

## <債券重視型>

第21期末 (2024年2月21日)

基準価額	22,416円
純資産総額	301億円
騰落率	12.4%
分配金	0円

## <標準型>

第21期末 (2024年2月21日)

基準価額	30,332円
純資産総額	743億円
騰落率	18.5%
分配金	0円

## <株式重視型>

第21期末 (2024年2月21日)

基準価額	39,860円
純資産総額	476億円
騰落率	24.9%
分配金	0円

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# DCニッセイ ワールドセレクトファンド 債券重視型 / 標準型 / 株式重視型

追加型投信 / 内外 / 資産複合

## 運用報告書(全体版)

作成対象期間:2023年2月22日~2024年2月21日

第21期(決算日 2024年2月21日)

### 受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) / (標準型) / (株式重視型)」は、このたび第21期の決算を行いました。

各ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券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」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

## 運用経過

2023年2月22日～2024年2月21日

## 基準価額等の推移



第21期首	19,943円	既払分配金	0円
第21期末	22,416円	騰落率 (分配金再投資ベース)	12.4%

(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

## &lt;上昇要因&gt;

- ・2023年3月下旬から7月にかけて、インフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の回復期待等を背景に国内外の株価が上昇したことに加え、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月初旬から下旬にかけて、日銀の金融緩和姿勢継続が示唆されたことや米連邦公開市場委員会（FOMC）で追加利上げ観測が後退したことなどから国内外の株価が上昇したこと
- ・12月中旬から当期末にかけて、米経済や企業業績への見通しが堅調であったことや国内では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国内外の株価が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月から10月末にかけて、日銀による金融政策正常化観測の高まりなどから金利が上昇（債券価格は下落）したこと

組入マザーファンド	投資比率	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	20.0%	20.4%	34.8%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	45.0	44.7	0.1
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	10.0	10.1	33.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	20.0	19.9	15.0
短期金融資産	5.0	5.0	-

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第21期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	33円	0.154%	信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は21,152円です。
(投信会社)	(14)	(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)	(14)	(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)	( 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	0.000	
(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	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)	(0.009)	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)	( 1)	(0.004)	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	35	0.168	

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

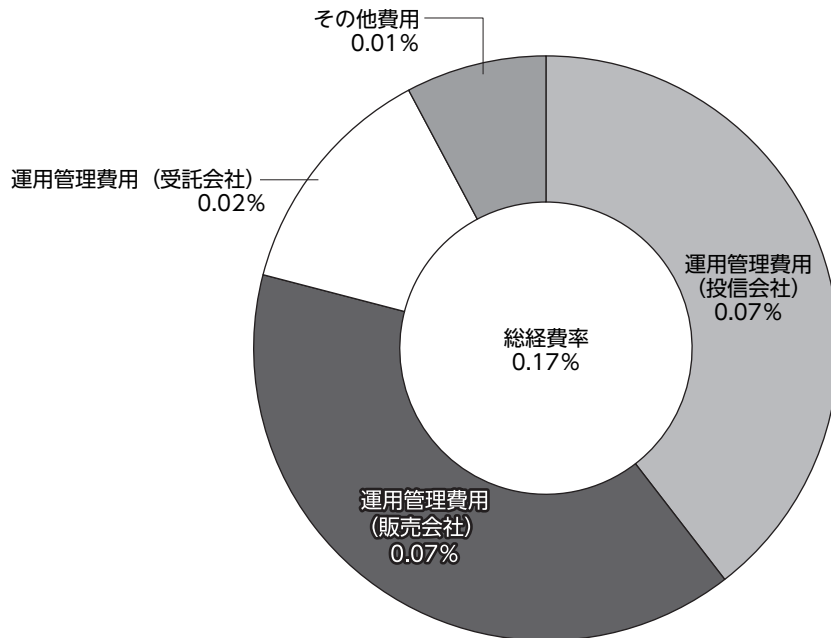
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## （参考情報）

## ■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.17%**です。



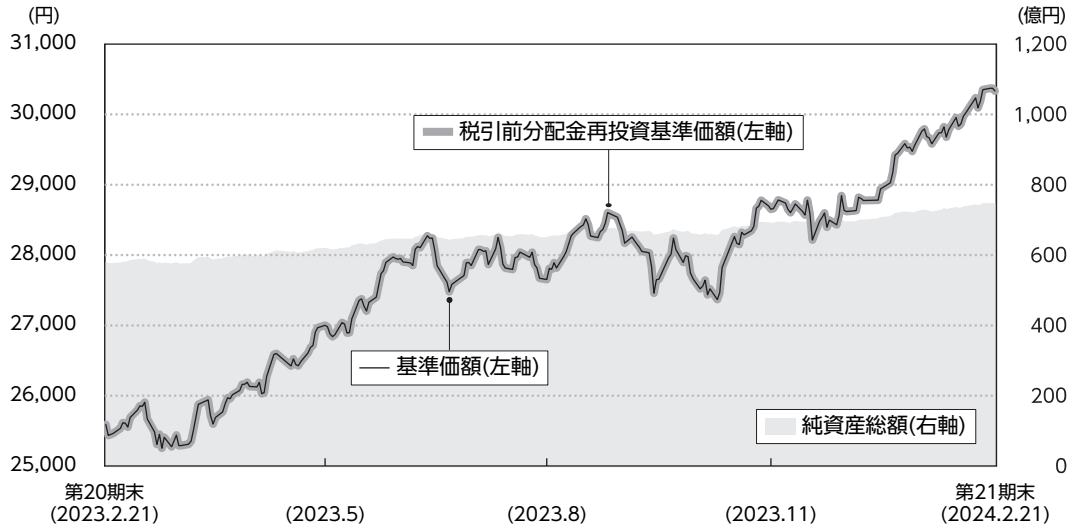
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## 基準価額等の推移



第21期首	25,589円	既払分配金	0円
第21期末	30,332円	騰落率(分配金再投資ベース)	18.5%

(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

## &lt;上昇要因&gt;

- ・2023年3月下旬から7月にかけて、インフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の回復期待等を背景に国内外の株価が上昇したことに加え、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月初旬から下旬にかけて、日銀の金融緩和姿勢継続が示唆されたことや米連邦公開市場委員会(FOMC)で追加利上げ観測が後退したことなどから国内外の株価が上昇したこと
- ・12月中旬から当期末にかけて、米経済や企業業績への見通しが堅調であったことや国内では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国内外の株価が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月から10月末にかけて、日銀による金融政策正常化観測の高まりなどから金利が上昇(債券価格は下落)したこと

組入マザーファンド	投資比率	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	30.0%	30.4%	34.8%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	30.0	29.7	0.1
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	20.0	20.1	33.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15.0	14.9	15.0
短期金融資産	5.0	4.9	-

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第21期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	43円	0.154%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は27,758円です。</p>
(投信会社)	(18)	(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)	(18)	(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)	(6)	(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	3	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)	(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)	<ul style="list-style-type: none"> <li>信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	46	0.167	

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

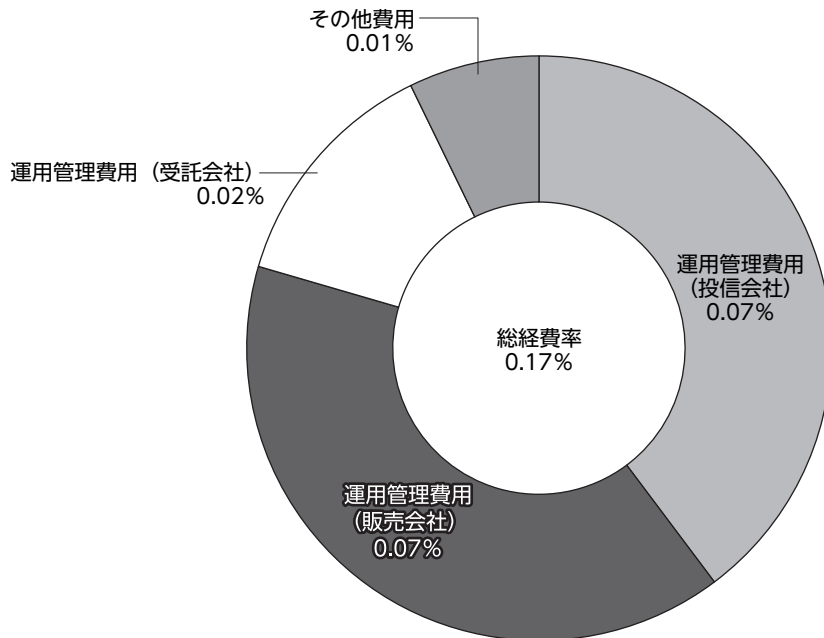
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## （参考情報）

## ■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.17%**です。



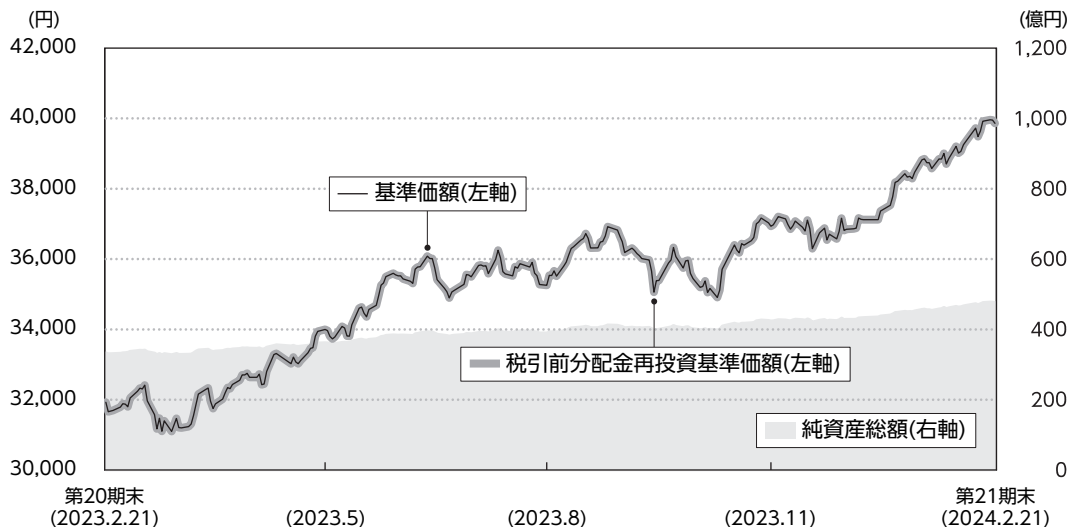
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## 基準価額等の推移



第21期首	31,923円	既払分配金	0円
第21期末	39,860円	騰落率(分配金再投資ベース)	24.9%

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

(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

## &lt;上昇要因&gt;

- ・2023年3月下旬から7月にかけて、インフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の回復期待等を背景に国内外の株価が上昇したことに加え、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月初旬から下旬にかけて、日銀の金融緩和姿勢継続が示唆されたことや米連邦公開市場委員会(FOMC)で追加利上げ観測が後退したことなどから国内外の株価が上昇したこと
- ・12月中旬から当期末にかけて、米経済や企業業績への見通しが堅調であったことや国内では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国内外の株価が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月から10月末にかけて、日銀による金融政策正常化観測の高まりなどから金利が上昇(債券価格は下落)したこと

組入マザーファンド	投資比率	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	40.0%	40.4%	34.8%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	15.0	14.8	0.1
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	30.0	30.0	33.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	10.0	9.9	15.0
短期金融資産	5.0	4.9	-

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。



## 1万口当たりの費用明細

項目	第21期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	55円	0.154%	信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は35,410円です。
(投信会社)	(23)	(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)	(23)	(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)	( 8)	(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	1	0.002	
(株式)	( 1)	(0.002)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(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	4	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)	( 3)	(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)	( 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	60	0.169	

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

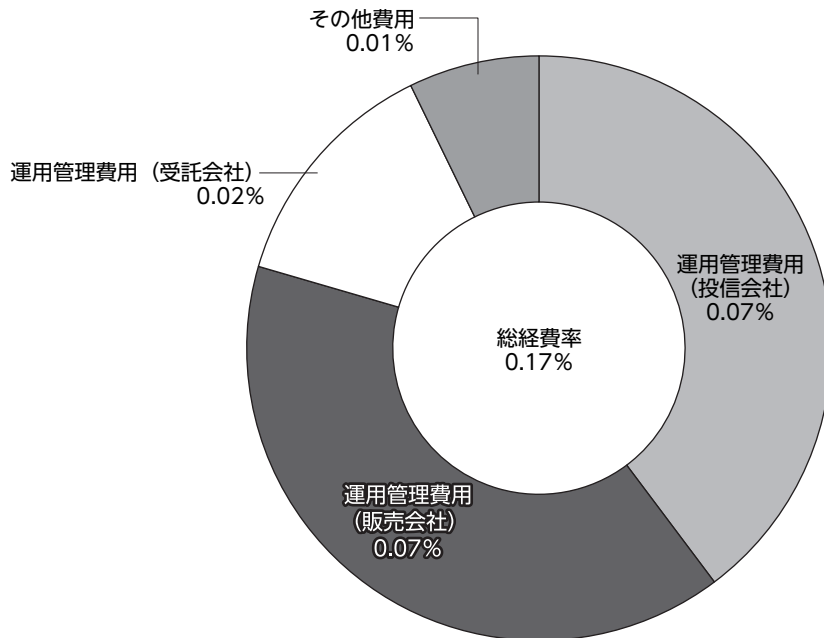
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## （参考情報）

## ■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.17%**です。



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

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

### ■国内株式市況

当期の国内株式市場はおおむね上昇基調で推移しました。

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

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

7月に入ると米金利の上昇や日銀によるイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、YCC）の運用柔軟化等、金融政策への思惑が交錯し株価は上下する展開となりましたが、その後、9月中旬にかけては米追加利上げ観測の後退を背景に上昇しました。9月下旬から10月末にかけては米金利の上昇を受けて株価は下落しましたが、11月に入ると日銀の金融緩和姿勢の継続が示唆されたことや米金利が低下したため株価は上昇する展開となりました。その後は円高の進行などから下落する場面もありましたが、年明け以降は米株高や円安に加えて、海外投資家の買いや新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。

### ■国内債券市況

10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、おおむね横ばいで推移した後、2023年3月中旬に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。4月下旬の日銀金融政策決定会合において金融政策の現状維持が発表されたことで6月末まで緩やかに低下しましたが、7月に入ると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直し引き上げ報道等から金融政策の修正観測が高まり金利は大きく上昇し、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金融政策の修正観測が強まり、金利は上昇基調となりましたが、11月に入ると米金融引き締め長期化観測が後退したことなどを背景に金利は低下しました。2024年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（FRB）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、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

## ■海外株式市況

海外株式市場は期を通じて見るとイギリスでは下落しましたが、米国やドイツでは上昇しました。

期初から2023年5月にかけては、米国において複数の銀行が経営破綻したことや大手金融機関クレディ・スイス・グループの経営不安が高まったことなどが嫌気されて株価は下落する場面もありましたが、欧米各国の当局による資金繰り支援や救済措置などの迅速な対応により市場心理が改善したこと、市場予想を上回る決算を発表した大型ハイテック株が堅調に推移したことなどからおおむね上昇しました。6月から7月にかけては、米国における債務上限法案の上下院での可決や堅調な経済指標を背景とした景気のソフトランディングへの期待感が強まったことなどから株価は上昇しました。その後は米国債の格下げや9月にF R Bによる金融引き締めに向き姿勢を受けて米金利が上昇したこと、米国の政府閉鎖問題、中東情勢の緊迫化を背景に株価は下落したものの、11月に入るとF O M Cで追加利上げ観測が後退したことや米政府機関における一部閉鎖の回避等を受けて反発しました。12月にはF R Bのパウエル議長が金融緩和に前向きな姿勢の発言をしたことや市場予想並みであった米消費者物価指数(C P I)等を受けて株価は続伸しました。2024年初から2月にかけては、前月までの株式市場における上昇の反動や米雇用統計が市場予想を上回り堅調な経済環境が確認されたことなどから金利が上昇し株価は下落する場面がありましたが、米経済や企業業績への見通しが堅調であったことや米国におけるインフレ鈍化への期待感から米国やドイツの株式市場が上昇し、結局、期を通じて見ると米国とドイツでは上昇し、イギリスでは下落して当期末を迎えました。

## ■海外債券市況

当期の米国10年国債金利は、期初は米地方銀行の経営破綻をきっかけに投資家のリスク回避姿勢が強まったことから一時的に低下しましたが、2023年4月から10月中旬にかけては堅調な米経済指標を背景に上昇基調となりました。10月下旬以降は中東情勢の悪化により投資家のリスク回避姿勢が強まったことや物価上昇率の鈍化を受けて将来の利下げ観測が強まったことから金利は低下しましたが、年明け以降は堅調な米雇用統計を背景にF R Bによる利下げ期待が後退したことなどから上昇し、結局、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初から2023年5月にかけて欧州中央銀行(E C B)の金融政策動向の影響を受けて大きく上下する場面がありましたが、おおむね横ばい圏での推移となりました。その後は各国の利上げや米金利の上昇を受けて上昇基調となり、9月にはE C Bが利上げ休止を示唆し成長率予測を引き下げたことなどから上昇幅を縮小する動きとなりました。10月下旬以降は中東情勢の悪化により投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどをを受けて金利は低下しましたが、年明け以降は米金利の上昇に追随するかたちで上昇し、結局、期を通じて見ると小幅に低下して当期末を迎えました。

## ■為替市況

当期の米ドル/円レートは上昇しました。

期初以降、堅調な米経済指標や植田日銀新総裁が金融緩和を継続するとの見方が強まったことからおおむね米ドル高円安基調で推移しました。2023年7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けて大きく円高に振れる場面があったものの、その後は米国が利上げ方向である一方で日本が金融緩和方向であったことから日米金利差が拡大し、大幅な米ドル高円安基調となりました。11月以降は米国の将来の利下げ観測が意識される一方で日本の金融政策正常化観測が高まったことでいったんは米ドル安円高基調に転じましたが、当期末にかけては早期の金融政策の変更はないとの見方から再び米ドル高円安基調となり、結局、期を通じて見ると米ドル高円安で当期末を迎えました。

当期のユーロ/円レートは上昇しました。

期初からE C Bが継続的に物価上昇リスクを警戒していたことや米金利の上昇に連れて欧州金利が上昇したことなどからおおむねユーロ高円安基調で推移しました。2023年7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けてユーロ安円高に転じる場面もありましたが、その後は日・欧中央銀行の金融政策の影響を受けて上下に振れつつも横ばい圏での推移となりました。11月には日本の金融政策正常化観測が高まったことでいったんはユーロ安円高となりましたが、その後は大手格付け機関によるイタリア国債の格下げが回避されたことなどをを受けてユーロに対する懸念が後退したことや日銀の金融緩和政策継続への見方が強まったことなどから再びユーロ高円安となり、結局、期を通じて見るとユーロ高円安で当期末を迎えました。

## ポートフォリオ

### ■各ファンド

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券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」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行いました。

### ■マザーファンド

#### <ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

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

#### <ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

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

#### <ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

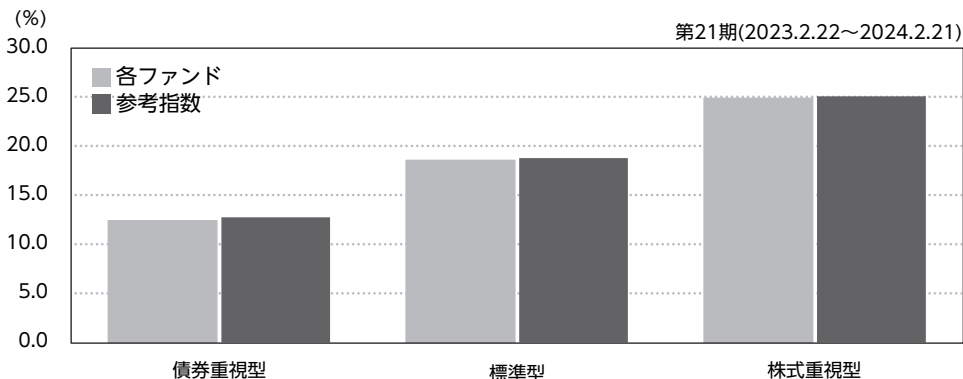
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークであるM S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

#### <ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

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

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

## 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。参考指数は、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、無担保コール翌日物の収益率に投資比率を乗じて合成したものです。

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。

### ■債券重視型

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+12.4%となり、参考指数騰落率(+12.7%)を下回りました。

### ■標準型

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+18.5%となり、参考指数騰落率(+18.8%)を下回りました。

### ■株式重視型

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+24.9%となり、参考指数騰落率(+25.1%)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	第21期 2023年2月22日～2024年2月21日		
	債券重視型	標準型	株式重視型
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	12,416円	20,332円	29,860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

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券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」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。相場動向やその見通しによって資産配分比率を変更するファンドではありません。従って、今後も投資比率（基準ポートフォリオ）に基づいて各マザーファンド受益証券の組み入れを行い、同投資比率を継続的に維持していく予定です。

## ■マザーファンド

### <ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

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

### <ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

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

### <ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

### <ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

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



# ファンドデータ

## DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第21期末 2024年2月21日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	20.4%
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	44.7
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	10.1
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	19.9

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

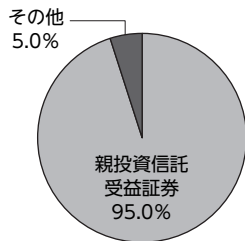
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

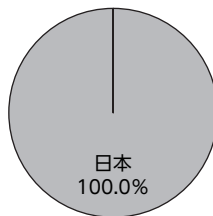
項目	第21期末 2024年2月21日
純資産総額	30,184,264,705円
受益権総口数	13,465,469,203口
1万口当たり基準価額	22,416円

(注) 当期間中における追加設定元本額は2,552,719,943円、同解約元本額は1,679,168,996円です。

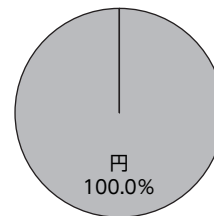
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年2月21日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

## DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）の組入資産の内容

### ■ 組入ファンド

	第21期末 2024年2月21日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	30.4%
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	29.7
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	20.1
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。

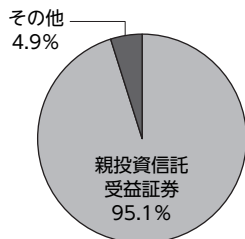
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■ 純資産等

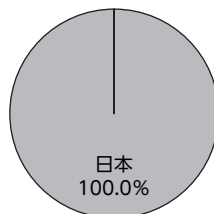
項目	第21期末 2024年2月21日
純資産総額	74,327,010,389円
受益権総口数	24,504,201,805口
1万口当たり基準価額	30,332円

(注) 当期間中における追加設定元本額は4,340,901,715円、同解約元本額は2,372,836,083円です。

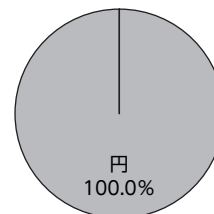
### ■ 資産別配分



### ■ 国別配分



### ■ 通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年2月21日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

## DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第21期末 2024年2月21日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	40.4%
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	14.8
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	30.0
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	9.9

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

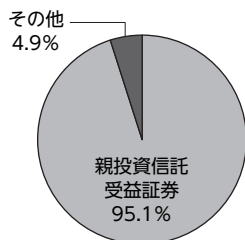
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

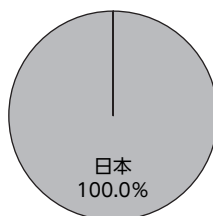
項目	第21期末 2024年2月21日
純資産総額	47,666,394,029円
受益権総口数	11,958,594,696口
1万口当たり基準価額	39,860円

(注) 当期間中における追加設定元本額は3,040,409,875円、同解約元本額は1,542,620,953円です。

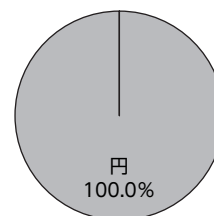
### ■資産別配分



### ■国別配分



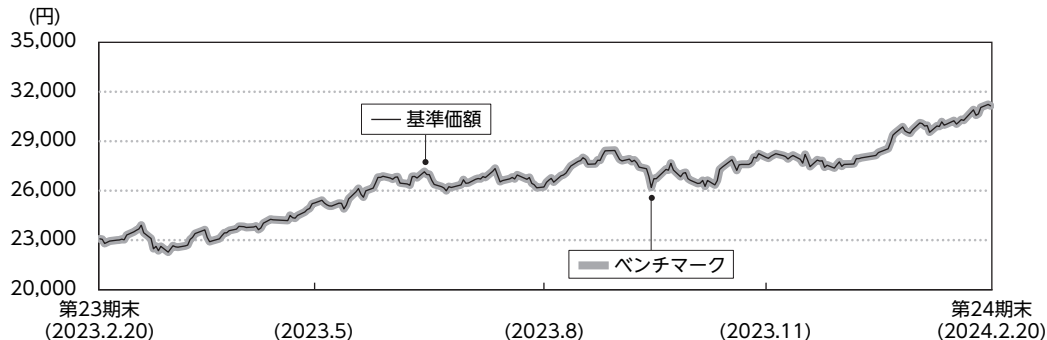
### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年2月21日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

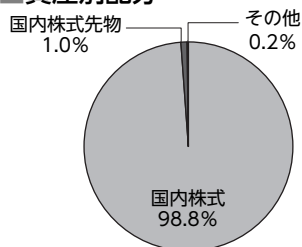
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	5.0%
ソニーグループ	円	2.5
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	2.4
東京エレクトロン	円	1.9
キーエンス	円	1.8
三菱商事	円	1.7
日立製作所	円	1.6
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.5
信越化学工業	円	1.5
日本電信電話	円	1.4
組入銘柄数		1,709

## ■ 1万口当たりの費用明細

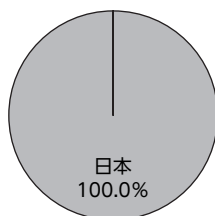
2023.2.21~2024.2.20

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

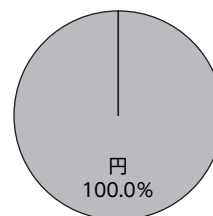
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



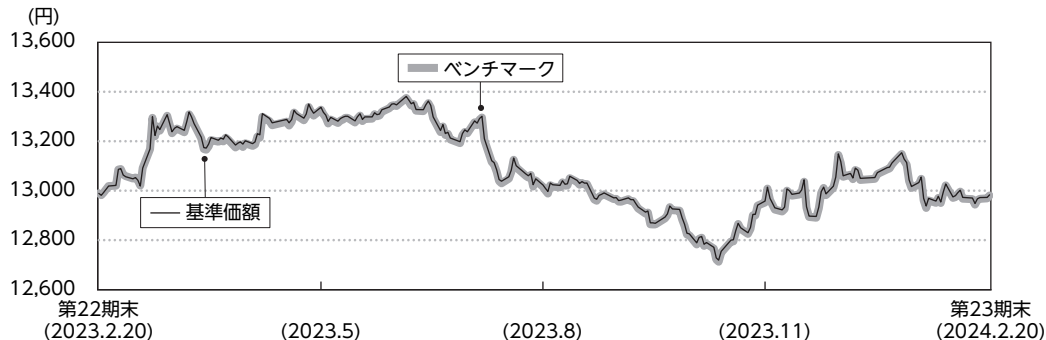
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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。

# ニッセイ国内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

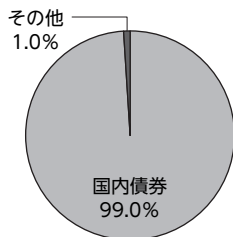
銘柄名	通貨	比率
第358回 利付国債 (10年)	円	7.5%
第350回 利付国債 (10年)	円	7.5
第134回 利付国債 (20年)	円	7.5
第160回 利付国債 (20年)	円	6.6
第158回 利付国債 (5年)	円	6.1
第452回 利付国債 (2年)	円	5.9
第148回 利付国債 (20年)	円	5.6
第176回 利付国債 (20年)	円	5.3
第 46 回 利付国債 (30年)	円	5.0
第 90 回 利付国債 (20年)	円	4.9
組入銘柄数		36

## ■ 1万口当たりの費用明細

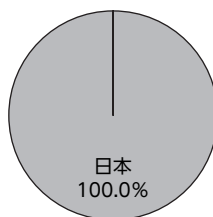
2023.2.21~2024.2.20

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

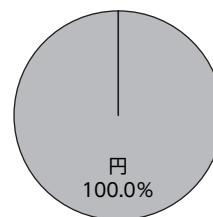
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



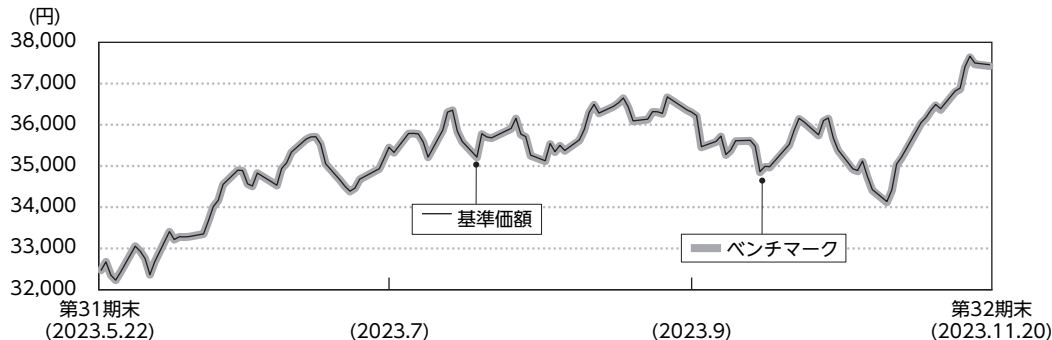
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

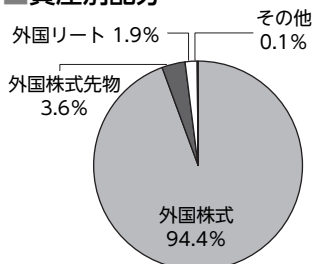
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	5.4%
MICROSOFT CORP	米ドル	4.7
S&P 500 EMINI FUTURE 202312 買	米ドル	2.7
AMAZON.COM INC	米ドル	2.4
NVIDIA CORP	米ドル	2.2
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.4
META PLATFORMS INC-A	米ドル	1.3
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.3
TESLA, INC.	米ドル	1.2
UNITEDHEALTH GROUP INC	米ドル	0.9
組入銘柄数		1278

## ■ 1万口当たりの費用明細

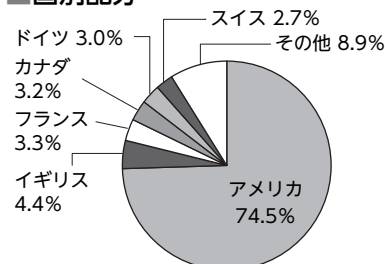
2023.5.23~2023.11.20

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	5

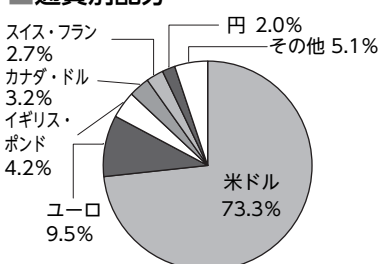
## ■ 資産別配分



## ■ 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。

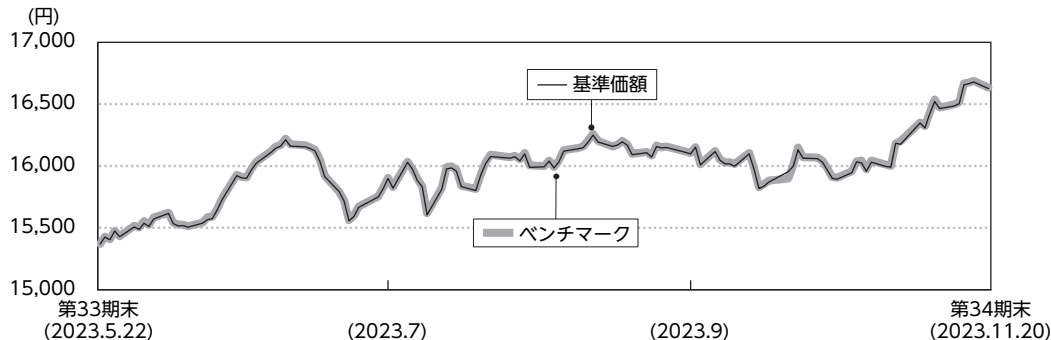
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2023年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

# ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

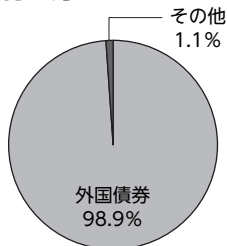
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.0% 2025/2/15	米ドル	1.7%
US TREASURY 2.25% 2025/11/15	米ドル	1.6
US TREASURY 2.125% 2025/5/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.25% 2024/11/15	米ドル	1.5
US TREASURY 1.625% 2026/2/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.875% 2028/8/15	米ドル	1.3
US TREASURY 1.625% 2026/5/15	米ドル	1.3
US TREASURY 1.5% 2026/8/15	米ドル	1.3
US TREASURY 2.25% 2027/11/15	米ドル	1.2
US TREASURY 2.0% 2025/8/15	米ドル	1.1
組入銘柄数		817

## ■ 1万口当たりの費用明細

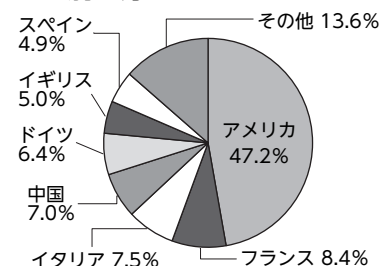
2023.5.23~2023.11.20

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

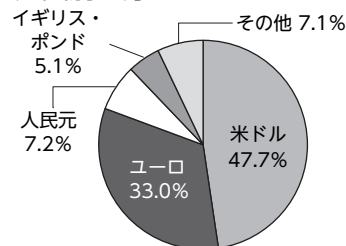
## ■ 資産別配分



## ■ 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(2023年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
17期(2020年2月21日)	18,561	0	5.4	18,561	19,550	5.6	28.9	0.7	64.8	0.3	14,127
18期(2021年2月22日)	19,431	0	4.7	19,431	20,476	4.7	29.9	0.5	64.3	0.2	19,046
19期(2022年2月21日)	19,791	0	1.9	19,791	20,918	2.2	28.5	1.1	64.6	0.2	22,732
20期(2023年2月21日)	19,943	0	0.8	19,943	21,162	1.2	29.3	0.8	64.0	0.2	25,112
21期(2024年2月21日)	22,416	0	12.4	22,416	23,856	12.7	29.7	0.6	63.9	0.2	30,184

(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
(期首)2023年2月21日	19,943	-	21,162	-	29.3	0.8	64.0	0.2
2月末	20,009	0.3	21,233	0.3	29.1	0.7	64.2	0.2
3月末	20,243	1.5	21,493	1.6	28.6	0.9	64.9	0.2
4月末	20,461	2.6	21,723	2.7	29.5	0.8	64.2	0.2
5月末	20,793	4.3	22,087	4.4	29.4	0.9	64.1	0.2
6月末	21,454	7.6	22,791	7.7	29.4	0.9	64.1	0.2
7月末	21,300	6.8	22,636	7.0	29.6	0.7	64.4	0.2
8月末	21,401	7.3	22,749	7.5	29.3	0.9	64.3	0.2
9月末	21,233	6.5	22,578	6.7	28.5	1.1	65.0	0.2
10月末	20,876	4.7	22,205	4.9	28.9	0.8	64.8	0.2
11月末	21,607	8.3	22,987	8.6	29.5	0.6	64.4	0.2
12月末	21,675	8.7	23,067	9.0	29.2	0.8	64.6	0.2
2024年1月末	22,147	11.1	23,567	11.4	30.5	0.7	63.6	0.2
(期末)2024年2月21日	22,416	12.4	23,856	12.7	29.7	0.6	63.9	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2月22日～2024年2月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	490,283	1,304,543	709,832	1,908,918
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	3,143,382	4,117,069	1,387,257	1,814,407
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	182,186	635,740	272,578	965,197
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	751,088	1,197,757	627,126	999,465

(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	45,625,740千円	112,920,220千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	187,271,457千円	704,880,639千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.24	0.16

(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2月22日～2024年2月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）

## 親投資信託残高

2024年2月21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	2,199,198	1,979,649	6,152,552
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	8,623,915	10,380,040	13,486,786
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	829,122	738,730	3,045,414
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	3,402,349	3,526,311	6,003,193

(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71,947,940千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが57,048,145千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが223,769,394千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが45,245,373千口です。

## 投資信託財産の構成

2024年2月21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	6,152,552	20.3
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	13,486,786	44.5
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	3,045,414	10.1
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	6,003,193	19.8
コール・ローン等、その他	1,588,228	5.2
投資信託財産総額	30,276,174	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル150.16円、1カナダ・ドル111.02円、1オーストラリア・ドル98.41円、1香港ドル19.20円、1シンガポール・ドル111.73円、1ニュージーランド・ドル92.63円、1イギリス・ポンド189.58円、1イスラエル・シェケル40.76円、1スイス・フラン170.29円、1デンマーク・クローネ21.78円、1ノルウェー・クローネ14.33円、1スウェーデン・クローナ14.51円、1メキシコ・ペソ8.803円、1人民元20.841円、1マレーシア・リンギット31.284円、1ポーランド・ズロチ37.609円、1ユーロ162.34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（906,034,219千円）の投資信託財産総額（923,368,981千円）に対する比率は98.1%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（76,976,335千円）の投資信託財産総額（77,334,173千円）に対する比率は99.5%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	30,276,174,988円
コール・ローン等	1,521,993,295
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	6,152,552,494
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	13,486,786,504
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	3,045,414,783
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	6,003,193,169
未収入金	66,234,743
(B)負債	91,910,283
未払解約金	69,198,482
未払信託報酬	22,155,881
その他未払費用	555,920
(C)純資産総額(A-B)	30,184,264,705
元本	13,465,469,203
次期繰越損益金	16,718,795,502
(D)受益権総口数	13,465,469,203口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,416円

(注) 期首元本額	12,591,918,256円
期中追加設定元本額	2,552,719,943円
期中一部解約元本額	1,679,168,996円

## 損益の状況

当期(2023年2月22日~2024年2月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 517,360円
受取利息	68,725
支払利息	△ 586,085
(B)有価証券売買損益	3,065,965,369
売買益	3,276,234,797
売買損	△ 210,269,428
(C)信託報酬等	△ 43,497,664
(D)当期損益金(A+B+C)	3,021,950,345
(E)前期繰越損益金	1,808,280,985
(分配準備積立金)	(1,808,772,367)
(繰越欠損金)	(△ 491,382)
(F)追加信託差損益金*	11,888,564,172
(配当等相当額)	(10,680,207,698)
(売買損益相当額)	(1,208,356,474)
(G)合計(D+E+F)	16,718,795,502
次期繰越損益金(G)	16,718,795,502
追加信託差損益金	11,888,564,172
(配当等相当額)	(10,680,207,698)
(売買損益相当額)	(1,208,356,474)
分配準備積立金	4,830,748,690
繰越欠損金	△ 517,360

- (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	3,021,976,323円
(c) 信託約款に定める収益調整金	11,888,564,172円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	1,808,772,367円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	16,719,312,862円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	12,416.44円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

## DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

### 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)	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
17期(2020年2月21日)	22,096	0	7.5	22,096	23,313	7.7	48.5	1.3	44.7	0.5	32,729
18期(2021年2月22日)	23,873	0	8.0	23,873	25,236	8.2	50.1	0.9	44.0	0.4	41,565
19期(2022年2月21日)	24,790	0	3.8	24,790	26,282	4.1	47.4	1.9	44.8	0.4	50,637
20期(2023年2月21日)	25,589	0	3.2	25,589	27,247	3.7	48.7	1.4	44.2	0.4	57,667
21期(2024年2月21日)	30,332	0	18.5	30,332	32,362	18.8	49.1	1.1	44.1	0.4	74,327

(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		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
	基準価額	騰落率		騰落率	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	%	%
(期首)2023年2月21日	25,589	-	27,247	-	48.7	1.4	44.2	0.4	
2月末	25,615	0.1	27,277	0.1	48.4	1.3	44.4	0.4	
3月末	25,876	1.1	27,571	1.2	47.8	1.5	45.1	0.4	
4月末	26,274	2.7	27,997	2.8	49.0	1.3	44.2	0.4	
5月末	26,890	5.1	28,665	5.2	49.0	1.5	44.1	0.4	
6月末	28,103	9.8	29,953	9.9	49.1	1.6	44.0	0.4	
7月末	28,087	9.8	29,942	9.9	49.6	1.1	44.1	0.4	
8月末	28,272	10.5	30,148	10.6	48.9	1.6	44.2	0.4	
9月末	28,051	9.6	29,920	9.8	48.2	1.8	44.9	0.4	
10月末	27,465	7.3	29,310	7.6	48.6	1.4	44.8	0.4	
11月末	28,660	12.0	30,585	12.3	49.5	1.0	44.3	0.4	
12月末	28,775	12.5	30,720	12.7	49.2	1.3	44.4	0.4	
2024年1月末	29,823	16.5	31,817	16.8	50.7	1.1	43.2	0.4	
(期末)2024年2月21日	30,332	18.5	32,362	18.8	49.1	1.1	44.1	0.4	

(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2月22日～2024年2月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	1,614,615	4,296,186	1,899,483	5,176,553
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	5,679,646	7,437,138	1,871,393	2,448,437
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	799,074	2,786,669	969,100	3,428,202
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,487,615	2,376,758	839,154	1,334,583

(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	45,625,740千円	112,920,220千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	187,271,457千円	704,880,639千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.24	0.16

(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2月22日～2024年2月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)

## 親投資信託残高

2024年2月21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	7,566,726	7,281,858	22,631,288
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	13,161,840	16,970,093	22,049,242
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	3,792,977	3,622,951	14,935,616
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	5,837,356	6,485,816	11,041,454

(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71,947,940千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが57,048,145千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが223,769,394千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが45,245,373千口です。

## 投資信託財産の構成

2024年2月21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	22,631,288	30.4
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	22,049,242	29.6
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	14,935,616	20.1
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	11,041,454	14.8
コール・ローン等、その他	3,810,854	5.1
投資信託財産総額	74,468,455	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル150.16円、1カナダ・ドル111.02円、1オーストラリア・ドル98.41円、1香港ドル19.20円、1シンガポール・ドル111.73円、1ニュージーランド・ドル92.63円、1イギリス・ポンド189.58円、1イスラエル・シェケル40.76円、1スイス・フラン170.29円、1デンマーク・クローネ21.78円、1ノルウェー・クローネ14.33円、1スウェーデン・クローナ14.51円、1メキシコ・ペソ8.803円、1人民元20.841円、1マレーシア・リンギット31.284円、1ポーランド・ズロチ37.609円、1ユーロ162.34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 (906,034,219千円) の投資信託財産総額 (923,368,981千円) に対する比率は98.1%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 (76,976,335千円) の投資信託財産総額 (77,334,173千円) 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。

## DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>74,468,455,086円</b>
コーポレート債	3,726,901,901
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	22,631,288,175
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	22,049,242,761
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	14,935,616,045
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	11,041,454,069
未収入金	83,952,135
<b>(B)負債</b>	<b>141,444,697</b>
未払解約金	87,092,095
未払信託報酬	53,349,612
その他未払費用	1,002,990
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>74,327,010,389</b>
元本	24,504,201,805
次期繰越損益金	49,822,808,584
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>24,504,201,805口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>30,332円</b>

(注) 期首元本額	22,536,136,173円
期中追加設定元本額	4,340,901,715円
期中一部解約元本額	2,372,836,083円

### 損益の状況

当期(2023年2月22日～2024年2月21日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 1,188,072円</b>
受取利息	132,374
支払利息	△ 1,320,446
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>10,798,590,919</b>
売買益	11,313,956,169
売買損	△ 515,365,250
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 102,343,958</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>10,695,058,889</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>8,930,795,660</b>
(分配準備積立金)	( 8,931,923,801)
(繰越欠損金)	(△ 1,128,141)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>30,196,954,035</b>
(配当等相当額)	( 28,561,967,427)
(売買損益相当額)	( 1,634,986,608)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>49,822,808,584</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>49,822,808,584</b>
追加信託差損益金	30,196,954,035
(配当等相当額)	( 28,561,967,427)
(売買損益相当額)	( 1,634,986,608)
分配準備積立金	19,627,042,621
繰越欠損金	△ 1,188,072

- (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	10,695,118,820円
(c) 信託約款に定める収益調整金	30,196,954,035円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	8,931,923,801円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	49,823,996,656円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	20,332.84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)	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
17期(2020年2月21日)	25,721	0	9.6	25,721	27,173	9.9	67.8	1.8	24.8	0.8	16,619
18期(2021年2月22日)	28,551	0	11.0	28,551	30,336	11.6	69.5	1.3	24.3	0.6	21,780
19期(2022年2月21日)	30,209	0	5.8	30,209	32,183	6.1	66.5	2.6	24.9	0.6	28,100
20期(2023年2月21日)	31,923	0	5.7	31,923	34,156	6.1	67.9	2.0	24.5	0.7	33,393
21期(2024年2月21日)	39,860	0	24.9	39,860	42,714	25.1	68.3	1.5	24.4	0.5	47,666

(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		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
	基準価額	騰落率		騰落率	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	%	
(期首)2023年2月21日	31,923	-	34,156	-	67.9	2.0	24.5	0.7	
2月末	31,883	△ 0.1	34,116	△ 0.1	67.7	1.8	24.7	0.6	
3月末	32,158	0.7	34,428	0.8	67.2	2.1	25.1	0.6	
4月末	32,802	2.8	35,122	2.8	68.3	1.7	24.4	0.6	
5月末	33,808	5.9	36,210	6.0	68.3	2.1	24.4	0.6	
6月末	35,780	12.1	38,313	12.2	68.3	2.2	24.3	0.6	
7月末	35,993	12.7	38,546	12.9	69.0	1.6	24.4	0.6	
8月末	36,298	13.7	38,884	13.8	68.2	2.3	24.5	0.6	
9月末	36,012	12.8	38,586	13.0	67.5	2.5	25.0	0.5	
10月末	35,117	10.0	37,647	10.2	68.0	1.9	24.9	0.5	
11月末	36,940	15.7	39,599	15.9	69.0	1.4	24.5	0.6	
12月末	37,119	16.3	39,807	16.5	68.6	1.8	24.6	0.6	
2024年1月末	39,003	22.2	41,795	22.4	69.9	1.6	23.7	0.6	
(期末)2024年2月21日	39,860	24.9	42,714	25.1	68.3	1.5	24.4	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2月22日～2024年2月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	1,825,914	4,893,224	1,456,008	3,967,072
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	2,399,229	3,140,480	776,330	1,015,980
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,031,279	3,629,211	842,348	2,978,046
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	953,833	1,528,205	437,019	696,324

(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	45,625,740千円	112,920,220千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	187,271,457千円	704,880,639千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.24	0.16

(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2月22日～2024年2月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）

## 親投資信託残高

2024年2月21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	5,830,862	6,200,768	19,271,367
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	3,796,612	5,419,511	7,041,571
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	3,281,796	3,470,727	14,308,073
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	2,244,992	2,761,806	4,701,700

(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71,947,940千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが57,048,145千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが223,769,394千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが45,245,373千口です。

## 投資信託財産の構成

2024年2月21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	19,271,367	40.3
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	7,041,571	14.7
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	14,308,073	29.9
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	4,701,700	9.8
コール・ローン等、その他	2,502,713	5.2
投資信託財産総額	47,825,426	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル150.16円、1カナダ・ドル111.02円、1オーストラリア・ドル98.41円、1香港ドル19.20円、1シンガポール・ドル111.73円、1ニュージーランド・ドル92.63円、1イギリス・ポンド189.58円、1イスラエル・シェケル40.76円、1スイス・フラン170.29円、1デンマーク・クローネ21.78円、1ノルウェー・クローネ14.33円、1スウェーデン・クローナ14.51円、1メキシコ・ペソ8.803円、1人民元20.841円、1マレーシア・リンギット31.284円、1ポーランド・ズロチ37.609円、1ユーロ162.34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（906,034,219千円）の投資信託財産総額（923,368,981千円）に対する比率は98.1%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（76,976,335千円）の投資信託財産総額（77,334,173千円）に対する比率は99.5%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	47,825,426,412円
コール・ローン等	2,382,907,937
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	19,271,367,697
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	7,041,571,350
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	14,308,073,908
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	4,701,700,204
未収入金	119,805,316
(B)負債	159,032,383
未払解約金	125,288,730
未払信託報酬	33,031,877
その他未払費用	711,776
(C)純資産総額(A-B)	47,666,394,029
元本	11,958,594,696
次期繰越損益金	35,707,799,333
(D)受益権総口数	11,958,594,696口
1万口当たり基準価額(C/D)	39,860円

(注) 期首元本額	10,460,805,774円
期中追加設定元本額	3,040,409,875円
期中一部解約元本額	1,542,620,953円

## 損益の状況

当期(2023年2月22日~2024年2月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 672,023円
受取利息	89,706
支払利息	△ 761,729
(B)有価証券売買損益	8,469,362,103
売買益	8,979,422,712
売買損	△ 510,060,609
(C)信託報酬等	△ 62,131,546
(D)当期損益金(A+B+C)	8,406,558,534
(E)前期繰越損益金	5,604,855,639
(分配準備積立金)	( 5,605,457,731)
(繰越欠損金)	(△ 602,092)
(F)追加信託差損益金*	21,696,385,160
(配当等相当額)	( 20,510,561,732)
(売買損益相当額)	( 1,185,823,428)
(G)合計(D+E+F)	35,707,799,333
次期繰越損益金(G)	35,707,799,333
追加信託差損益金	21,696,385,160
(配当等相当額)	( 20,510,561,732)
(売買損益相当額)	( 1,185,823,428)
分配準備積立金	14,012,086,196
繰越欠損金	△ 672,023

- (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	8,406,628,465円
(c) 信託約款に定める収益調整金	21,696,385,160円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	5,605,457,731円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	35,708,471,356円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	29,860.09円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

# お知らせ

## ■各ファンドの約款変更

マザーファンドのベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化しました。

(2023年11月22日)

# 各ファンドの概要

		債券重視型	標準型	株式重視型	
商品分類	信託期間	追加型投信／内外／資産複合			
運用方針		無期限			
		下記マザーファンド受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。			
主要運用対象	DCニッセイワールドセレクトファンド	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券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」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券			
	国内株式マザーファンド	国内の金融商品取引所上場株式等			
	国内債券マザーファンド	国内の公社債			
	外国株式マザーファンド	日本を除く主要先進国の株式			
	外国債券マザーファンド	日本を除く主要国の国債			
投資比率		各マザーファンドへは、原則として下記の比率で投資し、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。			
	国内株式マザーファンド	20%	30%	40%	
	国内債券マザーファンド	45%	30%	15%	
	外国株式マザーファンド	10%	20%	30%	
	外国債券マザーファンド	20%	15%	10%	
	短期金融資産	5%	5%	5%	
運用方法	実質投資割合	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の65%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の85%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の55%以下とします。	
	組入制限	国内株式マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。		
		国内債券マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限ります。		
		外国株式マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。		
		外国債券マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。		
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の利子・配当収入および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。				

# ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 24 期

(計算期間：2023年2月21日～2024年2月20日)

#### 運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

#### 主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

#### 運用方法

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



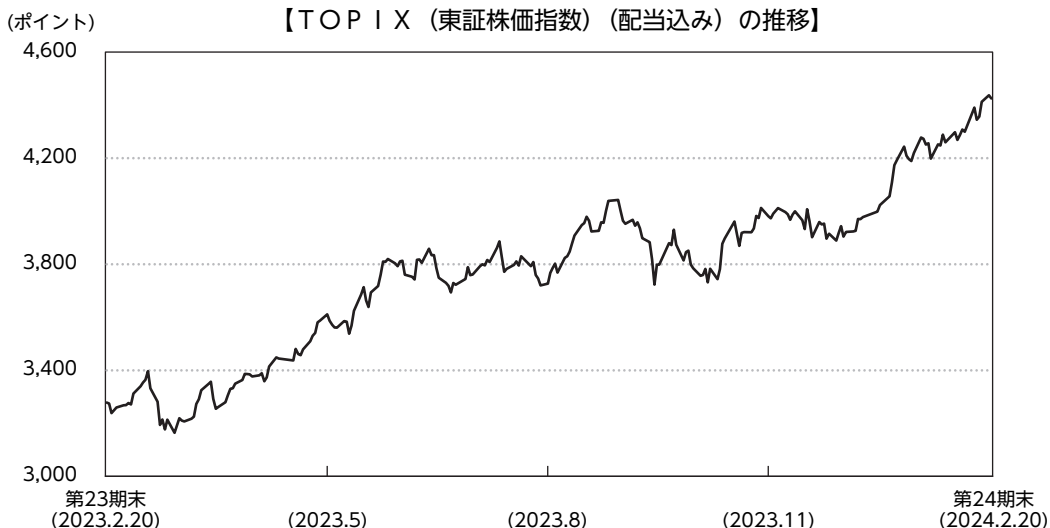
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2023年2月21日～2024年2月20日

## 国内株式市況



(注) FactSetのデータを使用しています。

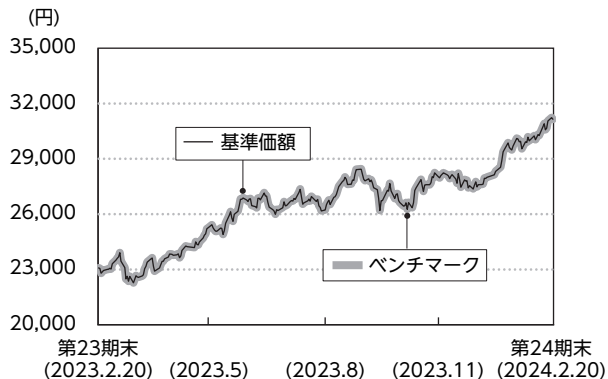
当期の国内株式市場はおおむね上昇基調で推移しました。

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

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

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

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは前掲の「国内株式市況」をご参照ください。

## ポートフォリオ

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

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

## ベンチマークとの差異

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

## 今後の運用方針

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

## お知らせ

### ■ 約款変更

ベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化しました。

(2023年8月19日)



## 最近5期の運用実績

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

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2023年2月21日～2024年2月20日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## 売買および取引の状況

2023年2月21日～2024年2月20日

## (1) 株式

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

## (2) 先物取引の種類別取引状況

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

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2023年2月21日～2024年2月20日

## 株式

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## 組入有価証券明細表

2024年2月20日現在

(1) 国内株式  
上場株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
極洋	3	3	11,036
ニッセイ	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
ホクト	7	6	12,381
<b>鉱業(0.3%)</b>			
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
<b>建設業(2.0%)</b>			
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
ピ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
ソネット	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
飛鳥建設	6	6	8,820
長谷工コーポレーション	64	53	100,097
松井建設	8	7	6,650
銭高組	1	-	-
鹿島建設	138	128	359,437
不動テトラ	4	4	8,844
鉄建建設	4	4	10,378
西松建設	10	11	50,727
三井住友建設	50	43	18,575
大豊建設	2	2	6,400
佐田建設	10	2	1,505
ナカノフドー建設	15	0.100	64
奥村組	10	9	47,470
東鉄工業	8	7	21,888
浅沼組	5	4	17,909
戸田建設	76	78	75,575
熊谷組	10	9	36,912
植木組	3	0.900	1,635
矢作建設工業	8	7	12,624
ピーエス三菱	7	7	7,784
日本ハウスホールディングス	13	21	6,447
新日本建設	8	8	10,184
東亜道路工業	1	2	14,858
日本道路	1	6	13,749
東亜建設工業	5	4	20,947
日本国土開発	18	16	8,613
若築建設	2	2	6,594
東洋建設	20	14	19,213
五洋建設	88	82	62,797
世紀東急工業	8	7	14,520
福田組	2	2	11,726
住友林業	47	50	205,374
日本基礎技術	8	8	3,661
巴コーポレーション	10	6	3,960
大和ハウス工業	174	160	698,193
ライト工業	11	12	22,596
積水ハウス	195	176	580,356
日特建設	6	5	6,501
北陸電気工事	7	5	6,864

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
カゴメ	29	25	89,908
アリアケジャパン	5	5	31,436
エバラ食品工業	1	2	6,410
ニチレイ	28	26	101,893
東洋水産	31	29	248,360
イートアンドホールディングス	2	3	6,411
ヨムラ・フード・ホールディングス	7	6	7,833
日清食品ホールディングス	22	61	275,598
永谷園ホールディングス	3	2	6,458
一正蒲鉾	6	-	-
フジッコ	6	6	11,658
ロック・フィールド	7	7	11,842
日本たばこ産業	412	354	1,385,103
ケンコーマヨネーズ	4	4	8,400
わらべや日洋ホールディングス	4	3	11,056
なとり	3	3	8,025
ファーマフーズ	9	8	8,316
ユーグレナ	40	36	22,905
紀文食品	5	5	6,211
ピックルスホールディングス	4	5	6,446
ミヨシ油脂	3	-	-
理研ビタミン	5	5	11,940
<b>繊維製品(0.4%)</b>			
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
<b>パルプ・紙(0.2%)</b>			
特種東海製紙	2	3	12,192
王子ホールディングス	265	247	137,183
日本製紙	33	33	38,223
三菱製紙	8	4	2,425
北越コーポレーション	40	29	38,164
大王製紙	28	26	28,440
阿波製紙	11	3	1,950
レンゴー	58	54	54,424
トーモク	3	3	7,871
ザ・パック	4	4	16,786
<b>化学(5.8%)</b>			
北の達人コーポレーション	26	26	6,015
クラレ	101	86	130,139
旭化成	398	401	422,693
レゾナック・ホールディングス	61	57	186,779
住友化学	473	440	137,498
住友精化	2	2	14,140
日産化学	30	27	175,267
ラサ工業	2	2	6,320
クレハ	5	13	34,853
多木化学	2	2	8,349
テイカ	4	5	7,089
石原産業	11	9	14,827
片倉コープアグリ	1	-	-
日本曹達	6	7	41,510
東ソー	85	79	159,868
トクヤマ	20	19	45,100
セントラル硝子	10	6	18,169
東亜合成	32	28	43,572
大阪ソーダ	3	4	46,863
関東電化工業	12	11	10,683
デンカ	23	21	54,496
信越化学工業	107	538	3,298,851

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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



## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
J F Eホールディングス	175	170	399,905	
東京製鐵	18	17	29,068	
共英製鋼	7	7	16,037	
大和工業	10	11	97,520	
東京鐵鋼	3	2	14,202	
大阪製鐵	4	2	6,636	
淀川製鋼所	7	7	29,925	
中部鋼鉄	-	4	10,036	
丸一鋼管	20	18	75,255	
大同特殊鋼	8	38	68,838	
日本高周波鋼業	15	-	-	
日本冶金工業	4	4	20,835	
山陽特殊製鋼	6	6	13,560	
愛知製鋼	3	3	12,355	
大太平洋金属	4	5	7,316	
新日本電工	42	30	9,211	
栗本鐵工所	3	2	9,352	
三菱製鋼	4	4	6,498	
日亜鋼業	18	10	3,515	
日本精線	1	1	6,960	
エンビプロ・ホールディングス	0.300	10	5,019	
シンニッタン	14	14	3,946	
<b>非鉄金属(0.7%)</b>				
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	
<b>金属製品(0.5%)</b>				
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	
東京製鋼	5	4	7,256	
サンコール	2	13	6,264	
モリテックスチール	7	0.100	26	
パイオラックス	9	7	20,580	
エイチワン	7	7	5,297	
日本発条	58	54	78,363	
中央発条	4	8	6,450	
三益半導体工業	5	5	17,160	
<b>機械(5.4%)</b>				
日本製鋼所	17	16	41,844	
三浦工業	26	25	73,475	
タクマ	19	20	38,117	

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱ロジスネクスト	10	9	13,927
日産自動車	904	800	453,016
いすゞ自動車	185	172	371,263
トヨタ自動車	3,497	3,255	11,113,935
日野自動車	82	89	42,200
三菱自動車工業	248	231	104,478
エフテック	1	1	987
武蔵精密工業	15	14	23,519
日産車体	11	6	6,220
新明和工業	20	17	20,366
極東開発工業	11	9	23,235
トピー工業	5	4	14,054
ティラド	1	1	6,545
曙ブレーキ工業	38	-	-
タチエス	10	10	21,952
NOK	24	23	48,024
フタバ産業	17	15	16,424
カヤバ	6	5	28,015
大同メタル工業	12	11	6,414
プレス工業	28	23	15,499
ミクニ	13	3	1,666
太平洋工業	14	13	19,801
アイシン	49	45	249,384
マツダ	210	196	339,645
今仙電機製作所	2	2	1,672
本田技研工業	517	1,445	2,527,258
スズキ	117	108	716,453
SUBARU	201	183	617,720
ヤマハ発動機	100	256	354,196
エクセディ	10	9	27,965
豊田合成	18	17	50,260
愛三工業	10	9	14,278
盟和産業	4	1	1,333
ヨロズ	7	6	6,358
エフ・シー・シー	11	10	22,218
シマノ	26	23	483,855
テイ・エス テック	29	21	41,387
ジャムコ	3	4	5,472
<b>精密機器(2.3%)</b>			
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
<b>その他製品(2.3%)</b>			
KYORITSU	25	-	-
スノーピーク	10	8	9,673
パラマウントベッドホールディングス	14	12	30,553
トランザクション	4	3	9,941
粧美堂	2	-	-
ニホンフラッシュ	6	6	6,500
前田工織	6	5	16,800
永大産業	18	-	-
アートネイチャー	6	7	6,233
フルヤ金属	-	1	13,776
パンダイナムコホールディングス	58	162	474,045
アイフィスジャパン	7	-	-
SHOEI	6	13	28,113

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フランスベッドホールディングス	7	7	10,048
パイロットコーポレーション	10	8	32,287
萩原工業	4	-	-
フジシールインターナショナル	12	12	24,300
タカラトミー	29	27	62,842
広済堂ホールディングス	4	15	10,235
プロネクサス	5	6	7,448
大建工業	3	-	-
TOPPANホールディングス	83	72	256,024
大日本印刷	75	64	291,405
共同印刷	1	1	5,994
NISSHA	12	10	15,220
TAKARA & COMPANY	4	3	9,842
アシックス	58	50	295,374
ツツミ	2	3	6,288
ローランド	4	4	21,582
小松ウオール工業	2	2	8,016
ヤマハ	40	37	120,428
河合楽器製作所	1	1	6,102
クリナップ	-	7	5,306
ピジョン	40	37	60,309
兼松サステック	0,400	-	-
キングジム	5	7	6,424
リンテック	12	11	35,938
イトーキ	13	12	24,151
任天堂	402	374	3,092,840
三菱鉛筆	9	8	20,487
タカラスタンダード	12	12	23,087
コクヨ	30	24	60,130
ナカバヤシ	9	11	6,236
グローブライド	5	5	10,743
オカムラ	19	17	38,928
美津濃	6	5	30,975
<b>電気・ガス業(1.3%)</b>			
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
<b>陸運業(2.6%)</b>			
SBSホールディングス	5	5	12,757
東武鉄道	70	65	251,937
相鉄ホールディングス	21	21	57,727
東急	178	166	294,849
京浜急行電鉄	72	73	95,713
小田急電鉄	96	98	206,486
京王電鉄	33	28	119,928
京成電鉄	41	38	284,666
富士急行	7	7	28,324
東日本旅客鉄道	108	108	974,546
西日本旅客鉄道	81	70	436,914
東海旅客鉄道	49	228	857,413
西武ホールディングス	77	71	154,979
鴻池運輸	10	10	18,200
西日本鉄道	17	15	37,983
ハマキョウレックス	5	5	19,864
サカイ引越センター	3	6	17,047
近鉄グループホールディングス	63	59	266,400
阪急阪神ホールディングス	84	78	339,743
南海電気鉄道	30	26	77,035
京阪ホールディングス	26	32	113,252
神戸電鉄	1	2	6,272
名古屋鉄道	70	61	130,295
山陽電気鉄道	4	4	9,558
アルプス物流	5	4	8,930

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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



## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	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
<b>銀行業(7.2%)</b>			
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
<b>証券・商品先物取引業(0.9%)</b>			
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
<b>保険業(2.6%)</b>			
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
<b>その他金融業(1.2%)</b>			
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
<b>不動産業(1.9%)</b>			
大東建託	23	21	367,545
いちご	72	67	27,216
日本駐車場開発	74	61	11,185
S R E ホールディングス	3	2	8,650
ADワークスグループ	20	20	4,763
ヒューリック	146	136	206,411
三栄建築設計	3	-	-
野村不動産ホールディングス	39	32	120,412
三重交通グループホールディングス	13	12	7,550
サムティ	10	9	23,212
ディア・ライフ	9	10	9,260
コーセーアールイー	6	3	3,307
地主	4	4	9,499
プレサンスコーポレーション	8	9	15,475
ハウスコム	4	4	3,864
J P M C	4	5	6,754
サンセイランディック	5	2	2,380
エストラスト	8	7	4,920

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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



## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ライク	2	4	6,581
A o b a - B B T	11	-	-
エスプール	18	20	6,457
WDBホールディングス	3	3	7,182
アドウェイズ	9	12	5,790
バリューコマース	4	5	6,153
インフォマート	68	63	24,813
J Pホールディングス	18	15	7,410
C Lホールディングス	6	-	-
プレステージ・インターナショナル	27	28	17,271
アミューズ	3	4	6,056
ドリームインキュベータ	2	2	6,468
クイック	5	4	10,101
T A C	22	-	-
電通グループ	64	59	258,348
びあ	2	2	6,594
イオンファンタジー	2	2	6,220
シーティーエス	7	9	6,880
H. U. グループホールディングス	19	17	48,594
アルプス技研	5	5	17,057
日本空調サービス	7	7	6,727
オリエンタルランド	69	322	1,738,597
ダスキン	14	13	45,954
明光ネットワークジャパン	8	8	6,505
ファルコホールディングス	3	2	6,664
秀英予備校	11	-	-
ラウンドワン	54	57	39,835
リゾートトラスト	25	26	67,190
ビー・エム・エル	8	7	20,580
りらいあコミュニケーションズ	10	-	-
リソー教育	29	31	7,246
早稲田アカデミー	4	-	-
ユー・エス・エス	67	68	178,318
東京個別指導学院	9	14	6,375
サイバーエージェント	156	134	141,704
楽天グループ	302	522	391,643
クリーク・アンド・リバー社	3	3	6,198
SBI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
キュービネットホールディングス	3	4	5,636

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

(注1) 銘柄欄の( )内は、当期末における国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

### (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
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
<b>(A)資産</b>	<b>産</b>	<b>224,657,797,609円</b>
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>(B)負債</b>	<b>債</b>	<b>655,207,961</b>
未払解約金		655,205,252
その他未払費用		2,709
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>		<b>224,002,589,648</b>
元本		71,936,737,810
次期繰越損益金		152,065,851,838
<b>(D)受益権総口数</b>		<b>71,936,737,810口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>		<b>31,139円</b>

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

### 損益の状況

当期(2023年2月21日~2024年2月20日)

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

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

# ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 23 期

(計算期間：2023年2月21日～2024年2月20日)

#### 運用方針

- ① 国内の公社債に投資し、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す。
- ② 原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

#### 主要運用 対象

国内の公社債

#### 運用方法

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



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

## 国内債券市況



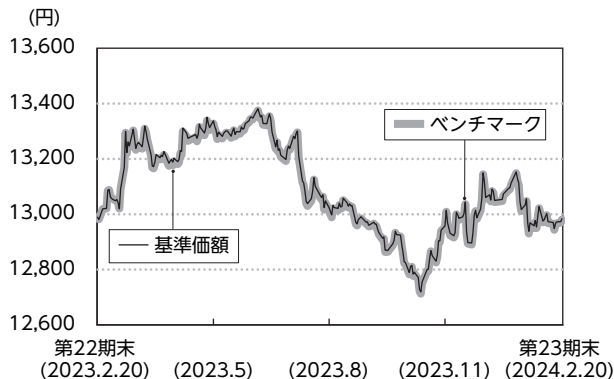
(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

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、おおむね横ばいで推移した後、2023年3月中旬に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。4月下旬の日銀金融政策決定会合において金融政策の現状維持が発表されたことで6月末まで緩やかに低下しましたが、7月に入ると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直し引き上げ報道等から金融政策の修正観測が高まり金利は大きく上昇し、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金融政策の修正観測が強まり、金利は上昇基調となりましたが、11月に入ると米金融引き締め長期化観測が後退したことなどを背景に金利は低下しました。2024年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（FRB）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、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 2023年3月中旬から下旬にかけて、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が低下（債券価格は上昇）したこと
- ・ 11月初旬から2024年1月中旬にかけて、米金融引き締め長期化観測が後退したことなどを背景に金利が低下したこと

#### <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-0.0%となり、ベンチマーク騰落率（-0.1%）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
19期(2020年2月20日)	13,877	1.1	13,894	1.2	99.2	41,491
20期(2021年2月22日)	13,621	△1.8	13,642	△1.8	99.2	47,767
21期(2022年2月21日)	13,505	△0.9	13,536	△0.8	99.2	55,653
22期(2023年2月20日)	12,989	△3.8	13,021	△3.8	99.2	60,362
23期(2024年2月20日)	12,983	△0.0	13,012	△0.1	99.0	74,084

(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2月20日	12,989	—	13,021	—	99.2
2月末	13,086	0.7	13,117	0.7	99.1
3月末	13,271	2.2	13,301	2.2	99.5
4月末	13,311	2.5	13,331	2.4	99.6
5月末	13,297	2.4	13,319	2.3	99.0
6月末	13,328	2.6	13,356	2.6	99.0
7月末	13,121	1.0	13,148	1.0	99.4
8月末	13,028	0.3	13,053	0.2	99.2
9月末	12,934	△0.4	12,960	△0.5	99.2
10月末	12,728	△2.0	12,753	△2.1	99.4
11月末	12,999	0.1	13,022	0.0	99.1
12月末	13,050	0.5	13,075	0.4	99.2
2024年1月末	12,954	△0.3	12,982	△0.3	99.4
(期末)2024年2月20日	12,983	△0.0	13,012	△0.1	99.0

(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	
その他費用 (その他)	0円 (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	0.000	

(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（13,096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

## 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	69,130,529	54,971,446

(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。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2月21日～2024年2月20日

## 公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
千円		千円	
第358回 利付国債 (10年)	5,097,183	第362回 利付国債 (10年)	5,024,624
第134回 利付国債 (20年)	5,061,484	第338回 利付国債 (10年)	4,813,084
第350回 利付国債 (10年)	4,582,138	第354回 利付国債 (10年)	4,093,290
第158回 利付国債 (5年)	4,544,301	第342回 利付国債 (10年)	4,075,996
第452回 利付国債 (2年)	4,352,781	第143回 利付国債 (20年)	3,297,024
第148回 利付国債 (20年)	4,210,849	第94回 利付国債 (20年)	3,263,648
第338回 利付国債 (10年)	4,163,800	第346回 利付国債 (10年)	3,113,432
第342回 利付国債 (10年)	3,674,714	第340回 利付国債 (10年)	2,911,772
第90回 利付国債 (20年)	3,626,047	第335回 利付国債 (10年)	2,787,796
第366回 利付国債 (10年)	3,601,071	第152回 利付国債 (20年)	2,718,995

(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2月20日現在

## 国内（邦貨建）公社債

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	73,776,000 (29,210,000)	73,373,274 (27,192,788)	99.0 (36.7)	–	62.8 (24.5)	25.5 ( 6.3)	10.7 ( 5.9)
合計	73,776,000 (29,210,000)	73,373,274 (27,192,788)	99.0 (36.7)	–	62.8 (24.5)	25.5 ( 6.3)	10.7 ( 5.9)

(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
国債証券	第450回 利付国債（2年）	0.0050	2025/7/1	12,000	11,992
	第452回 利付国債（2年）	0.0050	2025/9/1	4,353,000	4,347,689
	第143回 利付国債（5年）	0.1000	2025/3/20	10,000	10,010
	第151回 利付国債（5年）	0.0050	2027/3/20	119,000	118,471
	第158回 利付国債（5年）	0.1000	2028/3/20	4,552,000	4,523,550
	第4回 利付国債（40年）	2.2000	2051/3/20	2,248,000	2,502,788
	第8回 利付国債（40年）	1.4000	2055/3/20	358,000	329,789
	第12回 利付国債（40年）	0.5000	2059/3/20	1,344,000	902,375
	第16回 利付国債（40年）	1.3000	2063/3/20	72,000	61,621
	第338回 利付国債（10年）	0.4000	2025/3/20	592,000	594,510
	第340回 利付国債（10年）	0.4000	2025/9/20	2,959,000	2,973,913
	第342回 利付国債（10年）	0.1000	2026/3/20	1,179,000	1,178,386
	第344回 利付国債（10年）	0.1000	2026/9/20	1,523,000	1,521,629
	第346回 利付国債（10年）	0.1000	2027/3/20	2,396,000	2,391,950
	第350回 利付国債（10年）	0.1000	2028/3/20	5,562,000	5,527,237
	第354回 利付国債（10年）	0.1000	2029/3/20	1,271,000	1,255,150
	第358回 利付国債（10年）	0.1000	2030/3/20	5,637,000	5,541,621
	第362回 利付国債（10年）	0.1000	2031/3/20	117,000	114,075

## ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

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366回 利付国債 (10年)	0.2000	2032/3/20	3,703,000	3,597,242
	第14回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/3/20	121,000	140,422
	第30回 利付国債 (30年)	2.3000	2039/3/20	882,000	1,020,165
	第34回 利付国債 (30年)	2.2000	2041/3/20	1,127,000	1,278,547
	第38回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/3/20	260,000	276,486
	第46回 利付国債 (30年)	1.5000	2045/3/20	3,678,000	3,669,172
	第70回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/3/20	3,548,000	2,794,333
	第90回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/9/20	3,423,000	3,604,590
	第94回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/3/20	10,000	10,598
	第117回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/3/20	1,435,000	1,582,934
	第125回 利付国債 (20年)	2.2000	2031/3/20	124,000	139,018
	第134回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/3/20	5,034,000	5,524,714
	第136回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/3/20	18,000	19,468
	第143回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/3/20	1,166,000	1,263,069
	第148回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/3/20	3,859,000	4,141,710
	第152回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/3/20	1,561,000	1,622,035
	第160回 利付国債 (20年)	0.7000	2037/3/20	5,051,000	4,867,345
第176回 利付国債 (20年)	0.5000	2041/3/20	4,472,000	3,914,654	
	合計	-	-	73,776,000	73,373,274

### 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	%
公社債	73,373,274	98.9
コール・ローン等、その他	849,705	1.1
投資信託財産総額	74,222,979	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ国内債券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	
<b>(A)資産</b>	<b>産</b>	<b>74,222,979,746円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	601,916,141	
公 社 債 (評価額)	73,373,274,540	
未 収 利 息	205,600,679	
前 払 費 用	42,188,386	
<b>(B)負債</b>	<b>債</b>	<b>138,935,464</b>
未 払 解 約 金	138,934,870	
そ の 他 未 払 費 用	594	
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>74,084,044,282</b>	
元 本	57,063,526,944	
次 期 繰 越 損 益 金	17,020,517,338	
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>57,063,526,944口</b>	
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>12,983円</b>	

(注1) 期首元本額	46,473,690,789円
期中追加設定元本額	19,576,606,624円
期中一部解約元本額	8,986,770,469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ァンド別内訳は、次の通りです。	
ニッセイ国内債券インデックス S A (適格機関投資家限定)	1,665,913,549円
D Cニッセイ国内債券インデックス	7,803,434,563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)	3,819,401円
D Cニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	10,389,190,115円
D Cニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	16,972,467,342円
D Cニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	5,418,434,867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)	14,830,361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)	8,468,515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)	12,138,433円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	6,175,072,567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)	8,579,454,243円
ニッセイ日経225高値参照型アロケーションファンド	19,401,564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)	552,931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)	348,493円

### 損益の状況

当期 (2023年2月21日~2024年2月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>504,649,607円</b>
受 取 利 息	504,887,771
支 払 利 息	△ 238,164
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>△ 655,950,380</b>
売 買 益	213,358,435
売 買 損	△ 869,308,815
<b>(C)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 10,933</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 151,311,706</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>13,888,779,116</b>
<b>(F)追加信託差損益金</b>	<b>6,049,732,059</b>
<b>(G)解約差損益金</b>	<b>△ 2,766,682,131</b>
<b>(H)合 計(D+E+F+G)</b>	<b>17,020,517,338</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 (H)</b>	<b>17,020,517,338</b>

- (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。

# ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 32 期

(計算期間：2023年5月23日～2023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

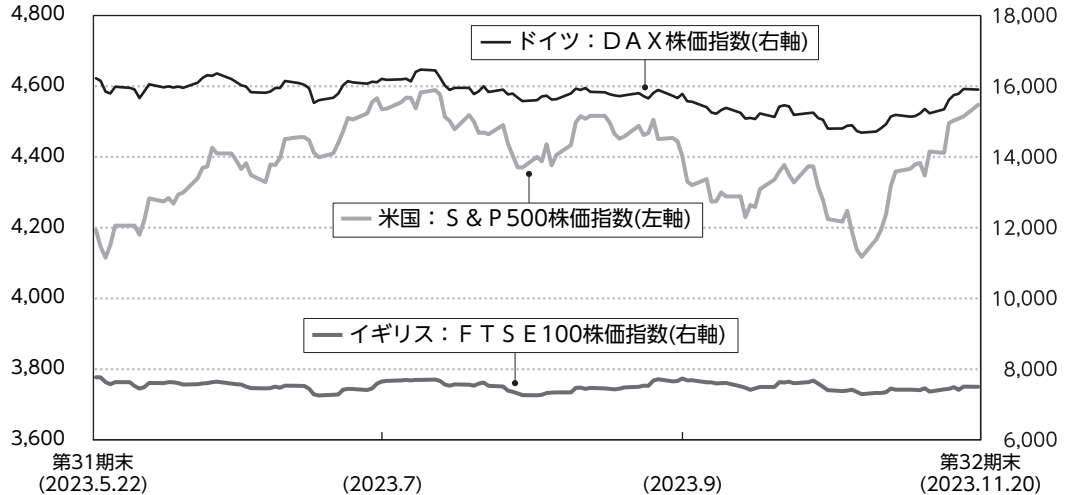
## 運用経過

2023年5月23日～2023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】

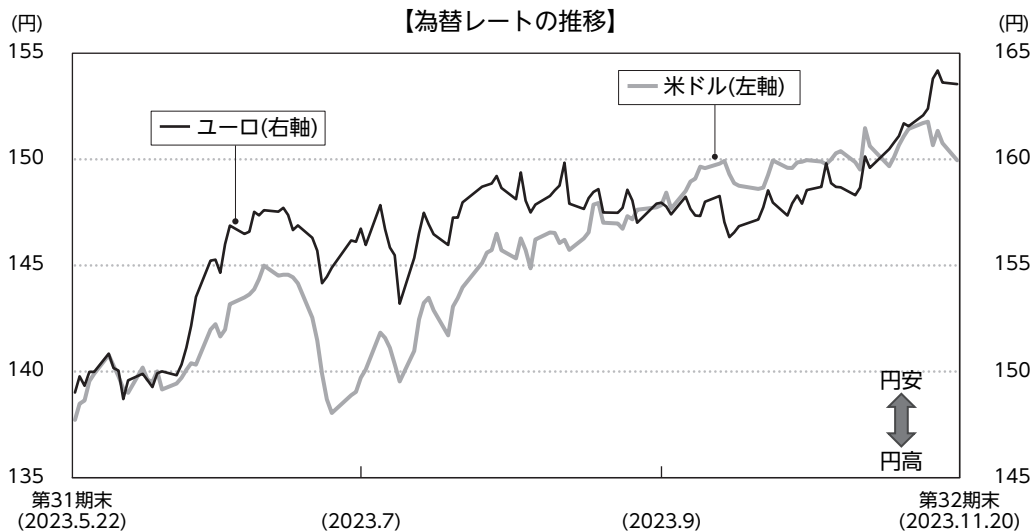


(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は米長期金利の上昇や地政学リスクの高まりから下落する一方、世界の主要な中央銀行による利上げの最終局面入り意識されたことなどから当期末にかけて上昇し、期を通じて見ると米国は上昇、ドイツとイギリスは下落しました。

期初から7月にかけては、米国における債務上限法案の上下院での可決や米消費者物価指数（CPI）がおおむね市場の予想通りとなったこと、堅調な経済指標を背景とした景気の軟着陸（ソフトランディング）への期待感が強まったことなどから株価はおおむね上昇しました。8月以降は米国債の格下げや堅調な経済指標を受けて米金利が上昇したことへの懸念等から株価は下落し、その後も米連邦準備制度理事会（FRB）による金融引き締めに向き姿勢を受けて米金利が上昇したことや米国の政府閉鎖問題、中東情勢の緊迫化を背景に下落しました。11月に入ると米連邦公開市場委員会（FOMC）で追加利上げ観測が後退したことなどを受けて株価は反発しました。結局、前期末と比較すると米国は上昇、ドイツとイギリスは下落して当期末を迎えました。

## ■為替市況



(注) 為替レートは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、7月に日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けて大きく円高に振れる場面があったものの、その後は米国が利上げ方向である一方で日本が金融緩和方向であったことから日米金利差が拡大し、大幅な米ドル高円安基調となりました。11月には米国の将来の利下げ観測が意識される一方で日本の金融政策正常化観測が高まったことでやや米ドル安円高となりましたが、結局、期を通じて見ると米ドル高円安で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、欧州中央銀行（ECB）が物価上昇リスクを警戒していたことや米金利の上昇に連れて欧州金利が上昇したことなどからユーロ高円安基調で始まりました。7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けてユーロ安円高に転じましたが、その後は日・欧中央銀行の金融政策の影響を受けて上下に振れつつも横ばい圏での推移となりました。11月には大手格付け機関によるイタリア国債の格下げが回避されたことなどをを受けてユーロに対する懸念が後退したことや日銀の金融緩和と政策継続への見方が強まったことなどからユーロ高円安となり、結局、期を通じて見るとユーロ高円安で当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 6月にFOMCにおいて市場の予想通り利上げが見送られたことに加えて、堅調な経済指標やCPIの減速を受けて米景気のソフトランディングへの期待感が強まったことなどから株価が上昇したこと
- ・ 11月にFOMCで追加利上げ観測が後退したことなどをを受けて株価が上昇したこと
- ・ 期を通じて内外金利差の拡大などから円安が進行したこと

#### <下落要因>

- ・ 9月にFRBによる金融引き締めに前向きな姿勢を受けて米金利が上昇する中、幅広いセクターで株価が下落したこと

## 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+15.3%となり、ベンチマーク騰落率(+15.2%)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。

## お知らせ

### ■ 約款変更

- ・ 以下の変更に伴い、関連条項に所要の変更を行いました。
  - ① 信託金の限度額を変更
  - ② ベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化

(2023年8月19日)



## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
28期(2021年11月22日)	29,525	16.8	28,808	16.8	94.9	2.9	2.1	513,761
29期(2022年5月20日)	27,529	△ 6.8	26,838	△ 6.8	94.8	2.8	2.3	510,207
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

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
		%		%			
(期首)2023年5月22日	32,472	—	31,568	—	95.1	2.9	2.0
5月末	32,757	0.9	31,845	0.9	95.7	2.9	2.0
6月末	35,334	8.8	34,344	8.8	94.3	3.5	1.9
7月末	35,870	10.5	34,865	10.4	95.1	2.8	1.9
8月末	36,493	12.4	35,466	12.3	93.8	4.2	1.9
9月末	35,612	9.7	34,608	9.6	94.5	3.5	1.8
10月末	34,419	6.0	33,440	5.9	95.0	3.0	1.8
(期末)2023年11月20日	37,454	15.3	36,382	15.2	94.4	3.6	1.9

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式)	0円	0.001%	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
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税 (株式)	1	0.003	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用 (保管費用)	3	0.008	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	
			・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	5	0.013	

(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（35,267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5月23日～2023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 30,057 ( 1,299)	千米ドル 282,332 (△ 135)	百株 5,304	千米ドル 28,957
	カナダ	3,162 ( 224)	千カナダ・ドル 18,932 (△ 96)	135	千カナダ・ドル 678
	オーストラリア	5,194 (△ 456)	千オーストラリア・ドル 11,696	131	千オーストラリア・ドル 54
	香港	5,551	千香港ドル 17,481	486	千香港ドル 1,242
	シンガポール	21,395	千シンガポール・ドル 2,625 (△ 23)	263	千シンガポール・ドル 344
	ニュージーランド	384	千ニュージーランド・ドル 334	6	千ニュージーランド・ドル 28
	イギリス	24,825	千イギリス・ポンド 17,312 (△ 261)	4,652	千イギリス・ポンド 953
	イスラエル	411	千イスラエル・シェケル 1,651	2,120	千イスラエル・シェケル 2,816
	スイス	1,174 ( 398)	千スイス・フラン 9,750 (△ 8)	3,614	千スイス・フラン 1,849
	デンマーク	348 ( 1,587)	千デンマーク・クローネ 20,170	6	千デンマーク・クローネ 390
ノルウェー	421	千ノルウェー・クローネ 7,476	29	千ノルウェー・クローネ 960	
スウェーデン	2,914 ( 161)	千スウェーデン・クローナ 46,530	2,433	千スウェーデン・クローナ 23,525	

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	591	956	705	3,553
		オランダ	1,496	7,389	480	1,216
			( 804)	(△ 26)		
		ベルギー	129	1,189	7	95
		ルクセンブルグ	91	188	37	87
		フランス	1,527	10,327	706	2,101
				(△ 58)		
		ドイツ	1,917	9,193	1,333	1,007
				(△ 30)		
		ポルトガル	669	432	31	54
			(△ 265)	(△ 6)		
		スペイン	2,729	2,623	773	579
		(△ 0.886)				
イタリア	3,013	1,959	545	554		
		(△ 1)				
フィンランド	666	872	477	217		
	( 447)					
オーストリア	46	179	—	—		
その他	117	108	82	35		

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	1	61	—	—
CROWN CASTLE INC	3	322	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	215	—	—
PROLOGIS INC	6	773	—	—
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	5	112	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	214	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	131	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	2	162	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.390	89	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4	93	—	—
WELLTOWER INC	5	447	—	—
HOST HOTELS AND RESORTS INC	4	75	—	—
KIMCO REALTY CORP	4	82	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.921	132	—	—
PUBLIC STORAGE	1	312	—	—
REGENCY CENTERS CORP	2	138	—	—
外国 SIMON PROPERTY GROUP INC	2	253	—	—
SUN COMMUNITIES INC	0.914	112	—	—
UDR INC	1	76	0.944	37
VENTAS INC	2	124	—	—
WP CAREY INC	2	131	—	—
REALTY INCOME CORP	8	508	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1	80	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	8	1,114	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	2	279	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	—	55	450
IRON MOUNTAIN INC	2	124	—	—
AMERICAN TOWER REIT INC	3	588	—	—
EQUINIX INC	0.740	563	—	—
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	2	47	—	—
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	2	101	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	2	107	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.793	174	—	—
INVITATION HOMES INC	4	142	—	—
VICI PROPERTIES INC	10	327	—	—

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	
	□数	金額	□数	金額
<b>(アメリカ)</b>	千□	千米ドル	千□	千米ドル
NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I	—	—	1	15
	( 1)			
<b>(カナダ)</b>		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.402	19	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.895	16	—	—
<b>(オーストラリア)</b>		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
GPT GROUP	13	53	—	—
GOODMAN GROUP	12	263	—	—
STOCKLAND	16	67	—	—
MIRVAC GROUP	27	61	—	—
VICINITY CENTRES	27	49	—	—
LENDLEASE GROUP	4	37	—	—
SCENTRE GROUP	35	94	—	—
DEXUS/AU	7	58	—	—
<b>(香港)</b>		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	52	2,345	—	—
<b>(シンガポール)</b>		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
CAPITALAND ASCENDAS REIT	58	162	—	—
		(△ 3)		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	38	72	—	—
		(△ 1)		
KEPPEL REIT	—	—	28	23
	( 28)	( 23)		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	32	53	—	—
		(△ 6)		
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	17	27	—	—
		(△0.822)		
<b>(イギリス)</b>		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	2	7	83	270
LAND SECURITIES GROUP PLC	4	29	—	—
SEGRO PLC	5	44	1	13
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>		千ユーロ		千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW SCA	1	35	—	—
<b>(ユーロ/フランス)</b>				
KLEPIERRE	1	34	—	—
		(△ 17)		

## 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
	(ユーロ/フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
外国	GECINA SA	0.322	31	—	—
	COVIVIO	0.711	31	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1	50	—	—

(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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	97,989	90,245	—	—

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2023年5月23日～2023年11月20日

### 株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC	92	2,510,403	27,085	ACTIVISION BLIZZARD INC	81	1,142,174	14,095
MICROSOFT CORP	47	2,295,263	48,417	CRH PLC	70	561,446	7,953
AMAZON.COM INC	69	1,318,611	19,099	HORIZON PHARMA PLC	21	368,563	17,417
NVIDIA CORP	18	1,191,988	65,921	JOHNSON & JOHNSON	12	309,700	24,180
TESLA, INC.	35	1,191,716	33,671	BLACK KNIGHT INC	14	163,686	11,348
ALPHABET INC-CL A	38	736,291	19,291	INVESTOR AB-A SHS	47	135,483	2,863
META PLATFORMS INC-A	13	601,398	44,750	TOTALENERGIES SE	15	133,366	8,506
CRH PLC	72	589,050	8,174	T-MOBILE US INC	6	120,738	20,052
KENVUE INC	152	523,567	3,437	NOVARTIS AG	8	120,099	13,427
ALPHABET INC-CL C	24	481,667	19,351	ALPHABET INC-CL C	5	98,669	17,420

(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

2023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	511	548	5,230	784,248	資本財
ABBOTT LABORATORIES	1,612	1,728	17,206	2,580,162	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	1,635	1,753	24,252	3,636,713	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCENTURE PLC	582	626	20,553	3,082,065	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	723	—	—	—	メディア・娯楽
ADOBE INC	429	453	27,300	4,093,709	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	54	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
ADVANCED MICRO DEVICES INC	1,490	1,600	19,306	2,895,000	半導体・半導体製造装置
AECOM	121	131	1,140	171,067	資本財
AERCAP HOLDINGS NV	124	153	1,050	157,484	資本財
AES CORP	617	665	1,132	169,745	公益事業
AFLAC INC	545	570	4,663	699,243	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	272	293	3,322	498,265	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	205	220	5,961	893,949	素材
AIRBNB INC-CLASS A	349	409	5,211	781,502	消費者サービス
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	145	151	1,698	254,753	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	108	116	1,485	222,788	素材
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	—	314	660	99,097	生活必需品流通・小売り
ALCOA CORP	163	—	—	—	素材
ALIGN TECHNOLOGY INC	68	72	1,492	223,871	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGION PLC	81	87	929	139,442	資本財
ALLIANT ENERGY CORP	231	249	1,228	184,277	公益事業
ALLSTATE CORP	245	261	3,507	525,923	保険
ALLY FINANCIAL INC	275	269	740	110,982	金融サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	113	123	2,027	303,994	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	5,521	5,902	79,870	11,976,583	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	5,064	5,256	71,980	10,793,510	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	1,657	1,774	7,243	1,086,237	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	8,487	9,178	133,248	19,980,616	一般消費財・サービス流通・小売り
AMCOR PLC	1,379	1,465	1,373	205,918	素材
AMEREN CORPORATION	238	260	2,011	301,662	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	474	511	3,959	593,727	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	587	627	10,207	1,530,682	金融サービス
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	66	71	785	117,820	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	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	686	718	4,634	694,885	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	167	193	2,554	383,114	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	98	103	3,597	539,513	金融サービス
AMETEK INC	212	229	3,565	534,677	資本財
AMGEN INC	493	531	14,094	2,113,524	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	550	591	5,307	795,920	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES INC	470	498	9,124	1,368,190	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	80	86	2,579	386,803	ソフトウェア・サービス
AON PLC	191	203	6,694	1,003,773	保険
APA CORP	296	306	1,128	169,276	エネルギー
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	370	394	3,428	514,095	金融サービス
APPLE INC	14,706	15,633	296,542	44,466,586	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	795	834	12,401	1,859,555	半導体・半導体製造装置
APTIV PLC	250	281	2,283	342,376	自動車・自動車部品
ARAMARK	215	245	681	102,207	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	341	369	3,090	463,474	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	507	541	4,003	600,340	食品・飲料・タバコ
ARES MANAGEMENT CORP - A	144	159	1,708	256,264	金融サービス
ARISTA NETWORKS INC	225	260	5,590	838,258	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	56	57	704	105,641	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	194	212	5,226	783,767	保険
ASPEN TECHNOLOGY INC	26	29	533	79,975	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	48	52	851	127,715	保険
AT&T INC	6,592	7,118	11,318	1,697,177	電気通信サービス
ATLISSIAN CORP-CL A	138	150	2,792	418,751	ソフトウェア・サービス
ATMOS ENERGY CORP	130	143	1,634	245,019	公益事業
AUTODESK INC	199	212	4,616	692,215	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	383	410	9,419	1,412,514	商業・専門サービス
AUTOZONE INC	17	18	4,739	710,642	一般消費財・サービス流通・小売り
AVANTOR INC	623	671	1,298	194,685	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVERY DENNISON CORP	74	80	1,524	228,673	素材
AXON ENTERPRISE INC	62	69	1,559	233,838	資本財
BAKER HUGHES COMPANY	925	1,006	3,391	508,574	エネルギー
BALL CORP	290	312	1,637	245,536	素材
BANK OF AMERICA CORP	6,674	7,128	21,371	3,204,631	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	709	773	3,652	547,667	金融サービス
BATH & BODY WORKS INC	210	216	634	95,151	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	466	502	1,782	267,286	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	262	282	6,584	987,382	ヘルスケア機器・サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	179	210	1,110	166,587	ソフトウェア・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,203	1,288	46,231	6,932,431	金融サービス
BEST BUY CO INC	187	195	1,331	199,671	一般消費財・サービス流通・小売り
BILL HOLDINGS, INC.	87	95	605	90,866	ソフトウェア・サービス
BIOGEN INC	133	143	3,279	491,734	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	171	186	1,633	244,913	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	20	21	657	98,666	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	145	156	955	143,322	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	144	-	-	-	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	138	148	10,670	1,600,035	金融サービス
BLACKSTONE INC	648	701	7,366	1,104,577	金融サービス
BLOCK INC	496	541	3,148	472,176	金融サービス
BOEING CO	523	568	11,817	1,771,972	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	35	36	11,509	1,725,849	消費者サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	122	130	1,650	247,444	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	216	232	801	120,185	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,324	1,428	7,763	1,164,161	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,965	2,088	10,617	1,592,044	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	385	410	40,103	6,013,527	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	108	117	2,142	321,298	商業・専門サービス
BROWN & BROWN INC	222	239	1,749	262,288	保険
BROWN-FORMAN CORP -CL B	286	308	1,804	270,585	食品・飲料・タバコ
BUILDERS FIRTSOURCE INC	-	127	1,700	254,965	資本財
BUNGE GLOBAL SA	138	149	1,597	239,611	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	60	64	877	131,556	一般消費財・サービス流通・小売り
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	108	115	955	143,304	運輸
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	253	270	7,269	1,090,113	ソフトウェア・サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	198	213	981	147,239	消費者サービス
CAMPBELL SOUP CO	194	192	788	118,228	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	352	379	4,085	612,634	金融サービス
CARDINAL HEALTH INC	242	252	2,614	392,048	ヘルスケア機器・サービス
CARLISLE COS INC	47	50	1,384	207,540	資本財
CARLYLE GROUP INC/THE	184	215	687	103,059	金融サービス
CARMAX INC	146	157	1,005	150,800	一般消費財・サービス流通・小売り
CARNIVAL CORP	925	1,000	1,480	221,980	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	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
CARRIER GLOBAL CORP	773	829	4,415	662,120	資本財
CATALENT INC	158	179	714	107,176	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	481	512	12,962	1,943,764	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	98	104	1,852	277,855	金融サービス
CBRE GROUP INC	292	308	2,413	361,964	不動産管理・開発
CDW CORP/DE	125	133	2,884	432,556	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	100	102	1,334	200,090	素材
CENCORA, INC.	142	170	3,330	499,364	ヘルスケア機器・サービス
CENTENE CORP	523	545	3,961	594,085	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	581	626	1,741	261,067	公益事業
CERIDIAN HCM HOLDING INC	127	146	1,014	152,089	商業・専門サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	181	193	1,499	224,857	素材
CHARLES RIVER LABORATORIES	47	50	962	144,255	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHARLES SCHWAB CORP	1,342	1,494	8,486	1,272,552	金融サービス
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	100	97	3,965	594,595	メディア・娯楽
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	92	92	1,322	198,333	ソフトウェア・サービス
CHENIERE ENERGY INC	206	241	4,187	627,877	エネルギー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	105	112	921	138,195	エネルギー
CHEVRON CORP	1,698	1,803	26,051	3,906,419	エネルギー
CHEWY INC - CLASS A	87	115	237	35,606	一般消費財・サービス流通・小売り
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	25	27	5,928	889,024	消費者サービス
CHUBB LTD	383	411	9,163	1,374,059	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	225	242	2,243	336,422	家庭用品・パーソナル用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	138	156	1,576	236,366	保険
CINTAS CORP	84	90	4,984	747,483	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	3,797	4,050	19,342	2,900,442	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CITIGROUP INC	1,790	1,934	8,776	1,316,026	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	455	480	1,334	200,173	銀行
CLARIVATE PLC	281	337	243	36,476	商業・専門サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	476	512	870	130,505	素材
COLOROX CO	114	122	1,710	256,516	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	236	273	1,986	297,915	ソフトウェア・サービス
CME GROUP INC	332	357	7,631	1,144,307	金融サービス
CMS ENERGY CORP	268	289	1,662	249,296	公益事業
COCA-COLA CO	3,798	4,083	23,384	3,506,526	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	190	204	1,230	184,558	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	159	171	634	95,085	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	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	474	504	3,506	525,773	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	115	167	1,655	248,304	金融サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	733	783	5,923	888,173	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	3,987	4,134	17,536	2,629,663	メディア・娯楽
CONAGRA BRANDS INC	443	474	1,337	200,559	食品・飲料・タバコ
CONFLUENT INC-CLASS A	-	162	309	46,367	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	1,151	1,202	13,781	2,066,468	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	327	344	3,144	471,589	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	153	163	3,863	579,279	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION ENERGY	302	322	3,922	588,150	公益事業
COOPER COS INC/THE	45	49	1,657	248,610	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	396	853	4,288	643,058	商業・専門サービス
CORNING INC	743	803	2,287	342,978	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	660	706	3,343	501,384	素材
COSTAR GROUP INC	375	406	3,359	503,769	不動産管理・開発
COSTCO WHOLESALE CORP	409	440	25,421	3,811,901	生活必需品流通・小売り
COTERRA ENERGY INC	728	752	2,013	301,980	エネルギー
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	188	222	4,613	691,770	ソフトウェア・サービス
CROWN HOLDINGS INC	110	119	997	149,559	素材
CSX CORP	1,943	2,035	6,436	965,186	運輸
CUMMINS INC	130	140	3,173	475,894	資本財
CVS HEALTH CORP	1,214	1,274	8,769	1,314,995	ヘルスケア機器・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	37	41	785	117,724	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	639	696	14,477	2,170,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DARDEN RESTAURANTS INC	113	120	1,873	280,898	消費者サービス
DARLING INTERNATIONAL INC	148	158	690	103,581	食品・飲料・タバコ
DATADOG INC - CLASS A	229	250	2,741	411,147	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	49	53	518	77,805	ヘルスケア機器・サービス
DECKERS OUTDOOR CORP	-	25	1,612	241,732	耐久消費財・アパレル
DEERE & CO	265	276	10,634	1,594,689	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	239	254	1,872	280,775	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	147	159	575	86,255	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	198	211	626	94,013	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	573	637	2,893	433,875	エネルギー
DEXCOM INC	357	385	4,044	606,456	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	154	170	2,667	399,946	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	-	62	734	110,202	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	252	252	2,179	326,860	金融サービス
DISH NETWORK CORP	230	-	-	-	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	185	201	863	129,554	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	208	218	2,640	396,006	生活必需品流通・小売り
DOLLAR TREE INC	204	208	2,393	358,835	生活必需品流通・小売り
DOMINION ENERGY INC	770	831	3,887	582,872	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	32	35	1,307	196,125	消費者サービス
DOORDASH INC - A	216	251	2,391	358,664	消費者サービス
DOVER CORP	129	139	1,916	287,320	資本財
DOW INC	650	703	3,635	545,157	素材
DR HORTON INC	302	304	3,904	585,525	耐久消費財・アパレル
DRAFTKINGS INC	-	413	1,586	237,939	消費者サービス
DROPBOX INC-CLASS A	253	257	697	104,646	ソフトウェア・サービス
DTE ENERGY COMPANY	179	204	2,121	318,168	公益事業
DUKE ENERGY CORP	711	766	6,896	1,034,059	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	459	455	3,247	486,918	素材
DYNATRACE INC	199	247	1,267	190,055	ソフトウェア・サービス
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	111	118	965	144,841	素材
EATON CORP PLC	367	396	9,024	1,353,261	資本財
EBAY INC	501	531	2,132	319,837	一般消費財・サービス流通・小売り
ECOLAB INC	237	254	4,695	704,129	素材
EDISON INTERNATIONAL	352	380	2,507	376,051	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	571	602	4,031	604,467	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	394	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	255	256	3,435	515,101	メディア・娯楽
ELEVANCE HEALTH, INC	220	235	10,908	1,635,728	ヘルスケア機器・サービス
ELI LILLY & CO	746	801	47,453	7,115,632	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	546	567	5,070	760,313	資本財
ENPHASE ENERGY INC	125	136	1,265	189,761	半導体・半導体製造装置
ENTEGRIS INC	137	148	1,530	229,537	半導体・半導体製造装置
ENERGY CORP	188	210	2,083	312,389	公益事業
EOG RESOURCES INC	542	581	7,207	1,080,746	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	53	57	1,486	222,928	ソフトウェア・サービス
EQT CORP	305	359	1,450	217,501	エネルギー
EQUIFAX INC	113	121	2,501	375,162	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	340	353	1,002	150,290	金融サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	23	25	707	106,102	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	230	249	888	133,279	公益事業
ESTEE LAUDER COS INC	213	230	2,855	428,171	家庭用品・パーソナル用品
ETSY INC	116	122	889	133,425	一般消費財・サービス流通・小売り
EVEREST GROUP LTD	36	42	1,687	252,973	保険
EVERGY INC	212	228	1,149	172,412	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	321	346	2,029	304,302	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	164	179	1,188	178,254	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	918	988	3,848	577,064	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	139	141	1,932	289,738	消費者サービス
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	146	151	1,805	270,755	運輸
EXXON MOBIL CORP	3,807	4,017	42,171	6,323,657	エネルギー
F5 INC	55	60	979	146,869	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	35	37	1,733	259,979	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	23	24	2,587	388,064	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	529	567	3,450	517,399	資本財
FEDEX CORP	228	237	6,073	910,711	運輸
FERGUSON PLC	192	203	3,383	507,336	資本財
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	238	257	1,158	173,704	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	548	589	3,220	482,971	金融サービス
FIFTH THIRD BANCORP	634	676	1,865	279,683	銀行
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	9	10	1,568	235,145	銀行
FIRST HORIZON NATIONAL CORP	496	528	652	97,790	銀行
FIRST SOLAR INC	88	100	1,563	234,451	半導体・半導体製造装置
FIRSTENERGY CORP	502	540	2,010	301,548	公益事業
FISERV INC	557	613	7,613	1,141,614	金融サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	64	69	1,622	243,356	金融サービス
FMC CORP	116	124	667	100,085	素材
FORD MOTOR CO	3,651	3,906	4,011	601,547	自動車・自動車部品
FORTINET INC	613	663	3,399	509,818	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	310	351	2,392	358,723	資本財
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	118	125	846	126,910	資本財
FOX CORP - CLASS A	275	263	800	120,080	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	138	144	410	61,524	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	276	298	724	108,589	金融サービス
FREPORT-MCMORAN INC	1,321	1,424	5,127	768,849	素材
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	55	54	326	48,959	金融サービス
GARMIN LTD	141	152	1,819	272,839	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
GARTNER INC	73	78	3,279	491,822	ソフトウェア・サービス
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	336	406	2,968	445,122	ヘルスケア機器・サービス
GEN DIGITAL INC	541	572	1,183	177,501	ソフトウェア・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	58	61	705	105,839	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	215	231	5,672	850,613	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,010	1,082	12,978	1,946,120	資本財
GENERAL MILLS INC	548	581	3,768	565,030	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	1,313	1,381	3,872	580,628	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	130	139	1,919	287,867	一般消費財・サービス流通・小売り
GILEAD SCIENCES INC	1,159	1,239	9,354	1,402,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	249	260	2,917	437,504	金融サービス
GLOBAL-E ONLINE LTD	-	89	274	41,096	一般消費財・サービス流通・小売り
GLOBE LIFE INC	85	90	1,064	159,651	保険
GODADDY INC - CLASS A	143	145	1,339	200,866	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	313	330	11,206	1,680,363	金融サービス
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	1,204	1,863	616	92,468	運輸
GRACO INC	155	167	1,349	202,354	資本財
HALLIBURTON CO	839	896	3,405	510,711	エネルギー
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	293	308	2,357	353,542	保険
HASBRO INC	121	131	591	88,690	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	196	205	5,053	757,809	ヘルスケア機器・サービス
HEICO CORP	40	43	734	110,180	資本財
HEICO CORP-CLASS A	68	74	1,007	151,096	資本財
HENRY SCHEIN INC	125	130	894	134,182	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	135	146	2,870	430,390	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	256	274	3,966	594,791	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,189	1,283	2,043	306,473	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HF SINCLAIR CORP	138	152	819	122,896	エネルギー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	250	262	4,425	663,556	消費者サービス
HOLOGIC INC	227	244	1,757	263,538	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	942	999	30,705	4,604,242	一般消費財・サービス流通・小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	621	661	12,653	1,897,365	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,031	1,103	362	54,414	不動産管理・開発
HORIZON PHARMA PLC	199	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	278	299	972	145,901	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	344	389	2,005	300,775	資本財
HP INC	929	881	2,496	374,323	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	49	53	1,602	240,231	資本財
HUBSPOT INC	42	46	2,195	329,283	ソフトウェア・サービス
HUMANA INC	117	124	6,185	927,557	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,333	1,435	1,590	238,520	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	36	39	938	140,760	資本財
HYATT HOTELS CORP - CL A	-	46	535	80,294	消費者サービス
IDEX CORP	69	75	1,488	223,162	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	76	82	3,824	573,555	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	284	302	7,248	1,086,907	資本財
ILLUMINA INC	145	157	1,482	222,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	174	188	1,023	153,405	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	374	402	2,828	424,120	資本財
INSULET CORP	64	69	1,206	180,875	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	3,815	4,145	18,162	2,723,418	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	516	556	6,198	929,501	金融サービス
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	835	902	13,799	2,069,196	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	235	253	1,877	281,517	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	312	327	1,094	164,134	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	359	383	1,164	174,613	メディア・娯楽
INTUIT INC	246	278	15,592	2,338,112	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	326	348	10,631	1,594,174	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	314	341	472	70,848	金融サービス
IQVIA HOLDINGS INC	171	184	3,776	566,321	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JABIL CIRCUIT INC	-	129	1,706	255,888	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	67	72	1,103	165,502	金融サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	116	126	1,705	255,730	商業・専門サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	147	158	628	94,294	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	58	63	768	115,174	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	76	82	1,466	219,899	運輸
JM SMUCKER CO	98	101	1,133	169,907	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	2,417	2,393	35,848	5,375,503	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	634	682	3,562	534,252	資本財
JPMORGAN CHASE & CO	2,711	2,904	44,385	6,655,582	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	299	319	863	129,452	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KELLANOVA	236	272	1,440	216,009	食品・飲料・タバコ
KENVUE INC	-	1,523	2,997	449,451	家庭用品・パーソナル用品
KEURIG DR PEPPER INC	721	907	2,879	431,766	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	861	930	1,146	171,947	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	165	177	2,361	354,114	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	312	335	4,066	609,790	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	1,869	2,005	3,400	509,975	エネルギー
KKR & CO INC -A	517	600	4,018	602,520	金融サービス
KLA CORPORATION	131	136	7,424	1,113,349	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	140	159	822	123,371	運輸
KRAFT HEINZ CO/THE	679	854	2,874	431,066	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	628	677	2,875	431,229	生活必需品流通・小売り
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	176	188	3,499	524,724	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	81	88	1,864	279,535	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	126	133	9,350	1,402,173	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	132	144	1,387	207,993	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	317	341	1,677	251,512	消費者サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	-	136	794	119,102	半導体・半導体製造装置
LEAR CORP	54	58	787	118,074	自動車・自動車部品
LEIDOS HOLDINGS INC	119	129	1,362	204,367	商業・専門サービス
LENNAR CORP-CL A	235	250	3,197	479,457	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	29	31	1,287	192,985	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	111	118	990	148,569	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-A	142	-	-	-	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	253	251	439	65,967	電気通信サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	63	-	-	-	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	155	162	423	63,445	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA GROUP-C	182	196	1,254	188,059	メディア・娯楽
LINDE PLC	456	486	19,849	2,976,368	素材
LIVE NATION INC	160	159	1,433	214,914	メディア・娯楽
LKQ CORP	234	265	1,208	181,262	一般消費財・サービス流通・小売り
LOCKHEED MARTIN CORP	218	226	10,075	1,510,763	資本財
LOEWS CORP	186	191	1,285	192,704	保険
LOWE'S COS INC	559	582	11,863	1,778,899	一般消費財・サービス流通・小売り
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	73	77	1,732	259,737	金融サービス
LUCID GROUP INC	388	905	384	57,729	自動車・自動車部品
LULULEMON ATHLETICA INC	107	115	4,864	729,416	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	240	258	2,514	377,058	素材
M&T BANK CORP	159	164	2,089	313,305	銀行
MANHATTAN ASSOCIATES INC	-	61	1,366	204,863	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	585	612	1,565	234,784	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	432	421	6,231	934,409	エネルギー
MARKEL GROUP INC	12	12	1,766	264,958	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	34	37	854	128,137	金融サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	248	256	5,272	790,572	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	458	491	9,729	1,458,889	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	57	61	2,845	426,662	素材
MARVELL TECHNOLOGY INC	788	854	4,751	712,434	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	208	223	1,344	201,568	資本財
MASIMO CORPORATION	46	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
MASTERCARD INC-CLASS A	793	841	33,670	5,048,941	金融サービス
MATCH GROUP INC	258	276	897	134,594	メディア・娯楽
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	231	249	1,656	248,418	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	677	725	20,011	3,000,758	消費者サービス
MCKESSON CORP	131	134	6,061	908,920	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	1,229	1,322	9,886	1,482,512	ヘルスケア機器・サービス
MERCADOLIBRE INC	41	44	6,502	975,120	一般消費財・サービス流通・小売り
MERCK & CO INC	2,343	2,522	25,662	3,848,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
META PLATFORMS INC-A	2,078	2,198	73,663	11,045,852	メディア・娯楽
METLIFE INC	616	646	4,046	606,789	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	20	21	2,296	344,340	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	283	288	1,149	172,385	消費者サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	508	541	4,518	677,620	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	1,004	1,088	8,443	1,266,101	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	6,546	7,020	259,661	38,936,271	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	301	322	2,462	369,265	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC	46	53	453	67,982	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	53	57	2,047	307,012	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	175	188	1,119	167,903	食品・飲料・タバコ
MONDAY.COM LTD	-	21	366	54,939	ソフトウェア・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,262	1,353	9,560	1,433,582	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	63	70	2,753	412,885	ソフトウェア・サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	41	44	2,418	362,691	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	723	780	4,275	641,092	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	152	164	5,854	877,811	金融サービス
MORGAN STANLEY	1,171	1,244	9,994	1,498,669	金融サービス
MOSAIC CO/THE	314	329	1,192	178,817	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	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	154	166	5,305	795,566	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	73	79	4,148	622,133	金融サービス
NASDAQ INC	317	341	1,826	273,859	金融サービス
NETAPP INC	200	211	1,636	245,431	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	411	441	20,585	3,086,765	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	88	97	1,056	158,454	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWELL BRANDS INC	363	-	-	-	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	733	789	2,869	430,244	素材
NEWS CORP - CLASS A	353	378	795	119,317	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	1,836	2,011	11,538	1,730,204	公益事業
NIKE INC	1,164	1,224	12,977	1,945,984	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	375	409	1,068	160,264	公益事業
NORDSON CORP	47	51	1,190	178,572	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	213	226	4,774	715,978	運輸
NORTHERN TRUST CORP	182	207	1,561	234,112	金融サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	135	143	6,657	998,236	資本財
NOVOCURE LTD	87	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	212	228	1,099	164,905	公益事業
NUCOR CORP	237	249	3,913	586,854	素材
NVIDIA CORP	2,274	2,454	121,024	18,147,641	半導体・半導体製造装置
NVR INC	2	3	2,034	305,036	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	239	258	5,186	777,679	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	672	664	4,052	607,626	エネルギー
OKTA INC	140	154	1,082	162,301	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	86	98	3,921	588,016	運輸
OMNICOM GROUP	188	198	1,568	235,144	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	399	429	3,005	450,639	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	413	444	2,962	444,217	エネルギー
ORACLE CORP	1,495	1,618	18,672	2,799,874	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	57	60	5,858	878,520	一般消費財・サービス流通・小売り
OTIS WORLDWIDE CORP	385	410	3,473	520,825	資本財
OVINTIV INC	229	246	1,110	166,527	エネルギー
OWENS CORNING	86	89	1,173	176,009	資本財
PACCAR INC	482	519	4,745	711,548	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	85	89	1,387	208,108	素材
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,554	1,801	3,690	553,417	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	279	303	7,526	1,128,559	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	562	486	641	96,182	メディア・娯楽
PARKER HANNIFIN CORP	118	127	5,515	827,083	資本財
PAYCHEX INC	299	322	3,790	568,454	商業・専門サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	47	51	919	137,844	商業・専門サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	38	44	677	101,534	商業・専門サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	1,001	1,053	5,957	893,277	金融サービス
PENTAIR PLC	151	163	1,030	154,582	資本財
PEPSICO INC	1,273	1,368	22,818	3,421,574	食品・飲料・タバコ
PFIZER INC	5,189	5,611	16,789	2,517,561	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	1,377	1,883	3,374	506,070	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,433	1,543	14,187	2,127,487	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	436	455	5,304	795,461	エネルギー
PINTEREST INC- CLASS A	543	590	1,859	278,867	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	208	232	5,532	829,627	エネルギー
PLUG POWER INC	485	-	-	-	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	372	396	5,169	775,107	銀行
POOL CORP	36	38	1,358	203,760	一般消費財・サービス流通・小売り
PPG INDUSTRIES INC	217	234	3,179	476,805	素材
PPL CORPORATION	680	731	1,909	286,302	公益事業
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	225	240	1,748	262,133	保険
PROCTER & GAMBLE CO	2,190	2,342	35,391	5,307,019	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	540	581	9,166	1,374,560	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	340	362	3,473	520,840	保険
PTC INC	103	111	1,719	257,817	ソフトウェア・サービス
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	461	495	3,160	473,922	公益事業
PULTE GROUP INC	210	221	1,955	293,173	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	93	97	921	138,209	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,036	1,107	14,335	2,149,656	半導体・半導体製造装置
QUANTA SERVICES INC	132	144	2,641	396,099	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	105	111	1,501	225,204	ヘルスケア機器・サービス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	178	199	2,085	312,793	金融サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	98	107	8,604	1,290,238	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	862	931	1,529	229,281	銀行
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	54	58	1,590	238,437	素材
REPLIGEN CORP	48	52	792	118,806	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REPUBLIC SERVICES INC	204	220	3,491	523,625	商業・専門サービス
RESMED INC	135	146	2,176	326,360	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	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
REVVITY INC	116	124	1,097	164,572	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	295	648	1,083	162,442	自動車・自動車部品
ROBERT HALF INC	100	107	866	129,890	商業・専門サービス
ROBINHOOD MARKETS INC - A	-	424	343	51,503	金融サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	330	418	1,584	237,661	メディア・娯楽
ROCKWELL AUTOMATION INC	106	114	3,142	471,239	資本財
ROKU INC	112	122	1,140	170,998	メディア・娯楽
ROLLINS INC	204	245	966	144,893	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	98	105	5,558	833,554	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	320	338	4,361	653,981	一般消費財・サービス流通・小売り
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	212	228	2,413	361,839	消費者サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	326	379	1,008	151,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RPM INTERNATIONAL INC	119	128	1,305	195,804	素材
RTX CORPORATION	1,359	1,452	11,575	1,735,676	資本財
S&P GLOBAL INC	307	326	13,305	1,995,225	金融サービス
SALESFORCE INC	924	968	21,415	3,211,275	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,310	1,416	7,486	1,122,635	エネルギー
SEA LTD-ADR	334	362	1,363	204,432	メディア・娯楽
SEAGATE TECHNOLOGY	181	185	1,406	210,872	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEAGEN INC	128	139	2,963	444,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEALED AIR CORP	133	143	478	71,714	素材
SEI INVESTMENTS COMPANY	105	112	650	97,582	金融サービス
SEMPRA	290	625	4,519	677,720	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	141	152	495	74,373	資本財
SERVICENOW INC	187	202	13,247	1,986,465	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	227	243	6,581	986,909	素材
SIRIUS XM HOLDINGS INC	718	770	391	58,682	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	148	158	1,490	223,476	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	117	123	945	141,824	資本財
SNAP INC - A	1,005	1,009	1,200	180,005	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	49	52	1,461	219,121	資本財
SNOWFLAKE INC-CLASS A	207	259	4,194	628,893	ソフトウェア・サービス
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	51	56	442	66,388	半導体・半導体製造装置
SOUTHERN CO	1,006	1,083	7,561	1,133,799	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	137	148	368	55,309	運輸
SPLUNK INC	150	156	2,360	353,970	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	209	222	1,225	183,781	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	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
STANLEY BLACK & DECKER INC	136	152	1,397	209,528	資本財
STARBUCKS CORP	1,061	1,139	12,029	1,803,885	消費者サービス
STATE STREET CORP	339	332	2,331	349,566	金融サービス
STEEL DYNAMICS INC	162	159	1,769	265,378	素材
STERIS PLC	92	98	1,963	294,420	ヘルスケア機器・サービス
STRYKER CORP	314	339	9,792	1,468,345	ヘルスケア機器・サービス
SUPER MICRO COMPUTER INC	-	46	1,354	203,171	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SYNCHRONY FINANCIAL	416	425	1,271	190,632	金融サービス
SYNOPSIS INC	141	151	8,086	1,212,637	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	468	503	3,571	535,558	生活必需品流通・小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	206	223	2,182	327,321	金融サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	155	168	2,598	389,627	メディア・娯楽
TARGA RESOURCES CORP	198	212	1,831	274,677	エネルギー
TARGET CORP	425	458	5,960	893,702	生活必需品流通・小売り
TE CONNECTIVITY LTD	293	313	4,117	617,491	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	43	46	1,827	274,032	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	43	46	992	148,882	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	143	154	1,419	212,795	半導体・半導体製造装置
TESLA, INC.	2,481	2,835	66,429	9,961,094	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	1,026	1,112	1,007	151,019	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	839	902	13,950	2,091,937	半導体・半導体製造装置
TEXAS PACIFIC LAND CORP	5	6	1,011	151,603	エネルギー
TEXTRON INC	192	200	1,550	232,493	資本財
THE CIGNA GROUP	282	294	8,308	1,245,928	ヘルスケア機器・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	362	383	17,882	2,681,487	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TJX COS INC	1,073	1,142	10,147	1,521,614	一般消費財・サービス流通・小売り
T-MOBILE US INC	576	538	7,959	1,193,593	電気通信サービス
TOAST INC-CLASS A	231	307	442	66,376	金融サービス
TORO CO	96	103	882	132,302	資本財
TRACTOR SUPPLY COMPANY	102	108	2,206	330,853	一般消費財・サービス流通・小売り
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	411	442	2,938	440,688	メディア・娯楽
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	102	108	1,011	151,724	金融サービス
TRANE TECHNOLOGIES PLC	212	226	5,182	777,094	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	47	54	5,227	783,893	資本財
TRANSUNION	178	192	1,119	167,856	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	216	229	3,943	591,396	保険
TRIMBLE INC	228	246	1,067	160,094	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	1,227	1,324	4,234	634,889	銀行
TWILIO INC - A	161	170	1,078	161,775	ソフトウェア・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	38	41	1,714	257,022	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	267	284	1,384	207,614	食品・飲料・タバコ
UBER TECHNOLOGIES INC	1,382	1,810	9,855	1,477,798	運輸
UGI CORP	193	-	-	-	公益事業
U-HAUL HOLDING CO	81	96	512	76,861	運輸
UIPATH INC - CLASS A	-	357	652	97,827	ソフトウェア・サービス
ULTA BEAUTY INC	47	49	2,025	303,658	一般消費財・サービス流通・小売り
UNION PACIFIC CORP	568	605	13,283	1,991,888	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	674	720	10,660	1,598,561	運輸
UNITED RENTALS INC	64	68	3,285	492,599	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	42	46	1,065	159,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	863	925	49,629	7,441,920	ヘルスケア機器・サービス
UNITY SOFTWARE INC	229	225	659	98,906	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	59	62	850	127,460	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,304	1,523	5,735	860,039	銀行
VAIL RESORTS INC	37	40	905	135,725	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	356	359	4,457	668,370	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	129	144	2,557	383,555	ヘルスケア機器・サービス
VERALTO CORP	-	232	1,648	247,228	商業・専門サービス
VERISIGN INC	88	93	1,955	293,177	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	144	143	3,411	511,510	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,887	4,187	15,169	2,274,666	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	237	255	8,972	1,345,366	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	305	329	566	85,011	耐久消費財・アパレル
VIATRIS INC	1,120	1,190	1,125	168,755	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	1,505	1,608	40,139	6,018,915	金融サービス
VISTRA CORP	330	333	1,161	174,104	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	196	235	3,519	527,705	ソフトウェア・サービス
VULCAN MATERIALS CO	122	132	2,807	420,949	素材
WABTEC CORP	159	178	2,064	309,607	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	679	729	1,548	232,272	生活必需品流通・小売り
WALMART INC	1,380	1,472	22,868	3,429,147	生活必需品流通・小売り
WALT DISNEY CO	1,685	1,816	17,101	2,564,355	メディア・娯楽
WARNER BROS DISCOVERY INC	2,132	2,300	2,464	369,490	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	237	256	3,452	517,633	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		
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円		
WASTE MANAGEMENT INC	379	404	6,896	1,034,185	商業・専門サービス	
WATERS CORP	54	58	1,536	230,469	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WATSCO INC	-	33	1,295	194,203	資本財	
WEBSTER FINANCIAL CORP	160	173	749	112,332	銀行	
WEC ENERGY GROUP INC	291	313	2,562	384,229	公益事業	
WELLS FARGO & CO	3,522	3,645	15,660	2,348,261	銀行	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	68	73	2,528	379,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WESTERN DIGITAL CORP	293	318	1,483	222,380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	35	37	493	74,050	素材	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	235	254	966	144,877	素材	
WEYERHAEUSER CO	680	727	2,321	348,119	エクイティ不動産投資信託 (REIT)	
WHIRLPOOL CORP	50	54	613	91,946	耐久消費財・アパレル	
WILLIAMS COS INC	1,126	1,210	4,288	643,116	エネルギー	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	100	105	2,559	383,864	保険	
WIX.COM LTD	52	53	518	77,778	ソフトウェア・サービス	
WOLFSPEED INC	114	123	454	68,180	半導体・半導体製造装置	
WORKDAY INC-CLASS A	185	204	4,742	711,074	ソフトウェア・サービス	
WR BERKLEY CORP	195	207	1,454	218,118	保険	
WW GRAINGER INC	42	44	3,599	539,740	資本財	
WYNN RESORTS LTD	99	101	883	132,515	消費者サービス	
XCEL ENERGY INC	505	546	3,312	496,711	公益事業	
XYLEM INC	166	237	2,406	360,869	資本財	
YUM! BRANDS INC	260	278	3,554	533,026	消費者サービス	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	47	51	1,114	167,187	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	144	152	596	89,417	不動産管理・開発	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	193	207	2,316	347,356	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	430	459	8,029	1,203,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	204	237	1,520	227,928	ソフトウェア・サービス	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	242	260	349	52,336	メディア・娯楽	
ZSCALER INC	80	87	1,631	244,594	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	313,393 601	339,445 605	3,882,866 -	582,235,857 <70.4%>	
<b>(カナダ)</b>			千カナダ・ドル			
AGNICO EAGLE MINES LTD	421	489	3,250	355,142	素材	
AIR CANADA	166	176	316	34,574	運輸	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	630	657	537	58,740	公益事業	



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	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	750	777	6,085	664,824	生活必需品流通・小売り
ALTAGAS LTD	263	282	777	84,918	公益事業
ARC RESOURCES LTD	587	608	1,302	142,254	エネルギー
BANK OF MONTREAL	627	710	7,963	870,029	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	1,104	1,188	7,257	792,894	銀行
BARRICK GOLD CORP	1,629	1,746	3,764	411,253	素材
BCE INC	79	87	473	51,719	電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	328	349	1,611	176,071	金融サービス
BROOKFIELD CORPORATION-A	1,312	1,401	6,511	711,386	金融サービス
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	121	136	484	52,976	公益事業
BRP INC/CA- SUB VOTING	33	36	374	40,869	耐久消費財・アパレル
CAE INC	295	317	915	100,068	資本財
CAMECO CORP	400	430	2,636	287,983	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	840	904	4,903	535,724	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	531	560	8,868	968,830	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,025	1,101	10,058	1,098,852	エネルギー
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	861	926	9,116	995,969	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	51	52	778	85,042	一般消費財・サービス流通・小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	123	135	424	46,342	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B	139	149	871	95,258	素材
CENOVUS ENERGY INC	1,332	1,425	3,536	386,311	エネルギー
CGI INC	196	211	2,933	320,469	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC	18	20	6,320	690,564	ソフトウェア・サービス
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	79	85	948	103,591	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC	253	282	2,788	304,691	一般消費財・サービス流通・小売り
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	366	389	815	89,045	金融サービス
EMERA INC	251	274	1,349	147,420	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	151	147	570	62,306	生活必需品流通・小売り
ENBRIDGE INC	1,877	2,018	9,327	1,019,031	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	21	21	2,546	278,253	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	545	585	897	98,010	素材
FIRSTSERVICE CORP	37	40	846	92,430	不動産管理・開発
FORTIS INC	449	485	2,742	299,641	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	177	191	3,158	345,086	素材
GEORGE WESTON LTD	66	62	1,033	112,874	生活必需品流通・小売り
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	170	232	960	104,934	商業・専門サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	167	178	875	95,614	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	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
GREAT-WEST LIFECO INC	264	282	1,204	131,601	保険
HYDRO ONE LTD	309	332	1,274	139,285	公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	98	102	898	98,184	保険
IGM FINANCIAL INC	80	86	292	31,927	金融サービス
IMPERIAL OIL LTD	196	204	1,614	176,390	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	162	175	3,661	400,000	保険
IVANHOE MINES LTD-CL A	564	607	669	73,112	素材
KEYERA CORP	207	230	740	80,914	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	1,163	1,219	889	97,223	素材
LOBLAW COS LTD	151	159	1,947	212,730	生活必需品流通・小売り
LUNDIN MINING CORP	609	655	588	64,285	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	252	271	2,086	227,906	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,749	1,835	4,824	527,108	保険
METRO INC	220	232	1,631	178,256	生活必需品流通・小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	313	337	3,083	336,857	銀行
NORTHLAND POWER INC	228	254	572	62,546	公益事業
NUTRIEN LTD	481	493	3,829	418,361	素材
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	60	63	170	18,589	金融サービス
ONEX CORPORATION	66	68	607	66,334	金融サービス
OPEN TEXT CORP	251	270	1,436	156,935	ソフトウェア・サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	195	362	712	77,817	素材
PARKLAND CORP	132	141	614	67,175	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	513	551	2,451	267,816	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	516	580	2,124	232,142	保険
QUEBECOR INC -CL B	145	155	480	52,481	電気通信サービス
RB GLOBAL INC	103	181	1,531	167,311	商業・専門サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	270	294	2,876	314,231	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	332	357	2,097	229,108	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,280	1,379	16,622	1,815,988	銀行
SAPUTO INC	233	254	686	75,048	食品・飲料・タバコ
SHOPIFY INC - CLASS A	1,100	1,192	11,193	1,222,882	ソフトウェア・サービス
STANTEC INC	-	111	1,074	117,382	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	545	586	4,074	445,140	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,253	1,312	6,080	664,298	エネルギー
TC ENERGY CORP	937	1,013	5,104	557,631	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	420	453	2,239	244,643	素材
TFI INTERNATIONAL INC	72	76	1,195	130,556	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	
<b>(カナダ)</b>		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
THOMSON REUTERS CORP		156	158	2,988	326,454	商業・専門サービス
TMX GROUP LTD		52	280	812	88,760	金融サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD		77	82	940	102,742	資本財
TORONTO-DOMINION BANK		1,678	1,829	15,511	1,694,670	銀行
TOURMALINE OIL CORP		297	320	2,128	232,591	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD		53	56	596	65,186	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		418	450	2,826	308,777	素材
WSP GLOBAL INC		115	124	2,369	258,882	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	36,824	40,075	242,290	26,470,279	
<b>(オーストラリア)</b>				千オーストラリア・ドル		
AMPOL LTD		219	236	793	77,427	エネルギー
ANZ GROUP HOLDINGS LTD		2,764	2,986	7,189	701,445	銀行
APA GROUP		1,090	1,253	1,045	101,967	公益事業
ARISTOCRAT LEISURE LTD		548	584	2,352	229,571	消費者サービス
ASX LTD		179	192	1,101	107,475	金融サービス
AURIZON HOLDINGS LTD		1,699	1,827	665	64,911	運輸
BHP GROUP LIMITED		4,683	5,035	23,468	2,289,849	素材
BLUESCOPE STEEL LTD		427	451	923	90,091	素材
BRAMBLES LTD		1,282	1,379	1,816	177,219	商業・専門サービス
COCHLEAR LTD		60	65	1,694	165,368	ヘルスケア機器・サービス
COLES GROUP LTD		1,237	1,330	2,051	200,137	生活必需品流通・小売り
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		1,566	1,666	17,072	1,665,746	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED		502	570	1,348	131,536	商業・専門サービス
CSL LIMITED		445	479	12,400	1,209,952	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA		1,323	1,425	701	68,436	生活必需品流通・小売り
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,565	1,683	4,246	414,318	素材
IDP EDUCATION LTD		193	249	593	57,867	消費者サービス
IGO LTD		629	677	602	58,792	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		2,275	2,422	1,419	138,518	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		411	437	2,103	205,267	素材
LOTTERY CORP LTD/THE		2,056	2,208	1,007	98,267	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD		339	364	6,108	596,053	金融サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		2,546	2,736	971	94,793	保険
MINERAL RESOURCES LTD		157	173	1,103	107,693	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		2,914	3,121	8,654	844,455	銀行
NEWCREST MINING LIMITED		824	-	-	-	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	
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	オーストラリアドル	千円	
NEWMONT CORP-CDI	-	354	2,001	195,313	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,068	1,139	1,340	130,771	素材
ORICA LTD	418	452	712	69,535	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,592	1,710	1,471	143,546	公益事業
PILBARA MINERALS LTD	2,354	2,680	954	93,102	素材
QANTAS AIRWAYS LTD	851	836	438	42,765	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,371	1,481	2,225	217,143	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	169	182	942	91,962	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	48	52	831	81,097	メディア・娯楽
REECE LTD	209	224	437	42,685	資本財
RIO TINTO LTD	343	368	4,630	451,783	素材
SANTOS LTD	2,917	3,227	2,255	220,113	エネルギー
SEEK LTD	311	353	819	79,999	メディア・娯楽
SONIC HEALTHCARE LTD	422	444	1,310	127,906	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	4,236	4,512	1,430	139,581	素材
SUNCORP GROUP LTD	1,168	1,257	1,679	163,906	保険
TELSTRA GROUP LTD	3,816	4,112	1,579	154,083	電気通信サービス
TRANSURBAN GROUP	2,843	3,063	3,980	388,334	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	666	718	762	74,366	食品・飲料・タバコ
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	200	233	780	76,165	金融サービス
WESFARMERS LIMITED	1,048	1,127	5,977	583,250	一般消費財・サービス流通・小売り
WESTPAC BANKING CORP	3,236	3,488	7,360	718,182	銀行
WISETECH GLOBAL LTD	136	164	1,108	108,141	ソフトウェア・サービス
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1,755	1,887	5,925	578,190	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,124	1,211	4,277	417,383	生活必需品流通・小売り
XERO LTD	124	142	1,446	141,116	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	64,384 51	68,991 51	158,118 -	15,427,596 <1.9%>
<b>(香港)</b>			千香港ドル		
AIA GROUP LTD	10,926	11,480	83,694	1,609,448	保険
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,420	3,680	7,839	150,748	銀行
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,590	1,713	2,607	50,136	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,834	1,959	7,522	144,665	不動産管理・開発
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,484	2,664	10,709	205,946	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	585	630	2,406	46,278	公益事業
CLP HOLDINGS LTD	1,521	1,631	9,715	186,822	公益事業
ESR GROUP LIMITED	1,842	2,178	2,195	42,218	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	
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港ドル	千円	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	2,008	2,168	9,344	179,694	消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,871	1,791	1,974	37,965	不動産管理・開発
HANG SENG BANK LTD	707	760	6,795	130,676	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,346	1,446	3,160	60,774	不動産管理・開発
HKT TRUST AND HKT LTD	3,580	3,900	3,217	61,872	電気通信サービス
HONG KONG & CHINA GAS	10,364	11,154	6,146	118,188	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,114	1,196	34,136	656,454	金融サービス
MTR CORP	1,432	1,547	4,580	88,087	運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,399	1,499	2,287	43,993	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,285	1,380	5,495	105,685	公益事業
SANDS CHINA LTD	2,237	2,409	5,156	99,168	消費者サービス
SINO LAND CO	3,220	3,660	2,957	56,868	不動産管理・開発
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1,240	1,330	1,630	31,356	運輸
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	1,340	1,440	11,327	217,826	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD	443	423	2,122	40,816	不動産管理・開発
SWIRE PROPERTIES LTD	1,082	1,162	1,773	34,098	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,275	1,370	11,117	213,790	資本財
WH GROUP LTD	7,690	8,270	3,878	74,586	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,537	1,667	4,418	84,966	不動産管理・開発
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	1,710	1,640	1,539	29,613	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	71,089 28	76,154 28	249,752 -	4,802,749 <0.6%>
<b>(シンガポール)</b>			千シンガポールドル		
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	2,402	2,585	798	89,118	不動産管理・開発
CITY DEVELOPMENTS LTD	375	494	305	34,061	不動産管理・開発
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,674	1,800	5,884	656,500	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	5,577	6,003	561	62,622	消費者サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	91	98	291	32,550	資本財
KEPPEL CORP LTD	1,349	1,445	934	104,308	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,130	3,364	4,363	486,791	銀行
SEATRIUM LTD	26,052	44,030	471	52,563	資本財
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	-	883	449	50,144	公益事業
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,240	1,477	921	102,828	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	793	852	812	90,684	金融サービス
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	1,448	1,555	601	67,141	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	7,687	8,288	1,931	215,453	電気通信サービス
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,090	1,256	3,435	383,260	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	
<b>(シンガポール)</b>		百株	百株	シンガポールドル	千円	
UOL Group Limited		428	459	282	31,494	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD		256	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,774	1,909	702	78,379	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	55,366 16	76,498 16	22,747 -	2,537,903 <0.3%>	
<b>(ニュージーランド)</b>				千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		1,152	1,237	956	86,034	運輸
EBOS GROUP LTD		149	152	588	52,899	ヘルスケア機器・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		533	575	1,263	113,673	ヘルスケア機器・サービス
MERCURY NZ LTD		638	685	414	37,299	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		1,187	1,276	638	57,413	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,764	1,877	943	84,861	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,426 6	5,803 6	4,804 -	432,181 <0.1%>	
<b>(イギリス)</b>				千イギリスポンド		
3I GROUP PLC		897	965	2,095	391,146	金融サービス
ABRDN PLC		1,867	1,936	333	62,269	金融サービス
ADMIRAL GROUP PLC		167	211	548	102,446	保険
ANGLO AMERICAN PLC		1,174	1,263	2,822	526,907	素材
ANTOFAGASTA PLC		364	391	539	100,771	素材
ASHTED GROUP PLC		405	435	2,283	426,286	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		329	345	822	153,464	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC		1,432	1,540	15,804	2,950,619	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		861	911	644	120,335	メディア・娯楽
AVIVA PLC		2,592	2,726	1,151	214,916	保険
BAE SYSTEMS PLC		2,854	3,029	3,197	596,882	資本財
BARCLAYS PLC		14,648	15,453	2,206	411,974	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		928	970	469	87,680	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT		100	105	477	89,171	耐久消費財・アパレル
BP PLC		16,779	17,242	8,236	1,537,687	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,966	2,112	5,325	994,252	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC		6,454	6,470	769	143,627	電気通信サービス
BUNZL PLC		312	335	988	184,634	資本財
BURBERRY GROUP PLC		355	374	586	109,458	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC		-	5,515	836	156,215	公益事業
COCA-COLA HBC AG-CDI		186	219	464	86,739	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC		1,624	1,723	3,604	672,934	消費者サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
CRH PLC	-	720	3,473	648,392	素材
CRODA INTERNATIONAL PLC	129	138	638	119,223	素材
DCC PLC	91	98	525	98,014	資本財
DIAGEO PLC	2,101	2,233	6,275	1,171,540	食品・飲料・タバコ
ENDEAVOUR MINING PLC	-	183	316	59,172	素材
ENTAIN PLC	544	634	543	101,432	消費者サービス
EXPERIAN PLC	851	914	2,681	500,591	商業・専門サービス
GLENCORE PLC	9,519	10,466	4,893	913,654	素材
GSK PLC	3,759	4,069	5,740	1,071,653	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HALEON PLC	4,694	5,505	1,799	335,919	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC	350	377	774	144,663	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARGREAVES LANSDOWN PLC	328	353	256	47,945	金融サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	152	164	289	53,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	18,456	19,644	12,089	2,256,928	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	827	858	1,589	296,719	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	1,317	1,389	1,040	194,300	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	161	167	1,018	190,136	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	149	160	610	113,996	商業・専門サービス
JD SPORTS FASHION PLC	2,384	2,575	357	66,680	一般消費財・サービス流通・小売り
JOHNSON MATTHEY PLC	169	182	277	51,898	素材
KINGFISHER PLC	1,803	1,892	441	82,375	一般消費財・サービス流通・小売り
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,522	5,947	1,365	254,918	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	62,167	63,969	2,769	517,104	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	302	397	3,396	634,026	金融サービス
M&G PLC	2,075	2,241	459	85,851	金融サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	-	1,341	700	130,776	資本財
MONDI PLC/WI	448	482	671	125,319	素材
NATIONAL GRID PLC	3,383	3,658	3,717	693,946	公益事業
NATWEST GROUP PLC	4,907	5,774	1,199	224,026	銀行
NEXT PLC	119	119	923	172,339	一般消費財・サービス流通・小売り
NMC HEALTH PLC	47	47	0.005	0.886	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	534	575	322	60,276	生活必需品流通・小売り
PEARSON PLC	597	640	609	113,856	消費者サービス
PERSIMMON PLC	295	318	394	73,682	耐久消費財・アパレル
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	699	752	368	68,882	保険
PRUDENTIAL PLC	2,540	2,735	2,585	482,643	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	661	713	3,847	718,362	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		
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
RELX PLC	1,770	1,881	5,615	1,048,318	商業・専門サービス	
RENTOKIL INITIAL PLC	2,328	2,503	1,161	216,763	商業・専門サービス	
RIO TINTO PLC	1,039	1,118	6,093	1,137,682	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	7,735	8,362	2,040	380,934	資本財	
SAGE GROUP PLC	942	1,016	1,000	186,848	ソフトウェア・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	1,623	1,643	437	81,693	生活必需品流通・小売り	
SCHRODERS PLC	817	799	325	60,793	金融サービス	
SEVERN TRENT PLC	232	250	675	126,147	公益事業	
SHELL PLC-NEW	6,524	6,663	17,381	3,244,933	エネルギー	
SMITH & NEPHEW PLC	804	867	888	165,871	ヘルスケア機器・サービス	
SMITHS GROUP PLC	327	347	573	107,097	資本財	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	68	73	655	122,455	資本財	
SSE PLC	997	1,082	1,943	362,848	公益事業	
ST JAMES'S PLACE PLC	503	546	375	70,118	金融サービス	
STANDARD CHARTERED PLC	2,273	2,355	1,554	290,215	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	3,270	3,517	442	82,550	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	6,842	7,122	1,965	366,989	生活必需品流通・小売り	
UNILEVER PLC	2,343	2,499	9,539	1,780,844	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	629	676	733	136,953	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC	24,274	23,169	1,737	324,414	電気通信サービス	
WHITBREAD PLC	186	196	655	122,450	消費者サービス	
WISE PLC - A	-	611	436	81,534	金融サービス	
WPP PLC	990	1,068	761	142,168	メディア・娯楽	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	254,927 77	275,100 82	180,171 -	33,636,305 <4.1%>	
<b>(イスラエル)</b>			千イスラエル・シケル			
AZRIELI GROUP	39	42	829	33,453	不動産管理・開発	
BANK HAPOALIM BM	1,173	1,261	3,788	152,783	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,426	1,525	4,099	165,321	銀行	
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	1,965	-	-	-	電気通信サービス	
ELBIT SYSTEMS LTD	24	26	1,961	79,118	資本財	
FIRST INTL BANK ISRAEL	51	-	-	-	銀行	
ICL GROUP LTD	655	769	1,481	59,766	素材	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	1,141	1,227	2,229	89,931	銀行	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	142	153	1,994	80,428	銀行	
NICE LTD	58	62	4,535	182,903	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	
<b>(イスラエル)</b>		百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
TOWER SEMICONDUCTOR LTD		101	-	-	-	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額	6,780	5,070	20,920	843,706	
	銘柄数<比率>	11	8	-	<0.1%>	
<b>(スイス)</b>				千スイス・フラン		
ABB LTD		1,452	1,589	5,368	908,495	資本財
ADECCO GROUP AG-REG		147	158	656	111,058	商業・専門サービス
ALCON INC		461	496	3,101	524,900	ヘルスケア機器・サービス
BACHEM HOLDING AG-REG B		30	33	240	40,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BALOISE HOLDING AG		42	45	596	100,939	保険
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		27	29	303	51,337	銀行
BARRY CALLEBAUT AG-REG		3	3	527	89,208	食品・飲料・タバコ
BKW AG		19	20	325	55,031	公益事業
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.96	0.95	1,030	174,423	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.10	0.10	1,084	183,434	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		482	518	5,841	988,549	耐久消費財・アパレル
CLARIANT AG		199	214	286	48,486	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG		3,329	-	-	-	金融サービス
DUFREY AG-REG		-	95	303	51,277	一般消費財・サービス流通・小売り
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		6	7	434	73,546	素材
GEBERIT AG-REG		33	33	1,584	268,049	資本財
GIVAUDAN-REG		8	9	2,960	501,059	素材
HELVETIA HOLDING AG-REG		-	36	454	76,885	保険
HOLCIM LTD		512	517	3,196	540,945	素材
JULIUS BAER GROUP LTD		197	204	1,139	192,897	金融サービス
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		50	54	1,330	225,157	運輸
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		159	163	1,234	208,885	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG		68	74	2,628	444,721	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA		2,542	2,653	26,270	4,445,437	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG		1,999	2,037	17,131	2,899,007	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDING AG		20	22	2,540	429,862	金融サービス
ROCHE HOLDING AG		649	698	16,588	2,807,149	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG-BR		24	31	808	136,786	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SANDOZ GROUP AG		-	407	1,040	176,077	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		22	23	440	74,489	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		37	40	775	131,198	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE		147	149	1,099	186,077	商業・専門サービス
SIG GROUP AG		282	304	637	107,838	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		
<b>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
SIKA AG-BEARER	135	145	3,424	579,510	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	48	51	1,198	202,860	ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG	103	110	1,330	225,144	ヘルスケア機器・サービス	
SWATCH GROUP AG	26	28	674	114,216	耐久消費財・アパレル	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	28	29	1,692	286,480	保険	
SWISS PRIME SITE-REG	70	76	647	109,560	不動産管理・開発	
SWISS RE AG	278	299	2,996	507,000	保険	
SWISSCOM AG	24	26	1,333	225,582	電気通信サービス	
TEMENOS GROUP AG-REG	58	63	439	74,370	ソフトウェア・サービス	
THE SWATCH GROUP AG-REG	50	53	237	40,271	耐久消費財・アパレル	
UBS GROUP AG	3,094	3,267	7,561	1,279,628	金融サービス	
VAT GROUP AG	24	26	1,016	171,955	資本財	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	139	149	6,534	1,105,761	保険	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,045 43	15,004 45	131,049 -	22,176,253 <2.7%>	
<b>(デンマーク)</b>			千デンマーク・クローネ			
A P MOLLER - MAERSK A/S	4	4	4,928	108,074	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S	2	3	3,103	68,067	運輸	
CARLSBERG AS-B	89	97	8,297	181,966	食品・飲料・タバコ	
CHR HANSEN HOLDING A/S	97	104	5,737	125,821	素材	
COLOPLAST-B	109	118	8,803	193,053	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S	637	685	12,152	266,498	銀行	
DEMANT A/S	85	100	2,754	60,415	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	173	184	20,067	440,070	運輸	
GENMAB A/S	60	65	14,552	319,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVO-NORDISK A/S	1,530	3,243	225,195	4,938,537	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	189	203	7,323	160,603	素材	
ORSTED A/S	174	188	5,882	128,996	公益事業	
PANDORA A/S	83	83	7,736	169,652	耐久消費財・アパレル	
ROCKWOOL A/S-B SHS	8	9	1,511	33,146	資本財	
TRYGVESTA AS	333	348	4,987	109,365	保険	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	933	1,003	17,834	391,114	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,515 16	6,444 16	350,867 -	7,694,519 <0.9%>	
<b>(ノルウェー)</b>			千ノルウェー・クローネ			
ADEVINTA ASA-B	269	289	3,156	43,777	メディア・娯楽	
AKER BP ASA	291	313	9,659	133,975	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		
<b>(ノルウェー)</b>	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円		
DNB BANK ASA	859	917	18,678	259,064	銀行	
EQUINOR ASA	879	894	31,231	433,183	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	184	198	3,508	48,661	保険	
KONGSBERG GRUPPEN ASA	81	86	4,060	56,321	資本財	
MOWI ASA	382	436	8,135	112,839	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO ASA	1,242	1,316	8,544	118,512	素材	
ORKLA ASA	693	743	5,786	80,263	食品・飲料・タバコ	
SALMAR ASA	60	72	4,156	57,649	食品・飲料・タバコ	
TELENOR ASA	659	715	8,092	112,242	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	152	163	6,115	84,821	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,757 12	6,149 12	111,125 -	1,541,313 <0.2%>	
<b>(スウェーデン)</b>			千スウェーデン・クローナ			
ALFA LAVAL AB	267	287	10,952	156,078	資本財	
ASSA ABLOY AB	926	995	26,229	373,771	資本財	
ATLAS COPCO AB	1,447	1,551	21,228	302,505	資本財	
ATLAS COPCO AB-A SHS	2,478	2,668	42,460	605,068	資本財	
BEIJER REF AB	-	382	4,634	66,043	資本財	
BIOVITRUM	157	194	4,712	67,149	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOLIDEN AB	252	271	8,004	114,067	素材	
BOLIDEN AB RED SHS	252	-	-	-	素材	
ELECTROLUX AB	203	-	-	-	耐久消費財・アパレル	
EMBRACER GROUP AB	605	-	-	-	メディア・娯楽	
EPIROC AB-A	607	653	12,524	178,474	資本財	
EPIROC AB-B	362	388	6,292	89,669	資本財	
EQT AB	328	353	8,749	124,686	金融サービス	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	562	604	15,455	220,240	家庭用品・パーソナル用品	
EVOLUTION AB	169	182	19,456	277,250	消費者サービス	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	581	647	4,007	57,105	不動産管理・開発	
GETINGE AB-B SHS	211	227	4,976	70,911	ヘルスケア機器・サービス	
HENNES & MAURITZ AB	675	641	10,769	153,469	一般消費財・サービス流通・小売り	
HEXAGON AB-B SHS	1,799	2,063	21,020	299,536	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HOLMEN AB-B SHARES	86	92	3,996	56,946	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	387	346	2,726	38,854	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	118	130	3,984	56,783	金融サービス	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	143	150	4,575	65,196	金融サービス	
INDUTRADE AB	252	272	6,137	87,455	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
<b>(スウェーデン)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		137	147	3,249	46,307	資本財
INVESTOR AB		1,680	1,718	36,313	517,464	金融サービス
INVESTOR AB-A SHS		464	-	-	-	金融サービス
KINNEVIK AB - B		223	-	-	-	金融サービス
LIFCO AB-B SHS		215	231	5,235	74,603	資本財
LUNDBERGS AB-B SHS		70	74	3,595	51,238	金融サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		1,400	1,506	9,854	140,421	資本財
NORDEA BANK ABP		3,057	3,200	38,531	549,066	銀行
SAAB AB-B		-	79	4,413	62,885	資本財
SAGAX AB-B		176	196	4,568	65,105	不動産管理・開発
SANDVIK AB		984	1,058	21,421	305,257	資本財
SECURITAS AB		453	487	4,381	62,433	商業・専門サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		1,492	1,574	19,874	283,216	銀行
SKANSKA AB-B SHS		314	337	5,622	80,124	資本財
SKF AB		353	338	6,425	91,559	資本財
SVENSKA CELLULOOSA AB		559	601	9,725	138,589	素材
SVENSKA HANDELSBANKEN		1,347	1,447	14,259	203,201	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES		836	842	15,530	221,305	銀行
TELE2 AB		538	554	4,511	64,290	電気通信サービス
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON		2,696	2,909	15,192	216,489	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB		2,527	2,474	5,977	85,182	電気通信サービス
VOLVO AB		1,388	1,494	34,777	495,575	資本財
VOLVO AB-A SHS		190	203	4,862	69,293	資本財
VOLVO CAR AB-B		550	592	2,148	30,616	自動車・自動車部品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	34,536 46	35,179 43	513,368 -	7,315,494 <0.9%>	
<b>(ユーロ/アイルランド)</b>				千ユーロ		
AIB GROUP PLC		985	1,427	598	97,890	銀行
BANK OF IRELAND GROUP PLC		988	1,048	901	147,377	銀行
CRH PLC		690	-	-	-	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.		154	175	2,545	416,239	消費者サービス
KERRY GROUP PLC-A		147	158	1,153	188,706	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC		142	153	1,061	173,517	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		228	258	820	134,155	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,336 7	3,222 6	7,080 -	1,157,886 <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	
<b>(ユーロ/オランダ)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
ABN AMRO BANK NV	372	399	507	83,006	銀行
ADYEN NV	20	21	2,239	366,189	金融サービス
AIRBUS SE	546	589	7,792	1,274,319	資本財
AKZO NOBEL NV	167	169	1,165	190,667	素材
ASM INTERNATIONAL NV	43	46	2,171	355,060	半導体・半導体製造装置
ASML HOLDING NV	372	400	25,190	4,119,695	半導体・半導体製造装置
ASR NEDERLAND NV	-	158	583	95,401	保険
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	-	76	916	149,957	半導体・半導体製造装置
CNH INDUSTRIAL NV	945	1,016	952	155,745	資本財
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	482	518	533	87,187	食品・飲料・タバコ
DSM-FIRMENICH AG	158	184	1,699	277,936	素材
EURONEXT NV	79	85	625	102,239	金融サービス
EXOR NV	99	107	924	151,218	金融サービス
FERRARI NV	116	125	4,128	675,132	自動車・自動車部品
HEINEKEN HOLDING NV	106	128	913	149,368	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN NV	239	286	2,381	389,430	食品・飲料・タバコ
IMCD NV	52	56	760	124,444	資本財
ING GROEP NV-CVA	3,443	3,595	4,585	749,974	銀行
JDE PEET'S BV	92	124	318	52,125	食品・飲料・タバコ
JUST EAT TAKEAWAY	169	-	-	-	消費者サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	965	964	2,567	419,889	生活必需品流通・小売り
KONINKLIJKE PHILIPS NV	858	922	1,789	292,647	ヘルスケア機器・サービス
NN GROUP NV	257	249	799	130,702	保険
OCI NV	97	104	222	36,396	素材
PROSUS	740	1,519	4,594	751,406	一般消費財・サービス流通・小売り
QIAGEN NV	210	226	816	133,540	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD NV	110	109	585	95,797	商業・専門サービス
ROYAL KPN NV	3,123	3,297	1,044	170,770	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	631	679	2,846	465,557	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	670	814	1,951	319,182	メディア・娯楽
WOLTERS KLUWER NV	237	255	3,133	512,380	商業・専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,413 29	17,234 30	78,741 -	12,877,372 <1.6%>
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>					
AGEAS	148	158	610	99,819	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	802	863	4,854	793,841	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE	51	55	2,515	411,416	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
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
D'IETIENEN GROUP		23	21	332	54,449	一般消費財・サービス流通・小売り
ELIA GROUP SA/NV		30	29	298	48,837	公益事業
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		92	94	687	112,443	金融サービス
KBC GROEP NV		231	248	1,324	216,548	銀行
LOTUS BAKERIES		-	0,41	308	50,489	食品・飲料・タバコ
SOFINA		14	15	308	50,387	金融サービス
SOLVAY SA		68	73	759	124,177	素材
UCB SA		116	125	860	140,710	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE		193	208	485	79,376	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,773	1,894	13,345	2,182,500	
		11	12	-	<0.3%>	
<b>(ユーロ/ルクセンブルグ)</b>						
ARCELORMITTAL		485	507	1,112	181,869	素材
TENARIS SA		435	468	733	119,940	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	921	975	1,845	301,810	
		2	2	-	<0.0%>	
<b>(ユーロ/フランス)</b>						
ACCOR		157	183	576	94,268	消費者サービス
ADP		27	29	341	55,866	運輸
AIR LIQUIDE		483	520	8,861	1,449,269	素材
ALSTOM RGPT		295	284	352	57,583	資本財
AMUNDI SA		56	60	338	55,438	金融サービス
ARKEMA		55	59	555	90,843	素材
AXA SA		1,738	1,823	5,176	846,562	保険
BIOMERIEUX		38	41	394	64,510	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS		1,026	1,042	5,914	967,266	銀行
BOLLORE SE		818	732	389	63,746	メディア・娯楽
BOUYGUES		208	189	661	108,106	資本財
BUREAU VERITAS SA		271	293	648	105,996	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA		151	163	2,915	476,788	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA		547	592	1,008	164,915	生活必需品流通・小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN		452	459	2,682	438,659	資本財
CREDIT AGRICOLE SA		1,125	1,201	1,413	231,219	銀行
DANONE		593	639	3,681	602,067	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA		23	20	384	62,802	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA		616	665	2,799	457,895	ソフトウェア・サービス
EDENRED		230	248	1,240	202,878	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	72	661	108,240	資本財
ENGIE	1,688	1,815	2,832	463,156	公益事業
ESSILORLUXOTTICA	268	293	5,256	859,597	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO	40	43	254	41,699	金融サービス
EUROFINS SCIENTIFIC	124	134	706	115,494	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GETLINK SE - REGR	405	355	578	94,603	運輸
HERMES INTERNATIONAL	29	31	6,058	990,830	耐久消費財・アパレル
IPSEN	34	37	401	65,611	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KERING	69	74	2,992	489,348	耐久消費財・アパレル
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	97	104	341	55,886	消費者サービス
LEGRAND SA	246	265	2,321	379,582	資本財
L'OREAL SA	223	239	10,162	1,662,045	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	255	274	19,530	3,194,030	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	627	674	1,999	326,941	自動車・自動車部品
ORANGE S.A.	1,867	1,882	2,084	340,899	電気通信サービス
PERNOD-RICARD	190	203	3,401	556,208	食品・飲料・タバコ
PUBLICIS GROUPE	211	227	1,680	274,826	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	21	22	256	41,893	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	177	190	677	110,854	自動車・自動車部品
SAFRAN SA	315	339	5,453	891,852	資本財
SANOFI	1,054	1,129	9,698	1,586,026	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	25	27	550	90,036	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	501	540	8,980	1,468,592	資本財
SEB SA	23	24	250	40,952	耐久消費財・アパレル
SOCIETE GENERALE	745	722	1,632	267,054	銀行
SODEXO	81	87	891	145,725	消費者サービス
TELEPERFORMANCE	54	58	794	129,958	商業・専門サービス
THALES SA	98	104	1,442	235,894	資本財
TOTALENERGIES SE	2,299	2,234	13,811	2,258,753	エネルギー
VALEO SA	191	205	277	45,401	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	615	675	1,895	310,005	公益事業
VINCI SA	497	528	5,778	945,023	資本財
VIVENDI SA	664	673	592	96,880	メディア・娯楽
WENDEL	24	26	194	31,799	金融サービス
WORLDLINE SA	221	238	328	53,705	金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,991 55	23,812 55	155,106 -	25,366,102 <3.1%>

## 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/ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	149	161	2,892	473,020	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE	372	400	9,157	1,497,558	保険
AROUNDTOWN SA	924	-	-	-	不動産管理・開発
BASF SE	848	888	3,935	643,556	素材
BAYER AG	908	976	4,046	661,787	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	305	298	2,844	465,155	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	54	57	501	81,953	自動車・自動車部品
BECHTLE AG	75	81	383	62,732	ソフトウェア・サービス
BEIERSDORF AG	93	100	1,246	203,934	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG SE	142	145	1,112	181,922	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	37	40	347	56,762	ヘルスケア機器・サービス
COMMERZBANK AG	982	1,056	1,181	193,190	銀行
CONTINENTAL AG	101	109	752	123,041	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	178	191	921	150,639	素材
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	418	490	1,431	234,156	資本財
DELIVERY HERO SE	158	174	573	93,767	消費者サービス
DEUTSCHE BANK AG	1,908	1,923	2,149	351,511	金融サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	175	188	3,185	520,983	金融サービス
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	551	593	474	77,574	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG	3,008	3,234	6,972	1,140,219	電気通信サービス
DHL GROUP	916	984	3,990	652,610	運輸
DR ING HC F PORSCHE AG	105	113	1,029	168,332	自動車・自動車部品
E.ON SE	2,074	2,229	2,576	421,368	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	193	209	386	63,224	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA	390	419	1,146	187,495	ヘルスケア機器・サービス
GEA GROUP AG	139	152	532	87,136	資本財
HANNOVER RUECK SE	55	59	1,250	204,468	保険
HEIDELBERG MATERIALS AG	133	143	1,022	167,268	素材
HELLOFRESH SE	150	154	247	40,447	生活必需品流通・小売り
HENKEL AG & CO KGAA	97	104	654	107,111	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG	163	167	1,194	195,280	家庭用品・パーソナル用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,206	1,297	4,357	712,665	半導体・半導体製造装置
KNORR-BREMSE AG	67	72	401	65,700	資本財
LEG IMMOBILIEN SE	68	73	520	85,069	不動産管理・開発
MERCEDES-BENZ GROUP AG	741	797	4,672	764,087	自動車・自動車部品
MERCK KGAA	119	128	2,015	329,649	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	49	53	994	162,647	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	
<b>(ユーロ/ドイツ)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	129	135	5,122	837,661	保険
NEMETSCHKE SE	53	57	455	74,502	ソフトウェア・サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	141	152	702	114,810	自動車・自動車部品
PUMA AG	97	104	555	90,777	耐久消費財・アパレル
RATIONAL AG	4	5	309	50,694	資本財
RHEINMETALL AG	40	43	1,207	197,501	資本財
RWE AG	593	627	2,407	393,694	公益事業
SAP SE	965	1,037	14,239	2,328,765	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	22	26	712	116,599	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCOUT24 SE	73	74	469	76,714	メディア・娯楽
SIEMENS AG	707	755	11,213	1,833,804	資本財
SIEMENS ENERGY AG	402	516	603	98,657	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	260	280	1,402	229,441	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG	122	132	1,280	209,482	素材
TALANX AG	-	62	400	65,438	保険
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	1,017	956	224	36,724	電気通信サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	91	-	-	-	電気通信サービス
VOLKSWAGEN AG	27	29	358	58,560	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG	171	204	2,227	364,235	自動車・自動車部品
VONOVIA SE	662	729	1,837	300,461	不動産管理・開発
WACKER CHEMIE AG	-	18	219	35,836	素材
ZALANDO SE	206	222	513	84,034	一般消費財・サービス流通・小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,862 57	24,445 57	117,564 -	19,226,433 <2.3%>
<b>(ユーロ/ポルトガル)</b>					
EDP RENOVAVEIS SA	265	305	499	81,671	公益事業
EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	265	-	-	-	公益事業
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,565	3,117	1,334	218,182	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	462	487	656	107,344	エネルギー
JERONIMO MARTINS	261	281	611	100,029	生活必需品流通・小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,820 5	4,192 4	3,101 -	507,227 <0.1%>
<b>(ユーロ/スペイン)</b>					
ACCIONA SA	22	24	317	51,853	公益事業
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	201	217	779	127,484	資本財
AENA SME SA	69	74	1,140	186,446	運輸
AMADEUS IT GROUP SA	416	447	2,800	458,068	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	
<b>(ユーロ/スペイン)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	5,570	5,926	4,909	802,889	銀行
BANCO SANTANDER SA	15,514	16,076	5,985	978,850	銀行
CAIXABANK	4,095	4,100	1,660	271,527	銀行
CELLNEX TELECOM SAU	524	564	1,836	300,322	電気通信サービス
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	60	65	176	28,943	公益事業
ENAGAS SA	230	247	400	65,463	公益事業
ENDESA SA	292	314	616	100,783	公益事業
FERROVIAL S.A.	450	-	-	-	資本財
FERROVIAL SE	-	505	1,528	249,989	資本財
GRIFOLS SA	275	296	375	61,340	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA	5,677	6,048	6,695	1,094,922	公益事業
INDITEX SA	1,008	1,083	3,865	632,130	一般消費財・サービス流通・小売り
NATURGY ENERGY GROUP SA	134	124	336	55,003	公益事業
REDEIA CORPORACION SA	376	405	613	100,276	公益事業
REPSOL SA	1,269	1,266	1,747	285,774	エネルギー
TELEFONICA SA	4,857	5,212	1,956	319,941	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	41,047 19	43,002 19	37,740 -	6,172,011 <0.7%>
<b>(ユーロ/イタリア)</b>					
AMPLIFON SPA	115	123	340	55,704	ヘルスケア機器・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	1,025	1,006	1,957	320,158	保険
DIASORIN ITALIA SPA	23	22	197	32,355	ヘルスケア機器・サービス
ENEL SPA	7,515	8,080	5,175	846,426	公益事業
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	2,308	2,346	3,522	576,149	エネルギー
FINECOBANK SPA	563	607	746	122,130	銀行
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	324	347	371	60,745	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO	14,919	15,442	4,144	677,830	銀行
MEDIOBANCA SPA	549	547	644	105,358	銀行
MONCLER SPA	189	204	1,032	168,839	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA	545	587	406	66,543	金融サービス
POSTE ITALIANE SPA	482	518	527	86,261	保険
PRYSMIAN SPA	235	260	932	152,520	資本財
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	96	103	469	76,768	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAM SPA	1,860	2,002	900	147,302	公益事業
STELLANTIS NV	2,078	2,198	4,060	664,039	自動車・自動車部品
TELECOM ITALIA SPA	9,330	10,078	261	42,689	電気通信サービス
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	1,298	1,395	1,049	171,560	公益事業

## 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	
<b>(ユーロ/イタリア)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNICREDIT SPA		1,775	1,831	4,585	749,840	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	45,238 19	47,705 19	31,327 -	5,123,226 <0.6%>	
<b>(ユーロ/フィンランド)</b>						
ELISA OYJ		134	145	610	99,865	電気通信サービス
FORTUM OYJ		414	445	565	92,420	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		252	271	465	76,083	生活必需品流通・小売り
KONE OYJ		314	337	1,395	228,267	資本財
METSO CORPORATION		613	658	596	97,522	資本財
NESTE OYJ		390	420	1,449	237,097	エネルギー
NOKIA OYJ		4,998	5,313	1,737	284,172	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ORION OYJ-CLASS B		98	107	402	65,866	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		443	456	1,774	290,135	保険
STORA ENSO OYJ		508	577	703	115,057	素材
UPM-KYMMENE OYJ		493	530	1,749	286,139	素材
WARTSILA OYJ		436	469	557	91,247	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,098 12	9,735 12	12,008 -	1,963,877 <0.2%>	
<b>(ユーロ/オーストリア)</b>						
ERSTE GROUP BANK AG		317	341	1,225	200,386	銀行
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A		62	67	577	94,524	公益事業
OMV AG		136	146	597	97,762	エネルギー
VOESTALPINE AG		106	115	301	49,304	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	623 4	670 4	2,702 -	441,978 <0.1%>	
<b>(ユーロ/その他)</b>						
AEGON LTD		1,654	1,674	831	135,919	保険
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		189	203	730	119,528	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,844 2	1,878 2	1,561 -	255,448 <0.0%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	169,971 222	178,770 222	462,124 -	75,575,875 <9.1%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,040,017 1,213	1,128,688 1,219	-	780,690,036 <94.4%>	

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	□数	□数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	
BOSTON PROPERTIES INC	13	14	815	122,319	
CROWN CASTLE INC	40	43	4,481	672,039	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14	16	1,695	254,272	
PROLOGIS INC	85	91	10,103	1,514,977	
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	43	49	875	131,231	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	12	14	2,384	357,577	
CAMDEN PROPERTY TRUST	9	10	927	139,023	
EQUITY RESIDENTIAL	33	35	1,982	297,268	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	6	1,345	201,752	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	49	54	895	134,254	
WELLTOWER INC	43	49	4,321	648,006	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	66	70	1,219	182,844	
KIMCO REALTY CORP	57	61	1,158	173,724	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10	11	1,407	211,072	
PUBLIC STORAGE	14	15	4,052	607,724	
REGENCY CENTERS CORP	14	16	1,018	152,690	
SIMON PROPERTY GROUP INC	30	32	3,953	592,882	
SUN COMMUNITIES INC	11	12	1,518	227,649	
UDR INC	30	31	1,019	152,941	
VENTAS INC	36	39	1,770	265,454	
WP CAREY INC	19	21	1,202	180,305	
REALTY INCOME CORP	58	66	3,542	531,258	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16	17	1,221	183,128	
EXTRA SPACE STORAGE INC	12	21	2,693	403,903	
DIGITAL REALTY TRUST INC	26	28	3,895	584,183	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	55	—	—	—	
IRON MOUNTAIN INC	26	28	1,802	270,330	
AMERICAN TOWER REIT INC	43	46	9,161	1,373,736	
EQUINIX INC	8	9	7,200	1,079,681	
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPOR	35	37	540	81,112	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	29	32	1,166	174,845	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	23	26	1,184	177,584	
SBA COMMUNICATIONS CORP	9	10	2,517	377,432	
INVITATION HOMES INC	56	60	2,038	305,646	
VICI PROPERTIES INC	89	99	2,853	427,918	
小計	□数・金額	1,133	1,185	87,967	13,190,775
	銘柄数<比率>	35	34	—	<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	
<b>(カナダ)</b>			千口	千口	千カナダ・ドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA			8	8	380	41,606
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR			14	15	267	29,258
小計	□数・金額		22	23	648	70,865
	銘柄数<比率>		2	2	—	<0.0%>
<b>(オーストラリア)</b>					千オーストラリア・ドル	
GPT GROUP			176	189	790	77,115
GOODMAN GROUP			156	168	3,896	380,163
STOCKLAND			220	236	943	92,088
MIRVAC GROUP			364	391	802	78,273
VICINITY CENTRES			356	383	710	69,313
LENDLEASE GROUP			63	68	469	45,776
SCENTRE GROUP			479	515	1,369	133,663
DEXUS/AU			99	106	764	74,544
小計	□数・金額		1,916	2,060	9,746	950,939
	銘柄数<比率>		8	8	—	<0.1%>
<b>(香港)</b>					千香港ドル	
LINK REIT			199	251	10,013	192,552
小計	□数・金額		199	251	10,013	192,552
	銘柄数<比率>		1	1	—	<0.0%>
<b>(シンガポール)</b>					千シンガポール・ドル	
CAPITALAND ASCENDAS REIT			311	370	1,036	115,648
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL			490	528	983	109,713
MAPLETREE LOGISTICS TRUST			311	343	542	60,570
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR			217	235	325	36,305
小計	□数・金額		1,330	1,478	2,888	322,238
	銘柄数<比率>		4	4	—	<0.0%>
<b>(イギリス)</b>					千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC			81	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC			65	70	457	85,405
SEGRO PLC			111	115	952	177,792
小計	□数・金額		257	185	1,409	263,197
	銘柄数<比率>		3	2	—	<0.0%>
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>					千ユーロ	
WAREHOUSES DE PAUW SCA			15	16	420	68,833
小計	□数・金額		15	16	420	68,833
	銘柄数<比率>		1	1	—	<0.0%>

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ/フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円
KLEPIERRE	19	21	492	80,601
GECINA SA	4	4	454	74,317
COVIVIO	4	5	226	36,969
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10	11	641	104,934
小計	□数・金額	42	1,814	296,824
	銘柄数<比率>	4	—	<0.0%>
ユーロ計	□数・金額	59	2,235	365,657
	銘柄数<比率>	5	—	<0.0%>
合計	□数・金額	5,244	—	15,356,225
	銘柄数<比率>	56	—	<1.9%>

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

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

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
外国 S&P 500 EMINI FUTURE	22,132	—
FTSE 100	2,204	—
DJ EURO STOXX 50	5,574	—

(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

2023年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	780,690,036	94.2
投資信託証券	15,356,225	1.9
コール・ローン等、その他	32,982,118	4.0
投資信託財産総額	829,028,380	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149.95円、1カナダ・ドル109.25円、1オーストラリア・ドル97.57円、1香港ドル19.23円、1シンガポール・ドル111.57円、1ニュージーランド・ドル89.96円、1イギリス・ポンド186.69円、1イスラエル・シケル40.328円、1スイス・フラン169.22円、1デンマーク・クローネ21.93円、1ノルウェー・クローネ13.87円、1スウェーデン・クローナ14.25円、1ユーロ163.54円です。

(注2) 外貨建純資産 (810,509,466千円) の投資信託財産総額 (829,028,380千円) に対する比率は97.8%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

(2023年11月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>843,905,268,660円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	19,901,926,195
株 式(評価額)	780,690,036,233
投 資 信 託 証 券(評価額)	15,356,225,963
未 収 入 金	16,020,545,503
未 収 配 当 金	950,156,766
差 入 委 託 証 拠 金	10,986,378,000
<b>(B)負債</b>	<b>16,847,404,762</b>
未 払 金	15,040,401,421
未 払 解 約 金	1,806,984,938
そ の 他 未 払 費 用	18,403
<b>(C)純 資 産 総 額(A - B)</b>	<b>827,057,863,898</b>
元 本	220,818,463,085
次 期 繰 越 損 益 金	606,239,400,813
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>220,818,463,085口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C / D)</b>	<b>37,454円</b>

(注1) 期首元本額	205,978,181,520円
期中追加設定元本額	26,115,488,072円
期中一部解約元本額	11,275,206,507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)	794,706,462円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,806,956,625円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,508,595,111円
ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)	2,154,739,003円
ニッセイインデックスバラス(債券重視) S A(適格機関投資家限定)	949,369円
ニッセイインデックスバラス(標準型) S A(適格機関投資家限定)	5,648,440円
ニッセイインデックスバラス(成長型) S A(適格機関投資家限定)	5,790,300円
ニッセイ外国株式インデックスA II(適格機関投資家限定)	326,433,259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	158,220,790,915円
DCニッセイ外国株式インデックス	39,070,481,438円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラスファンド(4資産均等型)	2,629,645,151円
DCニッセイターゲットデットファンド2055	395,039,390円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	177,542,196円
DCニッセイターゲットデットファンド2045	454,908,719円
DCニッセイターゲットデットファンド2035	677,865,953円
DCニッセイターゲットデットファンド2025	13,655,388円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラスファンド(6資産均等型)	94,377,931円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,675,694円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式・リート)	10,219,362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)	3,714,441円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラスファンド(8資産均等型)	21,299,634円
DCニッセイターゲットデットファンド2060	312,220,561円
DCニッセイターゲットデットファンド2050	199,356,481円
DCニッセイターゲットデットファンド2040	390,015,492円
DCニッセイターゲットデットファンド2030	184,195,638円
ニッセイ海外資産インデックス・バラスファンド2020-02(適格機関投資家限定)	161,299,099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)	253,851,314円
ニッセイ海外資産インデックス・バラスファンド2020-09(適格機関投資家限定)	162,468,312円
ニッセイ海外資産インデックス・バラスファンド2021-01(適格機関投資家限定)	159,155,707円
ニッセイ海外資産インデックス・バラスファンド2021-05(適格機関投資家限定)	158,496,026円
ニッセイ海外資産インデックス・バラスファンド2021-08(適格機関投資家限定)	141,595,628円
ニッセイ先進国株式インデックス(高成長ヘッジあり)(ラップ専用)	30,410,953円
ニッセイ先進国株式インデックス(高成長ヘッジなし)(ラップ専用)	6,069,453,038円
FWニッセイ先進国株式インデックス	56,059,397円
DCニッセイターゲットデットファンド2065	58,158,827円
ニッセイ海外資産インデックス・バラスファンドⅡ2023-05(適格機関投資家限定)	100,296,022円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	395,809円

### 損益の状況

当期(2023年5月23日~2023年11月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>6,521,239,758円</b>
受 取 配 当 金	6,238,208,851
受 取 利 息	61,970,427
受 取 他 収 益	224,459,610
支 払 利 息	△ 3,399,130
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>98,381,228,951</b>
売 買 損 益	129,007,619,592
売 買 損	△ 30,626,390,641
<b>(C)先 物 取 引 等 損 益</b>	<b>1,018,859,721</b>
取 引 損 益	1,903,646,971
取 引 損	△ 884,787,250
<b>(D)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 63,394,060</b>
<b>(E)当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>105,857,934,370</b>
<b>(F)前期繰越損益金</b>	<b>462,865,060,071</b>
<b>(G)追加信託差損益金</b>	<b>65,902,196,199</b>
<b>(H)解約差損益金</b>	<b>△ 28,385,789,827</b>
<b>(I)合 計(E + F + G + H)</b>	<b>606,239,400,813</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(I)</b>	<b>606,239,400,813</b>

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

# ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 34 期

(計算期間：2023年5月23日～2023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。 <ul style="list-style-type: none"><li>・ 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。</li><li>・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>



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

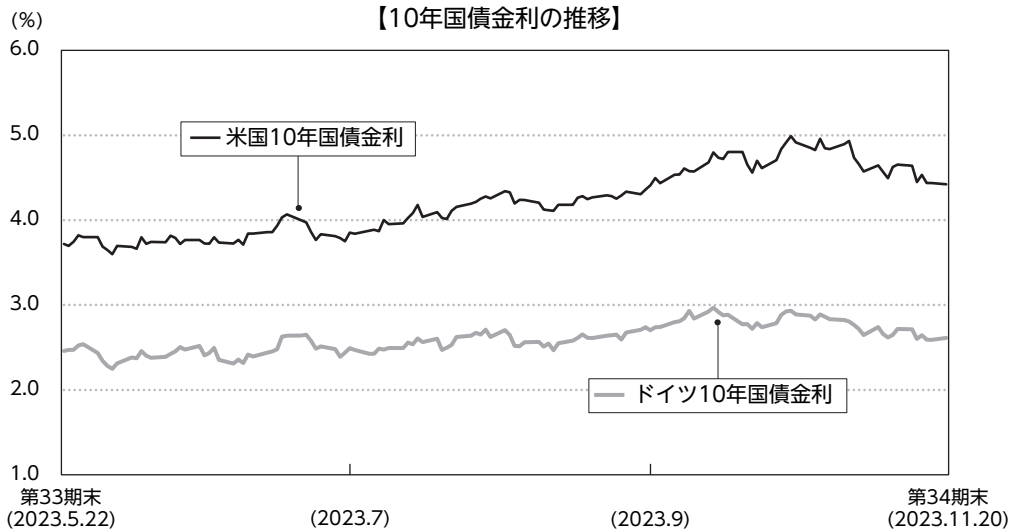


# 運用経過

2023年5月23日～2023年11月20日

## 投資環境

### 海外債券市況

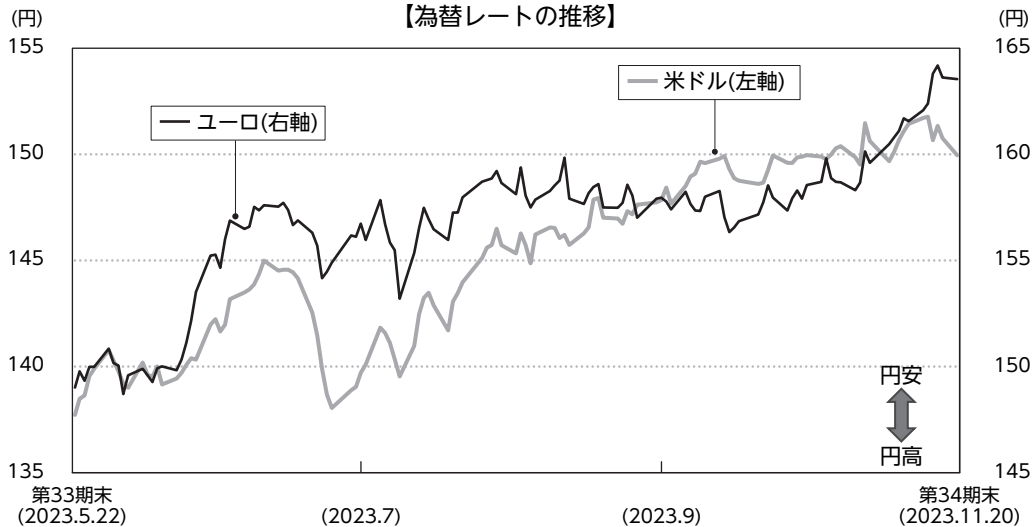


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、期初から10月中旬にかけて堅調な米経済指標を背景に利上げの継続が意識されたことから上昇基調となりました。その後は中東情勢の悪化により投資家のリスク回避姿勢が強まったことや物価上昇率の鈍化を受けて将来の利下げ観測が強まったことから金利は低下に転じましたが、結局、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初以降、各国の利上げや米金利の上昇を受けて上昇基調となり、9月には欧州中央銀行（ECB）が利上げ休止を示唆し、成長率予測を引き下げたことなどから上昇幅を縮小する動きとなりました。その後は中東情勢の悪化により投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを受けて低下に転じましたが、結局、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

## ■為替市況

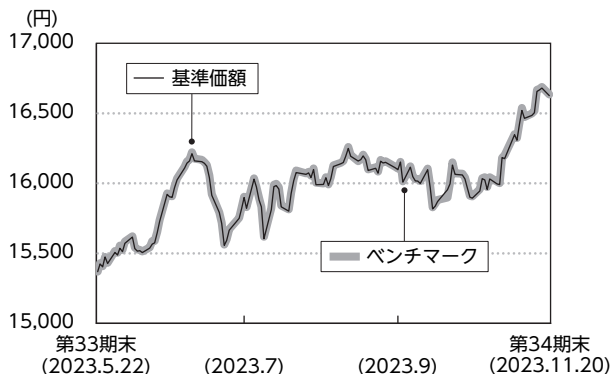


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、7月に日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けて大きく円高に振れる場面があったものの、その後は米国が利上げ方向である一方で日本が金融緩和方向であったことから日米金利差が拡大し、大幅な米ドル高円安基調となりました。11月には米国の将来の利下げ観測が意識される一方で日本の金融政策正常化観測が高まったことでやや米ドル安円高となりましたが、結局、期を通じて見ると米ドル高円安で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、ECBが物価上昇リスクを警戒していたことや米金利の上昇に連れて欧州金利が上昇したことなどからユーロ高円安基調で始まりました。7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けてユーロ安円高に転じましたが、その後は日・欧中央銀行の金融政策の影響を受けて上下に振れつつも横ばい圏での推移となりました。11月には大手格付け機関によるイタリア国債の格下げが回避されたことなどをを受けてユーロに対する懸念が後退したことや日銀の金融緩和と政策継続への見方が強まったことなどからユーロ高円安となり、結局、期を通じて見るとユーロ高円安で当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 期初から6月にかけて、米金融政策が利上げ方向であった一方で、国内においては金融緩和を維持したことから日米金利差が拡大し大幅な米ドル高円安基調となったこと

#### <下落要因>

- ・ 7月上旬から中旬にかけて、日銀の金融政策が修正されるとの見方が強まったことや米国の物価指標が鈍化し利上げ期待が後退したことで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+8.2%となり、ベンチマーク騰落率(+8.2%)に連動しました。

## 今後の運用方針

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
30期(2021年11月22日)	15,210	2.5	15,395	2.6	99.2	46,402
31期(2022年5月20日)	14,990	△1.4	15,179	△1.4	99.1	50,588
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

(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5月22日	15,369	—	15,569	—	99.0
5月末	15,536	1.1	15,757	1.2	99.1
6月末	16,160	5.1	16,386	5.2	98.9
7月末	15,811	2.9	16,028	3.0	99.2
8月末	16,249	5.7	16,470	5.8	98.9
9月末	15,998	4.1	16,224	4.2	99.2
10月末	15,990	4.0	16,209	4.1	99.0
(期末)2023年11月20日	16,626	8.2	16,850	8.2	98.9

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023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	0.018%	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)	(0.018)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	3	0.018	

(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（15,977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5月23日～2023年11月20日

## 公社債

		買付額	売付額	
外国	アメリカ	千米ドル 45,934	千米ドル 31,181	
	カナダ	千カナダ・ドル 2,352	千カナダ・ドル 1,575	
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 809	千オーストラリア・ドル 149	
	シンガポール	千シンガポール・ドル 363	千シンガポール・ドル 227	
	ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 318	千ニュージーランド・ドル 142	
	イギリス	千イギリス・ポンド 3,209	千イギリス・ポンド 677	
	イスラエル	千イスラエル・シケル 765	千イスラエル・シケル -	
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 1,154	千デンマーク・クローネ 494	
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 1,358	千ノルウェー・クローネ 153	
	スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 769	千スウェーデン・クローナ 109	
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 12,620	千メキシコ・ペソ 9,652	
	中国	千人民元 95,906	千人民元 11,808	
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 1,343	千マレーシア・リンギット 898	
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 1,656	千ポーランド・ズロチ 1,027	
	ユーロ	アイルランド	千ユーロ 179	千ユーロ 99
		オランダ	728	566
		ベルギー	957	892
		フランス	4,686	1,961
		ドイツ	4,705	2,969
		スペイン	2,717	1,872
イタリア		4,114	2,597	
フィンランド		330	133	
オーストリア	681	608		

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2023年5月23日～2023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	583,684	US TREASURY	1,489,814
US TREASURY	513,310	US TREASURY	997,560
US TREASURY	465,255	US TREASURY	566,698
US TREASURY	443,347	US TREASURY	285,027
US TREASURY	431,366	US TREASURY	266,439
US TREASURY	410,156	US TREASURY	226,269
US TREASURY	381,800	FRANCE (GOVT OF)	118,720
CHINA GOVERNMENT BOND	354,137	CHINA GOVERNMENT BOND	115,046
US TREASURY	334,300	US TREASURY	100,990
US TREASURY	316,543	US TREASURY	91,027

(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

2023年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	261,780	227,170	34,064,156	47.2	—	19.2	17.6	10.4
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	14,150	12,794	1,397,794	1.9	—	1.0	0.4	0.5
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア	12,140	10,689	1,042,944	1.4	—	1.0	0.3	0.1
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	2,890	2,782	310,487	0.4	—	0.3	0.1	0.1
	千ニューージーランド・ドル	千ニューージーランド・ドル						
ニューージーランド	2,140	1,849	166,401	0.2	—	0.1	0.1	0.0
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	23,780	19,415	3,624,647	5.0	—	3.6	0.9	0.6
	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル						
イスラエル	6,010	5,511	222,259	0.3	—	0.1	0.1	0.1

## 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 11,260	千デンマーク・クローネ 10,387	千円 227,799	% 0.3	% -	% 0.2	% 0.0	% 0.1	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 9,770	千ノルウェー・クローネ 9,006	124,924	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 10,890	千スウェーデン・クローナ 10,268	146,325	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 82,270	千メキシコ・ペソ 75,107	653,762	0.9	-	0.5	0.3	0.1	
中国	千人民元 241,970	千人民元 243,949	5,063,949	7.0	-	3.1	2.8	1.2	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 11,450	千マレーシア・リンギット 11,601	371,431	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 10,660	千ポーランド・ズロチ 9,821	366,007	0.5	-	0.2	0.3	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
	アイルランド	2,930	2,530	413,911	0.6	-	0.4	0.1	0.1
	オランダ	7,360	6,591	1,078,018	1.5	-	0.9	0.5	0.1
	ベルギー	8,590	7,693	1,258,182	1.7	-	1.2	0.5	0.1
	フランス	40,920	36,907	6,035,786	8.4	-	5.0	2.4	0.9
	ドイツ	30,720	28,173	4,607,563	6.4	-	3.4	2.1	0.9
	スペイン	23,770	21,775	3,561,212	4.9	-	2.8	1.5	0.7
	イタリア	35,540	32,922	5,384,213	7.5	-	4.1	2.3	1.1
	フィンランド	2,670	2,269	371,179	0.5	-	0.3	0.2	0.1
	オーストリア	5,890	5,150	842,327	1.2	-	0.7	0.4	0.1
合計	-	-	71,335,288	98.9	-	48.6	33.1	17.2	

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

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

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

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



## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/02/15	100	102	15,354
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	120	126	19,012
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	120	123	18,587
	US TREASURY	5.3750	2031/02/15	180	190	28,531
	US TREASURY	2.2500	2024/11/15	7,280	7,069	1,060,033
	US TREASURY	2.2500	2024/12/31	3,320	3,213	481,848
	US TREASURY	2.0000	2025/02/15	8,420	8,100	1,214,727
	US TREASURY	2.6250	2025/03/31	2,870	2,776	416,266
	US TREASURY	2.1250	2025/05/15	7,710	7,386	1,107,603
	US TREASURY	2.7500	2025/06/30	4,920	4,749	712,131
	US TREASURY	2.0000	2025/08/15	5,760	5,476	821,165
	US TREASURY	3.5000	2025/09/15	2,590	2,524	378,583
	US TREASURY	3.0000	2025/09/30	1,050	1,013	152,040
	US TREASURY	2.2500	2025/11/15	7,890	7,498	1,124,447
	US TREASURY	2.6250	2025/12/31	1,900	1,816	272,317
	US TREASURY	1.6250	2026/02/15	7,490	6,991	1,048,359
	US TREASURY	2.2500	2026/03/31	2,580	2,436	365,411
	US TREASURY	1.6250	2026/05/15	6,880	6,382	957,098
	US TREASURY	1.8750	2026/06/30	2,140	1,993	298,966
	US TREASURY	1.5000	2026/08/15	6,890	6,331	949,366
	US TREASURY	0.7500	2026/08/31	1,360	1,222	183,306
	US TREASURY	1.6250	2026/09/30	1,260	1,159	173,880
	US TREASURY	2.0000	2026/11/15	4,160	3,855	578,174
	US TREASURY	1.7500	2026/12/31	2,130	1,955	293,203
	US TREASURY	2.2500	2027/02/15	3,590	3,339	500,718
	US TREASURY	0.6250	2027/03/31	2,070	1,817	272,493
	US TREASURY	2.3750	2027/05/15	4,460	4,146	621,721
	US TREASURY	0.5000	2027/06/30	2,170	1,879	281,831
	US TREASURY	2.2500	2027/08/15	5,270	4,858	728,463
	US TREASURY	0.3750	2027/09/30	1,460	1,246	186,924
	US TREASURY	2.2500	2027/11/15	6,090	5,587	837,856
	US TREASURY	0.6250	2027/12/31	1,170	1,000	150,028
	US TREASURY	2.7500	2028/02/15	5,640	5,259	788,657
	US TREASURY	1.1250	2028/02/29	1,240	1,078	161,691
	US TREASURY	1.2500	2028/03/31	1,150	1,002	150,381
	US TREASURY	1.2500	2028/04/30	1,390	1,209	181,382
	US TREASURY	2.8750	2028/05/15	5,770	5,390	808,358

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千米ドル	千円
アメリカ	%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券					
US TREASURY	1.2500	2028/05/31	900	781	117,151
US TREASURY	2.8750	2028/08/15	6,900	6,426	963,677
US TREASURY	1.1250	2028/08/31	1,720	1,473	220,918
US TREASURY	1.3750	2028/10/31	1,940	1,674	251,107
US TREASURY	3.1250	2028/11/15	2,330	2,188	328,228
US TREASURY	1.5000	2028/11/30	1,520	1,317	197,553
US TREASURY	2.6250	2029/02/15	4,740	4,329	649,154
US TREASURY	2.3750	2029/05/15	4,050	3,636	545,237
US TREASURY	1.6250	2029/08/15	3,630	3,118	467,580
US TREASURY	1.7500	2029/11/15	3,200	2,754	413,017
US TREASURY	1.5000	2030/02/15	3,790	3,182	477,176
US TREASURY	0.6250	2030/08/15	4,980	3,875	581,091
US TREASURY	0.8750	2030/11/15	2,420	1,907	286,090
US TREASURY	1.1250	2031/02/15	2,330	1,862	279,258
US TREASURY	1.6250	2031/05/15	2,250	1,849	277,379
US TREASURY	1.2500	2031/08/15	2,520	1,997	299,465
US TREASURY	1.3750	2031/11/15	2,390	1,899	284,855
US TREASURY	1.8750	2032/02/15	2,330	1,917	287,490
US TREASURY	2.8750	2032/05/15	2,260	2,006	300,867
US TREASURY	2.7500	2032/08/15	2,190	1,918	287,725
US TREASURY	4.1250	2032/11/15	2,200	2,143	321,395
US TREASURY	3.5000	2033/02/15	2,190	2,031	304,555
US TREASURY	3.3750	2033/05/15	2,210	2,026	303,841
US TREASURY	3.8750	2033/08/15	2,100	2,004	300,526
US TREASURY	4.5000	2036/02/15	180	181	27,208
US TREASURY	5.0000	2037/05/15	140	147	22,067
US TREASURY	4.3750	2038/02/15	150	147	22,075
US TREASURY	4.5000	2038/05/15	170	168	25,276
US TREASURY	3.5000	2039/02/15	170	148	22,337
US TREASURY	4.2500	2039/05/15	270	257	38,672
US TREASURY	4.5000	2039/08/15	280	274	41,201
US TREASURY	4.3750	2039/11/15	300	289	43,429
US TREASURY	4.6250	2040/02/15	300	297	44,659
US TREASURY	1.1250	2040/05/15	890	520	78,080
US TREASURY	1.1250	2040/08/15	1,090	632	94,791
US TREASURY	3.8750	2040/08/15	290	261	39,167
US TREASURY	1.3750	2040/11/15	1,210	731	109,705
US TREASURY	4.2500	2040/11/15	280	264	39,601

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千米ドル	千円
アメリカ	%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券					
US TREASURY	1.8750	2041/02/15	1,480	974	146,104
US TREASURY	4.7500	2041/02/15	300	300	45,093
US TREASURY	2.2500	2041/05/15	1,260	881	132,159
US TREASURY	1.7500	2041/08/15	1,670	1,061	159,227
US TREASURY	2.0000	2041/11/15	1,390	920	138,068
US TREASURY	3.1250	2041/11/15	300	240	36,037
US TREASURY	2.3750	2042/02/15	1,140	803	120,413
US TREASURY	3.1250	2042/02/15	310	247	37,132
US TREASURY	3.0000	2042/05/15	290	226	33,919
US TREASURY	3.2500	2042/05/15	1,000	808	121,272
US TREASURY	2.7500	2042/08/15	330	246	36,946
US TREASURY	3.3750	2042/08/15	870	715	107,263
US TREASURY	2.7500	2042/11/15	500	372	55,797
US TREASURY	4.0000	2042/11/15	880	791	118,707
US TREASURY	3.1250	2043/02/15	420	330	49,622
US TREASURY	3.8750	2043/02/15	870	767	115,086
US TREASURY	2.8750	2043/05/15	670	505	75,792
US TREASURY	3.8750	2043/05/15	860	758	113,662
US TREASURY	3.6250	2043/08/15	480	407	61,038
US TREASURY	4.3750	2043/08/15	580	548	82,214
US TREASURY	3.7500	2043/11/15	490	422	63,380
US TREASURY	3.6250	2044/02/15	530	447	67,167
US TREASURY	3.3750	2044/05/15	480	389	58,373
US TREASURY	3.1250	2044/08/15	610	473	71,045
US TREASURY	3.0000	2044/11/15	540	409	61,440
US TREASURY	2.5000	2045/02/15	700	483	72,552
US TREASURY	3.0000	2045/05/15	360	271	40,779
US TREASURY	2.8750	2045/08/15	480	353	53,028
US TREASURY	3.0000	2045/11/15	280	210	31,584
US TREASURY	2.5000	2046/02/15	580	395	59,370
US TREASURY	2.5000	2046/05/15	590	401	60,218
US TREASURY	2.2500	2046/08/15	710	457	68,661
US TREASURY	2.8750	2046/11/15	330	240	36,115
US TREASURY	3.0000	2047/02/15	650	484	72,643
US TREASURY	3.0000	2047/05/15	500	372	55,818
US TREASURY	2.7500	2047/08/15	690	488	73,282
US TREASURY	2.7500	2047/11/15	730	516	77,479
US TREASURY	3.0000	2048/02/15	820	608	91,219

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	3.1250	2048/05/15	870	660	99,038
	US TREASURY	3.0000	2048/08/15	940	696	104,420
	US TREASURY	3.3750	2048/11/15	990	786	117,970
	US TREASURY	3.0000	2049/02/15	1,050	777	116,583
	US TREASURY	2.8750	2049/05/15	1,000	722	108,385
	US TREASURY	2.2500	2049/08/15	970	612	91,872
	US TREASURY	2.3750	2049/11/15	910	591	88,679
	US TREASURY	2.0000	2050/02/15	1,130	671	100,666
	US TREASURY	1.3750	2050/08/15	1,450	722	108,354
	US TREASURY	1.6250	2050/11/15	1,470	786	117,901
	US TREASURY	1.8750	2051/02/15	1,610	920	137,976
	US TREASURY	2.3750	2051/05/15	1,660	1,072	160,832
	US TREASURY	2.0000	2051/08/15	1,600	941	141,156
	US TREASURY	1.8750	2051/11/15	1,530	870	130,457
	US TREASURY	2.2500	2052/02/15	1,400	876	131,369
	US TREASURY	2.8750	2052/05/15	1,330	960	144,018
	US TREASURY	3.0000	2052/08/15	1,260	934	140,159
	US TREASURY	4.0000	2052/11/15	1,290	1,161	174,128
	US TREASURY	3.6250	2053/02/15	1,260	1,059	158,809
	US TREASURY	3.6250	2053/05/15	1,260	1,059	158,913
	US TREASURY	4.1250	2053/08/15	1,130	1,041	156,125
	US TREASURY	6.2500	2030/05/15	150	164	24,666
	US TREASURY	0.6250	2030/05/15	4,270	3,350	502,445
	US TREASURY	4.3750	2040/05/15	290	278	41,810
US TREASURY	4.3750	2041/05/15	280	267	40,135	
US TREASURY	3.7500	2041/08/15	280	246	36,926	
US TREASURY	1.2500	2050/05/15	1,330	640	96,077	
小計		-	-	-	-	34,064,156
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	3.0000	2024/11/01	320	314	34,356
	CANADIAN GOVERNMENT	3.7500	2025/02/01	320	316	34,533
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2025/03/01	190	181	19,875
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2025/04/01	270	258	28,261
	CANADIAN GOVERNMENT	3.7500	2025/05/01	340	335	36,663
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2025/06/01	250	241	26,375
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2025/08/01	420	412	45,077
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2025/09/01	610	568	62,128
	CANADIAN GOVERNMENT	3.0000	2025/10/01	230	223	24,453

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千カナダ・ドル	千円
カナダ		%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	4.5000	2025/11/01	370	370	40,437
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2026/03/01	400	365	39,896
	CANADIAN GOVERNMENT	3.0000	2026/04/01	220	213	23,333
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/06/01	170	159	17,381
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2026/09/01	390	358	39,113
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2027/03/01	360	329	35,983
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2027/06/01	170	153	16,806
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/09/01	350	335	36,625
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2028/03/01	320	315	34,421
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/06/01	150	138	15,183
	CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2028/09/01	440	428	46,862
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2029/03/01	70	70	7,719
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/06/01	140	129	14,183
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2029/06/01	170	186	20,417
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/12/01	110	101	11,083
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2030/06/01	720	616	67,348
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2030/12/01	620	496	54,236
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/06/01	780	666	72,790
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/12/01	650	550	60,126
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2032/06/01	540	472	51,615
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2032/12/01	460	417	45,582
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2033/06/01	420	388	42,405
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/06/01	190	220	24,116
	CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2033/12/01	340	327	35,802
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/06/01	120	135	14,857
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/06/01	180	188	20,547
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/01	220	216	23,683
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/01	240	208	22,777
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2051/12/01	880	641	70,113
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2053/12/01	690	466	51,017
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2055/12/01	170	144	15,813
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2064/12/01	150	126	13,782
小計		-	-	-	-	1,397,794
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	2024/11/21	600	576	56,238
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/04/21	450	443	43,311
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.2500	2025/11/21	440	407	39,740
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/04/21	450	451	44,065

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	
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	0.5000	2026/09/21	550	497	48,558
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	490	500	48,812
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	400	380	37,104
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	350	323	31,556
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	320	300	29,276
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	440	420	41,017
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2029/11/21	410	378	36,913
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5000	2030/05/21	510	459	44,811
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2030/12/21	440	351	34,318
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/06/21	540	441	43,052
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2031/11/21	690	533	52,070
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.2500	2032/05/21	640	497	48,554
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2032/11/21	600	481	46,941
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	530	532	51,912
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2033/11/21	500	441	43,064
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2034/05/21	420	394	38,509
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.5000	2034/12/21	360	328	32,098
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	300	252	24,638
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/04/21	270	247	24,123
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	230	193	18,891
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2041/05/21	320	244	23,810	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	310	231	22,561	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2051/06/21	430	230	22,447	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2054/06/21	150	149	14,540	
小計			-	-	-	1,042,944
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	2.3750	2025/06/01	220	216	24,135
	SINGAPORE GOVERNMENT	0.5000	2025/11/01	170	161	17,964
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/06/01	160	155	17,387
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.2500	2026/11/01	130	123	13,742
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	210	212	23,741
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2027/09/01	70	69	7,794
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2028/05/01	140	138	15,408
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2028/08/01	60	59	6,672
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	160	159	17,785
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	200	198	22,175
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.6250	2031/07/01	120	109	12,170
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2032/08/01	120	116	13,040

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千シンガポール・ドル	千円
シンガポール		%		千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	200	206	23,089
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	180	166	18,556
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2039/07/01	120	111	12,402
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	120	116	13,001
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	160	153	17,155
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2050/03/01	140	112	12,495
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2051/10/01	100	80	9,004
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2072/08/01	110	114	12,763
	小計		-	-	-	-
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	2.7500	2025/04/15	240	232	20,903
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	0.5000	2026/05/15	290	261	23,480
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5000	2027/04/15	80	79	7,145
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	0.2500	2028/05/15	140	115	10,346
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.0000	2029/04/20	250	229	20,657
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5000	2030/05/15	110	108	9,746
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.5000	2031/05/15	140	111	9,993
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.0000	2032/05/15	180	144	13,019
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.5000	2033/04/14	270	242	21,786
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.2500	2034/05/15	90	85	7,657
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2037/04/15	130	100	9,080
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.7500	2041/05/15	100	61	5,504
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2051/05/15	120	78	7,078
	小計		-	-	-	-
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	0.2500	2025/01/31	680	645	120,507
	UK TREASURY	5.0000	2025/03/07	390	391	73,144
	UK TREASURY	0.6250	2025/06/07	340	320	59,892
	UK TREASURY	2.0000	2025/09/07	310	296	55,431
	UK TREASURY	3.5000	2025/10/22	650	637	119,061
	UK TREASURY	0.1250	2026/01/30	340	311	58,132
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	360	335	62,716
	UK TREASURY	0.3750	2026/10/22	590	528	98,730
	UK TREASURY	4.1250	2027/01/29	710	707	132,172
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	330	298	55,795
	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	330	332	62,027
	UK TREASURY	0.1250	2028/01/31	340	289	54,014
	UK TREASURY	4.5000	2028/06/07	290	294	55,018

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千円	千円
イギリス	%		千円	千円	千円
国債証券					
UK TREASURY	1.6250	2028/10/22	320	286	53,567
UK TREASURY	6.0000	2028/12/07	260	283	52,898
UK TREASURY	0.5000	2029/01/31	600	502	93,735
UK TREASURY	0.8750	2029/10/22	340	285	53,270
UK TREASURY	0.3750	2030/10/22	400	313	58,605
UK TREASURY	4.7500	2030/12/07	450	471	88,008
UK TREASURY	0.2500	2031/07/31	610	459	85,775
UK TREASURY	1.0000	2032/01/31	780	615	114,975
UK TREASURY	4.2500	2032/06/07	480	488	91,173
UK TREASURY	3.2500	2033/01/31	740	692	129,234
UK TREASURY	0.8750	2033/07/31	490	363	67,906
UK TREASURY	4.6250	2034/01/31	80	82	15,478
UK TREASURY	4.5000	2034/09/07	310	317	59,361
UK TREASURY	0.6250	2035/07/31	470	313	58,600
UK TREASURY	4.2500	2036/03/07	370	369	68,950
UK TREASURY	1.7500	2037/09/07	480	350	65,452
UK TREASURY	3.7500	2038/01/29	420	390	72,859
UK TREASURY	4.7500	2038/12/07	330	342	63,867
UK TREASURY	1.1250	2039/01/31	510	324	60,577
UK TREASURY	4.2500	2039/09/07	290	283	52,884
UK TREASURY	4.2500	2040/12/07	330	320	59,885
UK TREASURY	1.2500	2041/10/22	550	332	61,997
UK TREASURY	4.5000	2042/12/07	410	409	76,365
UK TREASURY	3.2500	2044/01/22	470	389	72,775
UK TREASURY	3.5000	2045/01/22	450	385	71,980
UK TREASURY	0.8750	2046/01/31	370	181	33,924
UK TREASURY	4.2500	2046/12/07	380	363	67,824
UK TREASURY	1.5000	2047/07/22	420	236	44,085
UK TREASURY	1.7500	2049/01/22	260	152	28,435
UK TREASURY	4.2500	2049/12/07	300	286	53,437
UK TREASURY	0.6250	2050/10/22	380	152	28,387
UK TREASURY	1.2500	2051/07/31	590	288	53,806
UK TREASURY	3.7500	2052/07/22	290	254	47,425
UK TREASURY	1.5000	2053/07/31	370	189	35,318
UK TREASURY	3.7500	2053/10/22	480	418	78,105
UK TREASURY	1.6250	2054/10/22	310	162	30,355
UK TREASURY	4.2500	2055/12/07	380	363	67,939
UK TREASURY	1.7500	2057/07/22	420	225	42,011



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
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	4.0000	2060/01/22	300	276	51,676
	UK TREASURY	0.5000	2061/10/22	470	141	26,424
	UK TREASURY	4.0000	2063/10/22	230	211	39,490
	UK TREASURY	2.5000	2065/07/22	350	225	42,118
	UK TREASURY	3.5000	2068/07/22	350	291	54,459
	UK TREASURY	1.6250	2071/10/22	310	146	27,304
	UK TREASURY	1.1250	2073/10/22	220	81	15,279
	小計		-	-	-	-
イスラエル				千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	0.4000	2024/10/31	300	290	11,719
	ISRAEL FIXED BOND	0.5000	2025/04/30	520	497	20,044
	ISRAEL FIXED BOND	1.7500	2025/08/31	630	609	24,576
	ISRAEL FIXED BOND	0.5000	2026/02/27	420	390	15,755
	ISRAEL FIXED BOND	6.2500	2026/10/30	330	352	14,212
	ISRAEL FIXED BOND	2.0000	2027/03/31	560	534	21,574
	ISRAEL FIXED BOND	2.2500	2028/09/28	520	482	19,454
	ISRAEL FIXED BOND	3.7500	2029/02/28	180	181	7,327
	ISRAEL FIXED BOND	1.0000	2030/03/31	530	442	17,831
	ISRAEL FIXED BOND	1.3000	2032/04/30	360	288	11,615
	ISRAEL FIXED BOND	1.5000	2037/05/31	480	333	13,460
	ISRAEL FIXED BOND	5.5000	2042/01/31	430	489	19,733
	ISRAEL FIXED BOND	3.7500	2047/03/31	560	486	19,604
	ISRAEL FIXED BOND	2.8000	2052/11/29	190	132	5,350
小計		-	-	-	-	222,259
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	0.0000	2024/11/15	1,400	1,355	29,717
	KINGDOM OF DENMARK	1.7500	2025/11/15	1,370	1,338	29,348
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2027/11/15	1,450	1,333	29,244
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2029/11/15	1,250	1,102	24,172
	KINGDOM OF DENMARK	0.0000	2031/11/15	1,550	1,251	27,439
	KINGDOM OF DENMARK	2.2500	2033/11/15	640	608	13,340
	KINGDOM OF DENMARK	4.5000	2039/11/15	2,330	2,778	60,925
	KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2052/11/15	1,270	620	13,610
小計		-	-	-	-	227,799
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	1.7500	2025/03/13	1,350	1,310	18,175
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/02/19	1,070	1,015	14,089
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2027/02/17	1,060	994	13,797

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	
ノルウェー		%		千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/04/26	850	792	10,986	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2029/09/06	940	848	11,770	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.3750	2030/08/19	1,240	1,074	14,901	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.2500	2031/09/17	880	739	10,252	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.1250	2032/05/18	920	819	11,360	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0000	2033/08/15	1,020	965	13,394	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.5000	2042/10/06	440	446	6,197	
小計		-	-	-	-	124,924	
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	2.5000	2025/05/12	1,780	1,758	25,055	
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0000	2026/11/12	1,850	1,752	24,967	
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2028/05/12	1,610	1,480	21,091	
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2029/11/12	1,530	1,373	19,575	
	SWEDISH GOVERNMENT	0.1250	2031/05/12	1,220	1,016	14,482	
	SWEDISH GOVERNMENT	2.2500	2032/06/01	1,110	1,077	15,348	
	SWEDISH GOVERNMENT	1.7500	2033/11/11	830	765	10,910	
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	960	1,045	14,894	
小計		-	-	-	-	146,325	
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	10.0000	2024/12/05	4,840	4,801	41,794	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0000	2025/03/06	3,200	3,006	26,170	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	9,850	9,047	78,754	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.0000	2026/09/03	2,000	1,872	16,303	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5000	2027/03/04	8,020	7,122	61,997	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	7,620	7,158	62,313	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/03/01	1,050	1,016	8,846	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	6,240	6,023	52,433	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	9,310	8,503	74,020	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2033/05/26	4,950	4,363	37,979	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	2,120	1,883	16,392	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2035/05/24	600	542	4,720	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	1,650	1,721	14,983	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	4,810	4,418	38,463	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	6,670	5,632	49,023	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	5,840	5,007	43,589	
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2053/07/31	3,500	2,984	25,974		
小計		-	-	-	-	653,762	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千人民元	邦貨換算金額
中国	%		千人民元	千人民元	千円
国債証券					
CHINA GOVERNMENT BOND	2.2900	2024/12/25	14,000	14,001	290,638
CHINA GOVERNMENT BOND	2.3500	2025/03/15	3,000	3,000	62,281
CHINA GOVERNMENT BOND	2.2400	2025/05/25	5,500	5,489	113,946
CHINA GOVERNMENT BOND	2.0000	2025/06/15	6,000	5,969	123,907
CHINA GOVERNMENT BOND	2.1800	2025/08/25	8,300	8,280	171,886
CHINA GOVERNMENT BOND	2.2200	2025/09/25	4,000	3,992	82,877
CHINA GOVERNMENT BOND	2.2800	2025/11/25	7,500	7,487	155,418
CHINA GOVERNMENT BOND	2.4600	2026/02/15	7,000	7,014	145,612
CHINA GOVERNMENT BOND	3.0300	2026/03/11	1,200	1,221	25,353
CHINA GOVERNMENT BOND	2.3000	2026/05/15	17,600	17,587	365,081
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6900	2026/08/12	4,400	4,437	92,112
CHINA GOVERNMENT BOND	2.1800	2026/08/15	1,500	1,491	30,966
CHINA GOVERNMENT BOND	2.3700	2027/01/20	3,200	3,196	66,345
CHINA GOVERNMENT BOND	2.4800	2027/04/15	6,700	6,703	139,159
CHINA GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	4,800	4,807	99,791
CHINA GOVERNMENT BOND	2.4400	2027/10/15	10,300	10,287	213,546
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6400	2028/01/15	4,400	4,432	92,017
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6200	2028/04/15	10,200	10,261	213,008
CHINA GOVERNMENT BOND	3.0100	2028/05/13	720	737	15,300
CHINA GOVERNMENT BOND	2.4000	2028/07/15	11,300	11,255	233,650
CHINA GOVERNMENT BOND	2.9100	2028/10/14	5,400	5,498	114,132
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8000	2029/03/24	3,600	3,646	75,685
CHINA GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/06/15	4,500	4,535	94,158
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6200	2029/09/25	5,300	5,302	110,064
CHINA GOVERNMENT BOND	2.7900	2029/12/15	6,900	6,964	144,562
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8000	2030/03/25	8,400	8,480	176,046
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6200	2030/06/25	7,400	7,394	153,486
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6000	2030/09/15	4,000	3,989	82,823
CHINA GOVERNMENT BOND	3.0200	2031/05/27	1,000	1,028	21,354
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8900	2031/11/18	3,340	3,394	70,463
CHINA GOVERNMENT BOND	2.7500	2032/02/17	2,600	2,613	54,260
CHINA GOVERNMENT BOND	2.7600	2032/05/15	4,100	4,130	85,743
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6900	2032/08/15	1,000	1,001	20,793
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6000	2032/09/01	3,500	3,477	72,192
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8000	2032/11/15	5,700	5,763	119,641
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8800	2033/02/25	4,100	4,186	86,912
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6700	2033/05/25	7,900	7,899	163,983
CHINA GOVERNMENT BOND	2.5200	2033/08/25	6,400	6,334	131,485

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千人民元	千円
中国		%		千人民元	千人民元	千円
国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.8100	2050/09/14	1,200	1,372	28,486
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.7200	2051/04/12	1,260	1,419	29,469
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.5300	2051/10/18	3,650	4,006	83,162
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.3200	2052/04/15	5,400	5,704	118,408
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.1200	2052/10/25	5,800	5,887	122,208
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.1900	2053/04/15	7,900	8,262	171,521
小計		-	-	-	-	5,063,949
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	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8820	2025/03/14	340	342	10,960
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/09/15	680	685	21,947
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/04/15	360	366	11,742
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9060	2026/07/15	250	252	8,083
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9000	2026/11/30	370	373	11,943
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/03/15	610	615	19,705
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8990	2027/11/16	530	535	17,133
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/06/15	550	550	17,615
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.5040	2029/04/30	160	165	5,283
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8850	2029/08/15	440	440	14,109
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/04/15	490	507	16,250
	MALAYSIA GOVERNMENT	2.6320	2031/04/15	340	312	9,995
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	380	387	12,399
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.5820	2032/07/15	390	379	12,138
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	410	408	13,065
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.6420	2033/11/07	340	361	11,583
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8280	2034/07/05	460	451	14,470
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/05/31	320	326	10,447
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	590	630	20,198
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.8930	2038/06/08	500	545	17,480
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7570	2040/05/22	540	507	16,259
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.6960	2042/10/15	420	445	14,255
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	190	206	6,603
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	240	252	8,078
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9210	2048/07/06	360	389	12,460
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.0650	2050/06/15	610	579	18,555
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4570	2053/03/31	240	244	7,825
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.5020	2027/05/31	340	338	10,840
小計		-	-	-	-	371,431

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	
						千ポランド・ズチ	千ポランド・ズチ
ポーランド		%		千ポランド・ズチ	千ポランド・ズチ	千円	
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	0.7500	2025/04/25	770	723	26,960	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	1,030	997	37,162	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	1,200	1,120	41,767	
	POLAND GOVERNMENT BOND	0.2500	2026/10/25	730	634	23,642	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.7500	2027/05/25	730	696	25,973	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	710	647	24,123	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	820	741	27,639	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7.5000	2028/07/25	930	1,013	37,755	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/04/25	570	581	21,660	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/10/25	1,040	911	33,983	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.2500	2030/10/25	880	680	25,371	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.7500	2032/04/25	800	604	22,532	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6.0000	2033/10/25	450	467	17,434	
	小計		-	-	-	-	366,007
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド							
国債証券	IRELAND GOVERNMENT BOND	5.4000	2025/03/13	250	257	42,057	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/05/15	250	238	39,011	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.2000	2027/05/15	170	155	25,389	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.9000	2028/05/15	180	165	27,101	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.1000	2029/05/15	210	191	31,343	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	2.4000	2030/05/15	210	203	33,346	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.2000	2030/10/18	180	149	24,518	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3500	2031/03/18	150	134	22,071	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2031/10/18	200	159	26,077	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3000	2033/05/15	120	103	16,905	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.4000	2035/05/15	120	88	14,550	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.7000	2037/05/15	170	140	23,046	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.5500	2041/04/22	90	56	9,320	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	3.0000	2043/10/18	80	76	12,558	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	2.0000	2045/02/18	240	187	30,657	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2050/05/15	200	132	21,596	
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.3500	2032/10/18	110	87	14,358	
	小計		-	-	-	-	413,911
オランダ							
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2025/07/15	440	420	68,705	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2026/01/15	300	281	46,069	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2026/07/15	420	394	64,586	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
オランダ						
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2027/01/15	350	320	52,487
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2027/07/15	370	344	56,339
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/01/15	290	320	52,437
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2028/07/15	430	393	64,299
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2029/01/15	270	234	38,414
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2029/07/15	270	235	38,480
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2030/01/15	170	167	27,371
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2030/07/15	310	258	42,316
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2031/07/15	330	267	43,711
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2032/07/15	300	246	40,351
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/01/15	350	340	55,633
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/07/15	250	241	39,497
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/01/15	390	430	70,394
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2038/01/15	230	149	24,510
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2040/01/15	350	237	38,829
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/01/15	410	448	73,345
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.2500	2044/01/15	100	103	16,844
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/01/15	450	429	70,276
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2052/01/15	390	172	28,257
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2054/01/15	190	152	24,858
小計		-	-	-	-	1,078,018
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/06/22	490	472	77,232
	BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/03/28	270	279	45,655
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/06/22	350	333	54,505
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2027/06/22	360	335	54,813
	BELGIUM KINGDOM	0.0000	2027/10/22	240	214	35,153
	BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	460	510	83,443
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2028/06/22	380	347	56,828
	BELGIUM KINGDOM	0.9000	2029/06/22	420	378	61,822
	BELGIUM KINGDOM	0.1000	2030/06/22	310	257	42,191
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/06/22	380	328	53,701
	BELGIUM KINGDOM	0.0000	2031/10/22	310	244	39,919
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/03/28	200	213	34,918
	BELGIUM KINGDOM	0.3500	2032/06/22	360	285	46,730
	BELGIUM KINGDOM	1.2500	2033/04/22	240	203	33,320
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2033/06/22	390	384	62,803

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/06/22	210	205	33,592
	BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	440	509	83,244
	BELGIUM KINGDOM	1.4500	2037/06/22	150	118	19,304
	BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/06/22	190	155	25,471
	BELGIUM KINGDOM	2.7500	2039/04/22	120	109	17,844
	BELGIUM KINGDOM	0.4000	2040/06/22	200	121	19,857
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/03/28	370	402	65,744
	BELGIUM KINGDOM	3.4500	2043/06/22	90	87	14,298
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/06/22	220	223	36,494
	BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/06/22	240	162	26,573
	BELGIUM KINGDOM	1.7000	2050/06/22	250	166	27,238
	BELGIUM KINGDOM	1.4000	2053/06/22	240	142	23,237
	BELGIUM KINGDOM	3.3000	2054/06/22	210	192	31,539
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2057/06/22	160	117	19,136
	BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/06/22	200	139	22,819
	BELGIUM KINGDOM	0.6500	2071/06/22	140	53	8,744
小計		-	-	-	-	1,258,182
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	800	786	128,581
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2025/02/25	700	671	109,881
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2025/03/25	1,070	1,025	167,654
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/05/25	1,020	980	160,341
	FRANCE (GOVT OF)	6.0000	2025/10/25	630	664	108,637
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	830	797	130,418
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2026/02/25	1,010	944	154,543
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/04/25	980	991	162,227
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/05/25	1,110	1,044	170,840
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2026/09/24	930	918	150,207
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	880	813	133,039
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2027/02/25	900	820	134,117
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2027/05/25	900	844	138,066
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	1,230	1,224	200,299
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/02/25	1,010	925	151,289
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/05/25	1,380	1,258	205,779
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/11/25	1,310	1,182	193,417
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2029/02/25	610	605	99,034
	FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/04/25	880	993	162,434

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2029/05/25	1,220	1,074	175,794
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2029/11/25	1,050	885	144,796
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/05/25	1,340	1,308	214,013
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2030/11/25	1,270	1,037	169,610
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/05/25	1,340	1,211	198,169
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2031/11/25	1,160	916	149,811
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2032/05/25	780	605	98,991
	FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	780	941	154,033
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2032/11/25	1,000	917	150,057
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2033/05/25	830	823	134,625
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2033/11/25	140	144	23,582
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2034/05/25	980	812	132,943
	FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/04/25	640	730	119,542
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/05/25	1,030	814	133,175
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2038/05/25	370	278	45,576
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	590	630	103,165
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2039/06/25	730	585	95,821
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2040/05/25	560	352	57,714
	FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/04/25	840	950	155,508
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2043/05/25	280	238	38,991
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2044/06/25	430	241	39,419
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/05/25	670	639	104,562
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2048/05/25	660	491	80,325
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2050/05/25	720	465	76,069
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2052/05/25	730	364	59,576
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2053/05/25	690	336	55,024
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2054/05/25	400	352	57,587
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/04/25	440	469	76,715
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/04/25	440	472	77,260
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/05/25	370	230	37,684
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2072/05/25	260	90	14,825
小計		-	-	-	-	6,035,786
ドイツ						
国債証券	BUNDESobligation	0.0000	2025/04/11	480	459	75,155
	BUNDESobligation	0.0000	2025/10/10	160	151	24,783
	BUNDESobligation	0.0000	2025/10/10	610	577	94,372
	BUNDESobligation	0.0000	2026/04/10	610	571	93,409



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ					
国債証券					
BUNDESobligation	0.0000	2026/10/09	530	490	80,240
BUNDESobligation	0.0000	2027/04/16	490	448	73,393
BUNDESobligation	1.3000	2027/10/15	190	181	29,677
BUNDESobligation	1.3000	2027/10/15	650	620	101,478
BUNDESobligation	2.2000	2028/04/13	550	542	88,675
BUNDESobligation	2.4000	2028/10/19	500	497	81,300
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/02/15	680	657	107,560
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	640	618	101,097
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	750	712	116,481
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	720	669	109,434
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	650	602	98,554
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2027/08/15	720	668	109,259
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2027/11/15	490	443	72,536
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2028/02/15	640	588	96,305
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2028/08/15	630	567	92,882
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2028/11/15	600	531	86,882
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2029/02/15	620	553	90,526
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2029/08/15	650	565	92,491
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.1000	2029/11/15	570	557	91,194
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/01/04	260	315	51,549
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/02/15	610	524	85,774
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	210	178	29,213
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	720	611	100,028
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.4000	2030/11/15	180	178	29,214
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/02/15	620	519	84,984
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/08/15	200	165	27,074
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/08/15	710	587	96,097
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2032/02/15	670	546	89,407
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7000	2032/08/15	620	580	94,942
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.3000	2033/02/15	140	137	22,449
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.3000	2033/02/15	850	833	136,235
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.6000	2033/08/15	480	480	78,605
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/07/04	540	645	105,497
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2035/05/15	500	369	60,360
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2036/05/15	570	407	66,656
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	610	693	113,353
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2038/05/15	450	354	58,006

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	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ						
国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	420	495	81,043
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	470	589	96,451
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	420	444	72,686
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	660	626	102,415
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	690	653	106,927
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	810	590	96,604
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	220	107	17,540
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	870	421	68,995
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2052/08/15	600	275	45,023
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8000	2053/08/15	100	80	13,118
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8000	2053/08/15	530	424	69,379
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.2000	2024/12/12	190	187	30,690
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.5000	2025/03/13	390	386	63,179
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.8000	2025/06/12	400	397	65,051
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	3.1000	2025/09/18	370	370	60,554
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	3.1000	2025/12/12	50	50	8,200
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	300	339	55,485
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	380	425	69,556
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	300	328	53,796
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	480	573	93,717
小計		-	-	-	-	4,607,563
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	510	505	82,735
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2025/01/31	480	460	75,378
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/04/30	490	477	78,122
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2025/05/31	530	503	82,370
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/07/30	430	439	71,833
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	600	588	96,217
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2026/01/31	470	438	71,697
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	510	495	81,001
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.8000	2026/05/31	480	475	77,709
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	530	566	92,582
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	620	588	96,179
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2027/01/31	480	434	71,051
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	570	539	88,257
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2027/07/30	510	468	76,647
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	560	525	85,895

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン					
国債証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2028/01/31	600	526	86,146
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/04/30	620	575	94,126
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/07/30	540	499	81,658
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	450	490	80,192
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/01/31	590	668	109,392
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2029/04/30	470	429	70,280
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.5000	2029/05/31	80	81	13,262
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2029/07/30	590	516	84,472
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6000	2029/10/31	540	464	75,930
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2030/04/30	550	463	75,763
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/07/30	530	488	79,884
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2500	2030/10/31	540	472	77,261
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.1000	2031/04/30	540	426	69,755
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2031/10/31	490	392	64,259
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7000	2032/04/30	520	417	68,280
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/07/30	540	633	103,593
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.5500	2032/10/31	500	464	76,032
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.1500	2033/04/30	540	523	85,609
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.3500	2033/07/30	440	397	65,025
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.5500	2033/10/31	480	478	78,258
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.8500	2035/07/30	490	404	66,173
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/01/31	500	520	85,104
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8500	2037/07/30	320	218	35,706
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.9000	2039/07/30	190	187	30,725
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/07/30	450	498	81,455
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2000	2040/10/31	440	289	47,289
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/07/30	470	510	83,539
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0000	2042/07/30	230	139	22,775
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2043/07/30	210	191	31,325
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	350	402	65,787
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	440	361	59,166
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7000	2048/10/31	400	311	50,972
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0000	2050/10/31	500	248	40,707
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9000	2052/10/31	370	228	37,414
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/07/30	320	268	43,965
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2071/10/31	170	74	12,236
小計	-	-	-	-	3,561,212

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	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	2024/11/15	360	352	57,649
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2024/12/01	500	494	80,875
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2024/12/15	350	337	55,113
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.3500	2025/02/01	460	442	72,404
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2025/03/01	480	488	79,861
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4000	2025/03/28	400	398	65,211
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2025/05/15	370	359	58,723
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2025/06/01	470	455	74,536
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8500	2025/07/01	410	399	65,291
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2000	2025/08/15	360	345	56,578
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.6000	2025/09/29	220	220	36,013
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2025/11/15	430	422	69,060
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/01	440	427	69,904
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2026/01/15	380	380	62,186
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5000	2026/02/01	460	431	70,510
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/03/01	460	469	76,833
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2026/04/01	480	442	72,355
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8000	2026/04/15	350	352	57,656
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6000	2026/06/01	500	477	78,087
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1000	2026/07/15	390	376	61,559
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2026/08/01	440	400	65,569
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2026/09/15	190	191	31,345
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2500	2026/12/01	460	430	70,440
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.8500	2027/01/15	440	405	66,328
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.1000	2027/04/01	320	295	48,374
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2000	2027/06/01	410	392	64,148
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0500	2027/08/01	430	408	66,755
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2027/09/15	480	435	71,302
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5000	2027/11/01	600	664	108,634
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.6500	2027/12/01	400	386	63,163
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2028/02/01	530	497	81,382
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.2500	2028/03/15	410	355	58,153
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4000	2028/04/01	400	396	64,858
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5000	2028/07/15	360	312	51,074
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8000	2028/08/01	370	372	60,851
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/09/01	550	576	94,277
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2028/12/01	500	480	78,565

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア					
国債証券					
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.1000	2029/02/01	100	101	16,623
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.4500	2029/02/15	360	304	49,813
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2029/06/15	350	333	54,465
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0000	2029/08/01	510	490	80,215
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/01	680	732	119,854
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2029/12/15	410	410	67,080
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/03/01	600	589	96,390
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2030/04/01	500	430	70,328
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7000	2030/06/15	310	306	50,091
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2030/08/01	420	347	56,850
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2030/11/15	120	120	19,677
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2030/12/01	520	447	73,154
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9000	2031/04/01	540	435	71,213
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/05/01	700	792	129,648
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6000	2031/08/01	470	365	59,750
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2031/10/30	220	219	35,947
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2031/12/01	460	363	59,493
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/03/01	550	458	74,952
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2032/06/01	460	357	58,463
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2032/12/01	400	351	57,470
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/02/01	540	605	98,958
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.4000	2033/05/01	470	477	78,152
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2033/09/01	440	378	61,949
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.3500	2033/11/01	440	443	72,540
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2000	2034/03/01	160	158	25,951
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/08/01	590	623	101,928
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.3500	2035/03/01	350	317	51,923
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2035/04/30	250	241	39,539
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2036/03/01	290	208	34,108
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/09/01	380	298	48,865
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/02/01	690	657	107,509
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2037/03/01	380	247	40,452
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2038/03/01	230	198	32,391
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.9500	2038/09/01	330	273	44,661
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/08/01	560	582	95,259
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1000	2040/03/01	320	264	43,204
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/09/01	510	529	86,618

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	1.8000	2041/03/01	340	226	37,035
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.4500	2043/09/01	200	192	31,507
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/09/01	410	411	67,283
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2045/04/30	300	174	28,507
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/09/01	390	313	51,210
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/03/01	420	305	49,946
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2048/03/01	400	329	53,940
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2049/09/01	340	296	48,515
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2050/09/01	320	213	34,948
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7000	2051/09/01	330	183	30,075
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2052/09/01	200	121	19,856
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2053/10/01	180	171	28,075
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/03/01	210	138	22,650
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2072/03/01	110	60	9,815
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/01	220	242	39,702
小計		-	-	-	-	5,384,213
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/07/04	100	101	16,554
	FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/09/15	140	134	22,012
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/04/15	140	132	21,638
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2026/09/15	90	82	13,567
	FINNISH GOVERNMENT	1.3750	2027/04/15	100	95	15,555
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2027/09/15	150	137	22,463
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/07/04	120	119	19,533
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2028/09/15	150	133	21,902
	FINNISH GOVERNMENT	2.8750	2029/04/15	70	69	11,427
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2029/09/15	150	130	21,423
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2030/09/15	130	106	17,415
	FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/04/15	110	93	15,358
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2031/09/15	140	112	18,326
	FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2032/09/15	130	114	18,707
	FINNISH GOVERNMENT	3.0000	2033/09/15	110	108	17,794
	FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2034/04/15	100	82	13,449
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2036/04/15	110	74	12,253
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2038/04/15	90	83	13,689
	FINNISH GOVERNMENT	0.2500	2040/09/15	90	54	8,925
	FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/07/04	120	108	17,700

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド						
国債証券						
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2043/04/15	100	59	9,736
	FINNISH GOVERNMENT	1.3750	2047/04/15	130	89	14,703
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2052/04/15	100	43	7,039
小計	-	-	-	-	-	371,179
オーストリア						
国債証券						
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2025/04/20	200	191	31,264
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2000	2025/10/20	290	280	45,806
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	190	197	32,321
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.0000	2026/07/15	130	126	20,741
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2026/10/20	330	309	50,691
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2027/04/20	320	295	48,291
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	210	234	38,269
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2028/02/20	280	256	41,921
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2028/10/20	180	156	25,535
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2029/02/20	300	264	43,327
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.9000	2029/05/23	70	69	11,447
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2030/02/20	300	249	40,787
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4500	2030/10/20	90	92	15,094
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2031/02/20	330	265	43,410
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.9000	2032/02/20	270	227	37,167
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.9000	2033/02/20	280	274	44,903
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/05/23	210	195	31,955
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.2500	2036/10/20	150	102	16,733
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	340	369	60,449
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2040/10/20	140	80	13,102
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/06/20	190	183	30,021
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/02/20	220	153	25,104
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.8500	2049/05/23	110	81	13,280
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2051/03/20	210	112	18,472
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2053/10/20	80	75	12,401
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/01/26	100	108	17,714
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7000	2071/04/20	80	32	5,378
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2086/11/02	60	33	5,397
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1000	2117/09/20	130	88	14,531
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.8500	2120/06/30	100	41	6,801
小計	-	-	-	-	-	842,327
ユーロ小計	-	-	-	-	-	23,552,394
合計	-	-	-	-	-	71,335,288

## 投資信託財産の構成

2023年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	71,335,288	98.5
コール・ローン等、その他	1,073,573	1.5
投資信託財産総額	72,408,861	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149.95円、1カナダ・ドル109.25円、1オーストラリア・ドル97.57円、1シンガポール・ドル111.57円、1ニュージーランド・ドル89.96円、1イギリス・ポンド186.69円、1イスラエル・シケル40.328円、1デンマーク・クローネ21.93円、1ノルウェー・クローネ13.87円、1スウェーデン・クローナ14.25円、1メキシコ・ペソ8,704円、1人民元20,758円、1マレーシア・リンギット32,015円、1ポーランド・ズロチ37,264円、1ユーロ163.54円です。

(注2) 外貨建純資産（72,065,479千円）の投資信託財産総額（72,408,861千円）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

(2023年11月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>72,444,606,071円</b>
コーポレート債(評価額)	605,236,430
未収入金	71,335,288,110
未収利息	36,295,942
前払費用	429,300,020
	38,485,569
<b>(B)負債</b>	<b>323,415,867</b>
未払金	177,113,599
未払解約金	146,301,983
その他未払費用	285
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>72,121,190,204</b>
元本	43,378,960,163
次期繰越損益金	28,742,230,041
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>43,378,960,163口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>16,626円</b>

(注1) 期首元本額	40,223,772,028円
期中追加設定元本額	6,712,335,044円
期中一部解約元本額	3,557,146,909円
(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパーファンド別内訳は、次の通りです。	
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	3,461,059,032円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,218,098,531円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,547,097,324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)	912,607,004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)	2,067,561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)	6,149,747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)	4,503,470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	15,831,877,263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)	5,727,201,586円
DCニッセイ外国債券インデックス	4,257,065,641円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	293,816,747円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,933,271,698円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	341,078,933円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	552,481,112円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	64,415,551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)	205,521,429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)	20,223,791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)	46,373,044円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	229,109,652円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	148,732,633円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	297,949,699円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	198,032,837円
FWニッセイ外国債券インデックス	37,526,371円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	42,699,507円

### 損益の状況

当期(2023年5月23日~2023年11月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>834,723,988円</b>
受取利息	834,786,873
その他収益金	1,295
支払利息	△ 64,180
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>4,471,632,159</b>
売買益	5,971,897,645
売買損	△ 1,500,265,486
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 12,212,316</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>5,294,143,831</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>21,597,154,622</b>
<b>(F)追加信託差損益金</b>	<b>3,985,363,819</b>
<b>(G)解約差損益金</b>	<b>△ 2,134,432,231</b>
<b>(H)合計(D+E+F+G)</b>	<b>28,742,230,041</b>
次期繰越損益金(H)	<b>28,742,230,041</b>

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

## 指数に関して

### ■ ファンドのベンチマーク等について

#### ・ T O P I X（東証株価指数）（配当込み）

T O P I X（東証株価指数）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

#### ・ 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。

#### ・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

#### ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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