

## 第8期末(2022年11月21日)

基準価額	10,954円
純資産総額	50億円
騰落率	0.4%
分配金	0円

# DCニッセイ 外国債券インデックス

追加型投信/海外/債券/インデックス型

## 運用報告書(全体版)

作成対象期間:2021年11月23日~2022年11月21日

第8期(決算日 2022年11月21日)

### 受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「DCニッセイ外国債券インデックス」は、このたび第8期の決算を行いました。

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

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

### 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。



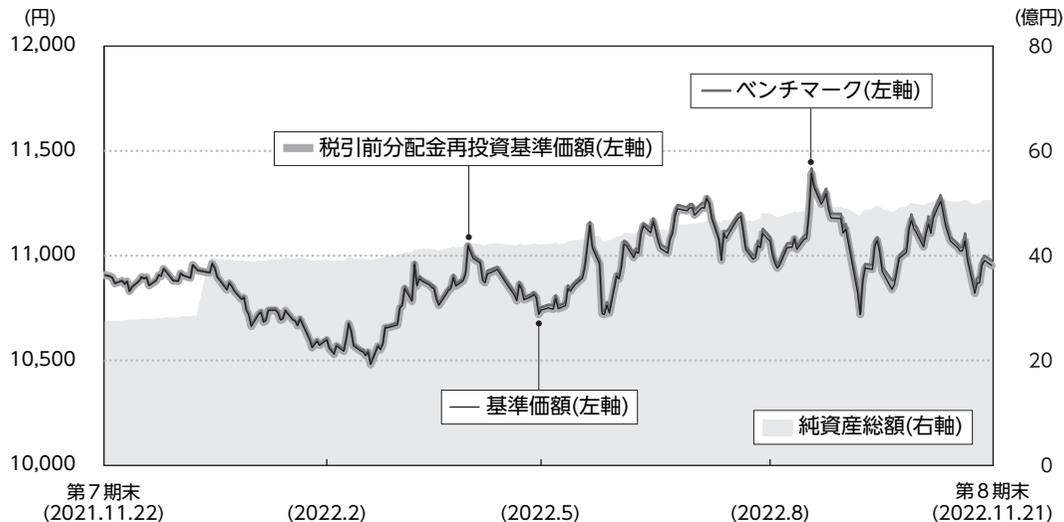
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

## 運用経過

2021年11月23日～2022年11月21日

## 基準価額等の推移



第8期首	10,907円	既払分配金	0円
第8期末	10,954円	騰落率(分配金再投資ベース)	0.4%

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

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

(注3) ベンチマークはF T S E世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

## ■基準価額の主な変動要因

## &lt;上昇要因&gt;

- ・2022年3月から10月にかけて、米金融政策が引き締め姿勢であった一方、国内においては金融緩和を維持したことから日米金利差が拡大し大幅な米ドル高円安基調となったこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2022年1月から3月上旬にかけて物価高を背景に利上げ観測が強まったこと、その後、5月中旬にかけては米連邦準備制度理事会(F R B)高官から早期の大幅利上げを示唆する発言が相次いだことを受けて金利が上昇(債券価格は下落)したこと

## 1万口当たりの費用明細

項目	第8期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	17円	0.153%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は10,913円です。</p>
(投信会社)	( 7)	(0.066)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	( 7)	(0.066)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	( 2)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
その他費用	5	0.050	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	( 5)	(0.042)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	( 1)	(0.009)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	( 0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <li>信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	22	0.204	

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

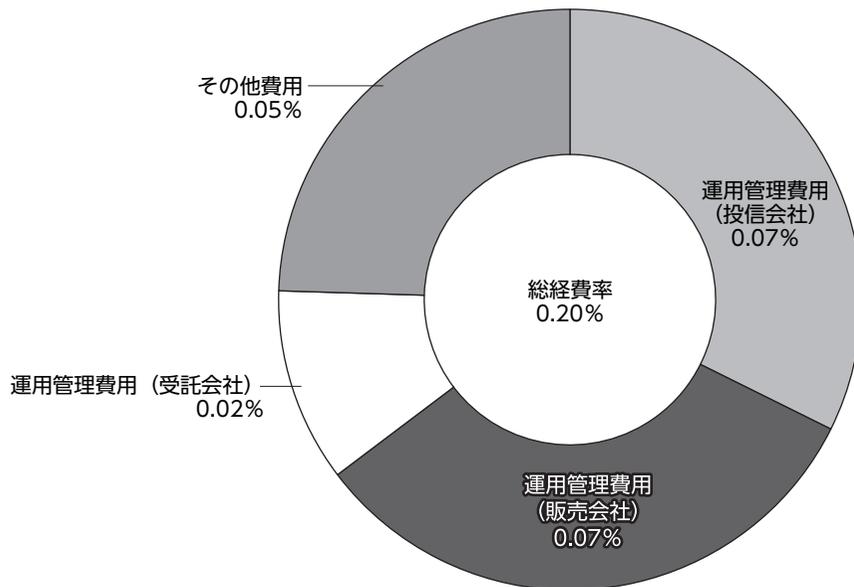
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## (参考情報)

## ■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.20%**です。



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

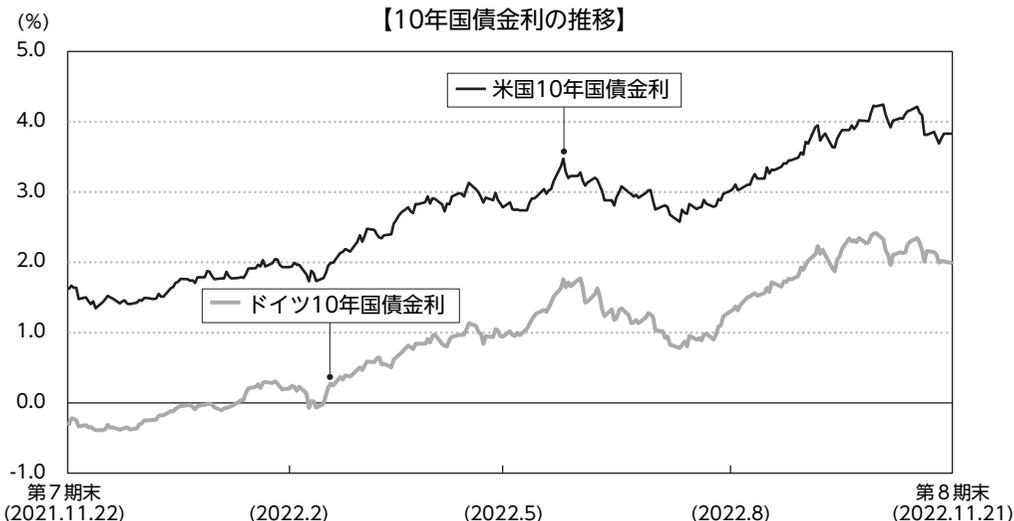
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

## 投資環境

## ■ 海外債券市況



(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、3月から5月上旬にかけて物価高を背景にFRB高官から早期利上げを示唆する発言が相次いだことなどから大幅に上昇しました。その後は利上げによる景気減速懸念を受けて一時低下する場面がありましたが、8月から10月にかけては堅調な米経済指標や物価上昇を受けて再び上昇し、結局、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、3月から5月にかけて域内の物価上昇が加速する中、欧州中央銀行(ECB)高官が早期利上げを示唆したことなどから大幅に上昇しました。6月中旬から7月にかけては、ロシアからの天然ガス供給の不透明感による景気減速懸念等を受けて一時低下しましたが、その後は物価上昇を背景に欧州の各中央銀行が利上げを行ったこと、イギリスの大幅減税や国債増発による財政懸念によりイギリス国債利回りが急騰したことなどから再び上昇基調を強め、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

## ■為替市況



(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、米国が物価上昇を背景に金融引き締め姿勢であった一方で、国内においては金融緩和を維持したことから日米金利差が拡大し、3月から10月にかけて大幅な米ドル高円安基調となりました。11月は米利上げペースの鈍化観測を受けてやや米ドル安円高となりましたが、結局、期初を上回る水準（米ドル高円安）で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、2022年2月中旬から3月上旬にかけてウクライナ情勢の緊迫からリスク回避的な動きとなりユーロ安となりましたが、その後はECBの金融引き締め姿勢を背景にユーロ高に転じました。7月にはロシアからの天然ガス供給の不透明感による景気減速懸念等を受けて一時ユーロ安となる場面がありましたが、その後はECBによる積極的な利上げ観測が高まり、再びユーロ高となりました。11月は小幅にユーロ安に転じましたが、結局、期初を上回る水準（ユーロ高円安）で当期末を迎えました。

## ポートフォリオ

### ■当ファンド

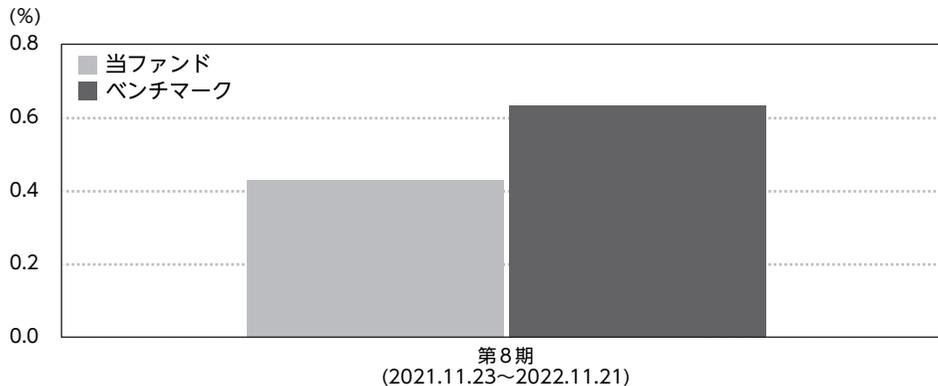
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

### ■マザーファンド

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

\*ベンチマークはF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

## ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+0.4%となり、ベンチマーク騰落率（+0.6%）にほぼ連動しました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## 分配金

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

### 【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	当期 2021年11月23日～2022年11月21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	1,231円

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

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

## 今後の運用方針

### ■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要国の国債に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### ■マザーファンド

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

# ファンドデータ

## 当ファンドの組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第8期末 2022年11月21日
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	100.0%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

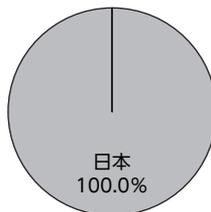
項目	第8期末 2022年11月21日
純資産総額	5,032,686,928円
受益権総口数	4,594,247,678口
1万口当たり基準価額	10,954円

(注) 当期間中における追加設定元本額は2,862,278,787円、同解約元本額は775,329,103円です。

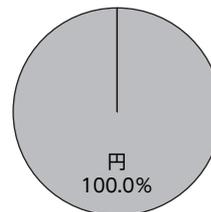
### ■資産別配分



### ■国別配分



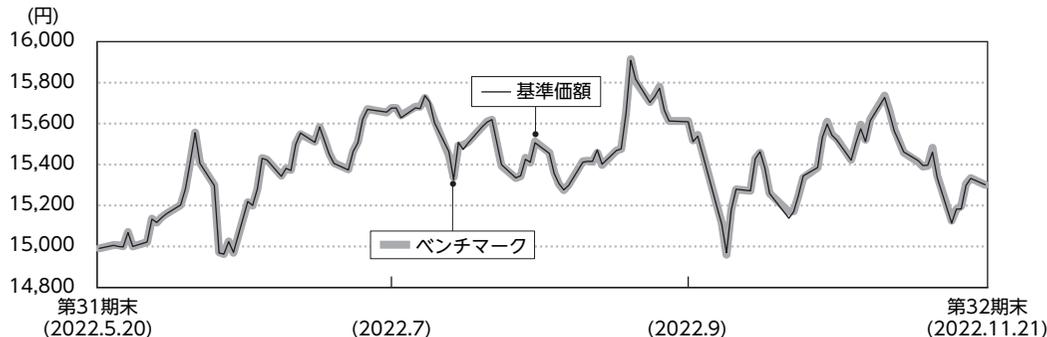
### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年11月21日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

### ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 上位銘柄

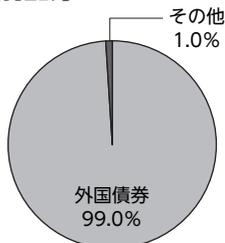
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.5% 2024/5/15	米ドル	2.0%
US TREASURY 2.25% 2024/11/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.0% 2025/2/15	米ドル	1.3
US TREASURY 2.375% 2024/8/15	米ドル	1.2
US TREASURY 2.75% 2024/2/15	米ドル	1.1
US TREASURY 2.125% 2025/5/15	米ドル	1.1
US TREASURY 0.25% 2024/3/15	米ドル	1.0
US TREASURY 2.625% 2029/2/15	米ドル	1.0
US TREASURY 2.0% 2025/8/15	米ドル	1.0
US TREASURY 0.375% 2024/9/15	米ドル	1.0
組入銘柄数		767

### ■ 1万口当たりの費用明細

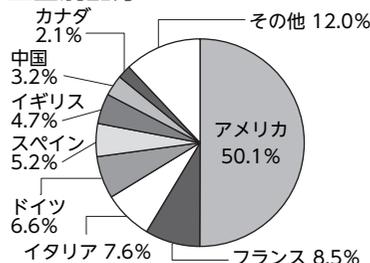
2022.5.21～2022.11.21

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

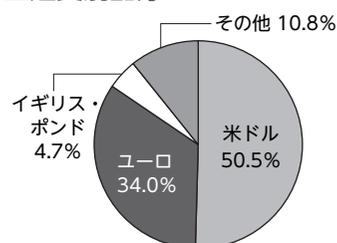
### ■ 資産別配分



### ■ 国別配分



### ■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2022年11月21日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	ベンチ マーク	期中 騰落率	債券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金				
	円	円	%	円		%	%	百万円
4期(2018年11月20日)	9,543	0	△2.4	9,543	9,631	△2.1	99.1	742
5期(2019年11月20日)	9,930	0	4.1	9,930	10,048	4.3	99.1	1,202
6期(2020年11月20日)	10,382	0	4.6	10,382	10,538	4.9	99.1	1,894
7期(2021年11月22日)	10,907	0	5.1	10,907	11,093	5.3	99.2	2,734
8期(2022年11月21日)	10,954	0	0.4	10,954	11,163	0.6	99.0	5,032

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	債券 組入比率
(期首)2021年11月22日	10,907	-	11,093	-	99.2
11月末	10,864	△0.4	11,051	△0.4	99.5
12月末	10,929	0.2	11,120	0.2	101.5
2022年1月末	10,740	△1.5	10,930	△1.5	99.4
2月末	10,544	△3.3	10,733	△3.2	99.0
3月末	10,889	△0.2	11,088	△0.0	99.0
4月末	10,912	0.0	11,114	0.2	99.0
5月末	10,842	△0.6	11,043	△0.4	99.1
6月末	11,102	1.8	11,310	2.0	99.1
7月末	11,177	2.5	11,393	2.7	99.3
8月末	11,040	1.2	11,246	1.4	99.1
9月末	10,941	0.3	11,147	0.5	99.0
10月末	11,260	3.2	11,482	3.5	99.0
(期末)2022年11月21日	10,954	0.4	11,163	0.6	99.0

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2021年11月23日～2022年11月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	2,051,145	3,130,722	559,949	852,978

(注) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2021年11月23日～2022年11月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2022年11月21日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,797,970	3,289,166	5,032,754

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ外国債券インデックスマザーファンド全体の口数は36,786,269千口です。

投資信託財産の構成

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	5,032,754	99.7
コール・ローン等、その他	16,552	0.3
投資信託財産総額	5,049,306	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21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1カナダ・ドル104.82円、1オーストラリア・ドル93.41円、1シンガポール・ドル102.07円、1ニュージーランド・ドル86.21円、1イギリス・ポンド166.59円、1イスラエル・シェケル40,408円、1デンマーク・クローネ19.47円、1ノルウェー・クローネ13.74円、1スウェーデン・クローナ13.18円、1メキシコ・ペソ7.213円、1人民元19.647円、1マレーシア・リングgit30.617円、1ポーランド・ズロチ30.809円、1ユーロ144.81円です。

(注2) ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(56,232,458千円)の投資信託財産総額(56,409,429千円)に対する比率は99.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## DCニッセイ外国債券インデックス

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>5,049,306,729円</b>
コール・ローン等	3,722,141
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	5,032,754,149
未収入金	12,830,439
<b>(B)負債</b>	<b>16,619,801</b>
未払解約金	12,763,855
未払信託報酬	3,656,528
その他未払費用	199,418
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>5,032,686,928</b>
元本	4,594,247,678
次期繰越損益金	438,439,250
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>4,594,247,678口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>10,954円</b>

(注) 期首元本額	2,507,297,994円
期中追加設定元本額	2,862,278,787円
期中一部解約元本額	775,329,103円

### 損益の状況

当期(2021年11月23日~2022年11月21日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 588円</b>
受取利息	33
支払利息	△ 621
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>19,589,965</b>
売買益	31,521,809
売買損	△ 11,931,844
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 6,817,887</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>12,771,490</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>127,838,335</b>
(分配準備積立金)	( 127,838,620)
(繰越欠損金)	(△ 285)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>297,829,425</b>
(配当等相当額)	( 425,152,313)
(売買損益相当額)	(△ 127,322,888)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>438,439,250</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>438,439,250</b>
追加信託差損益金	297,829,425
(配当等相当額)	( 425,152,313)
(売買損益相当額)	(△ 127,322,888)
分配準備積立金	140,610,413
繰越欠損金	△ 588

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
- (注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。
- (注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
- (注4) (F)追加信託差損益金\*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

### 分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	12,771,793円
(c) 信託約款に定める収益調整金	425,152,313円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	127,838,620円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	565,762,726円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	1,231.46円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

# お知らせ

## ■運用体制の変更について

運用部門については、CO-CIO（取締役執行役員、統括部長）の2名体制からCIO（取締役執行役員）1名とCO-CIO（統括部長）1名の体制に変更しました。

新たにCIOが就任し、従来のCO-CIOのうちの1名（統括部長）が、引き続きCO-CIOを務めています。（2022年3月25日）

# 当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。	
主要運用対象	DCニッセイ外国債券インデックス	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く主要国の国債
運用方法	DCニッセイ外国債券インデックス	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。	

# ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 32 期

(計算期間：2022年5月21日～2022年11月21日)

#### 運用方針

主に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

#### 主要運用 対象

日本を除く主要国の国債

#### 運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・ 株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2022年5月21日～2022年11月21日

## 投資環境

### 海外債券市況

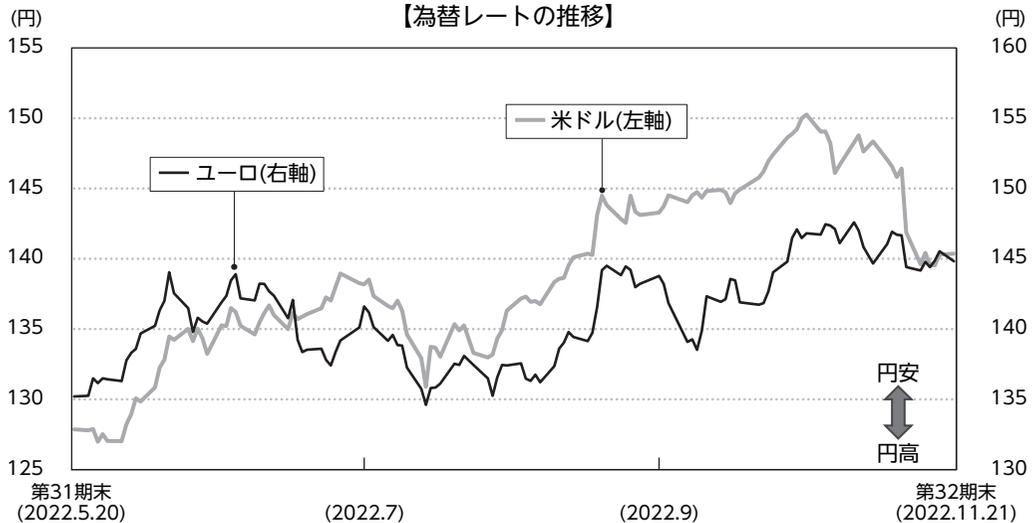


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、利上げ観測を背景に上昇基調で始まりましたが、その後は利上げによる景気減速懸念から一時低下に転じました。8月から10月にかけては堅調な米経済指標や物価上昇を受けて再び上昇基調となり、結局、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、利上げ観測を背景に上昇基調で始まりましたが、その後はロシアからの天然ガス供給の不透明感による景気減速懸念等を受けて一時低下しました。8月から10月にかけては、物価上昇を背景に欧州の各中央銀行が利上げを実施したこと、イギリスの大幅減税や国債増発による財政懸念によりイギリス国債利回りが急騰したことなどから再び上昇基調を強め、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

## ■為替市況

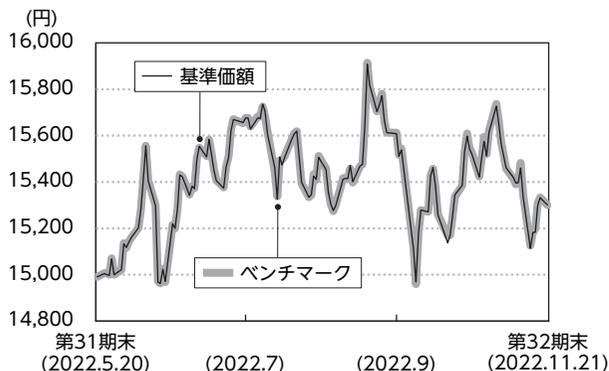


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、米国が物価上昇を背景に金融引き締め姿勢であった一方で、国内においては金融緩和を維持したことから日米金利差が拡大し、期初から10月にかけて大幅なドル高円安基調となりました。11月は米利上げペースの鈍化観測を受けてややドル安円高となりましたが、結局、期初を上回る水準（米ドル高円安）で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、欧州中央銀行（ECB）の金融引き締め姿勢を背景にユーロ高基調で始まりましたが、7月にはロシアからの天然ガス供給の不透明感による景気減速懸念等を受けて一時ユーロ安となりました。その後は再びECBによる利上げ観測が高まったことからユーロ高となり、11月は小幅ユーロ安に転じましたが、結局、期初を上回る水準（ユーロ高円安）で当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 期初から10月にかけて、米金融政策が引き締め姿勢であった一方、国内においては金融緩和を維持したことから日米金利差が拡大し大幅な米ドル高円安基調となったこと

#### <下落要因>

- ・ 8月初旬から10月にかけて、堅調な米経済指標やECBの利上げを背景に欧米金利が上昇(債券価格は下落)したこと

## ポートフォリオ

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

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+2.1%となり、ベンチマーク騰落率(+2.1%)に連動しました。

## 今後の運用方針

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
28期(2020年11月20日)	14,455	2.2	14,625	2.3	99.1	32,658
29期(2021年5月20日)	14,832	2.6	15,011	2.6	99.2	38,541
30期(2021年11月22日)	15,210	2.5	15,395	2.6	99.2	46,402
31期(2022年5月20日)	14,990	△1.4	15,179	△1.4	99.1	50,588
32期(2022年11月21日)	15,301	2.1	15,493	2.1	99.0	56,285

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	債券 組入比率
		%		%	
(期首)2022年5月20日	円 14,990	% -	15,179	% -	% 99.1
5月末	15,133	1.0	15,326	1.0	99.1
6月末	15,497	3.4	15,697	3.4	99.1
7月末	15,604	4.1	15,812	4.2	99.3
8月末	15,415	2.8	15,608	2.8	99.1
9月末	15,279	1.9	15,471	1.9	99.0
10月末	15,727	4.9	15,935	5.0	99.0
(期末)2022年11月21日	15,301	2.1	15,493	2.1	99.0

(注) 騰落率は期首比です。

## 1 万口当たりの費用明細

2022年5月21日～2022年11月21日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	3円	0.021%	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)	(0.021)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	3	0.021	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（15,406円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

## 売買および取引の状況

2022年5月21日～2022年11月21日

## 公社債

		買付額	売付額
アメリカ	国債証券	千米ドル	千米ドル
		48,836	30,295
カナダ	国債証券	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル
		2,694	1,632
オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル
		1,061	150
シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル
		418	188
ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル
		1,364	-
イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド
		3,137	1,551
イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル
		518	591
デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ
		967	527
ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ
		724	1,754
スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ
		879	482
メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ
		8,575	1,148
中国	国債証券	千人民元	千人民元
		56,832	6,646
マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット
		1,160	152
ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ
		1,150	743
ユーロ	国債証券	千ユーロ	千ユーロ
		277	143
		968	790
		1,112	792
		5,007	3,237
		5,446	3,083
		2,915	1,820
		5,452	4,655
		323	190
		785	611

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2022年5月21日～2022年11月21日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
US TREASURY	725,823	US TREASURY	640,978
US TREASURY	365,372	US TREASURY	569,843
US TREASURY	323,189	US TREASURY	448,901
US TREASURY	286,613	US TREASURY	439,329
US TREASURY	283,287	US TREASURY	320,944
US TREASURY	271,744	US TREASURY	290,157
US TREASURY	262,696	US TREASURY	216,640
US TREASURY	258,470	US TREASURY	198,102
US TREASURY	256,646	US TREASURY	135,199
US TREASURY	255,223	FRANCE (GOVT OF)	127,489

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2022年11月21日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	226,470	200,709	28,171,648	50.1	—	21.3	17.6	11.2
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	12,200	11,169	1,170,799	2.1	—	1.1	0.5	0.5
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア	10,200	9,301	868,898	1.5	—	1.1	0.4	0.1
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	2,670	2,561	261,475	0.5	—	0.3	0.1	0.1
	千ニューージーランド・ドル	千ニューージーランド・ドル						
ニューージーランド	1,560	1,362	117,433	0.2	—	0.1	0.1	—
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	17,720	15,891	2,647,321	4.7	—	3.5	0.8	0.4
	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル						
イスラエル	5,250	5,181	209,365	0.4	—	0.2	0.1	0.1

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

区分	当期末								
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 10,960	千デンマーク・クローネ 10,575	千円 205,907	% 0.4	% -	% 0.2	% 0.1	% 0.1	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 8,940	千ノルウェー・クローネ 8,328	114,439	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 11,090	千スウェーデン・クローナ 10,860	143,144	0.3	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 70,830	千メキシコ・ペソ 65,668	473,675	0.8	-	0.4	0.3	0.1	
中国	千人民元 92,670	千人民元 92,774	1,822,777	3.2	-	1.4	1.1	0.7	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 9,650	千マレーシア・リンギット 9,466	289,847	0.5	-	0.3	0.2	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 9,300	千ポーランド・ズロチ 7,654	235,832	0.4	-	0.1	0.2	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
	アイルランド	2,780	2,512	363,880	0.6	-	0.4	0.2	0.0
	オランダ	6,540	6,206	898,824	1.6	-	1.0	0.4	0.2
	ベルギー	7,740	7,321	1,060,167	1.9	-	1.3	0.4	0.1
	フランス	35,160	33,212	4,809,482	8.5	-	5.2	2.8	0.6
	ドイツ	26,790	25,603	3,707,703	6.6	-	3.7	1.9	1.0
	スペイン	20,900	20,018	2,898,936	5.2	-	3.0	1.5	0.6
	イタリア	31,540	29,727	4,304,883	7.6	-	4.3	2.4	1.0
	フィンランド	2,260	1,978	286,467	0.5	-	0.3	0.2	0.1
	オーストリア	5,030	4,591	664,886	1.2	-	0.7	0.4	0.1
合計	-	-	55,727,800	99.0	-	50.1	31.8	17.1	

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

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

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

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/02/15	100	105	14,766
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	120	131	18,389
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	120	127	17,886
	US TREASURY	5.3750	2031/02/15	170	187	26,317
	US TREASURY	2.7500	2023/11/15	1,660	1,628	228,582
	US TREASURY	0.1250	2023/12/15	3,760	3,580	502,579
	US TREASURY	2.2500	2023/12/31	2,500	2,432	341,425
	US TREASURY	2.7500	2024/02/15	4,550	4,440	623,240
	US TREASURY	0.2500	2024/03/15	4,350	4,103	575,959
	US TREASURY	2.1250	2024/03/31	2,030	1,960	275,223
	US TREASURY	2.5000	2024/05/15	8,430	8,163	1,145,880
	US TREASURY	2.0000	2024/06/30	2,090	2,004	281,283
	US TREASURY	2.3750	2024/08/15	5,020	4,830	677,958
	US TREASURY	0.3750	2024/09/15	4,270	3,959	555,765
	US TREASURY	2.1250	2024/09/30	1,990	1,904	267,258
	US TREASURY	2.2500	2024/11/15	6,230	5,963	837,034
	US TREASURY	2.2500	2024/12/31	2,520	2,407	337,885
	US TREASURY	2.0000	2025/02/15	5,300	5,026	705,514
	US TREASURY	2.6250	2025/03/31	2,470	2,375	333,414
	US TREASURY	2.1250	2025/05/15	4,680	4,432	622,115
	US TREASURY	2.7500	2025/06/30	2,880	2,769	388,730
	US TREASURY	2.0000	2025/08/15	4,220	3,968	556,987
	US TREASURY	3.5000	2025/09/15	1,600	1,566	219,837
	US TREASURY	3.0000	2025/09/30	1,750	1,689	237,175
	US TREASURY	2.2500	2025/11/15	3,760	3,546	497,856
	US TREASURY	2.6250	2025/12/31	2,400	2,286	320,967
	US TREASURY	1.6250	2026/02/15	3,570	3,288	461,524
	US TREASURY	2.2500	2026/03/31	2,580	2,424	340,270
	US TREASURY	1.6250	2026/05/15	3,230	2,962	415,765
	US TREASURY	1.8750	2026/06/30	2,030	1,875	263,270
	US TREASURY	1.5000	2026/08/15	3,640	3,305	463,927
	US TREASURY	0.7500	2026/08/31	1,360	1,198	168,288
	US TREASURY	1.6250	2026/09/30	1,930	1,759	246,936
	US TREASURY	2.0000	2026/11/15	3,720	3,429	481,428
	US TREASURY	1.7500	2026/12/31	2,130	1,943	272,735
	US TREASURY	2.2500	2027/02/15	3,310	3,073	431,377
	US TREASURY	0.6250	2027/03/31	2,070	1,787	250,946

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千円	千ドル
アメリカ	%		千円	千ドル	千円
国債証券					
US TREASURY	2.3750	2027/05/15	3,910	3,640	510,945
US TREASURY	0.5000	2027/06/30	2,220	1,892	265,588
US TREASURY	2.2500	2027/08/15	3,970	3,667	514,757
US TREASURY	0.3750	2027/09/30	1,710	1,437	201,781
US TREASURY	2.2500	2027/11/15	2,600	2,393	335,898
US TREASURY	0.6250	2027/12/31	1,120	946	132,841
US TREASURY	2.7500	2028/02/15	2,720	2,557	358,944
US TREASURY	1.1250	2028/02/29	1,240	1,071	150,426
US TREASURY	1.2500	2028/03/31	1,150	998	140,159
US TREASURY	1.2500	2028/04/30	1,390	1,204	169,027
US TREASURY	2.8750	2028/05/15	1,460	1,378	193,525
US TREASURY	1.2500	2028/05/31	1,700	1,470	206,406
US TREASURY	2.8750	2028/08/15	3,320	3,127	439,032
US TREASURY	1.1250	2028/08/31	1,970	1,681	236,036
US TREASURY	1.3750	2028/10/31	1,940	1,673	234,909
US TREASURY	3.1250	2028/11/15	1,240	1,182	165,989
US TREASURY	1.5000	2028/11/30	1,520	1,319	185,170
US TREASURY	2.6250	2029/02/15	4,300	3,978	558,396
US TREASURY	2.3750	2029/05/15	3,750	3,410	478,752
US TREASURY	1.6250	2029/08/15	3,400	2,947	413,729
US TREASURY	1.7500	2029/11/15	690	603	84,681
US TREASURY	1.5000	2030/02/15	1,210	1,031	144,817
US TREASURY	0.6250	2030/08/15	2,160	1,702	238,916
US TREASURY	0.8750	2030/11/15	2,230	1,789	251,134
US TREASURY	1.1250	2031/02/15	2,180	1,780	249,891
US TREASURY	1.6250	2031/05/15	2,140	1,804	253,317
US TREASURY	1.2500	2031/08/15	2,350	1,907	267,729
US TREASURY	1.3750	2031/11/15	2,280	1,859	260,976
US TREASURY	1.8750	2032/02/15	2,160	1,834	257,558
US TREASURY	2.8750	2032/05/15	2,090	1,932	271,257
US TREASURY	2.7500	2032/08/15	1,960	1,789	251,160
US TREASURY	4.5000	2036/02/15	170	182	25,638
US TREASURY	5.0000	2037/05/15	130	146	20,499
US TREASURY	4.3750	2038/02/15	160	168	23,686
US TREASURY	4.5000	2038/05/15	150	160	22,494
US TREASURY	3.5000	2039/02/15	160	151	21,201
US TREASURY	4.2500	2039/05/15	240	248	34,817
US TREASURY	4.5000	2039/08/15	260	276	38,852

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千米ドル	千円
アメリカ	%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券					
US TREASURY	4.3750	2039/11/15	270	282	39,668
US TREASURY	4.6250	2040/02/15	290	312	43,909
US TREASURY	1.1250	2040/05/15	820	511	71,741
US TREASURY	1.1250	2040/08/15	1,010	623	87,565
US TREASURY	3.8750	2040/08/15	270	263	36,955
US TREASURY	1.3750	2040/11/15	1,120	722	101,425
US TREASURY	4.2500	2040/11/15	260	266	37,338
US TREASURY	1.8750	2041/02/15	1,370	964	135,430
US TREASURY	4.7500	2041/02/15	280	305	42,816
US TREASURY	2.2500	2041/05/15	1,180	884	124,127
US TREASURY	1.7500	2041/08/15	1,540	1,046	146,907
US TREASURY	2.0000	2041/11/15	1,290	915	128,470
US TREASURY	3.1250	2041/11/15	280	241	33,927
US TREASURY	2.3750	2042/02/15	1,050	796	111,759
US TREASURY	3.1250	2042/02/15	290	250	35,104
US TREASURY	3.0000	2042/05/15	270	227	31,894
US TREASURY	3.2500	2042/05/15	920	806	113,191
US TREASURY	2.7500	2042/08/15	320	256	36,072
US TREASURY	3.3750	2042/08/15	700	625	87,781
US TREASURY	2.7500	2042/11/15	460	368	51,695
US TREASURY	3.1250	2043/02/15	390	331	46,593
US TREASURY	2.8750	2043/05/15	620	505	70,920
US TREASURY	3.6250	2043/08/15	430	395	55,533
US TREASURY	3.7500	2043/11/15	450	421	59,127
US TREASURY	3.6250	2044/02/15	490	449	63,040
US TREASURY	3.3750	2044/05/15	450	395	55,496
US TREASURY	3.1250	2044/08/15	560	470	66,107
US TREASURY	3.0000	2044/11/15	510	419	58,826
US TREASURY	2.5000	2045/02/15	670	502	70,519
US TREASURY	3.0000	2045/05/15	330	270	37,984
US TREASURY	2.8750	2045/08/15	450	360	50,578
US TREASURY	3.0000	2045/11/15	260	212	29,894
US TREASURY	2.5000	2046/02/15	540	402	56,428
US TREASURY	2.5000	2046/05/15	550	408	57,394
US TREASURY	2.2500	2046/08/15	680	479	67,288
US TREASURY	2.8750	2046/11/15	290	231	32,542
US TREASURY	3.0000	2047/02/15	600	490	68,852
US TREASURY	3.0000	2047/05/15	470	384	53,975

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	2.7500	2047/08/15	670	522	73,352
	US TREASURY	2.7500	2047/11/15	670	522	73,385
	US TREASURY	3.0000	2048/02/15	770	631	88,568
	US TREASURY	3.1250	2048/05/15	820	689	96,774
	US TREASURY	3.0000	2048/08/15	900	740	103,945
	US TREASURY	3.3750	2048/11/15	920	813	114,159
	US TREASURY	3.0000	2049/02/15	980	809	113,597
	US TREASURY	2.8750	2049/05/15	950	766	107,594
	US TREASURY	2.2500	2049/08/15	900	635	89,146
	US TREASURY	2.3750	2049/11/15	840	609	85,588
	US TREASURY	2.0000	2050/02/15	1,050	695	97,608
	US TREASURY	1.3750	2050/08/15	1,390	773	108,585
	US TREASURY	1.6250	2050/11/15	1,370	817	114,743
	US TREASURY	1.8750	2051/02/15	1,530	977	137,154
	US TREASURY	2.3750	2051/05/15	1,530	1,104	155,065
	US TREASURY	2.0000	2051/08/15	1,520	1,000	140,382
	US TREASURY	1.8750	2051/11/15	1,430	910	127,797
	US TREASURY	2.2500	2052/02/15	1,290	903	126,879
	US TREASURY	2.8750	2052/05/15	1,230	994	139,624
	US TREASURY	3.0000	2052/08/15	1,290	1,074	150,819
	US TREASURY	6.2500	2030/05/15	150	172	24,160
	US TREASURY	0.6250	2030/05/15	1,630	1,291	181,320
	US TREASURY	4.3750	2040/05/15	270	281	39,560
	US TREASURY	4.3750	2041/05/15	260	269	37,884
US TREASURY	3.7500	2041/08/15	260	247	34,677	
US TREASURY	1.2500	2050/05/15	1,230	662	92,923	
小計		-	-	-	-	28,171,648
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2064/12/01	140	124	13,087
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2023/11/01	290	279	29,346
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2024/02/01	310	297	31,225
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2024/03/01	130	127	13,320
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2024/04/01	410	389	40,857
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2024/05/01	310	299	31,341
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2024/06/01	230	224	23,582
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/08/01	330	323	33,894
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2024/09/01	180	172	18,086
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2024/10/01	290	273	28,680

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千カナダ・ドル	千円
カナダ		%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	3.0000	2024/11/01	280	275	28,829
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2025/03/01	150	141	14,831
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2025/04/01	250	236	24,822
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2025/06/01	230	221	23,230
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2025/09/01	570	521	54,629
	CANADIAN GOVERNMENT	3.0000	2025/10/01	120	117	12,321
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2026/03/01	370	331	34,732
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/06/01	160	149	15,646
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2026/09/01	360	327	34,346
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2027/03/01	330	301	31,593
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2027/06/01	170	153	16,112
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/09/01	330	321	33,673
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2028/03/01	80	80	8,458
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/06/01	140	131	13,812
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/06/01	130	123	12,934
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2029/06/01	160	184	19,334
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/12/01	100	94	9,924
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2030/06/01	670	587	61,569
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2030/12/01	580	473	49,623
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/06/01	750	660	69,186
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/12/01	630	550	57,680
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2032/06/01	490	445	46,672
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2032/12/01	260	246	25,807
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/06/01	170	208	21,892
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/06/01	110	131	13,816
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/06/01	160	175	18,386
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/01	210	217	22,798
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/01	220	201	21,081
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2051/12/01	830	638	66,968
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2053/12/01	570	406	42,659
小計		-	-	-	-	1,170,799
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/04/21	310	308	28,812
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.2500	2024/11/21	570	538	50,306
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/04/21	410	411	38,396
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.2500	2025/11/21	390	357	33,373
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/04/21	380	392	36,639
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.5000	2026/09/21	490	441	41,211

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千円	千円	
オーストラリア			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	450	476	44,496
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	380	369	34,522
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	290	273	25,557
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	260	250	23,420
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	380	375	35,105
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2029/11/21	350	334	31,218
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5000	2030/05/21	490	457	42,734
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2030/12/21	420	345	32,246
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/06/21	500	423	39,590
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2031/11/21	640	513	47,963
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.2500	2032/05/21	590	479	44,796
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2032/11/21	490	414	38,671
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	440	473	44,247
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2033/11/21	360	339	31,668
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	210	188	17,621
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/04/21	250	246	23,008
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	210	191	17,867
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2041/05/21	280	232	21,724
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	280	233	21,857
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2051/06/21	380	233	21,837
小計			-	-	-	868,898
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.0000	2024/02/01	180	177	18,109
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2024/09/01	200	199	20,407
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/06/01	170	167	17,135
	SINGAPORE GOVERNMENT	0.5000	2025/11/01	110	102	10,479
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/06/01	160	155	15,906
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.2500	2026/11/01	100	93	9,576
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	190	194	19,819
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2027/09/01	50	49	5,087
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2028/05/01	110	107	11,023
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	140	138	14,096
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	180	177	18,078
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.6250	2031/07/01	120	106	10,891
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2032/08/01	40	38	3,914
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	130	133	13,587
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	170	153	15,715
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2039/07/01	70	63	6,491

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千シンガポール・ドル	千円
シンガポール		%		千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	120	116	11,924
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	140	136	13,932
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2050/03/01	140	113	11,617
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2051/10/01	100	81	8,310
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2072/08/01	50	52	5,368
小計		-	-	-	-	261,475
ニュージーランド				千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	
国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2025/04/15	340	328	28,291
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	0.5000	2026/05/15	300	263	22,746
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.0000	2029/04/20	250	234	20,179
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.5000	2031/05/15	140	113	9,814
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.0000	2032/05/15	110	91	7,901
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.5000	2033/04/14	100	94	8,132
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2037/04/15	120	99	8,542
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.7500	2041/05/15	100	65	5,627
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2051/05/15	100	71	6,198
小計		-	-	-	-	117,433
イギリス				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	
国債証券	UK TREASURY	0.1250	2024/01/31	650	626	104,409
	UK TREASURY	1.0000	2024/04/22	330	320	53,337
	UK TREASURY	2.7500	2024/09/07	270	267	44,574
	UK TREASURY	0.2500	2025/01/31	500	467	77,854
	UK TREASURY	5.0000	2025/03/07	310	322	53,680
	UK TREASURY	0.6250	2025/06/07	350	328	54,741
	UK TREASURY	2.0000	2025/09/07	300	291	48,503
	UK TREASURY	0.1250	2026/01/30	260	236	39,407
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	330	310	51,804
	UK TREASURY	0.3750	2026/10/22	460	411	68,592
	UK TREASURY	4.1250	2027/01/29	100	102	17,112
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	270	246	41,052
	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	300	311	51,966
	UK TREASURY	0.1250	2028/01/31	310	263	43,908
	UK TREASURY	1.6250	2028/10/22	260	237	39,565
	UK TREASURY	6.0000	2028/12/07	220	251	41,847
	UK TREASURY	0.5000	2029/01/31	350	294	49,140
	UK TREASURY	0.8750	2029/10/22	300	256	42,714
	UK TREASURY	0.3750	2030/10/22	310	248	41,464
	UK TREASURY	4.7500	2030/12/07	360	399	66,607

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						千円	邦貨換算金額
イギリス		%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
国債証券	UK TREASURY	0.2500	2031/07/31	570	440	73,420	
	UK TREASURY	1.0000	2032/01/31	600	490	81,757	
	UK TREASURY	4.2500	2032/06/07	390	422	70,381	
	UK TREASURY	0.8750	2033/07/31	240	186	31,059	
	UK TREASURY	4.5000	2034/09/07	270	299	49,868	
	UK TREASURY	0.6250	2035/07/31	420	298	49,661	
	UK TREASURY	4.2500	2036/03/07	340	367	61,193	
	UK TREASURY	1.7500	2037/09/07	440	349	58,147	
	UK TREASURY	4.7500	2038/12/07	310	354	59,026	
	UK TREASURY	1.1250	2039/01/31	280	196	32,720	
	UK TREASURY	4.2500	2039/09/07	270	291	48,592	
	UK TREASURY	4.2500	2040/12/07	310	336	56,119	
	UK TREASURY	1.2500	2041/10/22	490	336	56,035	
	UK TREASURY	4.5000	2042/12/07	370	419	69,835	
	UK TREASURY	3.2500	2044/01/22	360	343	57,159	
	UK TREASURY	3.5000	2045/01/22	400	396	66,096	
	UK TREASURY	0.8750	2046/01/31	280	163	27,312	
	UK TREASURY	4.2500	2046/12/07	330	368	61,366	
	UK TREASURY	1.5000	2047/07/22	340	229	38,183	
	UK TREASURY	1.7500	2049/01/22	230	163	27,273	
	UK TREASURY	4.2500	2049/12/07	260	295	49,199	
	UK TREASURY	0.6250	2050/10/22	200	101	16,912	
	UK TREASURY	1.2500	2051/07/31	370	225	37,630	
	UK TREASURY	3.7500	2052/07/22	260	278	46,314	
	UK TREASURY	1.5000	2053/07/31	190	123	20,573	
	UK TREASURY	1.6250	2054/10/22	270	182	30,332	
	UK TREASURY	4.2500	2055/12/07	350	416	69,382	
	UK TREASURY	1.7500	2057/07/22	370	261	43,516	
	UK TREASURY	4.0000	2060/01/22	260	307	51,286	
	UK TREASURY	0.5000	2061/10/22	340	149	24,843	
	UK TREASURY	2.5000	2065/07/22	300	263	43,867	
	UK TREASURY	3.5000	2068/07/22	320	357	59,558	
	UK TREASURY	1.6250	2071/10/22	250	169	28,205	
	UK TREASURY	1.1250	2073/10/22	200	109	18,202	
小計		-	-	-	-	2,647,321	
イスラエル				千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル		
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1.5000	2023/11/30	310	310	12,534	
	ISRAEL FIXED BOND	3.7500	2024/03/31	440	453	18,333	
	ISRAEL FIXED BOND	0.4000	2024/10/31	250	237	9,581	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千イスラエル・シケル	千円
イスラエル		%		千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	0.5000	2025/04/30	390	366	14,816
	ISRAEL FIXED BOND	1.7500	2025/08/31	680	657	26,550
	ISRAEL FIXED BOND	0.5000	2026/02/27	230	212	8,604
	ISRAEL FIXED BOND	6.2500	2026/10/30	290	323	13,067
	ISRAEL FIXED BOND	2.0000	2027/03/31	380	366	14,819
	ISRAEL FIXED BOND	2.2500	2028/09/28	360	344	13,928
	ISRAEL FIXED BOND	1.0000	2030/03/31	500	431	17,424
	ISRAEL FIXED BOND	1.3000	2032/04/30	160	136	5,508
	ISRAEL FIXED BOND	1.5000	2037/05/31	370	293	11,869
	ISRAEL FIXED BOND	5.5000	2042/01/31	390	518	20,961
	ISRAEL FIXED BOND	3.7500	2047/03/31	500	528	21,365
小計		-	-	-	-	209,365
デンマーク				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	1.5000	2023/11/15	990	985	19,193
	KINGDOM OF DENMARK	0.0000	2024/11/15	1,220	1,169	22,760
	KINGDOM OF DENMARK	1.7500	2025/11/15	980	968	18,853
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2027/11/15	1,450	1,336	26,031
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2029/11/15	1,400	1,243	24,219
	KINGDOM OF DENMARK	0.0000	2031/11/15	1,490	1,218	23,733
	KINGDOM OF DENMARK	4.5000	2039/11/15	2,280	2,966	57,758
	KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2052/11/15	1,150	686	13,357
小計		-	-	-	-	205,907
ノルウェー				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0000	2024/03/14	1,430	1,423	19,557
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2025/03/13	1,250	1,205	16,568
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/02/19	980	926	12,723
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2027/02/17	880	827	11,375
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/04/26	840	788	10,832
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2029/09/06	860	784	10,773
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.3750	2030/08/19	1,200	1,050	14,437
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.2500	2031/09/17	760	647	8,892
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.1250	2032/05/18	740	675	9,279
小計		-	-	-	-	114,439
スウェーデン				千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	1.5000	2023/11/13	2,030	2,012	26,530
	SWEDISH GOVERNMENT	2.5000	2025/05/12	1,610	1,615	21,288
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0000	2026/11/12	1,740	1,661	21,895
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2028/05/12	1,320	1,228	16,194

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						邦貨換算金額	
スウェーデン		%		千クェーデン・クローナ	千クェーデン・クローナ	千円	
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2029/11/12	1,390	1,271	16,758	
	SWEDISH GOVERNMENT	0.1250	2031/05/12	1,070	914	12,059	
	SWEDISH GOVERNMENT	2.2500	2032/06/01	1,040	1,066	14,058	
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	890	1,089	14,359	
小計		-	-	-	-	143,144	
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2023/12/07	4,760	4,638	33,455	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2024/09/05	6,580	6,375	45,989	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/05	5,040	5,045	36,394	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0000	2025/03/06	2,100	1,892	13,651	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	8,870	7,958	57,403	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5000	2027/03/04	2,920	2,535	18,288	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	6,820	6,384	46,054	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	5,940	5,725	41,299	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	8,610	7,860	56,697	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	1,720	1,532	11,053	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	1,450	1,530	11,039	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	4,710	4,387	31,644	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	5,070	4,342	31,323	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	5,240	4,588	33,100	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2053/07/31	1,000	870	6,281	
小計		-	-	-	-	473,675	
中国				千人民元	千人民元		
国債証券	CHINAGOVERNMENTBOND	2.2800	2024/03/17	7,000	7,003	137,590	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.1800	2024/06/25	2,200	2,192	43,072	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.4700	2024/09/02	5,600	5,607	110,170	
	CHINAGOVERNMENTBOND	1.9900	2024/09/15	4,000	3,976	78,121	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.2400	2025/05/25	5,500	5,474	107,565	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.1800	2025/08/25	7,000	6,951	136,581	
	CHINAGOVERNMENTBOND	3.0300	2026/03/11	1,200	1,217	23,919	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.6900	2026/08/12	4,400	4,407	86,593	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.3700	2027/01/20	3,200	3,161	62,117	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.4800	2027/04/15	6,700	6,644	130,551	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.5000	2027/07/25	4,800	4,766	93,655	
	CHINAGOVERNMENTBOND	3.0100	2028/05/13	720	728	14,313	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.9100	2028/10/14	5,400	5,456	107,199	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.8000	2029/03/24	3,600	3,600	70,734	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千人民元	千円
中国		%		千人民元	千人民元	千円
国債証券	CHINAGOVERNMENTBOND	2.7500	2029/06/15	4,500	4,492	88,275
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.6200	2029/09/25	1,400	1,382	27,158
	CHINAGOVERNMENTBOND	3.0200	2031/05/27	1,000	1,015	19,961
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.8900	2031/11/18	3,340	3,348	65,796
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.7500	2032/02/17	2,600	2,574	50,577
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.7600	2032/05/15	4,100	4,064	79,859
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.6900	2032/08/15	1,000	984	19,352
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.6000	2032/09/01	3,100	3,041	59,754
	CHINAGOVERNMENTBOND	3.7200	2051/04/12	1,260	1,360	26,733
	CHINAGOVERNMENTBOND	3.5300	2051/10/18	3,650	3,829	75,249
	CHINAGOVERNMENTBOND	3.3200	2052/04/15	5,400	5,490	107,872
	小計		-	-	-	-
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1810	2024/07/15	770	780	23,894
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.0590	2024/09/30	120	121	3,713
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8820	2025/03/14	160	160	4,905
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/09/15	680	680	20,848
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/04/15	360	364	11,167
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9000	2026/11/30	370	368	11,279
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/03/15	610	606	18,566
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8990	2027/11/16	330	325	9,977
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/06/15	450	439	13,454
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.5040	2029/04/30	160	162	4,965
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8850	2029/08/15	370	360	11,052
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/04/15	420	424	13,001
	MALAYSIA GOVERNMENT	2.6320	2031/04/15	190	167	5,127
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	380	376	11,531
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.5820	2032/07/15	140	132	4,042
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	410	389	11,923
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.6420	2033/11/07	190	192	5,897
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8280	2034/07/05	360	337	10,341
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/05/31	320	310	9,513
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	440	451	13,819
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.8930	2038/06/08	180	185	5,670
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7570	2040/05/22	490	437	13,385
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.6960	2042/10/15	220	221	6,766
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	160	164	5,033
MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	210	210	6,434	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
マレーシア		%		千円・シンガポ	千円・シンガポ	千円
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9210	2048/07/06	240	241	7,386
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.0650	2050/06/15	580	521	15,974
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.5020	2027/05/31	340	332	10,172
小計		-	-	-	-	289,847
ポーランド				千円・ズロチ	千円・ズロチ	
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2024/04/25	880	827	25,504
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.2500	2024/10/25	770	703	21,683
	POLAND GOVERNMENT BOND	0.7500	2025/04/25	670	581	17,908
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	810	732	22,580
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	950	805	24,802
	POLAND GOVERNMENT BOND	0.2500	2026/10/25	690	527	16,262
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.7500	2027/05/25	590	510	15,729
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	670	549	16,926
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	760	612	18,883
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/04/25	180	167	5,175
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/10/25	970	748	23,071
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.2500	2030/10/25	720	472	14,568
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.7500	2032/04/25	640	413	12,735
小計		-	-	-	-	235,832
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ	
アイルランド						
国債証券	IRELAND GOVERNMENT BOND	3.4000	2024/03/18	170	172	25,039
	IRELAND GOVERNMENT BOND	5.4000	2025/03/13	230	246	35,760
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.0000	2026/05/15	240	231	33,472
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.2000	2027/05/15	150	137	19,879
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.9000	2028/05/15	170	157	22,856
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.1000	2029/05/15	210	194	28,219
	IRELAND GOVERNMENT BOND	2.4000	2030/05/15	190	191	27,742
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.2000	2030/10/18	170	144	20,869
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3500	2031/03/18	140	130	18,844
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.0000	2031/10/18	190	153	22,285
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.3000	2033/05/15	100	88	12,852
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.4000	2035/05/15	110	83	12,163
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.7000	2037/05/15	140	123	17,822
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.5500	2041/04/22	90	60	8,824
	IRELAND GOVERNMENT BOND	2.0000	2045/02/18	220	191	27,734
	IRELAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2050/05/15	160	122	17,689
	IRELAND GOVERNMENT BOND	0.3500	2032/10/18	100	81	11,823
小計		-	-	-	-	363,880

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
オランダ					
国債証券					
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2024/01/15	320	312	45,222
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2024/07/15	350	349	50,656
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2025/07/15	410	391	56,693
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2026/01/15	170	159	23,045
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2026/07/15	390	368	53,392
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2027/01/15	320	293	42,538
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2027/07/15	320	301	43,599
NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/01/15	270	313	45,421
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2028/07/15	350	324	47,001
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2029/01/15	260	227	32,948
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2029/07/15	250	220	31,930
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2030/07/15	290	246	35,692
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2031/07/15	270	224	32,494
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2032/07/15	220	186	26,980
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/01/15	310	315	45,687
NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/01/15	370	440	63,854
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2038/01/15	160	111	16,189
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2040/01/15	320	236	34,310
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/01/15	390	473	68,576
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/01/15	420	461	66,792
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2052/01/15	280	151	22,010
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2054/01/15	100	95	13,785
小計	-	-	-	-	898,824
ベルギー					
国債証券					
BELGIUM KINGDOM	2.6000	2024/06/22	310	312	45,265
BELGIUM KINGDOM	0.5000	2024/10/22	260	252	36,564
BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/06/22	460	445	64,507
BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/03/28	240	258	37,468
BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/06/22	350	336	48,737
BELGIUM KINGDOM	0.8000	2027/06/22	320	300	43,547
BELGIUM KINGDOM	0.0000	2027/10/22	200	179	25,964
BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	390	454	65,888
BELGIUM KINGDOM	0.8000	2028/06/22	360	333	48,254
BELGIUM KINGDOM	0.9000	2029/06/22	390	356	51,606
BELGIUM KINGDOM	0.1000	2030/06/22	260	220	31,859
BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/06/22	360	322	46,633
BELGIUM KINGDOM	0.0000	2031/10/22	290	234	33,886

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/03/28	190	213	30,912
	BELGIUM KINGDOM	0.3500	2032/06/22	330	269	38,957
	BELGIUM KINGDOM	1.2500	2033/04/22	220	194	28,220
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/06/22	180	185	26,794
	BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	410	505	73,212
	BELGIUM KINGDOM	1.4500	2037/06/22	150	125	18,131
	BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/06/22	170	149	21,714
	BELGIUM KINGDOM	2.7500	2039/04/22	90	88	12,813
	BELGIUM KINGDOM	0.4000	2040/06/22	180	118	17,205
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/03/28	360	427	61,860
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/06/22	200	226	32,766
	BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/06/22	230	178	25,826
	BELGIUM KINGDOM	1.7000	2050/06/22	230	178	25,902
	BELGIUM KINGDOM	1.4000	2053/06/22	200	141	20,464
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2057/06/22	140	123	17,893
	BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/06/22	160	137	19,852
	BELGIUM KINGDOM	0.6500	2071/06/22	110	51	7,453
小計		-	-	-	-	1,060,167
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2024/02/25	640	623	90,322
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2024/03/25	870	845	122,497
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2024/05/25	810	811	117,467
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	790	783	113,454
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2025/02/25	520	494	71,676
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2025/03/25	990	940	136,252
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/05/25	950	911	132,022
	FRANCE (GOVT OF)	6.0000	2025/10/25	630	698	101,100
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	790	763	110,561
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2026/02/25	940	875	126,818
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/04/25	910	949	137,426
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/05/25	1,030	971	140,656
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	810	750	108,666
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2027/02/25	850	774	112,174
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2027/05/25	800	759	109,925
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	1,100	1,128	163,370
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/02/25	570	527	76,436
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/05/25	1,180	1,089	157,740

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/11/25	1,120	1,025	148,550
	FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/04/25	820	975	141,330
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2029/05/25	1,080	966	139,937
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2029/11/25	940	803	116,345
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/05/25	1,180	1,202	174,064
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2030/11/25	1,060	883	127,910
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/05/25	1,200	1,128	163,458
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2031/11/25	930	754	109,214
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2032/05/25	740	590	85,444
	FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	730	941	136,299
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2032/11/25	430	412	59,679
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2034/05/25	840	724	104,975
	FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/04/25	600	728	105,481
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/05/25	910	759	109,999
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2038/05/25	120	97	14,060
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	550	633	91,731
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2039/06/25	630	551	79,826
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2040/05/25	500	343	49,732
	FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/04/25	790	979	141,837
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2043/05/25	100	94	13,738
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2044/06/25	340	217	31,454
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/05/25	610	655	94,911
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2048/05/25	630	539	78,061
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2050/05/25	680	517	74,940
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2052/05/25	660	400	57,942
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2053/05/25	510	303	43,916
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/04/25	420	524	75,997
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/04/25	340	430	62,388
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/05/25	310	237	34,320
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2072/05/25	210	92	13,358
小計		-	-	-	-	4,809,482
ドイツ						
国債証券	BUNDESobligation	0.0000	2024/04/05	520	505	73,204
	BUNDESobligation	0.0000	2024/10/18	470	452	65,458
	BUNDESobligation	0.0000	2025/04/11	470	448	64,912
	BUNDESobligation	0.0000	2025/10/10	100	94	13,718
	BUNDESobligation	0.0000	2025/10/10	520	491	71,167

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ					
国債証券					
BUNDESobligation	0.0000	2026/04/10	570	534	77,332
BUNDESobligation	0.0000	2026/10/09	490	453	65,724
BUNDESobligation	0.0000	2027/04/16	460	422	61,112
BUNDESobligation	1.3000	2027/10/15	100	96	14,040
BUNDESobligation	1.3000	2027/10/15	490	474	68,741
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2024/02/15	560	558	80,804
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2024/05/15	490	486	70,391
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2024/08/15	460	452	65,468
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/02/15	620	599	86,830
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	610	594	86,046
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	690	658	95,401
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	670	623	90,321
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	630	587	85,064
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2027/08/15	670	627	90,832
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2027/11/15	470	427	61,871
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2028/02/15	610	566	82,032
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2028/08/15	600	545	78,945
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2028/11/15	550	490	70,988
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2029/02/15	610	549	79,611
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2029/08/15	600	526	76,286
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.1000	2029/11/15	80	80	11,666
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/01/04	230	294	42,690
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/02/15	570	495	71,771
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	210	180	26,208
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	690	594	86,082
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/02/15	570	486	70,396
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/08/15	160	135	19,583
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/08/15	640	540	78,303
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2032/02/15	630	525	76,123
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7000	2032/08/15	440	428	61,997
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/07/04	500	639	92,537
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2035/05/15	460	354	51,303
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2036/05/15	510	384	55,698
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	570	700	101,377
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2038/05/15	200	170	24,640
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	380	490	70,962

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ						
国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	420	578	83,832
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	400	473	68,518
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	610	658	95,401
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	640	698	101,215
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	710	609	88,245
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	210	124	17,966
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	700	412	59,743
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2052/08/15	390	221	32,060
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8000	2053/08/15	80	76	11,066
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2023/12/15	390	381	55,248
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2024/03/15	430	418	60,605
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.2000	2024/06/14	350	340	49,258
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.4000	2024/09/13	290	281	40,777
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	270	322	46,722
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	290	340	49,269
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	300	343	49,719
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	440	555	80,397
小計		-	-	-	-	3,707,703
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2031/10/31	440	359	52,000
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4000	2023/10/31	350	357	51,699
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8000	2024/01/31	290	298	43,289
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8000	2024/04/30	510	520	75,400
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2024/05/31	470	453	65,735
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.2500	2024/07/30	370	358	51,853
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	500	504	73,077
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2025/01/31	440	419	60,686
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/04/30	500	492	71,280
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2025/05/31	420	395	57,342
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/07/30	380	403	58,439
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	530	528	76,502
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2026/01/31	440	408	59,088
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	530	522	75,714
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	440	495	71,766
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	540	518	75,091
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2027/01/31	410	369	53,538
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	490	470	68,146
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2027/07/30	450	416	60,328

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	490	466	67,482
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2028/01/31	390	341	49,476
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/04/30	490	460	66,749
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/07/30	480	450	65,186
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	390	443	64,207
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/01/31	480	575	83,283
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2029/04/30	520	484	70,110
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2029/07/30	230	203	29,444
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6000	2029/10/31	470	409	59,319
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2030/04/30	490	418	60,545
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/07/30	490	463	67,107
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2500	2030/10/31	510	455	65,993
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.1000	2031/04/30	480	383	55,522
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7000	2032/04/30	450	368	53,406
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/07/30	500	623	90,265
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.5500	2032/10/31	380	365	52,937
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.3500	2033/07/30	390	367	53,227
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.8500	2035/07/30	460	399	57,831
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/01/31	460	514	74,515
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8500	2037/07/30	270	194	28,110
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/07/30	400	489	70,865
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2000	2040/10/31	370	264	38,311
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/07/30	440	529	76,609
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0000	2042/07/30	150	101	14,667
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2043/07/30	100	100	14,586
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	310	400	57,961
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	380	356	51,684
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7000	2048/10/31	360	321	46,545
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0000	2050/10/31	430	250	36,319
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9000	2052/10/31	210	150	21,820
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/07/30	300	301	43,694
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2071/10/31	130	70	10,163
小計		-	-	-	-	2,898,936
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0000	2023/11/01	190	201	29,142
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2024/01/15	730	708	102,631
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2024/01/30	150	145	21,073

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア					
国債証券					
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2024/03/01	390	399	57,787
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2024/04/15	560	540	78,256
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8500	2024/05/15	490	484	70,150
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7500	2024/07/01	360	355	51,457
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2024/08/15	280	267	38,778
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2024/09/01	410	418	60,545
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2024/11/15	360	353	51,118
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2024/12/01	430	429	62,171
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2024/12/15	310	294	42,628
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.3500	2025/02/01	430	409	59,232
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2025/03/01	480	504	73,033
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2025/05/15	270	261	37,867
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2025/06/01	570	552	79,969
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8500	2025/07/01	360	350	50,822
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2000	2025/08/15	230	219	31,820
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2025/11/15	390	386	55,924
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/01	420	409	59,294
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2026/01/15	60	60	8,801
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5000	2026/02/01	440	407	58,962
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/03/01	390	409	59,251
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2026/04/01	460	415	60,227
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6000	2026/06/01	470	448	64,954
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1000	2026/07/15	360	349	50,546
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2026/08/01	360	322	46,709
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2500	2026/12/01	450	420	60,873
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.8500	2027/01/15	410	375	54,360
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.1000	2027/04/01	310	284	41,232
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2000	2027/06/01	380	365	52,995
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0500	2027/08/01	390	371	53,820
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2027/09/15	450	406	58,848
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5000	2027/11/01	500	577	83,577
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.6500	2027/12/01	280	271	39,333
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2028/02/01	610	574	83,192
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.2500	2028/03/15	410	349	50,610
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5000	2028/07/15	340	290	42,139
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/09/01	480	516	74,808
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2028/12/01	500	486	70,484

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア					
国債証券					
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.4500	2029/02/15	340	284	41,171
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2029/06/15	280	269	38,989
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0000	2029/08/01	470	459	66,472
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/01	630	704	102,033
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/03/01	570	572	82,867
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2030/04/01	490	421	61,086
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2030/08/01	390	321	46,558
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2030/12/01	470	407	58,957
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9000	2031/04/01	580	467	67,631
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/05/01	560	659	95,438
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6000	2031/08/01	450	348	50,432
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2031/12/01	410	324	46,949
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/03/01	520	437	63,378
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2032/06/01	400	311	45,173
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2032/12/01	330	293	42,521
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/02/01	450	520	75,443
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2033/09/01	390	339	49,184
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/08/01	520	569	82,536
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.3500	2035/03/01	300	280	40,660
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2035/04/30	120	120	17,413
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2036/03/01	300	224	32,550
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/09/01	350	289	41,853
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/02/01	570	574	83,182
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2037/03/01	340	232	33,640
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2038/03/01	150	136	19,763
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.9500	2038/09/01	310	272	39,392
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/08/01	510	570	82,637
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1000	2040/03/01	290	257	37,246
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/09/01	460	516	74,749
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8000	2041/03/01	340	245	35,570
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/09/01	370	410	59,403
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2045/04/30	280	181	26,238
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/09/01	360	324	47,001
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/03/01	370	303	43,924
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2048/03/01	380	354	51,284
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2049/09/01	290	287	41,582
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2050/09/01	320	243	35,314

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7000	2051/09/01	330	212	30,770
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2052/09/01	190	133	19,275
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/03/01	200	153	22,179
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2072/03/01	100	64	9,333
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/01	200	232	33,644
小計		-	-	-	-	4,304,883
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	2.0000	2024/04/15	100	99	14,465
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2024/09/15	100	96	13,954
	FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/07/04	90	94	13,679
	FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/09/15	130	125	18,177
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/04/15	140	132	19,165
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2026/09/15	80	73	10,626
	FINNISH GOVERNMENT	1.3750	2027/04/15	60	57	8,341
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2027/09/15	140	128	18,561
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/07/04	110	112	16,237
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2028/09/15	100	89	12,995
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2029/09/15	130	114	16,532
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2030/09/15	120	99	14,357
	FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/04/15	100	86	12,588
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2031/09/15	130	105	15,331
	FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2032/09/15	100	90	13,130
	FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2034/04/15	90	76	11,036
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2036/04/15	80	56	8,227
	FINNISH GOVERNMENT	0.2500	2040/09/15	80	52	7,552
	FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/07/04	110	108	15,675
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2043/04/15	100	65	9,543
	FINNISH GOVERNMENT	1.3750	2047/04/15	90	71	10,295
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2052/04/15	80	41	5,991
小計		-	-	-	-	286,467
オーストリア						
国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2024/07/15	240	231	33,550
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.6500	2024/10/21	250	247	35,892
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2025/04/20	150	142	20,633
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2000	2025/10/20	290	282	40,974
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	150	162	23,586
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.0000	2026/07/15	100	99	14,382

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
オーストリア					
国債証券					
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2026/10/20	340	322	46,662
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2027/04/20	280	259	37,524
REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	180	211	30,630
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2028/02/20	230	212	30,746
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2028/10/20	120	104	15,079
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2029/02/20	250	222	32,222
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2030/02/20	250	209	30,317
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2031/02/20	280	227	32,972
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.9000	2032/02/20	190	163	23,747
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/05/23	180	175	25,359
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.2500	2036/10/20	130	92	13,435
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	300	348	50,468
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2040/10/20	120	73	10,702
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/06/20	160	172	24,915
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/02/20	180	142	20,615
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.8500	2049/05/23	80	67	9,843
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2051/03/20	160	100	14,568
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/01/26	80	100	14,550
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7000	2071/04/20	70	35	5,123
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2086/11/02	60	40	5,875
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1000	2117/09/20	120	97	14,145
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.8500	2120/06/30	90	43	6,358
小計	-	-	-	-	664,886
ユーロ小計	-	-	-	-	18,995,232
合計	-	-	-	-	55,727,800

## 投資信託財産の構成

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	55,727,800	98.8
コール・ローン等、その他	681,629	1.2
投資信託財産総額	56,409,429	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21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1カナダ・ドル104.82円、1オーストラリア・ドル93.41円、1シンガポール・ドル102.07円、1ニュージーランド・ドル86.21円、1イギリス・ポンド166.59円、1イスラエル・シケル40.408円、1デンマーク・クローネ19.47円、1ノルウェー・クローネ13.74円、1スウェーデン・クローナ13.18円、1メキシコ・ペソ7,213円、1人民元19.647円、1マレーシア・リンギット30.617円、1ポーランド・ズロチ30.809円、1ユーロ144.81円です。

(注2) 外貨建純資産（56,232,458千円）の投資信託財産総額（56,409,429千円）に対する比率は99.7%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>56,441,125,543円</b>
コーポレート債(評価額)	361,575,834
未収入金	55,727,800,029
未収利息	31,894,675
前払費用	297,051,718
	22,803,287
<b>(B)負債</b>	<b>155,603,410</b>
未払金	74,244,057
未払解約金	81,359,225
その他未払費用	128
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>56,285,522,133</b>
元本	36,786,269,889
次期繰越損益金	19,499,252,244
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>36,786,269,889口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>15,301円</b>

(注1) 期首元本額	33,749,154,108円
期中追加設定元本額	6,095,504,207円
期中一部解約元本額	3,058,388,426円
(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパーファンド別内訳は、次の通りです。	
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	3,204,719,220円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,416,454,023円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,062,600,685円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	864,520,535円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)	
SA(適格機関投資家限定)	2,743,596円
ニッセイインデックスバランス(標準型)	
SA(適格機関投資家限定)	6,743,242円
ニッセイインデックスバランス(成長型)	
SA(適格機関投資家限定)	5,156,272円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	14,361,888,951円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	4,034,335,050円
DCニッセイ外国債券インデックス	3,289,166,819円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	194,490,072円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,733,127,766円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	222,180,351円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	437,042,241円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	70,272,806円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	170,801,283円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	18,635,379円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	41,316,219円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	140,408,215円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	93,510,516円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	206,076,638円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	191,924,583円
FWニッセイ外国債券インデックス	10,493,180円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	7,662,247円

### 損益の状況

当期(2022年5月21日~2022年11月21日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>591,240,685円</b>
受取利息	591,290,133
その他収益金	1,341
支払利息	△ 50,789
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>446,544,036</b>
売買益	4,272,453,847
売買損	△ 3,825,909,811
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 11,627,332</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>1,026,157,389</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>16,839,663,918</b>
<b>(F)追加信託差損益金</b>	<b>3,290,938,252</b>
<b>(G)解約差損益金</b>	<b>△ 1,657,507,315</b>
<b>(H)合計(D+E+F+G)</b>	<b>19,499,252,244</b>
次期繰越損益金(H)	<b>19,499,252,244</b>

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

## 指数に関して

### ■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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