

## 第11期末 (2025年11月20日)

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 40,021円 |
| 純資産総額 | 2,767億円 |
| 騰落率   | 17.1%   |
| 分配金   | 0円      |

# DCニッセイ 外国株式インデックス

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:2024年11月21日～2025年11月20日

第11期(決算日 2025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「DCニッセイ外国株式インデックス」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。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター 0120-762-506

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2024年11月21日～2025年11月20日

## 基準価額等の推移



|       |         |                 |       |
|-------|---------|-----------------|-------|
| 第11期首 | 34,172円 | 既払分配金           | 0円    |
| 第11期末 | 40,021円 | 騰落率 (分配金再投資ベース) | 17.1% |

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

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

(注3) 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「指標に関して」をご参照ください。

## 基準価額の主な変動要因

### <上昇要因>

- 2025年5月から6月にかけて、トランプ米政権の関税政策を巡る懸念が和らいだことや中東の地政学リスクが早期に緩和したことなどを受けて株価が上昇したこと
- 7月から10月にかけて、米国と主要国間において関税交渉が相次いで合意に至ったことや、米連邦準備制度理事会（F R B）による利下げ実施、主要なグローバル企業の業績発表などを受けて株価が上昇したこと
- 10月から11月にかけて、日銀の追加利上げ観測が後退したことなどから主要通貨に対して円安が進行したこと

### <下落要因>

- 2025年2月にトランプ米大統領による関税強化懸念の高まりを背景とした米景況感悪化懸念から米株式市場を中心に株価が下落したことと加えて、円高が進行したこと
- 当期末にかけてF R Bの政策不透明感に加え、生成人工知能（A I）関連銘柄への過熱感を警戒する売りが優勢となったことなどから株価が下落したこと

# DCニッセイ外国株式インデックス

## 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       | 35円  | 0.099%  | 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$<br>期中の平均基準価額は34,935円です。  |
| (投信会社)     | (13) | (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)     | (14) | (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) | (0.000) | 売買委託手数料 : 有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料  |
| (投資信託証券)   | ( 0) | (0.000) |   |
| 有価証券取引税    | 1    | 0.002   |   |
| (株式)       | ( 1) | (0.002) | 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数   |
| (投資信託証券)   | ( 0) | (0.000) | 有価証券取引税 : 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| その他費用      | 4    | 0.010   | その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数   |
| (保管費用)     | ( 3) | (0.008) | 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)      | ( 1) | (0.002) | <ul style="list-style-type: none"> <li>・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul> |
| 合計         | 39   | 0.112   |   |

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

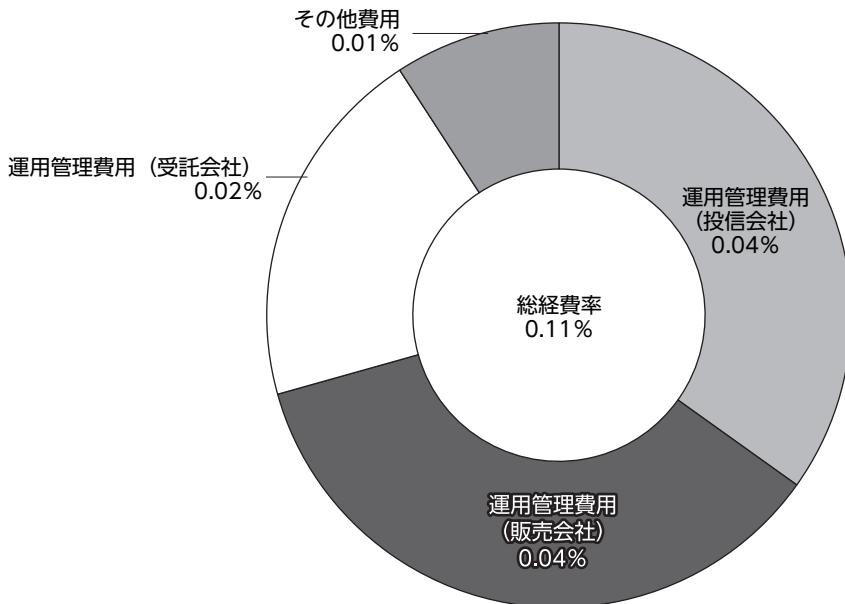
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## (参考情報)

## ■総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）**は0.11%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。

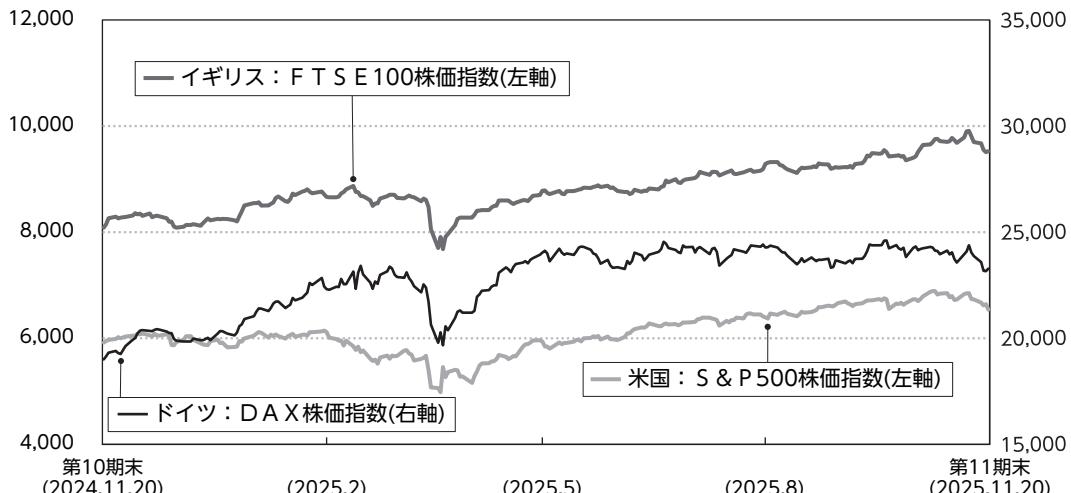
(注3) 各比率は年率換算した値です。

(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。

当期の先進国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

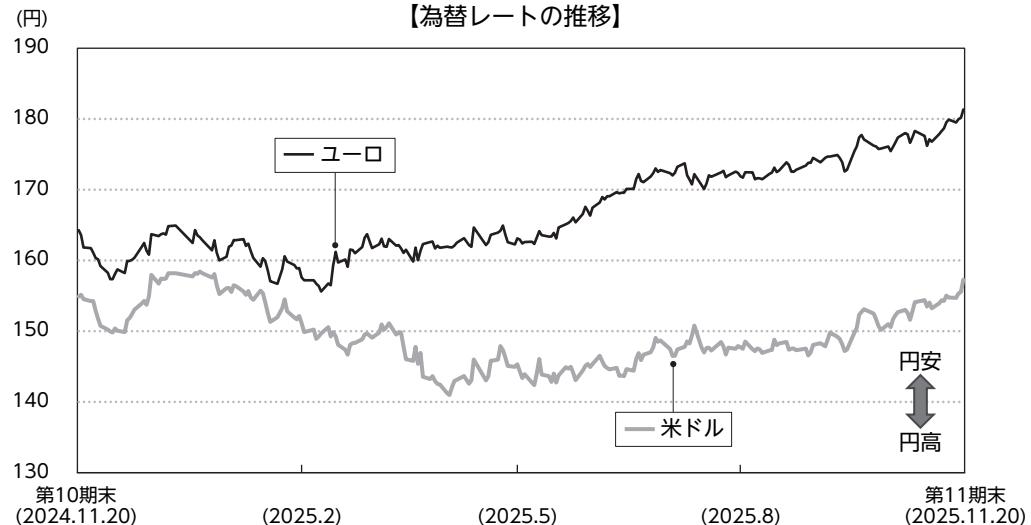
2025年4月上旬の米関税政策を巡る不透明感を受けて下落する場面はありました。主要企業の好業績や米英および米中間の通商協議進展による景気悪化懸念の後退などから上昇しました。

当期の海外株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初は、米国の生成A I関連企業の好調な決算等を背景に上昇したものの、F R Bの利下げ鈍化懸念に伴う金利上昇や中国景気への警戒感から米株式市場は下落しました。2025年初から2月にかけては、トランプ米政権の政策を巡る不透明感を背景とした景気減速懸念等により株価が下落する場面があったものの、A Iインフラ投資や金融機関の好決算などが好感され上昇しました。3月から4月にかけては、主要企業の好業績などを受けて株価はおおむね堅調に推移していましたが、4月上旬に米関税政策を巡る不透明感から急落する展開となりました。その後は、主要企業の好業績が下支えとなり反発し、5月から6月は米英や米中間の通商協議進展による景気悪化懸念の後退や、中東情勢の緊張緩和による地政学リスクの後退を背景に上昇しました。7月から10月にかけては、関税交渉合意や対中規制緩和、F R Bによる利下げ再開や生成A I関連の大型受注などを背景に株価は上昇しましたが、当期末にかけては、F R Bの政策不透明感に加え、生成A I関連銘柄への過熱感を警戒する売りが優勢となり下落しました。

# DCニッセイ外国株式インデックス

## ■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、期初から植田日銀総裁が追加利上げを示唆したとの報道などを受け、米ドル安円高となりましたが、2024年12月には米国で追加利下げに慎重な姿勢が見られ、米ドル高円安となりました。その後は日銀の利上げ期待が高まることやトランプ米大統領の就任を控え投資家のリスク回避姿勢が高まることなどから、米ドル安円高で推移しました。2025年4月にはトランプ米政権による関税政策をめぐる不透明感が高まり、さらに米ドル安円高となりました。その後は上下しつつ横ばいで推移しましたが、10月には自民党総裁選で高市氏が勝利したこと、財政拡張的な政策が示されるとの思惑から、期末にかけて米ドル高円安基調が継続し、結局、期を通じて見ると米ドル高円安となりました。

当期のユーロ／円レートは、期初から米国の関税が欧州景気の下押し圧力となることが意識され、ユーロ安円高となりましたが、2024年12月には米国で追加利下げに慎重な姿勢が見られ、米ドル円主導でユーロ高円安となりました。その後は日銀の利上げ期待が高まることやトランプ米大統領の就任を控え投資家のリスク回避姿勢が高まることなどから、ユーロ安円高で推移しました。2025年3月にはドイツ首相が大規模な財政拡大案について合意したことが報じられ、欧州金利が大幅に上昇したことから、ユーロ高円安となりました。その後は横ばいに推移しましたが、6月から7月にかけては追加利下げに慎重なECBと、利上げに慎重な日銀という金融政策の方向性が鮮明となり、ユーロ高円安で推移しました。10月には自民党総裁選で高市氏が勝利したこと、財政拡張的な政策が示されるとの思惑から、期末にかけてユーロ高円安基調が継続し、結局、期を通じて見るとユーロ高円安となりました。

## ポートフォリオ

### ■当ファンド

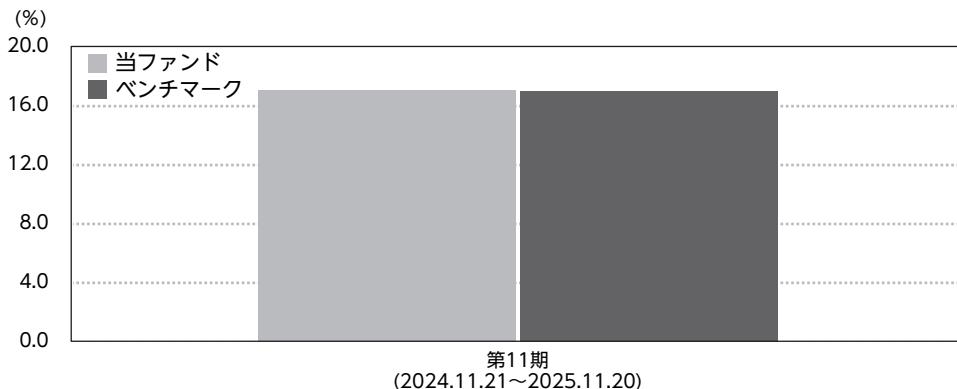
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの收益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

### ■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「指標について」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+17.1%となり、ベンチマーク騰落率 (+17.0%) 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、見送さ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<br>2024年11月21日～2025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  | 30,021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<br>2025年11月20日 |
|---------------------------|----------------------|
| ニッセイ外国株式インデックス<br>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

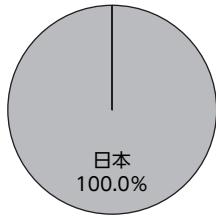
| 項目         | 第11期末<br>2025年11月20日 |
|------------|----------------------|
| 純資産総額      | 276,744,434,504円     |
| 受益権総口数     | 69,149,215,592口      |
| 1万口当たり基準価額 | 40,021円              |

(注) 当期間中における追加設定元本額は11,867,720,858円、同解約元本額は7,639,568,576円です。

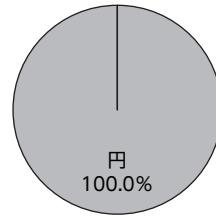
### ■資産別配分



### ■国別配分



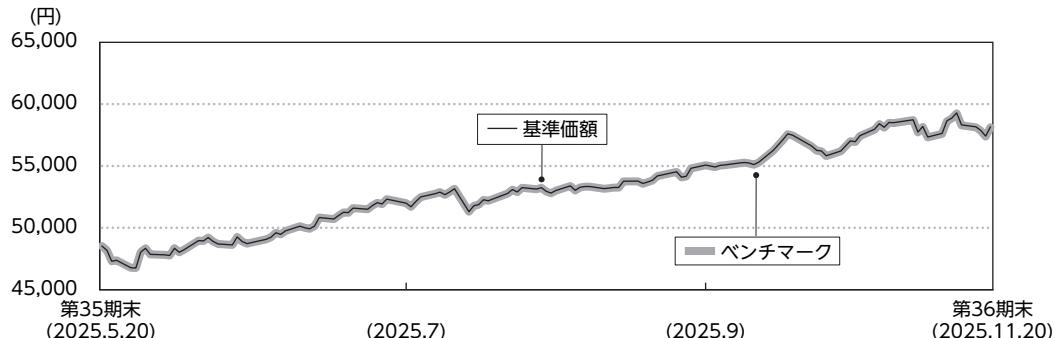
### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2025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スマザーファンドの概要

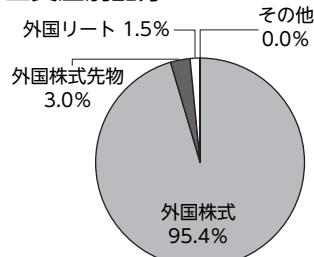
### ■基準価額の推移



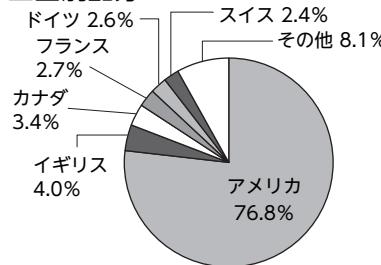
### ■上位銘柄

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

### ■資産別配分



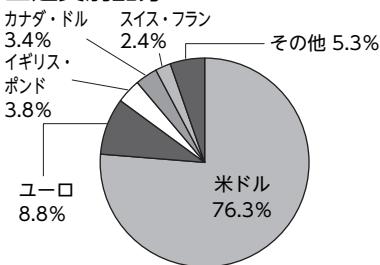
### ■国別配分



### ■1万口当たりの費用明細

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

### ■通貨別配分



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

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

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

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

# DCニッセイ外国株式インデックス

## 最近5期の運用実績

| 決算期              | 基準価額<br>(分配落) | 税引前<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (ご参考) 基準価額+累計分配金 |        | ベンチ<br>マーク | 期中<br>騰落率 | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|------------------|---------------|------------|-----------|------------------|--------|------------|-----------|------------|------------|--------------------|-----------|
|                  |               |            |           | 円                | 円      |            |           |            |            |                    |           |
| 7期(2021年11月22日)  | 20,414        | 0          | 42.2      | 20,414           | 20,421 | 42.2       | 94.9      | 2.9        | 2.1        | 80,296             |           |
| 8期(2022年11月21日)  | 21,153        | 0          | 3.6       | 21,153           | 21,153 | 3.6        | 94.1      | 2.9        | 2.1        | 102,474            |           |
| 9期(2023年11月20日)  | 25,824        | 0          | 22.1      | 25,824           | 25,790 | 21.9       | 94.4      | 3.6        | 1.9        | 146,333            |           |
| 10期(2024年11月20日) | 34,172        | 0          | 32.3      | 34,172           | 34,112 | 32.3       | 95.2      | 2.7        | 1.8        | 221,848            |           |
| 11期(2025年11月20日) | 40,021        | 0          | 17.1      | 40,021           | 39,923 | 17.0       | 95.4      | 3.0        | 1.5        | 276,744            |           |

(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<br>マーク | 騰落率    | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 |
|------------------|--------|--------|------------|--------|------------|------------|--------------------|
|                  |        |        |            |        |            |            |                    |
| (期首) 2024年11月20日 | 34,172 | —      | 34,112     | —      | 95.2       | 2.7        | 1.8                |
| 11月末             | 33,715 | △ 1.3  | 33,658     | △ 1.3  | 96.1       | 2.0        | 1.9                |
| 12月末             | 35,060 | 2.6    | 34,997     | 2.6    | 96.5       | 1.8        | 1.7                |
| 2025年1月末         | 35,133 | 2.8    | 35,070     | 2.8    | 96.1       | 2.1        | 1.7                |
| 2月末              | 33,286 | △ 2.6  | 33,219     | △ 2.6  | 95.2       | 2.8        | 1.8                |
| 3月末              | 32,090 | △ 6.1  | 32,020     | △ 6.1  | 95.3       | 2.9        | 1.8                |
| 4月末              | 30,737 | △ 10.1 | 30,663     | △ 10.1 | 94.4       | 3.7        | 1.8                |
| 5月末              | 32,940 | △ 3.6  | 32,866     | △ 3.7  | 95.6       | 2.7        | 1.7                |
| 6月末              | 34,504 | 1.0    | 34,425     | 0.9    | 96.0       | 2.2        | 1.6                |
| 7月末              | 36,413 | 6.6    | 36,330     | 6.5    | 95.8       | 2.6        | 1.6                |
| 8月末              | 36,707 | 7.4    | 36,623     | 7.4    | 96.3       | 2.0        | 1.6                |
| 9月末              | 38,046 | 11.3   | 37,957     | 11.3   | 96.0       | 2.4        | 1.6                |
| 10月末             | 40,252 | 17.8   | 40,153     | 17.7   | 95.7       | 2.8        | 1.5                |
| (期末) 2025年11月20日 | 40,021 | 17.1   | 39,923     | 17.0   | 95.4       | 3.0        | 1.5                |

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

# DCニッセイ外国株式インデックス

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2024年11月21日～2025年11月20日

|                        | 設定        |            | 解約        |            |
|------------------------|-----------|------------|-----------|------------|
|                        | 口数        | 金額         | 口数        | 金額         |
| 千円                     | 千円        | 千円         | 千円        | 千円         |
| ニッセイ外国株式インデックススマザーファンド | 8,170,527 | 41,355,711 | 5,305,716 | 26,749,322 |

(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スマザーファンド |  |
| (a) 期中の株式売買金額     | 99,391,778千円           |  |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,177,366,615千円        |  |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 0.08                   |  |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

## 利害関係人との取引状況等

2024年11月21日～2025年11月20日

### 利害関係人の発行する有価証券等

<ニッセイ外国株式インデックススマザーファンド>

| 種類  | 当期  |     |        |
|-----|-----|-----|--------|
|     | 買付額 | 売付額 | 当期末保有額 |
| 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円    |
| 株式  | 15  | 0   | 139    |

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

(注2) 金額は受渡代金です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

## 親投資信託残高

2025年11月20日現在

| 種類                     | 期首(前期末)    |            | 当期末         |    |
|------------------------|------------|------------|-------------|----|
|                        | 口数         | 口数         | 評価額         | 千円 |
| ニッセイ外国株式インデックススマザーファンド | 44,717,793 | 47,582,603 | 276,745,182 | 千円 |

(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スマザーファンド全体の口数は247,967,645千口です。

# DCニッセイ外国株式インデックス

## 投資信託財産の構成

2025年11月20日現在

| 項目                     | 当期末                |              |
|------------------------|--------------------|--------------|
|                        | 評価額                | 比率           |
| ニッセイ外国株式インデックススマザーファンド | 276,745,182        | 99.8         |
| コール・ローン等、その他           | 517,664            | 0.2          |
| <b>投資信託財産総額</b>        | <b>277,262,847</b> | <b>100.0</b> |

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.29円、1カナダ・ドル111.96円、1オーストラリア・ドル101.96円、1香港ドル20.19円、1シンガポール・ドル120.36円、1ニュージーランド・ドル88.22円、1イギリス・ポンド205.31円、1イスラエル・シェケル48.131円、1スイス・フラン195.20円、1デンマーク・クローネ24.28円、1ノルウェー・クローネ15.46円、1スウェーデン・クローナ16.47円、1ユーロ181.34円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックス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(1,423,073,172千円)の投資信託財産総額(1,444,333,630千円)に対する比率は98.5%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2025年11月20日現在)

| 項目                          | 当期末                     |
|-----------------------------|-------------------------|
| <b>(A)資産</b>                | <b>277,262,847,424円</b> |
| コール・ローン等                    | 121,186,539             |
| ニッセイ外国株式インデックススマザーファンド(評価額) | 276,745,182,728         |
| 未収入金                        | 396,478,157             |
| <b>(B)負債</b>                | <b>518,412,920</b>      |
| 未払解約金                       | 392,693,385             |
| 未払信託報酬                      | 124,336,575             |
| その他未払費用                     | 1,382,960               |
| <b>(C)純資産総額(A-B)</b>        | <b>276,744,434,504</b>  |
| 元本                          | 69,149,215,592          |
| 次期繰越損益金                     | 207,595,218,912         |
| <b>(D)受益権総口数</b>            | <b>69,149,215,592口</b>  |
| 1万口当たり基準価額(C/D)             | 40,021円                 |

(注) 期首元本額 64,921,063,310円  
 期中追加設定元本額 11,867,720,858円  
 期中一部解約元本額 7,639,568,576円

## 損益の状況

当期(2024年11月21日～2025年11月20日)

| 項目                     | 当期                     |
|------------------------|------------------------|
| <b>(A)配当等収益</b>        | <b>231,885円</b>        |
| 受取利息                   | 231,885                |
| <b>(B)有価証券売買損益</b>     | <b>39,865,627,809</b>  |
| 売買益                    | 41,628,054,216         |
| 売買損                    | △ 1,762,426,407        |
| <b>(C)信託報酬等</b>        | <b>△ 234,684,341</b>   |
| <b>(D)当期損益金(A+B+C)</b> | <b>39,631,175,353</b>  |
| <b>(E)前期繰越損益金</b>      | <b>79,970,194,470</b>  |
| (分配準備積立金)              | ( 79,970,194,470 )     |
| <b>(F)追加信託差損益金*</b>    | <b>87,993,849,089</b>  |
| (配当等相当額)               | ( 68,563,451,807 )     |
| (売買損益相当額)              | ( 19,430,397,282 )     |
| <b>(G)合計(D+E+F)</b>    | <b>207,595,218,912</b> |
| <b>次期繰越損益金(G)</b>      | <b>207,595,218,912</b> |
| 追加信託差損益金               | 87,993,849,089         |
| (配当等相当額)               | ( 68,563,451,807 )     |
| (売買損益相当額)              | ( 19,430,397,282 )     |
| 分配準備積立金                | 119,601,369,823        |

(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           | 231,885円         |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益       | 39,630,943,468円  |
| (c) 信託約款に定める収益調整金         | 87,993,849,089円  |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金       | 79,970,194,470円  |
| (e) 分配対象額 (a + b + c + d) | 207,595,218,912円 |
| (f) 分配対象額 (1万口当たり)        | 30,021.34円       |
| (g) 分配金                   | 0円               |
| (h) 分配金 (1万口当たり)          | 0円               |

# お知らせ

## ■運用報告書の電子交付について

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

(2025年4月1日)

## ■約款変更

運用報告書に関する記載の変更を行うため関連条項に所要の変更を行いました。

(2025年4月1日)

# 運用者情報

## ■当社運用担当者情報について

- 当社の運用担当者情報はHP上よりご確認いただけます。

## ■DCニッセイ外国株式インデックス（確定拠出年金向け）



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

# 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指し運用を行います。 |   |
| 主要運用対象  | D C ニッセイ<br>外国株式インデックス   | 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<br>インデックス<br>マザーファンド  | 日本を除く主要先進国の株式   |
| 運 用 方 法 | D C ニッセイ<br>外国株式インデックス   | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。<br>・株式への実質投資割合には、制限を設けません。<br>・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<br>インデックス<br>マザーファンド  | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。<br>・株式への投資割合には、制限を設けません。<br>・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。     |
| 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。   |   |

【受益者の皆様へ】 法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

# ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 36 期

(計算期間：2025年5月21日～2025年11月20日)

#### 運用方針

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

#### 主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

#### 運用方法

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

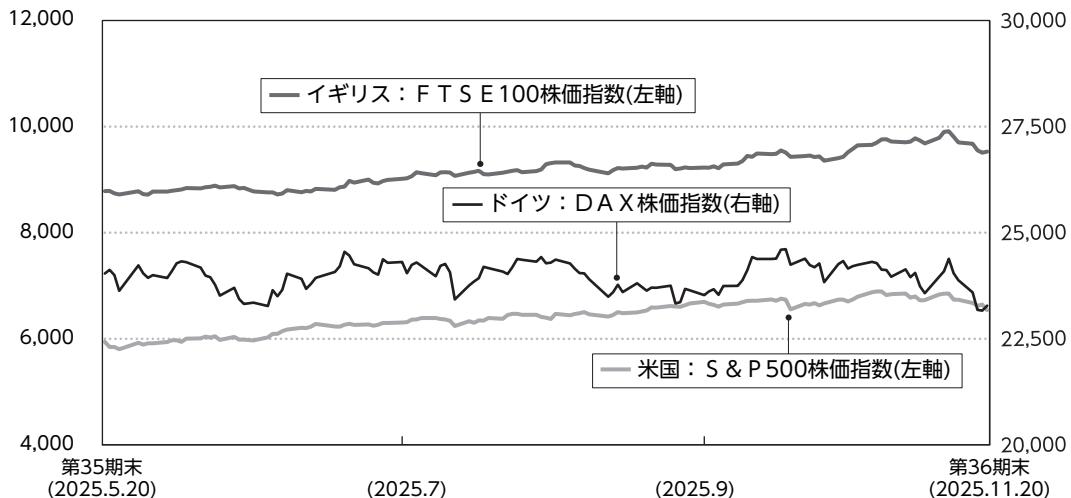
# 運用経過

2025年5月21日～2025年11月20日

## 投資環境

### ■海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



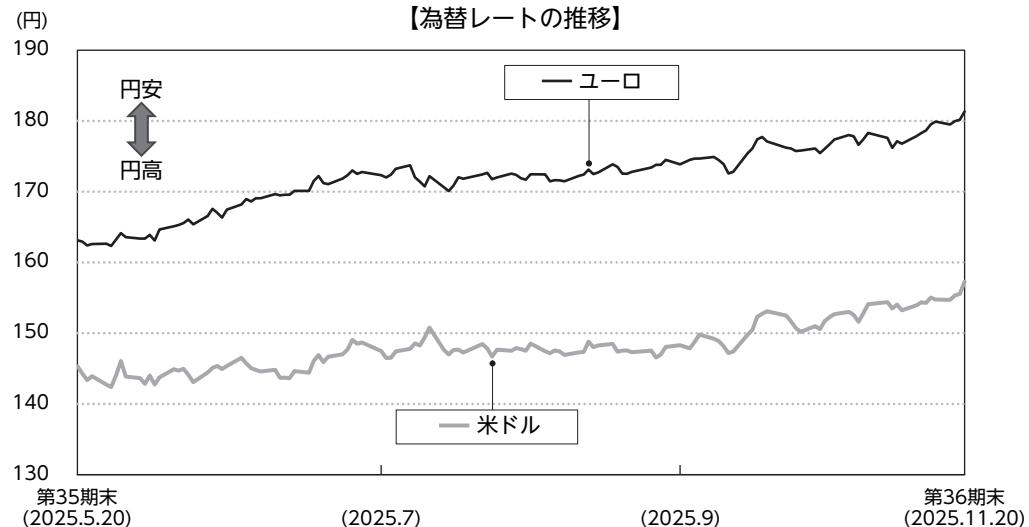
(注) FactSetのデータを使用しています。

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

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

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

## ■為替市況

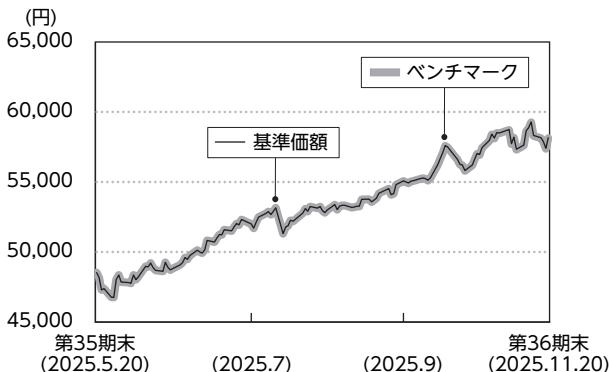


(注) 対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

## 基準価額等の推移



### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

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

#### <下落要因>

- ・当期末にかけてF R Bの政策不透明感に加え、生成A I関連銘柄への過熱感を警戒する売りが優勢となしたことなどから株価が下落したこと

## ポートフォリオ

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

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+19.9%となり、ベンチマーク騰落率(+19.8%)にはほぼ連動しました。

## 今後の運用方針

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

## お知らせ

### ■約款変更

運用報告書に関する記載の変更を行うため関連条項に所要の変更を行いました。

(2025年4月1日)

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## 最近5期の運用実績

| 決算期              | 基準価額   | 期中騰落率 | ベンチマーク | 期中騰落率 | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額     |
|------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|------------|-----------|
|                  |        |       | %      |       |        |        |            |           |
|                  | 円      | %     |        | %     | %      | %      | %          | 百万円       |
| 32期(2023年11月20日) | 37,454 | 15.3  | 36,382 | 15.2  | 94.4   | 3.6    | 1.9        | 827,057   |
| 33期(2024年5月20日)  | 45,829 | 22.4  | 44,477 | 22.2  | 95.8   | 2.1    | 1.8        | 1,045,118 |
| 34期(2024年11月20日) | 49,611 | 8.3   | 48,122 | 8.2   | 95.2   | 2.7    | 1.8        | 1,175,777 |
| 35期(2025年5月20日)  | 48,526 | △ 2.2 | 47,018 | △ 2.3 | 96.0   | 2.0    | 1.7        | 1,181,247 |
| 36期(2025年11月20日) | 58,161 | 19.9  | 56,320 | 19.8  | 95.4   | 3.0    | 1.5        | 1,442,209 |

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日             | 基準価額   | 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)2025年5月20日  | 48,526 | —     | 47,018 | —     | 96.0   | 2.0    | 1.7        |
| 5月末             | 47,848 | △ 1.4 | 46,364 | △ 1.4 | 95.6   | 2.7    | 1.7        |
| 6月末             | 50,124 | 3.3   | 48,564 | 3.3   | 96.0   | 2.2    | 1.6        |
| 7月末             | 52,901 | 9.0   | 51,250 | 9.0   | 95.8   | 2.6    | 1.6        |
| 8月末             | 53,333 | 9.9   | 51,665 | 9.9   | 96.3   | 2.0    | 1.6        |
| 9月末             | 55,282 | 13.9  | 53,546 | 13.9  | 96.0   | 2.4    | 1.6        |
| 10月末            | 58,493 | 20.5  | 56,643 | 20.5  | 95.7   | 2.8    | 1.5        |
| (期末)2025年11月20日 | 58,161 | 19.9  | 56,320 | 19.8  | 95.4   | 3.0    | 1.5        |

(注) 謄落率は期首比です。

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## 1万口当たりの費用明細

2025年5月21日～2025年11月20日

| 項目         | 当期       |              | 項目の概要   |
|------------|----------|--------------|---|
|            | 金額       | 比率           |   |
| 売買委託手数料    | 0円       | 0.000%       |   |
| (株式)       | (0)      | (0.000)      | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数   |
| (先物・オプション) | (0)      | (0.000)      | 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料  |
| (投資信託証券)   | (0)      | (0.000)      |   |
| 有価証券取引税    | 1        | 0.001        |   |
| (株式)       | (1)      | (0.001)      | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数   |
| (投資信託証券)   | (0)      | (0.000)      | 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| その他費用      | 2        | 0.004        | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数   |
| (保管費用)     | (2)      | (0.004)      | 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用  |
| (その他)      | (0)      | (0.000)      | <ul style="list-style-type: none"> <li>・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul> |
| <b>合計</b>  | <b>3</b> | <b>0.005</b> |   |

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（53,098円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

売買および取引の状況

2025年5月21日～2025年11月20日

(1) 株式

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

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

**(2) 投資信託証券**

| 銘柄                           | 買付    |      | 売付 |       |
|------------------------------|-------|------|----|-------|
|                              | 口数    | 金額   | 口数 | 金額    |
| (アメリカ)                       | 千口    | 千米ドル | 千口 | 千米ドル  |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 0.405 | 27   | —  | —     |
| CROWN CASTLE INC             | 1     | 110  | —  | —     |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 0.219 | 16   | —  | —     |
| PROLOGIS INC                 | 2     | 262  | —  | —     |
| ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT   | 6     | 131  | —  | —     |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 0.355 | 70   | —  | —     |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 0.273 | 30   | —  | —     |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 3     | 202  | —  | —     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 0.163 | 44   | —  | —     |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 1     | 23   | —  | —     |
| WELLTOWER INC                | 5     | 809  | —  | —     |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC  | —     | —    | 80 | 1,252 |
| KIMCO REALTY CORP            | 1     | 41   | —  | —     |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 0.299 | 44   | —  | —     |
| PUBLIC STORAGE               | 0.397 | 118  | —  | —     |
| REGENCY CENTERS CORP         | 0.410 | 29   | —  | —     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 0.791 | 134  | —  | —     |
| SUN COMMUNITIES INC          | 0.332 | 41   | —  | —     |
| UDR INC                      | 0.928 | 37   | —  | —     |
| VENTAS INC                   | 4     | 310  | —  | —     |
| WP CAREY INC                 | 0.529 | 34   | —  | —     |
| REALTY INCOME CORP           | 5     | 306  | —  | —     |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 0.456 | 28   | —  | —     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 0.534 | 78   | —  | —     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 1     | 234  | —  | —     |
| IRON MOUNTAIN INC            | 0.870 | 82   | —  | —     |
| AMERICAN TOWER REIT INC      | 1     | 252  | —  | —     |
| EQUINIX INC                  | 0.386 | 330  | —  | —     |

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

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

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

# 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<br>国 株式先物取引 | 百万円    | 百万円    | 百万円   | 百万円 |
|               | 92,256 | 77,352 | —     | —   |

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2025年5月21日～2025年11月20日

### 株式

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

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

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

## 組入有価証券明細表

2025年11月20日現在

## (1) 外国株式

| 銘柄                             | 期首(前期末) | 当期末    |         |                 | 業種等                    |
|--------------------------------|---------|--------|---------|-----------------|------------------------|
|                                | 株数      | 株数     | 評価額     | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                        |
| (アメリカ)                         | 百株      | 百株     | 千米ドル    | 千円              |                        |
| 3M CO                          | 629     | 634    | 10,568  | 1,662,372       | 資本財                    |
| ABBOTT LABORATORIES            | 2,004   | 2,051  | 25,876  | 4,070,038       | ヘルスケア機器・サービス           |
| ABBVIE INC                     | 2,041   | 2,082  | 48,504  | 7,629,299       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ACCENTURE PLC                  | 722     | 734    | 17,705  | 2,784,881       | ソフトウェア・サービス            |
| ADOBE INC                      | 502     | 500    | 15,908  | 2,502,276       | ソフトウェア・サービス            |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC     | 1,875   | 1,911  | 42,731  | 6,721,285       | 半導体・半導体製造装置            |
| AECOM                          | 153     | 155    | 1,761   | 277,131         | 資本財                    |
| AERCAP HOLDINGS NV             | 224     | 207    | 2,749   | 432,473         | 資本財                    |
| AFFIRM HOLDINGS INC            | —       | 315    | 2,063   | 324,556         | 金融サービス                 |
| AFLAC INC                      | 609     | 605    | 6,621   | 1,041,537       | 保険                     |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC       | 329     | 334    | 4,835   | 760,624         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC   | 256     | 262    | 6,645   | 1,045,236       | 素材                     |
| AIRBNB INC-CLASS A             | 500     | 508    | 5,822   | 915,817         | 消費者サービス                |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC        | 173     | 172    | 1,490   | 234,464         | ソフトウェア・サービス            |
| ALBEMARLE CORP                 | 135     | —      | —       | —               | 素材                     |
| ALBERTSONS COS INC - CLASS A   | 435     | 432    | 772     | 121,465         | 生活必需品流通・小売り            |
| ALIGN TECHNOLOGY INC           | 81      | 81     | 1,085   | 170,672         | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALLEGION PLC                   | 100     | 101    | 1,629   | 256,347         | 資本財                    |
| ALLIANT ENERGY CORP            | 296     | 302    | 2,035   | 320,130         | 公益事業                   |
| ALLSTATE CORP                  | 305     | 312    | 6,550   | 1,030,319       | 保険                     |
| ALLY FINANCIAL INC             | 316     | —      | —       | —               | 金融サービス                 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC    | 149     | 153    | 7,083   | 1,114,126       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALPHABET INC-CL A              | 6,747   | 6,860  | 200,872 | 31,595,257      | メディア・娯楽                |
| ALPHABET INC-CL C              | 5,757   | 5,793  | 169,732 | 26,697,290      | メディア・娯楽                |
| ALTRIA GROUP INC               | 1,958   | 1,986  | 11,642  | 1,831,225       | 食品・飲料・タバコ              |
| AMAZON.COM INC                 | 10,933  | 11,264 | 250,840 | 39,454,661      | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| AMCOR PLC                      | 1,673   | 2,709  | 2,281   | 358,888         | 素材                     |
| AMENTUM HOLDINGS INC           | 8       | —      | —       | —               | 商業・専門サービス              |
| AMEREN CORPORATION             | 308     | 325    | 3,348   | 526,752         | 公益事業                   |
| AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC | 615     | 629    | 7,665   | 1,205,655       | 公益事業                   |
| AMERICAN EXPRESS CO            | 651     | 660    | 22,771  | 3,581,659       | 金融サービス                 |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                            | 期首(前期末) | 当期末    |         |            | 業種等                    |  |
|-------------------------------|---------|--------|---------|------------|------------------------|--|
|                               | 株数      | 株数     | 評価額     |            |                        |  |
|                               |         |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                        |  |
| (アメリカ)                        | 百株      | 百株     | 千米ドル    | 千円         |                        |  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC  | 82      | 79     | 1,082   | 170,237    | 保険                     |  |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP  | 720     | 678    | 5,142   | 808,914    | 保険                     |  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC   | 225     | 229    | 2,923   | 459,818    | 公益事業                   |  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | 111     | 112    | 5,044   | 793,379    | 金融サービス                 |  |
| AMETEK INC                    | 267     | 272    | 5,213   | 820,013    | 資本財                    |  |
| AMGEN INC                     | 621     | 634    | 21,709  | 3,414,638  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| AMPHENOL CORP-CL A            | 1,392   | 1,425  | 19,486  | 3,064,986  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ANALOG DEVICES INC            | 573     | 585    | 13,585  | 2,136,872  | 半導体・半導体製造装置            |  |
| ANSYS INC                     | 101     | —      | —       | —          | ソフトウェア・サービス            |  |
| AON PLC                       | 224     | 241    | 8,324   | 1,309,351  | 保険                     |  |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC  | 457     | 471    | 5,998   | 943,563    | 金融サービス                 |  |
| APPLE INC                     | 17,374  | 17,607 | 472,879 | 74,379,238 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| APPLIED MATERIALS INC         | 940     | 946    | 22,243  | 3,498,722  | 半導体・半導体製造装置            |  |
| APPLOVIN CORP-CLASS A         | 241     | 272    | 14,420  | 2,268,206  | ソフトウェア・サービス            |  |
| APTIVE PLC                    | 271     | 256    | 1,856   | 292,026    | 自動車・自動車部品              |  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD        | 434     | 441    | 4,023   | 632,801    | 保険                     |  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO     | 553     | 566    | 3,299   | 518,967    | 食品・飲料・タバコ              |  |
| ARES MANAGEMENT CORP - A      | 217     | 254    | 3,691   | 580,571    | 金融サービス                 |  |
| ARISTA NETWORKS INC           | 1,237   | 1,258  | 15,707  | 2,470,646  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO       | 288     | 301    | 7,510   | 1,181,263  | 保険                     |  |
| ASSURANT INC                  | 59      | —      | —       | —          | 保険                     |  |
| AT&T INC                      | 8,301   | 8,493  | 21,462  | 3,375,819  | 電気通信サービス               |  |
| ATLASSIAN CORP-CL A           | 186     | 196    | 2,875   | 452,364    | ソフトウェア・サービス            |  |
| ATMOS ENERGY CORP             | 179     | 187    | 3,255   | 512,102    | 公益事業                   |  |
| AUTODESK INC                  | 248     | 252    | 7,346   | 1,155,520  | ソフトウェア・サービス            |  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | 470     | 478    | 11,984  | 1,884,982  | 商業・専門サービス              |  |
| AUTOZONE INC                  | 19      | 19     | 7,510   | 1,181,320  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| AVANTOR INC                   | 786     | —      | —       | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| AVERY DENNISON CORP           | 92      | 92     | 1,553   | 244,353    | 素材                     |  |
| AXON ENTERPRISE INC           | 83      | 87     | 4,631   | 728,426    | 資本財                    |  |
| BAKER HUGHES COMPANY          | 1,143   | 1,167  | 5,661   | 890,481    | エネルギー                  |  |
| BALL CORP                     | 344     | 310    | 1,478   | 232,504    | 素材                     |  |
| BANK OF AMERICA CORP          | 7,913   | 8,434  | 43,878  | 6,901,650  | 銀行                     |  |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP  | 828     | 842    | 9,062   | 1,425,466  | 金融サービス                 |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                                 | 期首(前期末) |       | 当期末     |            |                        | 業種等 |  |
|------------------------------------|---------|-------|---------|------------|------------------------|-----|--|
|                                    | 株数      | 株数    | 評価額     |            |                        |     |  |
|                                    |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                        |     |  |
| (アメリカ)                             | 百株      | 百株    | 千米ドル    | 千円         |                        |     |  |
| BAXTER INTERNATIONAL INC           | 590     | 606   | 1,072   | 168,625    | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| BECTON DICKINSON & CO              | 335     | 337   | 6,462   | 1,016,542  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B        | 184     | 189   | 767     | 120,788    | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B        | 1,537   | 1,597 | 80,079  | 12,595,750 | 金融サービス                 |     |  |
| BEST BUY CO INC                    | 234     | 236   | 1,762   | 277,224    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| BIOGEN INC                         | 168     | 172   | 2,901   | 456,349    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC        | 220     | 226   | 1,188   | 186,978    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BIO-RAD LABORATORIES-CL A          | 22      | —     | —       | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BIO-TECHNE CORP                    | 183     | —     | —       | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BLACKROCK INC                      | 169     | 173   | 17,603  | 2,768,883  | 金融サービス                 |     |  |
| BLACKSTONE INC                     | 834     | 860   | 11,926  | 1,875,859  | 金融サービス                 |     |  |
| BLOCK INC                          | 641     | 654   | 4,057   | 638,179    | 金融サービス                 |     |  |
| BOEING CO                          | 864     | 888   | 16,507  | 2,596,453  | 資本財                    |     |  |
| BOOKING HOLDINGS INC               | 38      | 38    | 17,989  | 2,829,506  | 消費者サービス                |     |  |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS       | 147     | 146   | 1,176   | 185,069    | 商業・専門サービス              |     |  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP             | 1,702   | 1,743 | 16,916  | 2,660,721  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO            | 2,343   | 2,400 | 10,990  | 1,728,655  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BROADCOM INC                       | 5,144   | 5,267 | 186,697 | 29,365,700 | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 135     | 138   | 3,133   | 492,874    | 商業・専門サービス              |     |  |
| BROWN & BROWN INC                  | 280     | 349   | 2,757   | 433,736    | 保険                     |     |  |
| BROWN-FORMAN CORP -CL B            | 211     | 215   | 586     | 92,323     | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC           | 132     | 130   | 1,246   | 196,118    | 資本財                    |     |  |
| BUNGE GLOBAL SA                    | 161     | 165   | 1,538   | 241,985    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| BURLINGTON STORES INC              | 73      | 74    | 2,077   | 326,776    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC        | 136     | 139   | 2,117   | 333,137    | 運輸                     |     |  |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC         | 316     | 321   | 9,874   | 1,553,176  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| CAMPBELL SOUP CO                   | 224     | —     | —       | —          | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP         | 736     | 754   | 15,274  | 2,402,497  | 金融サービス                 |     |  |
| CARDINAL HEALTH INC                | 279     | 281   | 5,837   | 918,251    | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| CARLISLE COS INC                   | 52      | 50    | 1,547   | 243,431    | 資本財                    |     |  |
| CARLYLE GROUP INC/THE              | 268     | 276   | 1,436   | 225,914    | 金融サービス                 |     |  |
| CARMAX INC                         | 177     | —     | —       | —          | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| CARNIVAL CORP                      | 1,199   | 1,237 | 3,226   | 507,547    | 消費者サービス                |     |  |
| CARRIER GLOBAL CORP                | 932     | 909   | 4,661   | 733,271    | 資本財                    |     |  |

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                  | 期首(前期末) |       | 当期末    |           |                    | 業種等 |  |
|-------------------------------------|---------|-------|--------|-----------|--------------------|-----|--|
|                                     | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                    |     |  |
|                                     |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                    |     |  |
| (アメリカ)                              | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                    |     |  |
| CARVANA CO                          | 133     | 143   | 4,723  | 743,037   | 一般消費財・サービス流通・小売り   |     |  |
| CATERPILLAR INC                     | 557     | 554   | 30,665 | 4,823,380 | 資本財                |     |  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC             | 120     | 123   | 3,138  | 493,726   | 金融サービス             |     |  |
| CBRE GROUP INC                      | 353     | 351   | 5,332  | 838,802   | 不動産管理・開発           |     |  |
| CDW CORP/DE                         | 154     | 155   | 2,169  | 341,249   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| CENCORA, INC.                       | 200     | 217   | 7,828  | 1,231,411 | ヘルスケア機器・サービス       |     |  |
| CENTENE CORP                        | 583     | 586   | 2,109  | 331,810   | ヘルスケア機器・サービス       |     |  |
| CENTERPOINT ENERGY INC              | 752     | 769   | 3,047  | 479,281   | 公益事業               |     |  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC          | 201     | 190   | 1,503  | 236,431   | 素材                 |     |  |
| CHARLES SCHWAB CORP                 | 1,989   | 2,034 | 18,850 | 2,964,948 | 金融サービス             |     |  |
| CHARTER COMMUNICATIONS-CL A         | 106     | 104   | 2,033  | 319,816   | メディア・娯楽            |     |  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES   | 101     | 102   | 1,895  | 298,212   | ソフトウェア・サービス        |     |  |
| CHENIERE ENERGY INC                 | 259     | 261   | 5,478  | 861,667   | エネルギー              |     |  |
| CHEVRON CORP                        | 1,972   | 2,311 | 35,058 | 5,514,276 | エネルギー              |     |  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC          | 1,574   | 1,588 | 4,924  | 774,541   | 消費者サービス            |     |  |
| CHUBB LTD                           | 442     | 448   | 13,189 | 2,074,652 | 保険                 |     |  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC              | 283     | 290   | 2,396  | 376,913   | 家庭用品・パーソナル用品       |     |  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP           | 180     | 184   | 2,977  | 468,269   | 保険                 |     |  |
| CINTAS CORP                         | 419     | 428   | 7,858  | 1,235,987 | 商業・専門サービス          |     |  |
| CISCO SYSTEMS INC                   | 4,601   | 4,690 | 36,769 | 5,783,480 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| CITIGROUP INC                       | 2,184   | 2,170 | 21,663 | 3,407,406 | 銀行                 |     |  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP            | 508     | 510   | 2,614  | 411,191   | 銀行                 |     |  |
| CLOROX CO                           | 143     | 145   | 1,432  | 225,325   | 家庭用品・パーソナル用品       |     |  |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A            | 353     | 366   | 7,183  | 1,129,918 | ソフトウェア・サービス        |     |  |
| CME GROUP INC                       | 416     | 424   | 11,580 | 1,821,419 | 金融サービス             |     |  |
| CMS ENERGY CORP                     | 345     | 352   | 2,572  | 404,572   | 公益事業               |     |  |
| CNH INDUSTRIAL NV                   | 1,010   | 1,031 | 989    | 155,618   | 資本財                |     |  |
| COCA-COLA CO                        | 4,728   | 4,821 | 34,282 | 5,392,325 | 食品・飲料・タバコ          |     |  |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC  | 238     | 271   | 2,426  | 381,679   | 食品・飲料・タバコ          |     |  |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP | 572     | 581   | 4,201  | 660,898   | ソフトウェア・サービス        |     |  |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A        | 224     | 236   | 6,091  | 958,106   | 金融サービス             |     |  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO                | 897     | 907   | 7,124  | 1,120,604 | 家庭用品・パーソナル用品       |     |  |
| COMCAST CORP                        | 4,410   | 4,391 | 11,800 | 1,856,083 | メディア・娯楽            |     |  |
| CONAGRA BRANDS INC                  | 552     | -     | -      | -         | 食品・飲料・タバコ          |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       | 当期末    |           |                        | 業種等 |  |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|-----|--|
|                              | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                        |     |  |
|                              |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |     |  |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |     |  |
| CONOCOPHILLIPS               | 1,494   | 1,487 | 13,090 | 2,058,928 | エネルギー                  |     |  |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 400     | 424   | 4,264  | 670,691   | 公益事業                   |     |  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   | 188     | 176   | 2,284  | 359,322   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| CONSTELLATION ENERGY         | 361     | 369   | 13,207 | 2,077,344 | 公益事業                   |     |  |
| COOPER COS INC/THE           | 230     | 235   | 1,696  | 266,893   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| COPART INC                   | 1,001   | 1,082 | 4,479  | 704,554   | 商業・専門サービス              |     |  |
| COREBRIDGE FINANCIAL INC     | 293     | 317   | 884    | 139,133   | 金融サービス                 |     |  |
| CORNING INC                  | 939     | 959   | 7,836  | 1,232,542 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| CORTEVA INC                  | 794     | 804   | 5,201  | 818,083   | 素材                     |     |  |
| COSTAR GROUP INC             | 473     | 497   | 3,284  | 516,587   | 不動産管理・開発               |     |  |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 512     | 522   | 46,559 | 7,323,371 | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| COTERRA ENERGY INC           | 850     | 899   | 2,315  | 364,272   | エネルギー                  |     |  |
| CRH PLC                      | 784     | 796   | 8,776  | 1,380,443 | 素材                     |     |  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 284     | 293   | 15,297 | 2,406,149 | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| CROWN HOLDINGS INC           | 138     | 137   | 1,299  | 204,346   | 素材                     |     |  |
| CSX CORP                     | 2,227   | 2,213 | 7,518  | 1,182,601 | 運輸                     |     |  |
| CUMMINS INC                  | 158     | 162   | 7,684  | 1,208,741 | 資本財                    |     |  |
| CVS HEALTH CORP              | 1,454   | 1,491 | 11,418 | 1,795,944 | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 54      | 56    | 2,678  | 421,375   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| DANAHER CORP                 | 751     | 759   | 16,888 | 2,656,389 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 135     | 138   | 2,346  | 369,136   | 消費者サービス                |     |  |
| DATADOG INC - CLASS A        | 325     | 339   | 5,978  | 940,302   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| DAVITA INC                   | 52      | 48    | 562    | 88,515    | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| DAYFORCE, INC.               | 173     | -     | -      | -         | 商業・専門サービス              |     |  |
| DECKERS OUTDOOR CORP         | 175     | 176   | 1,461  | 229,953   | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| DEERE & CO                   | 298     | 303   | 14,401 | 2,265,239 | 資本財                    |     |  |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 372     | 381   | 4,554  | 716,353   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| DELTA AIR LINES INC          | 186     | 192   | 1,095  | 172,300   | 運輸                     |     |  |
| DEVON ENERGY CORPORATION     | 720     | 717   | 2,531  | 398,137   | エネルギー                  |     |  |
| DEXCOM INC                   | 451     | 462   | 2,761  | 434,308   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| DIAMONDBACK ENERGY INC       | 219     | 223   | 3,323  | 522,732   | エネルギー                  |     |  |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    | 66      | 66    | 1,378  | 216,885   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| DOCUSIGN INC                 | 233     | 238   | 1,549  | 243,774   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 254     | 259   | 2,586  | 406,801   | 生活必需品流通・小売り            |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                          | 期首(前期末) |       | 当期末    |            |                        | 業種等 |  |
|-----------------------------|---------|-------|--------|------------|------------------------|-----|--|
|                             | 株数      | 株数    | 評価額    |            |                        |     |  |
|                             |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |                        |     |  |
| (アメリカ)                      | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円         |                        |     |  |
| DOLLAR TREE INC             | 236     | 233   | 2,335  | 367,418    | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| DOMINION ENERGY INC         | 970     | 1,005 | 6,054  | 952,247    | 公益事業                   |     |  |
| DOMINO'S PIZZA INC          | 39      | 38    | 1,533  | 241,146    | 消費者サービス                |     |  |
| DOORDASH INC - A            | 405     | 423   | 8,558  | 1,346,107  | 消費者サービス                |     |  |
| DOVER CORP                  | 158     | 161   | 2,900  | 456,214    | 資本財                    |     |  |
| DOW INC                     | 810     | 836   | 1,782  | 280,295    | 素材                     |     |  |
| DR HORTON INC               | 333     | 325   | 4,481  | 704,946    | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| DRAFTKINGS INC              | 507     | 526   | 1,528  | 240,374    | 消費者サービス                |     |  |
| DTE ENERGY COMPANY          | 239     | 244   | 3,303  | 519,558    | 公益事業                   |     |  |
| DUKE ENERGY CORP            | 892     | 916   | 11,200 | 1,761,733  | 公益事業                   |     |  |
| DUPONT DE NEMOURS INC       | 482     | 493   | 1,867  | 293,814    | 素材                     |     |  |
| DYNATRACE INC               | 344     | 355   | 1,611  | 253,538    | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY    | 133     | —     | —      | —          | 素材                     |     |  |
| EATON CORP PLC              | 456     | 461   | 15,943 | 2,507,799  | 資本財                    |     |  |
| EBAY INC                    | 553     | 543   | 4,416  | 694,724    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| ECOLAB INC                  | 294     | 300   | 7,864  | 1,237,066  | 素材                     |     |  |
| EDISON INTERNATIONAL        | 447     | 453   | 2,609  | 410,460    | 公益事業                   |     |  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP   | 681     | 691   | 5,947  | 935,470    | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| ELECTRONIC ARTS INC         | 287     | 281   | 5,672  | 892,221    | メディア・娯楽                |     |  |
| ELEVANCE HEALTH, INC        | 267     | 266   | 8,428  | 1,325,754  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| ELI LILLY & CO              | 932     | 949   | 99,680 | 15,678,747 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| EMCOR GROUP INC             | 53      | 52    | 3,193  | 502,287    | 資本財                    |     |  |
| EMERSON ELECTRIC CO         | 658     | 663   | 8,499  | 1,336,901  | 資本財                    |     |  |
| ENTEGRIS INC                | 174     | 178   | 1,317  | 207,185    | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| ENTERGY CORP                | 495     | 525   | 4,944  | 777,775    | 公益事業                   |     |  |
| EOG RESOURCES INC           | 646     | 642   | 6,883  | 1,082,676  | エネルギー                  |     |  |
| EPAM SYSTEMS INC            | 65      | —     | —      | —          | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| EQT CORP                    | 654     | 698   | 4,114  | 647,220    | エネルギー                  |     |  |
| EQUIFAX INC                 | 143     | 146   | 3,019  | 474,960    | 商業・専門サービス              |     |  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC      | 361     | 357   | 1,573  | 247,479    | 金融サービス                 |     |  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 29      | 29    | 854    | 134,331    | 保険                     |     |  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC     | 301     | 330   | 1,267  | 199,337    | 公益事業                   |     |  |
| ESTEE LAUDER COS INC        | 269     | 276   | 2,372  | 373,209    | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| EVEREST GROUP LTD           | 49      | 50    | 1,568  | 246,721    | 保険                     |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                                      | 期首(前期末) |       | 当期末    |           |                       | 業種等 |  |
|---|---------|-------|--------|-----------|-----------------------|-----|--|
|   | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                       |     |  |
|   |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                       |     |  |
| (アメリカ)                                  | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                       |     |  |
| EVERGY INC                              | 265     | 271   | 2,051  | 322,620   | 公益事業                  |     |  |
| EVERSOURCE ENERGY                       | 423     | 433   | 2,828  | 444,945   | 公益事業                  |     |  |
| EXACT SCIENCES CORP                     | 214     | —     | —      | —         | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| EXELON CORP                             | 1,160   | 1,190 | 5,422  | 852,934   | 公益事業                  |     |  |
| EXPAND ENERGY CORPORATION               | 240     | 266   | 3,125  | 491,606   | エネルギー                 |     |  |
| EXPEDIA GROUP INC                       | 141     | 143   | 3,438  | 540,823   | 消費者サービス               |     |  |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC | 161     | 161   | 2,242  | 352,766   | 運輸                    |     |  |
| EXXON MOBIL CORP                        | 5,078   | 5,080 | 59,619 | 9,377,614 | エネルギー                 |     |  |
| F5 INC                                  | 67      | 67    | 1,515  | 238,410   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |     |  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC            | 43      | 44    | 1,190  | 187,276   | 金融サービス                |     |  |
| FAIR ISAAC CORP                         | 28      | 28    | 4,981  | 783,468   | ソフトウェア・サービス           |     |  |
| FASTENAL CO                             | 662     | 1,352 | 5,348  | 841,216   | 資本財                   |     |  |
| FEDEX CORP                              | 264     | 268   | 7,045  | 1,108,110 | 運輸                    |     |  |
| FERGUSON ENTERPRISES INC                | 231     | 232   | 5,502  | 865,423   | 資本財                   |     |  |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL             | 300     | 307   | 1,763  | 277,342   | 保険                    |     |  |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION           | 622     | 619   | 3,881  | 610,556   | 金融サービス                |     |  |
| FIFTH THIRD BANCORP                     | 774     | 786   | 3,264  | 513,404   | 銀行                    |     |  |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A              | 11      | 10    | 1,987  | 312,574   | 銀行                    |     |  |
| FIRST SOLAR INC                         | 117     | 120   | 3,025  | 475,835   | 半導体・半導体製造装置           |     |  |
| FIRSTENERGY CORP                        | 632     | 646   | 2,991  | 470,488   | 公益事業                  |     |  |
| FISERV INC                              | 657     | 653   | 3,998  | 628,875   | 金融サービス                |     |  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC               | 76      | 78    | 2,182  | 343,222   | 金融サービス                |     |  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI            | 205     | 208   | 4,026  | 633,281   | 消費者サービス               |     |  |
| FORD MOTOR CO                           | 4,510   | 4,606 | 5,942  | 934,647   | 自動車・自動車部品             |     |  |
| FORTINET INC                            | 752     | 767   | 6,115  | 961,974   | ソフトウェア・サービス           |     |  |
| FORTIVE CORP                            | 400     | 399   | 2,014  | 316,825   | 資本財                   |     |  |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC         | 143     | —     | —      | —         | 資本財                   |     |  |
| FOX CORP - CLASS A                      | 256     | 251   | 1,632  | 256,728   | メディア・娯楽               |     |  |
| FOX CORP- CLASS B                       | 163     | 166   | 971    | 152,740   | メディア・娯楽               |     |  |
| FRANKLIN RESOURCES INC                  | 334     | —     | —      | —         | 金融サービス                |     |  |
| FREEPORT-MCMORAN INC                    | 1,659   | 1,692 | 6,981  | 1,098,058 | 素材                    |     |  |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR                   | 64      | 72    | 1,203  | 189,341   | 金融サービス                |     |  |
| GARMIN LTD                              | 177     | 192   | 3,657  | 575,330   | 耐久消費財・アパレル            |     |  |
| GARTNER INC                             | 89      | 90    | 2,050  | 322,472   | ソフトウェア・サービス           |     |  |

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       | 当期末    |           |                        | 業種等 |  |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|-----|--|
|                              | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                        |     |  |
|                              |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |     |  |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |     |  |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY     | 527     | 539   | 3,901  | 613,698   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| GE VEROVA INC                | 318     | 321   | 19,157 | 3,013,239 | 資本財                    |     |  |
| GEN DIGITAL INC              | 640     | 621   | 1,620  | 254,858   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 270     | 268   | 9,227  | 1,451,467 | 資本財                    |     |  |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 1,250   | 1,257 | 37,815 | 5,947,996 | 資本財                    |     |  |
| GENERAL MILLS INC            | 637     | 640   | 3,051  | 480,017   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| GENERAL MOTORS CO            | 1,269   | 1,132 | 7,760  | 1,220,724 | 自動車・自動車部品              |     |  |
| GENUINE PARTS CO             | 160     | 163   | 2,054  | 323,180   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| GILEAD SCIENCES INC          | 1,440   | 1,466 | 18,783 | 2,954,459 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 294     | 287   | 2,071  | 325,827   | 金融サービス                 |     |  |
| GLOBAL-E ONLINE LTD          | 115     | —     | —      | —         | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| GODADDY INC - CLASS A        | 162     | 167   | 2,086  | 328,230   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 362     | 361   | 28,425 | 4,471,019 | 金融サービス                 |     |  |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A     | 2,663   | 2,795 | 1,484  | 233,480   | 運輸                     |     |  |
| GRACO INC                    | 195     | 197   | 1,564  | 246,130   | 資本財                    |     |  |
| HALLIBURTON CO               | 1,015   | 1,013 | 2,682  | 421,932   | エネルギー                  |     |  |
| HARTFORD INSURANCE GROUP INC | 334     | 334   | 4,420  | 695,258   | 保険                     |     |  |
| HCA HEALTHCARE INC           | 219     | 212   | 10,231 | 1,609,338 | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| HEICO CORP                   | 51      | 51    | 1,596  | 251,103   | 資本財                    |     |  |
| HEICO CORP-CLASS A           | 87      | 89    | 2,147  | 337,834   | 資本財                    |     |  |
| HERSHEY CO/THE               | 170     | 174   | 3,185  | 500,969   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| HESS CORP                    | 320     | —     | —      | —         | エネルギー                  |     |  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS    | 1,519   | 1,547 | 3,186  | 501,267   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 281     | 280   | 7,478  | 1,176,238 | 消費者サービス                |     |  |
| HOLOGIC INC                  | 262     | 262   | 1,947  | 306,366   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| HOME DEPOT INC               | 1,147   | 1,173 | 39,237 | 6,171,616 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 751     | 757   | 14,440 | 2,271,337 | 資本財                    |     |  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 1,276   | 1,288 | 815    | 128,239   | 不動産管理・開発               |     |  |
| HORMEL FOODS CORP            | 349     | 357   | 794    | 124,888   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| HOWMET AEROSPACE INC         | 445     | 452   | 9,133  | 1,436,547 | 資本財                    |     |  |
| HP INC                       | 1,083   | 1,107 | 2,489  | 391,537   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| HUBBELL INC                  | 61      | 62    | 2,636  | 414,694   | 資本財                    |     |  |
| HUBSPOT INC                  | 56      | 59    | 2,138  | 336,416   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| HUMANA INC                   | 139     | 142   | 3,257  | 512,368   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                                     | 期首(前期末) |       | 当期末    |            |                        | 業種等 |  |
|--|---------|-------|--------|------------|------------------------|-----|--|
|  | 株数      | 株数    | 評価額    |            |                        |     |  |
|  |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |                        |     |  |
| (アメリカ)                                 | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円         |                        |     |  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC              | 1,677   | 1,717 | 2,641  | 415,508    | 銀行                     |     |  |
| HYATT HOTELS CORP - CL A               | 48      | 49    | 746    | 117,408    | 消費者サービス                |     |  |
| IDEX CORP                              | 87      | 89    | 1,442  | 226,943    | 資本財                    |     |  |
| IDEXX LABORATORIES INC                 | 94      | 94    | 6,609  | 1,039,561  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC                | 341     | 328   | 7,913  | 1,244,768  | 資本財                    |     |  |
| ILLUMINA INC                           | 183     | 186   | 2,242  | 352,707    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| INCYTE CORP                            | 189     | 193   | 1,965  | 309,106    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| INGERSOLL-RAND INC                     | 465     | 475   | 3,503  | 551,078    | 資本財                    |     |  |
| INSULET CORP                           | 81      | 82    | 2,873  | 452,011    | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| INTEL CORP                             | 4,983   | 5,142 | 18,056 | 2,840,075  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A           | 125     | 513   | 3,315  | 521,461    | 金融サービス                 |     |  |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC          | 663     | 676   | 10,389 | 1,634,165  | 金融サービス                 |     |  |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP   | 1,068   | 1,095 | 31,614 | 4,972,693  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC | 295     | 301   | 1,965  | 309,142    | 素材                     |     |  |
| INTERNATIONAL PAPER CO                 | 576     | 591   | 2,152  | 338,538    | 素材                     |     |  |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC           | 431     | —     | —      | —          | メディア・娯楽                |     |  |
| INTUIT INC                             | 323     | 328   | 21,396 | 3,365,524  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| INTUITIVE SURGICAL INC                 | 411     | 422   | 23,857 | 3,752,494  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| IQVIA HOLDINGS INC                     | 209     | 203   | 4,435  | 697,626    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| JABIL CIRCUIT INC                      | 128     | 126   | 2,530  | 398,028    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC            | 84      | 85    | 1,425  | 224,172    | 金融サービス                 |     |  |
| JACOBS SOLUTIONS INC                   | 143     | 141   | 2,050  | 322,466    | 商業・専門サービス              |     |  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD             | 185     | 191   | 1,215  | 191,189    | 資本財                    |     |  |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC         | 93      | 91    | 1,459  | 229,553    | 運輸                     |     |  |
| JM SMUCKER CO                          | 123     | 126   | 1,319  | 207,612    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| JOHNSON & JOHNSON                      | 2,781   | 2,836 | 57,447 | 9,035,842  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC     | 765     | 775   | 8,875  | 1,396,018  | 資本財                    |     |  |
| JPMORGAN CHASE & CO                    | 3,252   | 3,276 | 99,356 | 15,627,769 | 銀行                     |     |  |
| JUNIPER NETWORKS INC                   | 383     | —     | —      | —          | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| KELLANOVA                              | 318     | 327   | 2,729  | 429,389    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| KENVUE INC                             | 2,215   | 2,264 | 3,636  | 571,964    | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| KEURIG DR PEPPER INC                   | 1,332   | 1,521 | 4,091  | 643,493    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| KEYCORP                                | 1,072   | 1,099 | 1,907  | 300,048    | 銀行                     |     |  |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN               | 200     | 202   | 3,541  | 557,115    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       | 当期末    |           |                 | 業種等 |  |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|-----------------|-----|--|
|                              | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                 |     |  |
|                              |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                 |     |  |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                 |     |  |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 385     | 391   | 4,006  | 630,207   | 家庭用品・パーソナル用品    |     |  |
| KINDER MORGAN INC            | 2,309   | 2,357 | 6,323  | 994,561   | エネルギー           |     |  |
| KKR & CO INC -A              | 718     | 734   | 8,634  | 1,358,081 | 金融サービス          |     |  |
| KLA CORPORATION              | 154     | 155   | 18,198 | 2,862,421 | 半導体・半導体製造装置     |     |  |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 1,048   | 1,048 | 2,612  | 410,980   | 食品・飲料・タバコ       |     |  |
| KROGER CO                    | 794     | 740   | 4,990  | 785,029   | 生活必需品流通・小売      |     |  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 219     | 220   | 6,289  | 989,227   | 資本財             |     |  |
| LABCORP HOLDINGS INC         | 96      | 98    | 2,570  | 404,286   | ヘルスケア機器・サービス    |     |  |
| LAM RESEARCH CORP            | 1,486   | 1,507 | 22,436 | 3,529,108 | 半導体・半導体製造装置     |     |  |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 419     | 416   | 2,668  | 419,710   | 消費者サービス         |     |  |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 146     | 144   | 2,725  | 428,666   | 商業・専門サービス       |     |  |
| LENNAR CORP-CL A             | 275     | 268   | 3,089  | 485,931   | 耐久消費財・アパレル      |     |  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 37      | 37    | 1,679  | 264,239   | 資本財             |     |  |
| LIBERTY MEDIA CORP-FORMULA-C | 244     | 249   | 2,397  | 377,055   | メディア・娯楽         |     |  |
| LINDE PLC                    | 550     | 554   | 22,927 | 3,606,288 | 素材              |     |  |
| LIVE NATION INC              | 186     | 191   | 2,486  | 391,123   | メディア・娯楽         |     |  |
| LKQ CORP                     | 300     | —     | —      | —         | 一般消費財・サービス流通・小売 |     |  |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 246     | 248   | 11,686 | 1,838,121 | 資本財             |     |  |
| LOEWS CORP                   | 213     | 209   | 2,202  | 346,506   | 保険              |     |  |
| LOWE'S COS INC               | 652     | 660   | 15,092 | 2,373,850 | 一般消費財・サービス流通・小売 |     |  |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC   | 86      | 94    | 3,359  | 528,359   | 金融サービス          |     |  |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 128     | 128   | 2,131  | 335,218   | 耐久消費財・アパレル      |     |  |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 300     | 304   | 1,300  | 204,529   | 素材              |     |  |
| M&T BANK CORP                | 191     | 189   | 3,455  | 543,579   | 銀行              |     |  |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC     | 70      | —     | —      | —         | ソフトウェア・サービス     |     |  |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 371     | 361   | 7,074  | 1,112,717 | エネルギー           |     |  |
| MARKEL GROUP INC             | 14      | 14    | 3,046  | 479,237   | 保険              |     |  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL INC   | 272     | 274   | 7,798  | 1,226,617 | 消費者サービス         |     |  |
| MARSH & MCLENNAN COS INC     | 567     | 581   | 10,291 | 1,618,711 | 保険              |     |  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 70      | 71    | 4,239  | 666,879   | 素材              |     |  |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 999     | 1,016 | 8,266  | 1,300,238 | 半導体・半導体製造装置     |     |  |
| MASCO CORP                   | 249     | 248   | 1,477  | 232,433   | 資本財             |     |  |
| MASTERCARD INC-CLASS A       | 947     | 1,009 | 53,534 | 8,420,447 | 金融サービス          |     |  |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 291     | 298   | 1,992  | 313,424   | 食品・飲料・タバコ       |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                              | 期首(前期末) |       | 当期末     |            |                        | 業種等 |  |
|---------------------------------|---------|-------|---------|------------|------------------------|-----|--|
|                                 | 株数      | 株数    | 評価額     |            |                        |     |  |
|                                 |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                        |     |  |
| (アメリカ)                          | 百株      | 百株    | 千米ドル    | 千円         |                        |     |  |
| MCDONALD'S CORP                 | 828     | 843   | 25,523  | 4,014,576  | 消費者サービス                |     |  |
| MCKESSON CORP                   | 146     | 147   | 12,571  | 1,977,351  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| MEDTRONIC PLC                   | 1,481   | 1,510 | 15,159  | 2,384,416  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| MERCADOLIBRE INC                | 52      | 53    | 11,173  | 1,757,424  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| MERCK & CO INC                  | 2,923   | 2,960 | 28,139  | 4,426,130  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| META PLATFORMS INC-A            | 2,518   | 2,559 | 151,097 | 23,766,067 | メディア・娯楽                |     |  |
| METLIFE INC                     | 679     | 672   | 5,027   | 790,710    | 保険                     |     |  |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL    | 24      | 24    | 3,440   | 541,211    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| MGM MIRAGE                      | 257     | -     | -       | -          | 消費者サービス                |     |  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC        | 620     | 636   | 3,233   | 508,528    | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| MICRON TECHNOLOGY INC           | 1,287   | 1,319 | 29,804  | 4,687,984  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| MICROSOFT CORP                  | 8,160   | 8,324 | 405,486 | 63,779,045 | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| MICROSTRATEGY INC-CL A          | 262     | 307   | 5,739   | 902,801    | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| MODERNA INC                     | 378     | -     | -       | -          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| MOLINA HEALTHCARE INC           | 66      | 63    | 882     | 138,822    | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B | 208     | 209   | 946     | 148,833    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| MONDAY.COM LTD                  | 43      | 47    | 713     | 112,175    | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC      | 1,545   | 1,526 | 8,561   | 1,346,675  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| MONGODB INC                     | 86      | 96    | 3,249   | 511,113    | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC    | 56      | 56    | 4,993   | 785,482    | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| MONSTER BEVERAGE CORP           | 842     | 862   | 6,232   | 980,374    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| MOODY'S CORP                    | 188     | 190   | 9,023   | 1,419,320  | 金融サービス                 |     |  |
| MORGAN STANLEY                  | 1,395   | 1,412 | 22,927  | 3,606,269  | 金融サービス                 |     |  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC          | 193     | 196   | 7,311   | 1,150,055  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| MSCI INC                        | 90      | 91    | 5,105   | 802,987    | 金融サービス                 |     |  |
| NASDAQ INC                      | 498     | 507   | 4,365   | 686,678    | 金融サービス                 |     |  |
| NATERA INC                      | 144     | 152   | 3,339   | 525,295    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| NETAPP INC                      | 234     | 236   | 2,509   | 394,796    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| NETFLIX INC                     | 493     | 5,017 | 55,188  | 8,680,536  | メディア・娯楽                |     |  |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC      | 117     | 116   | 1,610   | 253,375    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| NEWMONT CORP                    | 1,315   | 1,297 | 11,353  | 1,785,799  | 素材                     |     |  |
| NEWS CORP - CLASS A             | 437     | 443   | 1,107   | 174,268    | メディア・娯楽                |     |  |
| NEXTERA ENERGY INC              | 2,375   | 2,427 | 20,452  | 3,216,946  | 公益事業                   |     |  |
| NIKE INC                        | 1,364   | 1,389 | 8,701   | 1,368,621  | 耐久消費財・アパレル             |     |  |

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 期首(前期末) |        | 当期末     |            |                        | 業種等 |  |
|------------------------------|---------|--------|---------|------------|------------------------|-----|--|
|                              | 株数      | 株数     | 評価額     |            |                        |     |  |
|                              |         |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                        |     |  |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株     | 千米ドル    | 千円         |                        |     |  |
| NISOURCE INC                 | 538     | 554    | 2,367   | 372,397    | 公益事業                   |     |  |
| NORDSON CORP                 | 62      | 63     | 1,441   | 226,686    | 資本財                    |     |  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 261     | 265    | 7,488   | 1,177,837  | 運輸                     |     |  |
| NORTHERN TRUST CORP          | 228     | 229    | 2,887   | 454,197    | 金融サービス                 |     |  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 159     | 161    | 9,109   | 1,432,832  | 資本財                    |     |  |
| NRG ENERGY INC               | 233     | 230    | 3,888   | 611,671    | 公益事業                   |     |  |
| NUCOR CORP                   | 271     | 272    | 4,042   | 635,831    | 素材                     |     |  |
| NUTANIX INC - A              | 294     | 300    | 1,813   | 285,209    | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| NVIDIA CORP                  | 28,295  | 28,765 | 536,529 | 84,390,774 | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| NVR INC                      | 3       | 3      | 2,328   | 366,203    | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 293     | 297    | 5,660   | 890,349    | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 812     | 869    | 3,603   | 566,787    | エネルギー                  |     |  |
| OKTA INC                     | 189     | 197    | 1,578   | 248,319    | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 221     | 224    | 2,857   | 449,516    | 運輸                     |     |  |
| OMNICOM GROUP                | 227     | 228    | 1,645   | 258,875    | メディア・娯楽                |     |  |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 492     | 492    | 2,272   | 357,386    | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| ONEOK INC                    | 717     | 736    | 5,115   | 804,591    | エネルギー                  |     |  |
| ORACLE CORP                  | 1,938   | 1,997  | 45,043  | 7,084,861  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 66      | 1,007  | 9,945   | 1,564,406  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 461     | 465    | 4,030   | 633,952    | 資本財                    |     |  |
| OVINTIV INC                  | 299     | —      | —       | —          | エネルギー                  |     |  |
| OWENS CORNING                | 98      | 100    | 993     | 156,249    | 資本財                    |     |  |
| PACCAR INC                   | 605     | 619    | 5,974   | 939,769    | 資本財                    |     |  |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 103     | 106    | 2,060   | 324,120    | 素材                     |     |  |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A  | 2,431   | 2,669  | 44,156  | 6,945,358  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 758     | 786    | 15,713  | 2,471,645  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 148     | 150    | 12,360  | 1,944,250  | 資本財                    |     |  |
| PAYCHEX INC                  | 374     | 382    | 4,189   | 659,004    | 商業・専門サービス              |     |  |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 59      | 61     | 987     | 155,331    | 商業・専門サービス              |     |  |
| PAYOUT HOLDINGS INC          | 1,100   | 1,089  | 6,547   | 1,029,796  | 金融サービス                 |     |  |
| PENTAIR PLC                  | 190     | 193    | 1,986   | 312,525    | 資本財                    |     |  |
| PEPSICO INC                  | 1,585   | 1,616  | 23,783  | 3,740,940  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| PFIZER INC                   | 6,549   | 6,705  | 16,682  | 2,623,929  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| PG&E CORP                    | 2,533   | 2,590  | 4,071   | 640,442    | 公益事業                   |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末   |        |           | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|--|
|                              | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                        |  |
|                              |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |  |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |  |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 1,796   | 1,835 | 28,555 | 4,491,571 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| PHILLIPS 66                  | 477     | 480   | 6,458  | 1,015,832 | エネルギー                  |  |
| PINTEREST INC- CLASS A       | 685     | 700   | 1,785  | 280,816   | メディア・娯楽                |  |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 458     | 466   | 8,533  | 1,342,240 | 銀行                     |  |
| POOL CORP                    | 44      | 42    | 986    | 155,093   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| PPG INDUSTRIES INC           | 268     | 267   | 2,525  | 397,233   | 素材                     |  |
| PPL CORPORATION              | 851     | 870   | 3,095  | 486,904   | 公益事業                   |  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 264     | 262   | 2,182  | 343,319   | 保険                     |  |
| PROCTER & GAMBLE CO          | 2,721   | 2,764 | 40,630 | 6,390,823 | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| PROGRESSIVE CORP             | 676     | 691   | 15,404 | 2,423,003 | 保険                     |  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 411     | 417   | 4,323  | 680,096   | 保険                     |  |
| PTC INC                      | 139     | 141   | 2,431  | 382,408   | ソフトウェア・サービス            |  |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 575     | 587   | 4,768  | 750,107   | 公益事業                   |  |
| PULTE GROUP INC              | 236     | 236   | 2,685  | 422,353   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| PURE STORAGE INC - CLASS A   | 358     | 365   | 2,999  | 471,745   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| QNITY ELECTRONICS INC        | —       | 246   | 1,963  | 308,777   | 半導体・半導体製造装置            |  |
| QUALCOMM INC                 | 1,283   | 1,275 | 21,182 | 3,331,849 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| QUANTA SERVICES INC          | 170     | 174   | 7,781  | 1,223,947 | 資本財                    |  |
| QUEST DIAGNOSTICS            | 128     | 131   | 2,447  | 384,983   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 224     | 225   | 3,561  | 560,134   | 金融サービス                 |  |
| REDDIT INC-CL A              | 76      | 122   | 2,300  | 361,785   | メディア・娯楽                |  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 124     | 125   | 8,795  | 1,383,462 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 1,049   | 1,059 | 2,565  | 403,585   | 銀行                     |  |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM    | 62      | 61    | 1,654  | 260,170   | 素材                     |  |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 253     | 257   | 5,607  | 881,929   | 商業・専門サービス              |  |
| RESMED INC                   | 169     | 172   | 4,234  | 666,068   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| REVVITY INC                  | 140     | 139   | 1,282  | 201,689   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | 878     | 915   | 1,347  | 211,994   | 自動車・自動車部品              |  |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A    | 707     | 858   | 10,149 | 1,596,447 | 金融サービス                 |  |
| ROBLOX CORP -CLASS A         | 561     | 668   | 6,508  | 1,023,783 | メディア・娯楽                |  |
| ROCKET LAB CORP              | —       | 508   | 2,218  | 349,018   | 資本財                    |  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 130     | 132   | 4,951  | 778,743   | 資本財                    |  |
| ROKU INC                     | 147     | —     | —      | —         | メディア・娯楽                |  |
| ROLLINS INC                  | 335     | 342   | 2,034  | 320,056   | 商業・専門サービス              |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

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

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                             | 期首(前期末) |       | 当期末     |            |                        | 業種等 |  |
|--------------------------------|---------|-------|---------|------------|------------------------|-----|--|
|                                | 株数      | 株数    | 評価額     |            |                        |     |  |
|                                |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                        |     |  |
| (アメリカ)                         | 百株      | 百株    | 千米ドル    | 千円         |                        |     |  |
| SUPER MICRO COMPUTER INC       | 608     | 598   | 2,017   | 317,267    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| SYNCHRONY FINANCIAL            | 449     | 448   | 3,252   | 511,526    | 金融サービス                 |     |  |
| SYNOPSYS INC                   | 178     | 218   | 8,442   | 1,327,995  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| SYSCO CORP                     | 567     | 571   | 4,329   | 681,008    | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| T ROWE PRICE GROUP INC         | 256     | 259   | 2,532   | 398,316    | 金融サービス                 |     |  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE  | 202     | 215   | 5,186   | 815,819    | メディア・娯楽                |     |  |
| TAPESTRY INC                   | —       | 244   | 2,555   | 402,026    | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| TARGA RESOURCES CORP           | 239     | 255   | 4,349   | 684,072    | エネルギー                  |     |  |
| TARGET CORP                    | 529     | 535   | 4,612   | 725,474    | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| TE CONNECTIVITY PLC            | 345     | 349   | 8,145   | 1,281,270  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC      | 53      | 55    | 2,728   | 429,169    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| TERADYNE INC                   | 188     | 189   | 3,181   | 500,402    | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| TESLA, INC.                    | 3,337   | 3,417 | 138,062 | 21,715,893 | 自動車・自動車部品              |     |  |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 1,294   | 1,351 | 3,303   | 519,581    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC          | 1,054   | 1,071 | 16,826  | 2,646,621  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP        | 22      | 23    | 2,085   | 328,101    | エネルギー                  |     |  |
| TEXTRON INC                    | 214     | 212   | 1,695   | 266,657    | 資本財                    |     |  |
| THE CIGNA GROUP                | 321     | 314   | 8,566   | 1,347,397  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC   | 441     | 445   | 25,535  | 4,016,459  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| TJX COS INC                    | 1,298   | 1,315 | 19,177  | 3,016,362  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| T-MOBILE US INC                | 604     | 603   | 12,743  | 2,004,373  | 電気通信サービス               |     |  |
| TOAST INC-CLASS A              | 462     | 528   | 1,741   | 273,895    | 金融サービス                 |     |  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY         | 617     | 625   | 3,284   | 516,641    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A    | 519     | 526   | 2,116   | 332,870    | メディア・娯楽                |     |  |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A   | 134     | 137   | 1,474   | 231,869    | 金融サービス                 |     |  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC         | 259     | 262   | 10,694  | 1,682,112  | 資本財                    |     |  |
| TRANSDIGM GROUP INC            | 64      | 66    | 8,882   | 1,397,160  | 資本財                    |     |  |
| TRANSUNION                     | 225     | 229   | 1,882   | 296,111    | 商業・専門サービス              |     |  |
| TRAVELERS COS INC/THE          | 262     | 267   | 7,622   | 1,198,872  | 保険                     |     |  |
| TRIMBLE INC                    | 281     | 281   | 2,129   | 334,895    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| TRUIST FINANCIAL CORP          | 1,534   | 1,544 | 6,894   | 1,084,400  | 銀行                     |     |  |
| TWILIO INC - A                 | 168     | 180   | 2,162   | 340,189    | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| TYLER TECHNOLOGIES INC         | 49      | 50    | 2,367   | 372,458    | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| TYSON FOODS INC-CL A           | 330     | 337   | 1,791   | 281,826    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                             | 期首(前期末) |       | 当期末    |            |                        | 業種等 |  |
|--------------------------------|---------|-------|--------|------------|------------------------|-----|--|
|                                | 株数      | 株数    | 評価額    |            |                        |     |  |
|                                |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額     |                        |     |  |
| (アメリカ)                         | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円         |                        |     |  |
| UBER TECHNOLOGIES INC          | 2,189   | 2,341 | 20,966 | 3,297,847  | 運輸                     |     |  |
| U-HAUL HOLDING CO              | 111     | 114   | 518    | 81,595     | 運輸                     |     |  |
| ULTA BEAUTY INC                | 53      | 52    | 2,635  | 414,502    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| UNION PACIFIC CORP             | 700     | 704   | 15,578 | 2,450,419  | 運輸                     |     |  |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC. | 94      | 96    | 879    | 138,366    | 運輸                     |     |  |
| UNITED PARCEL SERVICE INC      | 845     | 865   | 7,998  | 1,258,062  | 運輸                     |     |  |
| UNITED RENTALS INC             | 75      | 76    | 6,069  | 954,684    | 資本財                    |     |  |
| UNITED THERAPEUTICS CORP       | 48      | 50    | 2,406  | 378,447    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC         | 1,063   | 1,069 | 33,057 | 5,199,611  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC  | 67      | 67    | 1,534  | 241,360    | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| US BANCORP                     | 1,802   | 1,837 | 8,599  | 1,352,563  | 銀行                     |     |  |
| VALERO ENERGY CORP             | 365     | 369   | 6,654  | 1,046,635  | エネルギー                  |     |  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A      | 178     | 183   | 4,996  | 785,890    | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| VERALTO CORP                   | 285     | 292   | 2,870  | 451,434    | 商業・専門サービス              |     |  |
| VERISIGN INC                   | 99      | 99    | 2,449  | 385,318    | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| VERISK ANALYTICS INC           | 163     | 164   | 3,706  | 583,071    | 商業・専門サービス              |     |  |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC     | 4,871   | 4,977 | 20,503 | 3,225,017  | 電気通信サービス               |     |  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC     | 297     | 302   | 12,747 | 2,004,992  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| VERTIV HOLDINGS CO             | 411     | 426   | 7,282  | 1,145,408  | 資本財                    |     |  |
| VIATRIS INC                    | 1,379   | —     | —      | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| VISA INC-CLASS A SHARES        | 1,998   | 2,017 | 65,379 | 10,283,548 | 金融サービス                 |     |  |
| VISTRA CORP                    | 393     | 399   | 7,164  | 1,126,879  | 公益事業                   |     |  |
| VULCAN MATERIALS CO            | 152     | 155   | 4,425  | 696,125    | 素材                     |     |  |
| WABTEC CORP                    | 198     | 201   | 3,989  | 627,535    | 資本財                    |     |  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC   | 850     | —     | —      | —          | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| WALMART INC                    | 5,104   | 5,174 | 52,058 | 8,188,254  | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| WALT DISNEY CO                 | 2,092   | 2,119 | 22,184 | 3,489,349  | メディア・娯楽                |     |  |
| WARNER BROS DISCOVERY INC      | 2,693   | 2,771 | 6,400  | 1,006,720  | メディア・娯楽                |     |  |
| WASTE CONNECTIONS INC          | 298     | 304   | 5,321  | 836,956    | 商業・専門サービス              |     |  |
| WASTE MANAGEMENT INC           | 463     | 474   | 10,231 | 1,609,355  | 商業・専門サービス              |     |  |
| WATERS CORP                    | 68      | 70    | 2,640  | 415,268    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| WATSCO INC                     | 40      | 41    | 1,381  | 217,371    | 資本財                    |     |  |
| WEC ENERGY GROUP INC           | 365     | 376   | 4,146  | 652,138    | 公益事業                   |     |  |
| WELLS FARGO & CO               | 3,799   | 3,796 | 31,949 | 5,025,388  | 銀行                     |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                           | 期首(前期末)          |                | 当期末            |                |                          | 業種等 |  |
|------------------------------|------------------|----------------|----------------|----------------|--------------------------|-----|--|
|                              | 株数               | 株数             | 評価額            |                |                          |     |  |
|                              |                  |                | 外貨建金額          | 邦貨換算金額         |                          |     |  |
| (アメリカ)                       | 百株               | 百株             | 千米ドル           | 千円             |                          |     |  |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 83               | 84             | 2,185          | 343,748        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス   |     |  |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 399              | 411            | 6,328          | 995,454        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器       |     |  |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP       | 44               | —              | —              | —              | 素材                       |     |  |
| WEYERHAEUSER CO              | 839              | 855            | 1,826          | 287,215        | エクイティ不動産投資信託 (REIT)      |     |  |
| WILLIAMS COS INC             | 1,407            | 1,439          | 8,475          | 1,333,186      | エネルギー                    |     |  |
| WILLIAMS SONOMA INC          | 142              | 144            | 2,531          | 398,146        | 一般消費財・サービス流通・小売り         |     |  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 116              | 116            | 3,708          | 583,354        | 保険                       |     |  |
| WIX.COM LTD                  | 61               | 65             | 667            | 104,952        | ソフトウェア・サービス              |     |  |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 247              | 254            | 5,701          | 896,787        | ソフトウェア・サービス              |     |  |
| WR BERKLEY CORP              | 352              | 357            | 2,743          | 431,514        | 保険                       |     |  |
| WW GRAINGER INC              | 50               | 53             | 4,963          | 780,688        | 資本財                      |     |  |
| WYNN RESORTS LTD             | 107              | —              | —              | —              | 消費者サービス                  |     |  |
| XCEL ENERGY INC              | 663              | 680            | 5,417          | 852,165        | 公益事業                     |     |  |
| XYLEM INC                    | 280              | 286            | 3,988          | 627,342        | 資本財                      |     |  |
| YUM! BRANDS INC              | 322              | 327            | 4,862          | 764,826        | 消費者サービス                  |     |  |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 59               | 59             | 1,384          | 217,719        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器       |     |  |
| ZILLOW GROUP INC - C W/I     | 184              | 194            | 1,326          | 208,715        | 不動産管理・開発                 |     |  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 229              | 233            | 2,086          | 328,187        | ヘルスケア機器・サービス             |     |  |
| ZOETIS INC                   | 521              | 524            | 6,146          | 966,759        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス   |     |  |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 288              | 291            | 2,354          | 370,271        | ソフトウェア・サービス              |     |  |
| ZSCALER INC                  | 115              | 119            | 3,482          | 547,756        | ソフトウェア・サービス              |     |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 424,481<br>557 | 433,918<br>526 | 6,734,683<br>— | 1,059,298,313<br><73.4%> |     |  |
| (カナダ)                        |                  |                |                | 千カナダ・ドル        |                          |     |  |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 579              | 593            | 14,003         | 1,567,803      | 素材                       |     |  |
| AIR CANADA                   | 194              | —              | —              | —              | 運輸                       |     |  |
| ALAMOS GOLD INC-CLASS A      | —                | 496            | 2,362          | 264,479        | 素材                       |     |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 877              | 895            | 6,195          | 693,700        | 生活必需品流通・小売り              |     |  |
| ALTAGAS LTD                  | 348              | 355            | 1,569          | 175,708        | 公益事業                     |     |  |
| ARC RESOURCES LTD            | 686              | 691            | 1,744          | 195,280        | エネルギー                    |     |  |
| ATKINSREALIS GROUP INC       | —                | 195            | 1,740          | 194,894        | 資本財                      |     |  |
| BANK OF MONTREAL             | 844              | 848            | 14,527         | 1,626,538      | 銀行                       |     |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 1,441            | 1,472          | 13,849         | 1,550,567      | 銀行                       |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                                   | 期首(前期末) |       | 当期末     |           |                    | 業種等 |  |
|--------------------------------------|---------|-------|---------|-----------|--------------------|-----|--|
|                                      | 株数      | 株数    | 評価額     |           |                    |     |  |
|                                      |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |                    |     |  |
| (カナダ)                                | 百株      | 百株    | 千カナダ・ドル | 千円        |                    |     |  |
| BARRICK MINING CORPORATION           | 1,996   | 2,012 | 10,681  | 1,195,853 | 素材                 |     |  |
| BCE INC                              | 103     | 99    | 319     | 35,729    | 電気通信サービス           |     |  |
| BOMBARDIER INC-B                     | —       | 103   | 2,206   | 247,018   | 資本財                |     |  |
| BROOKFIELD ASSET MGMT-A              | 411     | 484   | 3,446   | 385,888   | 金融サービス             |     |  |
| BROOKFIELD CORPORATION-A             | 1,582   | 2,419 | 14,871  | 1,664,982 | 金融サービス             |     |  |
| BROOKFIELD RENEWABLE CORP            | 160     | 163   | 967     | 108,356   | 公益事業               |     |  |
| CAE INC                              | 369     | 360   | 1,316   | 147,380   | 資本財                |     |  |
| CAMECO CORP                          | 503     | 513   | 6,226   | 697,070   | エネルギー              |     |  |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE   | 1,091   | 1,102 | 13,027  | 1,458,531 | 銀行                 |     |  |
| CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO         | 618     | 630   | 8,290   | 928,224   | 運輸                 |     |  |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD       | 2,441   | 2,470 | 11,808  | 1,322,061 | エネルギー              |     |  |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED | 1,079   | 1,087 | 10,592  | 1,185,908 | 運輸                 |     |  |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A             | 61      | 60    | 1,008   | 112,889   | 一般消費財・サービス流通・小売り   |     |  |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A             | 160     | 164   | 693     | 77,627    | 公益事業               |     |  |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B            | 173     | 174   | 1,479   | 165,672   | 素材                 |     |  |
| CELESTICA INC                        | 134     | 135   | 5,963   | 667,709   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| CENOVUS ENERGY INC                   | 1,588   | 1,604 | 4,120   | 461,369   | エネルギー              |     |  |
| CGI INC                              | 235     | 236   | 2,873   | 321,690   | ソフトウェア・サービス        |     |  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC           | 23      | 23    | 7,607   | 851,695   | ソフトウェア・サービス        |     |  |
| DESCARTES SYSTEMS GRP/THE            | 99      | 101   | 1,137   | 127,387   | ソフトウェア・サービス        |     |  |
| DOLLARAMA INC                        | 322     | 327   | 6,387   | 715,137   | 一般消費財・サービス流通・小売り   |     |  |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP        | 471     | 477   | 1,717   | 192,288   | 商業・専門サービス          |     |  |
| EMERA INC                            | 345     | 355   | 2,414   | 270,334   | 公益事業               |     |  |
| EMPIRE CO LTD 'A'                    | 153     | 151   | 789     | 88,348    | 生活必需品流通・小売り        |     |  |
| ENBRIDGE INC                         | 2,520   | 2,574 | 17,608  | 1,971,433 | エネルギー              |     |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD          | 23      | 23    | 5,494   | 615,142   | 保険                 |     |  |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD           | 820     | 836   | 2,425   | 271,566   | 素材                 |     |  |
| FIRSTSERVICE CORP                    | 47      | 48    | 1,041   | 116,621   | 不動産管理・開発           |     |  |
| FORTIS INC                           | 578     | 595   | 4,317   | 483,346   | 公益事業               |     |  |
| FRANCO-NEVADA CORP                   | 222     | 227   | 6,284   | 703,637   | 素材                 |     |  |
| GEORGE WESTON LTD                    | 68      | 206   | 1,949   | 218,293   | 生活必需品流通・小売り        |     |  |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT         | 265     | 291   | 1,910   | 213,843   | 商業・専門サービス          |     |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                | 159     | 168   | 1,324   | 148,263   | 耐久消費財・アパレル         |     |  |
| GREAT-WEST LIFECO INC                | 326     | 331   | 2,088   | 233,850   | 保険                 |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                        | 期首(前期末) |       | 当期末     |           |             | 業種等 |  |
|---------------------------|---------|-------|---------|-----------|-------------|-----|--|
|                           | 株数      | 株数    | 評価額     |           |             |     |  |
|                           |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |             |     |  |
| (カナダ)                     | 百株      | 百株    | 千カナダ・ドル | 千円        |             |     |  |
| HYDRO ONE LTD             | 385     | 392   | 2,104   | 235,615   | 公益事業        |     |  |
| IA FINANCIAL CORP INC     | 108     | 110   | 1,808   | 202,529   | 保険          |     |  |
| IGM FINANCIAL INC         | 99      | 101   | 566     | 63,475    | 金融サービス      |     |  |
| IMPERIAL OIL LTD          | 206     | 210   | 2,930   | 328,053   | エネルギー       |     |  |
| INTACT FINANCIAL CORP     | 206     | 210   | 5,953   | 666,576   | 保険          |     |  |
| IVANHOE MINES LTD-CL A    | 861     | 880   | 1,112   | 124,593   | 素材          |     |  |
| KEYERA CORP               | 268     | 273   | 1,191   | 133,387   | エネルギー       |     |  |
| KINROSS GOLD CORP         | 1,419   | 1,445 | 5,198   | 581,973   | 素材          |     |  |
| LOBLAW COS LTD            | 175     | 705   | 4,328   | 484,610   | 生活必需品流通・小売り |     |  |
| LUNDIN GOLD INC           | —       | 128   | 1,458   | 163,282   | 素材          |     |  |
| LUNDIN MINING CORP        | 857     | 810   | 2,097   | 234,783   | 素材          |     |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC   | 312     | 317   | 2,124   | 237,813   | 自動車・自動車部品   |     |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP   | 2,000   | 2,017 | 9,615   | 1,076,519 | 保険          |     |  |
| METRO INC                 | 244     | 245   | 2,428   | 271,856   | 生活必需品流通・小売り |     |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA   | 455     | 463   | 7,509   | 840,752   | 銀行          |     |  |
| NUTRIEN LTD               | 568     | 576   | 4,534   | 507,733   | 素材          |     |  |
| ONEX CORPORATION          | 70      | —     | —       | —         | 金融サービス      |     |  |
| OPEN TEXT CORP            | 306     | 304   | 1,422   | 159,213   | ソフトウェア・サービス |     |  |
| PAN AMERICAN SILVER CORP  | 418     | 427   | 2,349   | 262,995   | 素材          |     |  |
| PEMBINA PIPELINE CORP     | 675     | 688   | 3,755   | 420,488   | エネルギー       |     |  |
| POWER CORP OF CANADA      | 651     | 660   | 4,503   | 504,160   | 保険          |     |  |
| QUEBECOR INC -CL B        | 189     | —     | —       | —         | 電気通信サービス    |     |  |
| RB GLOBAL INC             | 213     | 218   | 3,006   | 336,614   | 商業・専門サービス   |     |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN  | 356     | 368   | 3,515   | 393,619   | 消費者サービス     |     |  |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC | 425     | 436   | 2,351   | 263,262   | 電気通信サービス    |     |  |
| ROYAL BANK OF CANADA      | 1,635   | 1,663 | 34,682  | 3,883,030 | 銀行          |     |  |
| SAPUTO INC                | 298     | 296   | 1,145   | 128,269   | 食品・飲料・タバコ   |     |  |
| SHOPIFY INC - CLASS A     | 1,401   | 1,438 | 29,543  | 3,307,736 | ソフトウェア・サービス |     |  |
| STANTEC INC               | 132     | 135   | 1,823   | 204,213   | 資本財         |     |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC    | 668     | 667   | 5,506   | 616,548   | 保険          |     |  |
| SUNCOR ENERGY INC         | 1,455   | 1,450 | 9,172   | 1,026,912 | エネルギー       |     |  |
| TC ENERGY CORP            | 1,201   | 1,227 | 9,430   | 1,055,838 | エネルギー       |     |  |
| TECK RESOURCES LTD-CL B   | 548     | 550   | 3,101   | 347,198   | 素材          |     |  |
| TFI INTERNATIONAL INC     | 93      | 93    | 1,077   | 120,646   | 運輸          |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                             | 期首(前期末)          |              | 当期末          |              |                        | 業種等 |  |
|--------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|-----|--|
|                                | 株数               | 株数           | 評価額          |              |                        |     |  |
|                                |                  |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額       |                        |     |  |
| (カナダ)                          | 百株               | 百株           | 千カナダ・ドル      | 千円           |                        |     |  |
| THOMSON REUTERS CORP           | 182              | 186          | 3,519        | 394,053      | 商業・専門サービス              |     |  |
| TMX GROUP LTD                  | 323              | 330          | 1,706        | 191,090      | 金融サービス                 |     |  |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD        | 95               | 96           | 1,547        | 173,312      | 資本財                    |     |  |
| TORONTO-DOMINION BANK          | 2,024            | 2,030        | 23,280       | 2,606,475    | 銀行                     |     |  |
| TOURMALINE OIL CORP            | 411              | 435          | 2,694        | 301,725      | エネルギー                  |     |  |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD      | 63               | —            | —            | —            | 素材                     |     |  |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP   | 524              | 535          | 7,833        | 877,064      | 素材                     |     |  |
| WHITECAP RESOURCES INC         | —                | 1,465        | 1,718        | 192,353      | エネルギー                  |     |  |
| WSP GLOBAL INC                 | 151              | 154          | 3,804        | 425,969      | 資本財                    |     |  |
| 小計                             | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 46,824<br>81 | 50,869<br>82 | 437,839<br>— | 49,020,476<br><3.4%>   |     |  |
| (オーストラリア)                      |                  |              | 千オーストラリア・ドル  |              |                        |     |  |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD         | 3,443            | 3,518        | 12,356       | 1,259,870    | 銀行                     |     |  |
| APA GROUP                      | 1,503            | 1,546        | 1,445        | 147,397      | 公益事業                   |     |  |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD         | 652              | 661          | 3,765        | 383,932      | 消費者サービス                |     |  |
| ASX LTD                        | 224              | 229          | 1,333        | 136,009      | 金融サービス                 |     |  |
| BHP GROUP LIMITED              | 5,861            | 5,984        | 24,505       | 2,498,593    | 素材                     |     |  |
| BLUESCOPE STEEL LTD            | 506              | 516          | 1,168        | 119,099      | 素材                     |     |  |
| BRAMBLES LTD                   | 1,597            | 1,611        | 3,743        | 381,641      | 商業・専門サービス              |     |  |
| CARSALES.COM LTD               | 436              | 445          | 1,473        | 150,228      | メディア・娯楽                |     |  |
| COCHLEAR LTD                   | 75               | 77           | 2,078        | 211,900      | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| COLES GROUP LTD                | 1,548            | 1,581        | 3,534        | 360,332      | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 1,933            | 1,972        | 29,849       | 3,043,441    | 銀行                     |     |  |
| COMPUTERSHARE LIMITED          | 609              | 613          | 2,112        | 215,399      | 商業・専門サービス              |     |  |
| CSL LIMITED                    | 559              | 570          | 10,232       | 1,043,312    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| EVOLUTION MINING LTD           | —                | 2,354        | 2,599        | 265,072      | 素材                     |     |  |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD     | 1,957            | 1,997        | 4,067        | 414,674      | 素材                     |     |  |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD  | 2,731            | 2,787        | 2,154        | 219,678      | 保険                     |     |  |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI    | 496              | 681          | 1,834        | 187,095      | 素材                     |     |  |
| LOTTERY CORP LTD/THE           | 2,571            | 2,624        | 1,403        | 143,143      | 消費者サービス                |     |  |
| MACQUARIE GROUP LTD            | 418              | 426          | 8,106        | 826,514      | 金融サービス                 |     |  |
| MEDIBANK PRIVATE LTD           | 3,187            | 3,247        | 1,562        | 159,263      | 保険                     |     |  |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD    | 3,553            | 3,611        | 14,561       | 1,484,656    | 銀行                     |     |  |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD    | 1,319            | 1,598        | 4,090        | 417,091      | 素材                     |     |  |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                 | 期首(前期末) |        | 当期末        |           |                  | 業種等 |  |
|------------------------------------|---------|--------|------------|-----------|------------------|-----|--|
|                                    | 株数      | 株数     | 評価額        |           |                  |     |  |
|                                    |         |        | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |                  |     |  |
| (オーストラリア)                          | 百株      | 百株     | 千オーストラリアドル | 千円        |                  |     |  |
| ORIGIN ENERGY LIMITED              | 1,990   | 2,031  | 2,392      | 243,941   | 公益事業             |     |  |
| PRO MEDICUS LTD                    | 66      | 67     | 1,694      | 172,746   | ヘルスケア機器・サービス     |     |  |
| QANTAS AIRWAYS LTD                 | 852     | 872    | 836        | 85,259    | 運輸               |     |  |
| QBE INSURANCE GROUP LTD            | 1,738   | 1,779  | 3,512      | 358,164   | 保険               |     |  |
| REA GROUP LTD                      | 61      | 62     | 1,229      | 125,384   | メディア・娯楽          |     |  |
| REECE LTD                          | 261     | —      | —          | —         | 資本財              |     |  |
| RIO TINTO LTD                      | 428     | 437    | 5,656      | 576,693   | 素材               |     |  |
| SANTOS LTD                         | 3,751   | 3,825  | 2,555      | 260,552   | エネルギー            |     |  |
| SGH LTD                            | 234     | 239    | 1,035      | 105,589   | 資本財              |     |  |
| SIGMA HEALTHCARE LTD               | —       | 5,440  | 1,588      | 161,983   | ヘルスケア機器・サービス     |     |  |
| SONIC HEALTHCARE LTD               | 527     | 554    | 1,191      | 121,491   | ヘルスケア機器・サービス     |     |  |
| SOUTH32 LTD                        | 5,213   | 5,308  | 1,656      | 168,868   | 素材               |     |  |
| SUNCORP GROUP LTD                  | 1,250   | 1,275  | 2,403      | 245,035   | 保険               |     |  |
| TELSTRA GROUP LTD                  | 4,746   | 4,763  | 2,329      | 237,505   | 電気通信サービス         |     |  |
| TRANSURBAN GROUP                   | 3,592   | 3,669  | 5,526      | 563,510   | 運輸               |     |  |
| TREASURY WINE ESTATES LTD          | 938     | —      | —          | —         | 食品・飲料・タバコ        |     |  |
| WASHINGTON H SOUL PATTINSON        | —       | 282    | 1,010      | 103,029   | 金融サービス           |     |  |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON       | 276     | —      | —          | —         | 金融サービス           |     |  |
| WESFARMERS LIMITED                 | 1,310   | 1,337  | 10,696     | 1,090,619 | 一般消費財・サービス流通・小売り |     |  |
| WESTPAC BANKING CORP               | 3,966   | 4,034  | 15,065     | 1,536,085 | 銀行               |     |  |
| WISETECH GLOBAL LTD                | 212     | 236    | 1,487      | 151,702   | ソフトウェア・サービス      |     |  |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD          | 2,195   | 2,238  | 5,881      | 599,665   | エネルギー            |     |  |
| WOOLWORTHS GROUP LTD               | 1,412   | 1,440  | 4,014      | 409,313   | 生活必需品流通・小売り      |     |  |
| XERO LTD                           | 167     | 193    | 2,300      | 234,584   | ソフトウェア・サービス      |     |  |
| 小計                                 | 株数・金額   | 70,384 | 78,752     | 212,044   | 21,620,075       |     |  |
|                                    | 銘柄数<比率> | 43     | 43         | —         | <1.5%>           |     |  |
| (香港)                               |         |        | 千香港ドル      |           |                  |     |  |
| AIA GROUP LTD                      | 12,466  | 12,528 | 97,661     | 1,971,787 | 保険               |     |  |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD         | 4,270   | 4,360  | 16,639     | 335,946   | 銀行               |     |  |
| CK ASSET HOLDINGS LTD              | 2,219   | 2,269  | 8,917      | 180,044   | 不動産管理・開発         |     |  |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD          | 3,099   | 3,159  | 16,837     | 339,958   | 資本財              |     |  |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED | 725     | 740    | 4,033      | 81,426    | 公益事業             |     |  |
| CLP HOLDINGS LTD                   | 1,891   | 1,931  | 13,268     | 267,899   | 公益事業             |     |  |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD     | 2,528   | 2,578  | 10,276     | 207,478   | 消費者サービス          |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                                     | 期首(前期末) |        | 当期末       |           |           | 業種等 |  |
|--|---------|--------|-----------|-----------|-----------|-----|--|
|  | 株数      | 株数     | 評価額       |           |           |     |  |
|  |         |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額    |           |     |  |
| (香港)                                   | 百株      | 百株     | 千香港ドル     | 千円        |           |     |  |
| HANG SENG BANK LTD                     | 869     | 887    | 13,430    | 271,171   | 銀行        |     |  |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT             | 1,686   | 1,716  | 5,073     | 102,438   | 不動産管理・開発  |     |  |
| HKT TRUST AND HKT LTD                  | 4,540   | 4,610  | 5,439     | 109,829   | 電気通信サービス  |     |  |
| HONG KONG & CHINA GAS                  | 12,934  | 13,194 | 9,565     | 193,135   | 公益事業      |     |  |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR            | 1,392   | 1,419  | 59,091    | 1,193,062 | 金融サービス    |     |  |
| MTR CORP                               | 1,797   | 1,832  | 5,504     | 111,145   | 運輸        |     |  |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD              | 1,600   | 1,630  | 8,382     | 169,246   | 公益事業      |     |  |
| SANDS CHINA LTD                        | 2,793   | 2,857  | 5,789     | 116,898   | 消費者サービス   |     |  |
| SINO LAND CO                           | 4,700   | 4,340  | 4,509     | 91,041    | 不動産管理・開発  |     |  |
| SITC INTERNATIONAL HOLDINGS            | 1,550   | 1,590  | 4,496     | 90,784    | 運輸        |     |  |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD            | 1,670   | 1,705  | 16,941    | 342,048   | 不動産管理・開発  |     |  |
| SWIRE PACIFIC LTD                      | 463     | 413    | 2,800     | 56,541    | 資本財       |     |  |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO               | 1,585   | 1,725  | 14,490    | 292,553   | 資本財       |     |  |
| WH GROUP LTD                           | 9,605   | 9,810  | 8,573     | 173,107   | 食品・飲料・タバコ |     |  |
| WHARF HOLDINGS LTD                     | 1,240   | 1,260  | 3,001     | 60,596    | 不動産管理・開発  |     |  |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT           | 1,927   | 1,967  | 4,717     | 95,249    | 不動産管理・開発  |     |  |
| 小計                                     | 株数・金額   | 77,555 | 78,526    | 339,444   | 6,853,392 |     |  |
|  | 銘柄数<比率> | 23     | 23        | -         | <0.5%>    |     |  |
| (シンガポール)                               |         |        | 千シンガポールドル |           |           |     |  |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI           | 2,718   | 2,766  | 730       | 87,889    | 不動産管理・開発  |     |  |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD                 | 2,302   | 2,509  | 13,474    | 1,621,779 | 銀行        |     |  |
| GENTING SINGAPORE LTD                  | 7,005   | 7,150  | 536       | 64,543    | 消費者サービス   |     |  |
| KEPPEL CORP LTD                        | 1,681   | 1,717  | 1,727     | 207,898   | 資本財       |     |  |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP           | 3,910   | 3,991  | 7,247     | 872,327   | 銀行        |     |  |
| SEMCORP INDUSTRIES LTD                 | 1,027   | 1,051  | 661       | 79,567    | 公益事業      |     |  |
| SINGAPORE AIRLINES LTD                 | 1,721   | 1,786  | 1,153     | 138,866   | 運輸        |     |  |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD                 | 990     | 1,009  | 1,695     | 204,024   | 金融サービス    |     |  |
| SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD | 1,803   | 1,840  | 1,593     | 191,786   | 資本財       |     |  |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS           | 8,670   | 8,826  | 4,289     | 516,276   | 電気通信サービス  |     |  |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD               | 1,460   | 1,486  | 5,028     | 605,245   | 銀行        |     |  |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD               | 2,219   | 2,274  | 754       | 90,867    | 食品・飲料・タバコ |     |  |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING               | 2,981   | 3,042  | 1,019     | 122,655   | 資本財       |     |  |
| 小計                                     | 株数・金額   | 38,487 | 39,447    | 39,911    | 4,803,727 |     |  |
|  | 銘柄数<比率> | 13     | 13        | -         | <0.3%>    |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                           | 期首(前期末) |        | 当期末         |           |                        | 業種等 |  |
|------------------------------|---------|--------|-------------|-----------|------------------------|-----|--|
|                              | 株数      | 株数     | 評価額         |           |                        |     |  |
|                              |         |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |                        |     |  |
| (ニュージーランド)                   | 百株      | 百株     | ニュージーランド・ドル | 千円        |                        |     |  |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 1,941   | 1,989  | 1,547       | 136,518   | 運輸                     |     |  |
| CONTACT ENERGY LTD           | 921     | 988    | 919         | 81,119    | 公益事業                   |     |  |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 677     | 690    | 2,539       | 224,035   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| INFRATIL LTD                 | 1,064   | 1,098  | 1,268       | 111,918   | 金融サービス                 |     |  |
| MERIDIAN ENERGY LTD          | 1,506   | 1,544  | 895         | 79,004    | 公益事業                   |     |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 6,111  | 6,310       | 7,170     | 632,596                |     |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 5      | 5           | —         | <0.0%>                 |     |  |
| (イギリス)                       |         |        | 千イギリス・ポンド   |           |                        |     |  |
| 3I GROUP PLC                 | 1,123   | 1,146  | 3,807       | 781,631   | 金融サービス                 |     |  |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 301     | 307    | 971         | 199,441   | 保険                     |     |  |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 1,467   | 1,306  | 3,600       | 739,264   | 素材                     |     |  |
| ANTOFAGASTA PLC              | 454     | 463    | 1,225       | 251,630   | 素材                     |     |  |
| ASHTEAD GROUP PLC            | 503     | 502    | 2,325       | 477,477   | 資本財                    |     |  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 378     | 380    | 798         | 164,009   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| ASTRAZENECA PLC              | 1,791   | 1,828  | 24,854      | 5,102,892 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| AUTO TRADER GROUP PLC-WI     | 1,026   | 1,027  | 678         | 139,397   | メディア・娯楽                |     |  |
| AVIVA PLC                    | 3,094   | 3,604  | 2,277       | 467,688   | 保険                     |     |  |
| BAE SYSTEMS PLC              | 3,477   | 3,551  | 6,124       | 1,257,465 | 資本財                    |     |  |
| BARCLAYS PLC                 | 16,648  | 16,659 | 6,657       | 1,366,798 | 銀行                     |     |  |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 1,594   | 1,616  | 598         | 122,964   | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| BP PLC                       | 18,627  | 18,696 | 8,518       | 1,748,900 | エネルギー                  |     |  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 2,296   | 2,457  | 10,255      | 2,105,612 | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| BT GROUP PLC                 | 7,549   | 7,098  | 1,239       | 254,456   | 電気通信サービス               |     |  |
| BUNZL PLC                    | 381     | 386    | 808         | 166,065   | 資本財                    |     |  |
| CENTRICA PLC                 | 5,854   | 5,711  | 945         | 194,073   | 公益事業                   |     |  |
| COCA-COLA HBC AG-CDI         | 250     | 256    | 913         | 187,579   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| COMPASS GROUP PLC            | 1,960   | 2,000  | 4,888       | 1,003,611 | 消費者サービス                |     |  |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 153     | —      | —           | —         | 素材                     |     |  |
| DCC PLC                      | 114     | 115    | 572         | 117,637   | 資本財                    |     |  |
| DIAGEO PLC                   | 2,570   | 2,624  | 4,466       | 916,927   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| ENTAIN PLC                   | 702     | 716    | 510         | 104,766   | 消費者サービス                |     |  |
| EXPERIAN PLC                 | 1,061   | 1,082  | 3,538       | 726,582   | 商業・専門サービス              |     |  |
| FRESNILLO PLC                | —       | 258    | 623         | 128,107   | 素材                     |     |  |
| GLENCORE PLC                 | 11,975  | 11,949 | 4,216       | 865,759   | 素材                     |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                                | 期首(前期末) |        | 当期末    |           |                        | 業種等 |  |
|-----------------------------------|---------|--------|--------|-----------|------------------------|-----|--|
|                                   | 株数      | 株数     | 評価額    |           |                        |     |  |
|                                   |         |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |     |  |
| (イギリス)                            | 百株      | 百株     | 千円     |           |                        |     |  |
| GSK PLC                           | 4,789   | 4,814  | 8,534  | 1,752,116 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| HALEON PLC                        | 9,935   | 10,590 | 3,869  | 794,481   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| HALMA PLC                         | 438     | 447    | 1,480  | 304,035   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC         | 191     | 196    | 309    | 63,469    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| HSBC HOLDINGS PLC                 | 20,649  | 20,562 | 21,541 | 4,422,643 | 銀行                     |     |  |
| IMPERIAL BRANDS PLC               | 915     | 909    | 2,947  | 605,129   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| INFORMA PLC                       | 1,535   | 1,536  | 1,399  | 287,379   | メディア・娯楽                |     |  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 182     | 172    | 1,644  | 337,672   | 消費者サービス                |     |  |
| INTERTEK GROUP PLC                | 186     | 185    | 895    | 183,791   | 商業・専門サービス              |     |  |
| JD SPORTS FASHION PLC             | 2,994   | 2,987  | 240    | 49,321    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| KINGFISHER PLC                    | 2,096   | 2,070  | 598    | 122,958   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC         | 6,827   | 6,787  | 1,588  | 326,085   | 保険                     |     |  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC          | 70,030  | 70,606 | 6,185  | 1,269,877 | 銀行                     |     |  |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP       | 552     | 560    | 4,700  | 964,990   | 金融サービス                 |     |  |
| M&G PLC                           | 2,648   | 2,706  | 707    | 145,215   | 金融サービス                 |     |  |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC         | 2,366   | 2,420  | 817    | 167,941   | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            | 1,484   | 1,498  | 895    | 183,878   | 資本財                    |     |  |
| MONDI PLC/WI                      | 510     | 521    | 435    | 89,481    | 素材                     |     |  |
| NATIONAL GRID PLC                 | 5,652   | 5,777  | 6,679  | 1,371,336 | 公益事業                   |     |  |
| NATWEST GROUP PLC                 | 8,836   | 9,545  | 5,549  | 1,139,462 | 銀行                     |     |  |
| NEXT PLC                          | 135     | 137    | 1,901  | 390,309   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| NMC HEALTH PLC                    | 47      | 47     | 0,005  | 0,975     | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| PEARSON PLC                       | 691     | 690    | 688    | 141,268   | 消費者サービス                |     |  |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC        | 820     | 836    | 546    | 112,262   | 保険                     |     |  |
| PRUDENTIAL PLC                    | 3,060   | 3,042  | 3,150  | 646,894   | 保険                     |     |  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 792     | 800    | 4,627  | 949,997   | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| RELX PLC                          | 2,147   | 2,162  | 6,523  | 1,339,281 | 商業・専門サービス              |     |  |
| RENTOKIL INITIAL PLC              | 2,917   | 2,979  | 1,186  | 243,536   | 商業・専門サービス              |     |  |
| RIO TINTO PLC                     | 1,302   | 1,330  | 7,060  | 1,449,599 | 素材                     |     |  |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC          | 9,823   | 9,958  | 10,621 | 2,180,614 | 資本財                    |     |  |
| SAGE GROUP PLC                    | 1,157   | 1,140  | 1,242  | 255,089   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| SAINSBURY (J) PLC                 | 2,029   | 2,033  | 648    | 133,106   | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| SCHRODERS PLC                     | 931     | 857    | 326    | 67,002    | 金融サービス                 |     |  |
| SEVERN TRENT PLC                  | 312     | 319    | 857    | 176,082   | 公益事業                   |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                           | 期首(前期末)          |               | 当期末           |              |                      | 業種等 |  |
|------------------------------|------------------|---------------|---------------|--------------|----------------------|-----|--|
|                              | 株数               | 株数            | 評価額           |              |                      |     |  |
|                              |                  |               | 外貨建金額         | 邦貨換算金額       |                      |     |  |
| (イギリス)                       | 百株               | 百株            | 千イギリス・ポンド     | 千円           |                      |     |  |
| SHELL PLC-NEW                | 7,041            | 6,945         | 19,405        | 3,984,132    | エネルギー                |     |  |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 960              | 980           | 1,213         | 249,238      | ヘルスケア機器・サービス         |     |  |
| SMITHS GROUP PLC             | 395              | 389           | 941           | 193,274      | 資本財                  |     |  |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 85               | 86            | 594           | 121,988      | 資本財                  |     |  |
| SSE PLC                      | 1,273            | 1,302         | 2,857         | 586,637      | 公益事業                 |     |  |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 2,374            | 2,328         | 3,631         | 745,639      | 銀行                   |     |  |
| TESCO PLC                    | 7,782            | 7,735         | 3,399         | 697,983      | 生活必需品流通・小売り          |     |  |
| UNILEVER PLC                 | 2,862            | 2,890         | 12,943        | 2,657,435    | 家庭用品・パーソナル用品         |     |  |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 787              | 803           | 932           | 191,354      | 公益事業                 |     |  |
| VALTERRA PLATINUM LIMITED    | —                | 151           | 720           | 147,970      | 素材                   |     |  |
| VODAFONE GROUP PLC           | 23,873           | 23,157        | 2,123         | 435,988      | 電気通信サービス             |     |  |
| WHITBREAD PLC                | 204              | 206           | 565           | 116,138      | 消費者サービス              |     |  |
| WISE PLC - A                 | 769              | 785           | 703           | 144,495      | 金融サービス               |     |  |
| WPP PLC                      | 1,247            | 1,276         | 400           | 82,181       | メディア・娯楽              |     |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 304,013<br>72 | 306,030<br>73 | 256,254<br>— | 52,611,517<br><3.6%> |     |  |
| (イスラエル)                      | 千イスラエル・ショケル      |               |               |              |                      |     |  |
| AZRIELI GROUP                | 49               | 50            | 1,721         | 82,840       | 不動産管理・開発             |     |  |
| BANK HAPOALIM BM             | 1,453            | 1,473         | 10,298        | 495,699      | 銀行                   |     |  |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         | 1,735            | 1,760         | 12,291        | 591,593      | 銀行                   |     |  |
| ELBIT SYSTEMS LTD            | 30               | 32            | 5,167         | 248,731      | 資本財                  |     |  |
| ICL GROUP LTD                | 894              | 915           | 1,636         | 78,747       | 素材                   |     |  |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A       | 1,424            | 1,445         | 4,962         | 238,836      | 銀行                   |     |  |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD     | 179              | 184           | 4,268         | 205,443      | 銀行                   |     |  |
| NICE LTD                     | 72               | 74            | 2,538         | 122,195      | ソフトウェア・サービス          |     |  |
| NOVA LTD                     | 33               | 34            | 3,266         | 157,200      | 半導体・半導体製造装置          |     |  |
| PHOENIX FINANCIAL LTD        | —                | 266           | 3,650         | 175,708      | 保険                   |     |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 5,874<br>9    | 6,237<br>10   | 49,800<br>—  | 2,396,996<br><0.2%>  |     |  |
| (スイス)                        | 千スイス・フラン         |               |               |              |                      |     |  |
| ABB LTD                      | 1,826            | 1,847         | 10,058        | 1,963,512    | 資本財                  |     |  |
| ALCON INC                    | 577              | 588           | 3,562         | 695,337      | ヘルスケア機器・サービス         |     |  |
| AMRIZE LTD                   | —                | 601           | 2,275         | 444,097      | 素材                   |     |  |
| AVOLTA AG                    | 101              | 103           | 437           | 85,494       | 一般消費財・サービス流通・小売り     |     |  |

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                | 期首(前期末) |       | 当期末      |           |                        | 業種等 |  |
|-----------------------------------|---------|-------|----------|-----------|------------------------|-----|--|
|                                   | 株数      | 株数    | 評価額      |           |                        |     |  |
|                                   |         |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |                        |     |  |
| (スイス)                             | 百株      | 百株    | チスイス・フラン | 千円        |                        |     |  |
| BALOISE HOLDING AG                | 47      | 48    | 999      | 195,087   | 保険                     |     |  |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG      | 35      | 35    | 333      | 65,136    | 銀行                     |     |  |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG            | 4       | 4     | 510      | 99,683    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| BELIMO HOLDING AG-REG             | —       | 11    | 874      | 170,695   | 資本財                    |     |  |
| BKW AG                            | 24      | 24    | 405      | 79,135    | 公益事業                   |     |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC        | 1       | 1     | 1,324    | 258,522   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG       | 0.12    | 0.12  | 1,459    | 284,835   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG       | 621     | 633   | 10,241   | 1,999,089 | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG         | 8       | 8     | 442      | 86,422    | 素材                     |     |  |
| GALDERMA GROUP AG                 | 96      | 154   | 2,273    | 443,857   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| GEBERIT AG-REG                    | 38      | 39    | 2,438    | 476,049   | 資本財                    |     |  |
| GIVAUDAN-REG                      | 10      | 10    | 3,547    | 692,563   | 素材                     |     |  |
| HELVETIA HOLDING AG-REG           | 42      | 43    | 892      | 174,136   | 保険                     |     |  |
| HOLCIM LTD                        | 601     | 600   | 4,276    | 834,769   | 素材                     |     |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD             | 238     | 242   | 1,395    | 272,362   | 金融サービス                 |     |  |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG        | 55      | 56    | 865      | 168,976   | 運輸                     |     |  |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG        | 175     | 179   | 1,551    | 302,860   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| LONZA GROUP AG                    | 83      | 82    | 4,383    | 855,659   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| NESTLE SA                         | 3,027   | 3,037 | 24,126   | 4,709,451 | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| NOVARTIS AG                       | 2,277   | 2,241 | 22,909   | 4,471,943 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG         | 26      | 26    | 2,436    | 475,583   | 金融サービス                 |     |  |
| ROCHE HOLDING AG                  | 811     | 828   | 25,687   | 5,014,171 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| ROCHE HOLDING AG-BR               | 36      | 37    | 1,222    | 238,702   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| SANDOZ GROUP AG                   | 482     | 492   | 2,654    | 518,236   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG          | 27      | 27    | 736      | 143,803   | 資本財                    |     |  |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT       | 47      | 47    | 1,333    | 260,330   | 資本財                    |     |  |
| SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE | 175     | 195   | 1,738    | 339,290   | 商業・専門サービス              |     |  |
| SIG GROUP AG                      | 353     | 361   | 317      | 61,943    | 素材                     |     |  |
| SIKA AG-BEARER                    | 176     | 179   | 2,690    | 525,167   | 素材                     |     |  |
| SONOVA HOLDING AG-REG             | 58      | 59    | 1,161    | 226,813   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| STRAUMANN HOLDING AG              | 128     | 131   | 1,261    | 246,252   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| SWATCH GROUP AG                   | 33      | 34    | 572      | 111,719   | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG         | 33      | 33    | 2,868    | 559,862   | 保険                     |     |  |
| SWISS PRIME SITE-REG              | 89      | 94    | 1,091    | 213,092   | 不動産管理・開発               |     |  |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                        | 期首(前期末)          |              | 当期末          |              |                        | 業種等 |  |
|---------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|-----|--|
|                           | 株数               | 株数           | 評価額          |              |                        |     |  |
|                           |                  |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額       |                        |     |  |
| (スイス)                     | 百株               | 百株           | 千円           |              |                        |     |  |
| SWISS RE AG               | 348              | 352          | チスイス・フラン     | 948,553      | 保険                     |     |  |
| SWISSCOM AG               | 30               | 31           | 1,790        | 349,569      | 電気通信サービス               |     |  |
| TEMENOS GROUP AG-REG      | 65               | —            | —            | —            | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| UBS GROUP AG              | 3,798            | 3,741        | 11,448       | 2,234,783    | 金融サービス                 |     |  |
| VAT GROUP AG              | 31               | 31           | 1,029        | 200,997      | 資本財                    |     |  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 169              | 172          | 9,646        | 1,882,919    | 保険                     |     |  |
| 小計                        | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 16,816<br>42 | 17,479<br>43 | 176,134<br>— | 34,381,474<br><2.4%>   |     |  |
| (デンマーク)                   |                  |              | 千デンマーク・クローネ  |              |                        |     |  |
| A P MOLLER - MAERSK A/S   | 5                | 4            | 5,835        | 141,692      | 運輸                     |     |  |
| A P MOLLER - MAERSK A/S   | 3                | 3            | 4,356        | 105,767      | 運輸                     |     |  |
| CARLSBERG AS-B            | 110              | 110          | 8,471        | 205,692      | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| COLOPLAST-B               | 145              | 148          | 8,497        | 206,330      | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| DANSKE BANK A/S           | 797              | 787          | 22,491       | 546,098      | 銀行                     |     |  |
| DEMANT A/S                | 101              | 100          | 2,128        | 51,684       | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| DSV A/S                   | 236              | 240          | 33,578       | 815,290      | 運輸                     |     |  |
| GENMAB A/S                | 72               | 71           | 14,217       | 345,192      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| NOVONESIS (NOVOZYMES) B   | 406              | 415          | 16,590       | 402,808      | 素材                     |     |  |
| NOVO-NORDISK A/S          | 3,721            | 3,796        | 117,953      | 2,863,910    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| ORSTED A/S                | 194              | 198          | 2,491        | 60,484       | 公益事業                   |     |  |
| PANDORA A/S               | 94               | 93           | 7,013        | 170,293      | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| ROCKWOOL A/S-B SHS        | 108              | 113          | 2,319        | 56,312       | 資本財                    |     |  |
| TRYGVESTA AS              | 392              | 397          | 6,276        | 152,381      | 保険                     |     |  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S   | 1,167            | 1,190        | 18,128       | 440,154      | 資本財                    |     |  |
| ZEALAND PHARMA A/S        | 73               | —            | —            | —            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| 小計                        | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 7,631<br>16  | 7,674<br>15  | 270,349<br>— | 6,564,092<br><0.5%>    |     |  |
| (ノルウェー)                   |                  |              | 千ノルウェー・クローネ  |              |                        |     |  |
| AKER BP ASA               | 365              | 372          | 9,432        | 145,823      | エネルギー                  |     |  |
| DNB BANK ASA              | 1,032            | 1,044        | 27,300       | 422,071      | 銀行                     |     |  |
| EQUINOR ASA               | 966              | 903          | 21,312       | 329,486      | エネルギー                  |     |  |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 230              | 235          | 6,450        | 99,729       | 保険                     |     |  |
| KONGSBERG GRUPPEN ASA     | 101              | 518          | 12,248       | 189,366      | 資本財                    |     |  |
| MOWI ASA                  | 535              | 547          | 12,021       | 185,846      | 食品・飲料・タバコ              |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                          | 期首(前期末) |       | 当期末          |           |                        | 業種等 |  |
|-----------------------------|---------|-------|--------------|-----------|------------------------|-----|--|
|                             | 株数      | 株数    | 評価額          |           |                        |     |  |
|                             |         |       | 外貨建金額        | 邦貨換算金額    |                        |     |  |
| (ノルウェー)                     | 百株      | 百株    | 千ノルウェー・クローネ  | 千円        |                        |     |  |
| NORSK HYDRO ASA             | 1,619   | 1,628 | 11,559       | 178,711   | 素材                     |     |  |
| ORKLA ASA                   | 804     | 821   | 8,625        | 133,357   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| SALMAR ASA                  | 76      | 78    | 4,489        | 69,414    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| TELENOR ASA                 | 733     | 740   | 10,478       | 161,993   | 電気通信サービス               |     |  |
| YARA INTERNATIONAL ASA      | 190     | 194   | 7,061        | 109,175   | 素材                     |     |  |
| 小計                          | 株数・金額   | 6,655 | 7,084        | 130,981   | 2,024,976              |     |  |
|                             | 銘柄数<比率> | 11    | 11           | —         | <0.1%>                 |     |  |
| (スウェーデン)                    |         |       | 千スウェーデン・クローナ |           |                        |     |  |
| ADDTECH AB-B SHARES         | 300     | 305   | 9,430        | 155,326   | 資本財                    |     |  |
| ALFA LAVAL AB               | 333     | 340   | 14,779       | 243,419   | 資本財                    |     |  |
| ASSA ABLOY AB               | 1,156   | 1,180 | 40,786       | 671,760   | 資本財                    |     |  |
| ATLAS COPCO AB              | 1,802   | 1,840 | 25,149       | 414,216   | 資本財                    |     |  |
| ATLAS COPCO AB-A SHS        | 3,103   | 3,165 | 47,881       | 788,611   | 資本財                    |     |  |
| BEIJER REF AB               | 444     | 453   | 6,652        | 109,568   | 資本財                    |     |  |
| BIOVITRUM                   | 225     | 230   | 7,698        | 126,787   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BOLIDEN AB                  | 315     | 333   | 14,005       | 230,667   | 素材                     |     |  |
| EPIROC AB-A                 | 761     | 776   | 14,698       | 242,088   | 資本財                    |     |  |
| EPIROC AB-B                 | 450     | 460   | 7,843        | 129,188   | 資本財                    |     |  |
| EQT AB                      | 430     | 436   | 13,929       | 229,412   | 金融サービス                 |     |  |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B         | 704     | 709   | 18,287       | 301,187   | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| EVOLUTION AB                | 183     | 168   | 10,619       | 174,895   | 消費者サービス                |     |  |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 828     | 843   | 5,754        | 94,779    | 不動産管理・開発               |     |  |
| HENNES & MAURITZ AB         | 655     | 665   | 11,633       | 191,602   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| HEXAGON AB-B SHS            | 2,398   | 2,447 | 26,836       | 441,993   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| HOLMEN AB-B SHARES          | 87      | 89    | 3,121        | 51,403    | 素材                     |     |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS     | 138     | 143   | 5,603        | 92,281    | 金融サービス                 |     |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS     | 176     | 179   | 7,001        | 115,319   | 金融サービス                 |     |  |
| INDUTRADE AB                | 315     | 321   | 7,321        | 120,591   | 資本財                    |     |  |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS  | 170     | 173   | 3,952        | 65,102    | 資本財                    |     |  |
| INVESTOR AB                 | 1,995   | 2,038 | 62,906       | 1,036,071 | 金融サービス                 |     |  |
| LIFCO AB-B SHS              | 268     | 274   | 9,391        | 154,681   | 資本財                    |     |  |
| LUNDBERGS AB-B SHS          | 86      | 88    | 4,409        | 72,627    | 金融サービス                 |     |  |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS    | 1,753   | 1,787 | 5,730        | 94,378    | 資本財                    |     |  |
| SAAB AB-B                   | 370     | 377   | 18,571       | 305,875   | 資本財                    |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                              | 期首(前期末)          |              | 当期末          |              |                      | 業種等 |  |
|---------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|----------------------|-----|--|
|                                 | 株数               | 株数           | 評価額          |              |                      |     |  |
|                                 |                  |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額       |                      |     |  |
| (スウェーデン)                        | 百株               | 百株           | 千ユーロ・クロナ     | 千円           |                      |     |  |
| SAGAX AB-B                      | 253              | 258          | 5,240        | 86,315       | 不動産管理・開発             |     |  |
| SANDVIK AB                      | 1,231            | 1,256        | 34,987       | 576,237      | 資本財                  |     |  |
| SECURITAS AB                    | 567              | 579          | 8,051        | 132,611      | 商業・専門サービス            |     |  |
| SKANDINAViska ENSKILDA BAN-A    | 1,833            | 1,783        | 31,566       | 519,908      | 銀行                   |     |  |
| SKANSKA AB-B SHS                | 392              | 400          | 9,683        | 159,494      | 資本財                  |     |  |
| SKF AB                          | 393              | 401          | 9,485        | 156,219      | 資本財                  |     |  |
| SVENSKA CELLULOSA AB            | 700              | 716          | 8,566        | 141,089      | 素材                   |     |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN           | 1,686            | 1,722        | 21,258       | 350,133      | 銀行                   |     |  |
| SWEDBANK AB - A SHARES          | 981              | 1,001        | 28,524       | 469,796      | 銀行                   |     |  |
| TELE2 AB                        | 654              | 659          | 9,559        | 157,439      | 電気通信サービス             |     |  |
| TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON | 3,209            | 3,299        | 29,621       | 487,864      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器   |     |  |
| TELIA CO AB                     | 2,815            | 2,854        | 10,431       | 171,808      | 電気通信サービス             |     |  |
| TRELLEBORG AB-B SHS             | 245              | 238          | 9,019        | 148,545      | 資本財                  |     |  |
| VOLVO AB                        | 1,835            | 1,873        | 50,175       | 826,382      | 資本財                  |     |  |
| 小計                              | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 36,259<br>40 | 36,880<br>40 | 670,169<br>- | 11,037,685<br><0.8%> |     |  |
| (ユーロ／アイルランド)                    |                  |              | 千ユーロ         |              |                      |     |  |
| AIB GROUP PLC                   | 2,419            | 2,517        | 2,082        | 377,606      | 銀行                   |     |  |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC       | 1,159            | 1,136        | 1,700        | 308,453      | 銀行                   |     |  |
| KERRY GROUP PLC-A               | 172              | 193          | 1,485        | 269,314      | 食品・飲料・タバコ            |     |  |
| KINGSPAN GROUP PLC              | 178              | 182          | 1,197        | 217,146      | 資本財                  |     |  |
| RYANAIR HOLDINGS PLC            | -                | 1,000        | 2,649        | 480,419      | 運輸                   |     |  |
| 小計                              | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 3,930<br>4   | 5,030<br>5   | 9,115<br>-   | 1,652,940<br><0.1%>  |     |  |
| (ユーロ／オランダ)                      |                  |              |              |              |                      |     |  |
| ABN AMRO BANK NV                | 529              | 686          | 1,826        | 331,201      | 銀行                   |     |  |
| ADYEN NV                        | 25               | 29           | 3,934        | 713,559      | 金融サービス               |     |  |
| AIRBUS SE                       | 686              | 700          | 14,237       | 2,581,784    | 資本財                  |     |  |
| AKZO NOBEL NV                   | 197              | 201          | 1,083        | 196,570      | 素材                   |     |  |
| ASM INTERNATIONAL NV            | 54               | 55           | 2,730        | 495,161      | 半導体・半導体製造装置          |     |  |
| ASML HOLDING NV                 | 455              | 464          | 41,163       | 7,464,510    | 半導体・半導体製造装置          |     |  |
| ASR NEDERLAND NV                | 183              | 174          | 995          | 180,439      | 保険                   |     |  |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES     | 93               | 86           | 1,111        | 201,568      | 半導体・半導体製造装置          |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                            | 期首(前期末)          |              | 当期末          |              |                        | 業種等 |  |
|-------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|-----|--|
|                               | 株数               | 株数           | 評価額          |              |                        |     |  |
|                               |                  |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額       |                        |     |  |
| (ユーロ／オランダ)                    |                  |              |              |              |                        |     |  |
| CVC CAPITAL PARTNERS PLC      | 百株<br>245        | 百株<br>250    | 千ユーロ<br>346  | 千円<br>62,881 | 金融サービス                 |     |  |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV      | 712              | 724          | 392          | 71,117       | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| DSM-FIRMENICH AG              | 214              | 219          | 1,527        | 277,040      | 素材                     |     |  |
| EURONEXT NV                   | 90               | 92           | 1,163        | 210,938      | 金融サービス                 |     |  |
| EXOR NV                       | 113              | 109          | 777          | 140,936      | 金融サービス                 |     |  |
| FERRARI NV                    | 145              | 148          | 5,028        | 911,914      | 自動車・自動車部品              |     |  |
| HEINEKEN HOLDING NV           | 149              | 152          | 914          | 165,826      | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| HEINEKEN NV                   | 332              | 339          | 2,322        | 421,238      | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| IMCD NV                       | 68               | 69           | 532          | 96,586       | 資本財                    |     |  |
| ING GROEP NV-CVA              | 3,636            | 3,561        | 7,650        | 1,387,331    | 銀行                     |     |  |
| INPOST SA                     | 259              | 293          | 293          | 53,268       | 運輸                     |     |  |
| JDE PEET'S BV                 | 197              | 201          | 634          | 115,085      | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 1,062            | 1,069        | 3,723        | 675,235      | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV        | 922              | 907          | 2,125        | 385,519      | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| NN GROUP NV                   | 310              | 316          | 1,908        | 346,003      | 保険                     |     |  |
| PROSUS                        | 1,580            | 1,542        | 8,932        | 1,619,752    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| QIAGEN NV                     | 248              | 254          | 970          | 175,938      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| RANDSTAD NV                   | 125              | 128          | 429          | 77,819       | 商業・専門サービス              |     |  |
| ROYAL KPN NV                  | 4,561            | 4,655        | 1,786        | 324,016      | 電気通信サービス               |     |  |
| STMICROELECTRONICS NV         | 782              | 805          | 1,557        | 282,467      | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP BV      | 951              | 1,297        | 2,972        | 539,037      | メディア・娯楽                |     |  |
| WOLTERS KLUWER NV             | 275              | 281          | 2,568        | 465,704      | 商業・専門サービス              |     |  |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 19,213<br>30 | 19,821<br>30 | 115,641<br>－ | 20,970,459<br><1.5%>   |     |  |
| (ユーロ／ベルギー)                    |                  |              |              |              |                        |     |  |
| AGEAS                         | 173              | 175          | 1,014        | 183,934      | 保険                     |     |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV    | 1,037            | 1,165        | 6,163        | 1,117,619    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| ARGENX SE                     | 69               | 72           | 5,753        | 1,043,292    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| D'IETEREN GROUP               | 24               | 25           | 369          | 66,935       | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| ELIA GROUP SA/NV              | －                | 51           | 526          | 95,483       | 公益事業                   |     |  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA   | 96               | 95           | 694          | 125,995      | 金融サービス                 |     |  |
| KBC GROEP NV                  | 265              | 270          | 2,812        | 510,050      | 銀行                     |     |  |
| LOTUS BAKERIES                | 0.47             | 0.47         | 351          | 63,751       | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| SOFINA                        | 17               | 18           | 428          | 77,748       | 金融サービス                 |     |  |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       | 当期末    |           |                        | 業種等 |  |
|----------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|-----|--|
|                      | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                        |     |  |
|                      |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |     |  |
| (ユーロ／ベルギー)           | 百株      | 百株    | 千ユーロ   | 千円        |                        |     |  |
| SYENSQO SA           | 84      | 85    | 584    | 106,075   | 素材                     |     |  |
| UCB SA               | 145     | 148   | 3,410  | 618,542   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| 小計                   | 株数・金額   | 1,916 | 2,108  | 22,110    | 4,009,430              |     |  |
|                      | 銘柄数<比率> | 10    | 11     | －         | <0.3%>                 |     |  |
| (ユーロ／ルクセンブルグ)        |         |       |        |           |                        |     |  |
| ARCELORMITTAL        | 540     | 552   | 1,924  | 349,053   | 素材                     |     |  |
| TENARIS SA           | 475     | 441   | 771    | 139,914   | エネルギー                  |     |  |
| 小計                   | 株数・金額   | 1,016 | 993    | 2,696     | 488,968                |     |  |
|                      | 銘柄数<比率> | 2     | 2      | －         | <0.0%>                 |     |  |
| (ユーロ／フランス)           |         |       |        |           |                        |     |  |
| ACCOR                | 224     | 230   | 1,045  | 189,673   | 消費者サービス                |     |  |
| ADP                  | 39      | 40    | 490    | 89,006    | 運輸                     |     |  |
| AIR LIQUIDE          | 667     | 681   | 11,283 | 2,046,112 | 素材                     |     |  |
| ALSTOM RGPT          | 399     | 408   | 922    | 167,337   | 資本財                    |     |  |
| AMUNDI SA            | 71      | 72    | 473    | 85,873    | 金融サービス                 |     |  |
| ARKEMA               | 65      | 67    | 340    | 61,713    | 素材                     |     |  |
| AXA SA               | 2,046   | 2,089 | 7,897  | 1,432,067 | 保険                     |     |  |
| BIOMERIEUX           | 47      | 48    | 515    | 93,446    | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| BNP PARIBAS          | 1,175   | 1,199 | 8,047  | 1,459,253 | 銀行                     |     |  |
| BOLLORE SE           | 816     | 822   | 386    | 70,053    | メディア・娯楽                |     |  |
| BOUYGUES             | 219     | 226   | 935    | 169,618   | 資本財                    |     |  |
| BUREAU VERITAS SA    | 366     | 374   | 1,023  | 185,532   | 商業・専門サービス              |     |  |
| CAPGEMINI SA         | 178     | 191   | 2,445  | 443,538   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| CARREFOUR SA         | 627     | 695   | 898    | 162,865   | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| CIE DE SAINT-GOBAIN  | 518     | 529   | 4,298  | 779,517   | 資本財                    |     |  |
| CREDIT AGRICOLE SA   | 1,230   | 1,249 | 1,985  | 360,019   | 銀行                     |     |  |
| DANONE               | 745     | 762   | 5,924  | 1,074,311 | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| DASSAULT AVIATION SA | 22      | 23    | 631    | 114,541   | 資本財                    |     |  |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 772     | 792   | 1,852  | 336,019   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| EDENRED              | 280     | 283   | 518    | 93,979    | 金融サービス                 |     |  |
| EIFFAGE              | 79      | 80    | 914    | 165,913   | 資本財                    |     |  |
| ENGIE                | 2,110   | 2,153 | 4,646  | 842,674   | 公益事業                   |     |  |
| ESSILORLUXOTTICA     | 343     | 354   | 10,954 | 1,986,438 | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| EURAZEO              | 47      | －     | －      | －         | 金融サービス                 |     |  |

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                                  | 期首(前期末)          |              | 当期末          |               |                        | 業種等 |  |
|-------------------------------------|------------------|--------------|--------------|---------------|------------------------|-----|--|
|                                     | 株数               | 株数           | 評価額          |               |                        |     |  |
|                                     |                  |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額        |                        |     |  |
| (ユーロ／フランス)                          |                  |              |              |               |                        |     |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC                 | 百株<br>155        | 百株<br>139    | 千ユーロ<br>800  | 千円<br>145,121 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| FDJ UNITED                          | 117              | 131          | 306          | 55,661        | 消費者サービス                |     |  |
| GETLINK SE - REGR                   | 349              | 356          | 548          | 99,464        | 運輸                     |     |  |
| HERMES INTERNATIONAL                | 36               | 37           | 7,876        | 1,428,348     | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| IPSEN                               | 43               | 44           | 562          | 101,931       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| KERING                              | 86               | 87           | 2,605        | 472,475       | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| LEGRAND SA                          | 302              | 309          | 3,969        | 719,850       | 資本財                    |     |  |
| L'OREAL SA                          | 277              | 283          | 9,937        | 1,802,051     | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 317              | 294          | 17,972       | 3,259,083     | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| MICHELIN (C.G.D.E.)                 | 774              | 789          | 2,190        | 397,225       | 自動車・自動車部品              |     |  |
| ORANGE S.A.                         | 2,196            | 2,228        | 3,071        | 556,919       | 電気通信サービス               |     |  |
| PERNOD-RICARD                       | 233              | 238          | 1,863        | 337,947       | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| PUBLICIS GROUPE                     | 264              | 269          | 2,272        | 412,185       | メディア・娯楽                |     |  |
| RENAULT SA                          | 221              | 227          | 782          | 141,935       | 自動車・自動車部品              |     |  |
| REXEL SA                            | 258              | 264          | 816          | 148,089       | 資本財                    |     |  |
| SAFRAN SA                           | 415              | 424          | 12,681       | 2,299,693     | 資本財                    |     |  |
| SANOFI                              | 1,313            | 1,302        | 11,195       | 2,030,205     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH            | 33               | 34           | 636          | 115,471       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               | 631              | 646          | 14,682       | 2,662,578     | 資本財                    |     |  |
| SOCIETE GENERALE                    | 831              | 848          | 4,822        | 874,519       | 銀行                     |     |  |
| SODEXO                              | 102              | 104          | 487          | 88,424        | 消費者サービス                |     |  |
| TELEPERFORMANCE                     | 62               | 63           | 369          | 67,083        | 商業・専門サービス              |     |  |
| THALES SA                           | 107              | 109          | 2,545        | 461,534       | 資本財                    |     |  |
| TOTALENERGIES SE                    | 2,492            | 2,419        | 13,404       | 2,430,797     | エネルギー                  |     |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                | 812              | 741          | 2,115        | 383,567       | 公益事業                   |     |  |
| VINCI SA                            | 571              | 583          | 6,871        | 1,246,031     | 資本財                    |     |  |
| 小計                                  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 26,110<br>50 | 26,360<br>49 | 193,822<br>－  | 35,147,705<br><2.4%>   |     |  |
| (ユーロ／ドイツ)                           |                  |              |              |               |                        |     |  |
| ADIDAS AG                           | 197              | 201          | 3,082        | 558,918       | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| ALLIANZ SE                          | 446              | 455          | 16,357       | 2,966,202     | 保険                     |     |  |
| BASF SE                             | 1,031            | 1,052        | 4,535        | 822,545       | 素材                     |     |  |
| BAYER AG                            | 1,134            | 1,157        | 3,128        | 567,373       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG         | 334              | 330          | 2,818        | 511,076       | 自動車・自動車部品              |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                                | 期首(前期末) |       | 当期末    |           |                        | 業種等 |  |
|-----------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|-----|--|
|                                   | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                        |     |  |
|                                   |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |     |  |
| (ユーロ／ドイツ)                         | 百株      | 百株    | 千ユーロ   | 千円        |                        |     |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF      | 64      | 65    | 516    | 93,641    | 自動車・自動車部品              |     |  |
| BEIERSDORF AG                     | 114     | 114   | 1,016  | 184,274   | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| BRENTAG SE                        | 141     | 144   | 697    | 126,440   | 資本財                    |     |  |
| COMMERZBANK AG                    | 1,094   | 907   | 2,876  | 521,578   | 銀行                     |     |  |
| CONTINENTAL AG                    | 126     | 129   | 809    | 146,759   | 自動車・自動車部品              |     |  |
| COVESTRO AG-TEND                  | 200     | 200   | 1,234  | 223,851   | 素材                     |     |  |
| CTS EVENTIM AG & CO KGAA          | 72      | 73    | 586    | 106,367   | メディア・娯楽                |     |  |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG          | 548     | 560   | 2,001  | 362,925   | 資本財                    |     |  |
| DELIVERY HERO SE                  | 217     | 226   | 378    | 68,713    | 消費者サービス                |     |  |
| DEUTSCHE BANK AG                  | 2,137   | 2,181 | 6,516  | 1,181,758 | 金融サービス                 |     |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 217     | 221   | 4,658  | 844,738   | 金融サービス                 |     |  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG             | 692     | 708   | 560    | 101,554   | 運輸                     |     |  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG               | 4,044   | 4,121 | 11,192 | 2,029,677 | 電気通信サービス               |     |  |
| DHL GROUP                         | 1,109   | 1,131 | 4,838  | 877,450   | 運輸                     |     |  |
| DR ING HC F PORSCHE AG            | 131     | 134   | 598    | 108,462   | 自動車・自動車部品              |     |  |
| E.ON SE                           | 2,593   | 2,644 | 4,045  | 733,590   | 公益事業                   |     |  |
| EVONIK INDUSTRIES AG              | 297     | 303   | 404    | 73,375    | 素材                     |     |  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA            | 487     | 497   | 2,323  | 421,297   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| GEA GROUP AG                      | 178     | 172   | 981    | 178,011   | 資本財                    |     |  |
| HANNOVER RUECK SE                 | 69      | 71    | 1,792  | 325,105   | 保険                     |     |  |
| HEIDELBERG MATERIALS AG           | 157     | 157   | 3,363  | 609,957   | 素材                     |     |  |
| HENKEL AG & CO KGAA               | 119     | 123   | 801    | 145,370   | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| HENKEL KGAA-VORZUG                | 195     | 188   | 1,318  | 239,046   | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| HENSOLDT AG                       | —       | 74    | 577    | 104,789   | 資本財                    |     |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 1,508   | 1,539 | 5,045  | 914,965   | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| KNORR-BREMSE AG                   | 83      | 85    | 720    | 130,624   | 資本財                    |     |  |
| LEG IMMOBILIEN SE                 | 86      | 89    | 570    | 103,454   | 不動産管理・開発               |     |  |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG            | 834     | 851   | 4,852  | 879,896   | 自動車・自動車部品              |     |  |
| MERCK KGAA                        | 149     | 152   | 1,685  | 305,614   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG       | 62      | 63    | 2,222  | 403,043   | 資本財                    |     |  |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG  | 154     | 153   | 8,182  | 1,483,814 | 保険                     |     |  |
| NEMETSCHEK SE                     | 66      | 68    | 601    | 109,073   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF | 176     | 181   | 644    | 116,932   | 自動車・自動車部品              |     |  |
| PUMA AG                           | 121     | —     | —      | —         | 耐久消費財・アパレル             |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                                 | 期首(前期末)          |              | 当期末          |              |                       | 業種等 |  |
|------------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|-----------------------|-----|--|
|                                    | 株数               | 株数           | 評価額          |              |                       |     |  |
|                                    |                  |              | 外貨建金額        | 邦貨換算金額       |                       |     |  |
| (ユーロ／ドイツ)                          | 百株               | 百株           | 千ユーロ         | 千円           |                       |     |  |
| RATIONAL AG                        | 5                | 6            | 371          | 67,413       | 資本財                   |     |  |
| RHEINMETALL AG                     | 50               | 54           | 8,635        | 1,566,044    | 資本財                   |     |  |
| RWE AG                             | 729              | 744          | 3,270        | 593,009      | 公益事業                  |     |  |
| SAP SE                             | 1,206            | 1,231        | 25,297       | 4,587,367    | ソフトウェア・サービス           |     |  |
| SARTORIUS AG-VORZUG                | 30               | 30           | 691          | 125,444      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライサイエンス |     |  |
| SCOUT24 SE                         | 86               | 88           | 765          | 138,878      | メディア・娯楽               |     |  |
| SIEMENS AG                         | 878              | 895          | 19,584       | 3,551,470    | 資本財                   |     |  |
| SIEMENS ENERGY AG                  | 738              | 800          | 8,725        | 1,582,199    | 資本財                   |     |  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG            | 325              | 398          | 1,650        | 299,233      | ヘルスケア機器・サービス          |     |  |
| SYMRISE AG                         | 153              | 156          | 1,092        | 198,090      | 素材                    |     |  |
| TALANX AG                          | 74               | 75           | 819          | 148,687      | 保険                    |     |  |
| VOLKSWAGEN AG                      | 238              | 243          | 2,305        | 418,066      | 自動車・自動車部品             |     |  |
| VONOVIA SE                         | 856              | 887          | 2,311        | 419,090      | 不動産管理・開発              |     |  |
| ZALANDO SE                         | 259              | 264          | 599          | 108,658      | 一般消費財・サービス流通・小売り      |     |  |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 27,034<br>52 | 27,416<br>52 | 184,658<br>－ | 33,485,929<br><2.3%>  |     |  |
| (ユーロ／ポルトガル)                        |                  |              |              |              |                       |     |  |
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R        | －                | 9,777        | 770          | 139,714      | 銀行                    |     |  |
| EDP RENOVAVEIS SA                  | 362              | 373          | 420          | 76,314       | 公益事業                  |     |  |
| EDP SA                             | 3,632            | 3,704        | 1,385        | 251,185      | 公益事業                  |     |  |
| GALP ENERGIA SGPS SA               | 481              | 490          | 872          | 158,218      | エネルギー                 |     |  |
| JERONIMO MARTINS                   | 327              | 333          | 719          | 130,439      | 生活必需品流通・小売り           |     |  |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 4,802<br>4   | 14,679<br>5  | 4,168<br>－   | 755,871<br><0.1%>     |     |  |
| (ユーロ／スペイン)                         |                  |              |              |              |                       |     |  |
| ACCIONA SA                         | 28               | 29           | 514          | 93,317       | 公益事業                  |     |  |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV        | 205              | 211          | 1,622        | 294,296      | 資本財                   |     |  |
| AENA SME SA                        | 86               | 883          | 1,992        | 361,270      | 運輸                    |     |  |
| AMADEUS IT GROUP SA                | 519              | 530          | 3,291        | 596,816      | 消費者サービス               |     |  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | 6,656            | 6,793        | 12,065       | 2,187,907    | 銀行                    |     |  |
| BANCO DE SABADELL SA               | 6,280            | 5,919        | 1,841        | 333,964      | 銀行                    |     |  |
| BANCO SANTANDER SA                 | 17,500           | 17,542       | 15,647       | 2,837,511    | 銀行                    |     |  |
| BANKINTER SA                       | －                | 793          | 1,044        | 189,363      | 銀行                    |     |  |
| CAIXABANK                          | 4,560            | 4,593        | 4,143        | 751,466      | 銀行                    |     |  |

**ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド**

| 銘柄                                 | 期首(前期末)          |           | 当期末           |               |                        | 業種等 |  |
|------------------------------------|------------------|-----------|---------------|---------------|------------------------|-----|--|
|                                    | 株数               | 株数        | 評価額           |               |                        |     |  |
|                                    |                  |           | 外貨建金額         | 邦貨換算金額        |                        |     |  |
| (ユーロ／スペイン)                         |                  |           |               |               |                        |     |  |
| CELLNEX TELECOM SAU                | 百株<br>617        | 百株<br>587 | 千ユーロ<br>1,472 | 千円<br>267,005 | 電気通信サービス               |     |  |
| ENDESA SA                          | 365              | 374       | 1,147         | 208,153       | 公益事業                   |     |  |
| FERROVIAL SE                       | 547              | 604       | 3,272         | 593,391       | 資本財                    |     |  |
| GRIFOLS SA                         | 344              | 351       | 359           | 65,242        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| IBERDROLA SA                       | 6,727            | 7,480     | 13,389        | 2,428,026     | 公益事業                   |     |  |
| INDITEX SA                         | 1,260            | 1,286     | 6,087         | 1,103,853     | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI       | —                | 1,462     | 626           | 113,539       | 運輸                     |     |  |
| REDEIA CORPORACION SA              | 471              | 479       | 726           | 131,733       | 公益事業                   |     |  |
| REPSOL SA                          | 1,334            | 1,363     | 2,217         | 402,151       | エネルギー                  |     |  |
| TELEFONICA SA                      | 4,682            | 4,414     | 1,598         | 289,822       | 電気通信サービス               |     |  |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 52,188    | 55,700        | 73,060        | 13,248,833             |     |  |
| (ユーロ／イタリア)                         |                  |           |               |               |                        |     |  |
| AMPLIFON SPA                       | 143              | —         | —             | —             | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| ASSICURAZIONI GENERALI             | 1,086            | 1,004     | 3,295         | 597,540       | 保険                     |     |  |
| BANCA MEDIOLANUM SPA               | —                | 263       | 489           | 88,710        | 金融サービス                 |     |  |
| BANCO BPM SPA                      | 1,487            | 1,340     | 1,680         | 304,771       | 銀行                     |     |  |
| BPER BANCA SPA                     | 1,149            | 1,723     | 1,759         | 318,992       | 銀行                     |     |  |
| DIASORIN ITALIA SPA                | 25               | —         | —             | —             | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| ENEL SPA                           | 9,394            | 9,585     | 8,370         | 1,517,843     | 公益事業                   |     |  |
| ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA | 2,464            | 2,409     | 3,908         | 708,730       | エネルギー                  |     |  |
| FINECOBANK SPA                     | 705              | 720       | 1,484         | 269,288       | 銀行                     |     |  |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL       | 402              | 350       | 272           | 49,384        | 電気通信サービス               |     |  |
| INTESA SANPAOLO                    | 17,487           | 16,789    | 9,390         | 1,702,842     | 銀行                     |     |  |
| LEONARDO SPA                       | 467              | 476       | 2,275         | 412,618       | 資本財                    |     |  |
| MEDIOBANCA SPA                     | 578              | —         | —             | —             | 銀行                     |     |  |
| MONCLER SPA                        | 269              | 275       | 1,541         | 279,610       | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| NEXI SPA                           | 570              | 656       | 251           | 45,620        | 金融サービス                 |     |  |
| POSTE ITALIANE SPA                 | 527              | 538       | 1,115         | 202,337       | 金融サービス                 |     |  |
| PRYSMIAN SPA                       | 324              | 331       | 2,819         | 511,229       | 資本財                    |     |  |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA        | 132              | 135       | 680           | 123,312       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| SNAM SPA                           | 2,329            | 2,377     | 1,339         | 242,863       | 公益事業                   |     |  |
| STELLANTIS NV                      | 2,342            | 2,378     | 2,010         | 364,655       | 自動車・自動車部品              |     |  |
| TELECOM ITALIA SPA                 | 11,728           | 13,697    | 658           | 119,475       | 電気通信サービス               |     |  |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA | 1,621            | 1,655     | 1,494         | 271,037       | 公益事業                   |     |  |
| UNICREDIT SPA                      | 1,612            | 1,652     | 10,235        | 1,856,169     | 銀行                     |     |  |
| UNIPOL ASSICURAZIONI SPA           | 412              | 421       | 796           | 144,507       | 保険                     |     |  |
| 小計                                 | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 57,267    | 58,784        | 55,870        | 10,131,543             |     |  |

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

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

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

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

(注4) 業種は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    |           |            |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------|
|                              | 口数      | 口数    | 評価額    |           | 邦貨換算金額     |
|                              |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                       | 千口      | 千口    | 千米ドル   | 千円        |            |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 17      | 17    | 1,232  | 193,909   |            |
| CROWN CASTLE INC             | 50      | 51    | 4,675  | 735,482   |            |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 18      | 18    | 912    | 143,475   |            |
| PROLOGIS INC                 | 107     | 109   | 13,390 | 2,106,181 |            |
| ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT   | 64      | 71    | 1,549  | 243,771   |            |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 16      | 16    | 2,969  | 467,109   |            |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 12      | 12    | 1,286  | 202,417   |            |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 39      | 42    | 2,508  | 394,541   |            |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 7       | 7     | 1,931  | 303,825   |            |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 80      | 82    | 1,448  | 227,847   |            |
| WELLTOWER INC                | 71      | 77    | 15,176 | 2,387,167 |            |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC  | 80      | —     | —      | —         |            |
| KIMCO REALTY CORP            | 77      | 79    | 1,598  | 251,424   |            |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 13      | 13    | 1,792  | 281,911   |            |
| PUBLIC STORAGE               | 18      | 18    | 4,954  | 779,345   |            |
| REGENCY CENTERS CORP         | 19      | 20    | 1,404  | 220,940   |            |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 37      | 38    | 6,932  | 1,090,353 |            |
| SUN COMMUNITIES INC          | 14      | 15    | 1,890  | 297,369   |            |
| UDR INC                      | 36      | 37    | 1,283  | 201,870   |            |
| VENTAS INC                   | 48      | 53    | 4,254  | 669,174   |            |
| WP CAREY INC                 | 25      | 25    | 1,710  | 268,972   |            |
| REALTY INCOME CORP           | 101     | 106   | 6,045  | 950,889   |            |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 20      | 21    | 1,315  | 206,914   |            |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 24      | 25    | 3,240  | 509,664   |            |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 38      | 39    | 6,324  | 994,810   |            |
| IRON MOUNTAIN INC            | 33      | 34    | 3,014  | 474,187   |            |
| AMERICAN TOWER REIT INC      | 53      | 55    | 9,961  | 1,566,890 |            |
| EQUINIX INC                  | 11      | 11    | 8,823  | 1,387,874 |            |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 38      | 39    | 1,239  | 194,957   |            |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 31      | 32    | 1,397  | 219,864   |            |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 12      | 12    | 2,483  | 390,657   |            |
| INVITATION HOMES INC         | 67      | 68    | 1,884  | 296,442   |            |
| VICI PROPERTIES INC          | 121     | 124   | 3,634  | 571,740   |            |
| 小計                           | 口数・金額   | 1,415 | 1,381  | 122,270   | 19,231,987 |
|                              | 銘柄数<比率> | 33    | 32     | —         | <1.3%>     |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                               | 期首(前期末)          |             | 当期末         |             |                      |
|----------------------------------|------------------|-------------|-------------|-------------|----------------------|
|                                  | 口数               | 口数          | 評価額         |             | 邦貨換算金額               |
|                                  |                  |             | 外貨建金額       | 千円          |                      |
| (オーストラリア)                        | 千口               | 千口          | 千オーストラリア・ドル |             | 千円                   |
| GPT GROUP                        | 221              | —           | —           | —           | —                    |
| GOODMAN GROUP                    | 234              | 239         | 6,971       | 710,830     |                      |
| STOCKLAND                        | 275              | 282         | 1,744       | 177,887     |                      |
| VICINITY CENTRES                 | 446              | 456         | 1,154       | 117,758     |                      |
| SCENTRE GROUP                    | 599              | 613         | 2,503       | 255,246     |                      |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,776<br>5  | 1,591<br>4  | 12,374<br>— | 1,261,722<br><0.1%>  |
| (香港)                             |                  |             | 千香港ドル       |             |                      |
| LINK REIT                        | 300              | 306         | 12,718      | 256,791     |                      |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 300<br>1    | 306<br>1    | 12,718<br>— | 256,791<br><0.0%>    |
| (シンガポール)                         |                  |             | 千シンガポール・ドル  |             |                      |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT         | 432              | 461         | 1,291       | 155,461     |                      |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | 668              | 689         | 1,613       | 194,234     |                      |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,101<br>2  | 1,150<br>2  | 2,905<br>—  | 349,696<br><0.0%>    |
| (イギリス)                           |                  |             | 千イギリス・ポンド   |             |                      |
| LAND SECURITIES GROUP PLC        | 81               | 83          | 499         | 102,540     |                      |
| SEGRO PLC                        | 148              | 151         | 1,056       | 216,940     |                      |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 230<br>2    | 235<br>2    | 1,556<br>—  | 319,481<br><0.0%>    |
| (ユーロ／フランス)                       |                  |             | 千ユーロ        |             |                      |
| KLEPIERRE                        | 24               | 25          | 838         | 151,999     |                      |
| GECINA SA                        | 5                | 5           | 428         | 77,760      |                      |
| COVIVIO                          | 6                | 6           | 361         | 65,467      |                      |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD        | 13               | 14          | 1,290       | 234,065     |                      |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 50<br>4     | 51<br>4     | 2,918<br>—  | 529,293<br><0.0%>    |
| 合計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 4,874<br>47 | 4,718<br>45 | —<br>—      | 21,948,971<br><1.5%> |

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

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

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

## (3) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別                            | 当期末    |          |
|--------------------------------|--------|----------|
|                                | 買建額    | 売建額      |
| 外<br>国<br>S&P 500 EMINI FUTURE | 35,100 | 百万円<br>— |
| FTSE 100                       | 5,132  | —        |
| DJ EURO STOXX 50               | 3,405  | —        |

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2025年11月20日現在

| 項目           | 当期末           |              |
|--------------|---------------|--------------|
|              | 評価額           | 比率           |
| 株式           | 1,376,360,881 | 千円 %<br>95.3 |
| 投資信託証券       | 21,948,971    | 1.5          |
| コール・ローン等、その他 | 46,023,777    | 3.2          |
| 投資信託財産総額     | 1,444,333,630 | 100.0        |

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル157.29円、1カナダ・ドル111.96円、1オーストラリア・ドル101.96円、1香港ドル20.19円、1シンガポール・ドル120.36円、1ニュージーランド・ドル88.22円、1イギリス・ポンド205.31円、1イスラエル・シェケル48.131円、1スイス・フラン195.20円、1デンマーク・クローネ24.28円、1ノルウェー・クローネ15.46円、1スウェーデン・クローナ16.47円、1ユーロ181.34円です。

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。



## 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。