

第11期末 (2024年11月20日)

基準価額	43,682円
純資産総額	8,006億円
騰落率	32.3%
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

NISSAY
ASSET MANAGEMENT

東京都千代田区丸の内1-6-6

<購入・換金手数料なし>

ニッセイ外国株式 インデックスファンド

追加型投信／海外／株式／インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2023年11月21日～2024年11月20日

第11期(決算日 2024年11月20日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド」は、このたび第11期の決算を行いました。

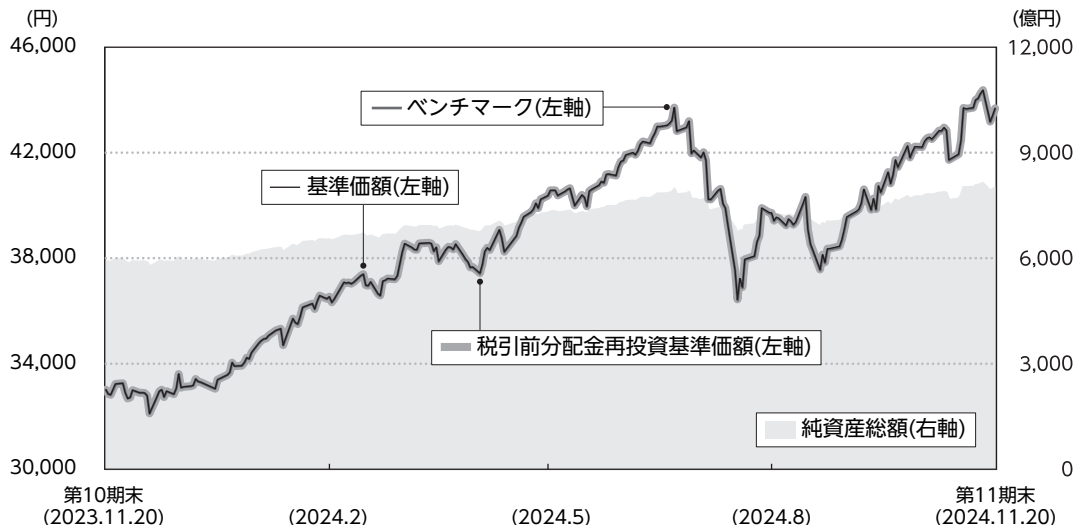
当ファンドは、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

運用経過

2023年11月21日～2024年11月20日

基準価額等の推移



第11期首	33,011円	既払分配金	0円
第11期末	43,682円	騰落率 (分配金再投資ベース)	32.3%

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

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

(注3) ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2024年1月から2月にかけて、米国経済がソフトランディング(軟着陸)するとの見方が強まったことや、大型ハイテク株の業績改善への期待感などから株価が上昇したこと
- ・5月から6月にかけて、米消費者物価指数(CPI)の伸び率鈍化などを受けて長期金利が低下したことなどが好感され米国株式市場が上昇したこと
- ・9月から10月にかけて、米連邦準備制度理事会(FRB)や欧州中央銀行(ECB)による利下げ実施等を受けて株価が上昇したことや、日銀の追加利上げタイミングが遅れるとの見方が広まったことなどから主要通貨に対して円安が進行したこと

<下落要因>

- ・2024年7月中旬から8月上旬にかけて、米大統領選を巡る混乱や米政府による対中半導体輸出規制の強化懸念、米景気の先行き懸念が高まり株価が下落したことに加えて、主要通貨に対して円高が進行したこと

1万口当たりの費用明細

項目	第11期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	38円	0.099%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は38,572円です。
(投信会社)	(15)	(0.038)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(15)	(0.039)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(8)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.003	
(株式)	(1)	(0.003)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(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	5	0.014	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)	(5)	(0.013)	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"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	45	0.117	

(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。

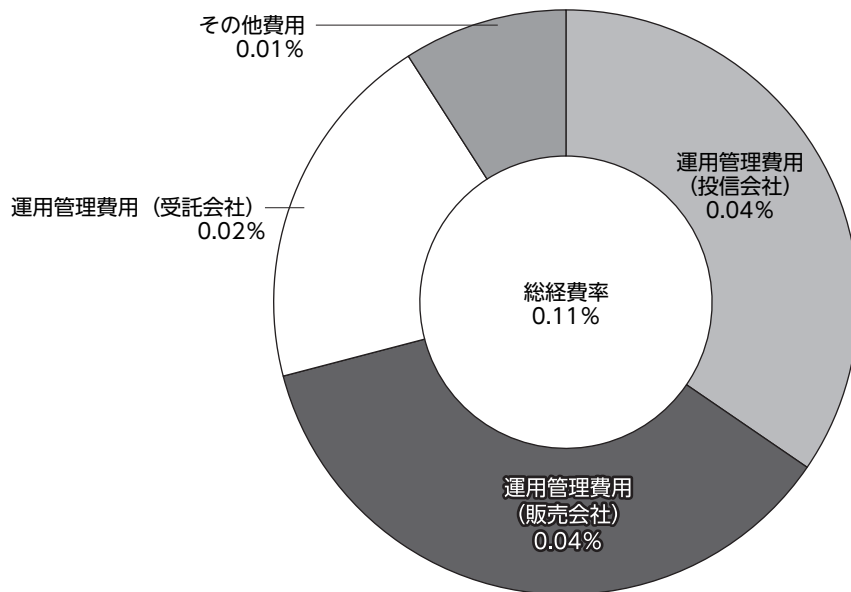
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.11%**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。

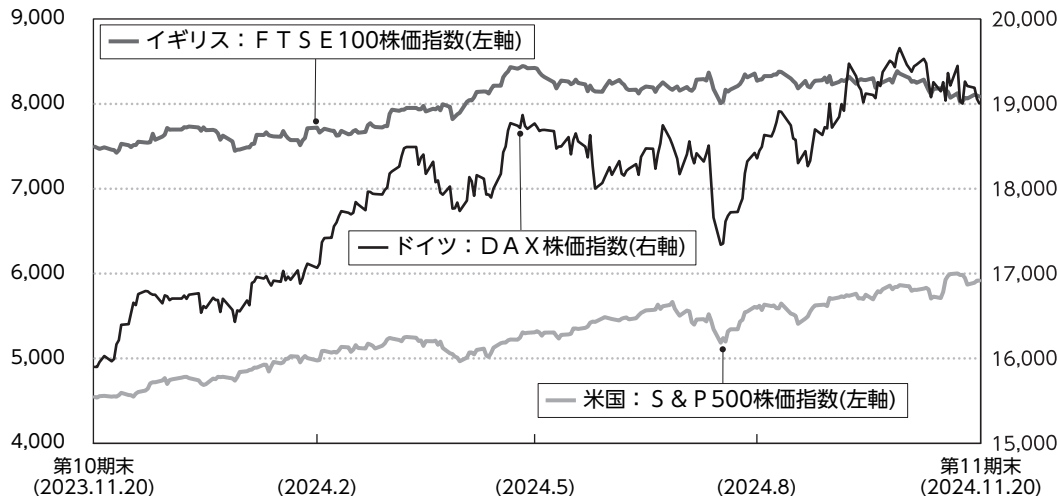
(注3) 各比率は年率換算した値です。

(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

■海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



(注) FactSetのデータを使用しています。

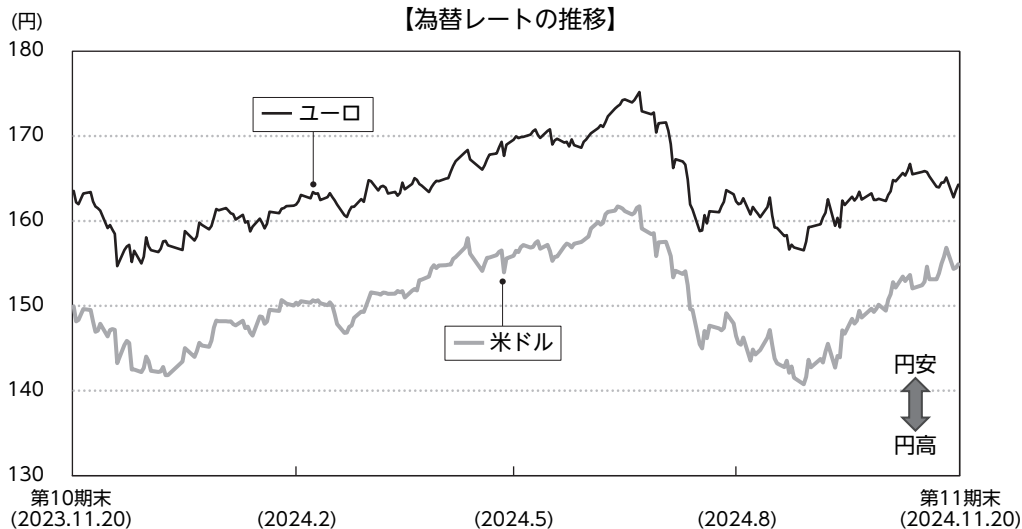
外国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

2023年12月に公表された米連邦公開市場委員会（FOMC）議事録の要旨が金融引き締めに慎重な姿勢であったことや、過度な金融引き締め長期化への警戒感が和らいだことなどから、年末にかけて株価は上昇しました。

年明け以降は米早期利下げ観測の後退により金利が上昇したことや中東における地政学リスクの高まりから株価は下落する場面があったものの、市場予想を上回る決算を発表した大型ハイテク株が堅調に推移したことなどから、2024年4月末にかけておおむね上昇しました。5月から6月にかけては米CPIの伸び率鈍化などを受けて長期金利が低下したことが好感され米国株式市場が上昇した一方、欧州の株式市場は欧州主要国における政治の不透明感が警戒され下落する場面がありました。7月中旬から8月上旬にかけては米大統領選を巡る混乱や米政府による対中半導体輸出規制の強化懸念、米景気の先行き懸念が高まり株価は下落しましたが、9月から10月にかけてはFRBやECBによる利下げ実施等を受けて上昇しました。

その後は米大統領選やFOMCでの利下げの動向などを背景に市場のボラティリティ（価格変動性）が高まる場面があったものの、前期末と比較すると株価は上昇して当期末を迎えました。

■為替市況



(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、期初から2023年12月末にかけて日本の財務省による為替介入への警戒感や日銀のマイナス金利解除期待が高まったことで下落しましたが、年明け以降は能登半島地震により日銀のマイナス金利解除期待が後退したことや堅調な米経済指標を背景にF R Bの早期利下げ観測が後退したことを受けて米ドル高円安に転じました。2024年5月には日本の財務省による為替介入とみられる動きにより米ドル安円高に振れる場面があったものの、堅調な米経済指標が続いたことや日銀の利上げ観測・F R Bの利下げ観測がそれぞれ後退したことなどから米ドル高円安基調となりました。7月中旬には日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあったことや米経済指標が弱含んだことなどから、大きく米ドル安円高に転じました。9月下旬以降は自民党総裁選で石破氏が勝利し10月の衆院選で連立与党が過半数の議席数を確保できなかったことで政治の不透明感が高まったこと、さらに米大統領選でトランプ氏優位との見方が強まったことから財政拡張や関税引き上げに伴う物価上昇への懸念が高まったことから再び米ドル高円安となり、結局、期を通じて見ると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、期初から2023年12月末にかけて日銀のマイナス金利解除期待が高まったことで下落しましたが、年明け以降は能登半島地震により日銀のマイナス金利解除期待が後退したことやユーロ圏主要国の購買担当者景気指数 (PMI) が市場予想を上回ったことからユーロ高円安に転じました。その後も日銀の追加利上げ観測が後退する一方で欧州域内の経済指標が堅調であったことからユーロ高円安基調が続きましたが、7月中旬には日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあったことや米経済指標が弱含んだことなどから大きくユーロ安円高となりました。9月下旬以降は自民党総裁選で石破氏が勝利し10月の衆院選で連立与党が過半数の議席数を確保できなかったことで政治の不透明感が高まったこと、さらにユーロ圏実質域内総生産 (GDP) が市場予想を上回るなど欧州域内の経済指標が堅調であったことなどから再びユーロ高円安推移となり、結局、期を通じて見ると期初と同程度の水準で当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

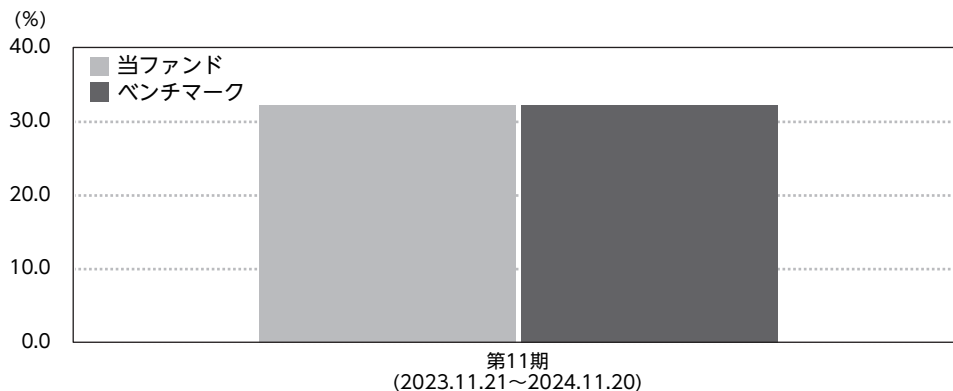
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

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。

*ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+32.3%となり、ベンチマーク騰落率（+32.3%）に連動しました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。
 なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	当期 2023年11月21日～2024年11月20日
当期分配金(税引前)	—
対基準価額比率	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	33,681円

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

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

今後の運用方針

■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に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。

■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。

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■組入ファンド

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

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

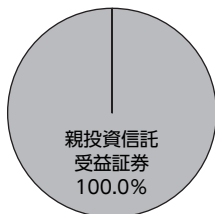
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

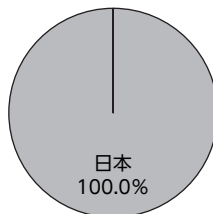
項目	第11期末 2024年11月20日
純資産総額	800,678,877,158円
受益権総口数	183,298,723,665口
1万口当たり基準価額	43,682円

(注) 当期間中における追加設定元本額は27,520,076,793円、同解約元本額は23,738,346,830円です。

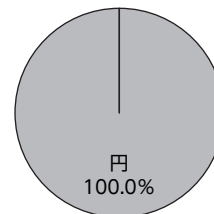
■資産別配分



■国別配分



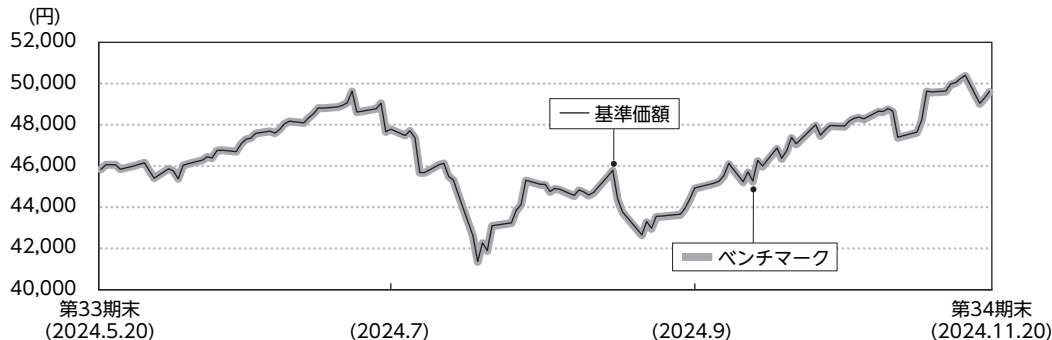
■通貨別配分



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

ニッセイ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

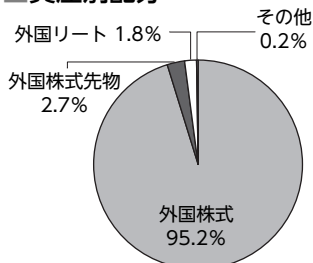
銘柄名	通貨	比率
NVIDIA CORP	米ドル	5.3%
APPLE INC	米ドル	4.9
MICROSOFT CORP	米ドル	4.3
AMAZON.COM INC	米ドル	2.8
S&P 500 EMINI FUTURE 202412 買	米ドル	2.0
META PLATFORMS INC-A	米ドル	1.8
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.5
TESLA, INC.	米ドル	1.4
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.3
BROADCOM INC	米ドル	1.1
組入銘柄数		1,214

■ 1万口当たりの費用明細

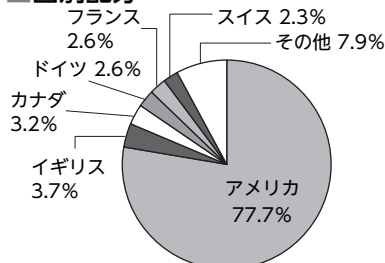
2024.5.21~2024.11.20

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

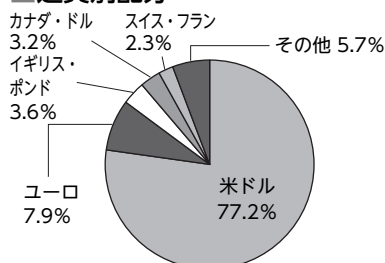
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

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

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

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

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	%	%	百万円
7期(2020年11月20日)	18,326	0	8.9	18,326	18,418	8.7	94.9	2.8	2.2	209,723
8期(2021年11月22日)	26,076	0	42.3	26,076	26,192	42.2	94.9	2.9	2.1	360,786
9期(2022年11月21日)	27,035	0	3.7	27,035	27,130	3.6	94.1	2.9	2.1	437,730
10期(2023年11月20日)	33,011	0	22.1	33,011	33,078	21.9	94.4	3.6	1.9	592,595
11期(2024年11月20日)	43,682	0	32.3	43,682	43,752	32.3	95.2	2.7	1.8	800,678

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		ベンチ マーク	騰落率		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%			%		%	%	%
(期首)2023年11月20日	33,011	-		33,078	-		94.4	3.6	1.9
11月末	32,717	△	0.9	32,782	△	0.9	96.0	1.9	1.9
12月末	33,294	0.9		33,360	0.9		95.8	2.1	2.0
2024年1月末	35,324	7.0		35,393	7.0		95.2	2.8	1.8
2月末	37,028	12.2		37,094	12.1		94.4	3.6	1.8
3月末	38,566	16.8		38,631	16.8		95.5	2.4	1.8
4月末	39,077	18.4		39,144	18.3		94.8	3.3	1.7
5月末	39,995	21.2		40,060	21.1		95.2	2.8	1.7
6月末	42,425	28.5		42,497	28.5		95.0	3.1	1.7
7月末	40,067	21.4		40,131	21.3		96.0	2.0	1.9
8月末	39,377	19.3		39,429	19.2		94.9	3.1	1.9
9月末	39,836	20.7		39,885	20.6		95.8	2.2	1.9
10月末	42,848	29.8		42,909	29.7		95.3	2.8	1.9
(期末)2024年11月20日	43,682	32.3		43,752	32.3		95.2	2.7	1.8

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2023年11月21日～2024年11月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	24,244,259	104,480,470	21,073,213	89,411,344

(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
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	119,653,250千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	950,647,585千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.12

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年11月21日～2024年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2024年11月20日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	158,220,790	161,391,837	800,681,044

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ外国株式インデックスマザーファンド全体の口数は236,998,387千口です。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	800,681,044	99.8
コール・ローン等、その他	1,760,937	0.2
投資信託財産総額	802,441,981	100.0

- (注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル154.91円、1カナダ・ドル110.98円、1オーストラリア・ドル101.30円、1香港ドル19.90円、1シンガポール・ドル115.86円、1ニュージーランド・ドル91.69円、1イギリス・ポンド196.60円、1イスラエル・シェケル41.387円、1スイス・フラン175.52円、1デンマーク・クローネ22.02円、1ノルウェー・クローネ14.13円、1スウェーデン・クローナ14.21円、1ユーロ164.27円です。
- (注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,160,760,262千円）の投資信託財産総額（1,177,767,156千円）に対する比率は98.6%です。
- (注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	802,441,981,678円
コール・ローン等	362,316,394
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	800,681,044,138
未収入金	1,398,621,146
(B) 負債	1,763,104,520
未払解約金	1,387,579,292
未払信託報酬	371,394,126
その他未払費用	4,131,102
(C) 純資産総額(A-B)	800,678,877,158
元本	183,298,723,665
次期繰越損益金	617,380,153,493
(D) 受益権総口数	183,298,723,665口
1万口当たり基準価額(C/D)	43,682円

- (注) 期首元本額 179,516,993,702円
 期中追加設定元本額 27,520,076,793円
 期中一部解約元本額 23,738,346,830円

損益の状況

当期(2023年11月21日~2024年11月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	179,474円
受取利息	183,345
支払利息	△ 3,871
(B) 有価証券売買損益	183,197,005,515
売買益	192,762,281,207
売買損	△ 9,565,275,692
(C) 信託報酬等	△ 695,956,026
(D) 当期損益金(A+B+C)	182,501,228,963
(E) 前期繰越損益金(分配準備積立金)	188,984,558,333
(F) 追加信託差損益金*(配当等相当額)(売買損益相当額)	245,894,366,197
(G) 合計(D+E+F)	617,380,153,493
次期繰越損益金(G)	617,380,153,493
追加信託差損益金(配当等相当額)(売買損益相当額)	245,894,366,197
分配準備積立金	371,485,787,296

- (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	11,681,218,236円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	170,820,010,727円
(c) 信託約款に定める収益調整金	245,894,366,197円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	188,984,558,333円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	617,380,153,493円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	33,681.64円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に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目標に運用を行います。	
主要運用対象	<購入・換金手数料なし> ニッセイ外国株式 インデックスファンド	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券
	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
運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイ外国株式 インデックスファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。	

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 34 期

(計算期間：2024年5月21日～2024年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

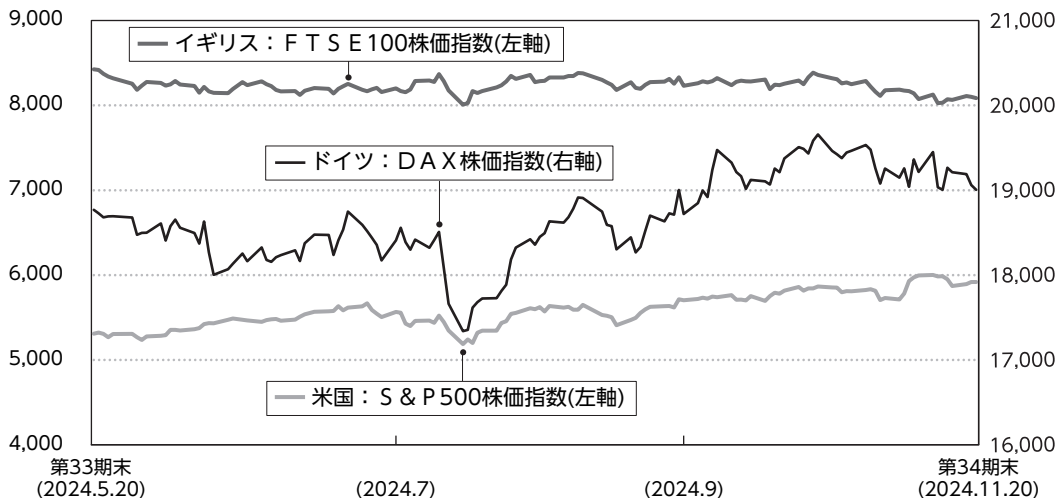
運用経過

2024年5月21日～2024年11月20日

投資環境

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



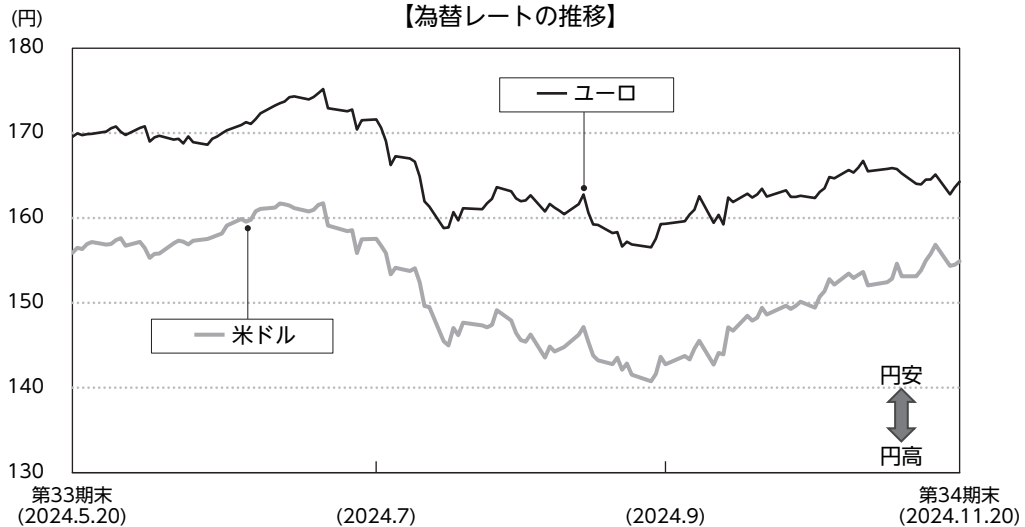
(注) FactSetのデータを使用しています。

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

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

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

■為替市況

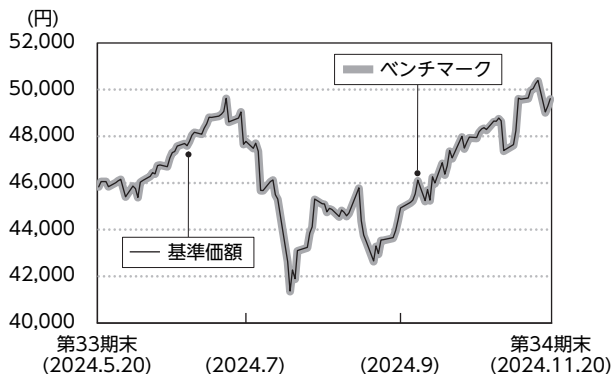


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

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

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2024年5月21日～2024年11月20日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

売買および取引の状況

2024年5月21日～2024年11月20日

(1) 株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

(2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	0.732	51	—	—
CROWN CASTLE INC	2	237	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.611	72	0.660	78
PROLOGIS INC	4	571	—	—
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	2	50	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.702	148	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.485	55	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	1	95	1	115
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.314	89	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2	62	—	—
WELLTOWER INC	7	866	—	—
HOST HOTELS AND RESORTS INC	3	60	—	—
KIMCO REALTY CORP	3	69	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.573	84	—	—
PUBLIC STORAGE	0.745	233	—	—
外国 REGENCY CENTERS CORP	0.859	58	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	242	—	—
SUN COMMUNITIES INC	0.626	80	—	—
UDR INC	1	64	—	—
VENTAS INC	2	124	—	—
WP CAREY INC	1	66	—	—
REALTY INCOME CORP	8	475	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.875	60	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	174	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	571	—	—
IRON MOUNTAIN INC	1	149	—	—
AMERICAN TOWER REIT INC	2	505	—	—
EQUINIX INC	0.564	442	—	—
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	2	74	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1	87	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.474	101	—	—
INVITATION HOMES INC	3	107	—	—
VICI PROPERTIES INC	5	185	—	—

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(3) 先物取引の種類別取引状況

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2024年5月21日～2024年11月20日

株式

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

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

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

組入有価証券明細表

2024年11月20日現在

(1) 外国株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	157	163	4,463	63,423	資本財	
INVESTOR AB	1,832	1,914	56,636	804,803	金融サービス	
LIFCO AB-B SHS	246	257	8,084	114,877	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	79	83	4,401	62,545	金融サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	1,607	1,679	7,978	113,369	資本財	
SAAB AB-B	338	354	8,816	125,288	資本財	
SAGAX AB-B	216	243	5,856	83,213	不動産管理・開発	
SANDVIK AB	1,128	1,180	23,886	339,432	資本財	
SECURITAS AB	519	544	7,229	102,729	商業・専門サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,679	1,756	26,318	373,978	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	359	376	8,257	117,346	資本財	
SKF AB	360	377	7,675	109,064	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB	641	670	9,523	135,333	素材	
SVENSKA HANDELSBANKEN	1,543	1,616	17,860	253,796	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	898	940	20,149	286,322	銀行	
TELE2 AB	591	611	6,869	97,611	電気通信サービス	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	3,101	3,073	27,234	386,998	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB	2,615	2,684	8,409	119,492	電気通信サービス	
TRELLEBORG AB-B SHS	-	235	8,283	117,706	資本財	
VOLVO AB	1,593	1,754	46,802	665,069	資本財	
VOLVO AB-A SHS	216	226	6,068	86,229	資本財	
VOLVO CAR AB-B	788	823	1,886	26,800	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額	34,486	36,355	622,248	8,842,145	
	銘柄数<比率>	42	44	-	<0.8%>	
(ユーロ/アイルランド)			千ユーロ			
AIB GROUP PLC	1,664	2,010	1,077	177,036	銀行	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,119	1,126	984	161,795	銀行	
KERRY GROUP PLC-A	167	171	1,464	240,592	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC	164	171	1,237	203,222	資本財	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	275	-	-	-	素材	
小計	株数・金額	3,391	3,479	4,764	782,647	
	銘柄数<比率>	5	4	-	<0.1%>	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ABN AMRO BANK NV	503	506	750	123,318	銀行
ADYEN NV	23	24	2,963	486,778	金融サービス
AIRBUS SE	628	658	9,033	1,483,909	資本財
AKZO NOBEL NV	180	189	1,058	173,863	素材
ASM INTERNATIONAL NV	49	51	2,555	419,760	半導体・半導体製造装置
ASML HOLDING NV	427	442	27,646	4,541,527	半導体・半導体製造装置
ASR NEDERLAND NV	167	175	791	130,068	保険
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	81	85	920	151,141	半導体・半導体製造装置
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	652	681	386	63,424	食品・飲料・タバコ
DSM-FIRMENICH AG	197	206	2,140	351,577	素材
EURONEXT NV	90	88	922	151,619	金融サービス
EXOR NV	98	109	1,027	168,848	金融サービス
FERRARI NV	133	139	5,672	931,826	自動車・自動車部品
HEINEKEN HOLDING NV	136	143	876	144,029	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN NV	304	318	2,270	372,974	食品・飲料・タバコ
IMCD NV	60	63	877	144,216	資本財
ING GROEP NV-CVA	3,520	3,657	5,467	898,143	銀行
INPOST SA	-	221	382	62,906	運輸
JDE PEET'S BV	102	135	245	40,398	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,008	1,036	3,376	554,594	生活必需品流通・小売り
KONINKLIJKE PHILIPS NV	849	884	2,168	356,231	ヘルスケア機器・サービス
NN GROUP NV	286	299	1,343	220,720	保険
OCI NV	111	-	-	-	素材
PROSUS	1,549	1,569	5,963	979,595	一般消費財・サービス流通・小売り
QIAGEN NV	233	245	947	155,670	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD NV	114	120	497	81,734	商業・専門サービス
ROYAL KPN NV	3,632	4,433	1,583	260,147	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	724	749	1,741	286,066	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	868	912	2,057	338,021	メディア・娯楽
WOLTERS KLUWER NV	263	275	4,216	692,596	商業・専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,001 29	18,425 29	89,886 -	14,765,712 <1.3%>
(ユーロ/ベルギー)					
AGEAS	169	176	854	140,417	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	919	994	5,271	865,990	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE	62	65	3,503	575,515	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ/ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
D'IETTEREN GROUP		22	23	461	75,825	一般消費財・サービス流通・小売り
ELIA GROUP SA/NV		31	32	272	44,750	公益事業
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		92	92	596	98,048	金融サービス
KBC GROEP NV		265	254	1,790	294,179	銀行
LOTUS BAKERIES		0.44	0.45	513	84,418	食品・飲料・タバコ
SOFINA		16	17	369	60,730	金融サービス
SYENSQO SA		78	81	587	96,584	素材
UCB SA		133	139	2,300	377,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE		221	-	-	-	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,014	1,879	16,523	2,714,348	
		12	11	-	<0.2%>	
(ユーロ/ルクセンブルグ)						
ARCELORMITTAL		539	518	1,244	204,439	素材
TENARIS SA		499	521	907	149,037	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,039	1,040	2,151	353,477	
		2	2	-	<0.0%>	
(ユーロ/フランス)						
ACCOR		200	215	927	152,411	消費者サービス
ADP		36	38	414	68,129	運輸
AIR LIQUIDE		555	640	10,194	1,674,579	素材
ALSTOM RGPT		305	383	815	133,925	資本財
AMUNDI SA		65	67	456	74,965	金融サービス
ARKEMA		63	62	475	78,123	素材
AXA SA		1,924	2,012	6,850	1,125,300	保険
BIOMERIEUX		43	45	448	73,677	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS		1,094	1,127	6,685	1,098,165	銀行
BOLLORE SE		753	787	457	75,138	メディア・娯楽
BOUYGUES		202	210	614	100,906	資本財
BUREAU VERITAS SA		312	351	986	161,974	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA		164	171	2,694	442,695	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA		599	601	881	144,850	生活必需品流通・小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN		482	501	4,454	731,819	資本財
CREDIT AGRICOLE SA		1,130	1,172	1,566	257,285	銀行
DANONE		681	714	4,648	763,636	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA		21	21	427	70,199	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA		707	741	2,369	389,199	ソフトウェア・サービス
EDENRED		264	276	792	130,196	金融サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ/ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	144	148	7,020	1,153,330	保険	
NEMETSCHKE SE	61	63	632	103,898	ソフトウェア・サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	161	169	590	97,001	自動車・自動車部品	
PUMA AG	111	117	537	88,289	耐久消費財・アパレル	
RATIONAL AG	5	5	493	81,079	資本財	
RHEINMETALL AG	46	48	2,916	479,167	資本財	
RWE AG	669	699	2,198	361,130	公益事業	
SAP SE	1,106	1,156	25,429	4,177,296	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG	27	29	606	99,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCOUT24 SE	79	82	697	114,593	メディア・娯楽	
SIEMENS AG	805	841	14,967	2,458,748	資本財	
SIEMENS ENERGY AG	550	707	3,234	531,317	資本財	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	298	312	1,540	253,121	ヘルスケア機器・サービス	
SYMRISE AG	140	147	1,536	252,377	素材	
TALANX AG	68	71	556	91,415	保険	
VOLKSWAGEN AG	31	-	-	-	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG	217	228	1,896	311,607	自動車・自動車部品	
VONOVIA SE	777	820	2,381	391,238	不動産管理・開発	
ZALANDO SE	237	248	677	111,259	一般消費財・サービス流通・小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,905 54	26,338 54	152,357 -	25,027,791 <2.1%>	
(ユーロ/ポルトガル)						
EDP RENOVAVEIS SA	326	345	373	61,292	公益事業	
EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	320	-	-	-	公益事業	
EDP SA	3,325	3,477	1,188	195,169	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	490	514	804	132,073	エネルギー	
JERONIMO MARTINS	300	314	547	89,890	生活必需品流通・小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,763 5	4,651 4	2,912 -	478,426 <0.0%>	
(ユーロ/スペイン)						
ACCIONA SA	26	27	313	51,468	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	223	202	841	138,193	資本財	
AENA SME SA	79	82	1,641	269,727	運輸	
AMADEUS IT GROUP SA	477	498	3,275	538,072	消費者サービス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ/フランス)		千□	千□	千ユーロ	千円
KLEPIERRE		22	23	688	113,124
GECINA SA		4	5	482	79,267
COVIVIO		5	6	318	52,382
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		12	13	973	159,877
小計	□数・金額	45	48	2,463	404,652
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
ユーロ計	□数・金額	64	67	2,869	471,373
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.0%>
合計	□数・金額	5,544	5,160	—	21,523,581
	銘柄数<比率>	54	51	—	<1.8%>

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日現在)

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

(注1)	期首元本額	228,048,095,816円
	期中追加設定元本額	23,976,725,288円
	期中一部解約元本額	15,026,433,160円
(注2)	当マザーファンドの当期末元本額におけるペビーフンド別内訳は、次の通りです。	
	DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	697,343,816円
	DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	3,470,977,936円
	DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	3,508,450,010円
	ニッセイ外国株式インデックスS A (適格機関投資家限定)	2,320,921,334円
	ニッセイインデックスバランス (債券重視型) S A (適格機関投資家限定)	655,727円
	ニッセイインデックスバランス (標準型) S A (適格機関投資家限定)	1,365,193円
	ニッセイインデックスバランス (成長型) S A (適格機関投資家限定)	4,377,084円
	ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ (適格機関投資家限定)	486,709,861円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	161,391,837,322円
	DCニッセイ外国株式インデックス	44,717,793,265円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
	バランスファンド (4資産均等型)	3,524,993,735円
	DCニッセイターゲットデートファンド2055	456,141,988円
	DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	170,795,264円
	DCニッセイターゲットデートファンド2045	522,390,715円
	DCニッセイターゲットデートファンド2035	638,505,039円
	DCニッセイターゲットデートファンド2025	8,367,952円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
	バランスファンド (6資産均等型)	87,345,461円
	ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式)	9,376,316円
	ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート)	10,650,648円
	ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート/債券)	3,519,880円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
	バランスファンド (8資産均等型)	20,246,799円
	DCニッセイターゲットデートファンド2060	379,050,839円
	DCニッセイターゲットデートファンド2050	254,048,022円
	DCニッセイターゲットデートファンド2040	445,049,698円
	DCニッセイターゲットデートファンド2030	154,611,872円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02 (適格機関投資家限定)	124,705,835円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド (GDP P型)バスケット)	281,731,466円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	125,508,152円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	123,087,223円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	122,623,889円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08 (適格機関投資家限定)	109,534,576円
	ニッセイ先進国株式インデックス (海陸ヘッジあり) (ラップ専用)	31,658,672円
	ニッセイ先進国株式インデックス (海陸ヘッジなし) (ラップ専用)	11,954,174,927円
	F Wニッセイ先進国株インデックス	53,058,104円
	DCニッセイターゲットデートファンド2065	180,150,980円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンドⅡ 2023-05 (適格機関投資家限定)	79,189,559円
	DCニッセイ世界株式インデックスコレクト	373,589,941円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-02 (適格機関投資家限定)	77,396,875円
	DCニッセイターゲットデートファンド2070	3,322,527円
	ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2024-08 (適格機関投資家限定)	73,129,442円

損益の状況

当期 (2024年5月21日~2024年11月20日)

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

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCI 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。