

第11期末 (2024年11月20日)

基準価額	14,638円
純資産総額	294億円
騰落率	7.8%
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。



NISSAY
ASSET MANAGEMENT

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

<購入・換金手数料なし>

ニッセイ外国債券

インデックスファンド

追加型投信／海外／債券／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>ニッセイ外国債券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。

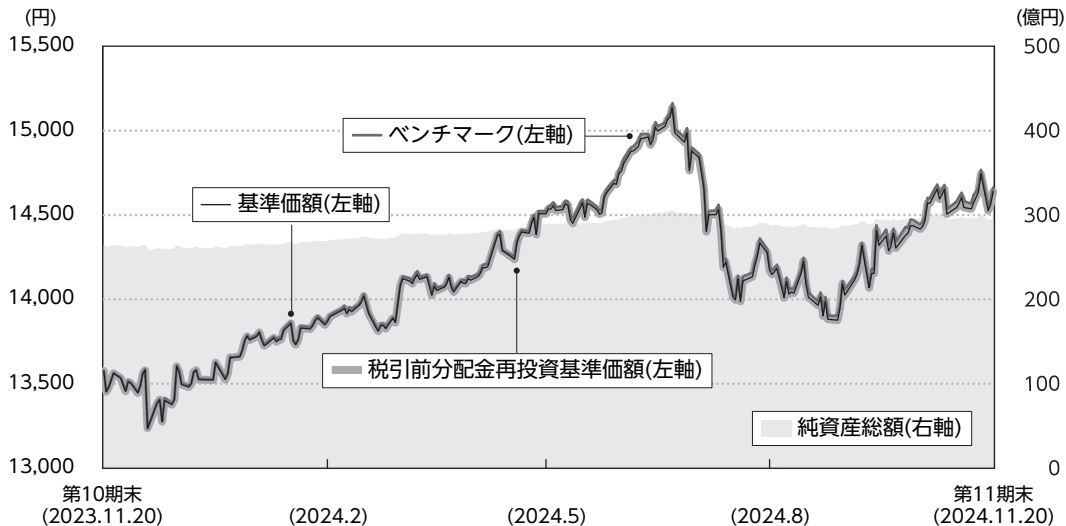
当ファンドは、「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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	13,576円	既払分配金	0円
第11期末	14,638円	騰落率 (分配金再投資ベース)	7.8%

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

(注2) 分配金を再投資するかどうかに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F T S E 世界国債インデックス (除く日本、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>

- ・年明けから2024年7月上旬にかけて、堅調な米経済指標が続いたことに加えて、物価上昇が根強い中、米連邦準備制度理事会 (F R B) の利下げ観測が後退したことや日銀の利上げペースが市場予想より緩やかであったことから米ドル高円安基調となったこと
- ・9月下旬から当期末にかけて、日本の政治的な不透明感が高まったことや米大統領選でトランプ氏優位との見方が強まったことから物価上昇への懸念が高まったことで米ドル高円安となったこと

<下落要因>

- ・2024年7月中旬から9月中旬にかけて、日本の財務省による円買いの為替介入とみられる動きがあったことや米経済指標が弱含んだことなどから大きく米ドル安円高となったこと

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	22円	0.154%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は14,166円です。</p>
(投信会社)	(9)	(0.066)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(9)	(0.066)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
その他費用	5	0.034	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(保管費用)	(5)	(0.033)	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	27	0.188	

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

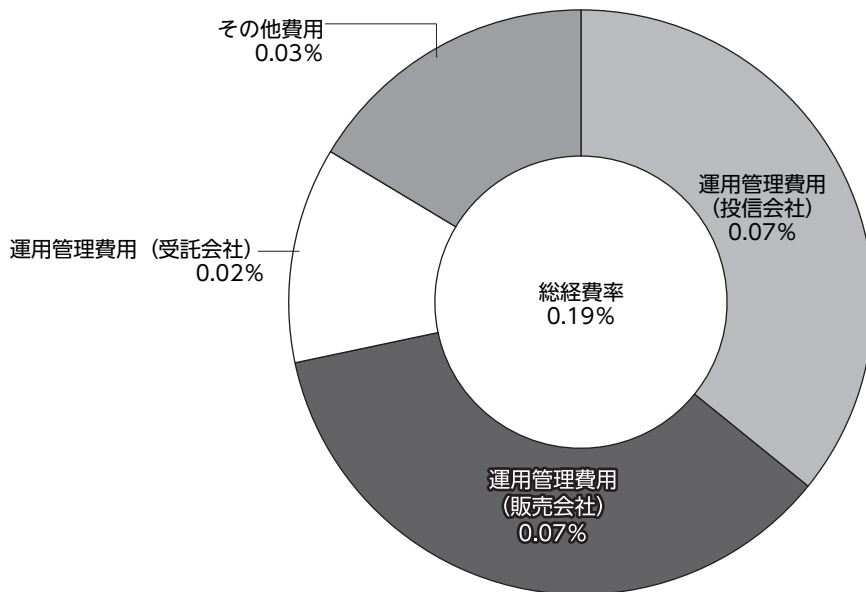
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(参考情報)

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.19%**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。

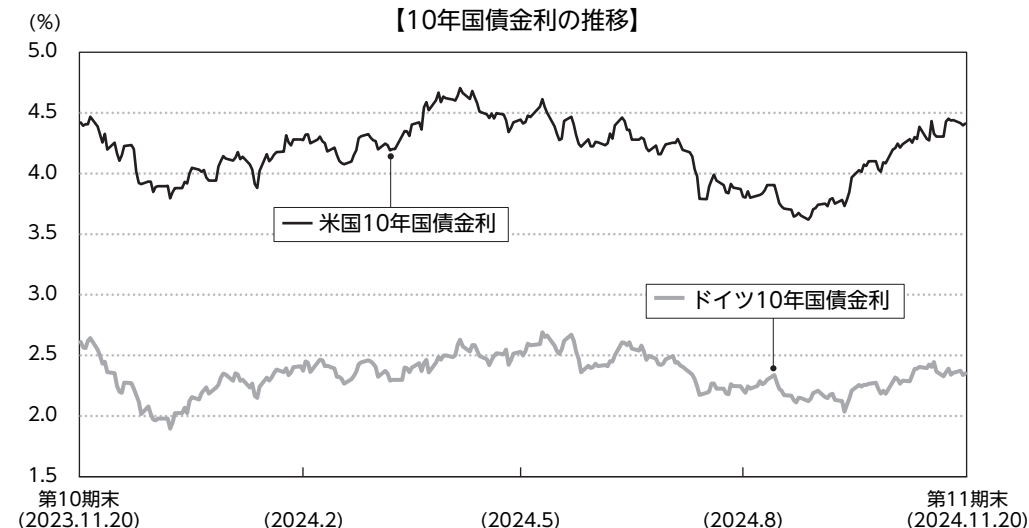
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(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

■ 海外債券市況

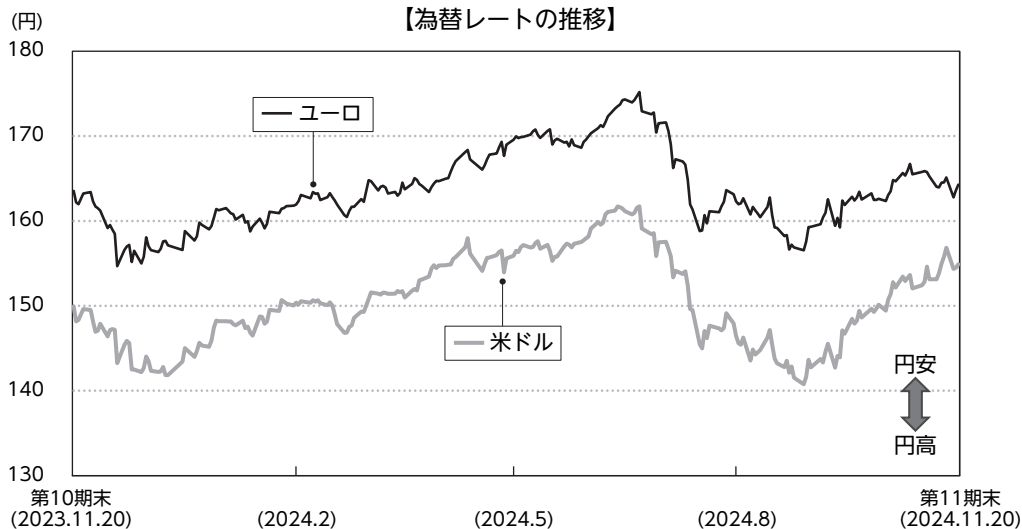


(注) ブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、期初から2023年12月末にかけて軟調な米経済指標や米連邦公開市場委員会 (FOMC) で政策金利の見通しが下方修正されたことを受けて低下しましたが、その後は雇用統計等の米経済指標が堅調となったことで利下げ観測が後退し上昇基調に転じました。2024年5月には米消費者物価指数 (CPI) の伸びが鈍化したことや米サプライマネジメント協会 (ISM) 非製造業景況感指数が軟調であったこと、7月のFOMCで将来の利下げへの可能性が示唆されたことなどから金利は再び低下基調となりました。10月以降は米大統領選でトランプ氏が勝利するとの見方が強まったことで財政拡張や関税引き上げに伴う物価上昇への懸念が高まったことから金利は上昇し、結局、期を通じて見ると期初と同程度の水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初から2023年12月末にかけてユーロ圏消費者物価指数 (HICP) が市場予想を下回ったことから早期利下げ観測が高まり低下しましたが、その後は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景気の底堅さが意識され上昇基調となりました。2024年6月以降は欧州議会選において極右政党が議席数を伸ばしたことで投資家のリスク回避姿勢が強まったことや欧州域内の経済指標が鈍化したことなどから再び低下基調となりました。10月以降はHICPが上昇したことや米国金利が上昇したことなどからドイツ金利も上昇に転じ、結局、期を通じて見るとやや低下して当期末を迎えました。

■為替市況



(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、期初から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

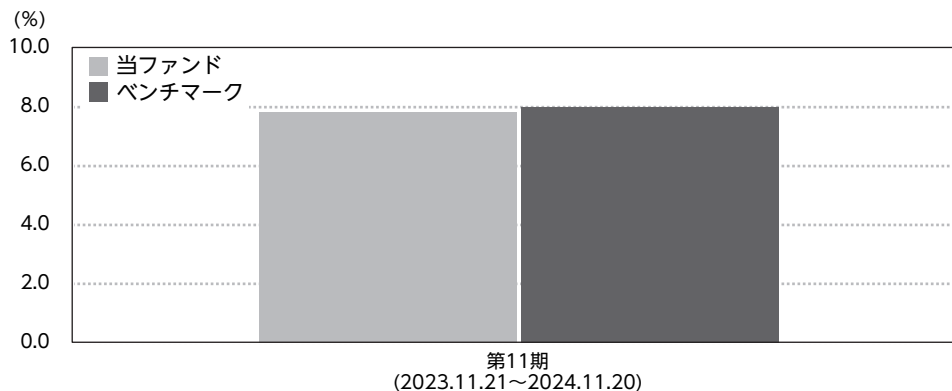
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

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

*ベンチマークはF T S E 世界国債インデックス（除く日本、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+7.8%となり、ベンチマーク騰落率（+8.0%）にほぼ連動しました。

(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	5,199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国の国債に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■マザーファンド

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

ファンドデータ

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
ニッセイ外国債券インデックス 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。

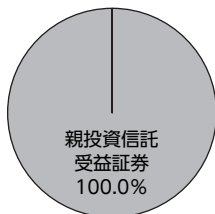
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

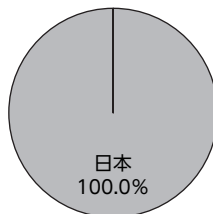
項目	第11期末 2024年11月20日
純資産総額	29,479,570,839円
受益権総口数	20,139,170,978口
1万口当たり基準価額	14,638円

(注) 当期間中における追加設定元本額は4,782,729,193円、同解約元本額は4,031,666,739円です。

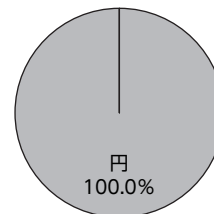
■資産別配分



■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。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

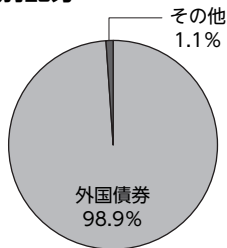
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 1.5% 2026/8/15	米ドル	2.4%
US TREASURY 1.625% 2026/2/15	米ドル	2.3
US TREASURY 1.625% 2026/5/15	米ドル	1.8
US TREASURY 2.625% 2029/2/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.25% 2025/11/15	米ドル	1.4
US TREASURY 2.375% 2029/5/15	米ドル	1.4
US TREASURY 2.375% 2027/5/15	米ドル	1.4
US TREASURY 2.0% 2026/11/15	米ドル	1.3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

■ 1万口当たりの費用明細

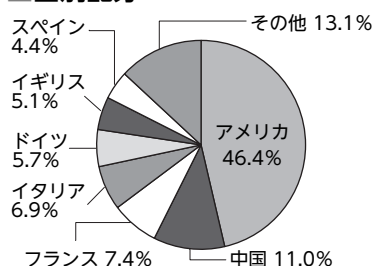
2024.5.21~2024.11.20

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

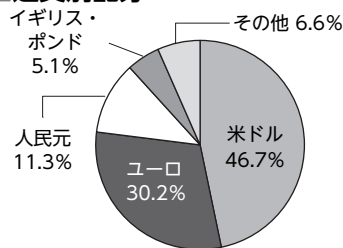
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

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

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

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	債券 組入比率	純資産 総額
	円	円	%	円		%	%	百万円
7期(2020年11月20日)	11,858	0	4.6	11,858	12,144	4.9	99.1	14,870
8期(2021年11月22日)	12,458	0	5.1	12,458	12,783	5.3	99.2	19,079
9期(2022年11月21日)	12,514	0	0.4	12,514	12,865	0.6	99.0	21,974
10期(2023年11月20日)	13,576	0	8.5	13,576	13,992	8.8	98.9	26,321
11期(2024年11月20日)	14,638	0	7.8	14,638	15,112	8.0	98.9	29,479

(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) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」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		債券 組入比率
			%			%	
(期首)2023年11月20日	円 13,576		% -	13,992		% -	% 98.9
11月末	13,510	△	0.5	13,934	△	0.4	98.8
12月末	13,525	△	0.4	13,944	△	0.3	98.9
2024年1月末	13,761		1.4	14,195		1.5	99.0
2月末	13,939		2.7	14,381		2.8	99.0
3月末	14,118		4.0	14,565		4.1	98.6
4月末	14,378		5.9	14,832		6.0	98.8
5月末	14,450		6.4	14,919		6.6	98.6
6月末	14,951		10.1	15,439		10.3	98.8
7月末	14,408		6.1	14,871		6.3	98.8
8月末	14,037		3.4	14,492		3.6	98.7
9月末	14,068		3.6	14,510		3.7	98.3
10月末	14,652		7.9	15,127		8.1	98.7
(期末)2024年11月20日	円 14,638		% 7.8	15,112		% 8.0	% 98.9

(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
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	3,902,688	6,754,350	3,314,996	5,715,960

(注) 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
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15,831,877	16,419,568	29,479,693

(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債券インデックスマザーファンド全体の口数は51,547,252千口です。

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	29,479,693	99.3
コール・ローン等、その他	199,213	0.7
投資信託財産総額	29,678,907	100.0

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

(注2) ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(92,515,496千円)の投資信託財産総額(93,021,048千円)に対する比率は99.5%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド

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	29,678,907,549円
コール・ローン等	21,976,022
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	29,479,693,870
未収入金	177,237,657
(B)負債	199,336,710
未払解約金	176,609,179
未払信託報酬	22,566,434
その他未払費用	161,097
(C)純資産総額(A-B)	29,479,570,839
元本	20,139,170,978
次期繰越損益金	9,340,399,861
(D)受益権総口数	20,139,170,978口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,638円

(注) 期首元本額	19,388,108,524円
期中追加設定元本額	4,782,729,193円
期中一部解約元本額	4,031,666,739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	10,902円
受取利息	11,116
支払利息	△ 214
(B)有価証券売買損益	1,937,645,306
売買益	2,125,948,729
売買損	△ 188,303,423
(C)信託報酬等	△ 43,474,854
(D)当期損益金(A+B+C)	1,894,181,354
(E)前期繰越損益金	2,540,728,664
(分配準備積立金)	(2,540,728,664)
(F)追加信託差損益金*	4,905,489,843
(配当等相当額)	(6,025,409,736)
(売買損益相当額)	(△1,119,919,893)
(G)合計(D+E+F)	9,340,399,861
次期繰越損益金(G)	9,340,399,861
追加信託差損益金	4,905,489,843
(配当等相当額)	(6,036,831,503)
(売買損益相当額)	(△1,131,341,660)
分配準備積立金	4,434,910,018

- (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	673,634,020円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,220,547,334円
(c) 信託約款に定める収益調整金	6,036,831,503円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	2,540,728,664円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	10,471,741,521円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	5,199.69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／債券／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を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> ニッセイ外国債券 インデックスファンド	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ外国債券 インデックス マザーファンド	日本を除く主要国の国債
運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイ外国債券 インデックスファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ外国債券 インデックス マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
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。	

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 36 期

(計算期間：2024年5月21日～2024年11月20日)

運用方針	主に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
	主に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	日本を除く主要国の国債
運用方法	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 <ul style="list-style-type: none">・ 株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

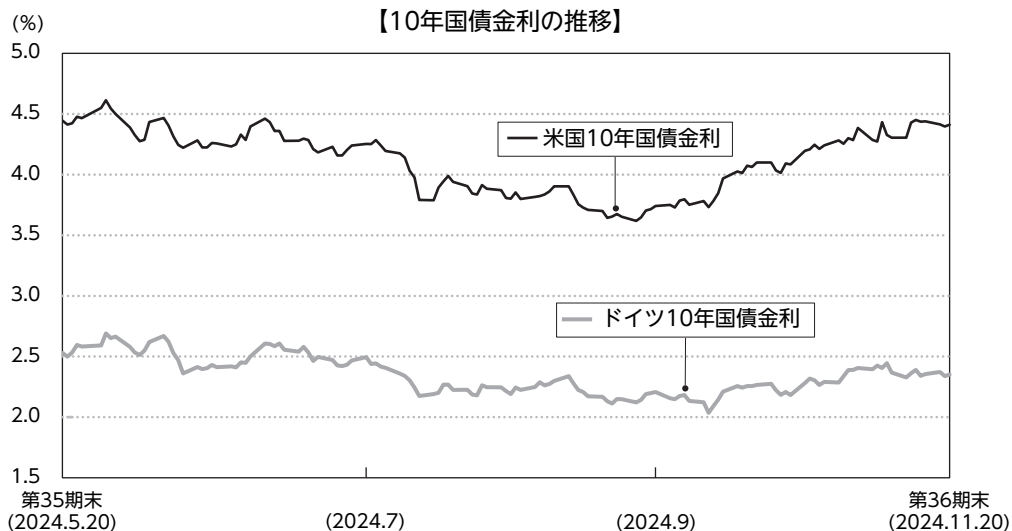
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2024年5月21日～2024年11月20日

投資環境

■ 海外債券市況

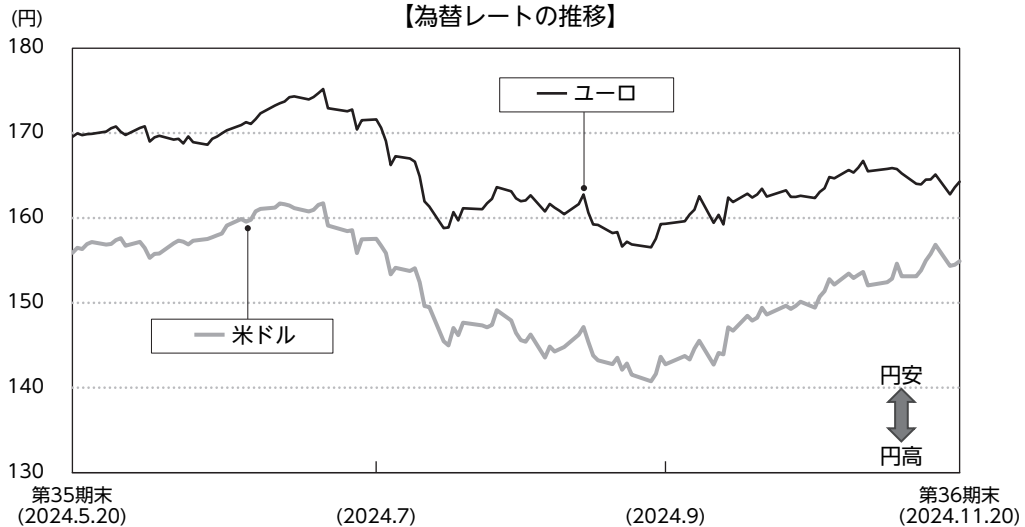


(注) プルームバーグのデータを使用しています。

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

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

■為替市況

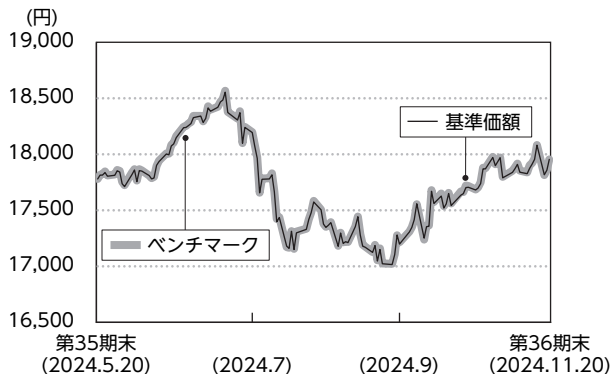


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

基準価額等の推移



■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

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

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2024年5月21日～2024年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	3円	0.017%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.017)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	<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	3	0.017	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

売買および取引の状況

2024年5月21日～2024年11月20日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2024年5月21日～2024年11月20日

公社債

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

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2024年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/02/15	100	102	15,815
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	120	126	19,583
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	120	124	19,276
	US TREASURY	5.3750	2031/02/15	180	190	29,574
	US TREASURY	2.2500	2025/11/15	8,610	8,433	1,306,432
	US TREASURY	2.6250	2025/12/31	1,410	1,383	214,310
	US TREASURY	1.6250	2026/02/15	14,490	14,019	2,171,694
	US TREASURY	2.2500	2026/03/31	2,580	2,509	388,704
	US TREASURY	1.6250	2026/05/15	11,270	10,837	1,678,795
	US TREASURY	1.8750	2026/06/30	2,290	2,204	341,522
	US TREASURY	1.5000	2026/08/15	15,180	14,477	2,242,681
	US TREASURY	0.7500	2026/08/31	1,360	1,277	197,969
	US TREASURY	1.6250	2026/09/30	1,130	1,077	166,849
	US TREASURY	2.0000	2026/11/15	8,190	7,839	1,214,488
	US TREASURY	1.7500	2026/12/31	2,230	2,118	328,163
	US TREASURY	2.2500	2027/02/15	7,800	7,468	1,156,897
	US TREASURY	0.6250	2027/03/31	2,070	1,903	294,859
	US TREASURY	2.3750	2027/05/15	8,580	8,204	1,270,978
	US TREASURY	0.5000	2027/06/30	3,820	3,468	537,338
	US TREASURY	2.2500	2027/08/15	7,710	7,318	1,133,742
	US TREASURY	0.3750	2027/09/30	1,460	1,309	202,791
	US TREASURY	2.2500	2027/11/15	6,340	5,987	927,572
	US TREASURY	0.6250	2027/12/31	1,170	1,047	162,226
	US TREASURY	2.7500	2028/02/15	5,930	5,663	877,278
	US TREASURY	1.1250	2028/02/29	1,310	1,185	183,667
	US TREASURY	1.2500	2028/03/31	1,150	1,042	161,486
	US TREASURY	1.2500	2028/04/30	1,390	1,257	194,759
	US TREASURY	2.8750	2028/05/15	6,210	5,934	919,374
	US TREASURY	1.2500	2028/05/31	900	812	125,820
	US TREASURY	2.8750	2028/08/15	7,100	6,762	1,047,573
	US TREASURY	1.1250	2028/08/31	1,670	1,488	230,615
	US TREASURY	1.3750	2028/10/31	1,940	1,738	269,333
	US TREASURY	3.1250	2028/11/15	5,430	5,206	806,589
	US TREASURY	1.5000	2028/11/30	1,820	1,635	253,390
	US TREASURY	2.6250	2029/02/15	9,370	8,781	1,360,323
	US TREASURY	2.3750	2029/05/15	9,000	8,315	1,288,203
	US TREASURY	1.6250	2029/08/15	8,720	7,754	1,201,212

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千米ドル	千円
アメリカ	%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券					
US TREASURY	3.1250	2041/11/15	300	248	38,475
US TREASURY	2.3750	2042/02/15	1,130	825	127,872
US TREASURY	3.1250	2042/02/15	330	271	42,100
US TREASURY	3.0000	2042/05/15	290	233	36,126
US TREASURY	3.2500	2042/05/15	1,040	867	134,359
US TREASURY	2.7500	2042/08/15	350	269	41,784
US TREASURY	3.3750	2042/08/15	910	770	119,349
US TREASURY	2.7500	2042/11/15	520	399	61,824
US TREASURY	4.0000	2042/11/15	890	821	127,313
US TREASURY	3.1250	2043/02/15	450	365	56,546
US TREASURY	3.8750	2043/02/15	890	805	124,814
US TREASURY	2.8750	2043/05/15	690	536	83,046
US TREASURY	3.8750	2043/05/15	900	813	125,999
US TREASURY	3.6250	2043/08/15	500	434	67,333
US TREASURY	4.3750	2043/08/15	960	927	143,640
US TREASURY	3.7500	2043/11/15	510	450	69,794
US TREASURY	4.7500	2043/11/15	980	993	153,827
US TREASURY	3.6250	2044/02/15	530	458	71,056
US TREASURY	4.5000	2044/02/15	980	960	148,751
US TREASURY	3.3750	2044/05/15	490	408	63,212
US TREASURY	4.6250	2044/05/15	980	975	151,146
US TREASURY	3.1250	2044/08/15	670	534	82,815
US TREASURY	4.1250	2044/08/15	630	586	90,806
US TREASURY	3.0000	2044/11/15	560	436	67,650
US TREASURY	2.5000	2045/02/15	740	527	81,724
US TREASURY	3.0000	2045/05/15	340	264	40,900
US TREASURY	2.8750	2045/08/15	480	364	56,394
US TREASURY	3.0000	2045/11/15	300	232	35,949
US TREASURY	2.5000	2046/02/15	600	422	65,417
US TREASURY	2.5000	2046/05/15	600	420	65,207
US TREASURY	2.2500	2046/08/15	750	498	77,292
US TREASURY	2.8750	2046/11/15	340	254	39,411
US TREASURY	3.0000	2047/02/15	670	510	79,135
US TREASURY	3.0000	2047/05/15	520	395	61,298
US TREASURY	2.7500	2047/08/15	730	529	81,968
US TREASURY	2.7500	2047/11/15	740	535	82,889
US TREASURY	3.0000	2048/02/15	830	627	97,280
US TREASURY	3.1250	2048/05/15	890	687	106,562

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	3.0000	2048/08/15	1,000	753	116,757
	US TREASURY	3.3750	2048/11/15	1,000	805	124,840
	US TREASURY	3.0000	2049/02/15	1,080	811	125,639
	US TREASURY	2.8750	2049/05/15	1,030	754	116,824
	US TREASURY	2.2500	2049/08/15	1,000	640	99,232
	US TREASURY	2.3750	2049/11/15	940	618	95,742
	US TREASURY	2.0000	2050/02/15	1,190	715	110,913
	US TREASURY	1.3750	2050/08/15	1,540	780	120,910
	US TREASURY	1.6250	2050/11/15	1,530	828	128,356
	US TREASURY	1.8750	2051/02/15	1,660	959	148,674
	US TREASURY	2.3750	2051/05/15	1,720	1,121	173,708
	US TREASURY	2.0000	2051/08/15	1,710	1,015	157,374
	US TREASURY	1.8750	2051/11/15	1,580	906	140,410
	US TREASURY	2.2500	2052/02/15	1,440	906	140,489
	US TREASURY	2.8750	2052/05/15	1,340	972	150,607
	US TREASURY	3.0000	2052/08/15	1,310	975	151,176
	US TREASURY	4.0000	2052/11/15	1,300	1,174	181,983
	US TREASURY	3.6250	2053/02/15	1,300	1,096	169,876
	US TREASURY	3.6250	2053/05/15	1,290	1,088	168,631
	US TREASURY	4.1250	2053/08/15	1,440	1,330	206,172
	US TREASURY	4.7500	2053/11/15	1,530	1,569	243,131
	US TREASURY	4.2500	2054/02/15	1,610	1,522	235,919
	US TREASURY	4.6250	2054/05/15	1,580	1,591	246,554
	US TREASURY	4.2500	2054/08/15	1,320	1,250	193,649
	US TREASURY	6.2500	2030/05/15	150	164	25,466
	US TREASURY	0.6250	2030/05/15	4,420	3,635	563,140
US TREASURY	4.3750	2040/05/15	310	304	47,211	
US TREASURY	4.3750	2041/05/15	300	293	45,537	
US TREASURY	3.7500	2041/08/15	280	253	39,221	
US TREASURY	1.2500	2050/05/15	1,380	678	105,158	
小計		-	-	-	-	42,916,152
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	4.5000	2025/11/01	410	414	45,991
	CANADIAN GOVERNMENT	4.5000	2026/02/01	520	527	58,515
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2026/03/01	420	404	44,872
	CANADIAN GOVERNMENT	3.0000	2026/04/01	240	239	26,539
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2026/05/01	590	596	66,145
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/06/01	190	185	20,567

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	91,538,259	98.4
コール・ローン等、その他	1,482,788	1.6
投資信託財産総額	93,021,048	100.0

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	93,067,446,882円
コーポレート債(評価額)	857,912,337
未収入金	91,538,259,497
未収入利息	57,322,000
前払費用	555,900,675
未払金	58,052,373
(B)負債	517,514,897
未払金	243,166,837
未払解約金	274,348,060
(C)純資産総額(A-B)	92,549,931,985
元本	51,547,252,121
次期繰越損益金	41,002,679,864
(D)受益権総口数	51,547,252,121口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,954円

(注1) 期首元本額 47,657,979,877円
 期中追加設定元本額 9,522,485,855円
 期中一部解約元本額 5,633,213,611円

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

DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	3,719,554,724円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,943,025,077円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,119,770,989円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	948,516,964円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)	
SA(適格機関投資家限定)	1,748,607円
ニッセイインデックスバランス(標準型)	
SA(適格機関投資家限定)	1,820,511円
ニッセイインデックスバランス(成長型)	
SA(適格機関投資家限定)	4,169,717円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	16,419,568,826円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	9,407,607,078円
DCニッセイ外国債券インデックス	5,312,167,039円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	415,696,244円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	2,277,794,873円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	481,210,463円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	658,843,100円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	47,605,942円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	232,962,464円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	23,409,296円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	53,877,032円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	343,759,203円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	233,207,795円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	418,890,043円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	229,579,308円
FWニッセイ外国債券インデックス	87,499,591円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	161,963,647円
DCニッセイターゲットデートファンド2070	3,003,588円

損益の状況

当期(2024年5月21日~2024年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,111,665,457円
受取利息	1,111,656,322
その他収益金	9,135
(B)有価証券売買損益	△ 183,191,904
売買益	1,521,544,924
売買損	△ 1,704,736,828
(C)信託報酬等	△ 14,988,773
(D)当期損益金(A+B+C)	913,484,780
(E)前期繰越損益金	37,079,358,443
(F)追加信託差損益金	7,310,657,552
(G)解約差損益金	△ 4,300,820,911
(H)合計(D+E+F+G)	41,002,679,864
次期繰越損益金(H)	41,002,679,864

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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