	公益事業	
CLP HOLDINGS LTD		1,741	1,816	12,088	240,557	公益事業	
ESR GROUP LIMITED		1,804	－	－	－	不動産管理・開発	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額 邦貨換算金額	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ 千円	
DNB BANK ASA		978	990	22,634 319,820	銀行
EQUINOR ASA		953	927	24,413 344,961	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		210	221	4,250 60,059	保険
KONGSBERG GRUPPEN ASA		93	97	12,073 170,598	資本財
MOWI ASA		492	514	10,219 144,404	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		1,403	1,553	11,025 155,797	素材
ORKLA ASA		737	771	7,434 105,043	食品・飲料・タバコ
SALMAR ASA		70	73	4,120 58,223	食品・飲料・タバコ
TELENOR ASA		688	698	9,155 129,366	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		174	182	5,764 81,448	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,136 11	6,380 11	119,051 -	1,682,202 <0.1%>
(スウェーデン)				千スウェーデン・クローナ	
ADDTECH AB-B SHARES		-	287	8,319 118,222	資本財
ALFA LAVAL AB		306	320	14,966 212,666	資本財
ASSA ABLOY AB		1,060	1,109	36,046 512,218	資本財
ATLAS COPCO AB		1,654	1,729	26,233 372,771	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		2,845	2,973	51,442 730,996	資本財
BEIJER REF AB		408	399	6,406 91,040	資本財
BIOVITRUM		206	215	6,520 92,656	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOLIDEN AB		289	302	9,639 136,978	素材
EPIROC AB-A		698	729	14,295 203,145	資本財
EPIROC AB-B		413	432	7,637 108,526	資本財
EQT AB		395	413	12,069 171,511	金融サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B		645	674	19,970 283,780	家庭用品・パーソナル用品
EVOLUTION AB		194	199	19,631 278,968	消費者サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		690	733	5,943 84,456	不動産管理・開発
GETINGE AB-B SHS		242	253	4,331 61,556	ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB		684	627	9,596 136,366	一般消費財・サービス流通・小売り
HEXAGON AB-B SHS		2,199	2,299	21,396 304,048	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLMEN AB-B SHARES		80	84	3,470 49,312	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		371	389	2,379 33,818	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		139	142	5,069 72,036	金融サービス
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		153	167	5,936 84,360	金融サービス
INDUTRADE AB		289	302	8,252 117,272	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(スウェーデン)		百株	百株	千ユーロ	千円		
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		157	163	4,463	63,423	資本財	
INVESTOR AB		1,832	1,914	56,636	804,803	金融サービス	
LIFCO AB-B SHS		246	257	8,084	114,877	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS		79	83	4,401	62,545	金融サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		1,607	1,679	7,978	113,369	資本財	
SAAB AB-B		338	354	8,816	125,288	資本財	
SAGAX AB-B		216	243	5,856	83,213	不動産管理・開発	
SANDVIK AB		1,128	1,180	23,886	339,432	資本財	
SECURITAS AB		519	544	7,229	102,729	商業・専門サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		1,679	1,756	26,318	373,978	銀行	
SKANSKA AB-B SHS		359	376	8,257	117,346	資本財	
SKF AB		360	377	7,675	109,064	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB		641	670	9,523	135,333	素材	
SVENSKA HANDELSBANKEN		1,543	1,616	17,860	253,796	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES		898	940	20,149	286,322	銀行	
TELE2 AB		591	611	6,869	97,611	電気通信サービス	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON		3,101	3,073	27,234	386,998	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB		2,615	2,684	8,409	119,492	電気通信サービス	
TRELLEBORG AB-B SHS		－	235	8,283	117,706	資本財	
VOLVO AB		1,593	1,754	46,802	665,069	資本財	
VOLVO AB-A SHS		216	226	6,068	86,229	資本財	
VOLVO CAR AB-B		788	823	1,886	26,800	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額	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'IETTEREN GROUP		22	23	461 75,825	一般消費財・サービス流通・小売り
ELIA GROUP SA/NV		31	32	272 44,750	公益事業
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		92	92	596 98,048	金融サービス
KBC GROEP NV		265	254	1,790 294,179	銀行
LOTUS BAKERIES		0.44	0.45	513 84,418	食品・飲料・タバコ
SOFINA		16	17	369 60,730	金融サービス
SYENSQO SA		78	81	587 96,584	素材
UCB SA		133	139	2,300 377,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE		221	—	— —	素材
小計	株数・金額	2,014	1,879	16,523 2,714,348	
	銘柄数<比率>	12	11	— <0.2%>	
(ユーロ／ルクセンブルグ)					
ARCELORMITTAL		539	518	1,244 204,439	素材
TENARIS SA		499	521	907 149,037	エネルギー
小計	株数・金額	1,039	1,040	2,151 353,477	
	銘柄数<比率>	2	2	— <0.0%>	
(ユーロ／フランス)					
ACCOR		200	215	927 152,411	消費者サービス
ADP		36	38	414 68,129	運輸
AIR LIQUIDE		555	640	10,194 1,674,579	素材
ALSTOM RGPT		305	383	815 133,925	資本財
AMUNDI SA		65	67	456 74,965	金融サービス
ARKEMA		63	62	475 78,123	素材
AXA SA		1,924	2,012	6,850 1,125,300	保険
BIOMERIEUX		43	45	448 73,677	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS		1,094	1,127	6,685 1,098,165	銀行
BOLLORE SE		753	787	457 75,138	メディア・娯楽
BOUYGUES		202	210	614 100,906	資本財
BUREAU VERITAS SA		312	351	986 161,974	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA		164	171	2,694 442,695	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA		599	601	881 144,850	生活必需品流通・小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN		482	501	4,454 731,819	資本財
CREDIT AGRICOLE SA		1,130	1,172	1,566 257,285	銀行
DANONE		681	714	4,648 763,636	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA		21	21	427 70,199	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA		707	741	2,369 389,199	ソフトウェア・サービス
EDENRED		264	276	792 130,196	金融サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

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

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

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日現在)

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

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

損益の状況

当期 (2024年5月21日～2024年11月20日)

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

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

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

運用報告書

第 8 期

(計算期間：2023年3月11日～2024年3月11日)

運用方針

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

主要運用 対象

国内の公社債

運用方法

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年3月11日～2024年3月11日

国内債券市況



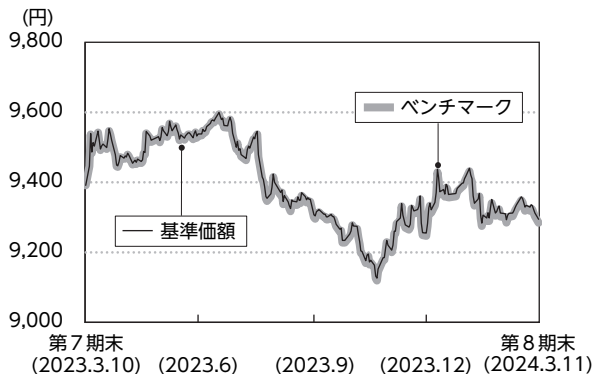
(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

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

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

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

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

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

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2023年3月11日～2024年3月11日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	0円	0.000%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	0	0.000	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

売買および取引の状況

2023年3月11日～2024年3月11日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

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

主要な売買銘柄

2023年3月11日～2024年3月11日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2024年3月11日現在

国内（邦貨建）公社債

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

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

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(国内公社債の内訳)

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

投資信託財産の構成

2024年3月11日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年3月11日現在)

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

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

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

ニッセイ国内債券パッシブD B (適格機関投資家限定)

	35,374,088,296円
DCニッセイ日本債券インデックス	5,214,727,778円
DCニッセイターゲットデットファンド2055	350,854,103円
DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	8,816,046,964円
DCニッセイターゲットデットファンド2045	642,290,762円
DCニッセイターゲットデットファンド2035	3,586,989,645円
DCニッセイターゲットデットファンド2025	1,208,005,642円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
バランスファンド (6資産均等型)	384,915,856円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート/債券)	38,635,807円
ニッセイ・インデックスパッケージ (国内・株式/リート/債券)	149,044,598円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
バランスファンド (8資産均等型)	86,288,489円
DCニッセイターゲットデットファンド2060	211,978,736円
DCニッセイターゲットデットファンド2050	229,582,939円
DCニッセイターゲットデットファンド2040	824,409,138円
DCニッセイターゲットデットファンド2030	3,471,043,373円
FWニッセイ国内債インデックス	47,391,415円
DCニッセイターゲットデットファンド2065	38,651,602円

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

損益の状況

当期 (2023年3月11日～2024年3月11日)

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 36 期

(計算期間：2024年5月21日～2024年11月20日)

運用方針	主に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	日本を除く主要国の国債
運用方法	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・ 株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

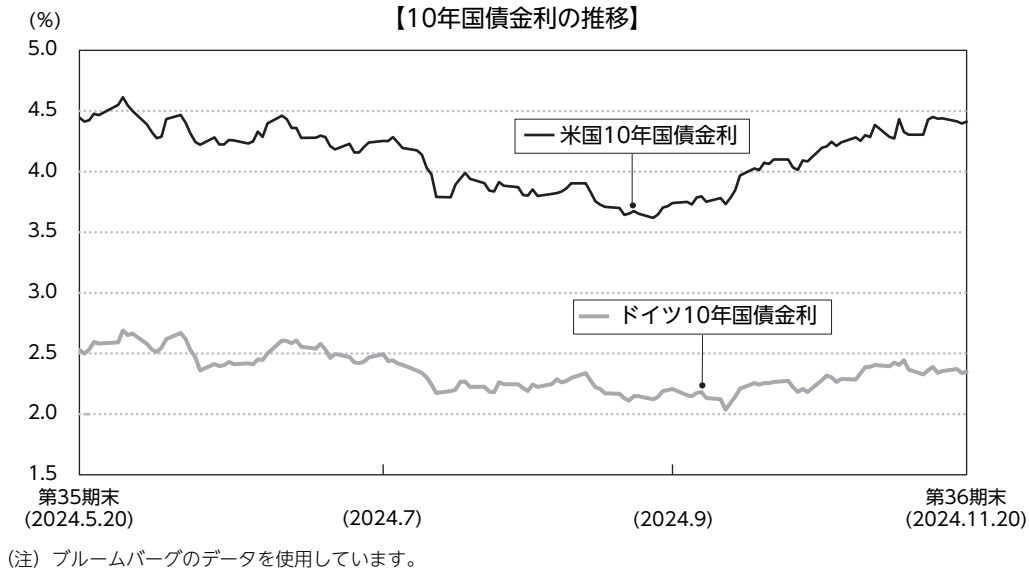
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2024年5月21日～2024年11月20日

投資環境

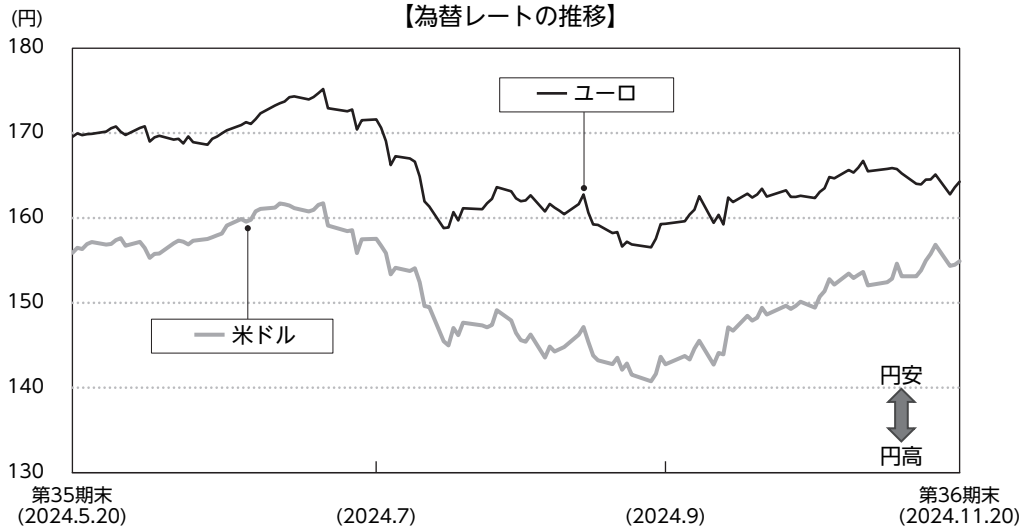
■ 海外債券市況



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

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

■為替市況

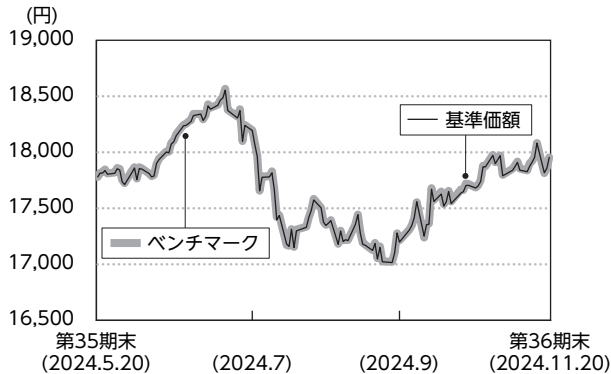


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

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

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2024年5月21日～2024年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	3円	0.017%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.017)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	3	0.017	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,723円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2024年5月21日～2024年11月20日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2024年5月21日～2024年11月20日

公社債

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

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2024年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

区分		当期末							
		額面金額	評価額		組入比率	うちＢＢ格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
			外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
デンマーク		千デンマーク・クローネ 11,120	千デンマーク・クローネ 10,937	千円 240,845	% 0.3	% －	% 0.2	% 0.1	% 0.1
ノルウェー		千ノルウェー・クローネ 10,860	千ノルウェー・クローネ 10,135	 143,211	0.2	－	0.1	0.0	0.0
スウェーデン		千スウェーデン・クローナ 10,850	千スウェーデン・クローナ 10,648	 151,309	0.2	－	0.1	0.1	0.0
メキシコ		千メキシコ・ペソ 98,250	千メキシコ・ペソ 88,369	 680,605	0.7	－	0.4	0.2	0.1
中国		千人民元 455,770	千人民元 475,936	10,192,509	11.0	－	5.0	3.9	2.1
マレーシア		千マレーシア・リンギット 12,970	千マレーシア・リンギット 13,267	 459,964	0.5	－	0.3	0.1	0.0
ポーランド		千ポーランド・ズロチ 13,120	千ポーランド・ズロチ 12,320	 467,006	0.5	－	0.1	0.3	0.1
ユーロ		千ユーロ	千ユーロ						
	アイルランド	2,920	2,644	434,358	0.5	－	0.3	0.1	0.0
	オランダ	7,930	7,376	1,211,691	1.3	－	0.8	0.4	0.1
	ベルギー	9,390	8,766	1,440,099	1.6	－	1.1	0.4	0.1
	フランス	45,110	41,594	6,832,706	7.4	－	4.3	2.2	0.9
	ドイツ	34,030	32,221	5,293,058	5.7	－	3.2	1.8	0.7
	ポルトガル	3,430	3,292	540,935	0.6	－	0.4	0.2	0.0
	スペイン	25,970	25,036	4,112,782	4.4	－	2.5	1.4	0.6
	イタリア	39,390	38,759	6,366,971	6.9	－	3.9	1.9	1.0
	フィンランド	3,070	2,763	453,927	0.5	－	0.3	0.1	0.0
オーストリア	6,740	6,146	1,009,605	1.1	－	0.7	0.3	0.1	
合計		－	－	91,538,259	98.9	－	48.5	32.4	17.9

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日現在)

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

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

損益の状況

当期(2024年5月21日~2024年11月20日)

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

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

ニッセイマネーマーケット マザーファンド

運用報告書

第 26 期

(計算期間：2024年4月16日～2024年10月15日)

運用方針

- ① 円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。
- ② 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

主要運用 対象

円建ての短期公社債および短期金融商品

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。
・ 外貨建資産への投資は行いません。



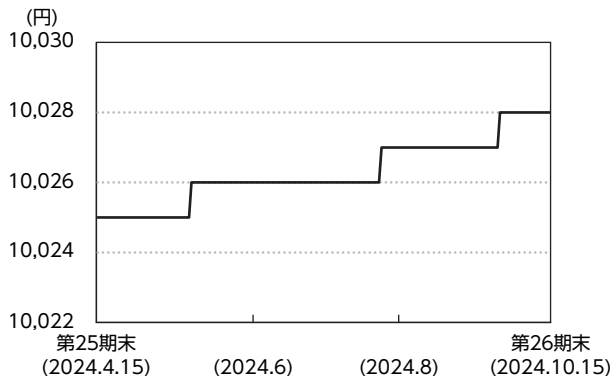
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2024年4月16日～2024年10月15日

基準価額等の推移



■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・前期末以降、利子等収益等が積み上がったこと

(注) 当マザーファンドはベンチマークを設けていません。

ポートフォリオ

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざしました。

ベンチマークとの差異

当マザーファンドは、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざして運用を行うことから、コンセプトに適った指数が存在しないため、ベンチマークなどを設けていません。

今後の運用方針

当マザーファンドは、円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。

今後も引き続き、安定した収益確保のため、短期証券を中心に投資していく方針です。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		
	円	%	%	百万円
22期 (2022年10月17日)	10,029	0.0	79.4	50
23期 (2023年 4 月17日)	10,027	△0.0	89.9	706
24期 (2023年10月16日)	10,025	△0.0	82.1	720
25期 (2024年 4 月15日)	10,025	0.0	83.1	1,391
26期 (2024年10月15日)	10,028	0.0	92.2	1,375

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	債券 組入比率
	円	%	%
(期首)2024年 4 月15日	10,025	—	83.1
4 月末	10,025	0.0	83.3
5 月末	10,026	0.0	83.5
6 月末	10,026	0.0	85.3
7 月末	10,026	0.0	86.0
8 月末	10,027	0.0	85.8
9 月末	10,028	0.0	86.1
(期末)2024年10月15日	10,028	0.0	92.2

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2024年4月16日～2024年10月15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（10,026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4月16日～2024年10月15日

公社債

		買付額	売付額
国内		千円	千円
	地方債証券	349,940	－
	特殊債券	－	(156,000)
			(82,000)

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

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

主要な売買銘柄

2024年4月16日～2024年10月15日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第146回 共同発行市場公募地方債	175,623	－	－
第147回 共同発行市場公募地方債	87,200		
第748回 東京都公募公債	87,117		

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2024年10月15日現在

国内（邦貨建）公社債

区分	額面金額	評価額	組入比率	当期末 うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	1,099,000 (1,099,000)	1,100,147 (1,100,147)	80.0 (80.0)	—	—	—	80.0 (80.0)
特殊債券 (除く金融債券)	167,000 (167,000)	167,152 (167,152)	12.2 (12.2)	—	—	—	12.2 (12.2)
合計	1,266,000 (1,266,000)	1,267,299 (1,267,299)	92.2 (92.2)	—	—	—	92.2 (92.2)

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

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(国内公社債の内訳)

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
地方債証券	第748回 東京都公募公債	0.4560	2025/ 9 /19	87,000	87,112
	第213回 神奈川県公募公債	0.5340	2025/ 3 /19	175,000	175,319
	第146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	2025/ 5 /23	175,000	175,406
	第147回 共同発行市場公募地方債	0.5480	2025/ 6 /25	87,000	87,186
	平成26年度第1回 滋賀県公募公債	0.4950	2024/11/28	200,000	200,121
	令和元年度第8回 神戸市公募公債(5年)	0.0010	2024/10/25	200,000	200,000
	令和元年度第1回 鹿児島県公募公債(5年)	0.0010	2024/10/31	175,000	175,000
	小計	—	—	—	1,100,147
特殊債券 (除く金融債券)	第231回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.4950	2024/11/29	79,000	79,047
	第69回 政保地方公共団体金融機構債券	0.4140	2025/ 2 /17	88,000	88,104
	小計	—	—	—	167,152
	合計	—	—	—	1,267,299

投資信託財産の構成

2024年10月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	1,267,299	92.1
コール・ローン等、その他	109,288	7.9
投資信託財産総額	1,376,587	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年10月15日現在)

項目	当期末
(A)資産	1,376,587,399円
コール・ローン等	108,477,511
公社債(評価額)	1,267,299,290
未収利息	721,187
前払費用	89,411
(B)負債	1,427,770
未払解約金	1,427,770
(C)純資産総額(A-B)	1,375,159,629
元本	1,371,321,507
次期繰越損益金	3,838,122
(D)受益権総口数	1,371,321,507口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,028円

(注1) 期首元本額 1,388,192,825円
 期中追加設定元本額 143,291,136円
 期中一部解約元本額 160,162,454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。

ニッセイグローバル高配当株式プラス(毎月決算型)	10,000円
ニッセイマネーマーケットファンド(適格機関投資家限定)	49,936,464円
ニッセイ豪州ハイ・インカム株式ファンド(毎月決算型)	9,994円
ニッセイアメリカ高配当株式ファンド(毎月決算型)	9,984円
ニッセイアメリカ高配当株式ファンド(年2回決算型)	9,984円
ニッセイ世界高配当株式ファンド(毎月決算型)	9,984円
ニッセイ世界高配当株式ファンド(年2回決算型)	9,984円
J P X日経400アクティブ・オープン米ドル投資型	9,976円
J P X日経400アクティブ・プレミアム・オープン(毎月決算型)	9,976円
ニッセイ・オーストラリア・リート・オープン(毎月決算型)	9,974円
ニッセイ・オーストラリア・リート・オープン(年2回決算型)	9,974円
ニッセイ/MF S外国株低ボラティリティ運用ファンド	9,967円
ニッセイA I 関連株式ファンド(為替ヘッジあり)	9,967円
ニッセイA I 関連株式ファンド(為替ヘッジなし)	9,967円
ニッセイ豪州ハイ・インカム株式ファンド(資産成長型)	9,968円
D Cニッセイターゲットデットファンド2025	1,320,986,105円
ニッセイ/コムジスト新興国成長株式ファンド(資産成長型)	9,969円
ニッセイ/コムジスト新興国成長株式ファンド(年2回決算型)	9,969円
ニッセイA I 関連株式ファンド(年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,969円
ニッセイA I 関連株式ファンド(年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,969円
ニッセイ/T C W債券戦略ファンド(3ヵ月決算型・為替ヘッジあり)	9,969円
ニッセイ/T C W債券戦略ファンド(3ヵ月決算型・為替ヘッジなし)	9,969円
ニッセイ/T C W債券戦略ファンド(資産成長型・為替ヘッジあり)	9,969円
ニッセイ/T C W債券戦略ファンド(資産成長型・為替ヘッジなし)	9,969円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド(年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,970円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド(年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,970円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド(資産成長型・為替ヘッジあり)	9,970円
ニッセイ/シュローダー・グローバルCBファンド(資産成長型・為替ヘッジなし)	9,970円
グローバル・ディスラプター成長株式ファンド(予想分配金提示型)	9,972円
グローバル・ディスラプター成長株式ファンド(資産成長型)	9,972円
ニッセイ新興国テクノロジー関連株式ファンド(予想分配金提示型)	9,972円
ニッセイ新興国テクノロジー関連株式ファンド(資産成長型)	9,972円
原定追加型・横上優選家財付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド(為替ヘッジあり)	9,973円
ニッセイ/シュローダー好利回りCBファンド2023-02(為替ヘッジあり・原定追加型)	9,974円
原定追加型・横上優選家財付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド2023-07(為替ヘッジあり)	9,975円
原定追加型・横上優選家財付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド2023-07(為替ヘッジなし)	9,975円
ニッセイ・マルチアセット・インカム戦略ファンド(資産成長型)	9,975円
ニッセイ・マルチアセット・インカム戦略ファンド(毎月決算型)	9,975円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド(毎月決算型・為替ヘッジあり)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド(毎月決算型・為替ヘッジなし)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド(年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド(年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,968円

損益の状況

当期(2024年4月16日～2024年10月15日)

項目	当期
(A)配当等収益	2,180,665円
受取利息	2,180,665
(B)有価証券売買損益	△1,789,977
売却損益	△1,789,977
(C)当期損益金(A+B)	390,688
(D)前期繰越損益金	3,489,065
(E)追加信託差損益金	377,348
(F)解約差損益金	△418,979
(G)合計(C+D+E+F)	3,838,122
次期繰越損益金(G)	3,838,122

(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。

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。

・N O M U R A - B P I 総合

N O M U R A - B P I 総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

・F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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

・東証 R E I T 指数（配当込み）

東証 R E I T 指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことが

できます。J P Xは、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。J P Xは、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。J P Xは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。J P Xは、ニッセイアセットマネジメント株式会社または当ファンドの購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、J P Xは当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

- ・ S & P グローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

S & P グローバルリートインデックス（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ブライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、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。