

### <債券重視型>

| 第23期末 (2026年2月24日) |         |
|--------------------|---------|
| 基準価額               | 25,298円 |
| 純資産総額              | 399億円   |
| 騰落率                | 10.7%   |
| 分配金                | 0円      |

### <標準型>

| 第23期末 (2026年2月24日) |         |
|--------------------|---------|
| 基準価額               | 37,322円 |
| 純資産総額              | 1,053億円 |
| 騰落率                | 16.9%   |
| 分配金                | 0円      |

### <株式重視型>

| 第23期末 (2026年2月24日) |         |
|--------------------|---------|
| 基準価額               | 53,330円 |
| 純資産総額              | 772億円   |
| 騰落率                | 23.4%   |
| 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:2025年2月22日~2026年2月24日

第23期(決算日 2026年2月24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23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

2025年2月22日～2026年2月24日

## 基準価額等の推移



|       |         |                 |       |
|-------|---------|-----------------|-------|
| 第23期首 | 22,856円 | 既払分配金           | 0円    |
| 第23期末 | 25,298円 | 騰落率 (分配金再投資ベース) | 10.7% |

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

(注2) 分配金を再投資するかどうかに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;

- ・2025年4月下旬から10月下旬にかけて、海外主要中央銀行の利下げや好調な企業収益を背景に外国株式が上昇したこと
- ・10月に高市新政権による経済政策への期待感から、国内株式が上昇したこと
- ・6月下旬から10月下旬にかけて、主に為替市場において円安が進行したことなどを背景に、円貨ベースで外国債券が上昇したこと
- ・2026年2月に、衆院選で自民党が大勝し高市政権の積極財政への期待感が高まったことなどから、国内株式が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・期初から4月上旬にかけて、トランプ米政権の関税政策が市場の想定以上に厳しい内容であったことを受けて国内外で株価が急落したこと
- ・2026年1月中旬から下旬にかけて、衆院選に向けて与野党の多くが消費税減税を公約に掲げたことで、財政拡張への懸念が高まり、金利が大幅に上昇（債券価格は下落）したこと

| 組入マザーファンド             | 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% | 20.6% | 42.9% |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 45.0  | 45.0  | △ 4.1 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 10.0  | 9.7   | 20.6  |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 20.0  | 19.7  | 13.9  |
| 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23期 |         | 項目の概要   |
|------------|------|---------|---|
|            | 金額   | 比率      |   |
| 信託報酬       | 37円  | 0.155%  | $\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は23,653円です。</p>                     |
| (投信会社)     | (16) | (0.067) | 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)     | (16) | (0.067) | 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    | 0.000   |   |
| (株式)       | (0)  | (0.000) | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数   |
| (投資信託証券)   | (0)  | (0.000) | 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| その他費用      | 2    | 0.006   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数   |
| (保管費用)     | (1)  | (0.005) | 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用  |
| (監査費用)     | (0)  | (0.001) | 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         | 38   | 0.162   |   |

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

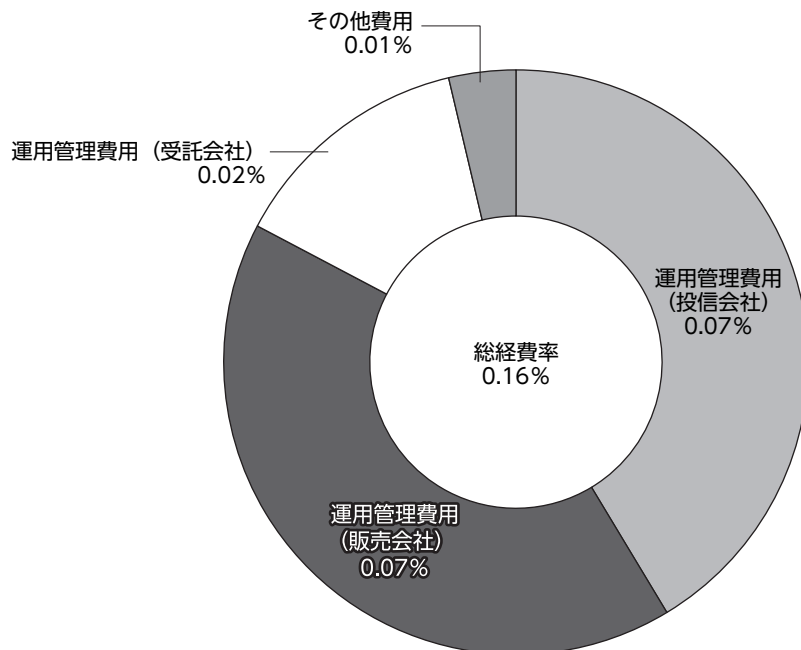
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## （参考情報）

## ■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.16%**です。



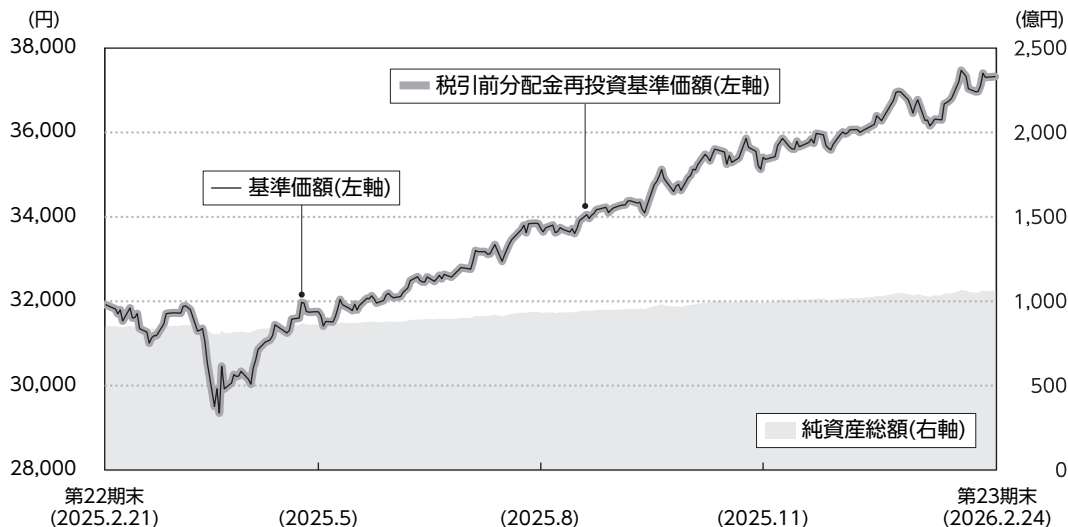
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

## 基準価額等の推移



|       |         |                 |       |
|-------|---------|-----------------|-------|
| 第23期首 | 31,913円 | 既払分配金           | 0円    |
| 第23期末 | 37,322円 | 騰落率 (分配金再投資ベース) | 16.9% |

(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;

- ・2025年4月下旬から10月下旬にかけて、海外主要中央銀行の利下げや好調な企業収益を背景に外国株式が上昇したこと
- ・10月に高市新政権による経済政策への期待感から、国内株式が上昇したこと
- ・6月下旬から10月下旬にかけて、主に為替市場において円安が進行したことなどを背景に、円貨ベースで外国債券が上昇したこと
- ・2026年2月に、衆院選で自民党が大勝し高市政権の積極財政への期待感が高まったことなどから、国内株式が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・期初から4月上旬にかけて、トランプ米政権の関税政策が市場の想定以上に厳しい内容であったことを受けて国内外で株価が急落したこと
- ・2026年1月中旬から下旬にかけて、衆院選に向けて与野党の多くが消費税減税を公約に掲げたことで、財政拡張への懸念が高まり、金利が大幅に上昇（債券価格は下落）したこと

| 組入マザーファンド             | 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% | 30.9% | 42.9% |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 30.0  | 29.9  | △ 4.1 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 20.0  | 19.5  | 20.6  |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 15.0  | 14.8  | 13.9  |
| 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23期 |         | 項目の概要   |
|------------|------|---------|---|
|            | 金額   | 比率      |   |
| 信託報酬       | 52円  | 0.155%  | $\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は33,697円です。</p>                     |
| (投信会社)     | (22) | (0.067) | ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価  |
| (販売会社)     | (22) | (0.067) | 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)     | ( 7) | (0.022) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価  |
| 売買委託手数料    | 0    | 0.000   |   |
| (株式)       | ( 0) | (0.000) | 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数   |
| (先物・オプション) | ( 0) | (0.000) | 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料  |
| (投資信託証券)   | ( 0) | (0.000) |   |
| 有価証券取引税    | 0    | 0.000   |   |
| (株式)       | ( 0) | (0.000) | 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数   |
| (投資信託証券)   | ( 0) | (0.000) | 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| その他費用      | 2    | 0.006   | その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数   |
| (保管費用)     | ( 2) | (0.005) | 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用  |
| (監査費用)     | ( 0) | (0.001) | 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         | 55   | 0.162   |   |

(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。

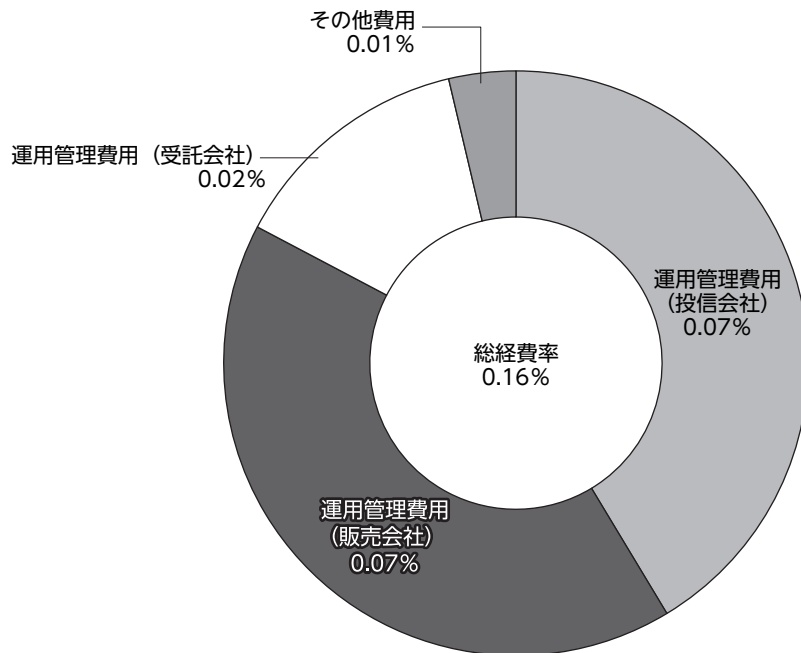
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.16%**です。



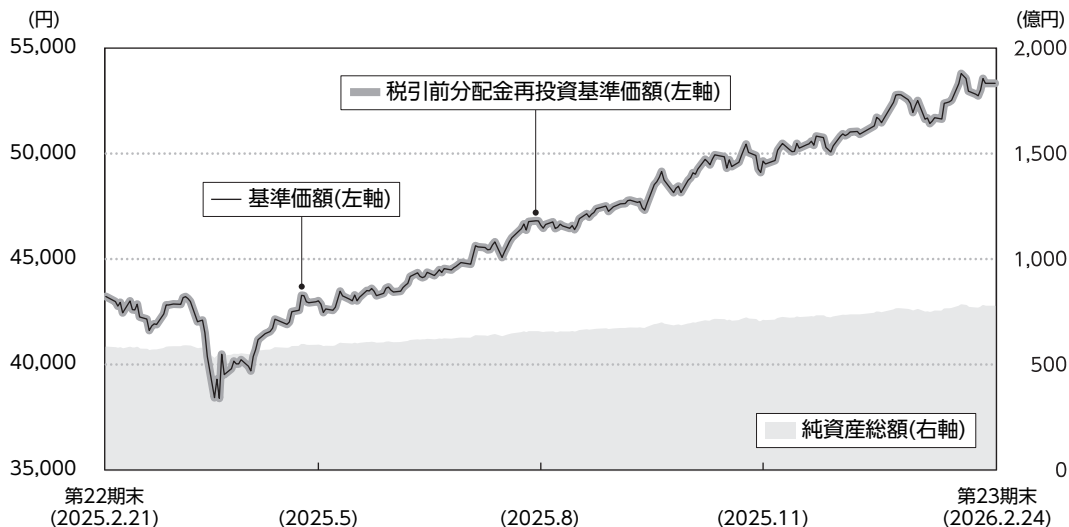
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

## 基準価額等の推移



|       |         |                 |       |
|-------|---------|-----------------|-------|
| 第23期首 | 43,225円 | 既払分配金           | 0円    |
| 第23期末 | 53,330円 | 騰落率 (分配金再投資ベース) | 23.4% |

(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;

- ・2025年4月下旬から10月下旬にかけて、海外主要中央銀行の利下げや好調な企業収益を背景に外国株式が上昇したこと
- ・10月に高市新政権による経済政策への期待感から、国内株式が上昇したこと
- ・6月下旬から10月下旬にかけて、主に為替市場において円安が進行したことなどを背景に、円貨ベースで外国債券が上昇したこと
- ・2026年2月に、衆院選で自民党が大勝し高市政権の積極財政への期待感が高まったことなどから、国内株式が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・期初から4月上旬にかけて、トランプ米政権の関税政策が市場の想定以上に厳しい内容であったことを受けて国内外で株価が急落したこと
- ・2026年1月中旬から下旬にかけて、衆院選に向けて与野党の多くが消費税減税を公約に掲げたことで、財政拡張への懸念が高まり、金利が大幅に上昇（債券価格は下落）したこと

| 組入マザーファンド             | 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% | 41.2% | 42.9% |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 15.0  | 15.0  | △ 4.1 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 30.0  | 29.1  | 20.6  |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 10.0  | 9.8   | 13.9  |
| 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23期 |         | 項目の概要  |
|------------|------|---------|--|
|            | 金額   | 比率      |  |
| 信託報酬       | 72円  | 0.155%  | 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$<br>期中の平均基準価額は46,543円です。 |
| (投信会社)     | (31) | (0.067) | 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)     | (31) | (0.067) | 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)     | (10) | (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    | 0.006   | その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数  |
| (保管費用)     | (2)  | (0.005) | 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)  | (0.001) | 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<br>・ 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         | 75   | 0.162   |  |

(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。

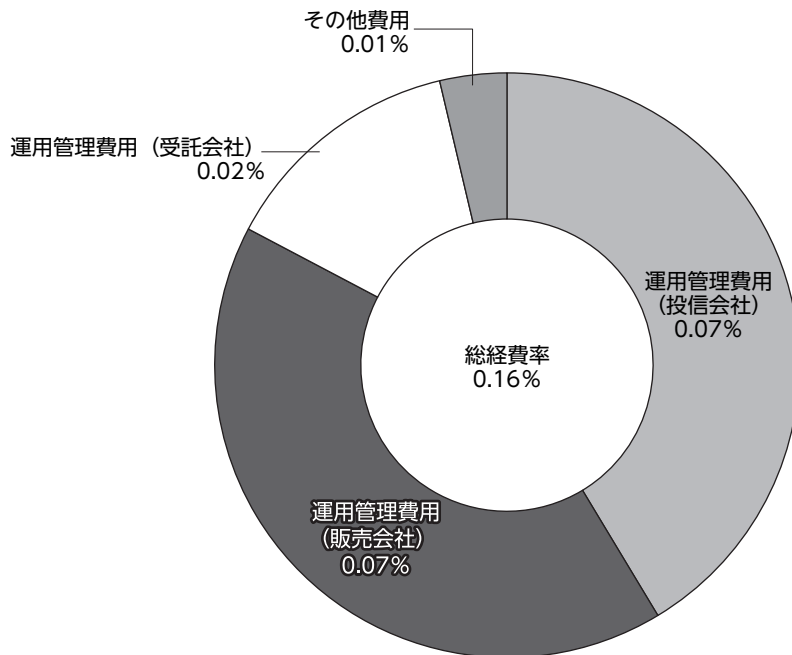
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.16%**です。



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

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

## 投資環境

### ■国内株式市況

国内株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、トランプ米大統領の関税政策への警戒感や地政学リスクの高まりから株価は軟調に推移しました。2025年4月には米国の相互関税策による世界経済の混乱懸念から一時急落しましたが、対米関税交渉の進展期待などを背景に投資家の過度なリスク回避姿勢が和らぎ、株価は上昇しました。

5月以降は各国の対米関税交渉の進展期待や地政学リスクの後退、米連邦準備制度理事会（FRB）による早期利下げ観測の高まりなどが好感され、株価は上昇基調で推移しました。日米関税交渉合意や堅調な企業業績、旺盛な人工知能（AI）関連投資需要なども株価を押し上げました。10月には高市新政権の拡張的な財政政策への期待感が追い風となり、株価は大きく上昇しました。

11月から12月にかけてはAI・半導体関連銘柄への高値警戒感などから調整する場面もありましたが、2026年1月以降は衆院選での自民党大勝を受け、高市政権の積極財政政策への期待感などから株価は大幅に上昇し、期初を大きく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。

2025年3月にはドイツの国防費増額報道を受けた欧州金利の上昇に伴って金利が上昇しました。4月に入ると、トランプ米政権による相互関税導入の発表を受け、不透明感が高まったことにより投資家がリスク回避的となったことから、金利は一時大幅に低下しましたが、5月には米中の追加関税引き下げが発表されたことなどをを受けて、再び上昇基調となりました。その後も7月の参院選において与党が過半数割れとなったことや、10月の自民党総裁選において高市氏が勝利したことを受けて、拡張的な財政運営への懸念が高まり上昇基調で推移しました。12月には、日銀が政策金利の0.75%程度への引き上げを決定し、海外経済や物価見通しの展望が上方修正され追加利上げへの期待感が高まり、さらに金利上昇しました。年明け以降は、衆議院解散後に与野党の多くが消費税減税を選挙公約に掲げたことで財政拡張への懸念が高まり、金利が大きく上昇しました。その後には、衆院選で大勝した自民党の高市首相が責任ある積極財政を掲げたことにより財政拡張懸念が後退し、当期末にかけて金利は低下しましたが、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

### ■海外株式市況

外国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2025年4月上旬にかけては、トランプ米政権の関税政策を巡る不透明感を背景とした景気減速懸念等により株価は下落しましたが、その後4月中旬以降にかけては、追加関税の停止措置や通商協議の進展などへの期待感や、主要企業の良好な業績を背景に株価は上昇しました。6月から7月にかけては、イランとイスラエルの早期停戦合意による中東情勢の緊張緩和や米関税交渉の進展、主要グローバル企業の良好な業績動向により、株価は上昇しました。8月から9月にかけては、米利下げ再開と追加利下げ観測の高まりや生成人工知能（AI）関連の大型受注などが好感され、株価は上昇しました。10月から12月にかけては、米中首脳会談による対立懸念の後退や主要企業の良好な業績発表、AI関連銘柄の継続的な物色などから、株価は上昇しました。当期末にかけては、AI投資への過熱感やソフトウェア代替懸念、米連邦準備制度理事会（FRB）の利下げに慎重な姿勢などが重荷となり、株価は軟調に推移しました。

## ■海外債券市況

当期の米国10年国債金利は、期初から2025年3月末にかけては、トランプ米政権の関税政策による景気後退への懸念などから低下しました。5月には米国がイギリスや中国との関税交渉において合意したことや、格付会社が米国債の格下げを行ったことを受けて、金利は大幅に上昇しました。その後、金利は上下しながらも、FRBの利下げ期待が高まったことや、雇用関連の経済指標が市場予想を下回ったことを受けて、低下基調となりました。2026年1月には円金利急騰の影響や、グリーンランドの取得を巡る米欧の対立を受けて金利が上昇しましたが、2月から当期末にかけては経済指標や物価指数が市場予想を下回ったことに加え、イラン情勢の緊迫化なども材料となり金利は低下しました。結局、期を通じて見ると米金利は低下して当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、2025年3月前半にはドイツ首相が大規模な財政拡大案について合意したことが報じられ急上昇しましたが、4月にはトランプ米政権の関税政策による景気後退への懸念に加え、欧州中央銀行（ECB）高官が追加利下げに積極的なスタンスを示したことで大幅に低下しました。6月にはドイツの国防費増額計画を受けて金利は上昇しました。その後、金利は上下しながらも上昇基調で推移し、12月にはドイツでの2026年度連邦予算における財政支出拡大と国債増発をめぐる懸念や、今後の利下げへの期待感の後退からさらに上昇しました。2026年2月から当期末にかけては米国で経済指標や物価指数が市場予想を下回ったことに加え、米国とイランの情勢緊迫化なども材料となり金利は低下しましたが、結局、期を通じて見ると、ドイツ金利は上昇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。2025年4月にはトランプ米政権による関税政策をめぐる不透明感が高まり、大幅に米ドル安円高となりました。その後は上下しつつ米ドル高円安基調で推移し、10月には自民党総裁選で高市氏が勝利したことで、財政拡張的な政策が示されるとの思惑から、11月末以降にかけてさらに米ドル高円安基調となりました。2026年1月には高市政権が衆議院解散を表明し、財政拡張に対する警戒感から一段と米ドル高円安が進行しましたが、その後に為替介入への警戒感から急速に米ドル安円高となりました。2月上旬から当期末にかけては、衆院選前後の動向等によって上下に推移しました。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／円レートは大幅に上昇しました。2025年3月はドイツ首相が大規模な財政拡大案について合意したことが報じられ、欧州金利が大幅に上昇したことから、ユーロ高円安となりました。その後は横ばいに推移しましたが、6月から7月にかけては追加利下げに慎重なECBと、利上げに慎重な日銀という金融政策の方向性の違いが鮮明となり、ユーロ高円安で推移しました。10月には自民党総裁選で高市氏が勝利したことで、財政拡張的な政策が示されるとの思惑から、11月末以降にかけてユーロ高円安基調が継続しました。2026年1月から当期末にかけては、衆院選前後の動向等によって上下して推移しました。結局、期を通じて見ると大幅な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>

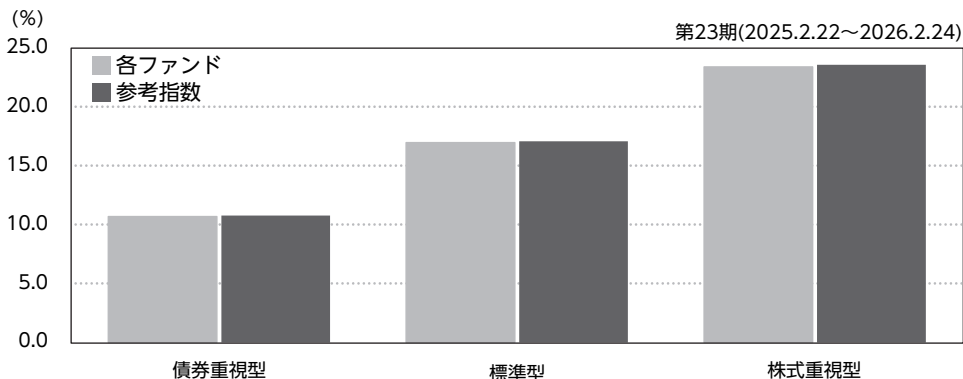
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークであるM S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

#### <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+10.7%となり、参考指数騰落率(+10.8%)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+16.9%となり、参考指数騰落率(+17.1%)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+23.4%となり、参考指数騰落率(+23.5%)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23期<br>2025年2月22日～2026年2月24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  | 15,297円                       | 27,322円 | 43,330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23期末<br>2026年2月24日 |
|---------------------------|---------------------|
| ニッセイ国内株式インデックス<br>マザーファンド | 20.6%               |
| ニッセイ国内債券インデックス<br>マザーファンド | 45.0                |
| ニッセイ外国株式インデックス<br>マザーファンド | 9.7                 |
| ニッセイ外国債券インデックス<br>マザーファンド | 19.7                |

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

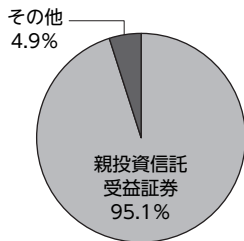
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

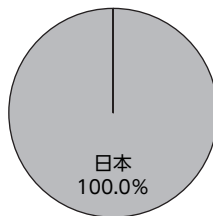
| 項目         | 第23期末<br>2026年2月24日 |
|------------|---------------------|
| 純資産総額      | 39,951,166,326円     |
| 受益権総口数     | 15,792,408,748口     |
| 1万口当たり基準価額 | 25,298円             |

(注) 当期間中における追加設定元本額は2,917,412,244円、同解約元本額は1,866,604,841円です。

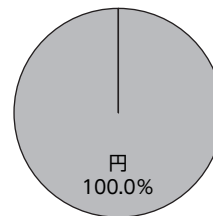
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2026年2月24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23期末<br>2026年2月24日 |
|---------------------------|---------------------|
| ニッセイ国内株式インデックス<br>マザーファンド | 30.9%               |
| ニッセイ国内債券インデックス<br>マザーファンド | 29.9                |
| ニッセイ外国株式インデックス<br>マザーファンド | 19.5                |
| ニッセイ外国債券インデックス<br>マザーファンド | 14.8                |

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

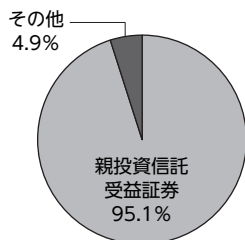
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

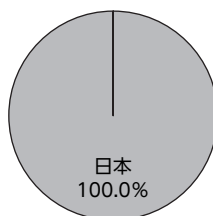
| 項目         | 第23期末<br>2026年2月24日 |
|------------|---------------------|
| 純資産総額      | 105,343,814,371円    |
| 受益権総口数     | 28,225,298,868口     |
| 1万口当たり基準価額 | 37,322円             |

(注) 当期間中における追加設定元本額は4,313,129,352円、同解約元本額は2,588,083,297円です。

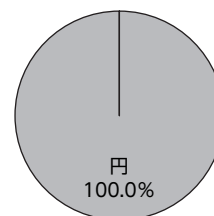
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2026年2月24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23期末<br>2026年2月24日 |
|---------------------------|---------------------|
| ニッセイ国内株式インデックス<br>マザーファンド | 41.2%               |
| ニッセイ国内債券インデックス<br>マザーファンド | 15.0                |
| ニッセイ外国株式インデックス<br>マザーファンド | 29.1                |
| ニッセイ外国債券インデックス<br>マザーファンド | 9.8                 |

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

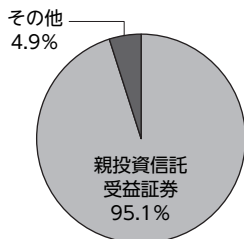
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

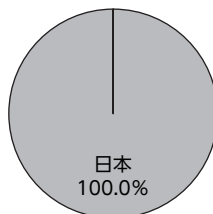
| 項目         | 第23期末<br>2026年2月24日 |
|------------|---------------------|
| 純資産総額      | 77,272,254,300円     |
| 受益権総口数     | 14,489,412,154口     |
| 1万口当たり基準価額 | 53,330円             |

(注) 当期間中における追加設定元本額は2,813,533,359円、同解約元本額は1,720,157,473円です。

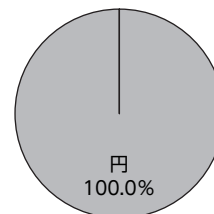
### ■資産別配分



### ■国別配分



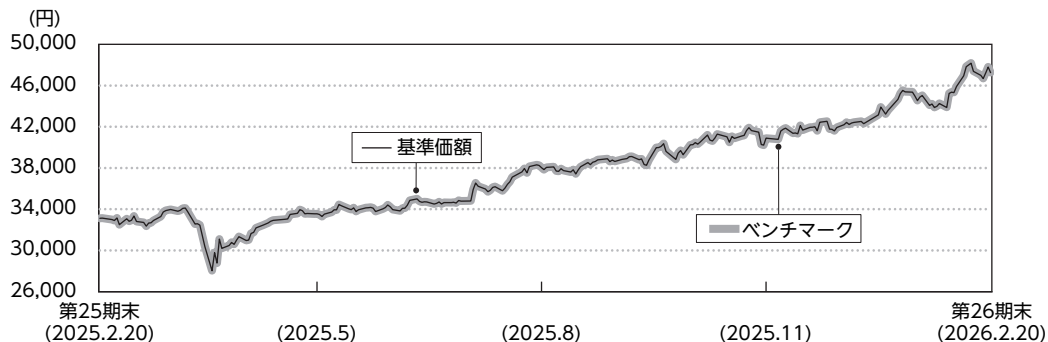
### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2026年2月24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

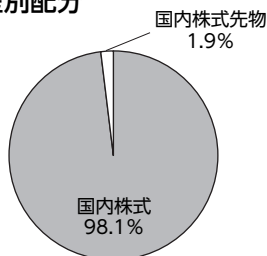
| 銘柄名               | 通貨 | 比率    |
|-------------------|----|-------|
| トヨタ自動車            | 円  | 3.5%  |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 円  | 3.3   |
| 三井住友フィナンシャルグループ   | 円  | 2.3   |
| 日立製作所             | 円  | 2.3   |
| ソニーグループ           | 円  | 2.1   |
| TOPIX 先物 0803月 買  | 円  | 1.9   |
| 三菱商事              | 円  | 1.9   |
| みずほフィナンシャルグループ    | 円  | 1.8   |
| 三菱重工業             | 円  | 1.7   |
| 東京エレクトロン          | 円  | 1.7   |
| 組入銘柄数             |    | 1,553 |

## ■ 1万口当たりの費用明細

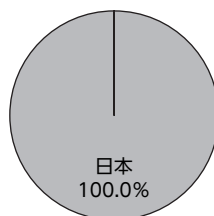
2025.2.21~2026.2.20

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

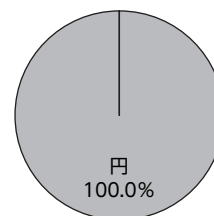
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



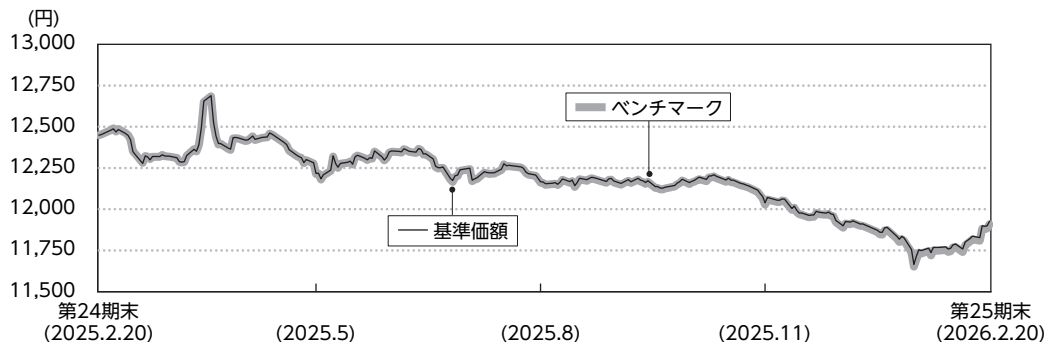
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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(2026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。

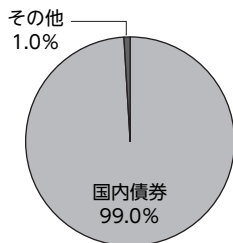
## ■ 上位銘柄

| 銘柄名               | 通貨 | 比率   |
|-------------------|----|------|
| 第348回 利付国債 (10年)  | 円  | 7.6% |
| 第178回 利付国債 (5年)   | 円  | 7.5  |
| 第366回 利付国債 (10年)  | 円  | 7.5  |
| 第358回 利付国債 (10年)  | 円  | 7.5  |
| 第374回 利付国債 (10年)  | 円  | 7.4  |
| 第352回 利付国債 (10年)  | 円  | 7.0  |
| 第168回 利付国債 (20年)  | 円  | 5.1  |
| 第 22 回 利付国債 (30年) | 円  | 4.9  |
| 第184回 利付国債 (20年)  | 円  | 4.5  |
| 第370回 利付国債 (10年)  | 円  | 3.1  |
| 組入銘柄数             |    | 30   |

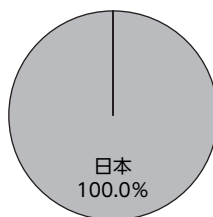
## ■ 1万口当たりの費用明細

当期 (2025年2月21日~2026年2月20日) における費用はありません。

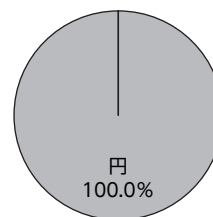
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



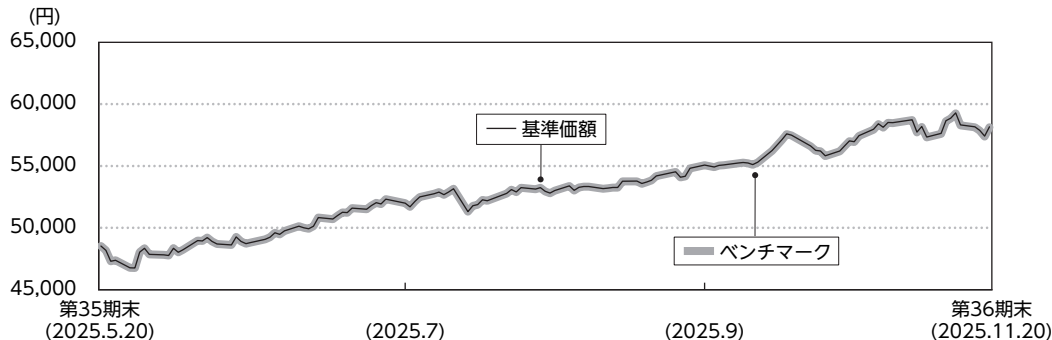
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日 (2026年2月20日現在) のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

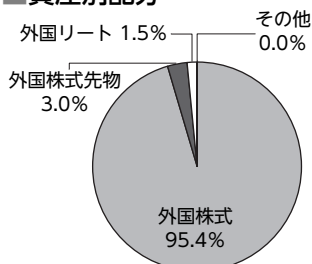
| 銘柄名                           | 通貨  | 比率    |
|-------------------------------|-----|-------|
| NVIDIA CORP                   | 米ドル | 5.9%  |
| APPLE INC                     | 米ドル | 5.2   |
| MICROSOFT CORP                | 米ドル | 4.4   |
| AMAZON.COM INC                | 米ドル | 2.7   |
| S&P 500 EMINI FUTURE 202512 買 | 米ドル | 2.4   |
| ALPHABET INC-CL A             | 米ドル | 2.2   |
| BROADCOM INC                  | 米ドル | 2.0   |
| ALPHABET INC-CL C             | 米ドル | 1.9   |
| META PLATFORMS INC-A          | 米ドル | 1.6   |
| TESLA, INC.                   | 米ドル | 1.5   |
| 組入銘柄数                         |     | 1,144 |

## ■ 1万口当たりの費用明細

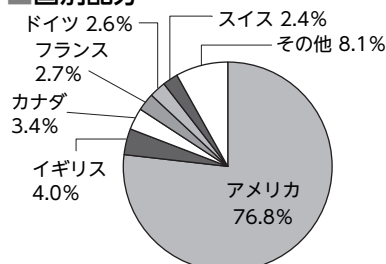
2025.5.21~2025.11.20

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

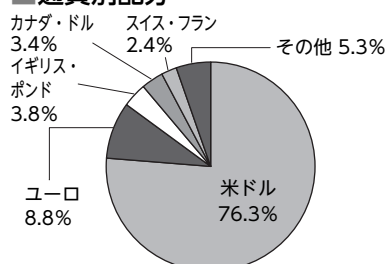
## ■ 資産別配分



## ■ 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。

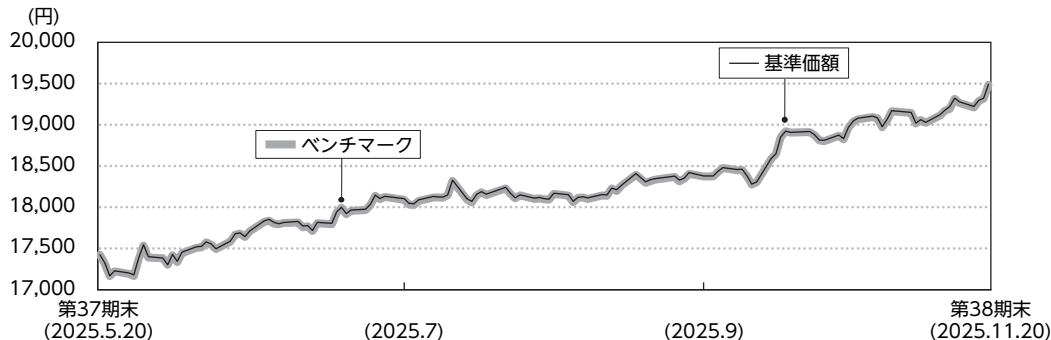
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2025年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(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

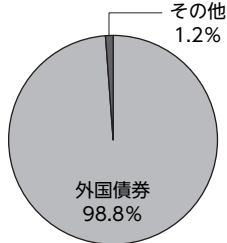
| 銘柄名                          | 通貨  | 比率   |
|------------------------------|-----|------|
| US TREASURY 2.25% 2027/2/15  | 米ドル | 3.1% |
| US TREASURY 2.375% 2027/5/15 | 米ドル | 2.5  |
| US TREASURY 2.25% 2027/8/15  | 米ドル | 1.8  |
| US TREASURY 2.25% 2027/11/15 | 米ドル | 1.7  |
| US TREASURY 2.875% 2028/5/15 | 米ドル | 1.6  |
| US TREASURY 2.875% 2028/8/15 | 米ドル | 1.6  |
| US TREASURY 2.0% 2026/11/15  | 米ドル | 1.4  |
| US TREASURY 2.625% 2029/2/15 | 米ドル | 1.3  |
| US TREASURY 0.625% 2030/8/15 | 米ドル | 1.3  |
| US TREASURY 2.375% 2029/5/15 | 米ドル | 1.3  |
| 組入銘柄数                        |     | 897  |

## ■ 1万口当たりの費用明細

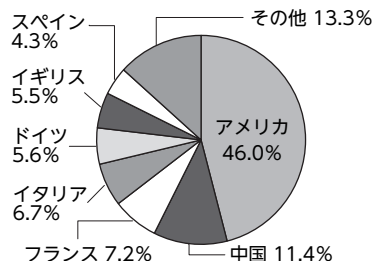
2025.5.21～2025.11.20

| 項目                       | 金額               |
|--------------------------|------------------|
| その他費用<br>(保管費用)<br>(その他) | 2円<br>(2)<br>(0) |
| 合計                       | 2                |

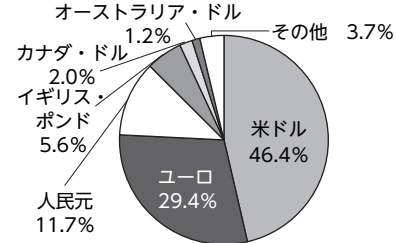
## ■ 資産別配分



## ■ 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(2025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<br>(分配落) | 税引前<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (ご参考)          | 参考指数   | 期中<br>騰落率 | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 債券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|-----------------|---------------|------------|-----------|----------------|--------|-----------|------------|------------|------------|--------------------|-----------|
|                 |               |            |           | 基準価額+<br>累計分配金 |        |           |            |            |            |                    |           |
|                 | 円             | 円          | %         | 円              |        | %         | %          | %          | %          | %                  | 百万円       |
| 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    |
| 22期(2025年2月21日) | 22,856        | 0          | 2.0       | 22,856         | 24,411 | 2.3       | 29.4       | 0.6        | 64.3       | 0.2                | 33,692    |
| 23期(2026年2月24日) | 25,298        | 0          | 10.7      | 25,298         | 27,039 | 10.8      | 29.5       | 0.7        | 64.0       | 0.2                | 39,951    |

(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<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 債券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 |
|----------------|--------|-------|--------|-------|------|------------|------------|------------|--------------------|
|                | 基準価額   | 騰落率   |        | 騰落率   | 騰落率  |            |            |            |                    |
|                | 円      | %     |        | %     | %    | %          | %          | %          | %                  |
| (期首)2025年2月21日 | 22,856 | -     | 24,411 | -     | 29.4 | 0.6        | 64.3       | 0.2        | 0.2                |
| 2月末            | 22,721 | △ 0.6 | 24,273 | △ 0.6 | 28.8 | 0.6        | 64.8       | 0.2        | 0.2                |
| 3月末            | 22,601 | △ 1.1 | 24,150 | △ 1.1 | 28.7 | 0.9        | 64.9       | 0.2        | 0.2                |
| 4月末            | 22,531 | △ 1.4 | 24,099 | △ 1.3 | 30.3 | 1.0        | 63.4       | 0.2        | 0.2                |
| 5月末            | 22,824 | △ 0.1 | 24,403 | △ 0.0 | 30.1 | 0.9        | 63.4       | 0.2        | 0.2                |
| 6月末            | 23,191 | 1.5   | 24,793 | 1.6   | 29.7 | 0.8        | 63.8       | 0.2        | 0.2                |
| 7月末            | 23,444 | 2.6   | 25,066 | 2.7   | 30.0 | 0.7        | 63.5       | 0.2        | 0.2                |
| 8月末            | 23,635 | 3.4   | 25,266 | 3.5   | 30.2 | 0.6        | 63.4       | 0.2        | 0.2                |
| 9月末            | 23,947 | 4.8   | 25,598 | 4.9   | 29.5 | 0.8        | 64.1       | 0.2        | 0.2                |
| 10月末           | 24,590 | 7.6   | 26,282 | 7.7   | 29.9 | 0.9        | 63.5       | 0.2        | 0.2                |
| 11月末           | 24,676 | 8.0   | 26,379 | 8.1   | 29.7 | 0.9        | 63.7       | 0.2        | 0.2                |
| 12月末           | 24,661 | 7.9   | 26,368 | 8.0   | 29.4 | 0.8        | 64.3       | 0.1        | 0.1                |
| 2026年1月末       | 24,709 | 8.1   | 26,415 | 8.2   | 29.6 | 0.7        | 63.7       | 0.1        | 0.1                |
| (期末)2026年2月24日 | 25,298 | 10.7  | 27,039 | 10.8  | 29.5 | 0.7        | 64.0       | 0.2        | 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

2025年2月22日～2026年2月24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 | 504,222   | 1,791,228 | 811,513   | 3,113,795 |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 4,948,052 | 6,008,583 | 2,141,339 | 2,614,750 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 208,520   | 1,032,837 | 237,682   | 1,264,332 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 884,850   | 1,621,368 | 732,199   | 1,357,386 |

(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<br>インデックスマザーファンド | ニッセイ外国株式<br>インデックスマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 48,040,443千円              | 107,994,216千円             |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 325,640,039千円             | 1,250,181,250千円           |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.14                      | 0.08                      |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

## 利害関係人との取引状況等

2025年2月22日～2026年2月24日

## 利害関係人の発行する有価証券等

&lt;ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド&gt;

| 種類 | 当期  |     |        |
|----|-----|-----|--------|
|    | 買付額 | 売付額 | 当期末保有額 |
|    | 百万円 | 百万円 | 百万円    |
| 株式 | 26  | 0   | 143    |

(注1) 利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とはCOREBRIDGE FINANCIAL INCです。

(注2) 金額は受渡代金です。

(注3) 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（債券重視型）

## 親投資信託残高

2026年2月24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 | 2,049,795  | 1,742,504  | 8,249,015  |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 12,235,536 | 15,042,248 | 17,969,470 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 672,873    | 643,711    | 3,890,269  |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 3,827,843  | 3,980,494  | 7,873,417  |

(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90,234,898千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが89,225,077千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが249,495,036千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが61,470,882千口です。

## 投資信託財産の構成

2026年2月24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 | 8,249,015  | 20.6  |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 17,969,470 | 44.9  |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 3,890,269  | 9.7   |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 7,873,417  | 19.7  |
| コール・ローン等、その他          | 2,023,872  | 5.1   |
| 投資信託財産総額              | 40,006,046 | 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24日における邦貨換算レートは、1米ドル154.86円、1カナダ・ドル113.05円、1オーストラリア・ドル109.39円、1香港ドル19.80円、1シンガポール・ドル122.29円、1ニュージーランド・ドル92.33円、1イギリス・ポンド209.01円、1イスラエル・シェケル49.593円、1スイス・フラン199.95円、1デンマーク・クローネ24.44円、1ノルウェー・クローネ16.19円、1スウェーデン・クローナ17.09円、1メキシコ・ペソ8.975円、1人民元22.479円、1マレーシア・リンギット39.828円、1ポーランド・ズロチ43.266円、1ユーロ182.55円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,490,037,754千円）の投資信託財産総額（1,509,635,618千円）に対する比率は98.7%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（121,352,141千円）の投資信託財産総額（122,103,146千円）に対する比率は99.4%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2026年2月24日現在)

| 項目                             | 当期末             |
|--------------------------------|-----------------|
| (A)資産                          | 40,006,046,879円 |
| コール・ローン等                       | 2,000,134,479   |
| ニッセイ国内株式インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 8,249,015,839   |
| ニッセイ国内債券インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 17,969,470,372  |
| ニッセイ外国株式インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 3,890,269,791   |
| ニッセイ外国債券インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 7,873,417,978   |
| 未収入金                           | 23,738,420      |
| (B)負債                          | 54,880,553      |
| 未払解約金                          | 24,649,190      |
| 未払信託報酬                         | 30,017,055      |
| その他未払費用                        | 214,308         |
| (C)純資産総額(A-B)                  | 39,951,166,326  |
| 元本                             | 15,792,408,748  |
| 次期繰越損益金                        | 24,158,757,578  |
| (D)受益権総口数                      | 15,792,408,748口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)                | 25,298円         |

|           |                 |
|-----------|-----------------|
| (注) 期首元本額 | 14,741,601,345円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,917,412,244円  |
| 期中一部解約元本額 | 1,866,604,841円  |

## 損益の状況

当期(2025年2月22日~2026年2月24日)

| 項目              | 当期                |
|-----------------|-------------------|
| (A)配当等収益        | 8,479,601円        |
| 受取利息            | 8,479,601         |
| (B)有価証券売買損益     | 3,672,051,145     |
| 売益              | 4,510,634,552     |
| 買損              | △ 838,583,407     |
| (C)信託報酬等        | △ 56,670,944      |
| (D)当期損益金(A+B+C) | 3,623,859,802     |
| (E)前期繰越損益金      | 4,180,158,756     |
| (分配準備積立金)       | ( 4,180,158,756)  |
| (F)追加信託差損益金*    | 16,354,739,020    |
| (配当等相当額)        | ( 14,544,568,371) |
| (売買損益相当額)       | ( 1,810,170,649)  |
| (G)合計(D+E+F)    | 24,158,757,578    |
| 次期繰越損益金(G)      | 24,158,757,578    |
| 追加信託差損益金        | 16,354,739,020    |
| (配当等相当額)        | ( 14,544,568,371) |
| (売買損益相当額)       | ( 1,810,170,649)  |
| 分配準備積立金         | 7,804,018,558     |

- (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     | 8,349,258円      |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 3,615,510,544円  |
| (c) 信託約款に定める収益調整金   | 16,354,739,020円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金 | 4,180,158,756円  |
| (e) 分配対象額(a+b+c+d)  | 24,158,757,578円 |
| (f) 分配対象額(1万口当たり)   | 15,297.70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<br>(分配落) | 税引前<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (ご参考)          | 参考指数   | 期中<br>騰落率 | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 債券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|-----------------|---------------|------------|-----------|----------------|--------|-----------|------------|------------|------------|--------------------|-----------|
|                 |               |            |           | 基準価額+<br>累計分配金 |        |           |            |            |            |                    |           |
|                 | 円             | 円          | %         | 円              |        | %         | %          | %          | %          | %                  | 百万円       |
| 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    |
| 22期(2025年2月21日) | 31,913        | 0          | 5.2       | 31,913         | 34,207 | 5.7       | 48.8       | 1.1        | 44.5       | 0.3                | 84,569    |
| 23期(2026年2月24日) | 37,322        | 0          | 16.9      | 37,322         | 40,043 | 17.1      | 48.9       | 1.2        | 44.2       | 0.3                | 105,343   |

(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<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 債券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 |
|----------------|--------|-------|--------|-------|------|------------|------------|------------|--------------------|
|                | 円      | %     |        | %     | %    |            |            |            |                    |
| (期首)2025年2月21日 | 31,913 | -     | 34,207 | -     | 48.8 | 1.1        | 44.5       | 0.3        |                    |
| 2月末            | 31,532 | △ 1.2 | 33,805 | △ 1.2 | 48.0 | 1.1        | 45.1       | 0.3        |                    |
| 3月末            | 31,291 | △ 1.9 | 33,552 | △ 1.9 | 47.9 | 1.5        | 45.1       | 0.4        |                    |
| 4月末            | 31,078 | △ 2.6 | 33,363 | △ 2.5 | 49.7 | 1.7        | 43.4       | 0.4        |                    |
| 5月末            | 31,915 | 0.0   | 34,249 | 0.1   | 49.6 | 1.5        | 43.4       | 0.4        |                    |
| 6月末            | 32,577 | 2.1   | 34,958 | 2.2   | 49.2 | 1.2        | 43.9       | 0.3        |                    |
| 7月末            | 33,237 | 4.1   | 35,669 | 4.3   | 49.5 | 1.2        | 43.6       | 0.3        |                    |
| 8月末            | 33,704 | 5.6   | 36,165 | 5.7   | 49.8 | 1.0        | 43.5       | 0.3        |                    |
| 9月末            | 34,344 | 7.6   | 36,849 | 7.7   | 48.9 | 1.3        | 44.2       | 0.3        |                    |
| 10月末           | 35,603 | 11.6  | 38,196 | 11.7  | 49.3 | 1.5        | 43.6       | 0.3        |                    |
| 11月末           | 35,857 | 12.4  | 38,481 | 12.5  | 49.1 | 1.4        | 43.9       | 0.3        |                    |
| 12月末           | 36,003 | 12.8  | 38,645 | 13.0  | 48.8 | 1.4        | 44.4       | 0.3        |                    |
| 2026年1月末       | 36,314 | 13.8  | 38,978 | 13.9  | 49.1 | 1.2        | 43.9       | 0.3        |                    |
| (期末)2026年2月24日 | 37,322 | 16.9  | 40,043 | 17.1  | 48.9 | 1.2        | 44.2       | 0.3        |                    |

(注) 期末基準価額は分配金（税引前）込み、騰落率は期首比です。

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2025年2月22日～2026年2月24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 | 1,523,203 | 5,443,117  | 2,353,735 | 9,049,700 |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 9,401,403 | 11,413,904 | 3,452,303 | 4,229,335 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 874,541   | 4,379,797  | 858,848   | 4,578,325 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 1,779,244 | 3,253,058  | 1,117,129 | 2,041,493 |

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目                | 当期                        |                           |
|-------------------|---------------------------|---------------------------|
|                   | ニッセイ国内株式<br>インデックスマザーファンド | ニッセイ外国株式<br>インデックスマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 48,040,443千円              | 107,994,216千円             |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 325,640,039千円             | 1,250,181,250千円           |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.14                      | 0.08                      |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

## 利害関係人との取引状況等

2025年2月22日～2026年2月24日

## 利害関係人の発行する有価証券等

&lt;ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド&gt;

| 種類 | 当期  |     |        |
|----|-----|-----|--------|
|    | 買付額 | 売付額 | 当期末保有額 |
|    | 百万円 | 百万円 | 百万円    |
| 株式 | 26  | 0   | 143    |

(注1) 利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とはCOREBRIDGE FINANCIAL INCです。

(注2) 金額は受渡代金です。

(注3) 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）

### 親投資信託残高

2026年2月24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 | 7,710,940  | 6,880,408  | 32,571,855 |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 20,456,772 | 26,405,872 | 31,544,455 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 3,375,023  | 3,390,716  | 20,491,794 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 7,199,817  | 7,861,931  | 15,550,901 |

(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90,234,898千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが89,225,077千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが249,495,036千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが61,470,882千口です。

### 投資信託財産の構成

2026年2月24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 | 32,571,855  | 30.9  |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 31,544,455  | 29.9  |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 20,491,794  | 19.4  |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 15,550,901  | 14.7  |
| コール・ローン等、その他          | 5,367,364   | 5.1   |
| 投資信託財産総額              | 105,526,371 | 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24日における邦貨換算レートは、1米ドル154.86円、1カナダ・ドル113.05円、1オーストラリア・ドル109.39円、1香港ドル19.80円、1シンガポール・ドル122.29円、1ニュージーランド・ドル92.33円、1イギリス・ポンド209.01円、1イスラエル・シケル49.593円、1スイス・フラン199.95円、1デンマーク・クローネ24.44円、1ノルウェー・クローネ16.19円、1スウェーデン・クローナ17.09円、1メキシコ・ペソ8.975円、1人民元22.479円、1マレーシア・リングギット39.828円、1ポーランド・ズロチ43.266円、1ユーロ182.55円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,490,037,754千円）の投資信託財産総額（1,509,635,618千円）に対する比率は98.7%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（121,352,141千円）の投資信託財産総額（122,103,146千円）に対する比率は99.4%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

(2026年2月24日現在)

| 項目                             | 当期末                     |
|--------------------------------|-------------------------|
| <b>(A)資産</b>                   | <b>105,526,371,672円</b> |
| コール・ローン等                       | 5,267,818,403           |
| ニッセイ国内株式インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 32,571,855,959          |
| ニッセイ国内債券インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 31,544,455,325          |
| ニッセイ外国株式インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 20,491,794,660          |
| ニッセイ外国債券インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 15,550,901,201          |
| 未収入金                           | 99,546,124              |
| <b>(B)負債</b>                   | <b>182,557,301</b>      |
| 未払解約金                          | 103,891,506             |
| 未払信託報酬                         | 78,107,980              |
| その他未払費用                        | 557,815                 |
| <b>(C)純資産総額(A-B)</b>           | <b>105,343,814,371</b>  |
| 元本                             | 28,225,298,868          |
| 次期繰越損益金                        | 77,118,515,503          |
| <b>(D)受益権総口数</b>               | <b>28,225,298,868口</b>  |
| 1万口当たり基準価額(C/D)                | <b>37,322円</b>          |

|           |                 |
|-----------|-----------------|
| (注) 期首元本額 | 26,500,252,813円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,313,129,352円  |
| 期中一部解約元本額 | 2,588,083,297円  |

### 損益の状況

当期(2025年2月22日~2026年2月24日)

| 項目                     | 当期                    |
|------------------------|-----------------------|
| <b>(A)配当等収益</b>        | <b>21,811,801円</b>    |
| 受取利息                   | 21,811,210            |
| その他収益金                 | 591                   |
| <b>(B)有価証券売買損益</b>     | <b>14,644,343,215</b> |
| 売買益                    | 16,335,703,074        |
| 売買損                    | △ 1,691,359,859       |
| <b>(C)信託報酬等</b>        | <b>△ 144,888,743</b>  |
| <b>(D)当期損益金(A+B+C)</b> | <b>14,521,266,273</b> |
| <b>(E)前期繰越損益金</b>      | <b>19,443,160,860</b> |
| (分配準備積立金)              | ( 19,443,160,860)     |
| <b>(F)追加信託差損益金*</b>    | <b>43,154,088,370</b> |
| (配当等相当額)               | ( 39,936,317,337)     |
| (売買損益相当額)              | ( 3,217,771,033)      |
| <b>(G)合計(D+E+F)</b>    | <b>77,118,515,503</b> |
| <b>次期繰越損益金(G)</b>      | <b>77,118,515,503</b> |
| 追加信託差損益金               | 43,154,088,370        |
| (配当等相当額)               | ( 39,936,317,337)     |
| (売買損益相当額)              | ( 3,217,771,033)      |
| 分配準備積立金                | 33,964,427,133        |

- (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     | 21,594,468円     |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 14,499,671,805円 |
| (c) 信託約款に定める収益調整金   | 43,154,088,370円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金 | 19,443,160,860円 |
| (e) 分配対象額(a+b+c+d)  | 77,118,515,503円 |
| (f) 分配対象額(1万口当たり)   | 27,322.48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<br>(分配落) | 税引前<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (ご参考)          | 参考指数   | 期中<br>騰落率 | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 債券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|-----------------|---------------|------------|-----------|----------------|--------|-----------|------------|------------|------------|--------------------|-----------|
|                 |               |            |           | 基準価額+<br>累計分配金 |        |           |            |            |            |                    |           |
|                 | 円             | 円          | %         | 円              |        | %         | %          | %          | %          | %                  | 百万円       |
| 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    |
| 22期(2025年2月21日) | 43,225        | 0          | 8.4       | 43,225         | 46,583 | 9.1       | 68.2       | 1.5        | 24.6       | 0.5                | 57,903    |
| 23期(2026年2月24日) | 53,330        | 0          | 23.4      | 53,330         | 57,553 | 23.5      | 68.1       | 1.7        | 24.5       | 0.5                | 77,272    |

(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<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 債券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 |
|----------------|--------|-------|--------|-------|------|------------|------------|------------|--------------------|
|                | 基準価額   | 騰落率   |        | 騰落率   | 騰落率  |            |            |            |                    |
|                | 円      | %     |        | %     | %    | %          | %          | %          |                    |
| (期首)2025年2月21日 | 43,225 | -     | 46,583 | -     | 68.2 | 1.5        | 24.6       | 0.5        |                    |
| 2月末            | 42,448 | △ 1.8 | 45,753 | △ 1.8 | 67.5 | 1.5        | 25.1       | 0.5        |                    |
| 3月末            | 42,022 | △ 2.8 | 45,295 | △ 2.8 | 67.2 | 2.1        | 25.1       | 0.5        |                    |
| 4月末            | 41,559 | △ 3.9 | 44,848 | △ 3.7 | 68.6 | 2.3        | 23.8       | 0.5        |                    |
| 5月末            | 43,249 | 0.1   | 46,669 | 0.2   | 68.6 | 2.1        | 23.8       | 0.5        |                    |
| 6月末            | 44,348 | 2.6   | 47,854 | 2.7   | 68.5 | 1.7        | 24.3       | 0.5        |                    |
| 7月末            | 45,662 | 5.6   | 49,276 | 5.8   | 68.7 | 1.6        | 24.1       | 0.5        |                    |
| 8月末            | 46,569 | 7.7   | 50,251 | 7.9   | 69.0 | 1.4        | 24.0       | 0.5        |                    |
| 9月末            | 47,721 | 10.4  | 51,493 | 10.5  | 68.1 | 1.8        | 24.4       | 0.5        |                    |
| 10月末           | 49,935 | 15.5  | 53,884 | 15.7  | 68.4 | 2.1        | 24.1       | 0.5        |                    |
| 11月末           | 50,474 | 16.8  | 54,485 | 17.0  | 68.3 | 1.9        | 24.3       | 0.5        |                    |
| 12月末           | 50,912 | 17.8  | 54,974 | 18.0  | 68.0 | 1.9        | 24.6       | 0.4        |                    |
| 2026年1月末       | 51,693 | 19.6  | 55,821 | 19.8  | 68.3 | 1.7        | 24.3       | 0.4        |                    |
| (期末)2026年2月24日 | 53,330 | 23.4  | 57,553 | 23.5  | 68.1 | 1.7        | 24.5       | 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

2025年2月22日～2026年2月24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 | 1,605,290 | 5,889,838 | 1,920,878 | 7,372,317 |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 4,264,690 | 5,175,645 | 1,590,359 | 1,948,194 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 1,030,960 | 5,318,311 | 767,627   | 4,092,879 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 1,193,184 | 2,188,226 | 636,853   | 1,153,396 |

(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<br>インデックスマザーファンド | ニッセイ外国株式<br>インデックスマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 48,040,443千円              | 107,994,216千円             |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 325,640,039千円             | 1,250,181,250千円           |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.14                      | 0.08                      |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

## 利害関係人との取引状況等

2025年2月22日～2026年2月24日

## 利害関係人の発行する有価証券等

&lt;ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド&gt;

| 種類 | 当期  |     |        |
|----|-----|-----|--------|
|    | 買付額 | 売付額 | 当期末保有額 |
|    | 百万円 | 百万円 | 百万円    |
| 株式 | 26  | 0   | 143    |

(注1) 利害関係人とは投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とはCOREBRIDGE FINANCIAL INCです。

(注2) 金額は受渡代金です。

(注3) 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（株式重視型）

## 親投資信託残高

2026年2月24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 | 7,033,453 | 6,717,865 | 31,802,373 |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 6,997,372 | 9,671,703 | 11,553,817 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 3,463,356 | 3,726,688 | 22,522,242 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 3,283,701 | 3,840,032 | 7,595,583  |

(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90,234,898千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが89,225,077千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが249,495,036千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが61,470,882千口です。

## 投資信託財産の構成

2026年2月24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 | 31,802,373 | 41.1  |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 11,553,817 | 14.9  |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 22,522,242 | 29.1  |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 7,595,583  | 9.8   |
| コール・ローン等、その他          | 3,921,367  | 5.1   |
| 投資信託財産総額              | 77,395,385 | 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24日における邦貨換算レートは、1米ドル154.86円、1カナダ・ドル113.05円、1オーストラリア・ドル109.39円、1香港ドル19.80円、1シンガポール・ドル122.29円、1ニュージーランド・ドル92.33円、1イギリス・ポンド209.01円、1イスラエル・シェケル49.593円、1スイス・フラン199.95円、1デンマーク・クローネ24.44円、1ノルウェー・クローネ16.19円、1スウェーデン・クローナ17.09円、1メキシコ・ペソ8.975円、1人民元22.479円、1マレーシア・リンギット39.828円、1ポーランド・ズロチ43.266円、1ユーロ182.55円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,490,037,754千円）の投資信託財産総額（1,509,635,618千円）に対する比率は98.7%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（121,352,141千円）の投資信託財産総額（122,103,146千円）に対する比率は99.4%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2026年2月24日現在)

| 項目                             | 当期末             |
|--------------------------------|-----------------|
| (A)資産                          | 77,395,385,388円 |
| コール・ローン等                       | 3,857,410,953   |
| ニッセイ国内株式インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 31,802,373,960  |
| ニッセイ国内債券インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 11,553,817,392  |
| ニッセイ外国株式インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 22,522,242,795  |
| ニッセイ外国債券インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 7,595,583,830   |
| 未収入金                           | 63,956,458      |
| (B)負債                          | 123,131,088     |
| 未払解約金                          | 66,666,679      |
| 未払信託報酬                         | 56,064,041      |
| その他未払費用                        | 400,368         |
| (C)純資産総額(A-B)                  | 77,272,254,300  |
| 元本                             | 14,489,412,154  |
| 次期繰越損益金                        | 62,782,842,146  |
| (D)受益権総口数                      | 14,489,412,154口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)                | 53,330円         |

|           |                 |
|-----------|-----------------|
| (注) 期首元本額 | 13,396,036,268円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,813,533,359円  |
| 期中一部解約元本額 | 1,720,157,473円  |

## 損益の状況

当期(2025年2月22日～2026年2月24日)

| 項目              | 当期                |
|-----------------|-------------------|
| (A)配当等収益        | 15,225,073円       |
| 受取利息            | 15,225,073        |
| (B)有価証券売買損益     | 13,808,703,037    |
| 売益              | 14,895,888,391    |
| 買損              | △ 1,087,185,354   |
| (C)信託報酬等        | △ 101,995,861     |
| (D)当期損益金(A+B+C) | 13,721,932,249    |
| (E)前期繰越損益金      | 14,136,368,243    |
| (分配準備積立金)       | ( 14,136,368,243) |
| (F)追加信託差損益金*    | 34,924,541,654    |
| (配当等相当額)        | ( 31,795,596,319) |
| (売買損益相当額)       | ( 3,128,945,335)  |
| (G)合計(D+E+F)    | 62,782,842,146    |
| 次期繰越損益金(G)      | 62,782,842,146    |
| 追加信託差損益金        | 34,924,541,654    |
| (配当等相当額)        | ( 31,795,596,319) |
| (売買損益相当額)       | ( 3,128,945,335)  |
| 分配準備積立金         | 27,858,300,492    |

- (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     | 15,112,878円     |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 13,706,819,371円 |
| (c) 信託約款に定める収益調整金   | 34,924,541,654円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金 | 14,136,368,243円 |
| (e) 分配対象額(a+b+c+d)  | 62,782,842,146円 |
| (f) 分配対象額(1万口当たり)   | 43,330.15円      |
| (g) 分配金             | 0円              |
| (h) 分配金(1万口当たり)     | 0円              |

# お知らせ

## ■運用報告書の電子交付について

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更され、書面交付またはデジタル交付いずれかを選択できるようになりました。本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献につながるものととらえています。今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供も進めていきます。

(2025年4月1日)

## ■各ファンドの約款変更

運用報告書に関する記載の変更を行うため関連条項に所要の変更を行いました。

(2025年4月1日)

# 運用者情報

## ■当社運用担当者情報について

・当社の運用担当者情報はHP上よりご確認ください。

## ■DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）



<https://www.nam.co.jp/fundinfo/nwsf/main.html>

## ■DCニッセイワールドセレクトファンド（債券重視型）（確定拠出年金向け）



<https://www.nam.co.jp/fundinfo/dcnwsf/main.html>

## ■DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）



[https://www.nam.co.jp/fundinfo/nwsf\\_50/main.html](https://www.nam.co.jp/fundinfo/nwsf_50/main.html)

■ DCニッセイワールドセレクトファンド（標準型）（確定拠出年金向け）



[https://www.nam.co.jp/fundinfo/dcnwsf\\_50/main.html](https://www.nam.co.jp/fundinfo/dcnwsf_50/main.html)

■ DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）



[https://www.nam.co.jp/fundinfo/nwsf\\_70/main.html](https://www.nam.co.jp/fundinfo/nwsf_70/main.html)

■ DCニッセイワールドセレクトファンド（株式重視型）（確定拠出年金向け）



[https://www.nam.co.jp/fundinfo/dcnwsf\\_70/main.html](https://www.nam.co.jp/fundinfo/dcnwsf_70/main.html)

# 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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>・株式への投資割合には、制限を設けません。<br>・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。<br>・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りです。  |   |  |
|        |  | 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。<br>・株式への投資割合には、制限を設けません。<br>・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。<br>・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。<br>・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 26 期

(計算期間：2025年2月21日～2026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。



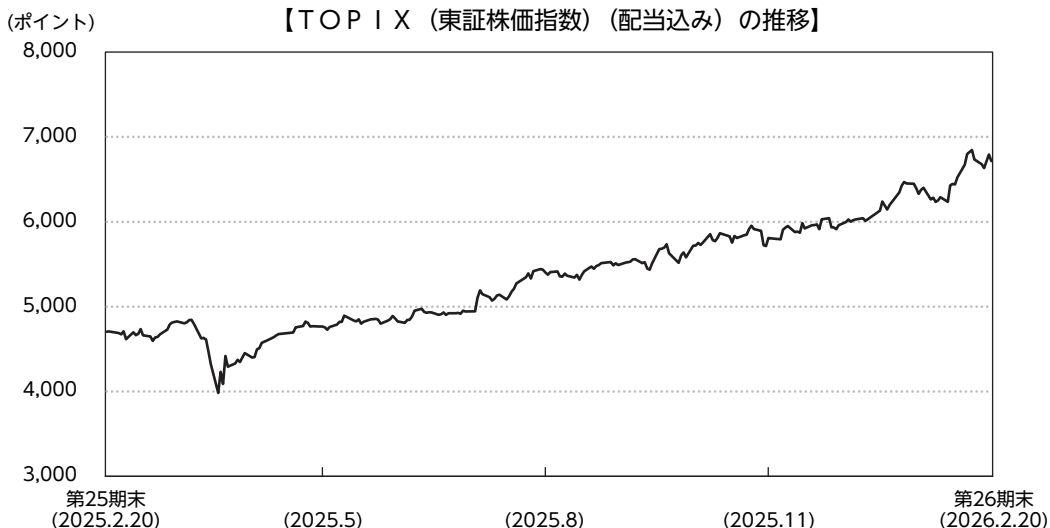
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2025年2月21日～2026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。

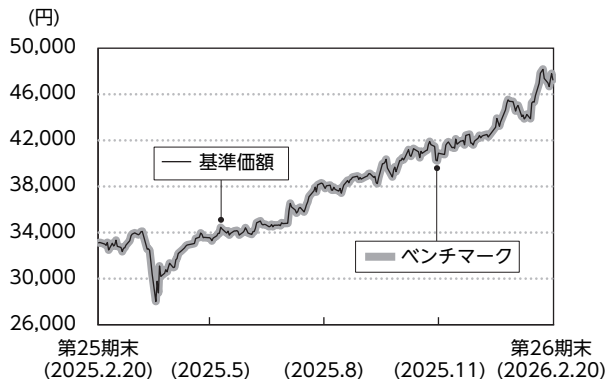
国内株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、トランプ米大統領の関税政策への警戒感や地政学リスクの高まりから株価は軟調に推移しました。2025年4月には米国の相互関税策による世界経済の混乱懸念から一時急落しましたが、対米関税交渉の進展期待などを背景に投資家の過度なリスク回避姿勢が和らぎ、株価は上昇しました。

5月以降は各国の対米関税交渉の進展期待や地政学リスクの後退、米連邦準備制度理事会（FRB）による早期利下げ観測の高まりなどが好感され、株価は上昇基調で推移しました。日米関税交渉合意や堅調な企業業績、旺盛な人工知能（AI）関連投資需要なども株価を押し上げました。10月には高市新政権の拡張的な財政政策への期待感が追い風となり、株価は大きく上昇しました。

11月から12月にかけてはAI・半導体関連銘柄への高値警戒感などから調整する場面もありましたが、2026年1月以降は衆院選での自民党大勝を受け、高市政権の積極財政政策への期待感などから株価は大幅に上昇し、期初を大きく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。

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+42.7%となり、ベンチマーク騰落率(+42.7%)に連動しました。

## 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

運用報告書に関する記載の変更を行うため関連条項に所要の変更を行いました。

(2025年4月1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     |
| 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 |
| 25期(2025年2月20日) | 33,113 | 6.3   |  | 33,486 | 6.3   |  | 98.4   | 1.7    | 291,269 |
| 26期(2026年2月20日) | 47,244 | 42.7  |  | 47,798 | 42.7  |  | 98.1   | 1.9    | 426,059 |

(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)2025年2月20日 | 33,113 | -    |     | 33,486 | -    |     | 98.4   | 1.7    |
| 2月末            | 32,485 | △    | 1.9 | 32,855 | △    | 1.9 | 98.2   | 1.7    |
| 3月末            | 32,555 | △    | 1.7 | 32,928 | △    | 1.7 | 96.8   | 3.1    |
| 4月末            | 32,661 | △    | 1.4 | 33,037 | △    | 1.3 | 97.2   | 2.9    |
| 5月末            | 34,325 | 3.7  |     | 34,723 | 3.7  |     | 96.9   | 3.1    |
| 6月末            | 35,000 | 5.7  |     | 35,404 | 5.7  |     | 97.5   | 2.6    |
| 7月末            | 36,111 | 9.1  |     | 36,527 | 9.1  |     | 97.9   | 2.2    |
| 8月末            | 37,740 | 14.0 |     | 38,176 | 14.0 |     | 98.2   | 1.9    |
| 9月末            | 38,867 | 17.4 |     | 39,313 | 17.4 |     | 97.4   | 2.7    |
| 10月末           | 41,278 | 24.7 |     | 41,749 | 24.7 |     | 97.1   | 2.9    |
| 11月末           | 41,862 | 26.4 |     | 42,344 | 26.5 |     | 97.1   | 3.1    |
| 12月末           | 42,290 | 27.7 |     | 42,781 | 27.8 |     | 97.0   | 3.1    |
| 2026年1月末       | 44,245 | 33.6 |     | 44,758 | 33.7 |     | 97.7   | 2.3    |
| (期末)2026年2月20日 | 47,244 | 42.7 |     | 47,798 | 42.7 |     | 98.1   | 1.9    |

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2025年2月21日～2026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<br>(株式) | 0円<br>(0) | 0.001%<br>(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<br>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)           |   |
| 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（37,703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

2025年2月21日～2026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         |
|    |    | 16,145   | 31,743,650 | 9,946 | 16,333,420 |
|    |    | (14,602) |            |       |            |

(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 |
|     | 67,336 | 67,511 | －     | －   |

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2025年2月21日～2026年2月20日

## 株式

| 買付                |     |         |        | 売付                        |       |         |       |
|-------------------|-----|---------|--------|---------------------------|-------|---------|-------|
| 銘柄                | 株数  | 金額      | 平均単価   | 銘柄                        | 株数    | 金額      | 平均単価  |
|                   | 千株  | 千円      | 円      |                           | 千株    | 千円      | 円     |
| トヨタ自動車            | 276 | 809,841 | 2,931  | NTTデータグループ                | 200   | 796,264 | 3,963 |
| 三井住友フィナンシャルグループ   | 191 | 799,875 | 4,185  | ニデック                      | 341   | 668,339 | 1,956 |
| 三菱重工業             | 189 | 766,926 | 4,044  | S C S K                   | 64    | 361,149 | 5,642 |
| 三菱商事              | 220 | 761,923 | 3,449  | NTT                       | 2,052 | 323,072 | 157   |
| ソニーグループ           | 179 | 692,052 | 3,861  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ         | 141   | 305,025 | 2,161 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 319 | 676,381 | 2,117  | MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 88    | 301,509 | 3,399 |
| ファーストリテイリング       | 12  | 613,235 | 49,058 | 本田技研工業                    | 174   | 275,191 | 1,577 |
| みずほフィナンシャルグループ    | 121 | 598,538 | 4,942  | 日本電気                      | 46    | 251,119 | 5,435 |
| 東京海上ホールディングス      | 89  | 519,197 | 5,814  | 日本郵政                      | 177   | 249,667 | 1,405 |
| 日立製作所             | 110 | 505,111 | 4,558  | テクノプロ・ホールディングス            | 47    | 230,560 | 4,823 |

(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

2026年2月20日現在

(1) 国内株式  
上場株式

| 銘柄                  | 期首(前期末) |     | 当期末 |           |
|---------------------|---------|-----|-----|-----------|
|                     | 株数      | 株数  | 株数  | 評価額       |
|                     | 千株      | 千株  | 千株  | 千円        |
| <b>水産・農林業(0.1%)</b> |         |     |     |           |
| 極洋                  | 4       | 4   | 4   | 24,104    |
| ニッセイ                | 102     | 99  | 99  | 146,561   |
| マルハニチロ              | 15      | 52  | 52  | 78,777    |
| ユキグニファクトリー          | 8       | 9   | 9   | 10,183    |
| カネコ種苗               | 2       | 2   | 2   | 4,233     |
| サカタのタネ              | 12      | 13  | 13  | 56,034    |
| ホクト                 | 9       | 9   | 9   | 19,215    |
| <b>鉱業(0.4%)</b>     |         |     |     |           |
| 住石ホールディングス          | 12      | 9   | 9   | 8,526     |
| 日鉄鉱業                | 4       | 20  | 20  | 76,598    |
| I N P E X           | 311     | 365 | 365 | 1,342,105 |
| 石油資源開発              | 56      | 67  | 67  | 158,154   |
| K & O エナジーグループ      | 4       | 4   | 4   | 25,333    |

| 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        |
| <b>建設業(2.6%)</b> |         |    |     |           |
| ショーボンドホールディングス   | 13      | 63 | 63  | 89,281    |
| ミライト・ワン          | 33      | 37 | 37  | 144,244   |
| タマホーム            | 6       | 6  | 6   | 26,486    |
| 第一カッター興業         | 4       | 6  | 6   | 10,771    |
| 安藤・間             | 59      | 57 | 57  | 121,862   |
| 東急建設             | 32      | 34 | 34  | 52,836    |
| コムシスホールディングス     | 36      | 38 | 38  | 213,380   |
| ビーアールホールディングス    | 20      | 26 | 26  | 14,044    |
| 高松コンストラクショングループ  | 7       | 8  | 8   | 31,873    |
| 東建コーポレーション       | 2       | 2  | 2   | 34,155    |
| ヤマウラ             | 5       | 6  | 6   | 10,342    |
| オリエンタル白石         | 38      | 40 | 40  | 16,884    |
| 大成建設             | 65      | 56 | 56  | 1,067,556 |

## 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            | 237     | 245 | 1,021,222 |
| 清水建設           | 196     | 207 | 717,325   |
| 長谷工コーポレーション    | 66      | 67  | 221,909   |
| 松井建設           | 4       | 6   | 11,457    |
| 鹿島建設           | 159     | 168 | 1,194,531 |
| 不動テトラ          | 4       | 4   | 16,297    |
| 鉄建建設           | 4       | 4   | 22,608    |
| 西松建設           | 11      | 12  | 80,005    |
| 三井住友建設         | 58      | -   | -         |
| 大豊建設           | 2       | -   | -         |
| 奥村組            | 12      | 12  | 86,715    |
| 東鉄工業           | 7       | 8   | 43,008    |
| 浅沼組            | 28      | 30  | 34,504    |
| 戸田建設           | 88      | 93  | 142,914   |
| 熊谷組            | 11      | 45  | 89,496    |
| 矢作建設工業         | 9       | 14  | 35,102    |
| ピーエス・コンストラクション | 5       | 6   | 23,218    |
| 日本ハウスホールディングス  | 21      | 29  | 9,399     |
| 新日本建設          | 10      | 10  | 22,042    |
| 東亜道路工業         | 12      | 11  | 21,902    |
| 日本道路           | 7       | -   | -         |
| 東亜建設工業         | 21      | 28  | 114,367   |
| 日本国土開発         | 23      | 23  | 15,634    |
| 若築建設           | 2       | 2   | 11,109    |
| 東洋建設           | 20      | -   | -         |
| 五洋建設           | 94      | 107 | 220,181   |
| 世紀東急工業         | 10      | 11  | 20,003    |
| 福田組            | 2       | 2   | 19,136    |
| 住友林業           | 62      | 197 | 348,530   |
| 大和ハウス工業        | 217     | 210 | 1,160,356 |
| ライト工業          | 14      | 14  | 59,160    |
| 積水ハウス          | 218     | 230 | 865,817   |
| 日特建設           | 6       | 7   | 10,161    |
| ユアテック          | 13      | 16  | 49,520    |
| 日本リーテック        | 5       | 5   | 18,260    |
| 四電工            | 9       | 9   | 19,104    |
| 中電工            | 11      | 10  | 49,692    |
| 関電工            | 39      | 41  | 278,889   |
| きんでん           | 50      | 52  | 421,984   |
| 東京エネシス         | 7       | 7   | 13,639    |
| トーエネック         | 11      | 14  | 32,942    |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当期末 |         |
|------------------|---------|-----|---------|
|                  | 株数      | 株数  | 評価額     |
|                  | 千株      | 千株  | 千円      |
| 住友電設             | 5       | -   | -       |
| 日本電設工業           | 13      | 14  | 70,928  |
| エクシオグループ         | 74      | 72  | 208,833 |
| 新日本空調            | 9       | 9   | 38,511  |
| クラフティア           | 15      | 16  | 161,786 |
| 三機工業             | 15      | 15  | 117,312 |
| 日揮ホールディングス       | 71      | 82  | 197,560 |
| 中外炉工業            | 2       | 2   | 10,437  |
| 太平電業             | 4       | 15  | 41,177  |
| 高砂熱学工業           | 17      | 40  | 203,255 |
| 朝日工業社            | 6       | 7   | 36,142  |
| 明星工業             | 12      | 12  | 24,832  |
| 大気社              | 9       | 19  | 73,515  |
| ダイダン             | 9       | 44  | 145,420 |
| 日比谷総合設備          | 5       | 5   | 35,035  |
| 飛島ホールディングス       | 7       | 7   | 19,585  |
| テスホールディングス       | 22      | 23  | 12,555  |
| インフロニア・ホールディングス  | 75      | 79  | 204,550 |
| 東洋エンジニアリング       | 10      | 11  | 34,272  |
| レイズネクスト          | 10      | 11  | 28,358  |
| <b>食料品(2.7%)</b> |         |     |         |
| ニッポン             | 23      | 27  | 76,140  |
| 日清製粉グループ本社       | 75      | 75  | 161,264 |
| 日東富士製粉           | 1       | 1   | 10,024  |
| 昭和産業             | 6       | 6   | 22,002  |
| 中部飼料             | 10      | 9   | 18,750  |
| フィード・ワン          | 10      | 10  | 12,560  |
| 日本甜菜製糖           | 3       | 3   | 14,239  |
| DM三井製糖           | 7       | 6   | 22,144  |
| ウェルネオシュガー        | 4       | 4   | 12,921  |
| 森永製菓             | 30      | 30  | 84,225  |
| 中村屋              | 2       | 3   | 9,705   |
| 江崎グリコ            | 20      | 21  | 127,922 |
| me i t o         | 3       | -   | -       |
| 井村屋グループ          | 4       | 4   | 10,533  |
| 不二家              | 5       | 5   | 12,792  |
| 山崎製パン            | 48      | 51  | 172,922 |
| モロゾフ             | 7       | 7   | 11,100  |
| 亀田製菓             | 4       | 4   | 21,045  |
| 寿スブリッツ           | 42      | 40  | 80,306  |
| カルビー             | 33      | 34  | 105,677 |

## 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        |
| 森永乳業               | 26      | 28  | 131,435   |
| 六甲バター              | 6       | 8   | 9,568     |
| ヤクルト本社             | 103     | 105 | 273,539   |
| 明治ホールディングス         | 93      | 106 | 410,491   |
| 雪印メグミルク            | 19      | 20  | 71,237    |
| プリマハム              | 9       | 10  | 29,138    |
| 日本ハム               | 31      | 28  | 198,202   |
| 丸大食品               | 7       | 7   | 18,202    |
| S Foods            | 8       | 8   | 26,712    |
| 柿安本店               | 3       | 3   | 9,805     |
| 伊藤ハム米久ホールディングス     | 11      | 13  | 82,593    |
| サッポロホールディングス       | 23      | 114 | 198,079   |
| アサヒグループホールディングス    | 542     | 573 | 979,312   |
| キリンホールディングス        | 301     | 318 | 839,043   |
| シマダヤ               | 4       | 2   | 4,422     |
| 宝ホールディングス          | 48      | 62  | 97,337    |
| オエノンホールディングス       | 23      | 22  | 10,579    |
| 養命酒製造              | -       | 2   | 11,200    |
| カ・コ・ラ ホラズヤホールディングス | 45      | 49  | 202,428   |
| ライフドリンク カンパニー      | 15      | 13  | 17,823    |
| サントリー食品インターナショナル   | 50      | 53  | 261,304   |
| グアールグループホールディングス   | 8       | 8   | 21,801    |
| 伊藤園                | 24      | 24  | 73,902    |
| キーコーヒー             | 8       | 8   | 17,096    |
| 日清オイリオグループ         | 10      | 10  | 63,828    |
| 不二製油               | 14      | 15  | 59,568    |
| J-オイルミルズ           | 8       | 8   | 17,739    |
| キッコーマン             | 239     | 252 | 375,050   |
| 味の素                | 167     | 379 | 1,744,158 |
| ブルドックソース           | 4       | 5   | 9,530     |
| キューピー              | 38      | 41  | 182,942   |
| ハウス食品グループ本社        | 24      | 28  | 87,373    |
| カゴメ                | 30      | 39  | 111,493   |
| アリアケジャパン           | 7       | 8   | 51,600    |
| エバラ食品工業            | 2       | 3   | 9,723     |
| ニチレイ               | 28      | 67  | 139,500   |
| 東洋水産               | 33      | 35  | 424,800   |
| イトアドホールディングス       | 3       | 4   | 9,568     |
| 日清食品ホールディングス       | 91      | 86  | 278,662   |
| フジッコ               | 7       | 8   | 14,120    |
| ロック・フィールド          | 8       | 8   | 11,968    |
| 日本たばこ産業            | 439     | 463 | 2,733,762 |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当期末 |         |
|--------------------|---------|-----|---------|
|                    | 株数      | 株数  | 評価額     |
|                    | 千株      | 千株  | 千円      |
| ケンコーマヨネーズ          | 4       | 4   | 10,776  |
| わらべや日洋ホールディングス     | 4       | 5   | 17,595  |
| なとり                | 4       | 5   | 9,670   |
| ファーマフーズ            | 9       | 13  | 8,757   |
| ユーグレナ              | 44      | 51  | 19,827  |
| 紀文食品               | 6       | 8   | 9,331   |
| ビックルスホールディングス      | 6       | -   | -       |
| オリオンビール            | -       | 12  | 16,675  |
| 理研ビタミン             | 6       | 6   | 20,100  |
| <b>繊維製品(0.4%)</b>  |         |     |         |
| 片倉工業               | 6       | 8   | 25,379  |
| グンゼ                | 5       | 12  | 55,620  |
| ユニチカ               | -       | 26  | 33,124  |
| 富士紡ホールディングス        | 2       | 3   | 37,476  |
| 倉敷紡績               | 4       | 5   | 52,704  |
| シキボウ               | 6       | 8   | 9,674   |
| 日本毛織               | 18      | 19  | 38,955  |
| 帝国繊維               | 8       | 8   | 23,488  |
| 帝人                 | 70      | 68  | 113,168 |
| 東レ                 | 537     | 523 | 669,428 |
| セーレン               | 14      | 16  | 60,671  |
| 小松マテーレ             | 10      | 2   | 2,033   |
| ワコールホールディングス       | 15      | 15  | 68,354  |
| ホギメディカル            | 9       | 8   | 56,865  |
| T S Iホールディングス      | 23      | 23  | 26,502  |
| ワールド               | 11      | 12  | 42,240  |
| 三陽商会               | 3       | 3   | 16,280  |
| オンワードホールディングス      | 47      | 45  | 36,285  |
| ルックホールディングス        | 3       | 3   | 9,458   |
| ゴールドウイン            | 13      | 45  | 109,868 |
| <b>パルプ・紙(0.1%)</b> |         |     |         |
| 特種東海製紙             | 3       | 13  | 22,684  |
| 王子ホールディングス         | 278     | 294 | 285,747 |
| 日本製紙               | 38      | 43  | 54,574  |
| 北越コーポレーション         | 41      | 43  | 39,806  |
| 大王製紙               | 37      | 39  | 43,864  |
| レンゴー               | 66      | 78  | 119,830 |
| トーモク               | 4       | 4   | 16,312  |
| ザ・パック              | 5       | 15  | 20,155  |
| <b>化学(4.6%)</b>    |         |     |         |
| 北の達人コーポレーション       | 41      | 65  | 8,918   |
| 東洋紡                | 31      | 33  | 53,592  |

## 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        |
| クラレ            | 98      | 98  | 176,023   |
| 旭化成            | 497     | 514 | 895,578   |
| レゾナック・ホールディングス | 66      | 75  | 841,500   |
| 住友化学           | 591     | 624 | 354,886   |
| 住友精化           | 3       | 3   | 21,984    |
| 日産化学           | 37      | 39  | 259,921   |
| ラサ工業           | 2       | 2   | 24,625    |
| クレハ            | 15      | 11  | 55,274    |
| 多木化学           | 2       | 3   | 11,490    |
| テイカ            | 5       | 6   | 10,735    |
| 石原産業           | 12      | 12  | 50,955    |
| 日本曹達           | 15      | 16  | 67,897    |
| 東ソー            | 98      | 113 | 298,584   |
| トクヤマ           | 23      | 27  | 113,396   |
| セントラル硝子        | 9       | 9   | 41,307    |
| 東亜合成           | 34      | 31  | 57,325    |
| 大阪ソーダ          | 25      | 27  | 64,633    |
| 関東電化工業         | 15      | 15  | 24,870    |
| デンカ            | 26      | 30  | 100,531   |
| 信越化学工業         | 654     | 690 | 3,970,950 |
| 日本カーバイド工業      | 3       | 3   | 11,400    |
| 堺化学工業          | 5       | 6   | 23,904    |
| 第一稀元素化学工業      | 9       | 7   | 19,500    |
| エア・ウォーター       | 69      | 73  | 154,039   |
| 日本酸素ホールディングス   | 71      | 87  | 511,402   |
| 日本化学工業         | -       | 3   | 10,555    |
| 日本パーカライジング     | 32      | 38  | 59,942    |
| 高圧ガス工業         | 10      | 11  | 12,543    |
| 四国化成ホールディングス   | 8       | 8   | 45,408    |
| ステラ ケミファ       | 4       | 4   | 21,689    |
| 保土谷化学工業        | 2       | 4   | 11,343    |
| 日本触媒           | 47      | 47  | 117,181   |
| 大日精化工業         | 5       | 5   | 25,890    |
| カネカ            | 18      | 19  | 97,448    |
| 三菱瓦斯化学         | 59      | 55  | 243,156   |
| 三井化学           | 66      | 139 | 323,195   |
| 東京応化工業         | 35      | 37  | 342,692   |
| 大阪有機化学工業       | 6       | 6   | 29,412    |
| 三菱ケミカルグループ     | 537     | 543 | 607,137   |
| KHネオケム         | 13      | 12  | 38,532    |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当期末 |           |
|----------------|---------|-----|-----------|
|                | 株数      | 株数  | 評価額       |
|                | 千株      | 千株  | 千円        |
| ダイセル           | 83      | 85  | 138,627   |
| 住友ベークライト       | 23      | 27  | 157,406   |
| 積水化学工業         | 146     | 162 | 484,167   |
| 日本ゼオン          | 56      | 56  | 114,198   |
| アイカ工業          | 18      | 19  | 75,126    |
| UBE            | 37      | 40  | 112,080   |
| 積水樹脂           | 9       | 9   | 20,773    |
| 旭有機材           | 4       | 5   | 25,974    |
| ニチバン           | 4       | 4   | 9,340     |
| リケンテクノス        | 13      | 13  | 23,195    |
| 大倉工業           | 3       | 4   | 19,940    |
| 積水化成成品工業       | 19      | 22  | 11,033    |
| 群栄化学工業         | 2       | -   | -         |
| ダイキョーニシカワ      | 16      | 16  | 15,015    |
| 森六             | 4       | 4   | 10,613    |
| 恵和             | 6       | 7   | 9,261     |
| 日本化薬           | 49      | 55  | 107,222   |
| カーリット          | 7       | 6   | 17,882    |
| 日本精化           | 4       | 4   | 12,950    |
| 扶桑化学工業         | 6       | 8   | 75,440    |
| トリケミカル研究所      | 8       | 9   | 32,618    |
| ADEKA          | 25      | 30  | 136,714   |
| 日油             | 86      | 89  | 264,627   |
| ハリマ化成グループ      | 8       | 10  | 10,383    |
| 花王             | 179     | 184 | 1,201,068 |
| 第一工業製薬         | 2       | 3   | 35,061    |
| 石原ケミカル         | 3       | 4   | 11,084    |
| 三洋化成工業         | 4       | 4   | 28,224    |
| 大日本塗料          | 8       | 8   | 12,564    |
| 日本ペイントホールディングス | 325     | 412 | 477,559   |
| 関西ペイント         | 61      | 61  | 168,894   |
| 中国塗料           | 16      | 15  | 73,060    |
| 藤倉化成           | 13      | 12  | 12,668    |
| 太陽ホールディングス     | 12      | 37  | 223,427   |
| DIC            | 26      | 27  | 119,066   |
| サカティンクス        | 16      | 17  | 46,727    |
| artience       | 13      | 14  | 60,736    |
| 富士フィルムホールディングス | 444     | 468 | 1,406,400 |
| 資生堂            | 153     | 150 | 463,559   |
| ライオン           | 93      | 89  | 155,564   |

## 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        |
| 高砂香料工業           | 5       | 29  | 40,442    |
| マンダム             | 14      | 16  | 51,996    |
| ミルボン             | 11      | 12  | 33,135    |
| コーセーホールディングス     | 15      | 17  | 106,726   |
| コタ               | 7       | 8   | 11,068    |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 37      | 39  | 54,164    |
| ノエビアホールディングス     | 6       | 6   | 31,809    |
| 新日本製薬            | 4       | 4   | 9,604     |
| エステー             | 6       | 7   | 11,242    |
| コニシ              | 23      | 24  | 32,903    |
| 長谷川香料            | 14      | 14  | 42,465    |
| 小林製薬             | 19      | 20  | 114,954   |
| 荒川化学工業           | 6       | 7   | 10,569    |
| メック              | 6       | 5   | 39,786    |
| 日本高純度化学          | 2       | 1   | 8,976     |
| タカラバイオ           | 23      | 20  | 23,993    |
| JCU              | 8       | 8   | 56,610    |
| デクセリアルズ          | 64      | 66  | 157,771   |
| アース製薬            | 6       | 7   | 34,932    |
| 北興化学工業           | 6       | 5   | 10,208    |
| 大成ラミックグループ       | 2       | 3   | 9,637     |
| クミアイ化学工業         | 29      | 34  | 24,671    |
| 日本農薬             | 11      | 11  | 12,102    |
| アキレス             | 4       | 6   | 10,923    |
| 有沢製作所            | 11      | 13  | 34,680    |
| 日東電工             | 232     | 236 | 855,626   |
| レック              | 9       | -   | -         |
| 三光合成             | 10      | 9   | 9,976     |
| ZACROS           | 5       | 24  | 34,513    |
| 前澤化成工業           | 5       | 5   | 11,600    |
| 未来工業             | 2       | 3   | 12,635    |
| JSP              | 6       | 5   | 15,312    |
| エフピコ             | 16      | 14  | 40,777    |
| 天馬               | 6       | -   | -         |
| 信越ポリマー           | 15      | 16  | 36,069    |
| ニフコ              | 27      | 29  | 151,116   |
| バルカー             | 5       | 6   | 32,500    |
| ユニ・チャーム          | 460     | 486 | 517,590   |
| <b>医薬品(3.8%)</b> |         |     |           |
| 協和キリン            | 86      | 91  | 253,954   |
| 武田薬品工業           | 655     | 691 | 4,006,101 |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当期末   |           |
|----------------------|---------|-------|-----------|
|                      | 株数      | 株数    | 評価額       |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |
| アステラス製薬              | 645     | 682   | 1,688,973 |
| 住友ファーマ               | 65      | 69    | 171,304   |
| 塩野義製薬                | 244     | 283   | 1,034,086 |
| 日本新薬                 | 19      | 20    | 102,306   |
| 中外製薬                 | 230     | 243   | 2,416,962 |
| 科研製薬                 | 12      | 11    | 49,105    |
| エーザイ                 | 96      | 101   | 519,071   |
| ロート製薬                | 77      | 82    | 195,389   |
| 小野薬品工業               | 150     | 173   | 454,136   |
| 久光製薬                 | 16      | 17    | 104,939   |
| 持田製薬                 | 9       | 9     | 35,910    |
| 参天製薬                 | 133     | 130   | 224,452   |
| 扶桑薬品工業               | 2       | 4     | 9,786     |
| ツムラ                  | 25      | 26    | 108,161   |
| キッセイ薬品工業             | 11      | 12    | 57,475    |
| 生化学工業                | 14      | 4     | 3,325     |
| 栄研化学                 | 11      | 11    | 33,550    |
| 鳥居薬品                 | 4       | -     | -         |
| JCRファーマ              | 24      | 33    | 22,916    |
| 東和薬品                 | 9       | 10    | 45,255    |
| 富士製薬工業               | 5       | 5     | 13,920    |
| ゼリア新薬工業              | 11      | 10    | 22,963    |
| ネクスラファーマ             | 34      | 34    | 30,587    |
| 第一三共                 | 695     | 713   | 2,083,517 |
| 杏林製薬                 | 16      | 15    | 26,317    |
| ダイト                  | 5       | 9     | 13,536    |
| 大塚ホールディングス           | 181     | 173   | 1,839,384 |
| ペプチドリーム              | 35      | 37    | 51,215    |
| セルソース                | 8       | 23    | 9,447     |
| あすか製薬ホールディングス        | 6       | 7     | 18,652    |
| サワイグループホールディングス      | 43      | 40    | 95,093    |
| <b>石油・石炭製品(0.6%)</b> |         |       |           |
| 日本コークス工業             | 74      | 76    | 9,535     |
| ニチレキグループ             | 7       | 8     | 20,036    |
| ユシロ                  | 3       | 4     | 12,380    |
| 富士石油                 | 18      | -     | -         |
| 出光興産                 | 344     | 336   | 476,368   |
| ENEOSホールディングス        | 1,249   | 1,098 | 1,599,561 |
| コスモエネルギーホールディングス     | 24      | 43    | 206,578   |
| <b>ゴム製品(0.6%)</b>    |         |       |           |
| 横浜ゴム                 | 37      | 43    | 346,418   |

## 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        |
| TOYO TIRE             | 42      | 49    | 232,488   |
| ブリヂストン                | 215     | 455   | 1,647,824 |
| 住友ゴム工業                | 72      | 83    | 227,788   |
| 藤倉コンポジット              | 7       | 6     | 16,672    |
| オカモト                  | 3       | 4     | 22,878    |
| フコク                   | 4       | 4     | 8,822     |
| ニッタ                   | 7       | 7     | 33,744    |
| 住友理工                  | 14      | -     | -         |
| 三ツ星ベルト                | 10      | 9     | 41,382    |
| バンドー化学                | 10      | 11    | 26,772    |
| <b>ガラス・土石製品(0.7%)</b> |         |       |           |
| 日東紡績                  | 8       | 9     | 207,760   |
| AGC                   | 71      | 75    | 475,826   |
| 日本板硝子                 | 37      | 43    | 25,936    |
| 日本電気硝子                | 27      | 26    | 160,680   |
| オハラ                   | 6       | 8     | 10,270    |
| 住友大阪セメント              | 12      | 13    | 57,317    |
| 太平洋セメント               | 45      | 48    | 223,056   |
| 日本ヒューム                | 6       | 13    | 21,583    |
| 日本コンクリート工業            | 19      | 27    | 9,737     |
| 三谷セキサン                | 2       | 3     | 23,264    |
| アジアパイルホールディングス        | 10      | 12    | 18,246    |
| 東海カーボン                | 67      | 78    | 81,588    |
| 日本カーボン                | 4       | 4     | 21,915    |
| 東洋炭素                  | 5       | 6     | 40,066    |
| ノリタケ                  | 8       | 8     | 56,052    |
| TOTO                  | 53      | 48    | 298,599   |
| 日本碍子                  | 81      | 86    | 373,334   |
| 日本特殊陶業                | 60      | 63    | 494,855   |
| MARUWA                | 3       | 3     | 176,256   |
| 品川リフラ                 | 9       | 9     | 22,924    |
| 黒崎播磨                  | 5       | 6     | 26,491    |
| ヨータイ                  | 0.100   | -     | -         |
| フジインコーポレーテッド          | 19      | 23    | 74,560    |
| ニチアス                  | 18      | 21    | 187,682   |
| ニチハ                   | 9       | 9     | 32,850    |
| <b>鉄鋼(0.8%)</b>       |         |       |           |
| 日本製鉄                  | 383     | 2,181 | 1,469,775 |
| 神戸製鋼所                 | 152     | 160   | 367,978   |
| 中山製鋼所                 | 15      | 16    | 10,230    |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当期末 |           |
|-------------------|---------|-----|-----------|
|                   | 株数      | 株数  | 評価額       |
|                   | 千株      | 千株  | 千円        |
| 合同製鐵              | 4       | 4   | 18,112    |
| JFEホールディングス       | 228     | 259 | 583,745   |
| 東京製鐵              | 21      | 22  | 35,256    |
| 共英製鋼              | 7       | 9   | 23,341    |
| 大和工業              | 14      | 14  | 183,672   |
| 東京製鋼              | 3       | 3   | 20,691    |
| 大阪製鐵              | 3       | 3   | 9,420     |
| ヨドコウ              | 7       | 46  | 64,816    |
| 中部鋼鈑              | 5       | 7   | 18,790    |
| 丸一鋼管              | 23      | 80  | 127,594   |
| モリ工業              | 1       | 9   | 9,327     |
| 大同特殊鋼             | 47      | 56  | 122,472   |
| 日本冶金工業            | 5       | 5   | 27,324    |
| 山陽特殊製鋼            | 7       | -   | -         |
| 愛知製鋼              | 4       | 15  | 49,500    |
| 大平洋金属             | 7       | 6   | 21,012    |
| 新日本電工             | 45      | 43  | 18,702    |
| 栗本鐵工所             | 3       | 18  | 31,824    |
| 三菱製鋼              | 5       | 5   | 11,132    |
| 日本精線              | 6       | 7   | 10,388    |
| エンビプロ・ホールディングス    | 7       | 3   | 3,196     |
| <b>非鉄金属(2.2%)</b> |         |     |           |
| JX金属              | -       | 222 | 752,696   |
| 大紀アルミニウム工業所       | 10      | 11  | 16,222    |
| 日本軽金属ホールディングス     | 22      | 23  | 69,451    |
| 三井金属              | 19      | 20  | 625,800   |
| 東邦亜鉛              | -       | 6   | 10,210    |
| 三菱マテリアル           | 54      | 53  | 279,655   |
| 住友金属鉱山            | 95      | 109 | 1,097,096 |
| DOWAホールディングス      | 20      | 21  | 219,024   |
| 古河機械金属            | 10      | 9   | 54,625    |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ    | 13      | 13  | 37,335    |
| 東邦チタニウム           | 15      | 14  | 27,477    |
| UACJ              | 10      | 48  | 120,032   |
| CKサンエツ            | 1       | 1   | 8,227     |
| 古河電気工業            | 25      | 26  | 620,711   |
| 住友電気工業            | 261     | 276 | 2,692,397 |
| フジクラ              | 81      | 102 | 2,356,410 |
| SWCC              | 10      | 11  | 165,996   |
| 平河ヒューテック          | 4       | 4   | 19,573    |

## 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      |
| リョービ              | 8       | 9   | 27,232  |
| A R Eホールディングス     | 30      | 32  | 137,538 |
| <b>金属製品(0.4%)</b> |         |     |         |
| 稲葉製作所             | 4       | 5   | 8,658   |
| 宮地エンジニアリンググループ    | 9       | 10  | 19,552  |
| トーカロ              | 21      | 23  | 69,092  |
| S U M C O         | 144     | 152 | 245,812 |
| 川田テクノロジーズ         | 4       | 6   | 32,147  |
| R S Technologies  | 5       | 5   | 20,412  |
| 東洋製鐵グループホールディングス  | 48      | 40  | 156,600 |
| ホッカンホールディングス      | 4       | 4   | 10,160  |
| コロナ               | 7       | 9   | 10,201  |
| 横河ブリッジホールディングス    | 13      | 13  | 44,160  |
| 三和ホールディングス        | 74      | 76  | 305,216 |
| 文化シャッター           | 19      | 25  | 51,605  |
| 三協立山              | 11      | 14  | 9,961   |
| アルインコ             | 6       | 8   | 9,660   |
| L I X I L         | 110     | 125 | 228,125 |
| ノーリツ              | 10      | 14  | 33,064  |
| 長府製作所             | 8       | 7   | 16,345  |
| リンナイ              | 40      | 40  | 165,113 |
| 日東精工              | 12      | 13  | 9,971   |
| 岡部                | 13      | 13  | 13,700  |
| ジーテクト             | 8       | 10  | 20,604  |
| 東プレ               | 13      | 14  | 39,888  |
| 高周波熱錬             | 11      | 12  | 17,400  |
| サンコール             | 26      | 9   | 11,191  |
| パイオラックス           | 10      | 8   | 15,308  |
| エイチワン             | 7       | 8   | 11,709  |
| 日本発条              | 67      | 60  | 182,045 |
| 中央発條              | 4       | 5   | 17,498  |
| <b>機械(6.9%)</b>   |         |     |         |
| 日本製鋼所             | 22      | 23  | 237,474 |
| 三浦工業              | 34      | 36  | 106,740 |
| タクマ               | 25      | 23  | 67,500  |
| ツガミ               | 15      | 16  | 64,712  |
| オークマ              | 13      | 13  | 61,855  |
| 芝浦機械              | 9       | 9   | 42,394  |
| アマダ               | 103     | 114 | 287,098 |
| アイダエンジニアリング       | 16      | 14  | 17,153  |
| F U J I           | 32      | 31  | 174,751 |
| 牧野フライス製作所         | 8       | 8   | 93,440  |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当期末 |           |
|----------------|---------|-----|-----------|
|                | 株数      | 株数  | 評価額       |
|                | 千株      | 千株  | 千円        |
| オーエスジー         | 32      | 27  | 78,915    |
| 旭ダイヤモンド工業      | 18      | 18  | 21,563    |
| D M G森精機       | 46      | 53  | 159,058   |
| ソディック          | 19      | 19  | 25,746    |
| ディスコ           | 35      | 37  | 2,792,062 |
| 日東工器           | 3       | 4   | 9,074     |
| 日進工具           | 9       | 10  | 9,838     |
| リケンN P R       | 9       | 9   | 37,080    |
| 島精機製作所         | 11      | 12  | 11,700    |
| オプトラン          | 12      | 12  | 36,378    |
| イワキ            | 4       | 5   | 14,773    |
| フリーユー          | 7       | 9   | 10,856    |
| ヤマシンフィルタ       | 15      | 16  | 9,639     |
| 日阪製作所          | 9       | 9   | 15,198    |
| やまびこ           | 12      | 12  | 48,128    |
| 野村マイクロ・サイエンス   | 12      | 14  | 48,856    |
| 平田機工           | 3       | 11  | 31,897    |
| P E G A S U S  | 14      | 12  | 9,672     |
| タツモ            | 5       | 5   | 13,260    |
| ナプテスコ          | 46      | 44  | 209,951   |
| 三井海洋開発         | 9       | 19  | 292,729   |
| レオン自動機         | 7       | 9   | 14,487    |
| S M C          | 22      | 22  | 1,617,936 |
| ホソカワミクロン       | 5       | 5   | 39,176    |
| ユニオンツール        | 3       | 3   | 49,000    |
| 瑞光             | -       | 9   | 9,259     |
| オイレス工業         | 10      | 9   | 25,171    |
| 日精エー・エス・ビー機械   | 2       | 3   | 25,680    |
| サトー            | 9       | 10  | 25,947    |
| 技研製作所          | 7       | 7   | 16,947    |
| 日本エアーテック       | 6       | 7   | 9,748     |
| 日精樹脂工業         | 7       | 10  | 9,666     |
| ワイエイシイホールディングス | 7       | -   | -         |
| 小松製作所          | 365     | 377 | 2,847,481 |
| 住友重機械工業        | 43      | 46  | 266,410   |
| 日立建機           | 29      | 31  | 204,328   |
| 日工             | 11      | 15  | 12,925    |
| 巴工業            | 2       | 8   | 18,670    |
| 井関農機           | 7       | 7   | 13,913    |
| T O W A        | 22      | 28  | 82,324    |
| 北川鉄工所          | 5       | 5   | 9,492     |
| ローツェ           | 38      | 46  | 159,344   |

## 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        |
| クボタ             | 379     | 396 | 1,206,520 |
| 荏原実業            | 3       | 8   | 23,714    |
| 三菱化工機           | 2       | 8   | 32,536    |
| 月島ホールディングス      | 10      | 10  | 34,965    |
| 帝国電機製作所         | 5       | 5   | 17,064    |
| 新東工業            | 16      | 15  | 18,571    |
| 澁谷工業            | 7       | 7   | 25,842    |
| アイチコーポレーション     | 12      | 13  | 18,252    |
| 小森コーポレーション      | 18      | 18  | 32,271    |
| 鶴見製作所           | 5       | 11  | 24,453    |
| 酒井重工業           | 2       | 4   | 9,576     |
| 荏原製作所           | 152     | 160 | 906,590   |
| 西島製作所           | 6       | 5   | 15,062    |
| A I R M A N     | 7       | 7   | 16,700    |
| ダイキン工業          | 96      | 102 | 2,012,460 |
| オルガノ            | 11      | 10  | 179,496   |
| トーヨーカネツ         | 2       | 6   | 20,085    |
| 栗田工業            | 41      | 47  | 392,090   |
| 椿本チエイン          | 33      | 33  | 88,479    |
| 木村化工機           | 8       | 7   | 11,310    |
| アネスト岩田          | 12      | 14  | 25,433    |
| ダイフク            | 125     | 132 | 835,532   |
| サムコ             | -       | 2   | 13,251    |
| タダノ             | 42      | 41  | 57,613    |
| フジテック           | 23      | 6   | 39,185    |
| C K D           | 20      | 23  | 127,440   |
| 平和              | 24      | 23  | 46,038    |
| 理想科学工業          | 11      | 12  | 15,650    |
| S A N K Y O     | 85      | 82  | 180,100   |
| 日本金銭機械          | 9       | 9   | 11,466    |
| マースグループホールディングス | 5       | 6   | 20,856    |
| ガリレイ            | 10      | 11  | 42,780    |
| ダイコク電機          | 3       | 3   | 10,272    |
| 竹内製作所           | 13      | 14  | 107,352   |
| アマノ             | 21      | 20  | 83,038    |
| ジャノメ            | 7       | 7   | 11,122    |
| マックス            | 8       | 10  | 72,360    |
| グローリー           | 19      | 20  | 81,590    |
| 新晃工業            | 21      | 21  | 30,177    |
| 大和冷機工業          | 11      | 12  | 20,232    |
| セガサミーホールディングス   | 66      | 64  | 156,468   |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当期末   |           |
|--------------------|---------|-------|-----------|
|                    | 株数      | 株数    | 評価額       |
|                    | 千株      | 千株    | 千円        |
| T P R              | 9       | 17    | 24,594    |
| ツバキ・ナカシマ           | 18      | 27    | 9,574     |
| ホシザキ               | 47      | 50    | 266,616   |
| 大豊工業               | 11      | -     | -         |
| 日本精工               | 137     | 145   | 191,762   |
| NTN                | 175     | 207   | 85,613    |
| ジェイテクト             | 66      | 73    | 151,199   |
| 不二越                | 5       | 5     | 30,044    |
| 日本トムソン             | 20      | 21    | 22,492    |
| THK                | 42      | 41    | 209,277   |
| Y U S H I N        | 10      | 12    | 8,831     |
| 前澤給装工業             | 5       | -     | -         |
| イーグル工業             | 8       | 8     | 29,754    |
| P I L L A R        | 6       | 7     | 59,203    |
| キッツ                | 24      | 27    | 61,407    |
| マキタ                | 92      | 97    | 580,601   |
| 三井E & S            | 39      | 38    | 314,701   |
| カナデビア              | 60      | 64    | 69,336    |
| 三菱重工業              | 1,296   | 1,467 | 7,284,151 |
| I H I              | 59      | 408   | 1,789,110 |
| スター精密              | 12      | 4     | 9,231     |
| <b>電気機器(17.8%)</b> |         |       |           |
| キョクシアホールディングス      | 33      | 47    | 974,544   |
| 日清紡ホールディングス        | 55      | 58    | 100,807   |
| イビデン               | 42      | 98    | 897,386   |
| コニカミノルタ            | 165     | 174   | 103,453   |
| ブラザー工業             | 99      | 97    | 300,815   |
| ミネベアミツミ            | 129     | 136   | 450,822   |
| 日立製作所              | 1,909   | 1,992 | 9,822,039 |
| 三菱電機               | 754     | 857   | 5,017,545 |
| 富士電機               | 45      | 56    | 707,972   |
| 安川電機               | 80      | 85    | 441,830   |
| シンフォニア テクノロジー      | 7       | 8     | 103,372   |
| 明電舎                | 12      | 14    | 111,070   |
| 山洋電気               | 3       | 9     | 44,190    |
| デンヨー               | 5       | 5     | 21,888    |
| PHCホールディングス        | 13      | 14    | 15,346    |
| KOKUSAI ELECTRIC   | 52      | 89    | 571,478   |
| ソシオネクスト            | 73      | 67    | 131,972   |
| 東芝テック              | 11      | 10    | 31,650    |
| 芝浦メカトロニクス          | 5       | 4     | 136,857   |

## 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        |
| マブチモーター               | 32      | 75    | 133,434   |
| ニデック                  | 327     | -     | -         |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス     | 23      | 27    | 9,273     |
| トレックス・セミコンダクター        | 5       | 6     | 10,962    |
| 東光高岳                  | 4       | 4     | 22,806    |
| ダイヘン                  | 7       | 7     | 105,485   |
| ヤーマン                  | 14      | 15    | 10,716    |
| JVCケンウッド              | 58      | 61    | 82,472    |
| ミマキエンジニアリング           | 6       | 6     | 11,953    |
| 大崎電気工業                | 15      | 15    | 25,380    |
| オムロン                  | 67      | 65    | 340,120   |
| 日東工業                  | 10      | 9     | 42,770    |
| I D E C               | 10      | 10    | 32,450    |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション     | 33      | 32    | 166,656   |
| B U F F A L O         | 1       | 2     | 10,542    |
| テクノメディカ               | 3       | 4     | 10,315    |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディングス | 12      | -     | -         |
| 日本電気                  | 104     | 514   | 2,013,607 |
| 富士通                   | 682     | 720   | 2,615,415 |
| 沖電気工業                 | 35      | 37    | 116,353   |
| 電気興業                  | 4       | -     | -         |
| サンケン電気                | 7       | 8     | 62,120    |
| アイホン                  | 4       | 4     | 11,795    |
| ルネサスエレクトロニクス          | 564     | 759   | 2,207,753 |
| セイコーエプソン              | 95      | 97    | 202,166   |
| ワコム                   | 52      | 47    | 39,903    |
| アルバック                 | 16      | 20    | 208,200   |
| E I Z O               | 9       | 11    | 24,893    |
| ジャパンディスプレイ            | -       | 449   | 10,347    |
| 日本信号                  | 16      | 19    | 33,481    |
| 京三製作所                 | 17      | 18    | 14,250    |
| 能美防災                  | 10      | 10    | 45,368    |
| ホーチキ                  | 4       | 6     | 36,112    |
| エレコム                  | 17      | 18    | 33,360    |
| パナソニック ホールディングス       | 876     | 925   | 2,322,463 |
| シャープ                  | 107     | 94    | 61,389    |
| アンリツ                  | 52      | 51    | 133,683   |
| 富士通ゼネラル               | 21      | -     | -         |
| ソニーグループ               | 2,532   | 2,674 | 8,921,464 |
| T D K                 | 640     | 676   | 1,609,356 |
| 帝国通信工業                | 3       | 3     | 9,537     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当期末 |           |
|---------------------|---------|-----|-----------|
|                     | 株数      | 株数  | 評価額       |
|                     | 千株      | 千株  | 千円        |
| タムラ製作所              | 29      | 31  | 21,403    |
| アルプスアルパイン           | 60      | 60  | 140,529   |
| 日本電波工業              | -       | 9   | 11,110    |
| 鈴木                  | 4       | 4   | 13,735    |
| メイコー                | 7       | 7   | 150,570   |
| 日本トリム               | -       | 2   | 10,180    |
| フォスター電機             | 7       | 7   | 21,549    |
| S M K               | 2       | -   | -         |
| ヨコオ                 | 6       | 6   | 20,734    |
| ホシデン                | 18      | 15  | 43,881    |
| ヒロセ電機               | 10      | 11  | 243,960   |
| 日本航空電子工業            | 19      | 18  | 47,927    |
| T O A               | 7       | 7   | 14,109    |
| マクセル                | 14      | 16  | 36,283    |
| 古野電気                | 8       | 10  | 84,456    |
| スミダコーポレーション         | 10      | 13  | 16,254    |
| アイコム                | 2       | 3   | 10,064    |
| リオン                 | 3       | -   | -         |
| 横河電機                | 81      | 85  | 462,608   |
| 新電元工業               | 2       | 3   | 12,919    |
| アズビル                | 200     | 188 | 253,640   |
| 日本光電工業              | 65      | 64  | 106,034   |
| チノー                 | 3       | 6   | 10,830    |
| 日本電子材料              | 4       | 4   | 39,984    |
| 堀場製作所               | 13      | 14  | 282,975   |
| アドバンテスト             | 231     | 244 | 6,223,542 |
| エスペック               | 6       | 7   | 29,678    |
| キーエンス               | 73      | 77  | 4,766,968 |
| 日置電機                | 3       | 4   | 29,356    |
| シスメックス              | 190     | 200 | 268,636   |
| 日本マイクロニクス           | 12      | 12  | 152,320   |
| メガチップス              | 5       | 5   | 45,250    |
| O B A R A G R O U P | 4       | 4   | 21,840    |
| コーセル                | 9       | 9   | 12,153    |
| イリソ電子工業             | 7       | 6   | 23,328    |
| オプテックスグループ          | 13      | 13  | 38,042    |
| 千代田インテグレ            | 2       | 2   | 9,613     |
| レーザーテック             | 28      | 32  | 1,004,992 |
| スタンレー電気             | 46      | 39  | 126,484   |
| ウシオ電機               | 32      | 32  | 99,304    |
| 日本セラミック             | 6       | 6   | 23,562    |

## 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        |
| 古河電池               | 5       | —   | —         |
| 山一電機               | 6       | 7   | 63,688    |
| 図研                 | 6       | 6   | 29,640    |
| 日本電子               | 17      | 17  | 116,224   |
| カシオ計算機             | 58      | 62  | 99,479    |
| ファナック              | 355     | 370 | 2,377,054 |
| 日本シイエムケイ           | 21      | 24  | 14,805    |
| エンプラス              | 2       | 2   | 33,097    |
| 大真空                | 11      | 15  | 10,349    |
| ローム                | 133     | 152 | 403,330   |
| 浜松ホトニクス            | 117     | 129 | 241,574   |
| 三井ハイテック            | 32      | 40  | 32,040    |
| 新光電気工業             | 26      | —   | —         |
| 京セラ                | 456     | 481 | 1,279,636 |
| 太陽誘電               | 32      | 41  | 192,311   |
| 村田製作所              | 646     | 739 | 2,718,765 |
| 双葉電子工業             | 14      | 16  | 11,488    |
| ニチコン               | 19      | 20  | 42,386    |
| 日本ケミコン             | 9       | 10  | 17,922    |
| KOA                | 12      | 14  | 23,448    |
| 市光工業               | 16      | 18  | 10,415    |
| 小糸製作所              | 76      | 80  | 218,817   |
| ミツバ                | 13      | 14  | 20,433    |
| SCREENホールディングス     | 30      | 27  | 608,846   |
| キャノン電子             | 7       | 8   | 31,218    |
| キャノン               | 366     | 348 | 1,630,380 |
| リコー                | 193     | 181 | 263,283   |
| 象印マホービン            | 21      | 21  | 33,348    |
| 東京エレクトロン           | 155     | 164 | 7,213,836 |
| イノテック              | 5       | 5   | 14,154    |
| <b>輸送用機器(6.7%)</b> |         |     |           |
| トヨタ紡織              | 30      | 38  | 122,834   |
| ユニプレス              | 13      | 14  | 21,182    |
| 豊田自動織機             | 62      | 66  | 1,335,220 |
| モリタホールディングス        | 11      | 12  | 35,733    |
| 三櫻工業               | 10      | 11  | 9,888     |
| デンソー               | 719     | 759 | 1,682,292 |
| 東海理化電機製作所          | 20      | 20  | 67,585    |
| 川崎重工業              | 55      | 58  | 1,046,236 |
| 名村造船所              | 21      | 24  | 136,246   |
| 日本車輛製造             | 3       | 3   | 12,825    |

| 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         | 11      | 12    | 18,984     |
| 日産自動車             | 917     | 1,184 | 527,058    |
| いすゞ自動車            | 226     | 206   | 570,009    |
| トヨタ自動車            | 3,902   | 4,121 | 14,980,562 |
| 日野自動車             | 110     | 116   | 51,770     |
| 三菱自動車工業           | 280     | 296   | 128,845    |
| 武蔵精密工業            | 18      | 17    | 40,527     |
| 日産車体              | 11      | 11    | 12,342     |
| 新明和工業             | 21      | 22    | 59,384     |
| 極東開発工業            | 9       | 12    | 44,416     |
| トピー工業             | 5       | 5     | 19,796     |
| ティラド              | 1       | 1     | 15,316     |
| 曙ブレーキ工業           | —       | 30    | 4,260      |
| タチエス              | 13      | 14    | 32,704     |
| NOK               | 28      | 28    | 93,225     |
| フタバ産業             | 22      | 20    | 23,296     |
| カヤバ               | 12      | 13    | 67,848     |
| 大同メタル工業           | 14      | 15    | 17,008     |
| プレス工業             | 28      | 31    | 30,783     |
| 太平洋工業             | 16      | 17    | 53,578     |
| アイシン              | 155     | 198   | 531,036    |
| マツダ               | 225     | 256   | 344,088    |
| 本田技研工業            | 1,739   | 1,683 | 2,598,103  |
| スズキ               | 593     | 569   | 1,306,433  |
| SUBARU            | 221     | 233   | 706,309    |
| ヤマハ発動機            | 310     | 383   | 473,102    |
| エクセディ             | 12      | 12    | 76,454     |
| 豊田合成              | 21      | 25    | 126,495    |
| 愛三工業              | 13      | 12    | 28,767     |
| ヨロズ               | 7       | 9     | 9,687      |
| エフ・シー・シー          | 12      | 15    | 56,776     |
| シマノ               | 31      | 32    | 550,288    |
| テイ・エス テック         | 29      | 28    | 57,153     |
| ジャムコ              | 4       | —     | —          |
| <b>精密機器(1.9%)</b> |         |       |            |
| リガク・ホールディングス      | 37      | 46    | 83,444     |
| 北里コーポレーション        | —       | 6     | 9,008      |
| テルモ               | 491     | 515   | 1,010,626  |
| 日機装               | 19      | 18    | 42,300     |
| 島津製作所             | 105     | 103   | 430,231    |
| JMS               | 14      | 6     | 2,904      |

## 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        |
| 長野計器               | 4       | 5   | 15,259    |
| パイ・テクノロジー          | 3       | 3   | 15,770    |
| 東京計器               | 5       | 6   | 56,192    |
| 愛知時計電機             | 2       | 3   | 11,636    |
| インターアクション          | 6       | 6   | 9,457     |
| 東京精密               | 15      | 14  | 248,356   |
| マニー                | 29      | 31  | 49,817    |
| ニコン                | 115     | 96  | 189,918   |
| トプコン               | 41      | -   | -         |
| オリンパス              | 420     | 420 | 621,600   |
| 理研計器               | 10      | 11  | 37,290    |
| タムロン               | 10      | 39  | 40,590    |
| HOYA               | 143     | 149 | 4,109,714 |
| ノーリツ鋼機             | 7       | 22  | 48,244    |
| A&Dホロンホールディングス     | 9       | 10  | 29,316    |
| 朝日インテック            | 89      | 92  | 275,100   |
| シチズン時計             | 67      | 64  | 110,873   |
| メニコン               | 27      | 28  | 52,569    |
| 松風                 | 7       | 7   | 12,614    |
| セイコーグループ           | 11      | 10  | 123,876   |
| ニプロ                | 61      | 64  | 99,257    |
| <b>その他製品(2.1%)</b> |         |     |           |
| 三井松島ホールディングス       | 5       | 13  | 19,777    |
| テクセンドフォトマスク        | -       | 21  | 63,633    |
| パラマウントベッドホールディングス  | 15      | -   | -         |
| トランザクシオン           | 4       | 8   | 10,748    |
| ニホンフラッシュ           | 8       | 11  | 9,633     |
| 前田工織               | 15      | 15  | 33,464    |
| アートネイチャー           | 9       | 1   | 1,053     |
| フルヤ金属              | 6       | 7   | 54,686    |
| パンダイナムホールディングス     | 199     | 207 | 835,419   |
| S H O E I          | 20      | 20  | 34,420    |
| フランスベッドホールディングス    | 10      | 11  | 14,796    |
| パイロットコーポレーション      | 11      | 11  | 57,655    |
| 萩原工業               | 4       | 5   | 9,790     |
| フジシールインターナショナル     | 16      | 15  | 43,724    |
| タカラトミー             | 30      | 38  | 103,455   |
| 広済堂ホールディングス        | 27      | 25  | 11,997    |
| プロネクサス             | 7       | 8   | 9,503     |
| TOPPANホールディングス     | 96      | 94  | 432,964   |
| 大日本印刷              | 152     | 167 | 517,291   |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当期末 |           |
|---------------------|---------|-----|-----------|
|                     | 株数      | 株数  | 評価額       |
|                     | 千株      | 千株  | 千円        |
| 共同印刷                | 2       | 7   | 13,010    |
| N I S S H A         | 12      | 13  | 18,278    |
| TAKARA & COMPANY    | 4       | 4   | 18,170    |
| アシックス               | 271     | 298 | 1,433,861 |
| ローランド               | 5       | 6   | 24,676    |
| 小松ウオール工業            | 4       | 5   | 16,535    |
| ヤマハ                 | 131     | 131 | 156,849   |
| 河合楽器製作所             | 2       | -   | -         |
| クリナップ               | 10      | 10  | 11,128    |
| ピジョン                | 46      | 45  | 75,295    |
| キングジム               | 8       | 11  | 9,442     |
| リンテック               | 13      | 16  | 86,688    |
| イトーキ                | 14      | 17  | 54,485    |
| 任天堂                 | 463     | 489 | 4,203,336 |
| 三菱鉛筆                | 10      | 10  | 23,680    |
| タカラスタンダード           | 16      | 17  | 52,500    |
| コクヨ                 | 35      | 153 | 137,369   |
| ナカバヤシ               | 3       | 16  | 9,824     |
| グローブライド             | 7       | 7   | 16,863    |
| オカムラ                | 22      | 23  | 60,347    |
| 美津濃                 | 7       | 20  | 82,888    |
| <b>電気・ガス業(1.4%)</b> |         |     |           |
| グリムス                | 3       | 3   | 10,377    |
| 東京電力ホールディングス        | 617     | 698 | 491,466   |
| 中部電力                | 270     | 285 | 735,248   |
| 関西電力                | 358     | 420 | 1,126,976 |
| 中国電力                | 127     | 134 | 145,206   |
| 北陸電力                | 75      | 79  | 85,366    |
| 東北電力                | 193     | 204 | 265,534   |
| 四国電力                | 68      | 72  | 126,963   |
| 九州電力                | 169     | 178 | 347,571   |
| 北海道電力               | 76      | 87  | 104,093   |
| 沖縄電力                | 18      | 19  | 23,482    |
| 電源開発                | 55      | 58  | 208,604   |
| イーレックス              | 14      | 15  | 10,700    |
| レノバ                 | 20      | 21  | 15,285    |
| 東京瓦斯                | 138     | 139 | 1,059,742 |
| 大阪瓦斯                | 144     | 138 | 884,099   |
| 東邦瓦斯                | 28      | 28  | 155,325   |
| 北海道瓦斯               | 22      | 23  | 20,097    |
| 広島ガス                | 19      | 12  | 4,876     |

## 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        |
| 西部ガスホールディングス     | 7       | 8   | 22,401    |
| 静岡ガス             | 16      | 17  | 25,824    |
| メタウォーター          | 10      | 10  | 41,457    |
| <b>陸運業(2.1%)</b> |         |     |           |
| SBSホールディングス      | 6       | 6   | 28,669    |
| 東武鉄道             | 77      | 80  | 244,945   |
| 相鉄ホールディングス       | 24      | 29  | 86,994    |
| 東急               | 205     | 199 | 384,748   |
| 京浜急行電鉄           | 90      | 87  | 135,366   |
| 小田急電鉄            | 121     | 117 | 204,920   |
| 京王電鉄             | 38      | 34  | 143,033   |
| 京成電鉄             | 127     | 135 | 179,685   |
| 富士急行             | 9       | 9   | 21,451    |
| 東日本旅客鉄道          | 404     | 427 | 1,630,485 |
| 西日本旅客鉄道          | 181     | 184 | 606,287   |
| 東海旅客鉄道           | 282     | 328 | 1,518,655 |
| 東京地下鉄            | 122     | 123 | 205,010   |
| 西武ホールディングス       | 79      | 84  | 390,687   |
| 鴻池運輸             | 12      | 13  | 46,662    |
| 西日本鉄道            | 21      | 22  | 70,201    |
| ハマキョウレックス        | 25      | 24  | 46,437    |
| サカイ引越センター        | 9       | 9   | 28,371    |
| 近鉄グループホールディングス   | 78      | 82  | 273,570   |
| 阪急阪神ホールディングス     | 97      | 102 | 465,269   |
| 南海電気鉄道           | 32      | 37  | 111,925   |
| 京阪ホールディングス       | 40      | 40  | 139,760   |
| 神戸電鉄             | 2       | 1   | 3,321     |
| 名古屋鉄道            | 81      | 85  | 154,284   |
| 山陽電気鉄道           | 5       | 5   | 11,704    |
| ヤマトホールディングス      | 89      | 94  | 174,367   |
| 山九               | 17      | 17  | 173,159   |
| 丸全昭和運輸           | 4       | 4   | 44,976    |
| センコーグループホールディングス | 48      | 56  | 107,884   |
| トナミホールディングス      | 1       | -   | -         |
| ニッコンホールディングス     | 41      | 33  | 128,205   |
| 福山通運             | 7       | 8   | 45,235    |
| セイノーホールディングス     | 36      | 38  | 99,307    |
| 神奈川中央交通          | 2       | 2   | 9,112     |
| AZ-COM&和ホールディングス | 22      | 24  | 22,608    |
| 九州旅客鉄道           | 56      | 58  | 226,961   |
| S Gホールディングス      | 123     | 130 | 197,340   |

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当期末 |         |
|------------------------|---------|-----|---------|
|                        | 株数      | 株数  | 評価額     |
|                        | 千株      | 千株  | 千円      |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 78      | 77  | 284,425 |
| <b>海運業(0.5%)</b>       |         |     |         |
| 日本郵船                   | 151     | 163 | 853,174 |
| 商船三井                   | 139     | 147 | 801,459 |
| 川崎汽船                   | 166     | 166 | 401,237 |
| N S ユナイテッド海運           | 4       | 4   | 37,485  |
| 飯野海運                   | 26      | 28  | 45,496  |
| 乾汽船                    | 9       | 9   | 14,841  |
| <b>空運業(0.3%)</b>       |         |     |         |
| 日本航空                   | 168     | 177 | 541,602 |
| ANAホールディングス            | 199     | 210 | 695,822 |
| <b>倉庫・運輸関連業(0.1%)</b>  |         |     |         |
| 日新                     | 5       | -   | -       |
| 三菱倉庫                   | 74      | 87  | 120,423 |
| 三井倉庫ホールディングス           | 7       | 23  | 82,789  |
| 住友倉庫                   | 21      | 22  | 86,625  |
| 澁澤倉庫                   | 3       | 12  | 17,223  |
| 日本トランスシティ              | 14      | 19  | 25,818  |
| 中央倉庫                   | 3       | 4   | 6,867   |
| 安田倉庫                   | 5       | 5   | 13,446  |
| 上組                     | 33      | 34  | 190,434 |
| キューソー流通システム            | 4       | 4   | 13,882  |
| エーアイティー                | 4       | 4   | 11,176  |
| 内外トランスライン              | 2       | -   | -       |
| 日本コンセプト                | 3       | -   | -       |
| <b>情報・通信業(5.9%)</b>    |         |     |         |
| NEC ネットエスアイ            | 28      | -   | -       |
| MIXI                   | 14      | 14  | 37,917  |
| クロスキャット                | 6       | 9   | 9,090   |
| システナ                   | 105     | 111 | 47,995  |
| デジタルアーツ                | 4       | 4   | 22,632  |
| 日鉄ソリューションズ             | 25      | 21  | 77,592  |
| キューブシステム               | 6       | 8   | 9,509   |
| コア                     | 3       | 4   | 9,931   |
| ディー・エヌ・エー              | 30      | 31  | 84,997  |
| ラクーンホールディングス           | 7       | 14  | 9,367   |
| ソフトクリエイトホールディングス       | 5       | 6   | 13,017  |
| TIS                    | 77      | 82  | 255,559 |
| グリーホールディングス            | 24      | 26  | 10,048  |
| GMOペパボ                 | 4       | -   | -       |
| コーエーテックホールディングス        | 55      | 48  | 82,376  |

## 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      |
| 三菱総合研究所               | 3       | 3   | 18,481  |
| ファインデックス              | 8       | -   | -       |
| ブレインパッド               | 5       | 3   | 8,611   |
| ポルトゥウィンホールディングス       | 15      | 28  | 8,837   |
| ネクソン                  | 161     | 191 | 616,828 |
| アイスタイル                | 22      | 29  | 13,632  |
| エムアップホールディングス         | 9       | 19  | 12,844  |
| エイチームホールディングス         | 7       | 7   | 7,668   |
| セルシス                  | 10      | 10  | 13,482  |
| エニグモ                  | 20      | -   | -       |
| コロプラ                  | 25      | 26  | 11,220  |
| ブロードリーフ               | 29      | 28  | 19,312  |
| デジタルハーツホールディングス       | 6       | 10  | 8,413   |
| メディアドゥ                | 4       | 5   | 9,342   |
| じげん                   | 18      | 22  | 9,522   |
| フィックスターズ              | 7       | 10  | 15,408  |
| CARTA HOLDINGS        | 4       | -   | -       |
| オプティム                 | 10      | 18  | 8,564   |
| セレス                   | 3       | 5   | 8,129   |
| S H I F T             | 73      | 69  | 45,865  |
| テクマトリックス              | 15      | 15  | 29,279  |
| プロシップ                 | -       | 6   | 8,996   |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント  | 18      | 18  | 44,694  |
| GMOペイメントゲートウェイ        | 16      | 15  | 115,382 |
| システムリサーチ              | 5       | 5   | 10,428  |
| インターネットイニシアティブ        | 40      | 42  | 95,115  |
| さくらインターネット            | 11      | 10  | 31,468  |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス  | 3       | 4   | 8,643   |
| S R Aホールディングス         | 4       | 4   | 21,890  |
| 朝日ネット                 | 10      | 13  | 9,004   |
| e B A S E             | 11      | 20  | 8,569   |
| アバントグループ              | 10      | 8   | 12,040  |
| アドソル日進                | 3       | 6   | 11,228  |
| フリービット                | -       | 5   | 8,823   |
| コムチュア                 | 9       | 10  | 14,904  |
| アステリア                 | 11      | -   | -       |
| アイル                   | 4       | 4   | 10,278  |
| マークラインズ               | 4       | 6   | 9,406   |
| g u m i               | 13      | 26  | 8,685   |
| テラスカイ                 | 2       | 4   | 7,946   |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 4       | 8   | 8,197   |

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当期末 |         |
|------------------------|---------|-----|---------|
|                        | 株数      | 株数  | 評価額     |
|                        | 千株      | 千株  | 千円      |
| ネオジャパン                 | 4       | -   | -       |
| P R T I M E S          | 3       | 3   | 8,564   |
| ラクス                    | 34      | 73  | 56,078  |
| ダブルスタンダード              | 4       | 5   | 8,075   |
| オープンドア                 | 11      | 28  | 10,203  |
| アカツキ                   | 3       | 3   | 11,609  |
| Ubicomホールディングス         | 4       | -   | -       |
| カナミックネットワーク            | 15      | -   | -       |
| チェンジホールディングス           | 18      | 15  | 14,085  |
| オークネット                 | 3       | 7   | 15,561  |
| マクロミル                  | 14      | -   | -       |
| オロ                     | 3       | 4   | 8,602   |
| ユーザーローカル               | 3       | 4   | 7,795   |
| PKSHA Technology       | 5       | 9   | 25,649  |
| マネーフォワード               | 18      | 17  | 54,020  |
| プラスアルファ・コンサルティング       | 9       | 9   | 19,972  |
| 電算システムホールディングス         | 3       | 3   | 10,370  |
| A P P I E R G R O U P  | 22      | 29  | 20,790  |
| ビジョナル                  | 8       | 9   | 63,965  |
| ハイマックス                 | 5       | 7   | 9,129   |
| 野村総合研究所                | 159     | 151 | 581,466 |
| 日本システム技術               | 6       | 7   | 14,400  |
| インテージホールディングス          | 4       | 5   | 9,735   |
| ソースネクスト                | 37      | 67  | 8,777   |
| シンプレクス・ホールディングス        | 14      | 61  | 51,374  |
| ラクスル                   | 17      | 15  | 29,434  |
| メルカリ                   | 40      | 33  | 120,097 |
| システムサポートホールディングス       | -       | 6   | 7,992   |
| ボードルア                  | -       | 4   | 7,704   |
| NE                     | -       | 13  | 8,659   |
| ウイングアーク1 s t           | 7       | 8   | 21,845  |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | 3       | 9   | 9,137   |
| S a n s a n            | 20      | 25  | 28,398  |
| ギフトィ                   | 6       | -   | -       |
| メドレー                   | 8       | 9   | 19,427  |
| ベース                    | 3       | 3   | 10,593  |
| J M D C                | 9       | 11  | 45,144  |
| フォーカスシステムズ             | 6       | 5   | 8,699   |
| クレスコ                   | 12      | 13  | 20,569  |
| フジ・メディア・ホールディングス       | 70      | 61  | 206,151 |
| オービック                  | 136     | 144 | 560,705 |

## 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        |
| ジャストシステム          | 10      | 11     | 44,800    |
| TDCソフト            | 12      | 14     | 15,154    |
| LINEヤフー           | 1,178   | 1,197  | 448,149   |
| トレンドマイクロ          | 38      | 44     | 255,391   |
| IDホールディングス        | 5       | 5      | 9,740     |
| 日本オラクル            | 14      | 14     | 140,223   |
| アルファシステムズ         | 2       | 2      | 9,150     |
| フューチャー            | 18      | 16     | 29,813    |
| CAC Holdings      | 4       | 4      | 9,148     |
| オービックビジネスコンサルタント  | 12      | 13     | 76,464    |
| アイティフォー           | 8       | 8      | 13,697    |
| 東計電算              | 2       | 2      | 9,350     |
| 大塚商会              | 83      | 88     | 267,824   |
| サイボウズ             | 10      | 10     | 23,154    |
| 電通総研              | 7       | 28     | 51,336    |
| ACCESS            | 7       | -      | -         |
| デジタルガレージ          | 11      | 11     | 22,666    |
| イーエムシステムズ         | 11      | 12     | 8,851     |
| ウェザーニューズ          | 5       | 5      | 22,797    |
| CIJ               | 20      | 18     | 9,456     |
| ビジネスエンジニアリング      | 1       | 9      | 12,803    |
| WOWOW             | 6       | 6      | 8,652     |
| スカラ               | 17      | 24     | 9,126     |
| ANYCOLOR          | 10      | 12     | 49,848    |
| IMAGICA GROUP     | 13      | -      | -         |
| ネットワンシステムズ        | 8       | -      | -         |
| アルゴグラフィックス        | 6       | 27     | 42,450    |
| マーベラス             | 13      | 19     | 9,680     |
| エイベックス            | 13      | 13     | 16,252    |
| BIPROGY           | 24      | 26     | 122,505   |
| 都築電気              | 4       | 5      | 19,925    |
| TBSホールディングス       | 36      | 38     | 219,417   |
| 日本テレビホールディングス     | 65      | 68     | 223,462   |
| 朝日放送グループホールディングス  | 0.100   | 11     | 9,499     |
| テレビ朝日ホールディングス     | 17      | 18     | 60,669    |
| スカパーJ SATホールディングス | 57      | 51     | 145,040   |
| テレビ東京ホールディングス     | 4       | 4      | 21,000    |
| ビジョン              | 11      | 16     | 20,914    |
| U-NEXT HOLDINGS   | 24      | 26     | 47,997    |
| 日本通信              | 59      | 64     | 8,785     |
| NTT               | 21,902  | 21,348 | 3,223,668 |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当期末    |           |
|----------------------|---------|--------|-----------|
|                      | 株数      | 株数     | 評価額       |
|                      | 千株      | 千株     | 千円        |
| KDDI                 | 541     | 1,092  | 2,858,503 |
| ソフトバンク               | 11,787  | 12,506 | 2,626,449 |
| 光通信                  | 8       | 7      | 322,707   |
| GMOインターネットグループ       | 24      | 25     | 73,543    |
| KADOKAWA             | 38      | 43     | 120,463   |
| 学研ホールディングス           | 13      | 14     | 14,753    |
| ゼンリン                 | 12      | 11     | 11,762    |
| アイネット                | 4       | -      | -         |
| 松竹                   | 4       | 4      | 50,996    |
| 東宝                   | 46      | 40     | 315,996   |
| 東映                   | 12      | 12     | 69,120    |
| NTTデータグループ           | 192     | -      | -         |
| ピー・シー・エー             | 4       | 5      | 9,888     |
| ビジネスブレイン太田昭和         | 3       | 2      | 8,540     |
| DTS                  | 12      | 61     | 69,154    |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 37      | 127    | 321,540   |
| シーイーシー               | 9       | 9      | 18,386    |
| カプコン                 | 146     | 154    | 486,366   |
| アイ・エス・ビー             | 5       | -      | -         |
| SCSK                 | 60      | -      | -         |
| NSW                  | 3       | 3      | 9,047     |
| アイネス                 | 5       | 6      | 12,273    |
| TKC                  | 13      | 12     | 48,000    |
| 富士ソフト                | 20      | -      | -         |
| NSD                  | 28      | 27     | 77,816    |
| コナミグループ              | 27      | 33     | 625,873   |
| 福井コンピュータホールディングス     | 5       | 4      | 13,986    |
| JBCホールディングス          | 4       | 20     | 27,665    |
| ミロク情報サービス            | 6       | 6      | 11,510    |
| ソフトバンクグループ           | 363     | 1,490  | 6,451,508 |
| <b>卸売業(8.4%)</b>     |         |        |           |
| リョーサン菱洋ホールディングス      | 11      | 15     | 50,711    |
| 高千穂交易                | 3       | 6      | 13,637    |
| 伊藤忠食品                | 1       | 1      | 21,456    |
| あらた                  | 11      | 12     | 37,562    |
| トーメンデバイス             | 1       | 1      | 16,140    |
| 東京エレクトロン デバイス        | 7       | 8      | 29,971    |
| 円谷フィールズホールディングス      | 12      | 15     | 23,195    |
| 双日                   | 86      | 79     | 535,190   |
| アルフレッサ ホールディングス      | 72      | 77     | 196,522   |
| 横浜冷凍                 | 19      | 20     | 29,210    |

## 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      |
| アルコニックス             | 11      | 12  | 38,682  |
| 神戸物産                | 60      | 71  | 266,750 |
| あい ホールディングス         | 14      | 16  | 46,133  |
| ダイワボウホールディングス       | 34      | 30  | 93,231  |
| マクニカホールディングス        | 60      | 57  | 150,115 |
| ラクト・ジャパン            | 3       | 3   | 12,827  |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 10      | 11  | 15,797  |
| 八洲電機                | 6       | 6   | 21,049  |
| レスター                | 6       | 7   | 21,630  |
| TOKAIホールディングス       | 42      | 44  | 53,622  |
| 三洋貿易                | 8       | 10  | 18,634  |
| ビューティガレージ           | 4       | 6   | 9,616   |
| ウイン・パートナーズ          | 5       | 7   | 10,031  |
| シップヘルスケアホールディングス    | 30      | 30  | 80,035  |
| 明治電機工業              | 4       | 4   | 10,045  |
| コメダホールディングス         | 20      | 20  | 58,390  |
| ユニソルホールディングス        | 6       | 7   | 15,967  |
| ヤマエグループホールディングス     | 8       | 8   | 24,360  |
| 小野建                 | 8       | 8   | 12,876  |
| 佐烏電機                | 4       | 5   | 10,223  |
| 伯東                  | 4       | 4   | 21,168  |
| コンドーテック             | 6       | 6   | 10,425  |
| ナガイレーベン             | 9       | 8   | 15,610  |
| 三菱食品                | 7       | -   | -       |
| 松田産業                | 5       | 6   | 45,446  |
| 第一興商                | 30      | 27  | 45,162  |
| メディパルホールディングス       | 84      | 87  | 256,084 |
| S P K               | 3       | 4   | 10,616  |
| 萩原電気ホールディングス        | 3       | 3   | 13,545  |
| アズワン                | 24      | 26  | 57,378  |
| スズデン                | 3       | 5   | 9,625   |
| シモジマ                | 5       | 6   | 9,839   |
| ドウシシャ               | 7       | 9   | 34,937  |
| 高速                  | 4       | 5   | 18,040  |
| リックス                | -       | 2   | 9,525   |
| 丸文                  | 6       | 7   | 9,073   |
| ハピネット               | 5       | 11  | 32,256  |
| 橋本総業ホールディングス        | 5       | 7   | 9,904   |
| 日本ライフライン            | 20      | 20  | 30,015  |
| タカショー               | 17      | 23  | 9,210   |
| I DOM               | 26      | 24  | 36,952  |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当期末   |           |
|-----------------|---------|-------|-----------|
|                 | 株数      | 株数    | 評価額       |
|                 | 千株      | 千株    | 千円        |
| 進和              | 4       | 4     | 15,864    |
| ダイترون          | 3       | 6     | 19,584    |
| シークス            | 11      | 13    | 18,143    |
| オーハシテクニカ        | 3       | 8     | 10,068    |
| 白銅              | 3       | 4     | 10,656    |
| 伊藤忠商事           | 522     | 2,756 | 6,044,284 |
| 丸紅              | 638     | 625   | 3,573,889 |
| 長瀬産業            | 34      | 35    | 164,535   |
| 蝶理              | 4       | 4     | 19,800    |
| 豊田通商            | 233     | 246   | 1,658,830 |
| 三共生興            | 11      | 10    | 9,448     |
| 兼松              | 32      | 68    | 158,843   |
| 三井物産            | 1,141   | 1,179 | 6,492,597 |
| 日本紙パルプ商事        | 37      | 43    | 47,328    |
| カメイ             | 8       | 7     | 25,217    |
| スターゼン           | 5       | 18    | 25,114    |
| 山善              | 26      | 24    | 37,549    |
| 椿本興業            | 4       | 5     | 17,100    |
| 住友商事            | 465     | 491   | 3,138,029 |
| 内田洋行            | 3       | 15    | 31,151    |
| 三菱商事            | 1,435   | 1,635 | 8,161,283 |
| 第一実業            | 7       | 7     | 26,410    |
| キャノンマーケティングジャパン | 15      | 19    | 132,262   |
| 西華産業            | 3       | 11    | 33,771    |
| 佐藤商事            | 5       | 5     | 13,862    |
| 東京産業            | 9       | 9     | 9,690     |
| ユアサ商事           | 6       | 7     | 43,540    |
| 神鋼商事            | 1       | 6     | 16,820    |
| 阪和興業            | 12      | 13    | 118,800   |
| 正栄食品工業          | 5       | 5     | 22,247    |
| カナデン            | 5       | 6     | 14,716    |
| R Y O D E N     | 6       | 6     | 22,365    |
| 岩谷産業            | 77      | 81    | 157,376   |
| 極東貿易            | 4       | 4     | 10,441    |
| アステナホールディングス    | 15      | 19    | 9,780     |
| 三愛オブリ           | 18      | 19    | 46,202    |
| 稲畑産業            | 21      | 18    | 78,727    |
| G S I クレオス      | 4       | 4     | 13,051    |
| 明和産業            | 11      | 11    | 11,033    |
| ワキタ             | 11      | 13    | 28,723    |
| 東邦ホールディングス      | 21      | 23    | 108,205   |

## 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      |
| サンゲツ                | 19      | 20  | 67,465  |
| ミツロコグループホールディングス    | 9       | 9   | 22,720  |
| シナネンホールディングス        | 2       | 1   | 11,024  |
| 伊藤忠エネクス             | 19      | 20  | 39,848  |
| サンリオ                | 63      | 81  | 431,013 |
| サンワ テクノス            | 3       | 4   | 15,557  |
| 新光商事                | 10      | 9   | 10,543  |
| トーヨー                | 3       | 9   | 12,614  |
| 三信電気                | 3       | 4   | 14,711  |
| 東陽テクニカ              | 7       | 7   | 14,060  |
| モスフードサービス           | 11      | 12  | 51,243  |
| 加賀電子                | 15      | 15  | 63,536  |
| ソーダニッカ              | 7       | 8   | 9,590   |
| 立花エレテック             | 4       | 4   | 16,586  |
| P A L T A C         | 12      | 12  | 61,929  |
| 三谷産業                | 20      | -   | -       |
| 西本Wismettacホールディングス | 3       | -   | -       |
| コア商事ホールディングス        | 9       | 11  | 9,401   |
| K P Pグループホールディングス   | 16      | 21  | 19,409  |
| ヤマタネ                | 3       | 6   | 15,041  |
| 泉州電業                | 5       | 5   | 33,592  |
| トラスコ中山              | 16      | 17  | 42,157  |
| オートバックスセブン          | 27      | 28  | 49,732  |
| モリト                 | 6       | 5   | 11,745  |
| 加藤産業                | 9       | 10  | 68,579  |
| イエローハット             | 13      | 20  | 35,541  |
| J Kホールディングス         | 6       | 6   | 9,990   |
| 日伝                  | 4       | 4   | 11,477  |
| 杉本商事                | 6       | 6   | 9,467   |
| 因幡電機産業              | 21      | 42  | 119,283 |
| 東テク                 | 7       | 9   | 39,403  |
| ミスミグループ本社           | 117     | 115 | 352,537 |
| スズケン                | 25      | 27  | 170,761 |
| ジェコス                | 6       | 6   | 11,364  |
| <b>小売業(4.2%)</b>    |         |     |         |
| インターメスティック          | 4       | 5   | 10,117  |
| サンエー                | 13      | 13  | 43,020  |
| カワチ薬品               | 6       | 6   | 20,032  |
| エービーシー・マート          | 34      | 43  | 110,292 |
| ハードオフコーポレーション       | 3       | -   | -       |
| アスクル                | 18      | 15  | 20,389  |

| 銘柄                       | 期首(前期末) | 当期末 |         |
|--------------------------|---------|-----|---------|
|                          | 株数      | 株数  | 評価額     |
|                          | 千株      | 千株  | 千円      |
| ゲオホールディングス               | 8       | 9   | 15,906  |
| アンドエスティHD                | 10      | 11  | 33,481  |
| くら寿司                     | 9       | 9   | 34,752  |
| キャンドウ                    | 2       | 2   | 10,208  |
| パルグループホールディングス           | 17      | 32  | 53,806  |
| エディオン                    | 33      | 39  | 86,775  |
| サーラコーポレーション              | 16      | 17  | 20,227  |
| ハローズ                     | 3       | 3   | 17,538  |
| フジオフードグループ本社             | 9       | 13  | 14,177  |
| あみやき亭                    | 5       | 6   | 9,560   |
| 大黒天物産                    | 2       | 2   | 16,095  |
| ハニーズホールディングス             | 6       | 7   | 11,066  |
| アルペン                     | 7       | 7   | 17,419  |
| クオールホールディングス             | 9       | 10  | 19,339  |
| ジンズホールディングス              | 5       | 5   | 29,288  |
| ビツカメラ                    | 46      | 43  | 77,629  |
| DCMホールディングス              | 40      | 42  | 72,292  |
| Monotaro                 | 110     | 116 | 241,322 |
| J. フロント リテイリング           | 89      | 94  | 245,506 |
| ドトール・日レスホールディングス         | 13      | 14  | 43,137  |
| マツキヨココカラ&カンパニー           | 136     | 142 | 370,306 |
| ブロンコビリー                  | 4       | 4   | 18,912  |
| ZOZO                     | 57      | 129 | 139,708 |
| トレジャー・ファクトリー             | 5       | 5   | 10,057  |
| 物語コーポレーション               | 15      | 15  | 79,659  |
| 三越伊勢丹ホールディングス            | 116     | 127 | 381,419 |
| Hamee                    | 5       | 19  | 9,192   |
| ウエルシアホールディングス            | 40      | -   | -       |
| クリエイトSDホールディングス          | 11      | 11  | 38,280  |
| シュッピン                    | 7       | 8   | 11,579  |
| オイシックス・ラ・大地              | 12      | 12  | 16,758  |
| ネクステージ                   | 17      | 18  | 68,808  |
| ジョイフル本田                  | 21      | 24  | 51,960  |
| エターナルホスピタリティグループ         | 2       | 3   | 12,546  |
| ホットランドホールディングス           | 5       | 6   | 11,976  |
| すかいらーくホールディングス           | 106     | 112 | 404,120 |
| SFPホールディングス              | 4       | 4   | 10,580  |
| 綿半ホールディングス               | 6       | 6   | 9,741   |
| ヨシックスホールディングス            | 2       | -   | -       |
| コイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 33      | 40  | 39,107  |
| B E E N O S              | 4       | -   | -       |

## 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        |
| あさひ                       | 6       | 7   | 9,409     |
| 日本調剤                      | 5       | -   | -         |
| コスモス薬品                    | 15      | 13  | 98,787    |
| セブン&アイ・ホールディングス           | 858     | 906 | 1,985,265 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス     | 58      | 123 | 94,524    |
| ツルハホールディングス               | 13      | 128 | 340,499   |
| サンマルクホールディングス             | 6       | 7   | 22,046    |
| トリドールホールディングス             | 21      | 23  | 98,128    |
| TOKYO BASE                | 20      | -   | -         |
| JMホールディングス                | 5       | 11  | 19,894    |
| アレンザホールディングス              | 6       | 8   | 12,418    |
| 串カツ田中ホールディングス             | 5       | 5   | 10,498    |
| パロックジャパンリミテッド             | 9       | 11  | 9,615     |
| クスリのアオキホールディングス           | 20      | 19  | 78,007    |
| 力の源ホールディングス               | 5       | 6   | 10,032    |
| FOOD & LIFE COMPANIES     | 41      | 47  | 438,689   |
| ブルーゾーンホールディングス            | -       | 9   | 91,665    |
| メディカルシステムネットワーク           | 16      | 18  | 9,424     |
| ノジマ                       | 25      | 80  | 91,943    |
| カッパ・クリエイト                 | 12      | 12  | 19,917    |
| 良品計画                      | 92      | 179 | 648,342   |
| アドヴァングループ                 | 7       | 1   | 1,500     |
| アルビス                      | 2       | 3   | 9,485     |
| G-7ホールディングス               | 8       | 8   | 13,305    |
| イオン北海道                    | 19      | 24  | 22,720    |
| コジマ                       | 15      | 13  | 18,196    |
| コーナン商事                    | 8       | 9   | 37,710    |
| エコス                       | 3       | 3   | 9,920     |
| ワタミ                       | 9       | 10  | 9,680     |
| パ・パ・アイク・インターナショナルホールディングス | 156     | 829 | 833,145   |
| 西松屋チェーン                   | 17      | 18  | 39,184    |
| ゼンショーホールディングス             | 44      | 41  | 413,217   |
| 幸楽苑                       | 6       | -   | -         |
| サイゼリヤ                     | 11      | 10  | 73,458    |
| V Tホールディングス               | 30      | 32  | 17,856    |
| 魚力                        | 2       | 4   | 9,304     |
| フジ・コーポレーション               | 3       | -   | -         |
| ユナイテッドアローズ                | 8       | 8   | 22,096    |
| ハイデイ日高                    | 12      | 13  | 42,693    |
| コロワイド                     | 43      | 46  | 84,451    |
| 壱番屋                       | 30      | 32  | 29,872    |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末 |           |
|------------------------------|---------|-----|-----------|
|                              | 株数      | 株数  | 評価額       |
|                              | 千株      | 千株  | 千円        |
| スギホールディングス                   | 41      | 44  | 154,041   |
| 薬王堂ホールディングス                  | 3       | 4   | 9,563     |
| スクロール                        | 11      | 14  | 19,006    |
| ヨンドシーホールディングス                | 7       | 7   | 14,687    |
| 木曽路                          | 11      | 12  | 31,843    |
| S R Sホールディングス                | 12      | 13  | 16,888    |
| リテールパートナーズ                   | 11      | 12  | 17,055    |
| 上新電機                         | 7       | 8   | 24,920    |
| 日本瓦斯                         | 37      | 39  | 119,000   |
| ロイヤルホールディングス                 | 13      | 31  | 48,145    |
| チヨダ                          | 7       | 8   | 9,589     |
| ライフコーポレーション                  | 8       | 15  | 42,594    |
| リンガーハット                      | 10      | 11  | 25,673    |
| Mr Max HD                    | 10      | 11  | 9,593     |
| AOKIホールディングス                 | 16      | 17  | 31,292    |
| オークワ                         | 12      | 10  | 9,646     |
| コメリ                          | 10      | 10  | 39,294    |
| 青山商事                         | 16      | 17  | 45,272    |
| しまむら                         | 18      | 57  | 204,792   |
| 高島屋                          | 107     | 118 | 273,113   |
| 松屋                           | 13      | 15  | 40,733    |
| イチ・ツー・オー リテイリング              | 37      | 39  | 99,271    |
| 近鉄百貨店                        | 4       | 5   | 9,438     |
| 丸井グループ                       | 51      | 47  | 149,927   |
| アクシアル リテイリング                 | 21      | 22  | 28,560    |
| イオン                          | 287     | 968 | 2,222,478 |
| イズミ                          | 11      | 14  | 45,095    |
| 平和堂                          | 12      | 13  | 40,200    |
| フジ                           | 14      | 12  | 27,039    |
| ヤオコー                         | 9       | -   | -         |
| ゼビオホールディングス                  | 10      | 9   | 10,776    |
| ケーズホールディングス                  | 52      | 55  | 93,492    |
| シルバーライフ                      | 4       | 11  | 9,488     |
| Genky DrugStores             | 6       | 7   | 31,572    |
| ブックオフグループホールディングス            | 5       | 6   | 11,268    |
| ギフトホールディングス                  | 3       | 4   | 18,032    |
| アインホールディングス                  | 7       | 9   | 57,251    |
| GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS | 4       | 4   | 13,358    |
| ヤマダホールディングス                  | 238     | 252 | 143,785   |
| アークランズ                       | 23      | 24  | 49,117    |
| ニトリホールディングス                  | 28      | 132 | 429,549   |

## 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         |
| ケーユーホールディングス       | 6       | 7     | 9,705      |
| 吉野家ホールディングス        | 30      | 30    | 94,767     |
| 松屋フーズホールディングス      | 3       | 3     | 23,829     |
| サガミホールディングス        | 12      | 13    | 24,829     |
| 王将フードサービス          | 15      | 16    | 53,911     |
| ミニストップ             | 6       | 6     | 12,096     |
| アークス               | 13      | 13    | 53,682     |
| パローホールディングス        | 14      | 15    | 58,247     |
| ベルク                | 3       | 3     | 27,828     |
| 大 庄                | 6       | 8     | 9,889      |
| ファーストリテイリング        | 43      | 55    | 3,709,584  |
| サンドラッグ             | 26      | 24    | 100,672    |
| サックスパー ホールディングス    | -       | 11    | 9,430      |
| ベルーナ               | 18      | 19    | 19,207     |
| <b>銀行業(11.2%)</b>  |         |       |            |
| いよぎんホールディングス       | 94      | 99    | 348,850    |
| しずおかフィナンシャルグループ    | 159     | 168   | 524,615    |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ   | 60      | 64    | 215,276    |
| 楽天銀行               | 33      | 40    | 362,961    |
| 京都フィナンシャルグループ      | 91      | 104   | 387,550    |
| めびきフィナンシャルグループ     | 363     | 357   | 471,240    |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ  | 9       | 9     | 111,622    |
| 九州フィナンシャルグループ      | 127     | 147   | 194,800    |
| ゆうちょ銀行             | 595     | 829   | 2,532,682  |
| 富山第一銀行             | 23      | 24    | 62,702     |
| 横浜フィナンシャルグループ      | 384     | 398   | 676,342    |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 44      | 46    | 206,367    |
| 三十三フィナンシャルグループ     | 6       | 7     | 45,288     |
| 第四北越フィナンシャルグループ    | 22      | 71    | 143,656    |
| ひろぎんホールディングス       | 101     | 106   | 204,381    |
| おきなわフィナンシャルグループ    | 5       | 6     | 38,350     |
| 十六フィナンシャルグループ      | 10      | 10    | 105,716    |
| CC Iグループ           | 7       | 79    | 80,736     |
| プロクレアホールディングス      | 8       | 9     | 26,598     |
| あいちフィナンシャルグループ     | 13      | 15    | 98,125     |
| S B I 新生銀行         | -       | 97    | 186,959    |
| あおぞら銀行             | 49      | 48    | 139,846    |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ  | 4,638   | 4,816 | 14,171,025 |
| りそなホールディングス        | 893     | 936   | 1,854,540  |
| 三井住友トラストグループ       | 257     | 265   | 1,457,647  |
| 三井住友フィナンシャルグループ    | 1,508   | 1,677 | 10,002,336 |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当期末   |           |
|-----------------|---------|-------|-----------|
|                 | 株数      | 株数    | 評価額       |
|                 | 千株      | 千株    | 千円        |
| 千葉銀行            | 223     | 233   | 556,547   |
| 群馬銀行            | 125     | 137   | 303,697   |
| 武蔵野銀行           | 11      | 10    | 67,838    |
| 千葉興業銀行          | 17      | 14    | 34,358    |
| 筑波銀行            | 31      | 33    | 23,952    |
| 七十七銀行           | 23      | 24    | 239,803   |
| 秋田銀行            | 4       | 5     | 28,305    |
| 山形銀行            | 8       | 9     | 26,342    |
| 岩手銀行            | 4       | 4     | 32,928    |
| 東邦銀行            | 62      | 87    | 62,689    |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 63      | 61    | 415,227   |
| スルガ銀行           | 48      | 51    | 110,407   |
| 八十二長野銀行         | 169     | 157   | 329,411   |
| 山梨中央銀行          | 8       | 9     | 50,406    |
| 大垣共立銀行          | 13      | 15    | 102,542   |
| 福井銀行            | 6       | 7     | 24,966    |
| 清水銀行            | 2       | 3     | 8,835     |
| 滋賀銀行            | 10      | 11    | 101,085   |
| 南都銀行            | 10      | 11    | 86,135    |
| 百五銀行            | 68      | 71    | 111,792   |
| 紀陽銀行            | 25      | 25    | 108,458   |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 40      | 46    | 287,249   |
| 山陰合同銀行          | 45      | 47    | 84,319    |
| 百十四銀行           | 7       | 7     | 71,250    |
| 四国銀行            | 10      | 12    | 28,896    |
| 阿波銀行            | 10      | 11    | 65,653    |
| 大分銀行            | 4       | 4     | 46,416    |
| 宮崎銀行            | 4       | 4     | 42,660    |
| 佐賀銀行            | 4       | 4     | 24,384    |
| 琉球銀行            | 16      | 16    | 39,884    |
| セブン銀行           | 259     | 239   | 70,761    |
| みずほフィナンシャルグループ  | 976     | 1,082 | 7,768,372 |
| 山口フィナンシャルグループ   | 70      | 74    | 204,477   |
| 名古屋銀行           | 4       | 14    | 78,793    |
| 北洋銀行            | 98      | 98    | 103,332   |
| 愛媛銀行            | 10      | 11    | 21,178    |
| 京葉銀行            | 32      | 33    | 70,983    |
| 栃木銀行            | 33      | 41    | 41,382    |
| 北日本銀行           | 2       | 2     | 12,504    |
| 東和銀行            | 13      | 15    | 18,633    |
| トモニホールディングス     | 69      | 72    | 71,150    |

## 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        |
| フィデアホールディングス              | 7       | 7     | 7     | 17,253    |
| 池田泉州ホールディングス              | 100     | 105   | 105   | 99,228    |
| <b>証券、商品先物取引業(1.0%)</b>   |         |       |       |           |
| F P G                     | 25      | 24    | 24    | 49,644    |
| ジャパンインベストメントアドバイザー        | 11      | 12    | 12    | 24,341    |
| S B Iホールディングス             | 116     | 268   | 268   | 899,811   |
| ジャフコ グループ                 | 21      | 20    | 20    | 49,674    |
| 大和証券グループ本社                | 517     | 546   | 546   | 869,505   |
| 野村ホールディングス                | 1,216   | 1,284 | 1,284 | 1,803,378 |
| 岡三証券グループ                  | 57      | 60    | 60    | 57,646    |
| 丸三証券                      | 24      | 25    | 25    | 27,457    |
| 東洋証券                      | 21      | 23    | 23    | 18,101    |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス      | 85      | 90    | 90    | 70,111    |
| 水戸証券                      | 19      | 20    | 20    | 13,167    |
| いちよし証券                    | 14      | 14    | 14    | 18,833    |
| 松井証券                      | 49      | 52    | 52    | 49,233    |
| マネックスグループ                 | 70      | 80    | 80    | 58,086    |
| 極東証券                      | 9       | 10    | 10    | 18,868    |
| 岩井コスモホールディングス             | 8       | 8     | 8     | 31,560    |
| アイザワ証券グループ                | 10      | 7     | 7     | 11,684    |
| スパークス・グループ                | 8       | 8     | 8     | 17,320    |
| <b>保険業(3.2%)</b>          |         |       |       |           |
| ライフネット生命保険                | -       | 12    | 12    | 25,510    |
| かんぽ生命保険                   | 84      | 86    | 86    | 427,465   |
| F P パートナー                 | 3       | 3     | 3     | 8,667     |
| SOMPOホールディングス             | 353     | 379   | 379   | 2,238,796 |
| アニコム ホールディングス             | 24      | 23    | 23    | 28,154    |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 529     | 476   | 476   | 2,056,320 |
| ソニーフィナンシャルグループ            | -       | 2,674 | 2,674 | 425,984   |
| 第一生命ホールディングス              | 340     | 1,501 | 1,501 | 2,345,967 |
| 東京海上ホールディングス              | 706     | 785   | 785   | 5,082,875 |
| T & Dホールディングス             | 194     | 189   | 189   | 759,471   |
| アドバンスクリエイト                | 5       | -     | -     | -         |
| <b>その他金融業(1.2%)</b>       |         |       |       |           |
| N S グループ                  | -       | 10    | 10    | 17,391    |
| 全国保証                      | 18      | 43    | 43    | 138,987   |
| ジェイリース                    | 5       | 6     | 6     | 9,372     |
| S B I アルヒ                 | 7       | 7     | 7     | 6,482     |
| プレミアグループ                  | 12      | 13    | 13    | 23,582    |
| ネットプロテクションズホールディングス       | 24      | 23    | 23    | 11,804    |
| クレディセゾン                   | 45      | 43    | 43    | 199,649   |

| 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        |
| 芙蓉総合リース           | 6       | 21  | 21  | 96,701    |
| みずほリース            | 54      | 57  | 57  | 86,616    |
| 東京センチュリー          | 54      | 57  | 57  | 127,761   |
| 日本証券金融            | 26      | 28  | 28  | 63,758    |
| アイフル              | 119     | 126 | 126 | 63,579    |
| リコーリース            | 6       | 7   | 7   | 44,352    |
| イオンフィナンシャルサービス    | 41      | 43  | 43  | 78,183    |
| アコム               | 172     | 136 | 136 | 69,240    |
| ジャックス             | 8       | 9   | 9   | 39,039    |
| オリエントコーポレーション     | 23      | 29  | 29  | 33,936    |
| オリックス             | 433     | 472 | 472 | 2,553,520 |
| 三菱HCキャピタル         | 362     | 382 | 382 | 575,389   |
| 日本取引所グループ         | 430     | 418 | 418 | 786,087   |
| イー・ギャランティ         | 11      | 12  | 12  | 21,750    |
| NECキャピタルソリューション   | 3       | 3   | 3   | 15,725    |
| <b>不動産業(2.2%)</b> |         |     |     |           |
| robot home        | 42      | 56  | 56  | 11,396    |
| 大東建託              | 24      | 129 | 129 | 450,753   |
| いちご               | 61      | 64  | 64  | 27,584    |
| 日本駐車場開発           | 86      | 90  | 90  | 25,542    |
| スター・マイカ・ホールディングス  | -       | 8   | 8   | 12,927    |
| S R Eホールディングス     | 2       | 3   | 3   | 10,598    |
| ヒューリック            | 168     | 222 | 222 | 453,770   |
| 野村不動産ホールディングス     | 45      | 212 | 212 | 238,022   |
| 三重交通グループホールディングス  | 15      | 18  | 18  | 10,958    |
| ディア・ライフ           | 12      | 13  | 13  | 14,300    |
| 地主                | 6       | 6   | 6   | 21,199    |
| プレサンスコーポレーション     | 9       | -   | -   | -         |
| J P M C           | 6       | 7   | 7   | 9,869     |
| フージャースホールディングス    | 11      | 13  | 13  | 17,210    |
| オープンハウスグループ       | 26      | 23  | 23  | 275,868   |
| 東急不動産ホールディングス     | 217     | 208 | 208 | 324,319   |
| 飯田グループホールディングス    | 69      | 65  | 65  | 176,442   |
| And Doホールディングス    | 5       | -   | -   | -         |
| シーアールイー           | 3       | -   | -   | -         |
| ケイアイスター不動産        | 3       | 3   | 3   | 26,048    |
| グッドコムアセット         | -       | 8   | 8   | 11,328    |
| ジェイ・エス・ビー         | 3       | 3   | 3   | 10,880    |
| ロードスターキャピタル       | 4       | 4   | 4   | 15,664    |
| 霞ヶ関キャピタル          | 3       | 7   | 7   | 55,860    |
| パーク24             | 56      | 54  | 54  | 116,902   |

## 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        |
| パラカ                | 3       | 4     | 9,432     |
| 三井不動産              | 993     | 1,129 | 2,355,511 |
| 三菱地所               | 412     | 458   | 2,334,833 |
| 平和不動産              | 11      | 15    | 39,594    |
| 東京建物               | 63      | 72    | 300,098   |
| 京阪神ビルディング          | 12      | 11    | 22,758    |
| 住友不動産              | 117     | 217   | 1,095,052 |
| テーオーシー             | 12      | 13    | 12,076    |
| レオパレス21            | 63      | 67    | 48,888    |
| スターツコーポレーション       | 11      | 14    | 72,192    |
| フジ住宅               | 9       | 11    | 10,219    |
| 空港施設               | 11      | 10    | 11,145    |
| 明和地所               | 6       | 8     | 9,462     |
| ゴールドクレスト           | 4       | 4     | 13,366    |
| エスリード              | 3       | 3     | 25,992    |
| 日神グループホールディングス     | 12      | 12    | 9,735     |
| エスコ                | 18      | 17    | 19,271    |
| MIRARTHホールディングス    | 42      | 48    | 20,056    |
| イオンモール             | 43      | -     | -         |
| カチタス               | 19      | 20    | 72,057    |
| トーセイ               | 12      | 22    | 36,883    |
| サンフロンティア不動産        | 12      | 11    | 28,848    |
| FJネクストホールディングス     | 7       | 7     | 13,111    |
| グランディハウス           | 11      | 3     | 2,401     |
| 日本空港ビルデング          | 25      | 27    | 144,018   |
| <b>サービス業(2.9%)</b> |         |       |           |
| LIFULL             | 38      | -     | -         |
| ジェイエイシーリクルートメント    | 27      | 28    | 25,228    |
| 日本M&Aセンターホールディングス  | 111     | 127   | 88,341    |
| メンバーズ              | -       | 6     | 7,772     |
| UTグループ             | 9       | 156   | 31,572    |
| アイティメディア           | 4       | -     | -         |
| ケアネット              | 15      | -     | -         |
| E・Jホールディングス        | 4       | 5     | 10,932    |
| オープンアップグループ        | 25      | 24    | 44,376    |
| コシダカホールディングス       | 23      | 21    | 25,404    |
| パソナグループ            | 9       | 8     | 16,359    |
| リンクアンドモチベーション      | 18      | 19    | 9,804     |
| エス・エム・エス           | 28      | 30    | 51,941    |
| パーソルホールディングス       | 688     | 726   | 174,747   |
| 学情                 | 3       | 5     | 9,820     |
| スタジオアリス            | 3       | 4     | 9,400     |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当期末 |           |
|--------------------|---------|-----|-----------|
|                    | 株数      | 株数  | 評価額       |
|                    | 千株      | 千株  | 千円        |
| NJS                | 1       | 1   | 8,692     |
| ALSOCK             | 126     | 133 | 157,457   |
| カクコム               | 54      | 51  | 86,519    |
| アイロムグループ           | 3       | -   | -         |
| セントケア・ホールディング      | 9       | 2   | 2,783     |
| ディップ               | 13      | 13  | 28,008    |
| デジタルホールディングス       | 4       | 4   | 8,224     |
| 新日本科学              | 8       | 8   | 14,347    |
| エムスリー              | 149     | 157 | 251,685   |
| ワールドホールディングス       | 3       | 3   | 10,389    |
| 博報堂DYホールディングス      | 85      | 101 | 114,300   |
| ぐるなび               | 20      | 58  | 8,790     |
| ファンコミュニケーションズ      | 17      | 19  | 9,118     |
| ライク                | 4       | 6   | 9,595     |
| エスプール              | 23      | 36  | 9,384     |
| WDBホールディングス        | 3       | 5   | 9,257     |
| アドウェイズ             | 24      | 35  | 10,067    |
| バリューコマース           | 9       | 14  | 6,277     |
| インフォマート            | 71      | 75  | 27,748    |
| JPHホールディングス        | 19      | 20  | 15,259    |
| プレステージ・インターナショナル   | 35      | 29  | 19,765    |
| プロトコーポレーション        | 8       | -   | -         |
| アミューズ              | 4       | -   | -         |
| ドリコムインキュベータ        | 1       | -   | -         |
| クイック               | 5       | 19  | 16,863    |
| 電通グループ             | 80      | 77  | 218,270   |
| ぴあ                 | 2       | 3   | 10,310    |
| イオンファンタジー          | 3       | 3   | 9,455     |
| シーティーエス            | 10      | 9   | 9,476     |
| H. U. グループホールディングス | 22      | 25  | 79,750    |
| アルプス技研             | 6       | 6   | 17,278    |
| 日本空調サービス           | 8       | 8   | 13,364    |
| オリエンタルランド          | 444     | 469 | 1,273,392 |
| ダスキン               | 16      | 18  | 76,508    |
| 明光ネットワークジャパン       | 9       | 13  | 9,405     |
| ファルコホールディングス       | 3       | 3   | 9,380     |
| ラウンドワン             | 71      | 75  | 74,517    |
| リゾートトラスト           | 29      | 75  | 141,940   |
| ビー・エム・エル           | 9       | 10  | 43,937    |
| リソー教育グループ          | 47      | -   | -         |
| 早稲田アカデミー           | 4       | 4   | 8,848     |
| ユー・エス・エス           | 155     | 151 | 279,568   |

## 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        |
| 東京個別指導学院             | 19      | —   | —         |
| サイバーエージェント           | 166     | 161 | 211,534   |
| 楽天グループ               | 532     | 629 | 517,371   |
| クリーク・アンド・リバー社        | 4       | 6   | 9,027     |
| SBIグローバルアセットマネジメント   | 14      | 14  | 9,059     |
| テー・オー・ダブリュー          | 21      | —   | —         |
| 山田コンサルティンググループ       | 3       | 5   | 9,039     |
| セントラルスポーツ            | 2       | 3   | 9,424     |
| フルキャストホールディングス       | 6       | 6   | 9,973     |
| エン                   | 12      | 13  | 15,665    |
| テクノプロ・ホールディングス       | 45      | —   | —         |
| アイ・アールジャパンホールディングス   | 9       | 11  | 9,475     |
| Keeper 技研            | 4       | 4   | 16,562    |
| イー・ガーディアン            | 3       | 5   | 9,036     |
| ジャパンマテリアル            | 23      | 24  | 49,751    |
| ベクトル                 | 10      | 10  | 14,758    |
| チャーム・ケア・コーポレーション     | 6       | 7   | 10,227    |
| キャリアリンク              | 2       | 3   | 9,674     |
| I B J                | 10      | 12  | 9,507     |
| アサンテ                 | 4       | 5   | 9,338     |
| バリュウーHR              | 6       | 7   | 9,989     |
| M&Aキャピタルパートナーズ       | 6       | 6   | 22,368    |
| ライドオンエクスプレスホールディングス  | 6       | 9   | 9,288     |
| シグマシス・ホールディングス       | 22      | 22  | 15,209    |
| ウィルグループ              | 6       | 8   | 10,248    |
| リクルートホールディングス        | 588     | 589 | 3,703,789 |
| エラン                  | 10      | 13  | 10,313    |
| 日本郵政                 | 845     | 717 | 1,444,012 |
| ベルシステム24ホールディングス     | 8       | 10  | 15,811    |
| 鎌倉新書                 | 13      | 15  | 8,784     |
| エアトリ                 | 5       | 12  | 9,300     |
| アトラエ                 | 8       | 13  | 9,326     |
| ストライク                | 3       | 3   | 17,004    |
| ソラスト                 | 20      | 19  | 17,664    |
| インソース                | 16      | 17  | 12,248    |
| ベイカレント               | 55      | 58  | 262,528   |
| Orchestra Holdings   | 8       | —   | —         |
| アイモバイル               | 14      | 18  | 9,466     |
| ジャパリエバーターサビスホールディングス | 29      | 67  | 109,895   |
| ミダックホールディングス         | 4       | 4   | 9,190     |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当期末 |         |
|-------------------|---------|-----|---------|
|                   | 株数      | 株数  | 評価額     |
|                   | 千株      | 千株  | 千円      |
| キュービネットホールディングス   | 6       | 6   | 9,146   |
| マネジメントソリューションズ    | —       | 7   | 9,812   |
| プロレド・パートナーズ       | 16      | 17  | 8,610   |
| アンビスホールディングス      | 16      | —   | —       |
| カーブスホールディングス      | 20      | 21  | 16,764  |
| フォーラムエンジニアリング     | 8       | —   | —       |
| Macbee Planet     | 2       | 6   | 9,350   |
| ダイレクトマーケティングミックス  | 25      | 7   | 2,587   |
| L I T A L I C O   | 6       | 7   | 10,206  |
| リログループ            | 42      | 35  | 65,692  |
| 東祥                | 9       | 12  | 11,606  |
| ID&E ホールディングス     | 5       | —   | —       |
| サンウェルズ            | 12      | —   | —       |
| TREホールディングス       | 17      | 18  | 33,031  |
| 人・夢・技術グループ        | 4       | 6   | 9,690   |
| 大栄環境              | 16      | 17  | 66,990  |
| 日本管財ホールディングス      | 7       | 8   | 23,805  |
| クオンツ総研ホールディングス    | 8       | 9   | 7,360   |
| エイチ・アイ・エス         | 24      | 23  | 29,278  |
| 共立メンテナンス          | 23      | 30  | 80,003  |
| イチネンホールディングス      | 7       | 7   | 16,408  |
| 建設技術研究所           | 7       | 8   | 28,085  |
| スペース              | 6       | 6   | 9,888   |
| 燦ホールディングス         | 6       | 6   | 9,942   |
| スバル興業             | 2       | 3   | 10,575  |
| ナガワ               | 2       | 2   | 12,579  |
| 東京都競馬             | 5       | 5   | 32,480  |
| カナモト              | 11      | 11  | 46,424  |
| ニシオホールディングス       | 6       | 6   | 29,799  |
| トランス・コスモス         | 9       | 10  | 40,851  |
| 乃村工藝社             | 32      | 34  | 49,868  |
| 藤田観光              | 3       | 15  | 36,903  |
| トーカイ              | 6       | 5   | 14,981  |
| セコム               | 153     | 148 | 890,568 |
| セントラル警備保障         | 4       | 3   | 11,384  |
| 丹青社               | 16      | 16  | 26,224  |
| メイテックグループホールディングス | 27      | 29  | 99,078  |
| 応用地質              | 6       | 7   | 20,682  |
| 船井総研ホールディングス      | 15      | 31  | 36,174  |
| 学究社               | 3       | 3   | 9,516   |

## 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                  |
| イオンディライト | 8       | —       | —                   |
| ナック      | 10      | 17      | 9,272               |
| ダイセキ     | 18      | 15      | 56,610              |
| ステップ     | 3       | 3       | 9,201               |
| 合計       | 株数・金額   | 138,136 | 158,937 417,871,231 |
|          | 銘柄数<比率> | 1,609   | 1,552 <98.1%>       |

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

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

### (2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別   | 当期末   |     |
|-------|-------|-----|
|       | 買建額   | 売建額 |
| 国内    | 百万円   | 百万円 |
| TOPIX | 8,293 | —   |

(注) 単位未満は切り捨てています。

### 投資信託財産の構成

2026年2月20日現在

| 項目           | 当期末         |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評価額         | 比率    |
|              | 千円          | %     |
| 株式           | 417,871,231 | 97.8  |
| コール・ローン等、その他 | 9,282,874   | 2.2   |
| 投資信託財産総額     | 427,154,105 | 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

(2026年2月20日現在)

| 項目                     | 当期末                     |
|------------------------|-------------------------|
| <b>(A)資産</b>           | <b>426,504,791,980円</b> |
| コール・ローン等               | 7,745,120,965           |
| 株式(評価額)                | 417,871,231,660         |
| 未収入金                   | 543,045,100             |
| 未収配当金                  | 510,051,171             |
| 差入委託証拠金                | △ 164,656,916           |
| <b>(B)負債</b>           | <b>445,059,931</b>      |
| 未払解約金                  | 445,059,931             |
| <b>(C)純資産総額(A-B)</b>   | <b>426,059,732,049</b>  |
| 元本                     | 90,182,149,526          |
| 次期繰越損益金                | 335,877,582,523         |
| <b>(D)受益権総口数</b>       | <b>90,182,149,526口</b>  |
| <b>1万口当たり基準価額(C/D)</b> | <b>47,244円</b>          |

|   |                 |
|---|-----------------|
| (注1) 期首元本額                                  | 87,962,939,470円 |
| 期中追加設定元本額                                   | 22,715,096,808円 |
| 期中一部解約元本額                                   | 20,495,886,752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TOPIXオープン                               | 4,643,807,461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)                 | 2,788,170,048円  |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)                   | 1,742,498,789円  |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)                     | 6,881,779,056円  |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)                   | 6,717,226,738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)          | 1,356,900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)            | 6,772,319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)            | 5,166,170円      |
| DCニッセイ国内株式インデックス                            | 8,356,796,281円  |
| ニッセイTOPIXインデックスファンド<購入・換金手数料なし>             | 26,051,429,802円 |
| ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)<購入・換金手数料なし>     | 5,903,404,324円  |
| DCニッセイターゲットデットファンド2055                      | 539,883,891円    |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)                     | 228,875,749円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2045                      | 632,916,453円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2035                      | 616,385,364円    |
| ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)<購入・換金手数料なし>     | 115,690,286円    |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)                     | 18,768,521円     |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)                 | 16,857,428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)              | 4,903,249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)              | 10,379,810円     |
| ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)<購入・換金手数料なし>     | 28,605,093円     |
| DCニッセイターゲットデットファンド2060                      | 461,397,960円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2050                      | 348,779,100円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2040                      | 568,709,872円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2030                      | 150,648,362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)               | 22,715,107,336円 |
| ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バASKET)<購入・換金手数料なし>        | 31,909,396円     |
| FWニッセイ国内株式インデックス                            | 82,463,041円     |
| DCニッセイターゲットデットファンド2065                      | 317,328,167円    |
| DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト                       | 124,393,824円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2070                      | 47,779,834円     |
| ニッセイインデックスバランス(外国株式重視型)SA(適格機関投資家限定)        | 8,865,697円      |
| ニッセイ全世界株式インデックスコレクトSA(適格機関投資家限定)            | 12,878,911円     |
| ニッセイ国内株式インデックス(特金専用)(適格機関投資家限定)             | 214,294円        |

### 損益の状況

当期(2025年2月21日~2026年2月20日)

| 項目                     | 当期                      |
|------------------------|-------------------------|
| <b>(A)配当等収益</b>        | <b>7,791,999,172円</b>   |
| 受取配当金                  | 7,754,681,794           |
| 受取利息                   | 36,988,060              |
| その他収益金                 | 329,318                 |
| <b>(B)有価証券売買損益</b>     | <b>115,897,409,776</b>  |
| 売買益                    | 126,771,611,551         |
| 売買損                    | △ 10,874,201,775        |
| <b>(C)先物取引等損益</b>      | <b>3,461,266,250</b>    |
| 取引益                    | 3,689,863,350           |
| 取引損                    | △ 228,597,100           |
| <b>(D)当期損益金(A+B+C)</b> | <b>127,150,675,198</b>  |
| <b>(E)前期繰越損益金</b>      | <b>203,306,223,546</b>  |
| <b>(F)追加信託差損益金</b>     | <b>62,815,877,394</b>   |
| <b>(G)解約差損益金</b>       | <b>△ 57,395,193,615</b> |
| <b>(H)合計(D+E+F+G)</b>  | <b>335,877,582,523</b>  |
| <b>次期繰越損益金(H)</b>      | <b>335,877,582,523</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) (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。

# ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 25 期

(計算期間：2025年2月21日～2026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

2025年2月21日～2026年2月20日

## 国内債券市況

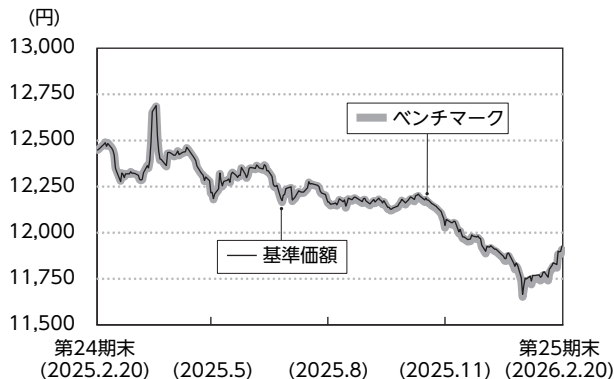


(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

2025年3月にはドイツの国防費増額報道を受けた欧州金利の上昇に伴って金利が上昇しました。4月に入ると、トランプ米政権による相互関税導入の発表を受け、不透明感が高まったことにより投資家がリスク回避的となったことから、金利は一時大幅に低下しましたが、5月には米中の追加関税引き下げが発表されたことなどを受けて、再び上昇基調となりました。その後も7月の参院選において与党が過半数割れとなったことや、10月の自民党総裁選において高市氏が勝利したことを受けて、拡張的な財政運営への懸念が高まり上昇基調で推移しました。12月には、日銀が政策金利の0.75%程度への引き上げを決定し、海外経済や物価見通しの展望が上方修正され追加利上げへの期待感が高まり、さらに金利上昇しました。年明け以降は、衆議院解散後に与野党の多くが消費税減税を選挙公約に掲げたことで財政拡張への懸念が高まり、金利が大きく上昇しました。その後には、衆院選で大勝した自民党の高市首相が責任ある積極財政を掲げたことにより財政拡張懸念が後退し、当期末にかけて金利は低下しましたが、結局、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>

- ・2025年4月上旬に、トランプ米政権による相互関税政策の発表を受けて投資家のリスク回避姿勢が高まったことから、金利が一時大幅に低下（債券価額は上昇）したこと
- ・2026年2月上旬から当期末にかけて、高市首相が責任ある積極財政を掲げたことにより財政拡張懸念が後退したことを受けて、金利が低下基調で推移したこと

#### <下落要因>

- ・10月末から12月下旬にかけて、高市自民党新総裁による拡張的な財政運営への懸念や日銀の利上げ観測の高まりにより金利が上昇したこと
- ・2026年1月に、衆院選に向けて与野党の多くが消費税減税を公約に掲げたことで、財政拡張への懸念が高まり、金利が大幅に上昇したこと

## 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-4.2%となり、ベンチマーク騰落率（-4.3%）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。

# お知らせ

## ■約款変更

運用報告書に関する記載の変更を行うため関連条項に所要の変更を行いました。

(2025年4月1日)

## 最近5期の運用実績

| 決算期              | 基準価額   | 期中   | ベンチ<br>マーク | 期中   | 債券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|------------------|--------|------|------------|------|------------|-----------|
|                  |        | 騰落率  |            | 騰落率  |            |           |
|                  | 円      | %    |            | %    | %          | 百万円       |
| 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    |
| 24期(2025年 2月20日) | 12,448 | △4.1 | 12,477     | △4.1 | 99.1       | 86,845    |
| 25期(2026年 2月20日) | 11,927 | △4.2 | 11,936     | △4.3 | 99.0       | 106,323   |

(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<br>マーク | 騰落率  | 債券<br>組入比率 |
|-----------------|--------|------|------------|------|------------|
|                 |        | %    |            | %    |            |
|                 | 円      | %    |            | %    | %          |
| (期首)2025年 2月20日 | 12,448 | —    | 12,477     | —    | 99.1       |
| 2月末             | 12,483 | 0.3  | 12,515     | 0.3  | 99.0       |
| 3月末             | 12,363 | △0.7 | 12,393     | △0.7 | 99.2       |
| 4月末             | 12,438 | △0.1 | 12,465     | △0.1 | 99.6       |
| 5月末             | 12,277 | △1.4 | 12,305     | △1.4 | 99.3       |
| 6月末             | 12,345 | △0.8 | 12,370     | △0.9 | 98.8       |
| 7月末             | 12,220 | △1.8 | 12,244     | △1.9 | 98.8       |
| 8月末             | 12,183 | △2.1 | 12,206     | △2.2 | 99.1       |
| 9月末             | 12,176 | △2.2 | 12,196     | △2.3 | 99.2       |
| 10月末            | 12,200 | △2.0 | 12,216     | △2.1 | 99.0       |
| 11月末            | 12,060 | △3.1 | 12,078     | △3.2 | 99.2       |
| 12月末            | 11,911 | △4.3 | 11,927     | △4.4 | 99.1       |
| 2026年 1月末       | 11,768 | △5.5 | 11,776     | △5.6 | 98.9       |
| (期末)2026年 2月20日 | 11,927 | △4.2 | 11,936     | △4.3 | 99.0       |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2025年2月21日～2026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 | -円 | -% | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数<br>売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料 |
| 有価証券取引税 | -  | -  | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金   |
| その他費用   | -  | -  | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数   |
| 合計      | -  | -  |   |

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（12,176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

2025年2月21日～2026年2月20日

公社債

|    |      | 買付額         | 売付額        |
|----|------|-------------|------------|
|    |      | 千円          | 千円         |
| 国内 | 国債証券 | 103,563,539 | 79,559,879 |

(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

2025年2月21日～2026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374回 利付国債（10年） | 8,113,031 | 第168回 利付国債（5年）  | 7,277,202 |
| 第178回 利付国債（5年）  | 8,060,396 | 第362回 利付国債（10年） | 5,719,780 |
| 第366回 利付国債（10年） | 7,688,098 | 第463回 利付国債（2年）  | 5,485,265 |
| 第352回 利付国債（10年） | 7,462,377 | 第346回 利付国債（10年） | 5,308,872 |
| 第358回 利付国債（10年） | 7,402,605 | 第354回 利付国債（10年） | 4,720,620 |
| 第348回 利付国債（10年） | 6,440,726 | 第370回 利付国債（10年） | 4,589,101 |
| 第350回 利付国債（10年） | 5,506,255 | 第152回 利付国債（20年） | 4,003,558 |
| 第22回 利付国債（30年）  | 5,443,232 | 第469回 利付国債（2年）  | 3,693,476 |
| 第346回 利付国債（10年） | 5,313,625 | 第143回 利付国債（20年） | 3,460,904 |
| 第168回 利付国債（20年） | 4,124,231 | 第158回 利付国債（5年）  | 3,393,591 |

(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

2026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<br>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 | 118,817,000<br>( 59,752,000) | 105,310,327<br>( 53,485,351) | 99.0<br>(50.3) | —               | 59.6<br>(30.2) | 27.9<br>(18.1) | 11.5<br>( 2.1) |
| 合計   | 118,817,000<br>( 59,752,000) | 105,310,327<br>( 53,485,351) | 99.0<br>(50.3) | —               | 59.6<br>(30.2) | 27.9<br>(18.1) | 11.5<br>( 2.1) |

(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154回 利付国債（5年）  | 0.1000 | 2027/9/20 | 2,220,000 | 2,183,037 |
|      | 第178回 利付国債（5年）  | 1.0000 | 2030/3/20 | 8,128,000 | 7,964,627 |
|      | 第4回 利付国債（40年）   | 2.2000 | 2051/3/20 | 2,206,000 | 1,807,397 |
|      | 第7回 利付国債（40年）   | 1.7000 | 2054/3/20 | 2,323,000 | 1,640,409 |
|      | 第8回 利付国債（40年）   | 1.4000 | 2055/3/20 | 4,836,000 | 3,110,563 |
|      | 第10回 利付国債（40年）  | 0.9000 | 2057/3/20 | 1,642,000 | 884,217   |
|      | 第11回 利付国債（40年）  | 0.8000 | 2058/3/20 | 1,031,000 | 526,139   |
|      | 第15回 利付国債（40年）  | 1.0000 | 2062/3/20 | 999,000   | 514,684   |
|      | 第346回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2027/3/20 | 1,999,000 | 1,978,970 |
|      | 第348回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2027/9/20 | 8,177,000 | 8,040,852 |
|      | 第350回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2028/3/20 | 3,107,000 | 3,035,352 |
|      | 第352回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2028/9/20 | 7,664,000 | 7,436,149 |
|      | 第354回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2029/3/20 | 3,445,000 | 3,314,296 |
|      | 第358回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2030/3/20 | 8,424,000 | 7,956,804 |
|      | 第362回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2031/3/20 | 2,394,000 | 2,217,921 |
|      | 第366回 利付国債（10年） | 0.2000 | 2032/3/20 | 8,711,000 | 7,957,498 |
|      | 第370回 利付国債（10年） | 0.5000 | 2033/3/20 | 3,641,000 | 3,329,658 |
|      | 第374回 利付国債（10年） | 0.8000 | 2034/3/20 | 8,614,000 | 7,898,779 |
|      | 第18回 利付国債（30年）  | 2.3000 | 2035/3/20 | 987,000   | 1,009,335 |

## 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 22 回 利付国債 (30年) | 2.5000 | 2036/3/20 | 5,004,000   | 5,170,282   |
|      | 第 34 回 利付国債 (30年) | 2.2000 | 2041/3/20 | 1,291,000   | 1,217,296   |
|      | 第 38 回 利付国債 (30年) | 1.8000 | 2043/3/20 | 3,038,000   | 2,632,457   |
|      | 第 46 回 利付国債 (30年) | 1.5000 | 2045/3/20 | 2,555,000   | 2,027,443   |
|      | 第 54 回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2047/3/20 | 3,150,000   | 2,063,659   |
|      | 第134回 利付国債 (20年)  | 1.8000 | 2032/3/20 | 3,026,000   | 3,042,612   |
|      | 第148回 利付国債 (20年)  | 1.5000 | 2034/3/20 | 2,026,000   | 1,963,133   |
|      | 第156回 利付国債 (20年)  | 0.4000 | 2036/3/20 | 1,736,000   | 1,464,593   |
|      | 第160回 利付国債 (20年)  | 0.7000 | 2037/3/20 | 3,267,000   | 2,774,107   |
|      | 第168回 利付国債 (20年)  | 0.4000 | 2039/3/20 | 7,000,000   | 5,382,580   |
|      | 第184回 利付国債 (20年)  | 1.1000 | 2043/3/20 | 6,176,000   | 4,765,463   |
| 合計   |                   | -      | -         | 118,817,000 | 105,310,327 |

### 投資信託財産の構成

2026年2月20日現在

| 項目           | 当期末         |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評価額         | 比率    |
|              | 千円          | %     |
| 公社債          | 105,310,327 | 99.0  |
| コール・ローン等、その他 | 1,107,823   | 1.0   |
| 投資信託財産総額     | 106,418,150 | 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

(2026年2月20日現在)

| 項目                     | 当期末                     |
|------------------------|-------------------------|
| <b>(A)資産</b>           | <b>106,418,150,888円</b> |
| コール・ローン等               | 723,460,631             |
| 公社債(評価額)               | 105,310,327,790         |
| 未収利息                   | 330,763,711             |
| 前払費用                   | 53,598,756              |
| <b>(B)負債</b>           | <b>94,813,353</b>       |
| 未払解約金                  | 94,813,353              |
| <b>(C)純資産総額(A-B)</b>   | <b>106,323,337,535</b>  |
| 元本                     | 89,141,653,539          |
| 次期繰越損益金                | 17,181,683,996          |
| <b>(D)受益権総口数</b>       | <b>89,141,653,539口</b>  |
| <b>1万口当たり基準価額(C/D)</b> | <b>11,927円</b>          |

(注1) 期首元本額 69,768,635,986円  
 期中追加設定元本額 34,091,607,981円  
 期中一部解約元本額 14,718,590,428円

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

ニッセイ国内債券インデックスSA (適格機関投資家限定) 1,719,096,165円  
 DCニッセイ国内債券インデックス 8,331,399,598円  
 DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型) 15,042,198,736円  
 DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) 26,411,299,660円  
 DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) 9,670,755,416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) 14,315,356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) 30,328,524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) 10,720,017円  
 ニッセイ国内債券インデックスファンド  
 <購入・換金手数料なし> 5,227,254,161円  
 ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)  
 <購入・換金手数料なし> 22,667,265,546円  
 ニッセイインデックスバランス (外国株式重視型) SA (適格機関投資家限定) 17,020,360円

### 損益の状況

当期 (2025年2月21日~2026年2月20日)

| 項目                    | 当期                     |
|-----------------------|------------------------|
| <b>(A)配当等収益</b>       | <b>792,281,942円</b>    |
| 受取利息                  | 792,281,942            |
| <b>(B)有価証券売買損益</b>    | <b>△ 4,733,796,760</b> |
| 売買益                   | 186,492,150            |
| 売買損                   | △ 4,920,288,910        |
| <b>(C)当期損益金(A+B)</b>  | <b>△ 3,941,514,818</b> |
| <b>(D)前期繰越損益金</b>     | <b>17,076,473,452</b>  |
| <b>(E)追加信託差損益金</b>    | <b>7,291,713,067</b>   |
| <b>(F)解約差損益金</b>      | <b>△ 3,244,987,705</b> |
| <b>(G)合計(C+D+E+F)</b> | <b>17,181,683,996</b>  |
| <b>次期繰越損益金(G)</b>     | <b>17,181,683,996</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) (E)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。

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

# ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 36 期

(計算期間：2025年5月21日～2025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

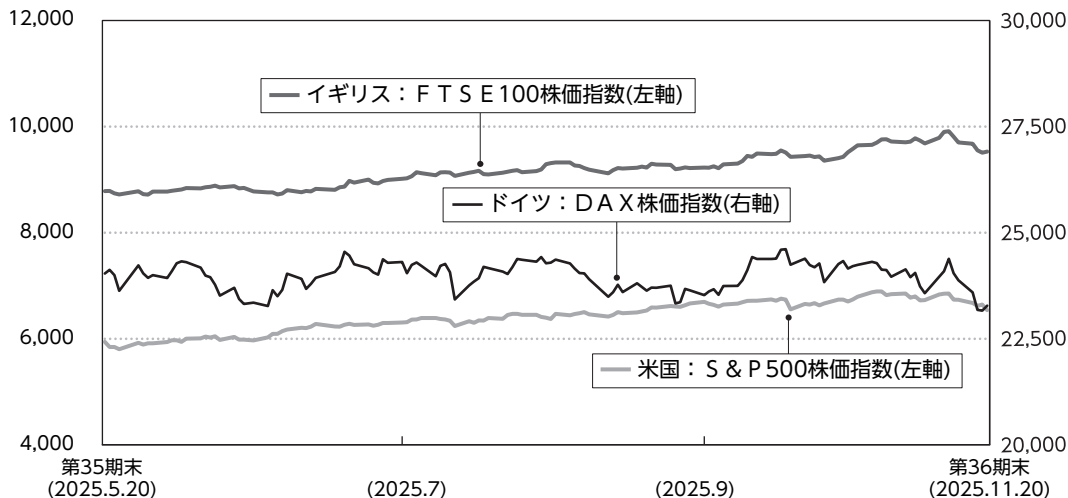
# 運用経過

2025年5月21日～2025年11月20日

## 投資環境

### ■ 海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



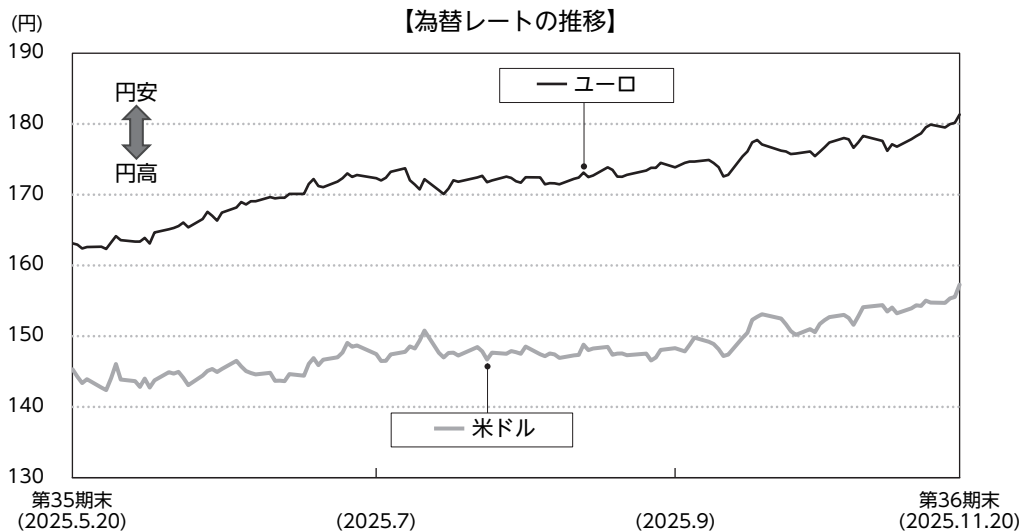
(注) FactSetのデータを使用しています。

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

米連邦準備制度理事会（FRB）の政策不透明感や生成人工知能（AI）関連銘柄への過熱感に対する警戒などから株価は下落する場面はあったものの、米英や米中間の通商協議の進展観測による景気悪化懸念の後退や中東情勢の緊張緩和による地政学リスクの後退などから上昇しました。

当期の海外株式市場は、期初より中東情勢の緊張緩和による地政学リスクの後退や、米英、米中間における通商協議の進展観測による景気悪化懸念の後退、加えて、堅調な経済指標が企業業績の下支えとなり好感され、上昇しました。7月から10月にかけては、米関税政策の不透明感が後退したことや米中貿易交渉の進展観測、良好な主要企業業績や米利下げ再開、生成AIデータセンター関連の受注拡大などが追い風となり、株価は上昇しました。当期末にかけては、FRBの政策不透明感に加え、生成AI関連銘柄への過熱感を警戒する売りが優勢となり、下落基調で推移しました。

## ■為替市況

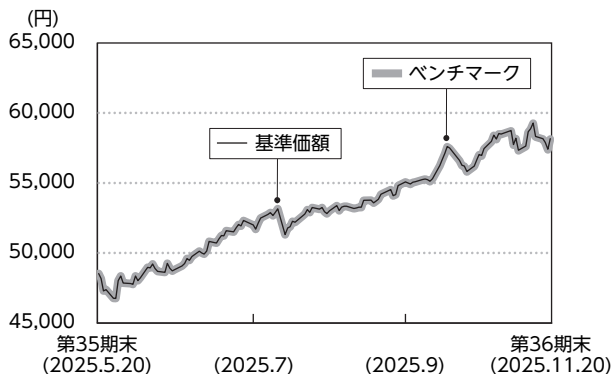


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、期初以降、上下して推移しましたが、7月には堅調な米雇用統計やトランプ米大統領が日本への関税率引き上げを示唆したことを受けて、米ドル高円安となりました。その後は横ばいに推移しましたが、10月に自民党総裁選で高市氏が勝利したことで、財政拡張的な政策が示されるとの思惑から、米ドル高円安基調となりました。また、米連邦公開市場委員会（FOMC）後の記者会見でパウエルFRB議長が早期の追加利下げに慎重な姿勢を示したことで、さらに米ドル高円安となりました。その後も、高市政権が拡張的な財政に傾くとの懸念を受けて、米ドル高円安基調が継続し、結局、期を通じて見ると大幅に米ドル高円安となりました。

当期のユーロ／円レートは、期初以降、上下して推移した後、6月から7月にかけては追加利下げに慎重なECBと、利上げに慎重な日銀という金融政策の方向性が鮮明となったことで、ユーロ高円安に推移しました。その後は横ばいに推移しましたが、10月に自民党総裁選で高市氏が勝利したことで、財政拡張的な政策が示されるとの思惑から、当期末にかけてユーロ高円安基調が継続し、結局、期を通じて見ると大幅にユーロ高円安となりました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 期初から6月にかけてトランプ米政権の関税政策を巡る懸念が和らいだことや、中東の地政学リスクが早期に緩和したことを受けて株価が上昇したこと
- ・ 7月から10月にかけて米国と主要国の関税交渉が相次いで合意したことや、FRBによる利下げ実施、主要なグローバル企業の良好な業績発表などを受けて株価が上昇したこと
- ・ 10月から11月にかけて日銀の追加利上げ観測が後退したことなどから、主要通貨に対して円安が進行したこと

#### <下落要因>

- ・ 当期末にかけてFRBの政策不透明感に加え、生成AI関連銘柄への過熱感を警戒する売りが優勢となったことなどから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+19.9%となり、ベンチマーク騰落率(+19.8%)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

運用報告書に関する記載の変更を行うため関連条項に所要の変更を行いました。

(2025年4月1日)

## 最近5期の運用実績

| 決算期              | 基準価額   |       | ベンチマーク |       | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額     |
|------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|------------|-----------|
|                  | 円      | 騰落率   | 騰落率    | 騰落率   |        |        |            |           |
| 32期(2023年11月20日) | 37,454 | 15.3  | 36,382 | 15.2  | 94.4   | 3.6    | 1.9        | 827,057   |
| 33期(2024年5月20日)  | 45,829 | 22.4  | 44,477 | 22.2  | 95.8   | 2.1    | 1.8        | 1,045,118 |
| 34期(2024年11月20日) | 49,611 | 8.3   | 48,122 | 8.2   | 95.2   | 2.7    | 1.8        | 1,175,777 |
| 35期(2025年5月20日)  | 48,526 | △ 2.2 | 47,018 | △ 2.3 | 96.0   | 2.0    | 1.7        | 1,181,247 |
| 36期(2025年11月20日) | 58,161 | 19.9  | 56,320 | 19.8  | 95.4   | 3.0    | 1.5        | 1,442,209 |

(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   |       | ベンチマーク |       | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 |
|-----------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|------------|
|                 | 円      | 騰落率   | 騰落率    | 騰落率   |        |        |            |
| (期首)2025年5月20日  | 48,526 | —     | 47,018 | —     | 96.0   | 2.0    | 1.7        |
| 5月末             | 47,848 | △ 1.4 | 46,364 | △ 1.4 | 95.6   | 2.7    | 1.7        |
| 6月末             | 50,124 | 3.3   | 48,564 | 3.3   | 96.0   | 2.2    | 1.6        |
| 7月末             | 52,901 | 9.0   | 51,250 | 9.0   | 95.8   | 2.6    | 1.6        |
| 8月末             | 53,333 | 9.9   | 51,665 | 9.9   | 96.3   | 2.0    | 1.6        |
| 9月末             | 55,282 | 13.9  | 53,546 | 13.9  | 96.0   | 2.4    | 1.6        |
| 10月末            | 58,493 | 20.5  | 56,643 | 20.5  | 95.7   | 2.8    | 1.5        |
| (期末)2025年11月20日 | 58,161 | 19.9  | 56,320 | 19.8  | 95.4   | 3.0    | 1.5        |

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2025年5月21日～2025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<br>(株式)<br>(先物・オプション)<br>(投資信託証券) | 0円<br>(0)<br>(0)<br>(0) | 0.000%<br>(0.000)<br>(0.000)<br>(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<br>売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料  |
| 有価証券取引税<br>(株式)<br>(投資信託証券)               | 1<br>(1)<br>(0)         | 0.001<br>(0.001)<br>(0.000)             | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>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<br>(保管費用)<br>(その他)                  | 2<br>(2)<br>(0)         | 0.004<br>(0.004)<br>(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<br>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<br>・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<br>・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計  | 3                       | 0.005                                   |  |

(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（53,098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

2025年5月21日～2025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<br>12,965<br>( 7,003) | 千米ドル<br>141,737<br>(△ 2,187)    | 百株<br>10,532 | 千米ドル<br>45,143        |
|    | カナダ      | 3,214<br>( 1,470)        | 千カナダ・ドル<br>14,439               | 640          | 千カナダ・ドル<br>3,131      |
|    | オーストラリア  | 9,584                    | 千オーストラリア・ドル<br>9,645<br>(△ 147) | 1,216        | 千オーストラリア・ドル<br>1,088  |
|    | 香港       | 1,481                    | 千香港ドル<br>5,855<br>(△ 69)        | 510          | 千香港ドル<br>697          |
|    | シンガポール   | 960                      | 千シンガポール・ドル<br>1,425<br>(△ 74)   | —            | 千シンガポール・ドル<br>—       |
|    | ニュージーランド | 199                      | 千ニュージーランド・ドル<br>204             | —            | 千ニュージーランド・ドル<br>—     |
|    | イギリス     | 4,321<br>(△ 25)          | 千イギリス・ポンド<br>4,556<br>(△ 65)    | 2,279        | 千イギリス・ポンド<br>1,403    |
|    | イスラエル    | 396                      | 千イスラエル・シケル<br>7,185             | 33           | 千イスラエル・シケル<br>2,480   |
|    | スイス      | 311<br>( 607)            | 千スイス・フラン<br>4,507               | 257          | 千スイス・フラン<br>1,647     |
|    | デンマーク    | 142<br>( 2,971)          | 千デンマーク・クローネ<br>5,835            | 3,072        | 千デンマーク・クローネ<br>7,219  |
|    | ノルウェー    | 101<br>( 410)            | 千ノルウェー・クローネ<br>2,154            | 83           | 千ノルウェー・クローネ<br>1,921  |
|    | スウェーデン   | 715                      | 千スウェーデン・クローナ<br>12,553          | 94           | 千スウェーデン・クローナ<br>2,682 |

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    | 1,123  | 2,659   | 23    | 29    |
|        |     | オランダ      | 868    | 3,934   | 259   | 888   |
|        |     | ベルギー      | 200    | 1,590   | 26    | 78    |
|        |     |           | ( 18)  |         |       |       |
|        |     | ルクセンブルグ   | 11     | 30      | 34    | 53    |
|        |     | フランス      | 546    | 3,844   | 296   | 2,597 |
|        |     | ドイツ       | 720    | 5,546   | 402   | 1,423 |
|        |     |           | ( 64)  | (△ 147) |       |       |
|        |     | ポルトガル     | 9,876  | 793     | -     | -     |
|        |     | スペイン      | 3,587  | 3,722   | 862   | 513   |
|        |     |           | ( 786) | (△ 1)   |       |       |
|        |     | イタリア      | 3,658  | 2,091   | 2,142 | 2,837 |
|        |     | (△ 0.000) |        |         |       |       |
| フィンランド | 618 | 524       | 104    | 39      |       |       |
| オーストリア | 12  | 83        | -      | -       |       |       |
| その他    | 53  | 130       | -      | -       |       |       |

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

(2) 投資信託証券

| 銘柄                           | 買付    |      | 売付 |       |
|------------------------------|-------|------|----|-------|
|                              | □数    | 金額   | □数 | 金額    |
| (アメリカ)                       | 千□    | 千米ドル | 千□ | 千米ドル  |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 0.405 | 27   | —  | —     |
| CROWN CASTLE INC             | 1     | 110  | —  | —     |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 0.219 | 16   | —  | —     |
| PROLOGIS INC                 | 2     | 262  | —  | —     |
| ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT   | 6     | 131  | —  | —     |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 0.355 | 70   | —  | —     |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 0.273 | 30   | —  | —     |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 3     | 202  | —  | —     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 0.163 | 44   | —  | —     |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 1     | 23   | —  | —     |
| WELLTOWER INC                | 5     | 809  | —  | —     |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC  | —     | —    | 80 | 1,252 |
| KIMCO REALTY CORP            | 1     | 41   | —  | —     |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 0.299 | 44   | —  | —     |
| PUBLIC STORAGE               | 0.397 | 118  | —  | —     |
| REGENCY CENTERS CORP         | 0.410 | 29   | —  | —     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 0.791 | 134  | —  | —     |
| SUN COMMUNITIES INC          | 0.332 | 41   | —  | —     |
| UDR INC                      | 0.928 | 37   | —  | —     |
| VENTAS INC                   | 4     | 310  | —  | —     |
| WP CAREY INC                 | 0.529 | 34   | —  | —     |
| REALTY INCOME CORP           | 5     | 306  | —  | —     |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 0.456 | 28   | —  | —     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 0.534 | 78   | —  | —     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 1     | 234  | —  | —     |
| IRON MOUNTAIN INC            | 0.870 | 82   | —  | —     |
| AMERICAN TOWER REIT INC      | 1     | 252  | —  | —     |
| EQUINIX INC                  | 0.386 | 330  | —  | —     |

外国

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          |
| <b>(アメリカ)</b>                          |       | 千口          |     | 千米ドル        |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A               | 0.840 | 30          | —   | —           |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE           | 0.775 | 36          | —   | —           |
| SBA COMMUNICATIONS CORP                | 0.242 | 55          | —   | —           |
| INVITATION HOMES INC                   | 1     | 44          | —   | —           |
| VICI PROPERTIES INC                    | 2     | 90          | —   | —           |
| <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                              | —     | —           | 221 | 1,061       |
| GOODMAN GROUP                          | 4     | 157         | —   | —           |
| STOCKLAND                              | 7     | 42          | —   | —           |
| VICINITY CENTRES                       | 10    | 26          | —   | —           |
| SCENTRE GROUP                          | 13    | 53          | —   | —           |
| <b>(香港)</b>                            |       | 千香港ドル       |     | 千香港ドル       |
| LINK REIT                              | 5     | 245         | —   | —           |
| <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               | 28    | 77          | —   | —           |
|  |       | (△ 3)       |     |             |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 21    | 45          | —   | —           |
|  |       | (△ 1)       |     |             |
| <b>(イギリス)</b>                          |       | 千イギリス・ポンド   |     | 千イギリス・ポンド   |
| LAND SECURITIES GROUP PLC              | 1     | 10          | —   | —           |
| SEGRO PLC                              | 2     | 19          | —   | —           |
| <b>(ユーロ／フランス)</b>                      |       | 千ユーロ        |     | 千ユーロ        |
| KLEPIERRE                              | 0.452 | 15          | —   | —           |
| GECINA SA                              | 0.100 | 9           | —   | —           |
| COVIVIO                                | 0.095 | 5           | —   | —           |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              | 0.353 | 30          | —   | —           |

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

| 種類別       | 買建            |               | 売建       |          |
|-----------|---------------|---------------|----------|----------|
|           | 新規買付額         | 決済額           | 新規売付額    | 決済額      |
| 外国 株式先物取引 | 百万円<br>92,256 | 百万円<br>77,352 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

(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

2025年5月21日～2025年11月20日

株式

| 銘柄                          | 買付  |           |        | 売付                                  |     |         |        |
|-----------------------------|-----|-----------|--------|-------------------------------------|-----|---------|--------|
|                             | 株数  | 金額        | 平均単価   | 銘柄                                  | 株数  | 金額      | 平均単価   |
|                             | 千株  | 千円        | 円      |                                     | 千株  | 千円      | 円      |
| MICROSOFT CORP              | 16  | 1,147,356 | 70,136 | T-MOBILE US INC                     | 7   | 246,625 | 35,071 |
| NVIDIA CORP                 | 47  | 1,121,158 | 23,850 | JUNIPER NETWORKS INC                | 38  | 232,719 | 5,975  |
| AMAZON.COM INC              | 33  | 1,025,214 | 31,047 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 2   | 219,444 | 83,375 |
| APPLE INC                   | 23  | 712,357   | 30,505 | MEDIOBANCA SPA                      | 63  | 196,056 | 3,068  |
| MASTERCARD INC-CLASS A      | 6   | 540,838   | 86,798 | MANHATTAN ASSOCIATES INC            | 7   | 192,940 | 27,336 |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 23  | 531,583   | 22,308 | SKYWORKS SOLUTIONS INC              | 18  | 184,884 | 9,995  |
| SOFI TECHNOLOGIES INC       | 130 | 490,636   | 3,764  | VIATRIS INC                         | 137 | 175,592 | 1,272  |
| BROADCOM INC                | 12  | 477,145   | 38,845 | EXACT SCIENCES CORP                 | 21  | 174,435 | 8,149  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 6   | 435,805   | 72,609 | ASSURANT INC                        | 5   | 173,916 | 29,392 |
| TESLA, INC.                 | 7   | 404,678   | 50,890 | STANLEY BLACK & DECKER INC          | 17  | 168,923 | 9,474  |

(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

2025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                          | 629     | 634    | 10,568  | 1,662,372  | 資本財                    |
| ABBOTT LABORATORIES            | 2,004   | 2,051  | 25,876  | 4,070,038  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ABBVIE INC                     | 2,041   | 2,082  | 48,504  | 7,629,299  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ACCENTURE PLC                  | 722     | 734    | 17,705  | 2,784,881  | ソフトウェア・サービス            |
| ADOBE INC                      | 502     | 500    | 15,908  | 2,502,276  | ソフトウェア・サービス            |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC     | 1,875   | 1,911  | 42,731  | 6,721,285  | 半導体・半導体製造装置            |
| AECOM                          | 153     | 155    | 1,761   | 277,131    | 資本財                    |
| AERCAP HOLDINGS NV             | 224     | 207    | 2,749   | 432,473    | 資本財                    |
| AFFIRM HOLDINGS INC            | -       | 315    | 2,063   | 324,556    | 金融サービス                 |
| AFLAC INC                      | 609     | 605    | 6,621   | 1,041,537  | 保険                     |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC       | 329     | 334    | 4,835   | 760,624    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC   | 256     | 262    | 6,645   | 1,045,236  | 素材                     |
| AIRBNB INC-CLASS A             | 500     | 508    | 5,822   | 915,817    | 消費者サービス                |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC        | 173     | 172    | 1,490   | 234,464    | ソフトウェア・サービス            |
| ALBEMARLE CORP                 | 135     | -      | -       | -          | 素材                     |
| ALBERTSONS COS INC - CLASS A   | 435     | 432    | 772     | 121,465    | 生活必需品流通・小売り            |
| ALIGN TECHNOLOGY INC           | 81      | 81     | 1,085   | 170,672    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALLEGION PLC                   | 100     | 101    | 1,629   | 256,347    | 資本財                    |
| ALLIANT ENERGY CORP            | 296     | 302    | 2,035   | 320,130    | 公益事業                   |
| ALLSTATE CORP                  | 305     | 312    | 6,550   | 1,030,319  | 保険                     |
| ALLY FINANCIAL INC             | 316     | -      | -       | -          | 金融サービス                 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC    | 149     | 153    | 7,083   | 1,114,126  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALPHABET INC-CL A              | 6,747   | 6,860  | 200,872 | 31,595,257 | メディア・娯楽                |
| ALPHABET INC-CL C              | 5,757   | 5,793  | 169,732 | 26,697,290 | メディア・娯楽                |
| ALTRIA GROUP INC               | 1,958   | 1,986  | 11,642  | 1,831,225  | 食品・飲料・タバコ              |
| AMAZON.COM INC                 | 10,933  | 11,264 | 250,840 | 39,454,661 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| AMCOR PLC                      | 1,673   | 2,709  | 2,281   | 358,888    | 素材                     |
| AMENTUM HOLDINGS INC           | 8       | -      | -       | -          | 商業・専門サービス              |
| AMEREN CORPORATION             | 308     | 325    | 3,348   | 526,752    | 公益事業                   |
| AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC | 615     | 629    | 7,665   | 1,205,655  | 公益事業                   |
| AMERICAN EXPRESS CO            | 651     | 660    | 22,771  | 3,581,659  | 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     |                        |
| (アメリカ)                        | 百株      | 百株     | 千米ドル    | 千円         |                        |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC  | 82      | 79     | 1,082   | 170,237    | 保険                     |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP  | 720     | 678    | 5,142   | 808,914    | 保険                     |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC   | 225     | 229    | 2,923   | 459,818    | 公益事業                   |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | 111     | 112    | 5,044   | 793,379    | 金融サービス                 |
| AMETEK INC                    | 267     | 272    | 5,213   | 820,013    | 資本財                    |
| AMGEN INC                     | 621     | 634    | 21,709  | 3,414,638  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMPHENOL CORP-CL A            | 1,392   | 1,425  | 19,486  | 3,064,986  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ANALOG DEVICES INC            | 573     | 585    | 13,585  | 2,136,872  | 半導体・半導体製造装置            |
| ANSYS INC                     | 101     | -      | -       | -          | ソフトウェア・サービス            |
| AON PLC                       | 224     | 241    | 8,324   | 1,309,351  | 保険                     |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC  | 457     | 471    | 5,998   | 943,563    | 金融サービス                 |
| APPLE INC                     | 17,374  | 17,607 | 472,879 | 74,379,238 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| APPLIED MATERIALS INC         | 940     | 946    | 22,243  | 3,498,722  | 半導体・半導体製造装置            |
| APPLOVIN CORP-CLASS A         | 241     | 272    | 14,420  | 2,268,206  | ソフトウェア・サービス            |
| APTIVE PLC                    | 271     | 256    | 1,856   | 292,026    | 自動車・自動車部品              |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD        | 434     | 441    | 4,023   | 632,801    | 保険                     |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO     | 553     | 566    | 3,299   | 518,967    | 食品・飲料・タバコ              |
| ARES MANAGEMENT CORP - A      | 217     | 254    | 3,691   | 580,571    | 金融サービス                 |
| ARISTA NETWORKS INC           | 1,237   | 1,258  | 15,707  | 2,470,646  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO       | 288     | 301    | 7,510   | 1,181,263  | 保険                     |
| ASSURANT INC                  | 59      | -      | -       | -          | 保険                     |
| AT&T INC                      | 8,301   | 8,493  | 21,462  | 3,375,819  | 電気通信サービス               |
| ATLISSIAN CORP-CL A           | 186     | 196    | 2,875   | 452,364    | ソフトウェア・サービス            |
| ATMOS ENERGY CORP             | 179     | 187    | 3,255   | 512,102    | 公益事業                   |
| AUTODESK INC                  | 248     | 252    | 7,346   | 1,155,520  | ソフトウェア・サービス            |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | 470     | 478    | 11,984  | 1,884,982  | 商業・専門サービス              |
| AUTOZONE INC                  | 19      | 19     | 7,510   | 1,181,320  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| AVANTOR INC                   | 786     | -      | -       | -          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AVERY DENNISON CORP           | 92      | 92     | 1,553   | 244,353    | 素材                     |
| AXON ENTERPRISE INC           | 83      | 87     | 4,631   | 728,426    | 資本財                    |
| BAKER HUGHES COMPANY          | 1,143   | 1,167  | 5,661   | 890,481    | エネルギー                  |
| BALL CORP                     | 344     | 310    | 1,478   | 232,504    | 素材                     |
| BANK OF AMERICA CORP          | 7,913   | 8,434  | 43,878  | 6,901,650  | 銀行                     |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP  | 828     | 842    | 9,062   | 1,425,466  | 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     |                        |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株    | 千米ドル    | 千円         |                        |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 590     | 606   | 1,072   | 168,625    | ヘルスケア機器・サービス           |
| BECTON DICKINSON & CO        | 335     | 337   | 6,462   | 1,016,542  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B  | 184     | 189   | 767     | 120,788    | ソフトウェア・サービス            |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 1,537   | 1,597 | 80,079  | 12,595,750 | 金融サービス                 |
| BEST BUY CO INC              | 234     | 236   | 1,762   | 277,224    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| BIOGEN INC                   | 168     | 172   | 2,901   | 456,349    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 220     | 226   | 1,188   | 186,978    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIO-RAD LABORATORIES-CL A    | 22      | -     | -       | -          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIO-TECHNE CORP              | 183     | -     | -       | -          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC                | 169     | 173   | 17,603  | 2,768,883  | 金融サービス                 |
| BLACKSTONE INC               | 834     | 860   | 11,926  | 1,875,859  | 金融サービス                 |
| BLOCK INC                    | 641     | 654   | 4,057   | 638,179    | 金融サービス                 |
| BOEING CO                    | 864     | 888   | 16,507  | 2,596,453  | 資本財                    |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 38      | 38    | 17,989  | 2,829,506  | 消費者サービス                |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 147     | 146   | 1,176   | 185,069    | 商業・専門サービス              |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 1,702   | 1,743 | 16,916  | 2,660,721  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 2,343   | 2,400 | 10,990  | 1,728,655  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BROADCOM INC                 | 5,144   | 5,267 | 186,697 | 29,365,700 | 半導体・半導体製造装置            |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 135     | 138   | 3,133   | 492,874    | 商業・専門サービス              |
| BROWN & BROWN INC            | 280     | 349   | 2,757   | 433,736    | 保険                     |
| BROWN-FORMAN CORP -CL B      | 211     | 215   | 586     | 92,323     | 食品・飲料・タバコ              |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC     | 132     | 130   | 1,246   | 196,118    | 資本財                    |
| BUNGE GLOBAL SA              | 161     | 165   | 1,538   | 241,985    | 食品・飲料・タバコ              |
| BURLINGTON STORES INC        | 73      | 74    | 2,077   | 326,776    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 136     | 139   | 2,117   | 333,137    | 運輸                     |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC   | 316     | 321   | 9,874   | 1,553,176  | ソフトウェア・サービス            |
| CAMPBELL SOUP CO             | 224     | -     | -       | -          | 食品・飲料・タバコ              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 736     | 754   | 15,274  | 2,402,497  | 金融サービス                 |
| CARDINAL HEALTH INC          | 279     | 281   | 5,837   | 918,251    | ヘルスケア機器・サービス           |
| CARLISLE COS INC             | 52      | 50    | 1,547   | 243,431    | 資本財                    |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 268     | 276   | 1,436   | 225,914    | 金融サービス                 |
| CARMAX INC                   | 177     | -     | -       | -          | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| CARNIVAL CORP                | 1,199   | 1,237 | 3,226   | 507,547    | 消費者サービス                |
| CARRIER GLOBAL CORP          | 932     | 909   | 4,661   | 733,271    | 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    |                    |
| (アメリカ)                              | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                    |
| CARVANA CO                          | 133     | 143   | 4,723  | 743,037   | 一般消費財・サービス流通・小売り   |
| CATERPILLAR INC                     | 557     | 554   | 30,665 | 4,823,380 | 資本財                |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC             | 120     | 123   | 3,138  | 493,726   | 金融サービス             |
| CBRE GROUP INC                      | 353     | 351   | 5,332  | 838,802   | 不動産管理・開発           |
| CDW CORP/DE                         | 154     | 155   | 2,169  | 341,249   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CENCORA, INC.                       | 200     | 217   | 7,828  | 1,231,411 | ヘルスケア機器・サービス       |
| CENTENE CORP                        | 583     | 586   | 2,109  | 331,810   | ヘルスケア機器・サービス       |
| CENTERPOINT ENERGY INC              | 752     | 769   | 3,047  | 479,281   | 公益事業               |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC          | 201     | 190   | 1,503  | 236,431   | 素材                 |
| CHARLES SCHWAB CORP                 | 1,989   | 2,034 | 18,850 | 2,964,948 | 金融サービス             |
| CHARTER COMMUNICATIONS-CL A         | 106     | 104   | 2,033  | 319,816   | メディア・娯楽            |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES   | 101     | 102   | 1,895  | 298,212   | ソフトウェア・サービス        |
| CHENIERE ENERGY INC                 | 259     | 261   | 5,478  | 861,667   | エネルギー              |
| CHEVRON CORP                        | 1,972   | 2,311 | 35,058 | 5,514,276 | エネルギー              |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC          | 1,574   | 1,588 | 4,924  | 774,541   | 消費者サービス            |
| CHUBB LTD                           | 442     | 448   | 13,189 | 2,074,652 | 保険                 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC              | 283     | 290   | 2,396  | 376,913   | 家庭用品・パーソナル用品       |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP           | 180     | 184   | 2,977  | 468,269   | 保険                 |
| CINTAS CORP                         | 419     | 428   | 7,858  | 1,235,987 | 商業・専門サービス          |
| CISCO SYSTEMS INC                   | 4,601   | 4,690 | 36,769 | 5,783,480 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CITIGROUP INC                       | 2,184   | 2,170 | 21,663 | 3,407,406 | 銀行                 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP            | 508     | 510   | 2,614  | 411,191   | 銀行                 |
| CLOROX CO                           | 143     | 145   | 1,432  | 225,325   | 家庭用品・パーソナル用品       |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A            | 353     | 366   | 7,183  | 1,129,918 | ソフトウェア・サービス        |
| CME GROUP INC                       | 416     | 424   | 11,580 | 1,821,419 | 金融サービス             |
| CMS ENERGY CORP                     | 345     | 352   | 2,572  | 404,572   | 公益事業               |
| CNH INDUSTRIAL NV                   | 1,010   | 1,031 | 989    | 155,618   | 資本財                |
| COCA-COLA CO                        | 4,728   | 4,821 | 34,282 | 5,392,325 | 食品・飲料・タバコ          |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC  | 238     | 271   | 2,426  | 381,679   | 食品・飲料・タバコ          |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP | 572     | 581   | 4,201  | 660,898   | ソフトウェア・サービス        |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A        | 224     | 236   | 6,091  | 958,106   | 金融サービス             |
| COLGATE-PALMOLIVE CO                | 897     | 907   | 7,124  | 1,120,604 | 家庭用品・パーソナル用品       |
| COMCAST CORP                        | 4,410   | 4,391 | 11,800 | 1,856,083 | メディア・娯楽            |
| CONAGRA BRANDS INC                  | 552     | -     | -      | -         | 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        |                        |
| CONOCOPHILLIPS               | 1,494   | 1,487 | 13,090 | 2,058,928 | エネルギー                  |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 400     | 424   | 4,264  | 670,691   | 公益事業                   |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 188     | 176   | 2,284  | 359,322   | 食品・飲料・タバコ              |
| CONSTELLATION ENERGY         | 361     | 369   | 13,207 | 2,077,344 | 公益事業                   |
| COOPER COS INC/THE           | 230     | 235   | 1,696  | 266,893   | ヘルスケア機器・サービス           |
| COPART INC                   | 1,001   | 1,082 | 4,479  | 704,554   | 商業・専門サービス              |
| COREBRIDGE FINANCIAL INC     | 293     | 317   | 884    | 139,133   | 金融サービス                 |
| CORNING INC                  | 939     | 959   | 7,836  | 1,232,542 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CORTEVA INC                  | 794     | 804   | 5,201  | 818,083   | 素材                     |
| COSTAR GROUP INC             | 473     | 497   | 3,284  | 516,587   | 不動産管理・開発               |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 512     | 522   | 46,559 | 7,323,371 | 生活必需品流通・小売り            |
| COTERRA ENERGY INC           | 850     | 899   | 2,315  | 364,272   | エネルギー                  |
| CRH PLC                      | 784     | 796   | 8,776  | 1,380,443 | 素材                     |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 284     | 293   | 15,297 | 2,406,149 | ソフトウェア・サービス            |
| CROWN HOLDINGS INC           | 138     | 137   | 1,299  | 204,346   | 素材                     |
| CSX CORP                     | 2,227   | 2,213 | 7,518  | 1,182,601 | 運輸                     |
| CUMMINS INC                  | 158     | 162   | 7,684  | 1,208,741 | 資本財                    |
| CVS HEALTH CORP              | 1,454   | 1,491 | 11,418 | 1,795,944 | ヘルスケア機器・サービス           |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 54      | 56    | 2,678  | 421,375   | ソフトウェア・サービス            |
| DANAHER CORP                 | 751     | 759   | 16,888 | 2,656,389 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 135     | 138   | 2,346  | 369,136   | 消費者サービス                |
| DATADOG INC - CLASS A        | 325     | 339   | 5,978  | 940,302   | ソフトウェア・サービス            |
| DAVITA INC                   | 52      | 48    | 562    | 88,515    | ヘルスケア機器・サービス           |
| DAYFORCE, INC.               | 173     | -     | -      | -         | 商業・専門サービス              |
| DECKERS OUTDOOR CORP         | 175     | 176   | 1,461  | 229,953   | 耐久消費財・アパレル             |
| DEERE & CO                   | 298     | 303   | 14,401 | 2,265,239 | 資本財                    |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 372     | 381   | 4,554  | 716,353   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| DELTA AIR LINES INC          | 186     | 192   | 1,095  | 172,300   | 運輸                     |
| DEVON ENERGY CORPORATION     | 720     | 717   | 2,531  | 398,137   | エネルギー                  |
| DEXCOM INC                   | 451     | 462   | 2,761  | 434,308   | ヘルスケア機器・サービス           |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | 219     | 223   | 3,323  | 522,732   | エネルギー                  |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    | 66      | 66    | 1,378  | 216,885   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| DOCUSIGN INC                 | 233     | 238   | 1,549  | 243,774   | ソフトウェア・サービス            |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 254     | 259   | 2,586  | 406,801   | 生活必需品流通・小売り            |

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                          | 期首(前期末) |       | 当期末    |            | 業種等                    |
|-----------------------------|---------|-------|--------|------------|------------------------|
|                             | 株数      | 株数    | 評価額    |            |                        |
|                             |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |                        |
| <b>(アメリカ)</b>               | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円         |                        |
| DOLLAR TREE INC             | 236     | 233   | 2,335  | 367,418    | 生活必需品流通・小売り            |
| DOMINION ENERGY INC         | 970     | 1,005 | 6,054  | 952,247    | 公益事業                   |
| DOMINO'S PIZZA INC          | 39      | 38    | 1,533  | 241,146    | 消費者サービス                |
| DOORDASH INC - A            | 405     | 423   | 8,558  | 1,346,107  | 消費者サービス                |
| DOVER CORP                  | 158     | 161   | 2,900  | 456,214    | 資本財                    |
| DOW INC                     | 810     | 836   | 1,782  | 280,295    | 素材                     |
| DR HORTON INC               | 333     | 325   | 4,481  | 704,946    | 耐久消費財・アパレル             |
| DRAFTKINGS INC              | 507     | 526   | 1,528  | 240,374    | 消費者サービス                |
| DTE ENERGY COMPANY          | 239     | 244   | 3,303  | 519,558    | 公益事業                   |
| DUKE ENERGY CORP            | 892     | 916   | 11,200 | 1,761,733  | 公益事業                   |
| DUPONT DE NEMOURS INC       | 482     | 493   | 1,867  | 293,814    | 素材                     |
| DYNATRACE INC               | 344     | 355   | 1,611  | 253,538    | ソフトウェア・サービス            |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY    | 133     | -     | -      | -          | 素材                     |
| EATON CORP PLC              | 456     | 461   | 15,943 | 2,507,799  | 資本財                    |
| EBAY INC                    | 553     | 543   | 4,416  | 694,724    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| ECOLAB INC                  | 294     | 300   | 7,864  | 1,237,066  | 素材                     |
| EDISON INTERNATIONAL        | 447     | 453   | 2,609  | 410,460    | 公益事業                   |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP   | 681     | 691   | 5,947  | 935,470    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ELECTRONIC ARTS INC         | 287     | 281   | 5,672  | 892,221    | メディア・娯楽                |
| ELEVANCE HEALTH, INC        | 267     | 266   | 8,428  | 1,325,754  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ELI LILLY & CO              | 932     | 949   | 99,680 | 15,678,747 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EMCOR GROUP INC             | 53      | 52    | 3,193  | 502,287    | 資本財                    |
| EMERSON ELECTRIC CO         | 658     | 663   | 8,499  | 1,336,901  | 資本財                    |
| ENTEGRIS INC                | 174     | 178   | 1,317  | 207,185    | 半導体・半導体製造装置            |
| ENTERGY CORP                | 495     | 525   | 4,944  | 777,775    | 公益事業                   |
| EOG RESOURCES INC           | 646     | 642   | 6,883  | 1,082,676  | エネルギー                  |
| EPAM SYSTEMS INC            | 65      | -     | -      | -          | ソフトウェア・サービス            |
| EQT CORP                    | 654     | 698   | 4,114  | 647,220    | エネルギー                  |
| EQUIFAX INC                 | 143     | 146   | 3,019  | 474,960    | 商業・専門サービス              |
| EQUITABLE HOLDINGS INC      | 361     | 357   | 1,573  | 247,479    | 金融サービス                 |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 29      | 29    | 854    | 134,331    | 保険                     |
| ESSENTIAL UTILITIES INC     | 301     | 330   | 1,267  | 199,337    | 公益事業                   |
| ESTEE LAUDER COS INC        | 269     | 276   | 2,372  | 373,209    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EVEREST GROUP LTD           | 49      | 50    | 1,568  | 246,721    | 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        |                        |
| EVERGY INC                              | 265     | 271   | 2,051  | 322,620   | 公益事業                   |
| EVERSOURCE ENERGY                       | 423     | 433   | 2,828  | 444,945   | 公益事業                   |
| EXACT SCIENCES CORP                     | 214     | -     | -      | -         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EXELON CORP                             | 1,160   | 1,190 | 5,422  | 852,934   | 公益事業                   |
| EXPAND ENERGY CORPORATION               | 240     | 266   | 3,125  | 491,606   | エネルギー                  |
| EXPEDIA GROUP INC                       | 141     | 143   | 3,438  | 540,823   | 消費者サービス                |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC | 161     | 161   | 2,242  | 352,766   | 運輸                     |
| EXXON MOBIL CORP                        | 5,078   | 5,080 | 59,619 | 9,377,614 | エネルギー                  |
| F5 INC                                  | 67      | 67    | 1,515  | 238,410   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC            | 43      | 44    | 1,190  | 187,276   | 金融サービス                 |
| FAIR ISAAC CORP                         | 28      | 28    | 4,981  | 783,468   | ソフトウェア・サービス            |
| FASTENAL CO                             | 662     | 1,352 | 5,348  | 841,216   | 資本財                    |
| FEDEX CORP                              | 264     | 268   | 7,045  | 1,108,110 | 運輸                     |
| FERGUSON ENTERPRISES INC                | 231     | 232   | 5,502  | 865,423   | 資本財                    |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL             | 300     | 307   | 1,763  | 277,342   | 保険                     |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION           | 622     | 619   | 3,881  | 610,556   | 金融サービス                 |
| FIFTH THIRD BANCORP                     | 774     | 786   | 3,264  | 513,404   | 銀行                     |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A              | 11      | 10    | 1,987  | 312,574   | 銀行                     |
| FIRST SOLAR INC                         | 117     | 120   | 3,025  | 475,835   | 半導体・半導体製造装置            |
| FIRSTENERGY CORP                        | 632     | 646   | 2,991  | 470,488   | 公益事業                   |
| FISERV INC                              | 657     | 653   | 3,998  | 628,875   | 金融サービス                 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC               | 76      | 78    | 2,182  | 343,222   | 金融サービス                 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI            | 205     | 208   | 4,026  | 633,281   | 消費者サービス                |
| FORD MOTOR CO                           | 4,510   | 4,606 | 5,942  | 934,647   | 自動車・自動車部品              |
| FORTINET INC                            | 752     | 767   | 6,115  | 961,974   | ソフトウェア・サービス            |
| FORTIVE CORP                            | 400     | 399   | 2,014  | 316,825   | 資本財                    |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC         | 143     | -     | -      | -         | 資本財                    |
| FOX CORP - CLASS A                      | 256     | 251   | 1,632  | 256,728   | メディア・娯楽                |
| FOX CORP- CLASS B                       | 163     | 166   | 971    | 152,740   | メディア・娯楽                |
| FRANKLIN RESOURCES INC                  | 334     | -     | -      | -         | 金融サービス                 |
| FREEMONT-MCMORAN INC                    | 1,659   | 1,692 | 6,981  | 1,098,058 | 素材                     |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR                   | 64      | 72    | 1,203  | 189,341   | 金融サービス                 |
| GARMIN LTD                              | 177     | 192   | 3,657  | 575,330   | 耐久消費財・アパレル             |
| GARTNER INC                             | 89      | 90    | 2,050  | 322,472   | 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        |                        |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY     | 527     | 539   | 3,901  | 613,698   | ヘルスケア機器・サービス           |
| GE VERNOVA INC               | 318     | 321   | 19,157 | 3,013,239 | 資本財                    |
| GEN DIGITAL INC              | 640     | 621   | 1,620  | 254,858   | ソフトウェア・サービス            |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 270     | 268   | 9,227  | 1,451,467 | 資本財                    |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 1,250   | 1,257 | 37,815 | 5,947,996 | 資本財                    |
| GENERAL MILLS INC            | 637     | 640   | 3,051  | 480,017   | 食品・飲料・タバコ              |
| GENERAL MOTORS CO            | 1,269   | 1,132 | 7,760  | 1,220,724 | 自動車・自動車部品              |
| GENUINE PARTS CO             | 160     | 163   | 2,054  | 323,180   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| GILEAD SCIENCES INC          | 1,440   | 1,466 | 18,783 | 2,954,459 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 294     | 287   | 2,071  | 325,827   | 金融サービス                 |
| GLOBAL-E ONLINE LTD          | 115     | -     | -      | -         | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| GODADDY INC - CLASS A        | 162     | 167   | 2,086  | 328,230   | ソフトウェア・サービス            |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 362     | 361   | 28,425 | 4,471,019 | 金融サービス                 |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A     | 2,663   | 2,795 | 1,484  | 233,480   | 運輸                     |
| GRACO INC                    | 195     | 197   | 1,564  | 246,130   | 資本財                    |
| HALLIBURTON CO               | 1,015   | 1,013 | 2,682  | 421,932   | エネルギー                  |
| HARTFORD INSURANCE GROUP INC | 334     | 334   | 4,420  | 695,258   | 保険                     |
| HCA HEALTHCARE INC           | 219     | 212   | 10,231 | 1,609,338 | ヘルスケア機器・サービス           |
| HEICO CORP                   | 51      | 51    | 1,596  | 251,103   | 資本財                    |
| HEICO CORP-CLASS A           | 87      | 89    | 2,147  | 337,834   | 資本財                    |
| HERSHEY CO/THE               | 170     | 174   | 3,185  | 500,969   | 食品・飲料・タバコ              |
| HESS CORP                    | 320     | -     | -      | -         | エネルギー                  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS    | 1,519   | 1,547 | 3,186  | 501,267   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 281     | 280   | 7,478  | 1,176,238 | 消費者サービス                |
| HOLOGIC INC                  | 262     | 262   | 1,947  | 306,366   | ヘルスケア機器・サービス           |
| HOME DEPOT INC               | 1,147   | 1,173 | 39,237 | 6,171,616 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 751     | 757   | 14,440 | 2,271,337 | 資本財                    |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 1,276   | 1,288 | 815    | 128,239   | 不動産管理・開発               |
| HORMEL FOODS CORP            | 349     | 357   | 794    | 124,888   | 食品・飲料・タバコ              |
| HOWMET AEROSPACE INC         | 445     | 452   | 9,133  | 1,436,547 | 資本財                    |
| HP INC                       | 1,083   | 1,107 | 2,489  | 391,537   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HUBBELL INC                  | 61      | 62    | 2,636  | 414,694   | 資本財                    |
| HUBSPOT INC                  | 56      | 59    | 2,138  | 336,416   | ソフトウェア・サービス            |
| HUMANA INC                   | 139     | 142   | 3,257  | 512,368   | ヘルスケア機器・サービス           |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                     | 期首(前期末) | 当期末   |        |            | 業種等                    |
|--|---------|-------|--------|------------|------------------------|
|  | 株数      | 株数    | 評価額    |            |                        |
|  |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |                        |
| (アメリカ)                                 | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円         |                        |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC              | 1,677   | 1,717 | 2,641  | 415,508    | 銀行                     |
| HYATT HOTELS CORP - CL A               | 48      | 49    | 746    | 117,408    | 消費者サービス                |
| IDEX CORP                              | 87      | 89    | 1,442  | 226,943    | 資本財                    |
| IDEXX LABORATORIES INC                 | 94      | 94    | 6,609  | 1,039,561  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC                | 341     | 328   | 7,913  | 1,244,768  | 資本財                    |
| ILLUMINA INC                           | 183     | 186   | 2,242  | 352,707    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INCYTE CORP                            | 189     | 193   | 1,965  | 309,106    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INGERSOLL-RAND INC                     | 465     | 475   | 3,503  | 551,078    | 資本財                    |
| INSULET CORP                           | 81      | 82    | 2,873  | 452,011    | ヘルスケア機器・サービス           |
| INTEL CORP                             | 4,983   | 5,142 | 18,056 | 2,840,075  | 半導体・半導体製造装置            |
| INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A           | 125     | 513   | 3,315  | 521,461    | 金融サービス                 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC          | 663     | 676   | 10,389 | 1,634,165  | 金融サービス                 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP   | 1,068   | 1,095 | 31,614 | 4,972,693  | ソフトウェア・サービス            |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC | 295     | 301   | 1,965  | 309,142    | 素材                     |
| INTERNATIONAL PAPER CO                 | 576     | 591   | 2,152  | 338,538    | 素材                     |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC           | 431     | -     | -      | -          | メディア・娯楽                |
| INTUIT INC                             | 323     | 328   | 21,396 | 3,365,524  | ソフトウェア・サービス            |
| INTUITIVE SURGICAL INC                 | 411     | 422   | 23,857 | 3,752,494  | ヘルスケア機器・サービス           |
| IQVIA HOLDINGS INC                     | 209     | 203   | 4,435  | 697,626    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JABIL CIRCUIT INC                      | 128     | 126   | 2,530  | 398,028    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC            | 84      | 85    | 1,425  | 224,172    | 金融サービス                 |
| JACOBS SOLUTIONS INC                   | 143     | 141   | 2,050  | 322,466    | 商業・専門サービス              |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD             | 185     | 191   | 1,215  | 191,189    | 資本財                    |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC         | 93      | 91    | 1,459  | 229,553    | 運輸                     |
| JM SMUCKER CO                          | 123     | 126   | 1,319  | 207,612    | 食品・飲料・タバコ              |
| JOHNSON & JOHNSON                      | 2,781   | 2,836 | 57,447 | 9,035,842  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC     | 765     | 775   | 8,875  | 1,396,018  | 資本財                    |
| JPMORGAN CHASE & CO                    | 3,252   | 3,276 | 99,356 | 15,627,769 | 銀行                     |
| JUNIPER NETWORKS INC                   | 383     | -     | -      | -          | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KELLANOVA                              | 318     | 327   | 2,729  | 429,389    | 食品・飲料・タバコ              |
| KENVUE INC                             | 2,215   | 2,264 | 3,636  | 571,964    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| KEURIG DR PEPPER INC                   | 1,332   | 1,521 | 4,091  | 643,493    | 食品・飲料・タバコ              |
| KEYCORP                                | 1,072   | 1,099 | 1,907  | 300,048    | 銀行                     |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN               | 200     | 202   | 3,541  | 557,115    | 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        |                  |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 385     | 391   | 4,006  | 630,207   | 家庭用品・パーソナル用品     |
| KINDER MORGAN INC            | 2,309   | 2,357 | 6,323  | 994,561   | エネルギー            |
| KKR & CO INC -A              | 718     | 734   | 8,634  | 1,358,081 | 金融サービス           |
| KLA CORPORATION              | 154     | 155   | 18,198 | 2,862,421 | 半導体・半導体製造装置      |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 1,048   | 1,048 | 2,612  | 410,980   | 食品・飲料・タバコ        |
| KROGER CO                    | 794     | 740   | 4,990  | 785,029   | 生活必需品流通・小売り      |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 219     | 220   | 6,289  | 989,227   | 資本財              |
| LABCORP HOLDINGS INC         | 96      | 98    | 2,570  | 404,286   | ヘルスケア機器・サービス     |
| LAM RESEARCH CORP            | 1,486   | 1,507 | 22,436 | 3,529,108 | 半導体・半導体製造装置      |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 419     | 416   | 2,668  | 419,710   | 消費者サービス          |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 146     | 144   | 2,725  | 428,666   | 商業・専門サービス        |
| LENNAR CORP-CL A             | 275     | 268   | 3,089  | 485,931   | 耐久消費財・アパレル       |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 37      | 37    | 1,679  | 264,239   | 資本財              |
| LIBERTY MEDIA CORP-FORMULA-C | 244     | 249   | 2,397  | 377,055   | メディア・娯楽          |
| LINDE PLC                    | 550     | 554   | 22,927 | 3,606,288 | 素材               |
| LIVE NATION INC              | 186     | 191   | 2,486  | 391,123   | メディア・娯楽          |
| LKQ CORP                     | 300     | -     | -      | -         | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 246     | 248   | 11,686 | 1,838,121 | 資本財              |
| LOEWS CORP                   | 213     | 209   | 2,202  | 346,506   | 保険               |
| LOWE'S COS INC               | 652     | 660   | 15,092 | 2,373,850 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC   | 86      | 94    | 3,359  | 528,359   | 金融サービス           |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 128     | 128   | 2,131  | 335,218   | 耐久消費財・アパレル       |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 300     | 304   | 1,300  | 204,529   | 素材               |
| M&T BANK CORP                | 191     | 189   | 3,455  | 543,579   | 銀行               |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC     | 70      | -     | -      | -         | ソフトウェア・サービス      |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 371     | 361   | 7,074  | 1,112,717 | エネルギー            |
| MARKEL GROUP INC             | 14      | 14    | 3,046  | 479,237   | 保険               |
| MARRIOTT INTERNATIONAL INC   | 272     | 274   | 7,798  | 1,226,617 | 消費者サービス          |
| MARSH & MCLENNAN COS INC     | 567     | 581   | 10,291 | 1,618,711 | 保険               |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 70      | 71    | 4,239  | 666,879   | 素材               |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 999     | 1,016 | 8,266  | 1,300,238 | 半導体・半導体製造装置      |
| MASCO CORP                   | 249     | 248   | 1,477  | 232,433   | 資本財              |
| MASTERCARD INC-CLASS A       | 947     | 1,009 | 53,534 | 8,420,447 | 金融サービス           |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 291     | 298   | 1,992  | 313,424   | 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     |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                   | 百株      | 百株    | 千米ドル    | 千円         |                        |
| MCDONALD'S CORP                 | 828     | 843   | 25,523  | 4,014,576  | 消費者サービス                |
| MCKESSON CORP                   | 146     | 147   | 12,571  | 1,977,351  | ヘルスケア機器・サービス           |
| MEDTRONIC PLC                   | 1,481   | 1,510 | 15,159  | 2,384,416  | ヘルスケア機器・サービス           |
| MERCADOLIBRE INC                | 52      | 53    | 11,173  | 1,757,424  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| MERCK & CO INC                  | 2,923   | 2,960 | 28,139  | 4,426,130  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| META PLATFORMS INC-A            | 2,518   | 2,559 | 151,097 | 23,766,067 | メディア・娯楽                |
| METLIFE INC                     | 679     | 672   | 5,027   | 790,710    | 保険                     |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL    | 24      | 24    | 3,440   | 541,211    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MGM MIRAGE                      | 257     | -     | -       | -          | 消費者サービス                |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC        | 620     | 636   | 3,233   | 508,528    | 半導体・半導体製造装置            |
| MICRON TECHNOLOGY INC           | 1,287   | 1,319 | 29,804  | 4,687,984  | 半導体・半導体製造装置            |
| MICROSOFT CORP                  | 8,160   | 8,324 | 405,486 | 63,779,045 | ソフトウェア・サービス            |
| MICROSTRATEGY INC-CL A          | 262     | 307   | 5,739   | 902,801    | ソフトウェア・サービス            |
| MODERNA INC                     | 378     | -     | -       | -          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MOLINA HEALTHCARE INC           | 66      | 63    | 882     | 138,822    | ヘルスケア機器・サービス           |
| MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B | 208     | 209   | 946     | 148,833    | 食品・飲料・タバコ              |
| MONDAY.COM LTD                  | 43      | 47    | 713     | 112,175    | ソフトウェア・サービス            |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC      | 1,545   | 1,526 | 8,561   | 1,346,675  | 食品・飲料・タバコ              |
| MONGODB INC                     | 86      | 96    | 3,249   | 511,113    | ソフトウェア・サービス            |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC    | 56      | 56    | 4,993   | 785,482    | 半導体・半導体製造装置            |
| MONSTER BEVERAGE CORP           | 842     | 862   | 6,232   | 980,374    | 食品・飲料・タバコ              |
| MOODY'S CORP                    | 188     | 190   | 9,023   | 1,419,320  | 金融サービス                 |
| MORGAN STANLEY                  | 1,395   | 1,412 | 22,927  | 3,606,269  | 金融サービス                 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC          | 193     | 196   | 7,311   | 1,150,055  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MSCI INC                        | 90      | 91    | 5,105   | 802,987    | 金融サービス                 |
| NASDAQ INC                      | 498     | 507   | 4,365   | 686,678    | 金融サービス                 |
| NATERA INC                      | 144     | 152   | 3,339   | 525,295    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NETAPP INC                      | 234     | 236   | 2,509   | 394,796    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NETFLIX INC                     | 493     | 5,017 | 55,188  | 8,680,536  | メディア・娯楽                |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC      | 117     | 116   | 1,610   | 253,375    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NEWMONT CORP                    | 1,315   | 1,297 | 11,353  | 1,785,799  | 素材                     |
| NEWS CORP - CLASS A             | 437     | 443   | 1,107   | 174,268    | メディア・娯楽                |
| NEXTERA ENERGY INC              | 2,375   | 2,427 | 20,452  | 3,216,946  | 公益事業                   |
| NIKE INC                        | 1,364   | 1,389 | 8,701   | 1,368,621  | 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         |                        |
| NISOURCE INC                 | 538     | 554    | 2,367   | 372,397    | 公益事業                   |
| NORDSON CORP                 | 62      | 63     | 1,441   | 226,686    | 資本財                    |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 261     | 265    | 7,488   | 1,177,837  | 運輸                     |
| NORTHERN TRUST CORP          | 228     | 229    | 2,887   | 454,197    | 金融サービス                 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 159     | 161    | 9,109   | 1,432,832  | 資本財                    |
| NRG ENERGY INC               | 233     | 230    | 3,888   | 611,671    | 公益事業                   |
| NUCOR CORP                   | 271     | 272    | 4,042   | 635,831    | 素材                     |
| NUTANIX INC - A              | 294     | 300    | 1,813   | 285,209    | ソフトウェア・サービス            |
| NVIDIA CORP                  | 28,295  | 28,765 | 536,529 | 84,390,774 | 半導体・半導体製造装置            |
| NVR INC                      | 3       | 3      | 2,328   | 366,203    | 耐久消費財・アパレル             |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 293     | 297    | 5,660   | 890,349    | 半導体・半導体製造装置            |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 812     | 869    | 3,603   | 566,787    | エネルギー                  |
| OKTA INC                     | 189     | 197    | 1,578   | 248,319    | ソフトウェア・サービス            |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 221     | 224    | 2,857   | 449,516    | 運輸                     |
| OMNICOM GROUP                | 227     | 228    | 1,645   | 258,875    | メディア・娯楽                |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 492     | 492    | 2,272   | 357,386    | 半導体・半導体製造装置            |
| ONEOK INC                    | 717     | 736    | 5,115   | 804,591    | エネルギー                  |
| ORACLE CORP                  | 1,938   | 1,997  | 45,043  | 7,084,861  | ソフトウェア・サービス            |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 66      | 1,007  | 9,945   | 1,564,406  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 461     | 465    | 4,030   | 633,952    | 資本財                    |
| OVINTIV INC                  | 299     | -      | -       | -          | エネルギー                  |
| OWENS CORNING                | 98      | 100    | 993     | 156,249    | 資本財                    |
| PACCAR INC                   | 605     | 619    | 5,974   | 939,769    | 資本財                    |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 103     | 106    | 2,060   | 324,120    | 素材                     |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A  | 2,431   | 2,669  | 44,156  | 6,945,358  | ソフトウェア・サービス            |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 758     | 786    | 15,713  | 2,471,645  | ソフトウェア・サービス            |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 148     | 150    | 12,360  | 1,944,250  | 資本財                    |
| PAYCHEX INC                  | 374     | 382    | 4,189   | 659,004    | 商業・専門サービス              |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 59      | 61     | 987     | 155,331    | 商業・専門サービス              |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 1,100   | 1,089  | 6,547   | 1,029,796  | 金融サービス                 |
| PENTAIR PLC                  | 190     | 193    | 1,986   | 312,525    | 資本財                    |
| PEPSICO INC                  | 1,585   | 1,616  | 23,783  | 3,740,940  | 食品・飲料・タバコ              |
| PFIZER INC                   | 6,549   | 6,705  | 16,682  | 2,623,929  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PG&E CORP                    | 2,533   | 2,590  | 4,071   | 640,442    | 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>(アメリカ)</b>                | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 1,796   | 1,835 | 28,555 | 4,491,571 | 食品・飲料・タバコ              |
| PHILLIPS 66                  | 477     | 480   | 6,458  | 1,015,832 | エネルギー                  |
| PINTEREST INC- CLASS A       | 685     | 700   | 1,785  | 280,816   | メディア・娯楽                |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 458     | 466   | 8,533  | 1,342,240 | 銀行                     |
| POOL CORP                    | 44      | 42    | 986    | 155,093   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| PPG INDUSTRIES INC           | 268     | 267   | 2,525  | 397,233   | 素材                     |
| PPL CORPORATION              | 851     | 870   | 3,095  | 486,904   | 公益事業                   |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 264     | 262   | 2,182  | 343,319   | 保険                     |
| PROCTER & GAMBLE CO          | 2,721   | 2,764 | 40,630 | 6,390,823 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PROGRESSIVE CORP             | 676     | 691   | 15,404 | 2,423,003 | 保険                     |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 411     | 417   | 4,323  | 680,096   | 保険                     |
| PTC INC                      | 139     | 141   | 2,431  | 382,408   | ソフトウェア・サービス            |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 575     | 587   | 4,768  | 750,107   | 公益事業                   |
| PULTE GROUP INC              | 236     | 236   | 2,685  | 422,353   | 耐久消費財・アパレル             |
| PURE STORAGE INC - CLASS A   | 358     | 365   | 2,999  | 471,745   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| QNTITY ELECTRONICS INC       | -       | 246   | 1,963  | 308,777   | 半導体・半導体製造装置            |
| QUALCOMM INC                 | 1,283   | 1,275 | 21,182 | 3,331,849 | 半導体・半導体製造装置            |
| QUANTA SERVICES INC          | 170     | 174   | 7,781  | 1,223,947 | 資本財                    |
| QUEST DIAGNOSTICS            | 128     | 131   | 2,447  | 384,983   | ヘルスケア機器・サービス           |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 224     | 225   | 3,561  | 560,134   | 金融サービス                 |
| REDDIT INC-CL A              | 76      | 122   | 2,300  | 361,785   | メディア・娯楽                |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 124     | 125   | 8,795  | 1,383,462 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 1,049   | 1,059 | 2,565  | 403,585   | 銀行                     |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM    | 62      | 61    | 1,654  | 260,170   | 素材                     |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 253     | 257   | 5,607  | 881,929   | 商業・専門サービス              |
| RESMED INC                   | 169     | 172   | 4,234  | 666,068   | ヘルスケア機器・サービス           |
| REVVITY INC                  | 140     | 139   | 1,282  | 201,689   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | 878     | 915   | 1,347  | 211,994   | 自動車・自動車部品              |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A    | 707     | 858   | 10,149 | 1,596,447 | 金融サービス                 |
| ROBLOX CORP -CLASS A         | 561     | 668   | 6,508  | 1,023,783 | メディア・娯楽                |
| ROCKET LAB CORP              | -       | 508   | 2,218  | 349,018   | 資本財                    |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 130     | 132   | 4,951  | 778,743   | 資本財                    |
| ROKU INC                     | 147     | -     | -      | -         | メディア・娯楽                |
| ROLLINS INC                  | 335     | 342   | 2,034  | 320,056   | 商業・専門サービス              |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                          | 期首(前期末) | 当期末   |        |           | 業種等                    |
|-----------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
|                             | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                        |
|                             |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| (アメリカ)                      | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| ROPER TECHNOLOGIES INC      | 123     | 126   | 5,638  | 886,805   | ソフトウェア・サービス            |
| ROSS STORES INC             | 381     | 385   | 6,186  | 973,120   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 295     | 304   | 7,784  | 1,224,415 | 消費者サービス                |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A    | 436     | 447   | 1,728  | 271,876   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RPM INTERNATIONAL INC       | 148     | 151   | 1,550  | 243,930   | 素材                     |
| RTX CORPORATION             | 1,537   | 1,575 | 27,368 | 4,304,834 | 資本財                    |
| S&P GLOBAL INC              | 366     | 370   | 18,162 | 2,856,786 | 金融サービス                 |
| SALESFORCE INC              | 1,105   | 1,127 | 25,684 | 4,039,856 | ソフトウェア・サービス            |
| SAMSARA INC-CL A            | 300     | 334   | 1,218  | 191,701   | ソフトウェア・サービス            |
| SEA LTD-ADR                 | 423     | 450   | 6,472  | 1,018,124 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| SEAGATE TECHNOLOGY          | 244     | 250   | 6,482  | 1,019,594 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SEI INVESTMENTS COMPANY     | 126     | -     | -      | -         | 金融サービス                 |
| SEMPRA                      | 731     | 768   | 6,997  | 1,100,655 | 公益事業                   |
| SERVICENOW INC              | 238     | 244   | 19,940 | 3,136,387 | ソフトウェア・サービス            |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE     | 276     | 280   | 9,255  | 1,455,814 | 素材                     |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC      | 184     | -     | -      | -         | 半導体・半導体製造装置            |
| SLB LTD                     | 1,631   | 1,769 | 6,343  | 997,829   | エネルギー                  |
| SMITH (A.O.) CORP           | 138     | -     | -      | -         | 資本財                    |
| SMURFIT WESTROCK PLC        | 601     | 615   | 2,073  | 326,124   | 素材                     |
| SNAP INC - A                | 1,233   | 1,263 | 1,014  | 159,598   | メディア・娯楽                |
| SNAP-ON INC                 | 60      | 61    | 2,036  | 320,309   | 資本財                    |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A       | 343     | 373   | 9,455  | 1,487,236 | ソフトウェア・サービス            |
| SOFI TECHNOLOGIES INC       | -       | 1,303 | 3,482  | 547,808   | 金融サービス                 |
| SOLVENTUM CORP              | 169     | 183   | 1,418  | 223,052   | ヘルスケア機器・サービス           |
| SOUTHERN CO                 | 1,265   | 1,295 | 11,536 | 1,814,648 | 公益事業                   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO       | 174     | -     | -      | -         | 運輸                     |
| SPOTIFY TECHNOLOGY SA       | 177     | 180   | 11,147 | 1,753,334 | メディア・娯楽                |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS  | 257     | 261   | 2,165  | 340,588   | 商業・専門サービス              |
| STANLEY BLACK & DECKER INC  | 178     | -     | -      | -         | 資本財                    |
| STARBUCKS CORP              | 1,310   | 1,339 | 11,212 | 1,763,645 | 消費者サービス                |
| STATE STREET CORP           | 338     | 335   | 3,829  | 602,286   | 金融サービス                 |
| STEEL DYNAMICS INC          | 167     | 166   | 2,583  | 406,299   | 素材                     |
| STERIS PLC                  | 114     | 115   | 2,954  | 464,694   | ヘルスケア機器・サービス           |
| STRYKER CORP                | 396     | 405   | 14,767 | 2,322,812 | ヘルスケア機器・サービス           |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                             | 期首(前期末) | 当期末   |         |            | 業種等                    |
|--------------------------------|---------|-------|---------|------------|------------------------|
|                                | 株数      | 株数    | 評価額     |            |                        |
|                                |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                        |
| (アメリカ)                         | 百株      | 百株    | 千米ドル    | 千円         |                        |
| SUPER MICRO COMPUTER INC       | 608     | 598   | 2,017   | 317,267    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SYNCHRONY FINANCIAL            | 449     | 448   | 3,252   | 511,526    | 金融サービス                 |
| SYNOPSIS INC                   | 178     | 218   | 8,442   | 1,327,995  | ソフトウェア・サービス            |
| SYSCO CORP                     | 567     | 571   | 4,329   | 681,008    | 生活必需品流通・小売り            |
| T ROWE PRICE GROUP INC         | 256     | 259   | 2,532   | 398,316    | 金融サービス                 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE  | 202     | 215   | 5,186   | 815,819    | メディア・娯楽                |
| TAPESTRY INC                   | -       | 244   | 2,555   | 402,026    | 耐久消費財・アパレル             |
| TARGA RESOURCES CORP           | 239     | 255   | 4,349   | 684,072    | エネルギー                  |
| TARGET CORP                    | 529     | 535   | 4,612   | 725,474    | 生活必需品流通・小売り            |
| TE CONNECTIVITY PLC            | 345     | 349   | 8,145   | 1,281,270  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC      | 53      | 55    | 2,728   | 429,169    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TERADYNE INC                   | 188     | 189   | 3,181   | 500,402    | 半導体・半導体製造装置            |
| TESLA, INC.                    | 3,337   | 3,417 | 138,062 | 21,715,893 | 自動車・自動車部品              |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 1,294   | 1,351 | 3,303   | 519,581    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXAS INSTRUMENTS INC          | 1,054   | 1,071 | 16,826  | 2,646,621  | 半導体・半導体製造装置            |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP        | 22      | 23    | 2,085   | 328,101    | エネルギー                  |
| TEXTRON INC                    | 214     | 212   | 1,695   | 266,657    | 資本財                    |
| THE CIGNA GROUP                | 321     | 314   | 8,566   | 1,347,397  | ヘルスケア機器・サービス           |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC   | 441     | 445   | 25,535  | 4,016,459  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TJX COS INC                    | 1,298   | 1,315 | 19,177  | 3,016,362  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| T-MOBILE US INC                | 604     | 603   | 12,743  | 2,004,373  | 電気通信サービス               |
| TOAST INC-CLASS A              | 462     | 528   | 1,741   | 273,895    | 金融サービス                 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY         | 617     | 625   | 3,284   | 516,641    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A    | 519     | 526   | 2,116   | 332,870    | メディア・娯楽                |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A   | 134     | 137   | 1,474   | 231,869    | 金融サービス                 |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC         | 259     | 262   | 10,694  | 1,682,112  | 資本財                    |
| TRANSDIGM GROUP INC            | 64      | 66    | 8,882   | 1,397,160  | 資本財                    |
| TRANSUNION                     | 225     | 229   | 1,882   | 296,111    | 商業・専門サービス              |
| TRAVELERS COS INC/THE          | 262     | 267   | 7,622   | 1,198,872  | 保険                     |
| TRIMBLE INC                    | 281     | 281   | 2,129   | 334,895    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TRUIST FINANCIAL CORP          | 1,534   | 1,544 | 6,894   | 1,084,400  | 銀行                     |
| TWILIO INC - A                 | 168     | 180   | 2,162   | 340,189    | ソフトウェア・サービス            |
| TYLER TECHNOLOGIES INC         | 49      | 50    | 2,367   | 372,458    | ソフトウェア・サービス            |
| TYSON FOODS INC-CL A           | 330     | 337   | 1,791   | 281,826    | 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         |                        |
| UBER TECHNOLOGIES INC          | 2,189   | 2,341 | 20,966 | 3,297,847  | 運輸                     |
| U-HAUL HOLDING CO              | 111     | 114   | 518    | 81,595     | 運輸                     |
| ULTA BEAUTY INC                | 53      | 52    | 2,635  | 414,502    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| UNION PACIFIC CORP             | 700     | 704   | 15,578 | 2,450,419  | 運輸                     |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC. | 94      | 96    | 879    | 138,366    | 運輸                     |
| UNITED PARCEL SERVICE INC      | 845     | 865   | 7,998  | 1,258,062  | 運輸                     |
| UNITED RENTALS INC             | 75      | 76    | 6,069  | 954,684    | 資本財                    |
| UNITED THERAPEUTICS CORP       | 48      | 50    | 2,406  | 378,447    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UNITEDHEALTH GROUP INC         | 1,063   | 1,069 | 33,057 | 5,199,611  | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC  | 67      | 67    | 1,534  | 241,360    | ヘルスケア機器・サービス           |
| US BANCORP                     | 1,802   | 1,837 | 8,599  | 1,352,563  | 銀行                     |
| VALERO ENERGY CORP             | 365     | 369   | 6,654  | 1,046,635  | エネルギー                  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A      | 178     | 183   | 4,996  | 785,890    | ヘルスケア機器・サービス           |
| VERALTO CORP                   | 285     | 292   | 2,870  | 451,434    | 商業・専門サービス              |
| VERISIGN INC                   | 99      | 99    | 2,449  | 385,318    | ソフトウェア・サービス            |
| VERISK ANALYTICS INC           | 163     | 164   | 3,706  | 583,071    | 商業・専門サービス              |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC     | 4,871   | 4,977 | 20,503 | 3,225,017  | 電気通信サービス               |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC     | 297     | 302   | 12,747 | 2,004,992  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VERTIV HOLDINGS CO             | 411     | 426   | 7,282  | 1,145,408  | 資本財                    |
| VIATRIS INC                    | 1,379   | -     | -      | -          | 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        | 1,998   | 2,017 | 65,379 | 10,283,548 | 金融サービス                 |
| VISTRA CORP                    | 393     | 399   | 7,164  | 1,126,879  | 公益事業                   |
| VULCAN MATERIALS CO            | 152     | 155   | 4,425  | 696,125    | 素材                     |
| WABTEC CORP                    | 198     | 201   | 3,989  | 627,535    | 資本財                    |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC   | 850     | -     | -      | -          | 生活必需品流通・小売り            |
| WALMART INC                    | 5,104   | 5,174 | 52,058 | 8,188,254  | 生活必需品流通・小売り            |
| WALT DISNEY CO                 | 2,092   | 2,119 | 22,184 | 3,489,349  | メディア・娯楽                |
| WARNER BROS DISCOVERY INC      | 2,693   | 2,771 | 6,400  | 1,006,720  | メディア・娯楽                |
| WASTE CONNECTIONS INC          | 298     | 304   | 5,321  | 836,956    | 商業・専門サービス              |
| WASTE MANAGEMENT INC           | 463     | 474   | 10,231 | 1,609,355  | 商業・専門サービス              |
| WATERS CORP                    | 68      | 70    | 2,640  | 415,268    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WATSCO INC                     | 40      | 41    | 1,381  | 217,371    | 資本財                    |
| WEC ENERGY GROUP INC           | 365     | 376   | 4,146  | 652,138    | 公益事業                   |
| WELLS FARGO & CO               | 3,799   | 3,796 | 31,949 | 5,025,388  | 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>(アメリカ)</b>                | 百株               | 百株             | 千米ドル           | 千円             |                          |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 83               | 84             | 2,185          | 343,748        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス   |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 399              | 411            | 6,328          | 995,454        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器       |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP       | 44               | -              | -              | -              | 素材                       |
| WEYERHAEUSER CO              | 839              | 855            | 1,826          | 287,215        | エクイティ不動産投資信託 (REIT)      |
| WILLIAMS COS INC             | 1,407            | 1,439          | 8,475          | 1,333,186      | エネルギー                    |
| WILLIAMS-SONOMA INC          | 142              | 144            | 2,531          | 398,146        | 一般消費財・サービス流通・小売り         |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 116              | 116            | 3,708          | 583,354        | 保険                       |
| WIX.COM LTD                  | 61               | 65             | 667            | 104,952        | ソフトウェア・サービス              |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 247              | 254            | 5,701          | 896,787        | ソフトウェア・サービス              |
| WR BERKLEY CORP              | 352              | 357            | 2,743          | 431,514        | 保険                       |
| WW GRAINGER INC              | 50               | 53             | 4,963          | 780,688        | 資本財                      |
| WYNN RESORTS LTD             | 107              | -              | -              | -              | 消費者サービス                  |
| XCEL ENERGY INC              | 663              | 680            | 5,417          | 852,165        | 公益事業                     |
| XYLEM INC                    | 280              | 286            | 3,988          | 627,342        | 資本財                      |
| YUM! BRANDS INC              | 322              | 327            | 4,862          | 764,826        | 消費者サービス                  |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 59               | 59             | 1,384          | 217,719        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器       |
| ZILLOW GROUP INC - C W/I     | 184              | 194            | 1,326          | 208,715        | 不動産管理・開発                 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 229              | 233            | 2,086          | 328,187        | ヘルスケア機器・サービス             |
| ZOETIS INC                   | 521              | 524            | 6,146          | 966,759        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス   |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 288              | 291            | 2,354          | 370,271        | ソフトウェア・サービス              |
| ZSCALER INC                  | 115              | 119            | 3,482          | 547,756        | ソフトウェア・サービス              |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 424,481<br>557 | 433,918<br>526 | 6,734,683<br>- | 1,059,298,313<br><73.4%> |
| <b>(カナダ)</b>                 |                  |                | 千カナダ・ドル        |                |                          |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 579              | 593            | 14,003         | 1,567,803      | 素材                       |
| AIR CANADA                   | 194              | -              | -              | -              | 運輸                       |
| ALAMOS GOLD INC-CLASS A      | -                | 496            | 2,362          | 264,479        | 素材                       |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 877              | 895            | 6,195          | 693,700        | 生活必需品流通・小売り              |
| ALTAGAS LTD                  | 348              | 355            | 1,569          | 175,708        | 公益事業                     |
| ARC RESOURCES LTD            | 686              | 691            | 1,744          | 195,280        | エネルギー                    |
| ATKINSREALIS GROUP INC       | -                | 195            | 1,740          | 194,894        | 資本財                      |
| BANK OF MONTREAL             | 844              | 848            | 14,527         | 1,626,538      | 銀行                       |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 1,441            | 1,472          | 13,849         | 1,550,567      | 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>(カナダ)</b>                         | 百株      | 百株    | 千カナダ・ドル | 千円        |                    |
| BARRICK MINING CORPORATION           | 1,996   | 2,012 | 10,681  | 1,195,853 | 素材                 |
| BCE INC                              | 103     | 99    | 319     | 35,729    | 電気通信サービス           |
| BOMBARDIER INC-B                     | -       | 103   | 2,206   | 247,018   | 資本財                |
| BROOKFIELD ASSET MGMT-A              | 411     | 484   | 3,446   | 385,888   | 金融サービス             |
| BROOKFIELD CORPORATION-A             | 1,582   | 2,419 | 14,871  | 1,664,982 | 金融サービス             |
| BROOKFIELD RENEWABLE CORP            | 160     | 163   | 967     | 108,356   | 公益事業               |
| CAE INC                              | 369     | 360   | 1,316   | 147,380   | 資本財                |
| CAMECO CORP                          | 503     | 513   | 6,226   | 697,070   | エネルギー              |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE   | 1,091   | 1,102 | 13,027  | 1,458,531 | 銀行                 |
| CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO         | 618     | 630   | 8,290   | 928,224   | 運輸                 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD       | 2,441   | 2,470 | 11,808  | 1,322,061 | エネルギー              |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED | 1,079   | 1,087 | 10,592  | 1,185,908 | 運輸                 |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A             | 61      | 60    | 1,008   | 112,889   | 一般消費財・サービス流通・小売り   |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A             | 160     | 164   | 693     | 77,627    | 公益事業               |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B            | 173     | 174   | 1,479   | 165,672   | 素材                 |
| CELESTICA INC                        | 134     | 135   | 5,963   | 667,709   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CENOVUS ENERGY INC                   | 1,588   | 1,604 | 4,120   | 461,369   | エネルギー              |
| CGI INC                              | 235     | 236   | 2,873   | 321,690   | ソフトウェア・サービス        |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC           | 23      | 23    | 7,607   | 851,695   | ソフトウェア・サービス        |
| DESCARTES SYSTEMS GRP/THE            | 99      | 101   | 1,137   | 127,387   | ソフトウェア・サービス        |
| DOLLARAMA INC                        | 322     | 327   | 6,387   | 715,137   | 一般消費財・サービス流通・小売り   |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP        | 471     | 477   | 1,717   | 192,288   | 商業・専門サービス          |
| EMERA INC                            | 345     | 355   | 2,414   | 270,334   | 公益事業               |
| EMPIRE CO LTD 'A'                    | 153     | 151   | 789     | 88,348    | 生活必需品流通・小売り        |
| ENBRIDGE INC                         | 2,520   | 2,574 | 17,608  | 1,971,433 | エネルギー              |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD          | 23      | 23    | 5,494   | 615,142   | 保険                 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD           | 820     | 836   | 2,425   | 271,566   | 素材                 |
| FIRSTSERVICE CORP                    | 47      | 48    | 1,041   | 116,621   | 不動産管理・開発           |
| FORTIS INC                           | 578     | 595   | 4,317   | 483,346   | 公益事業               |
| FRANCO-NEVADA CORP                   | 222     | 227   | 6,284   | 703,637   | 素材                 |
| GEORGE WESTON LTD                    | 68      | 206   | 1,949   | 218,293   | 生活必需品流通・小売り        |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT         | 265     | 291   | 1,910   | 213,843   | 商業・専門サービス          |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                | 159     | 168   | 1,324   | 148,263   | 耐久消費財・アパレル         |
| GREAT-WEST LIFECO INC                | 326     | 331   | 2,088   | 233,850   | 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>(カナダ)</b>              | 百株      | 百株    | 千カナダ・ドル | 千円        |             |
| HYDRO ONE LTD             | 385     | 392   | 2,104   | 235,615   | 公益事業        |
| IA FINANCIAL CORP INC     | 108     | 110   | 1,808   | 202,529   | 保険          |
| IGM FINANCIAL INC         | 99      | 101   | 566     | 63,475    | 金融サービス      |
| IMPERIAL OIL LTD          | 206     | 210   | 2,930   | 328,053   | エネルギー       |
| INTACT FINANCIAL CORP     | 206     | 210   | 5,953   | 666,576   | 保険          |
| IVANHOE MINES LTD-CL A    | 861     | 880   | 1,112   | 124,593   | 素材          |
| KEYERA CORP               | 268     | 273   | 1,191   | 133,387   | エネルギー       |
| KINROSS GOLD CORP         | 1,419   | 1,445 | 5,198   | 581,973   | 素材          |
| LOBLAW COS LTD            | 175     | 705   | 4,328   | 484,610   | 生活必需品流通・小売り |
| LUNDIN GOLD INC           | -       | 128   | 1,458   | 163,282   | 素材          |
| LUNDIN MINING CORP        | 857     | 810   | 2,097   | 234,783   | 素材          |
| MAGNA INTERNATIONAL INC   | 312     | 317   | 2,124   | 237,813   | 自動車・自動車部品   |
| MANULIFE FINANCIAL CORP   | 2,000   | 2,017 | 9,615   | 1,076,519 | 保険          |
| METRO INC                 | 244     | 245   | 2,428   | 271,856   | 生活必需品流通・小売り |
| NATIONAL BANK OF CANADA   | 455     | 463   | 7,509   | 840,752   | 銀行          |
| NUTRIEN LTD               | 568     | 576   | 4,534   | 507,733   | 素材          |
| ONEX CORPORATION          | 70      | -     | -       | -         | 金融サービス      |
| OPEN TEXT CORP            | 306     | 304   | 1,422   | 159,213   | ソフトウェア・サービス |
| PAN AMERICAN SILVER CORP  | 418     | 427   | 2,349   | 262,995   | 素材          |
| PEMBINA PIPELINE CORP     | 675     | 688   | 3,755   | 420,488   | エネルギー       |
| POWER CORP OF CANADA      | 651     | 660   | 4,503   | 504,160   | 保険          |
| QUEBECOR INC -CL B        | 189     | -     | -       | -         | 電気通信サービス    |
| RB GLOBAL INC             | 213     | 218   | 3,006   | 336,614   | 商業・専門サービス   |
| RESTAURANT BRANDS INTERN  | 356     | 368   | 3,515   | 393,619   | 消費者サービス     |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC | 425     | 436   | 2,351   | 263,262   | 電気通信サービス    |
| ROYAL BANK OF CANADA      | 1,635   | 1,663 | 34,682  | 3,883,030 | 銀行          |
| SAPUTO INC                | 298     | 296   | 1,145   | 128,269   | 食品・飲料・タバコ   |
| SHOPIFY INC - CLASS A     | 1,401   | 1,438 | 29,543  | 3,307,736 | ソフトウェア・サービス |
| STANTEC INC               | 132     | 135   | 1,823   | 204,213   | 資本財         |
| SUN LIFE FINANCIAL INC    | 668     | 667   | 5,506   | 616,548   | 保険          |
| SUNCOR ENERGY INC         | 1,455   | 1,450 | 9,172   | 1,026,912 | エネルギー       |
| TC ENERGY CORP            | 1,201   | 1,227 | 9,430   | 1,055,838 | エネルギー       |
| TECK RESOURCES LTD-CL B   | 548     | 550   | 3,101   | 347,198   | 素材          |
| TFI INTERNATIONAL INC     | 93      | 93    | 1,077   | 120,646   | 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           | 182              | 186          | 3,519        | 394,053      | 商業・専門サービス              |
| TMX GROUP LTD                  | 323              | 330          | 1,706        | 191,090      | 金融サービス                 |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD        | 95               | 96           | 1,547        | 173,312      | 資本財                    |
| TORONTO-DOMINION BANK          | 2,024            | 2,030        | 23,280       | 2,606,475    | 銀行                     |
| TOURMALINE OIL CORP            | 411              | 435          | 2,694        | 301,725      | エネルギー                  |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD      | 63               | -            | -            | -            | 素材                     |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP   | 524              | 535          | 7,833        | 877,064      | 素材                     |
| WHITECAP RESOURCES INC         | -                | 1,465        | 1,718        | 192,353      | エネルギー                  |
| WSP GLOBAL INC                 | 151              | 154          | 3,804        | 425,969      | 資本財                    |
| 小計                             | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 46,824<br>81 | 50,869<br>82 | 437,839<br>- | 49,020,476<br><3.4%>   |
| <b>(オーストラリア)</b>               |                  |              | 千オーストラリア・ドル  |              |                        |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD         | 3,443            | 3,518        | 12,356       | 1,259,870    | 銀行                     |
| APA GROUP                      | 1,503            | 1,546        | 1,445        | 147,397      | 公益事業                   |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD         | 652              | 661          | 3,765        | 383,932      | 消費者サービス                |
| ASX LTD                        | 224              | 229          | 1,333        | 136,009      | 金融サービス                 |
| BHP GROUP LIMITED              | 5,861            | 5,984        | 24,505       | 2,498,593    | 素材                     |
| BLUESCOPE STEEL LTD            | 506              | 516          | 1,168        | 119,099      | 素材                     |
| BRAMBLES LTD                   | 1,597            | 1,611        | 3,743        | 381,641      | 商業・専門サービス              |
| CARSALES.COM LTD               | 436              | 445          | 1,473        | 150,228      | メディア・娯楽                |
| COCHLEAR LTD                   | 75               | 77           | 2,078        | 211,900      | ヘルスケア機器・サービス           |
| COLES GROUP LTD                | 1,548            | 1,581        | 3,534        | 360,332      | 生活必需品流通・小売り            |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 1,933            | 1,972        | 29,849       | 3,043,441    | 銀行                     |
| COMPUTERSHARE LIMITED          | 609              | 613          | 2,112        | 215,399      | 商業・専門サービス              |
| CSL LIMITED                    | 559              | 570          | 10,232       | 1,043,312    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EVOLUTION MINING LTD           | -                | 2,354        | 2,599        | 265,072      | 素材                     |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD     | 1,957            | 1,997        | 4,067        | 414,674      | 素材                     |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD  | 2,731            | 2,787        | 2,154        | 219,678      | 保険                     |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI    | 496              | 681          | 1,834        | 187,095      | 素材                     |
| LOTTERY CORP LTD/THE           | 2,571            | 2,624        | 1,403        | 143,143      | 消費者サービス                |
| MACQUARIE GROUP LTD            | 418              | 426          | 8,106        | 826,514      | 金融サービス                 |
| MEDIBANK PRIVATE LTD           | 3,187            | 3,247        | 1,562        | 159,263      | 保険                     |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD    | 3,553            | 3,611        | 14,561       | 1,484,656    | 銀行                     |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD    | 1,319            | 1,598        | 4,090        | 417,091      | 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           |                      |  |
| ORIGIN ENERGY LIMITED              | 1,990            | 2,031        | 2,392        | 243,941      | 公益事業                 |  |
| PRO MEDICUS LTD                    | 66               | 67           | 1,694        | 172,746      | ヘルスケア機器・サービス         |  |
| QANTAS AIRWAYS LTD                 | 852              | 872          | 836          | 85,259       | 運輸                   |  |
| QBE INSURANCE GROUP LTD            | 1,738            | 1,779        | 3,512        | 358,164      | 保険                   |  |
| REA GROUP LTD                      | 61               | 62           | 1,229        | 125,384      | メディア・娯楽              |  |
| REECE LTD                          | 261              | -            | -            | -            | 資本財                  |  |
| RIO TINTO LTD                      | 428              | 437          | 5,656        | 576,693      | 素材                   |  |
| SANTOS LTD                         | 3,751            | 3,825        | 2,555        | 260,552      | エネルギー                |  |
| SGH LTD                            | 234              | 239          | 1,035        | 105,589      | 資本財                  |  |
| SIGMA HEALTHCARE LTD               | -                | 5,440        | 1,588        | 161,983      | ヘルスケア機器・サービス         |  |
| SONIC HEALTHCARE LTD               | 527              | 554          | 1,191        | 121,491      | ヘルスケア機器・サービス         |  |
| SOUTH32 LTD                        | 5,213            | 5,308        | 1,656        | 168,868      | 素材                   |  |
| SUNCORP GROUP LTD                  | 1,250            | 1,275        | 2,403        | 245,035      | 保険                   |  |
| TELSTRA GROUP LTD                  | 4,746            | 4,763        | 2,329        | 237,505      | 電気通信サービス             |  |
| TRANSURBAN GROUP                   | 3,592            | 3,669        | 5,526        | 563,510      | 運輸                   |  |
| TREASURY WINE ESTATES LTD          | 938              | -            | -            | -            | 食品・飲料・タバコ            |  |
| WASHINGTON H SOUL PATTINSON        | -                | 282          | 1,010        | 103,029      | 金融サービス               |  |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON       | 276              | -            | -            | -            | 金融サービス               |  |
| WESFARMERS LIMITED                 | 1,310            | 1,337        | 10,696       | 1,090,619    | 一般消費財・サービス流通・小売り     |  |
| WESTPAC BANKING CORP               | 3,966            | 4,034        | 15,065       | 1,536,085    | 銀行                   |  |
| WISETECH GLOBAL LTD                | 212              | 236          | 1,487        | 151,702      | ソフトウェア・サービス          |  |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD          | 2,195            | 2,238        | 5,881        | 599,665      | エネルギー                |  |
| WOOLWORTHS GROUP LTD               | 1,412            | 1,440        | 4,014        | 409,313      | 生活必需品流通・小売り          |  |
| XERO LTD                           | 167              | 193          | 2,300        | 234,584      | ソフトウェア・サービス          |  |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 70,384<br>43 | 78,752<br>43 | 212,044<br>- | 21,620,075<br><1.5%> |  |
| <b>(香港)</b>                        |                  |              | 千香港ドル        |              |                      |  |
| AIA GROUP LTD                      | 12,466           | 12,528       | 97,661       | 1,971,787    | 保険                   |  |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD         | 4,270            | 4,360        | 16,639       | 335,946      | 銀行                   |  |
| CK ASSET HOLDINGS LTD              | 2,219            | 2,269        | 8,917        | 180,044      | 不動産管理・開発             |  |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD          | 3,099            | 3,159        | 16,837       | 339,958      | 資本財                  |  |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED | 725              | 740          | 4,033        | 81,426       | 公益事業                 |  |
| CLP HOLDINGS LTD                   | 1,891            | 1,931        | 13,268       | 267,899      | 公益事業                 |  |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD     | 2,528            | 2,578        | 10,276       | 207,478      | 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>(香港)</b>                            | 百株               | 百株           | 千香港ドル        | 千円           |                     |
| HANG SENG BANK LTD                     | 869              | 887          | 13,430       | 271,171      | 銀行                  |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT             | 1,686            | 1,716        | 5,073        | 102,438      | 不動産管理・開発            |
| HKT TRUST AND HKT LTD                  | 4,540            | 4,610        | 5,439        | 109,829      | 電気通信サービス            |
| HONG KONG & CHINA GAS                  | 12,934           | 13,194       | 9,565        | 193,135      | 公益事業                |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR            | 1,392            | 1,419        | 59,091       | 1,193,062    | 金融サービス              |
| MTR CORP                               | 1,797            | 1,832        | 5,504        | 111,145      | 運輸                  |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD              | 1,600            | 1,630        | 8,382        | 169,246      | 公益事業                |
| SANDS CHINA LTD                        | 2,793            | 2,857        | 5,789        | 116,898      | 消費者サービス             |
| SINO LAND CO                           | 4,700            | 4,340        | 4,509        | 91,041       | 不動産管理・開発            |
| SITC INTERNATIONAL HOLDINGS            | 1,550            | 1,590        | 4,496        | 90,784       | 運輸                  |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD            | 1,670            | 1,705        | 16,941       | 342,048      | 不動産管理・開発            |
| SWIRE PACIFIC LTD                      | 463              | 413          | 2,800        | 56,541       | 資本財                 |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO               | 1,585            | 1,725        | 14,490       | 292,553      | 資本財                 |
| WH GROUP LTD                           | 9,605            | 9,810        | 8,573        | 173,107      | 食品・飲料・タバコ           |
| WHARF HOLDINGS LTD                     | 1,240            | 1,260        | 3,001        | 60,596       | 不動産管理・開発            |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT           | 1,927            | 1,967        | 4,717        | 95,249       | 不動産管理・開発            |
| 小計                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 77,555<br>23 | 78,526<br>23 | 339,444<br>- | 6,853,392<br><0.5%> |
| <b>(シンガポール)</b>                        |                  |              | 千シンガポールドル    |              |                     |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI           | 2,718            | 2,766        | 730          | 87,889       | 不動産管理・開発            |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD                 | 2,302            | 2,509        | 13,474       | 1,621,779    | 銀行                  |
| GENTING SINGAPORE LTD                  | 7,005            | 7,150        | 536          | 64,543       | 消費者サービス             |
| KEPPEL CORP LTD                        | 1,681            | 1,717        | 1,727        | 207,898      | 資本財                 |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP           | 3,910            | 3,991        | 7,247        | 872,327      | 銀行                  |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD                | 1,027            | 1,051        | 661          | 79,567       | 公益事業                |
| SINGAPORE AIRLINES LTD                 | 1,721            | 1,786        | 1,153        | 138,866      | 運輸                  |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD                 | 990              | 1,009        | 1,695        | 204,024      | 金融サービス              |
| SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD | 1,803            | 1,840        | 1,593        | 191,786      | 資本財                 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS           | 8,670            | 8,826        | 4,289        | 516,276      | 電気通信サービス            |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD               | 1,460            | 1,486        | 5,028        | 605,245      | 銀行                  |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD               | 2,219            | 2,274        | 754          | 90,867       | 食品・飲料・タバコ           |
| YANGZIJANG SHIPBUILDING                | 2,981            | 3,042        | 1,019        | 122,655      | 資本財                 |
| 小計                                     | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 38,487<br>13 | 39,447<br>13 | 39,911<br>-  | 4,803,727<br><0.3%> |

## 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>(ニュージーランド)</b>            |         | 百株      | 百株     | 千円       | 千円        |                        |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    |         | 1,941   | 1,989  | 1,547    | 136,518   | 運輸                     |
| CONTACT ENERGY LTD           |         | 921     | 988    | 919      | 81,119    | 公益事業                   |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C |         | 677     | 690    | 2,539    | 224,035   | ヘルスケア機器・サービス           |
| INFRATIL LTD                 |         | 1,064   | 1,098  | 1,268    | 111,918   | 金融サービス                 |
| MERIDIAN ENERGY LTD          |         | 1,506   | 1,544  | 895      | 79,004    | 公益事業                   |
| 小計                           | 株数・金額   | 6,111   | 6,310  | 7,170    | 632,596   |                        |
|                              | 銘柄数<比率> | 5       | 5      | -        | <0.0%>    |                        |
| <b>(イギリス)</b>                |         |         |        | 千イギリスポンド |           |                        |
| 3I GROUP PLC                 |         | 1,123   | 1,146  | 3,807    | 781,631   | 金融サービス                 |
| ADMIRAL GROUP PLC            |         | 301     | 307    | 971      | 199,441   | 保険                     |
| ANGLO AMERICAN PLC           |         | 1,467   | 1,306  | 3,600    | 739,264   | 素材                     |
| ANTOFAGASTA PLC              |         | 454     | 463    | 1,225    | 251,630   | 素材                     |
| ASHTREAD GROUP PLC           |         | 503     | 502    | 2,325    | 477,477   | 資本財                    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC |         | 378     | 380    | 798      | 164,009   | 食品・飲料・タバコ              |
| ASTRAZENECA PLC              |         | 1,791   | 1,828  | 24,854   | 5,102,892 | 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     |         | 1,026   | 1,027  | 678      | 139,397   | メディア・娯楽                |
| AVIVA PLC                    |         | 3,094   | 3,604  | 2,277    | 467,688   | 保険                     |
| BAE SYSTEMS PLC              |         | 3,477   | 3,551  | 6,124    | 1,257,465 | 資本財                    |
| BARCLAYS PLC                 |         | 16,648  | 16,659 | 6,657    | 1,366,798 | 銀行                     |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     |         | 1,594   | 1,616  | 598      | 122,964   | 耐久消費財・アパレル             |
| BP PLC                       |         | 18,627  | 18,696 | 8,518    | 1,748,900 | エネルギー                  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC |         | 2,296   | 2,457  | 10,255   | 2,105,612 | 食品・飲料・タバコ              |
| BT GROUP PLC                 |         | 7,549   | 7,098  | 1,239    | 254,456   | 電気通信サービス               |
| BUNZL PLC                    |         | 381     | 386    | 808      | 166,065   | 資本財                    |
| CENTRICA PLC                 |         | 5,854   | 5,711  | 945      | 194,073   | 公益事業                   |
| COCA-COLA HBC AG-CDI         |         | 250     | 256    | 913      | 187,579   | 食品・飲料・タバコ              |
| COMPASS GROUP PLC            |         | 1,960   | 2,000  | 4,888    | 1,003,611 | 消費者サービス                |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      |         | 153     | -      | -        | -         | 素材                     |
| DCC PLC                      |         | 114     | 115    | 572      | 117,637   | 資本財                    |
| DIAGEO PLC                   |         | 2,570   | 2,624  | 4,466    | 916,927   | 食品・飲料・タバコ              |
| ENTAIN PLC                   |         | 702     | 716    | 510      | 104,766   | 消費者サービス                |
| EXPERIAN PLC                 |         | 1,061   | 1,082  | 3,538    | 726,582   | 商業・専門サービス              |
| FRESNILLO PLC                |         | -       | 258    | 623      | 128,107   | 素材                     |
| GLENCORE PLC                 |         | 11,975  | 11,949 | 4,216    | 865,759   | 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    |                        |
| (イギリス)                            | 百株      | 百株     | 千イギリス・ポンド | 千円        |                        |
| GSK PLC                           | 4,789   | 4,814  | 8,534     | 1,752,116 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HALEON PLC                        | 9,935   | 10,590 | 3,869     | 794,481   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HALMA PLC                         | 438     | 447    | 1,480     | 304,035   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC         | 191     | 196    | 309       | 63,469    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HSBC HOLDINGS PLC                 | 20,649  | 20,562 | 21,541    | 4,422,643 | 銀行                     |
| IMPERIAL BRANDS PLC               | 915     | 909    | 2,947     | 605,129   | 食品・飲料・タバコ              |
| INFORMA PLC                       | 1,535   | 1,536  | 1,399     | 287,379   | メディア・娯楽                |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 182     | 172    | 1,644     | 337,672   | 消費者サービス                |
| INTERTEK GROUP PLC                | 186     | 185    | 895       | 183,791   | 商業・専門サービス              |
| JD SPORTS FASHION PLC             | 2,994   | 2,987  | 240       | 49,321    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| KINGFISHER PLC                    | 2,096   | 2,070  | 598       | 122,958   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC         | 6,827   | 6,787  | 1,588     | 326,085   | 保険                     |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC          | 70,030  | 70,606 | 6,185     | 1,269,877 | 銀行                     |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP       | 552     | 560    | 4,700     | 964,990   | 金融サービス                 |
| M&G PLC                           | 2,648   | 2,706  | 707       | 145,215   | 金融サービス                 |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC         | 2,366   | 2,420  | 817       | 167,941   | 生活必需品流通・小売り            |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            | 1,484   | 1,498  | 895       | 183,878   | 資本財                    |
| MONDI PLC/WI                      | 510     | 521    | 435       | 89,481    | 素材                     |
| NATIONAL GRID PLC                 | 5,652   | 5,777  | 6,679     | 1,371,336 | 公益事業                   |
| NATWEST GROUP PLC                 | 8,836   | 9,545  | 5,549     | 1,139,462 | 銀行                     |
| NEXT PLC                          | 135     | 137    | 1,901     | 390,309   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| NMC HEALTH PLC                    | 47      | 47     | 0.005     | 0.975     | ヘルスケア機器・サービス           |
| PEARSON PLC                       | 691     | 690    | 688       | 141,268   | 消費者サービス                |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC        | 820     | 836    | 546       | 112,262   | 保険                     |
| PRUDENTIAL PLC                    | 3,060   | 3,042  | 3,150     | 646,894   | 保険                     |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 792     | 800    | 4,627     | 949,997   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| RELX PLC                          | 2,147   | 2,162  | 6,523     | 1,339,281 | 商業・専門サービス              |
| RENTOKIL INITIAL PLC              | 2,917   | 2,979  | 1,186     | 243,536   | 商業・専門サービス              |
| RIO TINTO PLC                     | 1,302   | 1,330  | 7,060     | 1,449,599 | 素材                     |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC          | 9,823   | 9,958  | 10,621    | 2,180,614 | 資本財                    |
| SAGE GROUP PLC                    | 1,157   | 1,140  | 1,242     | 255,089   | ソフトウェア・サービス            |
| SAINSBURY (J) PLC                 | 2,029   | 2,033  | 648       | 133,106   | 生活必需品流通・小売り            |
| SCHRODERS PLC                     | 931     | 857    | 326       | 67,002    | 金融サービス                 |
| SEVERN TRENT PLC                  | 312     | 319    | 857       | 176,082   | 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>(イギリス)</b>  |                              |         |         | 千イギリス・ポンド  | 千円         |                  |
|                |                              | 百株      | 百株      |            |            |                  |
|                | SHELL PLC-NEW                | 7,041   | 6,945   | 19,405     | 3,984,132  | エネルギー            |
|                | SMITH & NEPHEW PLC           | 960     | 980     | 1,213      | 249,238    | ヘルスケア機器・サービス     |
|                | SMITHS GROUP PLC             | 395     | 389     | 941        | 193,274    | 資本財              |
|                | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 85      | 86      | 594        | 121,988    | 資本財              |
|                | SSE PLC                      | 1,273   | 1,302   | 2,857      | 586,637    | 公益事業             |
|                | STANDARD CHARTERED PLC       | 2,374   | 2,328   | 3,631      | 745,639    | 銀行               |
|                | TESCO PLC                    | 7,782   | 7,735   | 3,399      | 697,983    | 生活必需品流通・小売り      |
|                | UNILEVER PLC                 | 2,862   | 2,890   | 12,943     | 2,657,435  | 家庭用品・パーソナル用品     |
|                | UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 787     | 803     | 932        | 191,354    | 公益事業             |
|                | VALTERRA PLATINUM LIMITED    | -       | 151     | 720        | 147,970    | 素材               |
|                | VODAFONE GROUP PLC           | 23,873  | 23,157  | 2,123      | 435,988    | 電気通信サービス         |
|                | WHITBREAD PLC                | 204     | 206     | 565        | 116,138    | 消費者サービス          |
|                | WISE PLC - A                 | 769     | 785     | 703        | 144,495    | 金融サービス           |
|                | WPP PLC                      | 1,247   | 1,276   | 400        | 82,181     | メディア・娯楽          |
| 小計             | 株数・金額                        | 304,013 | 306,030 | 256,254    | 52,611,517 |                  |
|                | 銘柄数<比率>                      | 72      | 73      | -          | <3.6%>     |                  |
| <b>(イスラエル)</b> |                              |         |         | 千イスラエル・シケル |            |                  |
|                | AZRIELI GROUP                | 49      | 50      | 1,721      | 82,840     | 不動産管理・開発         |
|                | BANK HAPOALIM BM             | 1,453   | 1,473   | 10,298     | 495,699    | 銀行               |
|                | BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 1,735   | 1,760   | 12,291     | 591,593    | 銀行               |
|                | ELBIT SYSTEMS LTD            | 30      | 32      | 5,167      | 248,731    | 資本財              |
|                | ICL GROUP LTD                | 894     | 915     | 1,636      | 78,747     | 素材               |
|                | ISRAEL DISCOUNT BANK-A       | 1,424   | 1,445   | 4,962      | 238,836    | 銀行               |
|                | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 179     | 184     | 4,268      | 205,443    | 銀行               |
|                | NICE LTD                     | 72      | 74      | 2,538      | 122,195    | ソフトウェア・サービス      |
|                | NOVA LTD                     | 33      | 34      | 3,266      | 157,200    | 半導体・半導体製造装置      |
|                | PHOENIX FINANCIAL LTD        | -       | 266     | 3,650      | 175,708    | 保険               |
| 小計             | 株数・金額                        | 5,874   | 6,237   | 49,800     | 2,396,996  |                  |
|                | 銘柄数<比率>                      | 9       | 10      | -          | <0.2%>     |                  |
| <b>(スイス)</b>   |                              |         |         | 千スイス・フラン   |            |                  |
|                | ABB LTD                      | 1,826   | 1,847   | 10,058     | 1,963,512  | 資本財              |
|                | ALCON INC                    | 577     | 588     | 3,562      | 695,337    | ヘルスケア機器・サービス     |
|                | AMRIZE LTD                   | -       | 601     | 2,275      | 444,097    | 素材               |
|                | AVOLTA AG                    | 101     | 103     | 437        | 85,494     | 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    |                        |
| (スイス)                             | 百株      | 百株    | 千スイス・フラン | 千円        |                        |
| BALOISE HOLDING AG                | 47      | 48    | 999      | 195,087   | 保険                     |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG      | 35      | 35    | 333      | 65,136    | 銀行                     |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG            | 4       | 4     | 510      | 99,683    | 食品・飲料・タバコ              |
| BELIMO HOLDING AG-REG             | -       | 11    | 874      | 170,695   | 資本財                    |
| BKW AG                            | 24      | 24    | 405      | 79,135    | 公益事業                   |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC        | 1       | 1     | 1,324    | 258,522   | 食品・飲料・タバコ              |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG       | 0.12    | 0.12  | 1,459    | 284,835   | 食品・飲料・タバコ              |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG       | 621     | 633   | 10,241   | 1,999,089 | 耐久消費財・アパレル             |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG         | 8       | 8     | 442      | 86,422    | 素材                     |
| GALDERMA GROUP AG                 | 96      | 154   | 2,273    | 443,857   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GEBERIT AG-REG                    | 38      | 39    | 2,438    | 476,049   | 資本財                    |
| GIVAUDAN-REG                      | 10      | 10    | 3,547    | 692,563   | 素材                     |
| HELVETIA HOLDING AG-REG           | 42      | 43    | 892      | 174,136   | 保険                     |
| HOLCIM LTD                        | 601     | 600   | 4,276    | 834,769   | 素材                     |
| JULIUS BAER GROUP LTD             | 238     | 242   | 1,395    | 272,362   | 金融サービス                 |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG        | 55      | 56    | 865      | 168,976   | 運輸                     |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG        | 175     | 179   | 1,551    | 302,860   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| LONZA GROUP AG                    | 83      | 82    | 4,383    | 855,659   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NESTLE SA                         | 3,027   | 3,037 | 24,126   | 4,709,451 | 食品・飲料・タバコ              |
| NOVARTIS AG                       | 2,277   | 2,241 | 22,909   | 4,471,943 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG         | 26      | 26    | 2,436    | 475,583   | 金融サービス                 |
| ROCHE HOLDING AG                  | 811     | 828   | 25,687   | 5,014,171 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ROCHE HOLDING AG-BR               | 36      | 37    | 1,222    | 238,702   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SANDOZ GROUP AG                   | 482     | 492   | 2,654    | 518,236   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG          | 27      | 27    | 736      | 143,803   | 資本財                    |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT       | 47      | 47    | 1,333    | 260,330   | 資本財                    |
| SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE | 175     | 195   | 1,738    | 339,290   | 商業・専門サービス              |
| SIG GROUP AG                      | 353     | 361   | 317      | 61,943    | 素材                     |
| SIKA AG-BEARER                    | 176     | 179   | 2,690    | 525,167   | 素材                     |
| SONOVA HOLDING AG-REG             | 58      | 59    | 1,161    | 226,813   | ヘルスケア機器・サービス           |
| STRAUMANN HOLDING AG              | 128     | 131   | 1,261    | 246,252   | ヘルスケア機器・サービス           |
| SWATCH GROUP AG                   | 33      | 34    | 572      | 111,719   | 耐久消費財・アパレル             |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG         | 33      | 33    | 2,868    | 559,862   | 保険                     |
| SWISS PRIME SITE-REG              | 89      | 94    | 1,091    | 213,092   | 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>(スイス)</b>              |         | 百株      | 百株     | 千スイス・フラン    | 千円         |                        |
| SWISS RE AG               |         | 348     | 352    | 4,859       | 948,553    | 保険                     |
| SWISSCOM AG               |         | 30      | 31     | 1,790       | 349,569    | 電気通信サービス               |
| TEMENOS GROUP AG-REG      |         | 65      | -      | -           | -          | ソフトウェア・サービス            |
| UBS GROUP AG              |         | 3,798   | 3,741  | 11,448      | 2,234,783  | 金融サービス                 |
| VAT GROUP AG              |         | 31      | 31     | 1,029       | 200,997    | 資本財                    |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG |         | 169     | 172    | 9,646       | 1,882,919  | 保険                     |
| 小計                        | 株数・金額   | 16,816  | 17,479 | 176,134     | 34,381,474 |                        |
|                           | 銘柄数<比率> | 42      | 43     | -           | <2.4%>     |                        |
| <b>(デンマーク)</b>            |         |         |        | 千デンマーク・クローネ |            |                        |
| A P MOLLER - MAERSK A/S   |         | 5       | 4      | 5,835       | 141,692    | 運輸                     |
| A P MOLLER - MAERSK A/S   |         | 3       | 3      | 4,356       | 105,767    | 運輸                     |
| CARLSBERG AS-B            |         | 110     | 110    | 8,471       | 205,692    | 食品・飲料・タバコ              |
| COLOPLAST-B               |         | 145     | 148    | 8,497       | 206,330    | ヘルスケア機器・サービス           |
| DANSKE BANK A/S           |         | 797     | 787    | 22,491      | 546,098    | 銀行                     |
| DEMANT A/S                |         | 101     | 100    | 2,128       | 51,684     | ヘルスケア機器・サービス           |
| DSV A/S                   |         | 236     | 240    | 33,578      | 815,290    | 運輸                     |
| GENMAB A/S                |         | 72      | 71     | 14,217      | 345,192    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NOVONESIS (NOVOZYMES) B   |         | 406     | 415    | 16,590      | 402,808    | 素材                     |
| NOVO-NORDISK A/S          |         | 3,721   | 3,796  | 117,953     | 2,863,910  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ORSTED A/S                |         | 194     | 198    | 2,491       | 60,484     | 公益事業                   |
| PANDORA A/S               |         | 94      | 93     | 7,013       | 170,293    | 耐久消費財・アパレル             |
| ROCKWOOL A/S-B SHS        |         | 108     | 113    | 2,319       | 56,312     | 資本財                    |
| TRYGVESTA AS              |         | 392     | 397    | 6,276       | 152,381    | 保険                     |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S   |         | 1,167   | 1,190  | 18,128      | 440,154    | 資本財                    |
| ZEALAND PHARMA A/S        |         | 73      | -      | -           | -          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 小計                        | 株数・金額   | 7,631   | 7,674  | 270,349     | 6,564,092  |                        |
|                           | 銘柄数<比率> | 16      | 15     | -           | <0.5%>     |                        |
| <b>(ノルウェー)</b>            |         |         |        | 千ノルウェー・クローネ |            |                        |
| AKER BP ASA               |         | 365     | 372    | 9,432       | 145,823    | エネルギー                  |
| DNB BANK ASA              |         | 1,032   | 1,044  | 27,300      | 422,071    | 銀行                     |
| EQUINOR ASA               |         | 966     | 903    | 21,312      | 329,486    | エネルギー                  |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA |         | 230     | 235    | 6,450       | 99,729     | 保険                     |
| KONGSBERG GRUPPEN ASA     |         | 101     | 518    | 12,248      | 189,366    | 資本財                    |
| MOWI ASA                  |         | 535     | 547    | 12,021      | 185,846    | 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    |                        |
| <b>(ノルウェー)</b>              |         | 百株      | 百株    | 千ノルウェークローネ   | 千円        |                        |
| NORSK HYDRO ASA             |         | 1,619   | 1,628 | 11,559       | 178,711   | 素材                     |
| ORKLA ASA                   |         | 804     | 821   | 8,625        | 133,357   | 食品・飲料・タバコ              |
| SALMAR ASA                  |         | 76      | 78    | 4,489        | 69,414    | 食品・飲料・タバコ              |
| TELENOR ASA                 |         | 733     | 740   | 10,478       | 161,993   | 電気通信サービス               |
| YARA INTERNATIONAL ASA      |         | 190     | 194   | 7,061        | 109,175   | 素材                     |
| 小計                          | 株数・金額   | 6,655   | 7,084 | 130,981      | 2,024,976 |                        |
|                             | 銘柄数<比率> | 11      | 11    | -            | <0.1%>    |                        |
| <b>(スウェーデン)</b>             |         |         |       | 千スウェーデン・クローナ |           |                        |
| ADDTECH AB-B SHARES         |         | 300     | 305   | 9,430        | 155,326   | 資本財                    |
| ALFA LAVAL AB               |         | 333     | 340   | 14,779       | 243,419   | 資本財                    |
| ASSA ABLOY AB               |         | 1,156   | 1,180 | 40,786       | 671,760   | 資本財                    |
| ATLAS COPCO AB              |         | 1,802   | 1,840 | 25,149       | 414,216   | 資本財                    |
| ATLAS COPCO AB-A SHS        |         | 3,103   | 3,165 | 47,881       | 788,611   | 資本財                    |
| BEIJER REF AB               |         | 444     | 453   | 6,652        | 109,568   | 資本財                    |
| BIOVITRUM                   |         | 225     | 230   | 7,698        | 126,787   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BOLIDEN AB                  |         | 315     | 333   | 14,005       | 230,667   | 素材                     |
| EPIROC AB-A                 |         | 761     | 776   | 14,698       | 242,088   | 資本財                    |
| EPIROC AB-B                 |         | 450     | 460   | 7,843        | 129,188   | 資本財                    |
| EQT AB                      |         | 430     | 436   | 13,929       | 229,412   | 金融サービス                 |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B         |         | 704     | 709   | 18,287       | 301,187   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EVOLUTION AB                |         | 183     | 168   | 10,619       | 174,895   | 消費者サービス                |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS |         | 828     | 843   | 5,754        | 94,779    | 不動産管理・開発               |
| HENNES & MAURITZ AB         |         | 655     | 665   | 11,633       | 191,602   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| HEXAGON AB-B SHS            |         | 2,398   | 2,447 | 26,836       | 441,993   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HOLMEN AB-B SHARES          |         | 87      | 89    | 3,121        | 51,403    | 素材                     |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS     |         | 138     | 143   | 5,603        | 92,281    | 金融サービス                 |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS     |         | 176     | 179   | 7,001        | 115,319   | 金融サービス                 |
| INDUTRADE AB                |         | 315     | 321   | 7,321        | 120,591   | 資本財                    |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS  |         | 170     | 173   | 3,952        | 65,102    | 資本財                    |
| INVESTOR AB                 |         | 1,995   | 2,038 | 62,906       | 1,036,071 | 金融サービス                 |
| LIFCO AB-B SHS              |         | 268     | 274   | 9,391        | 154,681   | 資本財                    |
| LUNDBERGS AB-B SHS          |         | 86      | 88    | 4,409        | 72,627    | 金融サービス                 |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS    |         | 1,753   | 1,787 | 5,730        | 94,378    | 資本財                    |
| SAAB AB-B                   |         | 370     | 377   | 18,571       | 305,875   | 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      | 千円                   |                    |
| SAGAX AB-B                      |                  | 253          | 258          | 5,240        | 86,315               | 不動産管理・開発           |
| SANDVIK AB                      |                  | 1,231        | 1,256        | 34,987       | 576,237              | 資本財                |
| SECURITAS AB                    |                  | 567          | 579          | 8,051        | 132,611              | 商業・専門サービス          |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A    |                  | 1,833        | 1,783        | 31,566       | 519,908              | 銀行                 |
| SKANSKA AB-B SHS                |                  | 392          | 400          | 9,683        | 159,494              | 資本財                |
| SKF AB                          |                  | 393          | 401          | 9,485        | 156,219              | 資本財                |
| SVENSKA CELLULOSA AB            |                  | 700          | 716          | 8,566        | 141,089              | 素材                 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN           |                  | 1,686        | 1,722        | 21,258       | 350,133              | 銀行                 |
| SWEDBANK AB - A SHARES          |                  | 981          | 1,001        | 28,524       | 469,796              | 銀行                 |
| TELE2 AB                        |                  | 654          | 659          | 9,559        | 157,439              | 電気通信サービス           |
| TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON |                  | 3,209        | 3,299        | 29,621       | 487,864              | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELIA CO AB                     |                  | 2,815        | 2,854        | 10,431       | 171,808              | 電気通信サービス           |
| TRELLEBORG AB-B SHS             |                  | 245          | 238          | 9,019        | 148,545              | 資本財                |
| VOLVO AB                        |                  | 1,835        | 1,873        | 50,175       | 826,382              | 資本財                |
| 小計                              | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 36,259<br>40 | 36,880<br>40 | 670,169<br>- | 11,037,685<br><0.8%> |                    |
| <b>(ユーロ/アイルランド)</b>             |                  |              |              | 千ユーロ         |                      |                    |
| AIB GROUP PLC                   |                  | 2,419        | 2,517        | 2,082        | 377,606              | 銀行                 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC       |                  | 1,159        | 1,136        | 1,700        | 308,453              | 銀行                 |
| KERRY GROUP PLC-A               |                  | 172          | 193          | 1,485        | 269,314              | 食品・飲料・タバコ          |
| KINGSPAN GROUP PLC              |                  | 178          | 182          | 1,197        | 217,146              | 資本財                |
| RYANAIR HOLDINGS PLC            |                  | -            | 1,000        | 2,649        | 480,419              | 運輸                 |
| 小計                              | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 3,930<br>4   | 5,030<br>5   | 9,115<br>-   | 1,652,940<br><0.1%>  |                    |
| <b>(ユーロ/オランダ)</b>               |                  |              |              |              |                      |                    |
| ABN AMRO BANK NV                |                  | 529          | 686          | 1,826        | 331,201              | 銀行                 |
| ADYEN NV                        |                  | 25           | 29           | 3,934        | 713,559              | 金融サービス             |
| AIRBUS SE                       |                  | 686          | 700          | 14,237       | 2,581,784            | 資本財                |
| AKZO NOBEL NV                   |                  | 197          | 201          | 1,083        | 196,570              | 素材                 |
| ASM INTERNATIONAL NV            |                  | 54           | 55           | 2,730        | 495,161              | 半導体・半導体製造装置        |
| ASML HOLDING NV                 |                  | 455          | 464          | 41,163       | 7,464,510            | 半導体・半導体製造装置        |
| ASR NEDERLAND NV                |                  | 183          | 174          | 995          | 180,439              | 保険                 |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES     |                  | 93           | 86           | 1,111        | 201,568              | 半導体・半導体製造装置        |

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           |                        |  |
| CVC CAPITAL PARTNERS PLC      | 245              | 250          | 346          | 62,881       | 金融サービス                 |  |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV      | 712              | 724          | 392          | 71,117       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| DSM-FIRMENICH AG              | 214              | 219          | 1,527        | 277,040      | 素材                     |  |
| EURONEXT NV                   | 90               | 92           | 1,163        | 210,938      | 金融サービス                 |  |
| EXOR NV                       | 113              | 109          | 777          | 140,936      | 金融サービス                 |  |
| FERRARI NV                    | 145              | 148          | 5,028        | 911,914      | 自動車・自動車部品              |  |
| HEINEKEN HOLDING NV           | 149              | 152          | 914          | 165,826      | 食品・飲料・タバコ              |  |
| HEINEKEN NV                   | 332              | 339          | 2,322        | 421,238      | 食品・飲料・タバコ              |  |
| IMCD NV                       | 68               | 69           | 532          | 96,586       | 資本財                    |  |
| ING GROEP NV-CVA              | 3,636            | 3,561        | 7,650        | 1,387,331    | 銀行                     |  |
| INPOST SA                     | 259              | 293          | 293          | 53,268       | 運輸                     |  |
| JDE PEET'S BV                 | 197              | 201          | 634          | 115,085      | 食品・飲料・タバコ              |  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 1,062            | 1,069        | 3,723        | 675,235      | 生活必需品流通・小売り            |  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV        | 922              | 907          | 2,125        | 385,519      | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| NN GROUP NV                   | 310              | 316          | 1,908        | 346,003      | 保険                     |  |
| PROSUS                        | 1,580            | 1,542        | 8,932        | 1,619,752    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| QIAGEN NV                     | 248              | 254          | 970          | 175,938      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| RANDSTAD NV                   | 125              | 128          | 429          | 77,819       | 商業・専門サービス              |  |
| ROYAL KPN NV                  | 4,561            | 4,655        | 1,786        | 324,016      | 電気通信サービス               |  |
| STMICROELECTRONICS NV         | 782              | 805          | 1,557        | 282,467      | 半導体・半導体製造装置            |  |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP BV      | 951              | 1,297        | 2,972        | 539,037      | メディア・娯楽                |  |
| WOLTERS KLUWER NV             | 275              | 281          | 2,568        | 465,704      | 商業・専門サービス              |  |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 19,213<br>30 | 19,821<br>30 | 115,641<br>- | 20,970,459<br><1.5%>   |  |
| <b>(ユーロ/ベルギー)</b>             |                  |              |              |              |                        |  |
| AGEAS                         | 173              | 175          | 1,014        | 183,934      | 保険                     |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV    | 1,037            | 1,165        | 6,163        | 1,117,619    | 食品・飲料・タバコ              |  |
| ARGENX SE                     | 69               | 72           | 5,753        | 1,043,292    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| D'IETEREN GROUP               | 24               | 25           | 369          | 66,935       | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| ELIA GROUP SA/NV              | -                | 51           | 526          | 95,483       | 公益事業                   |  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA   | 96               | 95           | 694          | 125,995      | 金融サービス                 |  |
| KBC GROEP NV                  | 265              | 270          | 2,812        | 510,050      | 銀行                     |  |
| LOTUS BAKERIES                | 0.47             | 0.47         | 351          | 63,751       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| SOFINA                        | 17               | 18           | 428          | 77,748       | 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                 |
| <b>(ユーロ／ベルギー)</b>    |         | 百株      | 百株    | 千ユーロ   | 千円        |                        |
| SYENSQO SA           |         | 84      | 85    | 584    | 106,075   | 素材                     |
| UCB SA               |         | 145     | 148   | 3,410  | 618,542   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 小計                   | 株数・金額   | 1,916   | 2,108 | 22,110 | 4,009,430 |                        |
|                      | 銘柄数<比率> | 10      | 11    | -      | <0.3%>    |                        |
| <b>(ユーロ／ルクセンブルグ)</b> |         |         |       |        |           |                        |
| ARCELORMITTAL        |         | 540     | 552   | 1,924  | 349,053   | 素材                     |
| TENARIS SA           |         | 475     | 441   | 771    | 139,914   | エネルギー                  |
| 小計                   | 株数・金額   | 1,016   | 993   | 2,696  | 488,968   |                        |
|                      | 銘柄数<比率> | 2       | 2     | -      | <0.0%>    |                        |
| <b>(ユーロ／フランス)</b>    |         |         |       |        |           |                        |
| ACCOR                |         | 224     | 230   | 1,045  | 189,673   | 消費者サービス                |
| ADP                  |         | 39      | 40    | 490    | 89,006    | 運輸                     |
| AIR LIQUIDE          |         | 667     | 681   | 11,283 | 2,046,112 | 素材                     |
| ALSTOM RGPT          |         | 399     | 408   | 922    | 167,337   | 資本財                    |
| AMUNDI SA            |         | 71      | 72    | 473    | 85,873    | 金融サービス                 |
| ARKEMA               |         | 65      | 67    | 340    | 61,713    | 素材                     |
| AXA SA               |         | 2,046   | 2,089 | 7,897  | 1,432,067 | 保険                     |
| BIOMERIEUX           |         | 47      | 48    | 515    | 93,446    | ヘルスケア機器・サービス           |
| BNP PARIBAS          |         | 1,175   | 1,199 | 8,047  | 1,459,253 | 銀行                     |
| BOLLORE SE           |         | 816     | 822   | 386    | 70,053    | メディア・娯楽                |
| BOUYGUES             |         | 219     | 226   | 935    | 169,618   | 資本財                    |
| BUREAU VERITAS SA    |         | 366     | 374   | 1,023  | 185,532   | 商業・専門サービス              |
| CAPGEMINI SA         |         | 178     | 191   | 2,445  | 443,538   | ソフトウェア・サービス            |
| CARREFOUR SA         |         | 627     | 695   | 898    | 162,865   | 生活必需品流通・小売り            |
| CIE DE SAINT-GOBAIN  |         | 518     | 529   | 4,298  | 779,517   | 資本財                    |
| CREDIT AGRICOLE SA   |         | 1,230   | 1,249 | 1,985  | 360,019   | 銀行                     |
| DANONE               |         | 745     | 762   | 5,924  | 1,074,311 | 食品・飲料・タバコ              |
| DASSAULT AVIATION SA |         | 22      | 23    | 631    | 114,541   | 資本財                    |
| DASSAULT SYSTEMES SA |         | 772     | 792   | 1,852  | 336,019   | ソフトウェア・サービス            |
| EDENRED              |         | 280     | 283   | 518    | 93,979    | 金融サービス                 |
| EIFFAGE              |         | 79      | 80    | 914    | 165,913   | 資本財                    |
| ENGIE                |         | 2,110   | 2,153 | 4,646  | 842,674   | 公益事業                   |
| ESSILORLUXOTTICA     |         | 343     | 354   | 10,954 | 1,986,438 | ヘルスケア機器・サービス           |
| EURAZEO              |         | 47      | -     | -      | -         | 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       |                        |
| <b>(ユーロ/フランス)</b>                   | 百株               | 百株           | 千ユーロ         | 千円           |                        |
| EUROFINS SCIENTIFIC                 | 155              | 139          | 800          | 145,121      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FDJ UNITED                          | 117              | 131          | 306          | 55,661       | 消費者サービス                |
| GETLINK SE - REGR                   | 349              | 356          | 548          | 99,464       | 運輸                     |
| HERMES INTERNATIONAL                | 36               | 37           | 7,876        | 1,428,348    | 耐久消費財・アパレル             |
| IPSEN                               | 43               | 44           | 562          | 101,931      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KERING                              | 86               | 87           | 2,605        | 472,475      | 耐久消費財・アパレル             |
| LEGRAND SA                          | 302              | 309          | 3,969        | 719,850      | 資本財                    |
| L'OREAL SA                          | 277              | 283          | 9,937        | 1,802,051    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 317              | 294          | 17,972       | 3,259,083    | 耐久消費財・アパレル             |
| MICHELIN (C.G.D.E.)                 | 774              | 789          | 2,190        | 397,225      | 自動車・自動車部品              |
| ORANGE S.A.                         | 2,196            | 2,228        | 3,071        | 556,919      | 電気通信サービス               |
| PERNOD-RICARD                       | 233              | 238          | 1,863        | 337,947      | 食品・飲料・タバコ              |
| PUBLICIS GROUPE                     | 264              | 269          | 2,272        | 412,185      | メディア・娯楽                |
| RENAULT SA                          | 221              | 227          | 782          | 141,935      | 自動車・自動車部品              |
| REXEL SA                            | 258              | 264          | 816          | 148,089      | 資本財                    |
| SAFRAN SA                           | 415              | 424          | 12,681       | 2,299,693    | 資本財                    |
| SANOFI                              | 1,313            | 1,302        | 11,195       | 2,030,205    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH            | 33               | 34           | 636          | 115,471      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               | 631              | 646          | 14,682       | 2,662,578    | 資本財                    |
| SOCIETE GENERALE                    | 831              | 848          | 4,822        | 874,519      | 銀行                     |
| SODEXO                              | 102              | 104          | 487          | 88,424       | 消費者サービス                |
| TELEPERFORMANCE                     | 62               | 63           | 369          | 67,083       | 商業・専門サービス              |
| THALES SA                           | 107              | 109          | 2,545        | 461,534      | 資本財                    |
| TOTALENERGIES SE                    | 2,492            | 2,419        | 13,404       | 2,430,797    | エネルギー                  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                | 812              | 741          | 2,115        | 383,567      | 公益事業                   |
| VINCI SA                            | 571              | 583          | 6,871        | 1,246,031    | 資本財                    |
| 小計                                  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 26,110<br>50 | 26,360<br>49 | 193,822<br>- | 35,147,705<br><2.4%>   |
| <b>(ユーロ/ドイツ)</b>                    |                  |              |              |              |                        |
| ADIDAS AG                           | 197              | 201          | 3,082        | 558,918      | 耐久消費財・アパレル             |
| ALLIANZ SE                          | 446              | 455          | 16,357       | 2,966,202    | 保険                     |
| BASF SE                             | 1,031            | 1,052        | 4,535        | 822,545      | 素材                     |
| BAYER AG                            | 1,134            | 1,157        | 3,128        | 567,373      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG         | 334              | 330          | 2,818        | 511,076      | 自動車・自動車部品              |

## 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    |                        |
| (ユーロ/ドイツ)                         | 百株      | 百株    | 千ユーロ   | 千円        |                        |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF      | 64      | 65    | 516    | 93,641    | 自動車・自動車部品              |
| BEIERSDORF AG                     | 114     | 114   | 1,016  | 184,274   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| BRENNTAG SE                       | 141     | 144   | 697    | 126,440   | 資本財                    |
| COMMERZBANK AG                    | 1,094   | 907   | 2,876  | 521,578   | 銀行                     |
| CONTINENTAL AG                    | 126     | 129   | 809    | 146,759   | 自動車・自動車部品              |
| COVESTRO AG-TEND                  | 200     | 200   | 1,234  | 223,851   | 素材                     |
| CTS EVENTIM AG & CO KGAA          | 72      | 73    | 586    | 106,367   | メディア・娯楽                |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG          | 548     | 560   | 2,001  | 362,925   | 資本財                    |
| DELIVERY HERO SE                  | 217     | 226   | 378    | 68,713    | 消費者サービス                |
| DEUTSCHE BANK AG                  | 2,137   | 2,181 | 6,516  | 1,181,758 | 金融サービス                 |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 217     | 221   | 4,658  | 844,738   | 金融サービス                 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG             | 692     | 708   | 560    | 101,554   | 運輸                     |
| DEUTSCHE TELEKOM AG               | 4,044   | 4,121 | 11,192 | 2,029,677 | 電気通信サービス               |
| DHL GROUP                         | 1,109   | 1,131 | 4,838  | 877,450   | 運輸                     |
| DR ING HC F PORSCHE AG            | 131     | 134   | 598    | 108,462   | 自動車・自動車部品              |
| E.ON SE                           | 2,593   | 2,644 | 4,045  | 733,590   | 公益事業                   |
| EVONIK INDUSTRIES AG              | 297     | 303   | 404    | 73,375    | 素材                     |
| FRESENIUS SE & CO KGAA            | 487     | 497   | 2,323  | 421,297   | ヘルスケア機器・サービス           |
| GEA GROUP AG                      | 178     | 172   | 981    | 178,011   | 資本財                    |
| HANNOVER RUECK SE                 | 69      | 71    | 1,792  | 325,105   | 保険                     |
| HEIDELBERG MATERIALS AG           | 157     | 157   | 3,363  | 609,957   | 素材                     |
| HENKEL AG & CO KGAA               | 119     | 123   | 801    | 145,370   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HENKEL KGAA-VORZUG                | 195     | 188   | 1,318  | 239,046   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HENSOLDT AG                       | -       | 74    | 577    | 104,789   | 資本財                    |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 1,508   | 1,539 | 5,045  | 914,965   | 半導体・半導体製造装置            |
| KNORR-BREMSE AG                   | 83      | 85    | 720    | 130,624   | 資本財                    |
| LEG IMMOBILIEN SE                 | 86      | 89    | 570    | 103,454   | 不動産管理・開発               |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG            | 834     | 851   | 4,852  | 879,896   | 自動車・自動車部品              |
| MERCK KGAA                        | 149     | 152   | 1,685  | 305,614   | 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       | 62      | 63    | 2,222  | 403,043   | 資本財                    |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG  | 154     | 153   | 8,182  | 1,483,814 | 保険                     |
| NEMETSCHKE SE                     | 66      | 68    | 601    | 109,073   | ソフトウェア・サービス            |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF | 176     | 181   | 644    | 116,932   | 自動車・自動車部品              |
| PUMA AG                           | 121     | -     | -      | -         | 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>(ユーロ/ドイツ)</b>                   |                  | 百株           | 百株           | 千ユーロ         | 千円                   |                        |
| RATIONAL AG                        |                  | 5            | 6            | 371          | 67,413               | 資本財                    |
| RHEINMETALL AG                     |                  | 50           | 54           | 8,635        | 1,566,044            | 資本財                    |
| RWE AG                             |                  | 729          | 744          | 3,270        | 593,009              | 公益事業                   |
| SAP SE                             |                  | 1,206        | 1,231        | 25,297       | 4,587,367            | ソフトウェア・サービス            |
| SARTORIUS AG-VORZUG                |                  | 30           | 30           | 691          | 125,444              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCOUT24 SE                         |                  | 86           | 88           | 765          | 138,878              | メディア・娯楽                |
| SIEMENS AG                         |                  | 878          | 895          | 19,584       | 3,551,470            | 資本財                    |
| SIEMENS ENERGY AG                  |                  | 738          | 800          | 8,725        | 1,582,199            | 資本財                    |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG            |                  | 325          | 398          | 1,650        | 299,233              | ヘルスケア機器・サービス           |
| SYMRISE AG                         |                  | 153          | 156          | 1,092        | 198,090              | 素材                     |
| TALANX AG                          |                  | 74           | 75           | 819          | 148,687              | 保険                     |
| VOLKSWAGEN AG                      |                  | 238          | 243          | 2,305        | 418,066              | 自動車・自動車部品              |
| VONOVIA SE                         |                  | 856          | 887          | 2,311        | 419,090              | 不動産管理・開発               |
| ZALANDO SE                         |                  | 259          | 264          | 599          | 108,658              | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 27,034<br>52 | 27,416<br>52 | 184,658<br>- | 33,485,929<br><2.3%> |                        |
| <b>(ユーロ/ポルトガル)</b>                 |                  |              |              |              |                      |                        |
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R        |                  | -            | 9,777        | 770          | 139,714              | 銀行                     |
| EDP RENOVAVEIS SA                  |                  | 362          | 373          | 420          | 76,314               | 公益事業                   |
| EDP SA                             |                  | 3,632        | 3,704        | 1,385        | 251,185              | 公益事業                   |
| GALP ENERGIA SGPS SA               |                  | 481          | 490          | 872          | 158,218              | エネルギー                  |
| JERONIMO MARTINS                   |                  | 327          | 333          | 719          | 130,439              | 生活必需品流通・小売り            |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 4,802<br>4   | 14,679<br>5  | 4,168<br>-   | 755,871<br><0.1%>    |                        |
| <b>(ユーロ/スペイン)</b>                  |                  |              |              |              |                      |                        |
| ACCIONA SA                         |                  | 28           | 29           | 514          | 93,317               | 公益事業                   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV        |                  | 205          | 211          | 1,622        | 294,296              | 資本財                    |
| AENA SME SA                        |                  | 86           | 883          | 1,992        | 361,270              | 運輸                     |
| AMADEUS IT GROUP SA                |                  | 519          | 530          | 3,291        | 596,816              | 消費者サービス                |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA |                  | 6,656        | 6,793        | 12,065       | 2,187,907            | 銀行                     |
| BANCO DE SABADELL SA               |                  | 6,280        | 5,919        | 1,841        | 333,964              | 銀行                     |
| BANCO SANTANDER SA                 |                  | 17,500       | 17,542       | 15,647       | 2,837,511            | 銀行                     |
| BANKINTER SA                       |                  | -            | 793          | 1,044        | 189,363              | 銀行                     |
| CAIXABANK                          |                  | 4,560        | 4,593        | 4,143        | 751,466              | 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>(ユーロ/スペイン)</b>                  |                  | 百株           | 百株           | 千ユーロ        | 千円                   |                        |
| CELLNEX TELECOM SAU                |                  | 617          | 587          | 1,472       | 267,005              | 電気通信サービス               |
| ENDESA SA                          |                  | 365          | 374          | 1,147       | 208,153              | 公益事業                   |
| FERROVIAL SE                       |                  | 547          | 604          | 3,272       | 593,391              | 資本財                    |
| GRIFOLS SA                         |                  | 344          | 351          | 359         | 65,242               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| IBERDROLA SA                       |                  | 6,727        | 7,480        | 13,389      | 2,428,026            | 公益事業                   |
| INDITEX SA                         |                  | 1,260        | 1,286        | 6,087       | 1,103,853            | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI       |                  | -            | 1,462        | 626         | 113,539              | 運輸                     |
| REDEIA CORPORACION SA              |                  | 471          | 479          | 726         | 131,733              | 公益事業                   |
| REPSOL SA                          |                  | 1,334        | 1,363        | 2,217       | 402,151              | エネルギー                  |
| TELEFONICA SA                      |                  | 4,682        | 4,414        | 1,598       | 289,822              | 電気通信サービス               |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 52,188<br>17 | 55,700<br>19 | 73,060<br>- | 13,248,833<br><0.9%> |                        |
| <b>(ユーロ/イタリア)</b>                  |                  |              |              |             |                      |                        |
| AMPLIFON SPA                       |                  | 143          | -            | -           | -                    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ASSICURAZIONI GENERALI             |                  | 1,086        | 1,004        | 3,295       | 597,540              | 保険                     |
| BANCA MEDIOLANUM SPA               |                  | -            | 263          | 489         | 88,710               | 金融サービス                 |
| BANCO BPM SPA                      |                  | 1,487        | 1,340        | 1,680       | 304,771              | 銀行                     |
| BPER BANCA SPA                     |                  | 1,149        | 1,723        | 1,759       | 318,992              | 銀行                     |
| DIASORIN ITALIA SPA                |                  | 25           | -            | -           | -                    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ENEL SPA                           |                  | 9,394        | 9,585        | 8,370       | 1,517,843            | 公益事業                   |
| ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA |                  | 2,464        | 2,409        | 3,908       | 708,730              | エネルギー                  |
| FINECOBANK SPA                     |                  | 705          | 720          | 1,484       | 269,288              | 銀行                     |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL       |                  | 402          | 350          | 272         | 49,384               | 電気通信サービス               |
| INTESA SANPAOLO                    |                  | 17,487       | 16,789       | 9,390       | 1,702,842            | 銀行                     |
| LEONARDO SPA                       |                  | 467          | 476          | 2,275       | 412,618              | 資本財                    |
| MEDIOBANCA SPA                     |                  | 578          | -            | -           | -                    | 銀行                     |
| MONCLER SPA                        |                  | 269          | 275          | 1,541       | 279,610              | 耐久消費財・アパレル             |
| NEXI SPA                           |                  | 570          | 656          | 251         | 45,620               | 金融サービス                 |
| POSTE ITALIANE SPA                 |                  | 527          | 538          | 1,115       | 202,337              | 金融サービス                 |
| PRYSMIAN SPA                       |                  | 324          | 331          | 2,819       | 511,229              | 資本財                    |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA        |                  | 132          | 135          | 680         | 123,312              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SNAM SPA                           |                  | 2,329        | 2,377        | 1,339       | 242,863              | 公益事業                   |
| STELLANTIS NV                      |                  | 2,342        | 2,378        | 2,010       | 364,655              | 自動車・自動車部品              |
| TELECOM ITALIA SPA                 |                  | 11,728       | 13,697       | 658         | 119,475              | 電気通信サービス               |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA |                  | 1,621        | 1,655        | 1,494       | 271,037              | 公益事業                   |
| UNICREDIT SPA                      |                  | 1,612        | 1,652        | 10,235      | 1,856,169            | 銀行                     |
| UNIPOL ASSICURAZIONI SPA           |                  | 412          | 421          | 796         | 144,507              | 保険                     |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 57,267<br>23 | 58,784<br>21 | 55,870<br>- | 10,131,543<br><0.7%> |                        |

## 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/フィンランド)</b>                   |                  | 百株                 | 百株                 | 千ユーロ         | 千円                       |                        |
| ELISA OYJ                             |                  | 169                | 172                | 655          | 118,796                  | 電気通信サービス               |
| FORTUM OYJ                            |                  | 516                | 526                | 975          | 176,888                  | 公益事業                   |
| KESKO OYJ-B SHS                       |                  | 315                | 322                | 578          | 104,848                  | 生活必需品流通・小売り            |
| KONE OYJ                              |                  | 392                | 400                | 2,258        | 409,581                  | 資本財                    |
| METSO CORPORATION                     |                  | 718                | 780                | 1,060        | 192,286                  | 資本財                    |
| NESTE OYJ                             |                  | 489                | 498                | 856          | 155,271                  | エネルギー                  |
| NOKIA OYJ                             |                  | 5,827              | 6,110              | 3,208        | 581,739                  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NORDEA BANK ABP                       |                  | 3,641              | 3,681              | 5,308        | 962,709                  | 銀行                     |
| ORION OYJ-CLASS B                     |                  | 125                | 128                | 756          | 137,201                  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SAMPO OYJ                             |                  | 2,794              | 2,850              | 2,819        | 511,343                  | 保険                     |
| STORA ENSO OYJ                        |                  | 671                | 686                | 672          | 121,925                  | 素材                     |
| UPM-KYMMENE OYJ                       |                  | 616                | 622                | 1,447        | 262,490                  | 素材                     |
| WARTSILA OYJ                          |                  | 579                | 591                | 1,542        | 279,630                  | 資本財                    |
| 小計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 16,857<br>13       | 17,372<br>13       | 22,139<br>-  | 4,014,712<br><0.3%>      |                        |
| <b>(ユーロ/オーストリア)</b>                   |                  |                    |                    |              |                          |                        |
| ERSTE GROUP BANK AG                   |                  | 355                | 362                | 3,278        | 594,577                  | 銀行                     |
| OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A             |                  | 78                 | 80                 | 505          | 91,738                   | 公益事業                   |
| OMV AG                                |                  | 170                | 174                | 842          | 152,738                  | エネルギー                  |
| 小計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 604<br>3           | 617<br>3           | 4,626<br>-   | 839,055<br><0.1%>        |                        |
| <b>(ユーロ/その他)</b>                      |                  |                    |                    |              |                          |                        |
| AEGON LTD                             |                  | 1,525              | 1,556              | 1,015        | 184,132                  | 保険                     |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA |                  | 237                | 259                | 1,025        | 185,972                  | ヘルスケア機器・サービス           |
| 小計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,762<br>2         | 1,816<br>2         | 2,040<br>-   | 370,104<br><0.0%>        |                        |
| ユーロ計                                  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 212,705<br>210     | 230,702<br>212     | 689,950<br>- | 125,115,554<br><8.7%>    |                        |
| 合計                                    | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,253,801<br>1,122 | 1,299,913<br>1,096 | -<br>-       | 1,376,360,881<br><95.4%> |                        |

(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□      | 千□    | 千米ドル   | 千円        |            |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 17      | 17    | 1,232  | 193,909   |            |
| CROWN CASTLE INC             | 50      | 51    | 4,675  | 735,482   |            |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 18      | 18    | 912    | 143,475   |            |
| PROLOGIS INC                 | 107     | 109   | 13,390 | 2,106,181 |            |
| ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT   | 64      | 71    | 1,549  | 243,771   |            |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 16      | 16    | 2,969  | 467,109   |            |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 12      | 12    | 1,286  | 202,417   |            |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 39      | 42    | 2,508  | 394,541   |            |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 7       | 7     | 1,931  | 303,825   |            |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 80      | 82    | 1,448  | 227,847   |            |
| WELLTOWER INC                | 71      | 77    | 15,176 | 2,387,167 |            |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC  | 80      | —     | —      | —         |            |
| KIMCO REALTY CORP            | 77      | 79    | 1,598  | 251,424   |            |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 13      | 13    | 1,792  | 281,911   |            |
| PUBLIC STORAGE               | 18      | 18    | 4,954  | 779,345   |            |
| REGENCY CENTERS CORP         | 19      | 20    | 1,404  | 220,940   |            |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 37      | 38    | 6,932  | 1,090,353 |            |
| SUN COMMUNITIES INC          | 14      | 15    | 1,890  | 297,369   |            |
| UDR INC                      | 36      | 37    | 1,283  | 201,870   |            |
| VENTAS INC                   | 48      | 53    | 4,254  | 669,174   |            |
| WP CAREY INC                 | 25      | 25    | 1,710  | 268,972   |            |
| REALTY INCOME CORP           | 101     | 106   | 6,045  | 950,889   |            |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 20      | 21    | 1,315  | 206,914   |            |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 24      | 25    | 3,240  | 509,664   |            |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 38      | 39    | 6,324  | 994,810   |            |
| IRON MOUNTAIN INC            | 33      | 34    | 3,014  | 474,187   |            |
| AMERICAN TOWER REIT INC      | 53      | 55    | 9,961  | 1,566,890 |            |
| EQUINIX INC                  | 11      | 11    | 8,823  | 1,387,874 |            |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 38      | 39    | 1,239  | 194,957   |            |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 31      | 32    | 1,397  | 219,864   |            |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 12      | 12    | 2,483  | 390,657   |            |
| INVITATION HOMES INC         | 67      | 68    | 1,884  | 296,442   |            |
| VICI PROPERTIES INC          | 121     | 124   | 3,634  | 571,740   |            |
| 小計                           | □数・金額   | 1,415 | 1,381  | 122,270   | 19,231,987 |
|                              | 銘柄数<比率> | 33    | 32     | —         | <1.3%>     |

## 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>(オーストラリア)</b>                 |         | 千□      | 千□    | 千オーストラリア・ドル | 千円         |
| GPT GROUP                        |         | 221     | —     | —           | —          |
| GOODMAN GROUP                    |         | 234     | 239   | 6,971       | 710,830    |
| STOCKLAND                        |         | 275     | 282   | 1,744       | 177,887    |
| VICINITY CENTRES                 |         | 446     | 456   | 1,154       | 117,758    |
| SCENTRE GROUP                    |         | 599     | 613   | 2,503       | 255,246    |
| 小計                               | □数・金額   | 1,776   | 1,591 | 12,374      | 1,261,722  |
|                                  | 銘柄数<比率> | 5       | 4     | —           | <0.1%>     |
| <b>(香港)</b>                      |         |         |       | 千香港ドル       |            |
| LINK REIT                        |         | 300     | 306   | 12,718      | 256,791    |
| 小計                               | □数・金額   | 300     | 306   | 12,718      | 256,791    |
|                                  | 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         |         | 432     | 461   | 1,291       | 155,461    |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL |         | 668     | 689   | 1,613       | 194,234    |
| 小計                               | □数・金額   | 1,101   | 1,150 | 2,905       | 349,696    |
|                                  | 銘柄数<比率> | 2       | 2     | —           | <0.0%>     |
| <b>(イギリス)</b>                    |         |         |       | 千イギリス・ポンド   |            |
| LAND SECURITIES GROUP PLC        |         | 81      | 83    | 499         | 102,540    |
| SEGRO PLC                        |         | 148     | 151   | 1,056       | 216,940    |
| 小計                               | □数・金額   | 230     | 235   | 1,556       | 319,481    |
|                                  | 銘柄数<比率> | 2       | 2     | —           | <0.0%>     |
| <b>(ユーロ/フランス)</b>                |         |         |       | 千ユーロ        |            |
| KLEPIERRE                        |         | 24      | 25    | 838         | 151,999    |
| GECINA SA                        |         | 5       | 5     | 428         | 77,760     |
| COVIVIO                          |         | 6       | 6     | 361         | 65,467     |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD        |         | 13      | 14    | 1,290       | 234,065    |
| 小計                               | □数・金額   | 50      | 51    | 2,918       | 529,293    |
|                                  | 銘柄数<比率> | 4       | 4     | —           | <0.0%>     |
| 合計                               | □数・金額   | 4,874   | 4,718 | —           | 21,948,971 |
|                                  | 銘柄数<比率> | 47      | 45    | —           | <1.5%>     |

(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。

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高

| 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 | 35,100 | -   |
|     | FTSE 100             | 5,132  | -   |
|     | DJ EURO STOXX 50     | 3,405  | -   |

(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

2025年11月20日現在

| 項目           | 当期末           |       |
|--------------|---------------|-------|
|              | 評価額           | 比率    |
|              | 千円            | %     |
| 株式           | 1,376,360,881 | 95.3  |
| 投資信託証券       | 21,948,971    | 1.5   |
| コール・ローン等、その他 | 46,023,777    | 3.2   |
| 投資信託財産総額     | 1,444,333,630 | 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157.29円、1カナダ・ドル111.96円、1オーストラリア・ドル101.96円、1香港ドル20.19円、1シンガポール・ドル120.36円、1ニュージーランド・ドル88.22円、1イギリス・ポンド205.31円、1イスラエル・シケル48.131円、1スイス・フラン195.20円、1デンマーク・クローネ24.28円、1ノルウェー・クローネ15.46円、1スウェーデン・クローナ16.47円、1ユーロ181.34円です。

(注2) 外貨建純資産（1,423,073,172千円）の投資信託財産総額（1,444,333,630千円）に対する比率は98.5%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

(2025年11月20日現在)

| 項目                  | 当期末                |
|---------------------|--------------------|
| (A)資産               | 1,463,051,802,862円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等     | 26,677,245,242     |
| 株 式(評価額)            | 1,376,360,881,103  |
| 投 資 信 託 証 券(評価額)    | 21,948,971,681     |
| 未 収 入 金             | 19,225,406,311     |
| 未 収 配 当 金           | 1,114,285,320      |
| 差 入 委 託 証 拠         | 17,725,013,205     |
| (B)負債               | 20,842,119,779     |
| 未 払 金               | 18,968,182,033     |
| 未 払 解 約 金           | 1,873,937,746      |
| (C)純 資 産 総 額(A - B) | 1,442,209,683,083  |
| 元 本                 | 247,967,645,861    |
| 次 期 繰 越 損 益 金       | 1,194,242,037,222  |
| (D)受 益 権 総 口 数      | 247,967,645,861口   |
| 1万口当たり基準価額(C / D)   | 58,161円            |

|      |  |                  |
|------|--|------------------|
| (注1) | 期首元本額  | 243,424,876,585円 |
|      | 期中追加設定元本額                                    | 19,085,346,696円  |
|      | 期中一部解約元本額                                    | 14,542,577,420円  |
| (注2) | 当マザーファンドの当期末元本額におけるペビーフンド別内訳は、次の通りです。        |                  |
|      | DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)                   | 658,335,764円     |
|      | DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)                     | 3,406,625,412円   |
|      | DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)                   | 3,644,604,076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)                | 2,430,959,791円   |
|      | ニッセイインテックスバランス (債券重視型) S A (適格機関投資家限定)       | 526,044円         |
|      | ニッセイインテックスバランス (標準型) S A (適格機関投資家限定)         | 2,812,340円       |
|      | ニッセイインテックスバランス (成長型) S A (適格機関投資家限定)         | 3,057,711円       |
|      | ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ (適格機関投資家限定)              | 486,966,505円     |
|      | ニッセイ外国株式インデックスファンド                           |                  |
|      | <購入・換金手数料なし>                                 | 162,799,974,685円 |
|      | DCニッセイ外国株式インデックス                             | 47,582,603,932円  |
|      | ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型)                 |                  |
|      | <購入・換金手数料なし>                                 | 4,168,662,141円   |
|      | DCニッセイターゲットデートファンド2055                       | 526,013,583円     |
|      | DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)                     | 174,887,333円     |
|      | DCニッセイターゲットデートファンド2045                       | 622,137,397円     |
|      | DCニッセイターゲットデートファンド2035                       | 612,845,421円     |
|      | DCニッセイターゲットデートファンド2025                       | 5,142,546円       |
|      | ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型)                 |                  |
|      | <購入・換金手数料なし>                                 | 85,108,439円      |
|      | ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)                     | 12,723,914円      |
|      | ニッセイ・インテックスパッケージ (内外・株式/リート)                 | 11,896,036円      |
|      | ニッセイ・インテックスパッケージ (内外・株式/リート/債券)              | 3,547,576円       |
|      | ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型)                 |                  |
|      | <購入・換金手数料なし>                                 | 20,187,609円      |
|      | DCニッセイターゲットデートファンド2060                       | 446,022,862円     |
|      | DCニッセイターゲットデートファンド2050                       | 329,573,594円     |
|      | DCニッセイターゲットデートファンド2040                       | 538,929,571円     |
|      | DCニッセイターゲットデートファンド2030                       | 120,722,375円     |
|      | ニッセイ世界株式ファンド (GDP型バケット)                      |                  |
|      | <購入・換金手数料なし>                                 | 312,913,943円     |
|      | ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01 (適格機関投資家限定)   | 109,244,373円     |
|      | ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05 (適格機関投資家限定)   | 108,878,703円     |
|      | ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08 (適格機関投資家限定)   |                  |
|      | ニッセイ先進国株式インデックス (海経ヘッジあり) (ラップ専用)            | 97,369,975円      |
|      | ニッセイ先進国株式インデックス (海経ヘッジなし) (ラップ専用)            | 31,632,731円      |
|      | FWニッセイ先進国株インデックス                             | 16,810,416,059円  |
|      | DCニッセイターゲットデートファンド2065                       | 108,692,308円     |
|      | DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト                        | 278,151,347円     |
|      | DCニッセイターゲットデートファンド2070                       | 1,196,674,461円   |
|      | DCニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-08 (適格機関投資家限定) | 38,366,288円      |
|      | ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-08 (適格機関投資家限定)   | 67,061,501円      |
|      | ニッセイインテックスバランス (外国株式重視型) S A (適格機関投資家限定)     | 5,999,462円       |
|      | ニッセイ全世界株式インデックスコレクト S A (適格機関投資家限定)          | 107,378,053円     |

## 損益の状況

当期 (2025年5月21日~2025年11月20日)

| 項目                      | 当期                |
|-------------------------|-------------------|
| (A)配 当 等 収 益 金          | 9,000,751,321円    |
| 受 取 配 当 金               | 8,623,096,508     |
| 受 取 そ の 他 の 収 益         | 106,200,013       |
| 受 取 そ の 他 の 収 益         | 271,454,800       |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益      | 226,002,086,018   |
| 売 買 損 益                 | 288,341,886,793   |
| 売 買 損 益                 | △ 62,339,800,775  |
| (C)先 物 取 引 等 損 益        | 2,324,670,673     |
| 取 引 損 益                 | 2,735,865,841     |
| 取 引 損 益                 | △ 411,195,168     |
| (D)信 託 報 酬 等            | △ 51,362,696      |
| (E)当期損益金(A + B + C + D) | 237,276,145,316   |
| (F)前期繰越損益金              | 937,822,306,821   |
| (G)追加信託差損益金             | 82,151,335,745    |
| (H)解約差損益金               | △ 63,007,750,660  |
| (I)合計(E + F + G + H)    | 1,194,242,037,222 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I)        | 1,194,242,037,222 |

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

# ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 38 期

(計算期間：2025年5月21日～2025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

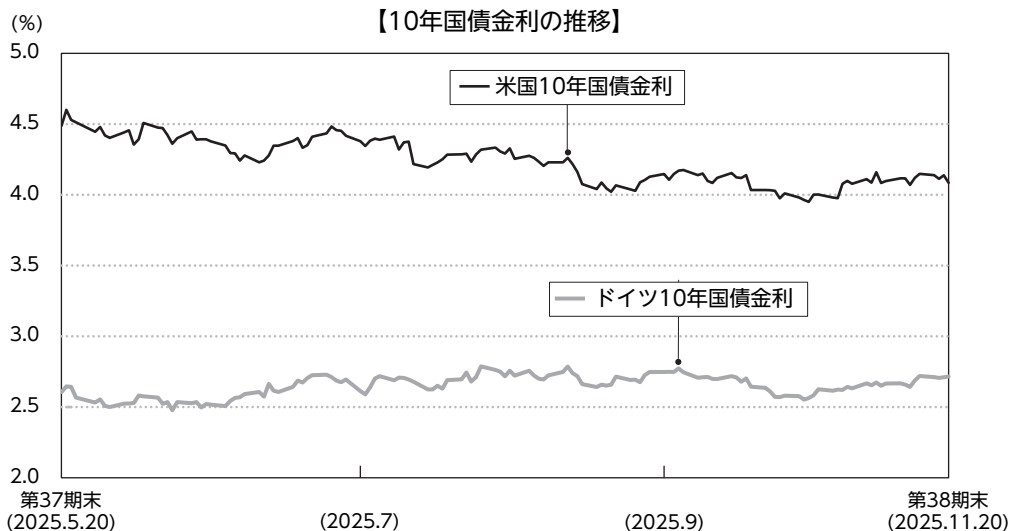
東京都千代田区丸の内1-6-6

## 運用経過

2025年5月21日～2025年11月20日

## 投資環境

## 海外債券市況

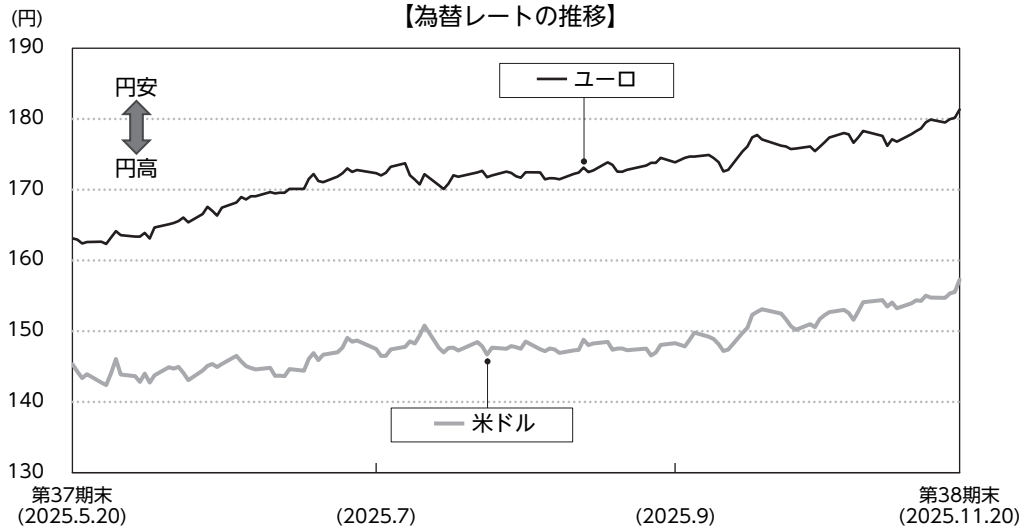


(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、期初から低下基調となりました。6月にはイランとイスラエルが停戦合意したことで、原油価格上昇によるインフレ再燃懸念が後退したことや、一部の米連邦準備制度理事会（FRB）高官が利下げに前向きな姿勢を示したことを受けて、金利は低下しました。7月には米雇用統計が市場予想を上回る底堅い結果となったことなどを受けて、金利は一時上昇基調となりましたが、8月にパウエルFRB議長がジャクソンホール会議において利下げに転じる可能性を示唆したことや、9月に雇用関連の経済指標が市場予想を下回ったことなどから、低下基調となりました。10月には米中首脳会談を前に米国が中国に対する関税を引き上げるとの報道を受けて、金利はさらに低下しました。期末にかけては緩やかに金利は上昇しましたが、結局、期を通じて見ると低下して当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初はトランプ米大統領がユーロ圏に対して厳しい関税を課す意向を示したことで、景気減速懸念から低下基調で推移しました。6月には欧州中央銀行（ECB）ラガルド総裁が今後の追加利下げに慎重な姿勢を示したことや、ドイツによる国防費の増額計画により財政悪化懸念が高まったことなどから、金利は上昇基調となりました。その後はおおむね横ばいで推移しましたが、10月には米中首脳会談を前に米国が中国に対する関税を引き上げるとの報道を受けて金利は低下しました。期末にかけては金利はやや上昇し、結局、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

## ■為替市況

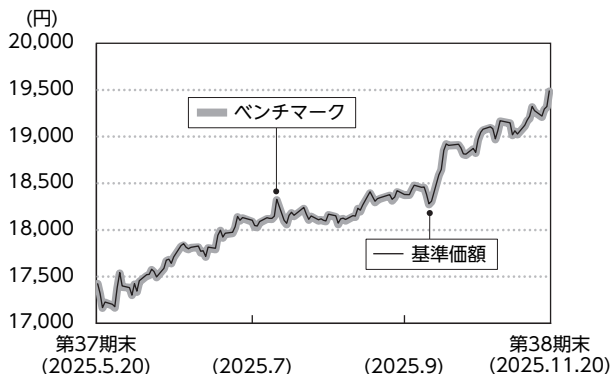


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、期初以降、上下して推移しましたが、7月には堅調な米雇用統計やトランプ米大統領が日本への関税率引き上げを示唆したことを受けて、米ドル高円安となりました。その後は横ばいに推移しましたが、10月に自民党総裁選で高市氏が勝利したことで、財政拡張的な政策が示されるとの思惑から、米ドル高円安基調となりました。また、米連邦公開市場委員会（FOMC）後の記者会見でパウエルFRB議長が早期の追加利下げに慎重な姿勢を示したことで、さらに米ドル高円安となりました。その後も、高市政権が拡張的な財政に傾くとの懸念を受けて、米ドル高円安基調が継続し、結局、期を通じて見ると大幅に米ドル高円安となりました。

当期のユーロ／円レートは、期初以降、上下して推移した後、6月から7月にかけては追加利下げに慎重なECBと、利上げに慎重な日銀という金融政策の方向性が鮮明となったことで、ユーロ高円安に推移しました。その後は横ばいに推移しましたが、10月に自民党総裁選で高市氏が勝利したことで、財政拡張的な政策が示されるとの思惑から、当期末にかけてユーロ高円安基調が継続し、結局、期を通じて見ると大幅にユーロ高円安となりました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 2025年6月にイランとイスラエルが停戦合意したことで、原油価格上昇によるインフレ再燃懸念が後退したことや、一部のFRB高官が利下げに前向きな姿勢を示したことを受けて米金利が低下(債券価格は上昇)基調となったこと
- ・ 2025年10月以降、高市政権の下で財政拡張的な政策が示されるとの思惑から円安となったこと

#### <下落要因>

- ・ 7月に米雇用統計が市場予想を上回る底堅い結果となったことなどを受けて米金利が上昇基調となったこと

## 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+11.9%となり、ベンチマーク騰落率(+11.8%)にほぼ連動しました。

## 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。

## お知らせ

### ■ 約款変更

運用報告書に関する記載の変更を行うため関連条項に所要の変更を行いました。

(2025年4月1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 | 債券組入比率 |      | 純資産総額   |
|------------------|--------|-------|------|--------|--------|------|---------|
|                  |        |       |      |        |        |      |         |
|                  | 円      |       | %    |        | %      | %    | 百万円     |
| 34期(2023年11月20日) | 16,626 |       | 8.2  | 16,850 | 8.2    | 98.9 | 72,121  |
| 35期(2024年5月20日)  | 17,780 |       | 6.9  | 18,023 | 7.0    | 98.8 | 84,737  |
| 36期(2024年11月20日) | 17,954 |       | 1.0  | 18,199 | 1.0    | 98.9 | 92,549  |
| 37期(2025年5月20日)  | 17,422 | △     | 3.0  | 17,681 | △      | 2.8  | 94,858  |
| 38期(2025年11月20日) | 19,489 |       | 11.9 | 19,774 |        | 11.8 | 115,059 |

(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 | 債券組入比率 |      |
|-----------------|--------|-----|------|--------|--------|------|
|                 |        |     |      |        |        |      |
|                 | 円      |     | %    |        | %      | %    |
| (期首)2025年5月20日  | 17,422 |     | —    | 17,681 | —      | 98.8 |
| 5月末             | 17,401 | △   | 0.1  | 17,648 | △      | 0.2  |
| 6月末             | 17,828 |     | 2.3  | 18,079 |        | 2.2  |
| 7月末             | 18,148 |     | 4.2  | 18,415 |        | 4.1  |
| 8月末             | 18,112 |     | 4.0  | 18,368 |        | 3.9  |
| 9月末             | 18,459 |     | 6.0  | 18,725 |        | 5.9  |
| 10月末            | 19,170 |     | 10.0 | 19,448 |        | 10.0 |
| (期末)2025年11月20日 | 19,489 |     | 11.9 | 19,774 |        | 11.8 |

(注) 騰落率は期首比です。

## 1 万口当たりの費用明細

2025年5月21日～2025年11月20日

| 項目     | 当期  |         | 項目の概要   |
|--------|-----|---------|---|
|        | 金額  | 比率      |   |
| その他費用  | 2円  | 0.011%  | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数   |
| (保管費用) | (2) | (0.011) | 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用  |
| (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     | 2   | 0.011   |   |

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（18,238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

2025年5月21日～2025年11月20日

## 公社債

|        |          | 買付額                   | 売付額                 |             |
|--------|----------|-----------------------|---------------------|-------------|
| 外国     | アメリカ     | 千米ドル<br>108,880       | 千米ドル<br>78,983      |             |
|        | カナダ      | 千カナダ・ドル<br>4,586      | 千カナダ・ドル<br>1,815    |             |
|        | オーストラリア  | 千オーストラリア・ドル<br>2,019  | 千オーストラリア・ドル<br>638  |             |
|        | シンガポール   | 千シンガポール・ドル<br>450     | 千シンガポール・ドル<br>240   |             |
|        | ニュージーランド | 千ニュージーランド・ドル<br>600   | 千ニュージーランド・ドル<br>233 |             |
|        | イギリス     | 千イギリス・ポンド<br>5,294    | 千イギリス・ポンド<br>1,307  |             |
|        | イスラエル    | 千イスラエル・シケル<br>1,399   | 千イスラエル・シケル<br>337   |             |
|        | デンマーク    | 千デンマーク・クローネ<br>1,176  | 千デンマーク・クローネ<br>224  |             |
|        | ノルウェー    | 千ノルウェー・クローネ<br>1,619  | 千ノルウェー・クローネ<br>-    |             |
|        | スウェーデン   | 千スウェーデン・クローナ<br>1,588 | 千スウェーデン・クローナ<br>49  |             |
|        | メキシコ     | 千メキシコ・ペソ<br>19,237    | 千メキシコ・ペソ<br>6,848   |             |
|        | 中国       | 千人民元<br>120,793       | 千人民元<br>50,931      |             |
|        | マレーシア    | 千マレーシア・リンギット<br>1,850 | 千マレーシア・リンギット<br>353 |             |
|        | ポーランド    | 千ポーランド・ズロチ<br>4,553   | 千ポーランド・ズロチ<br>2,300 |             |
|        | ユーロ      | アイルランド                | 千ユーロ<br>233         | 千ユーロ<br>275 |
|        |          | オランダ                  | 786                 | 444         |
|        |          | ベルギー                  | 1,172               | 555         |
|        |          | フランス                  | 5,996               | 2,510       |
|        |          | ドイツ                   | 5,496               | 2,680       |
|        |          | ポルトガル                 | 499                 | 280         |
| スペイン   |          | 3,244                 | 2,024               |             |
| イタリア   |          | 5,575                 | 2,611               |             |
| フィンランド |          | 502                   | 107                 |             |
| オーストリア |          | 892                   | 617                 |             |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2025年5月21日～2025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 | 2,318,468 | US TREASURY           | 4,418,473 |
| US TREASURY | 2,009,447 | US TREASURY           | 2,087,592 |
| US TREASURY | 1,642,666 | US TREASURY           | 1,934,399 |
| US TREASURY | 1,603,726 | US TREASURY           | 1,169,341 |
| US TREASURY | 1,376,104 | US TREASURY           | 562,724   |
| US TREASURY | 774,685   | US TREASURY           | 562,706   |
| US TREASURY | 716,270   | CHINA GOVERNMENT BOND | 363,868   |
| US TREASURY | 652,980   | US TREASURY           | 324,555   |
| US TREASURY | 494,738   | CHINA GOVERNMENT BOND | 293,653   |
| US TREASURY | 483,349   | CHINA GOVERNMENT BOND | 254,213   |

(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

2025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<br>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      | 367,110       | 336,446       | 52,919,633 | 46.0 | —               | 19.0      | 16.4 | 10.6 |
|           | 千カナダ・ドル       | 千カナダ・ドル       |            |      |                 |           |      |      |
| カナダ       | 21,280        | 20,369        | 2,280,545  | 2.0  | —               | 1.1       | 0.5  | 0.4  |
|           | 千オーストラリア・ドル   | 千オーストラリア・ドル   |            |      |                 |           |      |      |
| オーストラリア   | 14,900        | 13,559        | 1,382,558  | 1.2  | —               | 0.8       | 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    | 3,590         | 3,818         | 459,596    | 0.4  | —               | 0.2       | 0.1  | 0.1  |
|           | 千ニューージーランド・ドル | 千ニューージーランド・ドル |            |      |                 |           |      |      |
| ニューージーランド | 3,960         | 3,757         | 331,503    | 0.3  | —               | 0.2       | 0.1  | 0.0  |
|           | 千イギリス・ポンド     | 千イギリス・ポンド     |            |      |                 |           |      |      |
| イギリス      | 37,340        | 30,956        | 6,355,653  | 5.5  | —               | 3.8       | 1.3  | 0.4  |
|           | 千イスラエル・シケル    | 千イスラエル・シケル    |            |      |                 |           |      |      |
| イスラエル     | 9,700         | 9,258         | 445,614    | 0.4  | —               | 0.2       | 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<br>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<br>10,930  | 千デンマーク・クローネ<br>10,259  | 千円<br>249,101 | %<br>0.2  | %<br>-          | %<br>0.1  | %<br>0.0 | %<br>0.0 |     |
| ノルウェー  | 千ノルウェー・クローネ<br>13,060  | 千ノルウェー・クローネ<br>12,176  | 188,254       | 0.2       | -               | 0.1       | 0.0      | 0.0      |     |
| スウェーデン | 千スウェーデン・クローナ<br>13,610 | 千スウェーデン・クローナ<br>13,192 | 217,277       | 0.2       | -               | 0.1       | 0.1      | 0.0      |     |
| メキシコ   | 千メキシコ・ペソ<br>118,200    | 千メキシコ・ペソ<br>113,098    | 969,898       | 0.8       | -               | 0.5       | 0.2      | 0.1      |     |
| 中国     | 千人民元<br>568,470        | 千人民元<br>594,132        | 13,122,124    | 11.4      | -               | 5.1       | 4.3      | 2.0      |     |
| マレーシア  | 千マレーシア・リンギット<br>14,990 | 千マレーシア・リンギット<br>15,608 | 590,110       | 0.5       | -               | 0.3       | 0.1      | 0.1      |     |
| ポーランド  | 千ポーランド・ズロチ<br>17,930   | 千ポーランド・ズロチ<br>17,556   | 752,885       | 0.7       | -               | 0.2       | 0.4      | 0.1      |     |
| ユーロ    | 千ユーロ                   | 千ユーロ                   |               |           |                 |           |          |          |     |
|        | アイルランド                 | 3,040                  | 2,690         | 487,888   | 0.4             | -         | 0.3      | 0.1      | 0.0 |
|        | オランダ                   | 8,640                  | 7,832         | 1,420,286 | 1.2             | -         | 0.8      | 0.3      | 0.1 |
|        | ベルギー                   | 10,430                 | 9,427         | 1,709,604 | 1.5             | -         | 1.0      | 0.3      | 0.1 |
|        | フランス                   | 50,240                 | 45,394        | 8,231,748 | 7.2             | -         | 4.2      | 2.1      | 0.9 |
|        | ドイツ                    | 38,410                 | 35,520        | 6,441,248 | 5.6             | -         | 3.0      | 1.8      | 0.9 |
|        | ポルトガル                  | 3,920                  | 3,713         | 673,395   | 0.6             | -         | 0.3      | 0.2      | 0.1 |
|        | スペイン                   | 28,690                 | 27,529        | 4,992,269 | 4.3             | -         | 2.4      | 1.4      | 0.6 |
|        | イタリア                   | 42,840                 | 42,468        | 7,701,306 | 6.7             | -         | 3.9      | 1.9      | 0.9 |
|        | フィンランド                 | 3,620                  | 3,227         | 585,208   | 0.5             | -         | 0.3      | 0.1      | 0.0 |
|        | オーストリア                 | 7,450                  | 6,625         | 1,201,471 | 1.0             | -         | 0.7      | 0.3      | 0.1 |
| 合計     | -                      | -                      | 113,709,185   | 98.8      | -               | 48.6      | 32.6     | 17.6     |     |

(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 | 5.2500 | 2028/11/15 | 120    | 125    | 19,749    |
|      | US TREASURY | 5.3750 | 2031/02/15 | 180    | 193    | 30,498    |
|      | US TREASURY | 2.0000 | 2026/11/15 | 10,390 | 10,219 | 1,607,474 |
|      | US TREASURY | 2.2500 | 2027/02/15 | 23,240 | 22,842 | 3,592,875 |
|      | US TREASURY | 2.3750 | 2027/05/15 | 18,810 | 18,469 | 2,905,103 |
|      | US TREASURY | 2.2500 | 2027/08/15 | 13,720 | 13,406 | 2,108,686 |
|      | US TREASURY | 2.2500 | 2027/11/15 | 12,940 | 12,608 | 1,983,167 |
|      | US TREASURY | 0.6250 | 2027/12/31 | 4,180  | 3,929  | 618,069   |
|      | US TREASURY | 2.7500 | 2028/02/15 | 8,540  | 8,387  | 1,319,266 |
|      | US TREASURY | 1.1250 | 2028/02/29 | 1,310  | 1,239  | 195,030   |
|      | US TREASURY | 1.2500 | 2028/03/31 | 1,150  | 1,089  | 171,365   |
|      | US TREASURY | 1.2500 | 2028/04/30 | 1,390  | 1,314  | 206,726   |
|      | US TREASURY | 2.8750 | 2028/05/15 | 11,730 | 11,531 | 1,813,794 |
|      | US TREASURY | 1.2500 | 2028/05/31 | 900    | 849    | 133,608   |
|      | US TREASURY | 2.8750 | 2028/08/15 | 11,590 | 11,373 | 1,788,937 |
|      | US TREASURY | 1.1250 | 2028/08/31 | 1,570  | 1,468  | 230,950   |
|      | US TREASURY | 1.3750 | 2028/10/31 | 1,840  | 1,726  | 271,516   |
|      | US TREASURY | 3.1250 | 2028/11/15 | 6,240  | 6,156  | 968,406   |
|      | US TREASURY | 1.5000 | 2028/11/30 | 1,650  | 1,551  | 243,964   |
|      | US TREASURY | 2.6250 | 2029/02/15 | 9,720  | 9,426  | 1,482,748 |
|      | US TREASURY | 2.3750 | 2029/05/15 | 9,590  | 9,198  | 1,446,883 |
|      | US TREASURY | 1.6250 | 2029/08/15 | 9,180  | 8,547  | 1,344,421 |
|      | US TREASURY | 1.7500 | 2029/11/15 | 8,870  | 8,258  | 1,298,910 |
|      | US TREASURY | 1.5000 | 2030/02/15 | 9,440  | 8,644  | 1,359,706 |
|      | US TREASURY | 0.6250 | 2030/08/15 | 10,860 | 9,418  | 1,481,495 |
|      | US TREASURY | 0.8750 | 2030/11/15 | 7,490  | 6,531  | 1,027,293 |
|      | US TREASURY | 1.1250 | 2031/02/15 | 5,790  | 5,086  | 800,067   |
|      | US TREASURY | 1.6250 | 2031/05/15 | 6,000  | 5,369  | 844,496   |
|      | US TREASURY | 1.2500 | 2031/08/15 | 6,190  | 5,383  | 846,820   |
|      | US TREASURY | 4.1250 | 2031/10/31 | 2,160  | 2,195  | 345,399   |
|      | US TREASURY | 1.3750 | 2031/11/15 | 3,820  | 3,324  | 522,851   |
|      | US TREASURY | 1.8750 | 2032/02/15 | 5,970  | 5,322  | 837,193   |
|      | US TREASURY | 2.8750 | 2032/05/15 | 5,730  | 5,407  | 850,503   |
|      | US TREASURY | 2.7500 | 2032/08/15 | 5,730  | 5,347  | 841,066   |
|      | US TREASURY | 4.1250 | 2032/11/15 | 2,350  | 2,382  | 374,769   |
|      | US TREASURY | 3.5000 | 2033/02/15 | 2,410  | 2,346  | 369,144   |
|      | US TREASURY | 3.3750 | 2033/05/15 | 2,400  | 2,312  | 363,781   |

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 | 3.8750 | 2033/08/15 | 2,600 | 2,585 | 406,667 |
|      | US TREASURY | 4.5000 | 2033/11/15 | 2,730 | 2,828 | 444,830 |
|      | US TREASURY | 4.0000 | 2034/02/15 | 2,900 | 2,900 | 456,209 |
|      | US TREASURY | 4.3750 | 2034/05/15 | 2,870 | 2,943 | 462,969 |
|      | US TREASURY | 3.8750 | 2034/08/15 | 2,890 | 2,853 | 448,885 |
|      | US TREASURY | 4.2500 | 2034/11/15 | 2,930 | 2,970 | 467,210 |
|      | US TREASURY | 4.6250 | 2035/02/15 | 2,890 | 3,009 | 473,423 |
|      | US TREASURY | 4.2500 | 2035/05/15 | 2,890 | 2,923 | 459,822 |
|      | US TREASURY | 4.2500 | 2035/08/15 | 2,850 | 2,879 | 452,898 |
|      | US TREASURY | 4.5000 | 2036/02/15 | 210   | 217   | 34,200  |
|      | US TREASURY | 5.0000 | 2037/05/15 | 160   | 171   | 27,026  |
|      | US TREASURY | 4.3750 | 2038/02/15 | 150   | 151   | 23,874  |
|      | US TREASURY | 4.5000 | 2038/05/15 | 190   | 194   | 30,553  |
|      | US TREASURY | 3.5000 | 2039/02/15 | 190   | 173   | 27,365  |
|      | US TREASURY | 4.2500 | 2039/05/15 | 270   | 265   | 41,819  |
|      | US TREASURY | 4.5000 | 2039/08/15 | 310   | 312   | 49,100  |
|      | US TREASURY | 4.3750 | 2039/11/15 | 320   | 317   | 49,905  |
|      | US TREASURY | 4.6250 | 2040/02/15 | 320   | 325   | 51,156  |
|      | US TREASURY | 1.1250 | 2040/05/15 | 960   | 613   | 96,466  |
|      | US TREASURY | 1.1250 | 2040/08/15 | 1,170 | 739   | 116,312 |
|      | US TREASURY | 3.8750 | 2040/08/15 | 330   | 307   | 48,337  |
|      | US TREASURY | 1.3750 | 2040/11/15 | 1,300 | 849   | 133,635 |
|      | US TREASURY | 4.2500 | 2040/11/15 | 300   | 291   | 45,772  |
|      | US TREASURY | 1.8750 | 2041/02/15 | 1,560 | 1,097 | 172,671 |
|      | US TREASURY | 4.7500 | 2041/02/15 | 320   | 327   | 51,537  |
|      | US TREASURY | 2.2500 | 2041/05/15 | 1,210 | 897   | 141,119 |
|      | US TREASURY | 1.7500 | 2041/08/15 | 1,680 | 1,141 | 179,489 |
|      | US TREASURY | 2.0000 | 2041/11/15 | 1,520 | 1,068 | 168,028 |
|      | US TREASURY | 3.1250 | 2041/11/15 | 300   | 249   | 39,304  |
|      | US TREASURY | 2.3750 | 2042/02/15 | 1,210 | 897   | 141,096 |
|      | US TREASURY | 3.1250 | 2042/02/15 | 330   | 273   | 43,040  |
|      | US TREASURY | 3.0000 | 2042/05/15 | 310   | 251   | 39,540  |
|      | US TREASURY | 3.2500 | 2042/05/15 | 1,070 | 899   | 141,449 |
|      | US TREASURY | 2.7500 | 2042/08/15 | 350   | 272   | 42,821  |
|      | US TREASURY | 3.3750 | 2042/08/15 | 940   | 801   | 126,020 |
|      | US TREASURY | 2.7500 | 2042/11/15 | 550   | 425   | 66,979  |
|      | US TREASURY | 4.0000 | 2042/11/15 | 950   | 877   | 138,090 |
|      | US TREASURY | 3.1250 | 2043/02/15 | 450   | 367   | 57,729  |

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 | 3.8750 | 2043/02/15 | 930   | 843   | 132,731 |
|      | US TREASURY | 2.8750 | 2043/05/15 | 740   | 579   | 91,110  |
|      | US TREASURY | 3.8750 | 2043/05/15 | 950   | 860   | 135,310 |
|      | US TREASURY | 3.6250 | 2043/08/15 | 500   | 435   | 68,510  |
|      | US TREASURY | 4.3750 | 2043/08/15 | 1,020 | 983   | 154,725 |
|      | US TREASURY | 3.7500 | 2043/11/15 | 540   | 477   | 75,108  |
|      | US TREASURY | 4.7500 | 2043/11/15 | 1,010 | 1,019 | 160,394 |
|      | US TREASURY | 3.6250 | 2044/02/15 | 590   | 511   | 80,435  |
|      | US TREASURY | 4.5000 | 2044/02/15 | 1,010 | 986   | 155,237 |
|      | US TREASURY | 3.3750 | 2044/05/15 | 540   | 450   | 70,805  |
|      | US TREASURY | 4.6250 | 2044/05/15 | 1,000 | 991   | 155,979 |
|      | US TREASURY | 3.1250 | 2044/08/15 | 680   | 544   | 85,598  |
|      | US TREASURY | 4.1250 | 2044/08/15 | 1,020 | 945   | 148,735 |
|      | US TREASURY | 3.0000 | 2044/11/15 | 610   | 477   | 75,043  |
|      | US TREASURY | 4.6250 | 2044/11/15 | 1,010 | 999   | 157,174 |
|      | US TREASURY | 2.5000 | 2045/02/15 | 770   | 551   | 86,723  |
|      | US TREASURY | 4.7500 | 2045/02/15 | 1,030 | 1,034 | 162,766 |
|      | US TREASURY | 3.0000 | 2045/05/15 | 380   | 295   | 46,498  |
|      | US TREASURY | 5.0000 | 2045/05/15 | 1,010 | 1,046 | 164,670 |
|      | US TREASURY | 2.8750 | 2045/08/15 | 490   | 372   | 58,523  |
|      | US TREASURY | 4.8750 | 2045/08/15 | 810   | 825   | 129,912 |
|      | US TREASURY | 3.0000 | 2045/11/15 | 300   | 231   | 36,490  |
|      | US TREASURY | 2.5000 | 2046/02/15 | 610   | 430   | 67,645  |
|      | US TREASURY | 2.5000 | 2046/05/15 | 590   | 414   | 65,199  |
|      | US TREASURY | 2.2500 | 2046/08/15 | 790   | 526   | 82,839  |
|      | US TREASURY | 2.8750 | 2046/11/15 | 290   | 216   | 34,126  |
|      | US TREASURY | 3.0000 | 2047/02/15 | 620   | 472   | 74,377  |
|      | US TREASURY | 3.0000 | 2047/05/15 | 480   | 365   | 57,426  |
|      | US TREASURY | 2.7500 | 2047/08/15 | 760   | 550   | 86,544  |
|      | US TREASURY | 2.7500 | 2047/11/15 | 790   | 570   | 89,688  |
|      | US TREASURY | 3.0000 | 2048/02/15 | 890   | 671   | 105,553 |
|      | US TREASURY | 3.1250 | 2048/05/15 | 930   | 715   | 112,588 |
|      | US TREASURY | 3.0000 | 2048/08/15 | 1,060 | 795   | 125,097 |
|      | US TREASURY | 3.3750 | 2048/11/15 | 1,070 | 857   | 134,916 |
|      | US TREASURY | 3.0000 | 2049/02/15 | 1,150 | 858   | 135,103 |
|      | US TREASURY | 2.8750 | 2049/05/15 | 1,100 | 800   | 125,871 |
|      | US TREASURY | 2.2500 | 2049/08/15 | 1,050 | 668   | 105,097 |
|      | US TREASURY | 2.3750 | 2049/11/15 | 950   | 619   | 97,446  |

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         | 2.0000     | 2050/02/15 | 1,220   | 727     | 114,355    |
|             | US TREASURY         | 1.3750     | 2050/08/15 | 1,620   | 811     | 127,641    |
|             | US TREASURY         | 1.6250     | 2050/11/15 | 1,590   | 849     | 133,651    |
|             | US TREASURY         | 1.8750     | 2051/02/15 | 1,800   | 1,023   | 160,969    |
|             | US TREASURY         | 2.3750     | 2051/05/15 | 1,800   | 1,153   | 181,418    |
|             | US TREASURY         | 2.0000     | 2051/08/15 | 1,790   | 1,044   | 164,221    |
|             | US TREASURY         | 1.8750     | 2051/11/15 | 1,660   | 934     | 146,940    |
|             | US TREASURY         | 2.2500     | 2052/02/15 | 1,540   | 950     | 149,555    |
|             | US TREASURY         | 2.8750     | 2052/05/15 | 1,440   | 1,023   | 160,935    |
|             | US TREASURY         | 3.0000     | 2052/08/15 | 1,380   | 1,004   | 158,054    |
|             | US TREASURY         | 4.0000     | 2052/11/15 | 1,380   | 1,216   | 191,342    |
|             | US TREASURY         | 3.6250     | 2053/02/15 | 1,380   | 1,135   | 178,666    |
|             | US TREASURY         | 3.6250     | 2053/05/15 | 1,350   | 1,109   | 174,565    |
|             | US TREASURY         | 4.1250     | 2053/08/15 | 1,510   | 1,358   | 213,681    |
|             | US TREASURY         | 4.7500     | 2053/11/15 | 1,590   | 1,586   | 249,503    |
|             | US TREASURY         | 4.2500     | 2054/02/15 | 1,670   | 1,535   | 241,442    |
|             | US TREASURY         | 4.6250     | 2054/05/15 | 1,640   | 1,604   | 252,381    |
|             | US TREASURY         | 4.2500     | 2054/08/15 | 1,680   | 1,544   | 242,951    |
|             | US TREASURY         | 4.5000     | 2054/11/15 | 1,680   | 1,610   | 253,376    |
|             | US TREASURY         | 4.6250     | 2055/02/15 | 1,680   | 1,644   | 258,671    |
|             | US TREASURY         | 4.7500     | 2055/05/15 | 1,670   | 1,668   | 262,427    |
|             | US TREASURY         | 4.7500     | 2055/08/15 | 1,560   | 1,558   | 245,178    |
|             | US TREASURY         | 6.2500     | 2030/05/15 | 150     | 165     | 26,070     |
|             | US TREASURY         | 0.6250     | 2030/05/15 | 10,200  | 8,916   | 1,402,545  |
| US TREASURY | 4.3750              | 2040/05/15 | 310        | 306     | 48,178  |            |
| US TREASURY | 4.3750              | 2041/05/15 | 300        | 294     | 46,280  |            |
| US TREASURY | 3.7500              | 2041/08/15 | 330        | 299     | 47,098  |            |
| US TREASURY | 1.2500              | 2050/05/15 | 1,450      | 708     | 111,405 |            |
| 小計          |                     | -          | -          | -       | -       | 52,919,633 |
| カナダ         |                     |            |            | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル |            |
| 国債証券        | CANADIAN GOVERNMENT | 3.2500     | 2026/11/01 | 510     | 514     | 57,565     |
|             | CANADIAN GOVERNMENT | 3.0000     | 2027/02/01 | 650     | 654     | 73,281     |
|             | CANADIAN GOVERNMENT | 1.2500     | 2027/03/01 | 400     | 394     | 44,139     |
|             | CANADIAN GOVERNMENT | 2.7500     | 2027/05/01 | 690     | 693     | 77,591     |
|             | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0000     | 2027/06/01 | 230     | 225     | 25,191     |
|             | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5000     | 2027/08/01 | 710     | 710     | 79,517     |
|             | CANADIAN GOVERNMENT | 2.7500     | 2027/09/01 | 390     | 391     | 43,858     |
|             | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5000     | 2027/11/01 | 460     | 460     | 51,504     |

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   | 3.5000 | 2028/03/01 | 370         | 377         | 42,305    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.0000 | 2028/06/01 | 160         | 157         | 17,679    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 3.2500 | 2028/09/01 | 500         | 508         | 56,982    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 4.0000 | 2029/03/01 | 650         | 677         | 75,843    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.2500 | 2029/06/01 | 140         | 138         | 15,455    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 5.7500 | 2029/06/01 | 190         | 209         | 23,450    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 3.5000 | 2029/09/01 | 720         | 740         | 82,874    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.2500 | 2029/12/01 | 130         | 127         | 14,294    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.7500 | 2030/03/01 | 790         | 789         | 88,364    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 1.2500 | 2030/06/01 | 790         | 738         | 82,659    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.7500 | 2030/09/01 | 1,000       | 996         | 111,574   |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 0.5000 | 2030/12/01 | 670         | 596         | 66,785    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.7500 | 2031/03/01 | 110         | 109         | 12,237    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 1.5000 | 2031/06/01 | 890         | 826         | 92,492    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 1.5000 | 2031/12/01 | 740         | 680         | 76,179    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.0000 | 2032/06/01 | 590         | 554         | 62,091    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.5000 | 2032/12/01 | 500         | 482         | 53,998    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.7500 | 2033/06/01 | 470         | 458         | 51,367    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 5.7500 | 2033/06/01 | 190         | 223         | 24,995    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 3.2500 | 2033/12/01 | 510         | 513         | 57,530    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 3.5000 | 2034/03/01 | 150         | 153         | 17,205    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 3.0000 | 2034/06/01 | 820         | 809         | 90,588    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 3.2500 | 2034/12/01 | 730         | 731         | 81,949    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 3.2500 | 2035/06/01 | 930         | 929         | 104,082   |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 3.2500 | 2035/12/01 | 630         | 627         | 70,242    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 5.0000 | 2037/06/01 | 140         | 161         | 18,105    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 4.0000 | 2041/06/01 | 190         | 201         | 22,505    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 3.5000 | 2045/12/01 | 250         | 246         | 27,603    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.7500 | 2048/12/01 | 250         | 214         | 24,060    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.0000 | 2051/12/01 | 980         | 702         | 78,599    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 1.7500 | 2053/12/01 | 740         | 488         | 54,693    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.7500 | 2055/12/01 | 690         | 571         | 63,946    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 3.5000 | 2057/12/01 | 480         | 461         | 51,650    |
|         | CANADIAN GOVERNMENT   | 2.7500 | 2064/12/01 | 150         | 120         | 13,500    |
| 小計      |                       | -      | -          | -           | -           | 2,280,545 |
| 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 | 4.7500 | 2027/04/21 | 600         | 609         | 62,127    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2027/11/21 | 530         | 520         | 53,113    |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名     | 利率                    | 償還年月日  | 額面金額       | 評価額         |             |           |
|---------|-----------------------|--------|------------|-------------|-------------|-----------|
|         |                       |        |            | 千円          | 千円          |           |
| オーストラリア |                       |        | %          | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円        |
| 国債証券    | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.2500 | 2028/05/21 | 550         | 531         | 54,171    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2028/11/21 | 560         | 544         | 55,548    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.2500 | 2029/04/21 | 620         | 610         | 62,197    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2029/11/21 | 670         | 644         | 65,676    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.5000 | 2030/05/21 | 650         | 614         | 62,615    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.0000 | 2030/12/21 | 600         | 520         | 53,048    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2031/06/21 | 700         | 614         | 62,628    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.0000 | 2031/11/21 | 820         | 688         | 70,250    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2032/05/21 | 800         | 671         | 68,460    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2032/11/21 | 700         | 598         | 61,040    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5000 | 2033/04/21 | 610         | 622         | 63,458    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2033/11/21 | 640         | 585         | 59,748    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.7500 | 2034/05/21 | 610         | 586         | 59,783    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.2500 | 2034/06/21 | 240         | 239         | 24,378    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.5000 | 2034/12/21 | 700         | 655         | 66,825    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2035/06/21 | 720         | 627         | 64,021    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.2500 | 2035/12/21 | 490         | 483         | 49,293    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.2500 | 2036/03/21 | 500         | 492         | 50,208    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.2500 | 2036/10/21 | 400         | 392         | 40,007    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.7500 | 2037/04/21 | 470         | 438         | 44,698    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.2500 | 2039/06/21 | 250         | 215         | 21,952    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2041/05/21 | 380         | 297         | 30,334    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2047/03/21 | 340         | 252         | 25,787    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2051/06/21 | 500         | 263         | 26,850    |
|         | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.7500 | 2054/06/21 | 250         | 238         | 24,329    |
| 小計      |                       |        | -          | -           | -           | 1,382,558 |
| 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  | 1.2500 | 2026/11/01 | 210         | 210         | 25,278    |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT  | 3.5000 | 2027/03/01 | 300         | 308         | 37,154    |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2.8750 | 2027/09/01 | 160         | 164         | 19,817    |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2.6250 | 2028/05/01 | 160         | 165         | 19,889    |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2.8750 | 2028/08/01 | 100         | 104         | 12,545    |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT  | 3.0000 | 2029/04/01 | 140         | 147         | 17,739    |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2.8750 | 2029/07/01 | 220         | 231         | 27,824    |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2.5000 | 2030/04/01 | 70          | 72          | 8,784     |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2.8750 | 2030/09/01 | 250         | 265         | 31,901    |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT  | 1.6250 | 2031/07/01 | 140         | 139         | 16,828    |
|         | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2.6250 | 2032/08/01 | 140         | 147         | 17,793    |

## 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 | 220          | 244          | 29,465  |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 3.3750 | 2034/05/01 | 80           | 89           | 10,788  |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2.7500 | 2035/03/01 | 70           | 75           | 9,073   |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2.2500 | 2036/08/01 | 210          | 216          | 26,047  |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2.3750 | 2039/07/01 | 140          | 146          | 17,633  |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2.2500 | 2040/07/01 | 40           | 41           | 4,998   |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2.7500 | 2042/04/01 | 160          | 177          | 21,308  |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2.7500 | 2046/03/01 | 200          | 226          | 27,317  |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 1.8750 | 2050/03/01 | 160          | 157          | 18,968  |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 1.8750 | 2051/10/01 | 150          | 148          | 17,837  |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 3.2500 | 2054/06/01 | 110          | 139          | 16,749  |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 3.0000 | 2072/08/01 | 160          | 198          | 23,850  |
| 小計       |                        | -      | -          | -            | -            | 459,596 |
| 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 | 4.5000 | 2027/04/15 | 220          | 225          | 19,909  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 0.2500 | 2028/05/15 | 420          | 393          | 34,735  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 3.0000 | 2029/04/20 | 360          | 359          | 31,682  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4.5000 | 2030/05/15 | 410          | 430          | 37,978  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 1.5000 | 2031/05/15 | 410          | 369          | 32,561  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 2.0000 | 2032/05/15 | 350          | 315          | 27,860  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 3.5000 | 2033/04/14 | 380          | 371          | 32,786  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4.2500 | 2034/05/15 | 250          | 254          | 22,478  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4.5000 | 2035/05/15 | 310          | 319          | 28,204  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4.2500 | 2036/05/15 | 210          | 210          | 18,577  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 2.7500 | 2037/04/15 | 190          | 162          | 14,377  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 1.7500 | 2041/05/15 | 160          | 108          | 9,574   |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 2.7500 | 2051/05/15 | 170          | 115          | 10,170  |
|          | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 5.0000 | 2054/05/15 | 120          | 120          | 10,607  |
|          | 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            | 4.1250 | 2027/01/29 | 800          | 802          | 164,845 |
|          | UK TREASURY            | 3.7500 | 2027/03/07 | 890          | 889          | 182,627 |
|          | UK TREASURY            | 1.2500 | 2027/07/22 | 450          | 432          | 88,790  |
|          | UK TREASURY            | 4.2500 | 2027/12/07 | 400          | 404          | 83,050  |
|          | UK TREASURY            | 0.1250 | 2028/01/31 | 650          | 602          | 123,737 |
|          | UK TREASURY            | 4.3750 | 2028/03/07 | 1,150        | 1,163        | 238,916 |
|          | UK TREASURY            | 4.5000 | 2028/06/07 | 860          | 874          | 179,451 |
|          | UK TREASURY            | 1.6250 | 2028/10/22 | 430          | 405          | 83,271  |

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 | 6.0000 | 2028/12/07 | 310   | 329   | 67,734  |
| UK TREASURY | 0.5000 | 2029/01/31 | 730   | 658   | 135,231 |
| UK TREASURY | 4.0000 | 2029/05/22 | 130   | 130   | 26,739  |
| UK TREASURY | 4.1250 | 2029/07/22 | 910   | 916   | 188,091 |
| UK TREASURY | 0.8750 | 2029/10/22 | 430   | 384   | 78,993  |
| UK TREASURY | 4.3750 | 2030/03/07 | 1,080 | 1,095 | 224,974 |
| UK TREASURY | 0.3750 | 2030/10/22 | 470   | 396   | 81,427  |
| UK TREASURY | 4.7500 | 2030/12/07 | 570   | 590   | 121,308 |
| UK TREASURY | 4.1250 | 2031/03/07 | 100   | 100   | 20,548  |
| UK TREASURY | 0.2500 | 2031/07/31 | 720   | 583   | 119,871 |
| UK TREASURY | 4.0000 | 2031/10/22 | 890   | 882   | 181,174 |
| UK TREASURY | 1.0000 | 2032/01/31 | 890   | 737   | 151,505 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2032/06/07 | 610   | 612   | 125,766 |
| UK TREASURY | 3.2500 | 2033/01/31 | 810   | 755   | 155,099 |
| UK TREASURY | 0.8750 | 2033/07/31 | 960   | 742   | 152,386 |
| UK TREASURY | 4.6250 | 2034/01/31 | 780   | 787   | 161,773 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2034/07/31 | 880   | 862   | 177,014 |
| UK TREASURY | 4.5000 | 2034/09/07 | 450   | 449   | 92,307  |
| UK TREASURY | 4.5000 | 2035/03/07 | 1,000 | 992   | 203,745 |
| UK TREASURY | 0.6250 | 2035/07/31 | 620   | 429   | 88,226  |
| UK TREASURY | 4.7500 | 2035/10/22 | 430   | 432   | 88,833  |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2036/03/07 | 550   | 529   | 108,776 |
| UK TREASURY | 1.7500 | 2037/09/07 | 570   | 415   | 85,289  |
| UK TREASURY | 3.7500 | 2038/01/29 | 800   | 716   | 147,052 |
| UK TREASURY | 4.7500 | 2038/12/07 | 420   | 413   | 84,931  |
| UK TREASURY | 1.1250 | 2039/01/31 | 600   | 381   | 78,423  |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2039/09/07 | 330   | 306   | 62,877  |
| UK TREASURY | 4.3750 | 2040/01/31 | 820   | 765   | 157,224 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2040/12/07 | 400   | 365   | 75,086  |
| UK TREASURY | 5.2500 | 2041/01/31 | 210   | 213   | 43,804  |
| UK TREASURY | 1.2500 | 2041/10/22 | 640   | 374   | 76,945  |
| UK TREASURY | 4.5000 | 2042/12/07 | 490   | 452   | 92,834  |
| UK TREASURY | 4.7500 | 2043/10/22 | 850   | 799   | 164,154 |
| UK TREASURY | 3.2500 | 2044/01/22 | 550   | 420   | 86,252  |
| UK TREASURY | 3.5000 | 2045/01/22 | 530   | 415   | 85,338  |
| UK TREASURY | 0.8750 | 2046/01/31 | 440   | 200   | 41,170  |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2046/12/07 | 450   | 388   | 79,717  |
| UK TREASURY | 1.5000 | 2047/07/22 | 480   | 244   | 50,194  |

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  |                    | %      |            | 千イギリス・ポンド   | 千イギリス・ポンド   | 千円      |
| 国債証券  | UK TREASURY        | 1.7500 | 2049/01/22 | 310         | 162         | 33,323  |
|       | UK TREASURY        | 4.2500 | 2049/12/07 | 330         | 280         | 57,508  |
|       | UK TREASURY        | 0.6250 | 2050/10/22 | 500         | 178         | 36,651  |
|       | UK TREASURY        | 1.2500 | 2051/07/31 | 660         | 280         | 57,646  |
|       | UK TREASURY        | 3.7500 | 2052/07/22 | 350         | 268         | 55,034  |
|       | UK TREASURY        | 1.5000 | 2053/07/31 | 720         | 317         | 65,145  |
|       | UK TREASURY        | 3.7500 | 2053/10/22 | 680         | 514         | 105,685 |
|       | UK TREASURY        | 4.3750 | 2054/07/31 | 770         | 650         | 133,584 |
|       | UK TREASURY        | 1.6250 | 2054/10/22 | 360         | 162         | 33,268  |
|       | UK TREASURY        | 4.2500 | 2055/12/07 | 450         | 371         | 76,322  |
|       | UK TREASURY        | 5.3750 | 2056/01/31 | 130         | 128         | 26,446  |
|       | UK TREASURY        | 1.7500 | 2057/07/22 | 560         | 252         | 51,786  |
|       | UK TREASURY        | 4.0000 | 2060/01/22 | 340         | 266         | 54,615  |
|       | UK TREASURY        | 0.5000 | 2061/10/22 | 630         | 157         | 32,373  |
|       | UK TREASURY        | 4.0000 | 2063/10/22 | 450         | 347         | 71,398  |
|       | UK TREASURY        | 2.5000 | 2065/07/22 | 390         | 207         | 42,628  |
|       | UK TREASURY        | 3.5000 | 2068/07/22 | 410         | 283         | 58,177  |
|       | UK TREASURY        | 1.6250 | 2071/10/22 | 500         | 192         | 39,584  |
|       | UK TREASURY        | 1.1250 | 2073/10/22 | 270         | 82          | 16,951  |
|       | 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  | 2.0000 | 2027/03/31 | 680         | 673         | 32,396  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 3.7500 | 2027/09/30 | 900         | 904         | 43,546  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 2.2500 | 2028/09/28 | 970         | 934         | 44,968  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 3.7500 | 2029/02/28 | 840         | 862         | 41,534  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 4.6000 | 2029/08/31 | 470         | 488         | 23,522  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 1.0000 | 2030/03/31 | 930         | 835         | 40,196  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 1.3000 | 2032/04/30 | 1,000       | 866         | 41,693  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 4.0000 | 2035/03/30 | 870         | 898         | 43,259  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 1.5000 | 2037/05/31 | 970         | 755         | 36,382  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 5.5000 | 2042/01/31 | 750         | 902         | 43,457  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 3.7500 | 2047/03/31 | 650         | 616         | 29,696  |
|       | ISRAEL FIXED BOND  | 2.8000 | 2052/11/29 | 670         | 518         | 24,960  |
|       | 小計                 |        | -          | -           | -           | -       |
| 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  | DENMARK GOVT BOND  | 2.2500 | 2035/11/15 | 720         | 700         | 17,000  |
|       | KINGDOM OF DENMARK | 2.2500 | 2026/11/15 | 680         | 684         | 16,609  |
|       | KINGDOM OF DENMARK | 0.5000 | 2027/11/15 | 1,450       | 1,416       | 34,382  |

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  |
| <b>デンマーク</b>  |                         | %      |            | 千デンマーク・クローネ  | 千デンマーク・クローネ  | 千円      |
| 国債証券          | KINGDOM OF DENMARK      | 0.5000 | 2029/11/15 | 1,150        | 1,085        | 26,351  |
|               | KINGDOM OF DENMARK      | 0.0000 | 2031/11/15 | 1,060        | 930          | 22,596  |
|               | KINGDOM OF DENMARK      | 2.2500 | 2033/11/15 | 1,690        | 1,672        | 40,598  |
|               | KINGDOM OF DENMARK      | 4.5000 | 2039/11/15 | 2,400        | 2,877        | 69,874  |
|               | KINGDOM OF DENMARK      | 0.2500 | 2052/11/15 | 1,780        | 893          | 21,687  |
| 小計            |                         | -      | -          | -            | -            | 249,101 |
| <b>ノルウェー</b>  |                         |        |            | 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 | 2027/02/17 | 1,400        | 1,363        | 21,084  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT    | 2.0000 | 2028/04/26 | 1,200        | 1,149        | 17,768  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT    | 1.7500 | 2029/09/06 | 1,270        | 1,175        | 18,171  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT    | 1.3750 | 2030/08/19 | 1,550        | 1,381        | 21,356  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT    | 1.2500 | 2031/09/17 | 1,160        | 998          | 15,444  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT    | 2.1250 | 2032/05/18 | 1,250        | 1,118        | 17,289  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT    | 3.0000 | 2033/08/15 | 1,440        | 1,342        | 20,759  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT    | 3.6250 | 2034/04/13 | 1,260        | 1,221        | 18,880  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT    | 3.7500 | 2035/06/12 | 1,340        | 1,303        | 20,157  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT    | 3.6250 | 2039/05/31 | 670          | 637          | 9,850   |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT    | 3.5000 | 2042/10/06 | 520          | 484          | 7,492   |
| 小計            |                         | -      | -          | -            | -            | 188,254 |
| <b>スウェーデン</b> |                         |        |            | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ |         |
| 国債証券          | SWEDISH GOVERNMENT      | 1.0000 | 2026/11/12 | 2,280        | 2,259        | 37,218  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT      | 0.7500 | 2028/05/12 | 1,950        | 1,892        | 31,175  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT      | 0.7500 | 2029/11/12 | 2,200        | 2,084        | 34,332  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT      | 0.1250 | 2031/05/12 | 1,430        | 1,272        | 20,950  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT      | 2.2500 | 2032/06/01 | 1,270        | 1,259        | 20,741  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT      | 1.7500 | 2033/11/11 | 1,490        | 1,409        | 23,219  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT      | 2.2500 | 2035/05/11 | 1,880        | 1,818        | 29,950  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT      | 3.5000 | 2039/03/30 | 1,110        | 1,195        | 19,689  |
|               | 小計                      |        | -          | -            | -            | -       |
| <b>メキシコ</b>   |                         |        |            | 千メキシコ・ペソ     | 千メキシコ・ペソ     |         |
| 国債証券          | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.5000 | 2027/03/04 | 7,720        | 7,533        | 64,608  |
|               | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5000 | 2027/06/03 | 8,420        | 8,417        | 72,188  |
|               | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2028/03/02 | 5,200        | 5,280        | 45,286  |
|               | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2029/03/01 | 10,850       | 11,004       | 94,367  |
|               | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2029/05/31 | 9,840        | 9,973        | 85,527  |
|               | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2030/02/28 | 6,800        | 6,855        | 58,792  |
|               | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500 | 2031/05/29 | 12,280       | 11,920       | 102,228 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名  |                         | 利率      | 償還年月日      | 額面金額     | 評価額      |         |
|------|-------------------------|---------|------------|----------|----------|---------|
|      |                         |         |            |          | 千メキシコ・ペソ | 千円      |
| メキシコ |                         | %       |            | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円      |
| 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5000  | 2033/05/26 | 7,750    | 7,274    | 62,381  |
|      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500  | 2034/11/23 | 10,620   | 9,978    | 85,572  |
|      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000  | 2035/05/24 | 800      | 754      | 6,473   |
|      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000  | 2036/02/21 | 2,700    | 2,540    | 21,785  |
|      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0000 | 2036/11/20 | 2,350    | 2,530    | 21,704  |
|      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000  | 2038/11/18 | 5,410    | 5,161    | 44,263  |
|      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500  | 2042/11/13 | 10,670   | 9,228    | 79,140  |
|      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000  | 2047/11/07 | 6,340    | 5,548    | 47,583  |
|      | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000  | 2053/07/31 | 10,450   | 9,094    | 77,994  |
| 小計   |                         | -       | -          | -        | -        | 969,898 |
| 中国   |                         |         |            | 千人民元     | 千人民元     |         |
| 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.3900  | 2026/11/15 | 12,500   | 12,627   | 278,896 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 1.0600  | 2026/12/15 | 6,000    | 5,981    | 132,116 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.3700  | 2027/01/20 | 3,200    | 3,237    | 71,509  |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.0400  | 2027/02/25 | 16,000   | 16,137   | 356,407 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.4800  | 2027/04/15 | 6,700    | 6,803    | 150,260 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 1.8500  | 2027/05/15 | 10,000   | 10,073   | 222,476 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 1.3800  | 2027/06/15 | 17,500   | 17,509   | 386,724 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.5000  | 2027/07/25 | 9,800    | 9,967    | 220,150 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 1.6200  | 2027/08/15 | 9,000    | 9,034    | 199,533 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.4400  | 2027/10/15 | 10,300   | 10,495   | 231,810 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 1.4200  | 2027/11/15 | 4,000    | 4,004    | 88,445  |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 3.2800  | 2027/12/03 | 7,700    | 8,020    | 177,133 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.6400  | 2028/01/15 | 6,400    | 6,570    | 145,114 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 1.4500  | 2028/02/25 | 16,000   | 16,028   | 354,018 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.6200  | 2028/04/15 | 10,200   | 10,495   | 231,798 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 3.0100  | 2028/05/13 | 9,420    | 9,800    | 216,457 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 1.4600  | 2028/05/25 | 9,000    | 9,020    | 199,234 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.4000  | 2028/07/15 | 11,300   | 11,593   | 256,048 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 1.4200  | 2028/08/15 | 3,000    | 2,999    | 66,249  |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.9100  | 2028/10/14 | 7,400    | 7,720    | 170,506 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.5500  | 2028/10/15 | 11,400   | 11,769   | 259,945 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.3700  | 2029/01/15 | 15,500   | 15,936   | 351,966 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.8000  | 2029/03/24 | 4,600    | 4,801    | 106,037 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.0500  | 2029/04/15 | 10,000   | 10,185   | 224,956 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 3.2900  | 2029/05/23 | 3,000    | 3,202    | 70,739  |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 2.7500  | 2029/06/15 | 4,500    | 4,700    | 103,819 |
|      | CHINA GOVERNMENT BOND   | 1.9100  | 2029/07/15 | 10,200   | 10,341   | 228,401 |

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<br>千円 |
| 中国                    | %      |            | 千人民元   | 千人民元   | 千円           |
| 国債証券                  |        |            |        |        |              |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6200 | 2029/09/25 | 5,300  | 5,518  | 121,886      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.7400 | 2029/10/15 | 5,000  | 5,039  | 111,308      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.1300 | 2029/11/21 | 5,200  | 5,549  | 122,556      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7900 | 2029/12/15 | 6,900  | 7,248  | 160,099      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.4300 | 2030/01/25 | 13,500 | 13,437 | 296,789      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8000 | 2030/03/25 | 8,400  | 8,856  | 195,603      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6800 | 2030/05/21 | 6,500  | 6,815  | 150,520      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6200 | 2030/06/25 | 7,400  | 7,749  | 171,148      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.5500 | 2030/07/25 | 5,000  | 5,000  | 110,440      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6000 | 2030/09/15 | 12,300 | 12,892 | 284,737      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.2700 | 2030/11/19 | 1,500  | 1,634  | 36,090       |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.5400 | 2030/12/25 | 13,800 | 14,441 | 318,959      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.2800 | 2031/03/25 | 9,000  | 9,303  | 205,484      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.0200 | 2031/05/27 | 7,000  | 7,552  | 166,810      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.1200 | 2031/06/25 | 7,600  | 7,795  | 172,174      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.8700 | 2031/09/15 | 7,000  | 7,085  | 156,497      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8900 | 2031/11/18 | 4,140  | 4,446  | 98,195       |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.4900 | 2031/12/25 | 6,000  | 5,939  | 131,182      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2032/02/17 | 5,000  | 5,323  | 117,584      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.7900 | 2032/03/25 | 14,000 | 14,101 | 311,451      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7600 | 2032/05/15 | 4,600  | 4,911  | 108,483      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6900 | 2032/08/15 | 5,400  | 5,737  | 126,723      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6000 | 2032/09/01 | 5,000  | 5,296  | 116,985      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.7800 | 2032/09/15 | 6,500  | 6,533  | 144,309      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8000 | 2032/11/15 | 5,700  | 6,120  | 135,187      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8800 | 2033/02/25 | 4,100  | 4,440  | 98,084       |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6700 | 2033/05/25 | 7,100  | 7,574  | 167,294      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.5200 | 2033/08/25 | 6,400  | 6,767  | 149,476      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6700 | 2033/11/25 | 8,400  | 8,988  | 198,512      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.3500 | 2034/02/25 | 10,600 | 11,078 | 244,676      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.2700 | 2034/05/25 | 12,400 | 12,892 | 284,755      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.1100 | 2034/08/25 | 7,900  | 8,110  | 179,136      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 2.0400 | 2034/11/25 | 5,100  | 5,209  | 115,060      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.6100 | 2035/02/15 | 13,600 | 13,407 | 296,113      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.6500 | 2035/05/15 | 3,500  | 3,460  | 76,427       |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.6700 | 2035/05/25 | 11,500 | 11,423 | 252,299      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 1.8300 | 2035/08/25 | 6,500  | 6,518  | 143,969      |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 4.0800 | 2048/10/22 | 4,600  | 6,216  | 137,291      |

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         |
| <b>中国</b>             | %      |            | 千人民元         | 千人民元         | 千円         |
| <b>国債証券</b>           |        |            |              |              |            |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.8600 | 2049/07/22 | 5,200        | 6,830        | 150,849    |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.3900 | 2050/03/16 | 4,500        | 5,539        | 122,341    |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.8100 | 2050/09/14 | 1,600        | 2,101        | 46,413     |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.7200 | 2051/04/12 | 1,260        | 1,653        | 36,516     |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.5300 | 2051/10/18 | 3,650        | 4,657        | 102,873    |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.3200 | 2052/04/15 | 5,400        | 6,659        | 147,082    |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.1200 | 2052/10/25 | 5,800        | 6,930        | 153,060    |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.1900 | 2053/04/15 | 7,400        | 8,960        | 197,913    |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2053/10/15 | 9,600        | 11,319       | 250,001    |
| 小計                    | -      | -          | -            | -            | 13,122,124 |
| <b>マレーシア</b>          |        |            | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット |            |
| <b>国債証券</b>           |        |            |              |              |            |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.9000 | 2026/11/30 | 470          | 474          | 17,956     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.8920 | 2027/03/15 | 610          | 617          | 23,358     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.8990 | 2027/11/16 | 590          | 601          | 22,730     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.5190 | 2028/04/20 | 600          | 606          | 22,938     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.7330 | 2028/06/15 | 550          | 559          | 21,139     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.5040 | 2029/04/30 | 230          | 240          | 9,076      |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.8850 | 2029/08/15 | 720          | 738          | 27,920     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.4980 | 2030/04/15 | 610          | 641          | 24,250     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.3360 | 2030/05/15 | 290          | 291          | 11,018     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 2.6320 | 2031/04/15 | 810          | 782          | 29,564     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.2320 | 2031/06/30 | 380          | 396          | 14,994     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.5820 | 2032/07/15 | 540          | 544          | 20,576     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.8440 | 2033/04/15 | 410          | 419          | 15,873     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.6420 | 2033/11/07 | 570          | 615          | 23,264     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.8280 | 2034/07/05 | 750          | 767          | 29,006     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.2540 | 2035/05/31 | 400          | 423          | 16,024     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.4760 | 2035/07/02 | 110          | 110          | 4,169      |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.7620 | 2037/04/07 | 640          | 707          | 26,746     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.8930 | 2038/06/08 | 550          | 615          | 23,251     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.0540 | 2039/04/18 | 670          | 693          | 26,229     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 3.7570 | 2040/05/22 | 590          | 591          | 22,368     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.6960 | 2042/10/15 | 610          | 676          | 25,590     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.9350 | 2043/09/30 | 190          | 216          | 8,192      |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.1800 | 2044/05/16 | 500          | 521          | 19,722     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.7360 | 2046/03/15 | 270          | 300          | 11,366     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.9210 | 2048/07/06 | 410          | 471          | 17,807     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.0650 | 2050/06/15 | 730          | 743          | 28,104     |
| MALAYSIA GOVERNMENT   | 4.4570 | 2053/03/31 | 610          | 658          | 24,907     |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名    |                         | 利率     | 償還年月日      | 額面金額  |       | 評価額     |         |
|--------|-------------------------|--------|------------|-------|-------|---------|---------|
|        |                         |        |            |       |       | 千円      | 邦貨換算金額  |
| マレーシア  |                         | %      |            | 千円    | 千円    | 千円      | 千円      |
| 国債証券   | MALAYSIA GOVERNMENT     | 3.9170 | 2055/07/15 | 240   | 237   | 8,993   |         |
|        | MALAYSIAN GOVERNMENT    | 3.5020 | 2027/05/31 | 340   | 343   | 12,967  |         |
| 小計     |                         | -      | -          | -     | -     | 590,110 |         |
| ポーランド  |                         |        |            | 千円    | 千円    |         |         |
| 国債証券   | POLAND GOVERNMENT BOND  | 3.7500 | 2027/05/25 | 1,140 | 1,138 | 48,805  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 2.5000 | 2027/07/25 | 1,190 | 1,163 | 49,879  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 2.7500 | 2028/04/25 | 1,160 | 1,124 | 48,228  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 7.5000 | 2028/07/25 | 1,290 | 1,395 | 59,860  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 5.7500 | 2029/04/25 | 1,380 | 1,436 | 61,606  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 4.7500 | 2029/07/25 | 1,370 | 1,381 | 59,248  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 2.7500 | 2029/10/25 | 1,420 | 1,331 | 57,099  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 5.0000 | 2030/01/25 | 1,240 | 1,257 | 53,940  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 4.5000 | 2030/07/25 | 1,620 | 1,605 | 68,869  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 1.2500 | 2030/10/25 | 1,340 | 1,140 | 48,896  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 1.7500 | 2032/04/25 | 1,440 | 1,191 | 51,084  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 6.0000 | 2033/10/25 | 1,460 | 1,543 | 66,189  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 5.0000 | 2034/10/25 | 1,340 | 1,318 | 56,530  |         |
|        | POLAND GOVERNMENT BOND  | 5.0000 | 2035/10/25 | 540   | 528   | 22,648  |         |
|        | 小計                      |        | -          | -     | -     | -       | 752,885 |
| ユーロ    |                         |        |            | 千円    | 千円    |         |         |
| アイルランド |                         |        |            |       |       |         |         |
| 国債証券   | IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.2000 | 2027/05/15 | 190   | 185   | 33,563  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.9000 | 2028/05/15 | 210   | 204   | 37,010  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.1000 | 2029/05/15 | 250   | 240   | 43,628  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 2.4000 | 2030/05/15 | 240   | 240   | 43,580  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.2000 | 2030/10/18 | 180   | 161   | 29,324  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.3500 | 2031/03/18 | 170   | 160   | 29,184  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2031/10/18 | 220   | 189   | 34,374  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.3000 | 2033/05/15 | 130   | 117   | 21,317  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 2.6000 | 2034/10/18 | 190   | 185   | 33,610  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.4000 | 2035/05/15 | 140   | 110   | 20,010  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.7000 | 2037/05/15 | 210   | 181   | 32,921  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.5500 | 2041/04/22 | 120   | 79    | 14,485  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2043/10/18 | 90    | 85    | 15,479  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 2.0000 | 2045/02/18 | 280   | 223   | 40,585  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.5000 | 2050/05/15 | 210   | 140   | 25,446  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 3.1500 | 2055/10/18 | 90    | 81    | 14,763  |         |
|        | IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.3500 | 2032/10/18 | 120   | 102   | 18,600  |         |
|        | 小計                      |        | -          | -     | -     | -       | 487,888 |

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 | 370  | 361  | 65,631    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.7500 | 2027/07/15 | 430  | 421  | 76,411    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5000 | 2028/01/15 | 300  | 321  | 58,307    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.7500 | 2028/07/15 | 480  | 463  | 84,036    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2029/01/15 | 390  | 364  | 66,077    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.2500 | 2029/07/15 | 350  | 325  | 59,092    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5000 | 2030/01/15 | 360  | 362  | 65,762    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2030/07/15 | 400  | 358  | 65,064    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2031/07/15 | 410  | 356  | 64,736    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5000 | 2032/07/15 | 390  | 340  | 61,827    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5000 | 2033/01/15 | 360  | 357  | 64,797    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5000 | 2033/07/15 | 300  | 296  | 53,736    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5000 | 2034/07/15 | 330  | 323  | 58,608    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5000 | 2035/07/15 | 280  | 271  | 49,261    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0000 | 2037/01/15 | 480  | 526  | 95,478    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2038/01/15 | 340  | 234  | 42,487    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5000 | 2040/01/15 | 380  | 265  | 48,134    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.7500 | 2042/01/15 | 440  | 467  | 84,843    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.2500 | 2044/01/15 | 280  | 278  | 50,474    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.7500 | 2047/01/15 | 540  | 491  | 89,155    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2052/01/15 | 470  | 195  | 35,482    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0000 | 2054/01/15 | 440  | 325  | 59,046    |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.5000 | 2056/01/15 | 120  | 120  | 21,832    |
| 小計   |                        | -      | -          | -    | -    | 1,420,286 |
| ベルギー |                        |        |            |      |      |           |
| 国債証券 | BELGIUM KINGDOM        | 0.8000 | 2027/06/22 | 400  | 392  | 71,144    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 0.0000 | 2027/10/22 | 280  | 269  | 48,813    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 5.5000 | 2028/03/28 | 470  | 505  | 91,662    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 0.8000 | 2028/06/22 | 450  | 434  | 78,787    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 0.9000 | 2029/06/22 | 490  | 465  | 84,435    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 2.7000 | 2029/10/22 | 240  | 242  | 43,962    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 0.1000 | 2030/06/22 | 410  | 367  | 66,627    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 2.6000 | 2030/10/22 | 200  | 200  | 36,270    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 1.0000 | 2031/06/22 | 420  | 383  | 69,603    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 0.0000 | 2031/10/22 | 330  | 281  | 51,037    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 4.0000 | 2032/03/28 | 230  | 245  | 44,609    |
|      | BELGIUM KINGDOM        | 0.3500 | 2032/06/22 | 420  | 357  | 64,914    |

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  | 1.2500 | 2033/04/22 | 300   | 267   | 48,498    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 3.0000 | 2033/06/22 | 510   | 511   | 92,730    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 3.0000 | 2034/06/22 | 300   | 298   | 54,056    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 2.8500 | 2034/10/22 | 460   | 449   | 81,507    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 5.0000 | 2035/03/28 | 510   | 583   | 105,866   |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 3.1000 | 2035/06/22 | 280   | 276   | 50,171    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 1.4500 | 2037/06/22 | 190   | 154   | 27,949    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 1.9000 | 2038/06/22 | 250   | 208   | 37,874    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 2.7500 | 2039/04/22 | 240   | 219   | 39,746    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 0.4000 | 2040/06/22 | 260   | 164   | 29,820    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 4.2500 | 2041/03/28 | 420   | 446   | 80,909    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 3.4500 | 2042/06/22 | 120   | 114   | 20,779    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 3.4500 | 2043/06/22 | 140   | 132   | 24,069    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 3.7500 | 2045/06/22 | 230   | 224   | 40,758    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 1.6000 | 2047/06/22 | 270   | 177   | 32,110    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 1.7000 | 2050/06/22 | 270   | 170   | 30,962    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 1.4000 | 2053/06/22 | 260   | 143   | 25,948    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 3.3000 | 2054/06/22 | 250   | 213   | 38,652    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 3.5000 | 2055/06/22 | 240   | 210   | 38,239    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 2.2500 | 2057/06/22 | 210   | 137   | 24,848    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 2.1500 | 2066/06/22 | 220   | 130   | 23,588    |
|      | BELGIUM KINGDOM  | 0.6500 | 2071/06/22 | 160   | 47    | 8,647     |
| 小計   |                  | -      | -          | -     | -     | 1,709,604 |
| フランス |                  |        |            |       |       |           |
| 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 0.2500 | 2026/11/25 | 880   | 864   | 156,678   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2027/02/25 | 1,140 | 1,110 | 201,381   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 1.0000 | 2027/05/25 | 1,050 | 1,032 | 187,314   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 2.5000 | 2027/09/24 | 1,090 | 1,096 | 198,816   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 2.7500 | 2027/10/25 | 1,480 | 1,495 | 271,246   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2028/02/25 | 1,280 | 1,238 | 224,550   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2028/05/25 | 1,630 | 1,569 | 284,626   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 2.4000 | 2028/09/24 | 890   | 891   | 161,578   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2028/11/25 | 1,500 | 1,429 | 259,293   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 2.7500 | 2029/02/25 | 1,390 | 1,403 | 254,588   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 5.5000 | 2029/04/25 | 1,080 | 1,186 | 215,185   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2029/05/25 | 1,400 | 1,308 | 237,287   |
|      | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2029/11/25 | 1,220 | 1,103 | 200,102   |

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) | 2.7500 | 2030/02/25 | 1,380 | 1,388 | 251,788 |
| FRANCE (GOVT OF) | 2.5000 | 2030/05/25 | 1,690 | 1,681 | 304,944 |
| FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2030/11/25 | 1,400 | 1,224 | 222,047 |
| FRANCE (GOVT OF) | 2.7000 | 2031/02/25 | 860   | 857   | 155,451 |
| FRANCE (GOVT OF) | 1.5000 | 2031/05/25 | 1,580 | 1,477 | 267,873 |
| FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2031/11/25 | 1,410 | 1,188 | 215,564 |
| FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2032/05/25 | 1,160 | 959   | 173,908 |
| FRANCE (GOVT OF) | 5.7500 | 2032/10/25 | 860   | 1,005 | 182,350 |
| FRANCE (GOVT OF) | 2.0000 | 2032/11/25 | 1,350 | 1,262 | 228,911 |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.0000 | 2033/05/25 | 1,100 | 1,091 | 197,854 |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.5000 | 2033/11/25 | 1,280 | 1,307 | 237,089 |
| FRANCE (GOVT OF) | 1.2500 | 2034/05/25 | 1,560 | 1,328 | 240,926 |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.0000 | 2034/11/25 | 1,030 | 1,003 | 182,062 |
| FRANCE (GOVT OF) | 4.7500 | 2035/04/25 | 880   | 978   | 177,364 |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.2000 | 2035/05/25 | 1,210 | 1,191 | 215,996 |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.5000 | 2035/11/25 | 370   | 371   | 67,313  |
| FRANCE (GOVT OF) | 1.2500 | 2036/05/25 | 1,400 | 1,124 | 203,847 |
| FRANCE (GOVT OF) | 1.2500 | 2038/05/25 | 810   | 612   | 111,076 |
| FRANCE (GOVT OF) | 4.0000 | 2038/10/25 | 680   | 700   | 126,969 |
| FRANCE (GOVT OF) | 1.7500 | 2039/06/25 | 880   | 694   | 125,981 |
| FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2040/05/25 | 840   | 531   | 96,301  |
| FRANCE (GOVT OF) | 4.5000 | 2041/04/25 | 980   | 1,052 | 190,789 |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.6000 | 2042/05/25 | 360   | 344   | 62,526  |
| FRANCE (GOVT OF) | 2.5000 | 2043/05/25 | 630   | 513   | 93,040  |
| FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2044/06/25 | 620   | 338   | 61,337  |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.2500 | 2045/05/25 | 760   | 679   | 123,288 |
| FRANCE (GOVT OF) | 2.0000 | 2048/05/25 | 730   | 502   | 91,098  |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.0000 | 2049/06/25 | 360   | 297   | 53,997  |
| FRANCE (GOVT OF) | 1.5000 | 2050/05/25 | 820   | 483   | 87,605  |
| FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2052/05/25 | 820   | 368   | 66,762  |
| FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2053/05/25 | 810   | 352   | 63,931  |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.0000 | 2054/05/25 | 620   | 486   | 88,302  |
| FRANCE (GOVT OF) | 4.0000 | 2055/04/25 | 570   | 540   | 98,055  |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.2500 | 2055/05/25 | 580   | 475   | 86,275  |
| FRANCE (GOVT OF) | 3.7500 | 2056/05/25 | 480   | 430   | 78,021  |
| FRANCE (GOVT OF) | 4.0000 | 2060/04/25 | 540   | 502   | 91,037  |
| FRANCE (GOVT OF) | 1.7500 | 2066/05/25 | 450   | 227   | 41,175  |

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 | 2072/05/25 | 350  | 89   | 16,229    |
| 小計                       | -      | -          | -    | -    | 8,231,748 |
| ドイツ                      |        |            |      |      |           |
| 国債証券 BUNDESobligation    | 0.0000 | 2027/04/16 | 530  | 515  | 93,517    |
| BUNDESobligation         | 1.3000 | 2027/10/15 | 220  | 217  | 39,414    |
| BUNDESobligation         | 1.3000 | 2027/10/15 | 740  | 731  | 132,566   |
| BUNDESobligation         | 2.2000 | 2028/04/13 | 630  | 632  | 114,746   |
| BUNDESobligation         | 2.4000 | 2028/10/19 | 710  | 716  | 129,933   |
| BUNDESobligation         | 2.1000 | 2029/04/12 | 160  | 159  | 28,990    |
| BUNDESobligation         | 2.1000 | 2029/04/12 | 600  | 599  | 108,695   |
| BUNDESobligation         | 2.5000 | 2029/10/11 | 570  | 576  | 104,555   |
| BUNDESobligation         | 2.4000 | 2030/04/18 | 770  | 775  | 140,539   |
| BUNDESobligation         | 2.2000 | 2030/10/10 | 510  | 507  | 92,085    |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.2500 | 2027/02/15 | 750  | 734  | 133,208   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5000 | 2027/08/15 | 820  | 799  | 144,982   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2027/11/15 | 540  | 519  | 94,211    |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5000 | 2028/02/15 | 680  | 658  | 119,356   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.2500 | 2028/08/15 | 700  | 667  | 121,013   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2028/11/15 | 650  | 611  | 110,966   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.2500 | 2029/02/15 | 710  | 669  | 121,422   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2029/08/15 | 720  | 665  | 120,618   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.1000 | 2029/11/15 | 660  | 657  | 119,263   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.2500 | 2030/01/04 | 270  | 312  | 56,705    |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2030/02/15 | 680  | 620  | 112,477   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2030/08/15 | 270  | 243  | 44,115    |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2030/08/15 | 810  | 729  | 132,314   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.4000 | 2030/11/15 | 680  | 682  | 123,822   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2031/02/15 | 660  | 586  | 106,316   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2031/08/15 | 230  | 201  | 36,547    |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2031/08/15 | 770  | 674  | 122,304   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2032/02/15 | 760  | 655  | 118,916   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.7000 | 2032/08/15 | 670  | 639  | 116,000   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5000 | 2032/11/15 | 270  | 270  | 48,978    |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.3000 | 2033/02/15 | 290  | 286  | 51,915    |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.3000 | 2033/02/15 | 930  | 917  | 166,415   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.6000 | 2033/08/15 | 730  | 732  | 132,824   |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.2000 | 2034/02/15 | 830  | 805  | 146,124   |

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 | 4.7500 | 2034/07/04 | 590   | 687  | 124,628   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.6000 | 2034/08/15 | 840   | 837  | 151,931   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5000 | 2035/02/15 | 140   | 138  | 25,056    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5000 | 2035/02/15 | 850   | 838  | 151,974   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2035/05/15 | 570   | 442  | 80,155    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.6000 | 2035/08/15 | 620   | 614  | 111,394   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2036/05/15 | 650   | 486  | 88,185    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0000 | 2037/01/04 | 670   | 744  | 135,027   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0000 | 2038/05/15 | 760   | 606  | 110,031   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.2500 | 2039/07/04 | 470   | 536  | 97,251    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.7500 | 2040/07/04 | 560   | 673  | 122,118   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.6000 | 2041/05/15 | 410   | 385  | 69,914    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.2500 | 2042/07/04 | 530   | 539  | 97,812    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5000 | 2044/07/04 | 810   | 734  | 133,111   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5000 | 2046/08/15 | 860   | 767  | 139,171   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.2500 | 2048/08/15 | 1,000 | 680  | 123,371   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2050/08/15 | 300   | 134  | 24,473    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2050/08/15 | 1,080 | 483  | 87,704    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2052/08/15 | 840   | 351  | 63,702    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.8000 | 2053/08/15 | 290   | 211  | 38,418    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.8000 | 2053/08/15 | 810   | 589  | 106,914   |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5000 | 2054/08/15 | 630   | 535  | 97,068    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.9000 | 2056/08/15 | 400   | 367  | 66,559    |
|       | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 2.0000 | 2026/12/10 | 280   | 280  | 50,791    |
|       | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 2.2000 | 2027/03/11 | 450   | 451  | 81,834    |
|       | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 1.7000 | 2027/06/10 | 450   | 448  | 81,241    |
|       | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 1.9000 | 2027/09/16 | 450   | 449  | 81,452    |
|       | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 2.0000 | 2027/12/16 | 50    | 49   | 9,064     |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5000 | 2027/07/04 | 300   | 321  | 58,276    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.6250 | 2028/01/04 | 380   | 408  | 74,056    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.7500 | 2028/07/04 | 330   | 352  | 63,961    |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5000 | 2031/01/04 | 520   | 599  | 108,721   |
| 小計    |                          | -      | -          | -     | -    | 6,441,248 |
| ポルトガル |                          |        |            |       |      |           |
| 国債証券  | OBRIGACOES DO TESOURO    | 4.1250 | 2027/04/14 | 60    | 61   | 11,204    |
|       | OBRIGACOES DO TESOURO    | 0.7000 | 2027/10/15 | 340   | 332  | 60,241    |
|       | OBRIGACOES DO TESOURO    | 2.1250 | 2028/10/17 | 390   | 390  | 70,877    |

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  |         |
| <b>ポルトガル</b> |                          |        |            |      |     |         |
| <b>国債証券</b>  | OBRIGACOES DO TESOURO    | 1.9500 | 2029/06/15 | 300  | 297 | 54,034  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 3.8750 | 2030/02/15 | 190  | 202 | 36,651  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 0.4750 | 2030/10/18 | 280  | 255 | 46,360  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 0.3000 | 2031/10/17 | 230  | 201 | 36,624  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 1.6500 | 2032/07/16 | 200  | 187 | 34,042  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 2.8750 | 2033/10/14 | 80   | 80  | 14,526  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 2.2500 | 2034/04/18 | 240  | 228 | 41,427  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 2.8750 | 2034/10/20 | 150  | 149 | 27,021  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 3.0000 | 2035/06/15 | 130  | 129 | 23,485  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 0.9000 | 2035/10/12 | 200  | 163 | 29,632  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 4.1000 | 2037/04/15 | 280  | 304 | 55,157  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 3.5000 | 2038/06/18 | 130  | 132 | 23,957  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 3.3750 | 2040/06/15 | 70   | 69  | 12,529  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 1.1500 | 2042/04/11 | 140  | 98  | 17,834  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 4.1000 | 2045/02/15 | 200  | 212 | 38,445  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 1.0000 | 2052/04/12 | 190  | 102 | 18,596  |
|              | OBRIGACOES DO TESOURO    | 3.6250 | 2054/06/12 | 120  | 114 | 20,744  |
| 小計           |                          | -      | -          | -    | -   | 673,395 |
| <b>スペイン</b>  |                          |        |            |      |     |         |
| <b>国債証券</b>  | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.3000 | 2026/10/31 | 660  | 655 | 118,878 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2027/01/31 | 560  | 546 | 99,130  |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.5000 | 2027/04/30 | 630  | 625 | 113,346 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.5000 | 2027/05/31 | 580  | 583 | 105,844 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8000 | 2027/07/30 | 570  | 558 | 101,228 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4500 | 2027/10/31 | 620  | 612 | 111,122 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2028/01/31 | 680  | 649 | 117,791 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4000 | 2028/04/30 | 680  | 668 | 121,171 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.4000 | 2028/05/31 | 540  | 542 | 98,392  |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4000 | 2028/07/30 | 620  | 607 | 110,098 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.1500 | 2028/10/31 | 590  | 638 | 115,749 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 6.0000 | 2029/01/31 | 640  | 712 | 129,277 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4500 | 2029/04/30 | 580  | 563 | 102,201 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.5000 | 2029/05/31 | 660  | 685 | 124,245 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8000 | 2029/07/30 | 660  | 623 | 113,035 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.6000 | 2029/10/31 | 620  | 578 | 104,883 |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7000 | 2030/01/31 | 430  | 434 | 78,703  |
|              | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5000 | 2030/04/30 | 660  | 605 | 109,864 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名  | 利率                       | 償還年月日  | 額面金額       | 評価額  |     |           |
|------|--------------------------|--------|------------|------|-----|-----------|
|      |                          |        |            | 千ユーロ | 千円  |           |
| ユーロ  | %                        |        | 千ユーロ       | 千ユーロ | 千円  |           |
| スペイン |                          |        |            |      |     |           |
| 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.9500 | 2030/07/30 | 670  | 653 | 118,572   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.2500 | 2030/10/31 | 730  | 686 | 124,456   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.1000 | 2031/04/30 | 680  | 594 | 107,743   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.1000 | 2031/07/30 | 590  | 602 | 109,334   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5000 | 2031/10/31 | 620  | 546 | 99,077    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.7000 | 2032/04/30 | 710  | 624 | 113,252   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.7500 | 2032/07/30 | 630  | 743 | 134,791   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.5500 | 2032/10/31 | 610  | 599 | 108,653   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.0000 | 2033/01/31 | 70   | 70  | 12,784    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.1500 | 2033/04/30 | 620  | 629 | 114,212   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.3500 | 2033/07/30 | 560  | 537 | 97,543    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.5500 | 2033/10/31 | 650  | 675 | 122,572   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.2500 | 2034/04/30 | 590  | 598 | 108,563   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.4500 | 2034/10/31 | 620  | 636 | 115,443   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.1500 | 2035/04/30 | 630  | 629 | 114,152   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.8500 | 2035/07/30 | 580  | 517 | 93,791    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.2000 | 2035/10/31 | 550  | 549 | 99,649    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.2000 | 2037/01/31 | 610  | 658 | 119,477   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8500 | 2037/07/30 | 470  | 355 | 64,457    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.9000 | 2039/07/30 | 460  | 477 | 86,567    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9000 | 2040/07/30 | 500  | 573 | 104,042   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.2000 | 2040/10/31 | 480  | 347 | 62,968    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.5000 | 2041/01/31 | 200  | 196 | 35,570    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7000 | 2041/07/30 | 560  | 629 | 114,192   |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0000 | 2042/07/30 | 410  | 273 | 49,562    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.4500 | 2043/07/30 | 450  | 431 | 78,313    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.1500 | 2044/10/31 | 430  | 510 | 92,578    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.9000 | 2046/10/31 | 490  | 426 | 77,342    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7000 | 2048/10/31 | 540  | 445 | 80,706    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0000 | 2050/10/31 | 580  | 314 | 56,945    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.9000 | 2052/10/31 | 470  | 310 | 56,287    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.0000 | 2054/10/31 | 370  | 366 | 66,509    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.4500 | 2066/07/30 | 390  | 338 | 61,320    |
|      | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4500 | 2071/10/31 | 190  | 87  | 15,863    |
|      | 小計                       | -      | -          | -    | -   | 4,992,269 |
| イタリア |                          |        |            |      |     |           |
| 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.2500 | 2026/12/01 | 490  | 486 | 88,185    |

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 | 0.8500 | 2027/01/15 | 500  | 493  | 89,484  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.9500 | 2027/02/15 | 410  | 414  | 75,103  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5500 | 2027/02/25 | 430  | 432  | 78,379  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.1000 | 2027/04/01 | 410  | 404  | 73,388  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.2000 | 2027/06/01 | 490  | 491  | 89,052  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.4500 | 2027/07/15 | 350  | 357  | 64,796  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0500 | 2027/08/01 | 480  | 479  | 86,971  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1000 | 2027/08/26 | 270  | 269  | 48,889  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2027/09/15 | 570  | 558  | 101,239 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.7000 | 2027/10/15 | 380  | 383  | 69,549  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5000 | 2027/11/01 | 640  | 692  | 125,602 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.6500 | 2027/12/01 | 490  | 494  | 89,675  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0000 | 2028/02/01 | 590  | 588  | 106,651 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.2500 | 2028/03/15 | 470  | 449  | 81,508  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.4000 | 2028/04/01 | 450  | 461  | 83,767  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.6500 | 2028/06/15 | 390  | 393  | 71,337  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.5000 | 2028/07/15 | 400  | 382  | 69,285  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8000 | 2028/08/01 | 430  | 446  | 81,007  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.7500 | 2028/09/01 | 630  | 671  | 121,729 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8000 | 2028/12/01 | 550  | 558  | 101,197 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.3500 | 2029/01/15 | 220  | 219  | 39,822  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.1000 | 2029/02/01 | 430  | 452  | 82,011  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.4500 | 2029/02/15 | 420  | 395  | 71,640  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8000 | 2029/06/15 | 410  | 414  | 75,238  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.3500 | 2029/07/01 | 470  | 483  | 87,755  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.0000 | 2029/08/01 | 580  | 591  | 107,256 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.0000 | 2029/10/01 | 390  | 396  | 71,942  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.2500 | 2029/11/01 | 740  | 816  | 148,131 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8500 | 2029/12/15 | 570  | 598  | 108,512 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5000 | 2030/03/01 | 720  | 747  | 135,596 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.3500 | 2030/04/01 | 620  | 589  | 106,840 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.7000 | 2030/06/15 | 390  | 407  | 73,919  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.9500 | 2030/07/01 | 420  | 425  | 77,142  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2030/08/01 | 460  | 426  | 77,272  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.7000 | 2030/10/01 | 430  | 429  | 77,974  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0000 | 2030/11/15 | 420  | 444  | 80,694  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.6500 | 2030/12/01 | 560  | 532  | 96,595  |

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 | 2.8500 | 2031/02/01 | 100  | 100  | 18,206  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5000 | 2031/02/15 | 450  | 466  | 84,517  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9000 | 2031/04/01 | 640  | 581  | 105,416 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0000 | 2031/05/01 | 790  | 920  | 166,924 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.4500 | 2031/07/15 | 460  | 474  | 86,096  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.6000 | 2031/08/01 | 530  | 468  | 85,009  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0000 | 2031/10/30 | 310  | 329  | 59,801  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.1500 | 2031/11/15 | 500  | 507  | 91,954  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2031/12/01 | 490  | 438  | 79,481  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.6500 | 2032/03/01 | 670  | 622  | 112,886 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2032/06/01 | 550  | 485  | 88,059  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.2500 | 2032/07/15 | 410  | 416  | 75,437  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.2500 | 2032/11/15 | 380  | 384  | 69,717  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5000 | 2032/12/01 | 570  | 551  | 99,965  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.7500 | 2033/02/01 | 630  | 738  | 133,928 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.4000 | 2033/05/01 | 530  | 575  | 104,431 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.4500 | 2033/09/01 | 550  | 524  | 95,140  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.3500 | 2033/11/01 | 510  | 551  | 100,074 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.2000 | 2034/03/01 | 490  | 524  | 95,120  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8500 | 2034/07/01 | 470  | 490  | 88,902  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2034/08/01 | 710  | 803  | 145,624 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8500 | 2035/02/01 | 510  | 530  | 96,148  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.3500 | 2035/03/01 | 550  | 551  | 100,077 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0000 | 2035/04/30 | 340  | 359  | 65,136  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.6500 | 2035/08/01 | 510  | 520  | 94,358  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.6000 | 2035/10/01 | 500  | 507  | 91,963  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.4500 | 2036/03/01 | 370  | 306  | 55,519  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.2500 | 2036/09/01 | 420  | 373  | 67,800  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0000 | 2037/02/01 | 820  | 857  | 155,451 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2037/03/01 | 440  | 334  | 60,618  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0500 | 2037/10/30 | 340  | 354  | 64,287  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.2500 | 2038/03/01 | 360  | 345  | 62,712  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.9500 | 2038/09/01 | 400  | 371  | 67,312  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2039/08/01 | 640  | 726  | 131,810 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.1500 | 2039/10/01 | 400  | 416  | 75,437  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.1000 | 2040/03/01 | 350  | 324  | 58,761  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2040/09/01 | 610  | 692  | 125,506 |

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  |           |
| <b>イタリア</b>   |                          |        |            |      |     |           |
| <b>国債証券</b>   | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8500 | 2040/10/01 | 370  | 369 | 66,991    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.8000 | 2041/03/01 | 430  | 328 | 59,511    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.4500 | 2043/09/01 | 360  | 380 | 69,051    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.7500 | 2044/09/01 | 490  | 539 | 97,797    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5000 | 2045/04/30 | 320  | 212 | 38,517    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.1000 | 2046/04/30 | 110  | 110 | 20,078    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.2500 | 2046/09/01 | 460  | 407 | 73,852    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.7000 | 2047/03/01 | 450  | 362 | 65,787    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.4500 | 2048/03/01 | 480  | 434 | 78,802    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8500 | 2049/09/01 | 430  | 411 | 74,589    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.4500 | 2050/09/01 | 410  | 301 | 54,680    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.7000 | 2051/09/01 | 430  | 263 | 47,759    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1500 | 2052/09/01 | 220  | 148 | 26,911    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5000 | 2053/10/01 | 340  | 351 | 63,799    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.3000 | 2054/10/01 | 370  | 369 | 66,925    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.6500 | 2055/10/01 | 120  | 125 | 22,818    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8000 | 2067/03/01 | 250  | 179 | 32,548    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1500 | 2072/03/01 | 190  | 112 | 20,486    |
|               | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.2500 | 2026/11/01 | 240  | 251 | 45,647    |
| 小計            |                          | -      | -          | -    | -   | 7,701,306 |
| <b>フィンランド</b> |                          |        |            |      |     |           |
| <b>国債証券</b>   | FINNISH GOVERNMENT       | 1.3750 | 2027/04/15 | 100  | 99  | 17,978    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 0.5000 | 2027/09/15 | 180  | 175 | 31,739    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 2.7500 | 2028/07/04 | 140  | 142 | 25,798    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 0.5000 | 2028/09/15 | 170  | 162 | 29,413    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 2.8750 | 2029/04/15 | 160  | 163 | 29,559    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 0.5000 | 2029/09/15 | 190  | 177 | 32,151    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 2.5000 | 2030/04/15 | 140  | 140 | 25,461    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 0.0000 | 2030/09/15 | 150  | 133 | 24,153    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 0.7500 | 2031/04/15 | 130  | 118 | 21,441    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 0.1250 | 2031/09/15 | 180  | 155 | 28,282    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 2.6250 | 2032/04/15 | 90   | 89  | 16,251    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 1.5000 | 2032/09/15 | 200  | 184 | 33,480    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 3.0000 | 2033/09/15 | 190  | 191 | 34,800    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 1.1250 | 2034/04/15 | 130  | 112 | 20,438    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 3.0000 | 2034/09/15 | 190  | 190 | 34,548    |
|               | FINNISH GOVERNMENT       | 3.0000 | 2035/09/15 | 180  | 179 | 32,491    |

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  | 0.1250 | 2036/04/15 | 120  | 88  | 15,971  |
|        | FINNISH GOVERNMENT  | 2.7500 | 2038/04/15 | 110  | 104 | 18,908  |
|        | FINNISH GOVERNMENT  | 0.2500 | 2040/09/15 | 130  | 82  | 14,958  |
|        | FINNISH GOVERNMENT  | 2.6250 | 2042/07/04 | 140  | 125 | 22,727  |
|        | FINNISH GOVERNMENT  | 0.5000 | 2043/04/15 | 140  | 85  | 15,495  |
|        | FINNISH GOVERNMENT  | 3.2000 | 2045/04/15 | 70   | 66  | 12,086  |
|        | FINNISH GOVERNMENT  | 1.3750 | 2047/04/15 | 160  | 107 | 19,448  |
|        | FINNISH GOVERNMENT  | 0.1250 | 2052/04/15 | 100  | 40  | 7,409   |
|        | FINNISH GOVERNMENT  | 2.9500 | 2055/04/15 | 130  | 111 | 20,210  |
| 小計     |                     |        | -          | -    | -   | 585,208 |
| オーストリア |                     |        |            |      |     |         |
| 国債証券   | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.5000 | 2027/04/20 | 390  | 381 | 69,260  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.2500 | 2027/07/15 | 210  | 224 | 40,676  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7500 | 2028/02/20 | 340  | 330 | 59,894  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2028/10/20 | 280  | 262 | 47,688  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.5000 | 2029/02/20 | 360  | 340 | 61,764  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.9000 | 2029/05/23 | 160  | 163 | 29,642  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.5000 | 2029/10/20 | 210  | 211 | 38,324  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2030/02/20 | 350  | 316 | 57,405  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.4500 | 2030/10/20 | 240  | 250 | 45,437  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2031/02/20 | 410  | 359 | 65,182  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.9000 | 2032/02/20 | 330  | 297 | 53,865  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.8000 | 2032/09/20 | 80   | 80  | 14,583  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.9000 | 2033/02/20 | 450  | 453 | 82,304  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.9000 | 2034/02/20 | 340  | 340 | 61,725  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.4000 | 2034/05/23 | 250  | 240 | 43,634  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.9500 | 2035/02/20 | 290  | 289 | 52,438  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.2500 | 2036/10/20 | 200  | 147 | 26,664  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.1500 | 2037/03/15 | 370  | 404 | 73,346  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.2000 | 2039/07/15 | 190  | 187 | 34,069  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2040/10/20 | 180  | 108 | 19,761  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.1500 | 2044/06/20 | 250  | 238 | 43,200  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5000 | 2047/02/20 | 250  | 173 | 31,503  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.8500 | 2049/05/23 | 200  | 145 | 26,343  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7500 | 2051/03/20 | 260  | 137 | 24,926  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.1500 | 2053/10/20 | 230  | 207 | 37,704  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.8000 | 2062/01/26 | 100  | 101 | 18,364  |
|        | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7000 | 2071/04/20 | 160  | 57  | 10,401  |

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名                 | 利率     | 償還年月日      | 額面金額 | 評価額  |             |
|---------------------|--------|------------|------|------|-------------|
|                     |        |            |      | 千ユーロ | 千円          |
| ユーロ                 | %      |            | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円          |
| オーストリア              |        |            |      |      |             |
| 国債証券                |        |            |      |      |             |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5000 | 2086/11/02 | 80   | 38   | 7,037       |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.1000 | 2117/09/20 | 150  | 90   | 16,336      |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.8500 | 2120/06/30 | 140  | 44   | 7,982       |
| 小計                  | -      | -          | -    | -    | 1,201,471   |
| ユーロ小計               | -      | -          | -    | -    | 33,444,428  |
| 合計                  | -      | -          | -    | -    | 113,709,185 |

### 投資信託財産の構成

2025年11月20日現在

| 項目           | 当期末         |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評価額         | 比率    |
|              | 千円          | %     |
| 公社債          | 113,709,185 | 98.4  |
| コール・ローン等、その他 | 1,802,770   | 1.6   |
| 投資信託財産総額     | 115,511,955 | 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157.29円、1カナダ・ドル111.96円、1オーストラリア・ドル101.96円、1シンガポール・ドル120.36円、1ニュージーランド・ドル88.22円、1イギリス・ポンド205.31円、1イスラエル・シケル48.131円、1デンマーク・クローネ24.28円、1ノルウェー・クローネ15.46円、1スウェーデン・クローナ16.47円、1メキシコ・ペソ8.575円、1人民元22.086円、1マレーシア・リンギット37.806円、1ポーランド・ズロチ42.883円、1ユーロ181.34円です。

(注2) 外貨建純資産（115,016,435千円）の投資信託財産総額（115,511,955千円）に対する比率は99.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ外国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

(2025年11月20日現在)

| 項目                         |          | 当期末                     |
|----------------------------|----------|-------------------------|
| <b>(A)資産</b>               | <b>産</b> | <b>115,546,790,834円</b> |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等            |          | 1,011,627,130           |
| 公 社 債(評価額)                 |          | 113,709,185,642         |
| 未 収 入 金                    |          | 35,806,567              |
| 未 収 利 息                    |          | 739,347,448             |
| 前 払 費 用                    |          | 50,824,047              |
| <b>(B)負債</b>               | <b>債</b> | <b>486,982,283</b>      |
| 未 払 金                      |          | 285,495,584             |
| 未 払 解 約 金                  |          | 201,486,699             |
| <b>(C)純 資 産 総 額(A - B)</b> |          | <b>115,059,808,551</b>  |
| 元 本                        |          | 59,038,982,252          |
| 次 期 繰 越 損 益 金              |          | 56,020,826,299          |
| <b>(D)受 益 権 総 口 数</b>      |          | <b>59,038,982,252口</b>  |
| <b>1万口当たり基準価額(C / D)</b>   |          | <b>19,489円</b>          |

(注1) 期首元本額 54,446,032,965円  
 期中追加設定元本額 9,177,861,568円  
 期中一部解約元本額 4,584,912,281円

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

|                              |                 |
|------------------------------|-----------------|
| DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)    | 3,996,272,016円  |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)      | 7,755,033,721円  |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)    | 3,687,589,503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) | 1,038,755,253円  |
| ニッセイインデックスバランス(債券重視型)        |                 |
| S A(適格機関投資家限定)               | 1,597,188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)               | 4,269,168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)               | 3,317,233円      |
| ニッセイ外国債券インデックスファンド           |                 |
| <購入・換金手数料なし>                 | 16,403,372,348円 |
| ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)  |                 |
| <購入・換金手数料なし>                 | 12,655,537,309円 |
| DCニッセイ外国債券インデックス             | 6,392,797,522円  |
| DCニッセイターゲットデットファンド2055       | 555,396,171円    |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)      | 2,653,822,519円  |
| DCニッセイターゲットデットファンド2045       | 670,613,861円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2035       | 767,892,748円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2025       | 34,073,459円     |
| ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)  |                 |
| <購入・換金手数料なし>                 | 258,357,982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)               | 27,216,829円     |
| ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)  |                 |
| <購入・換金手数料なし>                 | 61,950,872円     |
| DCニッセイターゲットデットファンド2060       | 467,431,247円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2050       | 351,597,337円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2040       | 592,987,795円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2030       | 251,236,463円    |
| FWニッセイ外国債インデックス              | 73,290,000円     |
| DCニッセイターゲットデットファンド2065       | 290,026,878円    |
| DCニッセイターゲットデットファンド2070       | 39,993,472円     |
| ニッセイインデックスバランス(外国株式重視型)      |                 |
| S A(適格機関投資家限定)               | 4,553,358円      |

### 損益の状況

当期(2025年5月21日~2025年11月20日)

| 項目                             | 当期                     |
|--------------------------------|------------------------|
| <b>(A)配 当 等 収 益</b>            | <b>1,438,734,909円</b>  |
| 受 取 利 息                        | 1,438,727,650          |
| そ の 他 収 益 金                    | 7,259                  |
| <b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>      | <b>10,472,868,869</b>  |
| 売 買 損 益                        | 10,879,858,609         |
| 売 買 損                          | △ 406,989,740          |
| <b>(C)信 託 報 酬 等</b>            | <b>△ 11,608,524</b>    |
| <b>(D)当 期 損 益 金(A + B + C)</b> | <b>11,899,995,254</b>  |
| <b>(E)前 期 繰 越 損 益 金</b>        | <b>40,412,385,972</b>  |
| <b>(F)追 加 信 託 差 損 益 金</b>      | <b>7,524,667,843</b>   |
| <b>(G)解 約 差 損 益 金</b>          | <b>△ 3,816,222,770</b> |
| <b>(H)合 計(D + E + F + G)</b>   | <b>56,020,826,299</b>  |
| <b>次 期 繰 越 損 益 金(H)</b>        | <b>56,020,826,299</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。