

第7期末（2024年2月21日）

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 11,292円 |
| 純資産総額 | 135億円 |
| 騰落率 | 6.7% |
| 分配金 | 0円 |

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

DCニッセイ ワールドセレクトファンド (安定型)

追加型投信／内外／資産複合

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2023年2月22日～2024年2月21日

第7期(決算日 2024年2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ニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」は、このたび第7期の決算を行いました。

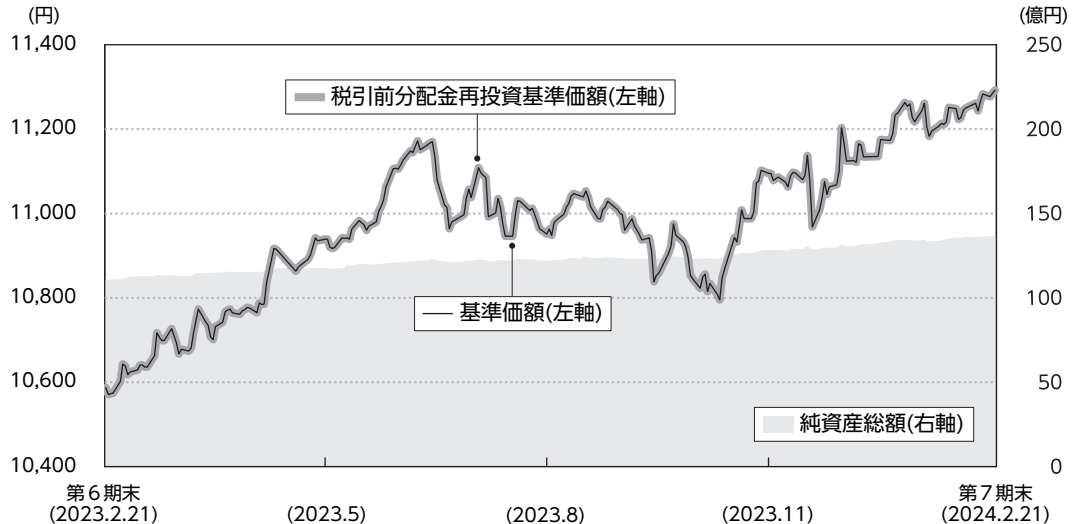
当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

運用経過

2023年2月22日～2024年2月21日

基準価額等の推移



| | | | |
|------|---------|-----------------|------|
| 第7期首 | 10,587円 | 既払分配金 | 0円 |
| 第7期末 | 11,292円 | 騰落率 (分配金再投資ベース) | 6.7% |

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2023年3月下旬から7月にかけて、インフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の回復期待等を背景に国内外の株価が上昇したことに加え、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月初旬から下旬にかけて、日銀の金融緩和姿勢継続が示唆されたことや米連邦公開市場委員会(FOMC)で追加利上げ観測が後退したことなどから国内外の株価が上昇したこと
- ・12月中旬から当期末にかけて、米経済や企業業績への見通しが堅調であったことや国内では新しい少額投資非課税制度(NISA)に伴う資金流入への期待感等を背景に国内外の株価が上昇したこと

<下落要因>

- ・2023年9月から10月末にかけて、日銀による金融政策正常化観測の高まりなどから金利が上昇(債券価格は下落)したこと

| 組入マザーファンド | 投資比率 | 組入比率 | 騰落率 |
|-----------------------|------|------|-------|
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 5.0% | 5.1% | 34.8% |
| ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド | 60.0 | 59.9 | 0.2 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 5.0 | 5.1 | 33.7 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 25.0 | 25.0 | 15.0 |
| 短期金融資産 | 5.0 | 5.0 | - |

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第7期 | | 項目の概要 |
|------------|------|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 17円 | 0.154% | $\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は10,978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 |
| 売買委託手数料 | 0 | 0.000 | |
| (株式) | (0) | (0.000) | 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数 |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| 有価証券取引税 | 0 | 0.000 | |
| (株式) | (0) | (0.000) | 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| その他費用 | 2 | 0.016 | その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (1) | (0.010) | 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) | (0.006) | 公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | <ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 19 | 0.170 | |

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

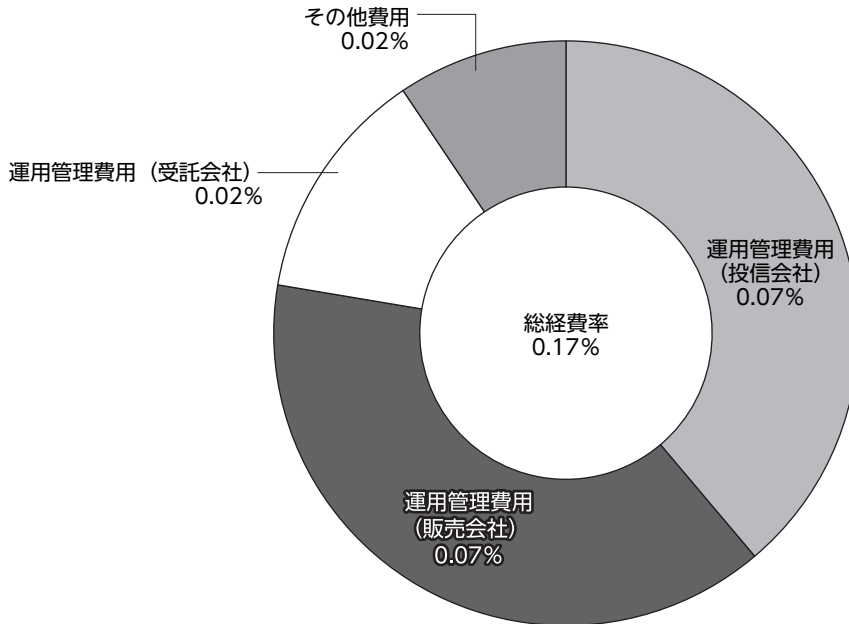
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(参考情報)

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.17%**です。



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

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

投資環境

■国内株式市況

当期の国内株式市場はおおむね上昇基調で推移しました。

期初以降、欧米における金融引き締めと長期化懸念が後退したことや、日銀の金融緩和の現状維持により市場に安心感が広がったことから株価は上昇しましたが、2023年3月中旬に米地銀の経営破綻や欧州大手投資銀行の信用不安等に伴う欧米金融システムに対する懸念を受けて下落しました。

3月下旬以降は外国人投資家の買い越しや東京証券取引所が株価純資産倍率（PBR）の低い企業に資本効率や株価を意識した経営を求めたことによる日本企業の資本コスト意識の高まりなど、国内独自のポジティブ要因に加えて、米経済の軟着陸（ソフトランディング）への期待感や人工知能（AI）ブームによる世界同時株高の追い風を受けて株価は上昇基調で推移しました。

7月に入ると米金利の上昇や日銀によるイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、YCC）の運用柔軟化等、金融政策への思惑が交錯し株価は上下する展開となりましたが、その後、9月中旬にかけては米追加利上げ観測の後退を背景に上昇しました。9月下旬から10月末にかけては米金利の上昇を受けて株価は下落しましたが、11月に入ると日銀の金融緩和姿勢の継続が示唆されたことや米金利が低下したため株価は上昇する展開となりました。その後は円高の進行などから下落する場面もありましたが、年明け以降は米株高や円安に加えて、海外投資家の買いや新NISAに伴う資金流入への期待感等を背景に株価は大きく上昇し、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

■国内債券市況

10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、おおむね横ばいで推移した後、2023年3月中旬に日銀が金融緩和の現状維持を改めて示したことから金利は低下しました。4月下旬の日銀金融政策決定会合において金融政策の現状維持が発表されたことで6月末まで緩やかに低下しましたが、7月に入ると内田日銀副総裁のインタビューや日銀の物価上昇率の見直し引き上げ報道等から金融政策の修正観測が高まり金利は大きく上昇し、その後も米金利の上昇を受けて上昇基調で推移しました。

9月上旬には植田日銀総裁のインタビューをきっかけに金融政策の修正観測が強まり、金利は上昇基調となりましたが、11月に入ると米金融引き締めと長期化観測が後退したことなどを背景に金利は低下しました。2024年1月中旬以降は、堅調な米経済指標や米連邦準備制度理事会（FRB）高官の早期利下げ期待をけん制する発言などにより米金利が上昇する中、国内金利も上昇基調となり、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

■海外株式市場

海外株式市場は期を通じて見るとイギリスでは下落しましたが、米国やドイツでは上昇しました。

期初から2023年5月にかけては、米国において複数の銀行が経営破綻したことや大手金融機関クレディ・スイス・グループの経営不安が高まったことなどが嫌気されて株価は下落する場面もありましたが、欧米各国の当局による資金繰り支援や救済措置などの迅速な対応により市場心理が改善したこと、市場予想を上回る決算を発表した大型ハイテック株が堅調に推移したことなどからおおむね上昇しました。6月から7月にかけては、米国における債務上限法案の上下院での可決や堅調な経済指標を背景とした景気のソフトランディングへの期待感が強まったことなどから株価は上昇しました。その後は米国債の格下げや9月にF R Bによる金融引き締めに向き姿勢を受けて米金利が上昇したこと、米国の政府閉鎖問題、中東情勢の緊迫化を背景に株価は下落したものの、11月に入るとF O M Cで追加利上げ観測が後退したことや米政府機関における一部閉鎖の回避等を受けて反発しました。12月にはF R Bのパウエル議長が金融緩和に前向きな姿勢の発言をしたことや市場予想並みであった米消費者物価指数(C P I)等を受けて株価は続伸しました。2024年初から2月にかけては、前月までの株式市場における上昇の反動や米雇用統計が市場予想を上回り堅調な経済環境が確認されたことなどから金利が上昇し株価は下落する場面がありましたが、米経済や企業業績への見通しが堅調であったことや米国におけるインフレ鈍化への期待感から米国やドイツの株式市場が上昇し、結局、期を通じて見ると米国とドイツでは上昇し、イギリスでは下落して当期末を迎えました。

■海外債券市場

当期の米国10年国債金利は、期初は米地方銀行の経営破綻をきっかけに投資家のリスク回避姿勢が強まったことから一時的に低下しましたが、2023年4月から10月中旬にかけては堅調な米経済指標を背景に上昇基調となりました。10月下旬以降は中東情勢の悪化により投資家のリスク回避姿勢が強まったことや物価上昇率の鈍化を受けて将来の利下げ観測が強まったことから金利は低下しましたが、年明け以降は堅調な米雇用統計を背景にF R Bによる利下げ期待が後退したことなどから上昇し、結局、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初から2023年5月にかけて欧州中央銀行(E C B)の金融政策動向の影響を受けて大きく上下する場面がありましたが、おおむね横ばい圏での推移となりました。その後は各国の利上げや米金利の上昇を受けて上昇基調となり、9月にはE C Bが利上げ休止を示唆し成長率予測を引き下げたことなどから上昇幅を縮小する動きとなりました。10月下旬以降は中東情勢の悪化により投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどをを受けて金利は低下しましたが、年明け以降は米金利の上昇に追随するかたちで上昇し、結局、期を通じて見ると小幅に低下して当期末を迎えました。

■為替市場

当期の米ドル/円レートは上昇しました。

期初以降、堅調な米経済指標や植田日銀新総裁が金融緩和を継続するとの見方が強まったことからおおむね米ドル高円安基調で推移しました。2023年7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けて大きく円高に振れる場面があったものの、その後は米国が利上げ方向である一方で日本が金融緩和方向であっ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りました。11月以降は米国の将来の利下げ観測が意識される一方で日本の金融政策正常化観測が高まったことでいったんは米ドル安円高基調に転じましたが、当期末にかけては早期の金融政策の変更はないとの見方から再び米ドル高円安基調となり、結局、期を通じて見ると米ドル高円安で当期末を迎えました。

当期のユーロ/円レートは上昇しました。

期初からE C Bが継続的に物価上昇リスクを警戒していたことや米金利の上昇に連れて欧州金利が上昇したことなどからおおむねユーロ高円安基調で推移しました。2023年7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けてユーロ安円高に転じる場面もありましたが、その後は日・欧中央銀行の金融政策の影響を受けて上下に振れつつも横ばい圏での推移となりました。11月には日本の金融政策正常化観測が高まったことでいったんはユーロ安円高となりましたが、その後は大手格付け機関によるイタリア国債の格下げが回避されたことなどをを受けてユーロに対する懸念が後退したことや日銀の金融緩和と政策継続への見方が強まったことなどから再びユーロ高円安となり、結局、期を通じて見ると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

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行いました。

■マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

国内の公社債に投資することにより、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

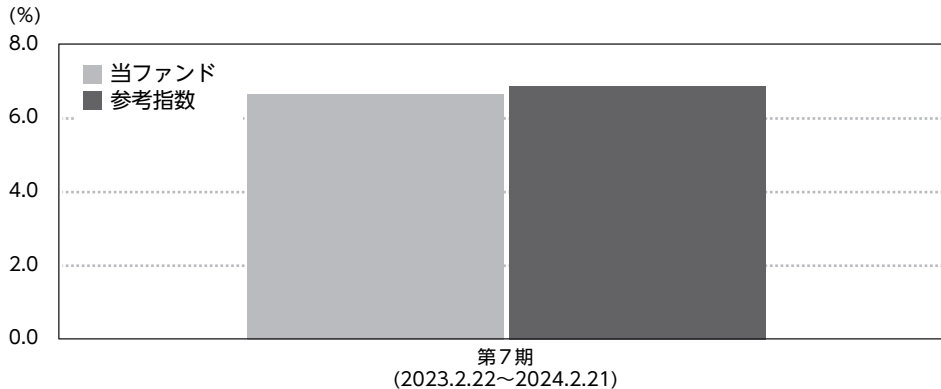
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く主要国の国債に投資することにより、ベンチマークである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した。

*ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

参考指数との差異



当ファンドはベンチマークを設けていません。参考指数は、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、無担保コール翌日物の収益率に投資比率を乗じて合成したものです。

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+6.7%となり、参考指数騰落率（+6.9%）を下回りました。信託報酬等を控除した関係などから参考指数騰落率を下回る結果となりました。

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 参考指数の詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

分配金

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。

なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

| 項目 | 当期 2023年2月22日~2024年2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 | 1,292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

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。相場動向やその見通しによって資産配分比率を変更するファンドではありません。従って、今後も投資比率（基準ポートフォリオ）に基づいて各マザーファンド受益証券の組み入れを行い、同投資比率を継続的に維持していく予定です。

■マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

国内の公社債に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

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

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■ 組入ファンド

| | 第7期末 2024年2月21日 |
|---------------------------|--------------------|
| ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド | 5.1% |
| ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド | 59.9 |
| ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド | 5.1 |
| ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド | 25.0 |

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

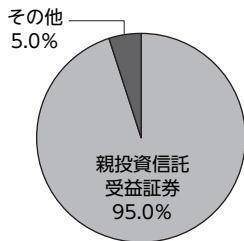
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■ 純資産等

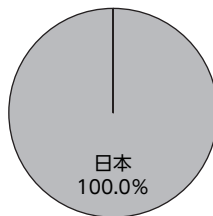
| 項目 | 第7期末 2024年2月21日 |
|------------|--------------------|
| 純資産総額 | 13,564,224,959円 |
| 受益権総口数 | 12,012,346,424口 |
| 1万口当たり基準価額 | 11,292円 |

(注) 当期間中における追加設定元本額は3,332,882,597円、同解約元本額は1,733,363,991円です。

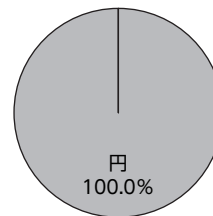
■ 資産別配分



■ 国別配分



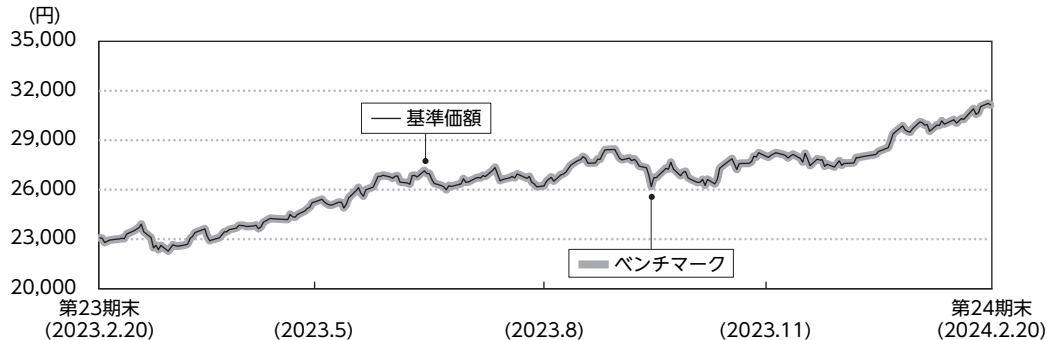
■ 通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2024年2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。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

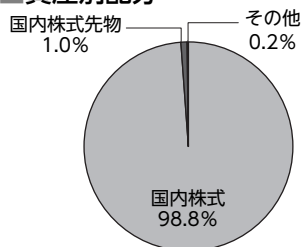
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------|----|-------|
| トヨタ自動車 | 円 | 5.0% |
| ソニーグループ | 円 | 2.5 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 円 | 2.4 |
| 東京エレクトロン | 円 | 1.9 |
| キーエンス | 円 | 1.8 |
| 三菱商事 | 円 | 1.7 |
| 日立製作所 | 円 | 1.6 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 円 | 1.5 |
| 信越化学工業 | 円 | 1.5 |
| 日本電信電話 | 円 | 1.4 |
| 組入銘柄数 | | 1,709 |

■ 1万口当たりの費用明細

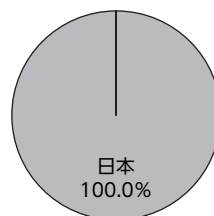
2023.2.21~2024.2.20

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

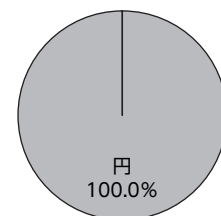
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



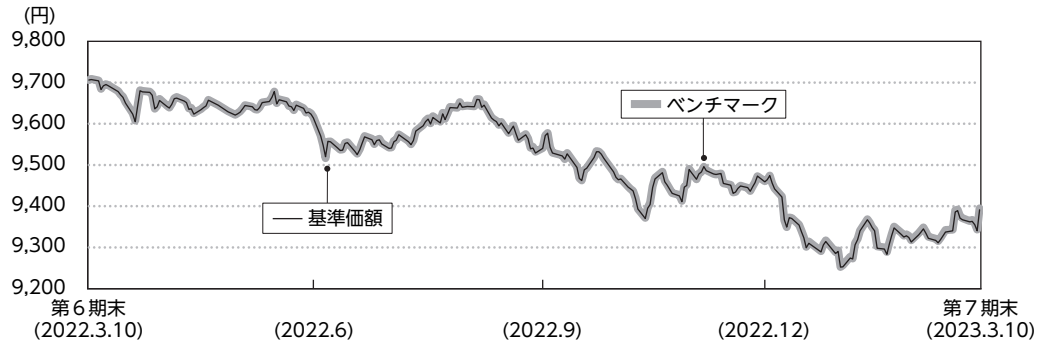
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

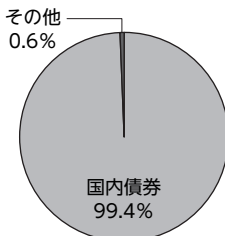
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|------------------|----|------|
| 第350回 利付国債 (10年) | 円 | 0.9% |
| 第364回 利付国債 (10年) | 円 | 0.9 |
| 第368回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 第365回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 第349回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 第338回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 第360回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 第361回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 第218回 政保道路機構債券 | 円 | 0.8 |
| 第359回 利付国債 (10年) | 円 | 0.8 |
| 組入銘柄数 | | 368 |

■ 1万口当たりの費用明細

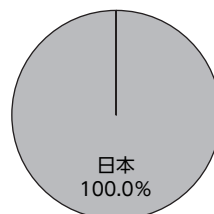
2022.3.11~2023.3.10

| 項目 | 金額 |
|----------------|-----------|
| その他費用 (その他) | 0円 (0) |
| 合計 | 0 |

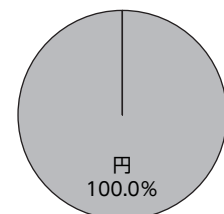
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



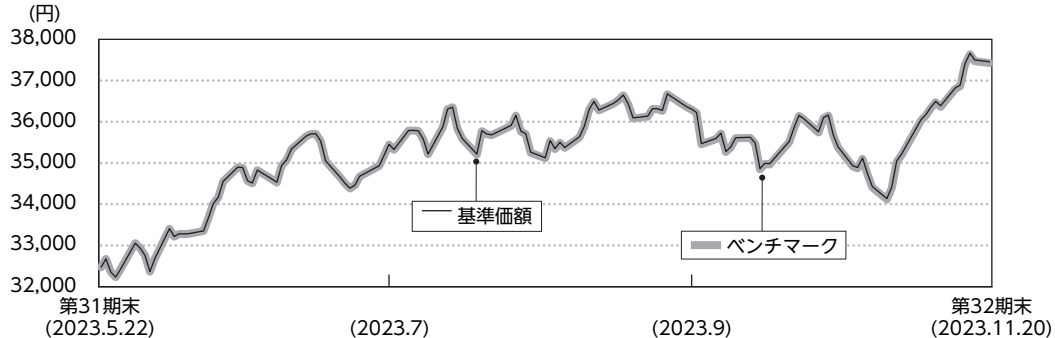
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2023年3月10日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

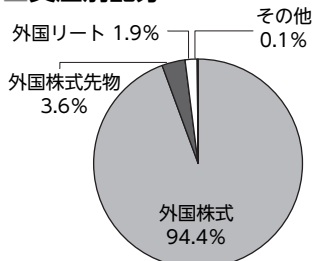
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------------------|-----|------|
| APPLE INC | 米ドル | 5.4% |
| MICROSOFT CORP | 米ドル | 4.7% |
| S&P 500 EMINI FUTURE 202312 買 | 米ドル | 2.7% |
| AMAZON.COM INC | 米ドル | 2.4% |
| NVIDIA CORP | 米ドル | 2.2% |
| ALPHABET INC-CL A | 米ドル | 1.4% |
| META PLATFORMS INC-A | 米ドル | 1.3% |
| ALPHABET INC-CL C | 米ドル | 1.3% |
| TESLA, INC. | 米ドル | 1.2% |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 米ドル | 0.9% |
| 組入銘柄数 | | 1278 |

■ 1万口当たりの費用明細

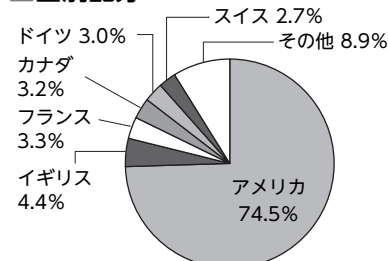
2023.5.23~2023.11.20

| 項目 | 金額 |
|------------|-----|
| 売買委託手数料 | 0円 |
| (株式) | (0) |
| (先物・オプション) | (0) |
| (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 | 3 |
| (保管費用) | (3) |
| (その他) | (0) |
| 合計 | 5 |

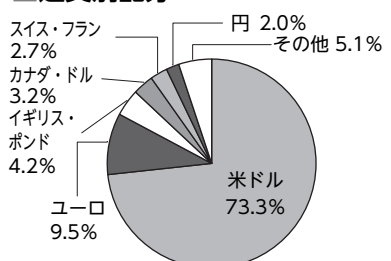
■ 資産別配分



■ 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。

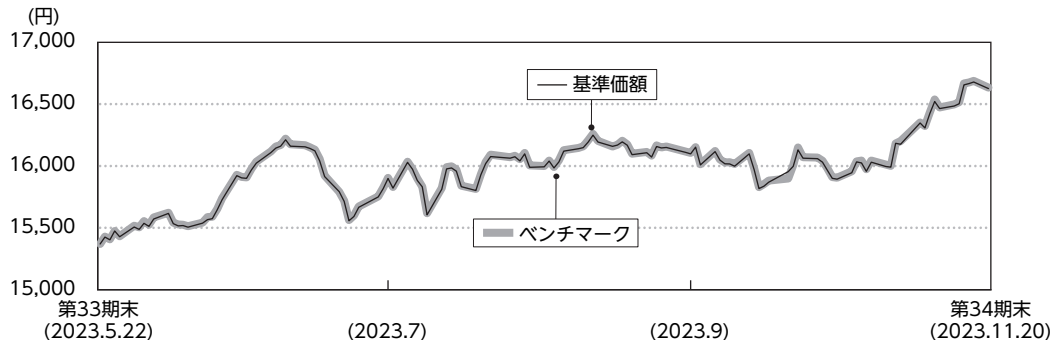
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2023年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

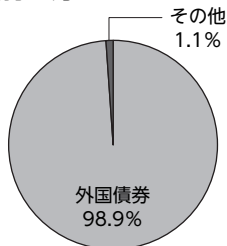
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|------------------------------|-----|------|
| US TREASURY 2.0% 2025/2/15 | 米ドル | 1.7% |
| US TREASURY 2.25% 2025/11/15 | 米ドル | 1.6 |
| US TREASURY 2.125% 2025/5/15 | 米ドル | 1.5 |
| US TREASURY 2.25% 2024/11/15 | 米ドル | 1.5 |
| US TREASURY 1.625% 2026/2/15 | 米ドル | 1.5 |
| US TREASURY 2.875% 2028/8/15 | 米ドル | 1.3 |
| US TREASURY 1.625% 2026/5/15 | 米ドル | 1.3 |
| US TREASURY 1.5% 2026/8/15 | 米ドル | 1.3 |
| US TREASURY 2.25% 2027/11/15 | 米ドル | 1.2 |
| US TREASURY 2.0% 2025/8/15 | 米ドル | 1.1 |
| 組入銘柄数 | | 817 |

■ 1万口当たりの費用明細

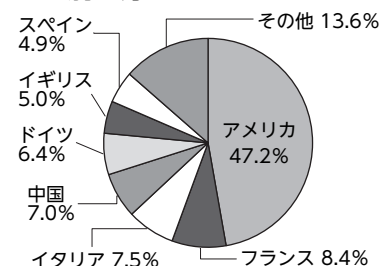
2023.5.23~2023.11.20

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

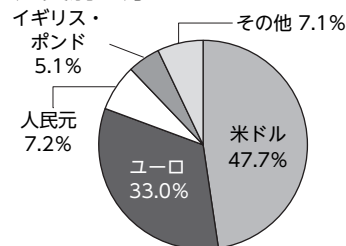
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2023年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

DCニッセイワールドセレクトファンド（安定型）

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 税引前 | 期中 | (ご参考) | 参考指数 | 期中 | 株式 | 株式 | 債券 | 投資信託 | 純資産 |
|----------------|--------|-----|------|--------|--------|------|------|------|------|------|--------|
| | (分配) | 分配金 | 騰落率 | 基準価額+ | | 騰落率 | 組入比率 | 先物比率 | 組入比率 | 証券 | |
| | | 円 | 円 | % | 円 | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 3期(2020年2月21日) | 10,590 | 0 | 3.9 | 10,590 | 10,640 | 4.1 | 9.6 | 0.3 | 84.3 | 0.1 | 3,187 |
| 4期(2021年2月22日) | 10,669 | 0 | 0.7 | 10,669 | 10,738 | 0.9 | 9.9 | 0.2 | 83.9 | 0.1 | 5,944 |
| 5期(2022年2月21日) | 10,748 | 0 | 0.7 | 10,748 | 10,842 | 1.0 | 9.4 | 0.4 | 84.2 | 0.1 | 8,963 |
| 6期(2023年2月21日) | 10,587 | 0 | △1.5 | 10,587 | 10,714 | △1.2 | 9.7 | 0.3 | 83.8 | 0.1 | 11,023 |
| 7期(2024年2月21日) | 11,292 | 0 | 6.7 | 11,292 | 11,450 | 6.9 | 9.8 | 0.2 | 83.9 | 0.1 | 13,564 |

(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)に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | 参考指数 | 騰落率 | 株式 | 株式 | 債券 | 投資信託 |
|----------------|--------|-----|--------|-----|------|------|------|------|
| | 円 | % | | % | 組入比率 | 先物比率 | 組入比率 | 証券 |
| | | 円 | % | | % | % | % | 組入比率 |
| (期首)2023年2月21日 | 10,587 | — | 10,714 | — | 9.7 | 0.3 | 83.8 | 0.1 |
| 2月末 | 10,643 | 0.5 | 10,771 | 0.5 | 9.7 | 0.3 | 84.1 | 0.1 |
| 3月末 | 10,773 | 1.8 | 10,904 | 1.8 | 9.4 | 0.3 | 84.3 | 0.1 |
| 4月末 | 10,837 | 2.4 | 10,970 | 2.4 | 9.8 | 0.2 | 84.0 | 0.1 |
| 5月末 | 10,942 | 3.4 | 11,081 | 3.4 | 9.8 | 0.3 | 84.1 | 0.1 |
| 6月末 | 11,151 | 5.3 | 11,293 | 5.4 | 9.8 | 0.3 | 84.3 | 0.1 |
| 7月末 | 11,001 | 3.9 | 11,144 | 4.0 | 9.9 | 0.2 | 84.1 | 0.1 |
| 8月末 | 11,041 | 4.3 | 11,184 | 4.4 | 9.7 | 0.3 | 84.1 | 0.1 |
| 9月末 | 10,937 | 3.3 | 11,084 | 3.5 | 9.4 | 0.4 | 84.5 | 0.1 |
| 10月末 | 10,795 | 2.0 | 10,941 | 2.1 | 9.6 | 0.3 | 84.3 | 0.1 |
| 11月末 | 11,097 | 4.8 | 11,249 | 5.0 | 9.9 | 0.2 | 84.2 | 0.1 |
| 12月末 | 11,134 | 5.2 | 11,289 | 5.4 | 9.7 | 0.2 | 84.3 | 0.1 |
| 2024年1月末 | 11,211 | 5.9 | 11,368 | 6.1 | 10.2 | 0.2 | 83.8 | 0.1 |
| (期末)2024年2月21日 | 11,292 | 6.7 | 11,450 | 6.9 | 9.8 | 0.2 | 83.9 | 0.1 |

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2023年2月22日～2024年2月21日

| | 設定 | | 解約 | |
|-----------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 79,808 | 212,756 | 98,563 | 265,721 |
| ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド | 2,932,812 | 2,753,273 | 1,277,639 | 1,199,794 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 59,603 | 209,043 | 75,468 | 267,860 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 585,369 | 937,686 | 468,940 | 750,932 |

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 当期 | |
|-------------------|---------------------------|---------------------------|
| | ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド | ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 45,625,740千円 | 112,920,220千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 187,271,457千円 | 704,880,639千円 |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.24 | 0.16 |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

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

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2023年2月22日～2024年2月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)

親投資信託残高

2024年2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 |
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 242,181 | 223,426 | 694,386 |
| ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド | 7,050,377 | 8,705,551 | 8,119,667 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 182,613 | 166,749 | 687,423 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 1,873,266 | 1,989,696 | 3,387,258 |

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが71,947,940千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが60,158,160千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが223,769,394千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが45,245,373千口です。

投資信託財産の構成

2024年2月21日現在

| 項目 | 当期末 | |
|-----------------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 694,386 | 5.1 |
| ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド | 8,119,667 | 59.7 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 687,423 | 5.1 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 3,387,258 | 24.9 |
| コール・ローン等、その他 | 722,058 | 5.3 |
| 投資信託財産総額 | 13,610,796 | 100.0 |

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル150.16円、1カナダ・ドル111.02円、1オーストラリア・ドル98.41円、1香港ドル19.20円、1シンガポール・ドル111.73円、1ニュージーランド・ドル92.63円、1イギリス・ポンド189.58円、1イスラエル・シケル40.76円、1スイス・フラン170.29円、1デンマーク・クローネ21.78円、1ノルウェー・クローネ14.33円、1スウェーデン・クローナ14.51円、1メキシコ・ペソ8.803円、1人民元20.841円、1マレーシア・リングギット31.284円、1ポーランド・ズロチ37.609円、1ユーロ162.34円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (906,034,219千円) の投資信託財産総額 (923,368,981千円) に対する比率は98.1%です。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (76,976,335千円) の投資信託財産総額 (77,334,173千円) に対する比率は99.5%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日現在)

| 項目 | 当期末 |
|--------------------------------|------------------------|
| (A)資産 | 13,610,796,281円 |
| コール・ローン等 | 687,347,274 |
| ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額) | 694,386,964 |
| ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額) | 8,119,667,677 |
| ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額) | 687,423,807 |
| ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額) | 3,387,258,991 |
| 未収入金 | 34,711,568 |
| (B)負債 | 46,571,322 |
| 未払解約金 | 36,301,016 |
| 未払信託報酬 | 9,890,172 |
| その他未払費用 | 380,134 |
| (C)純資産総額(A-B) | 13,564,224,959 |
| 元本 | 12,012,346,424 |
| 次期繰越損益金 | 1,551,878,535 |
| (D)受益権総口数 | 12,012,346,424口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 11,292円 |

| | |
|-----------|-----------------|
| (注) 期首元本額 | 10,412,827,818円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,332,882,597円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,733,363,991円 |

損益の状況

当期 (2023年2月22日~2024年2月21日)

| 項目 | 当期 |
|------------------------|----------------------|
| (A)配当等収益 | △ 235,342円 |
| 受取利息 | 35,629 |
| 支払利息 | △ 270,971 |
| (B)有価証券売買損益 | 736,310,216 |
| 売買益 | 805,782,387 |
| 売買損 | △ 69,472,171 |
| (C)信託報酬等 | △ 19,588,657 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | 716,486,217 |
| (E)前期繰越損益金 | △ 59,196,316 |
| (分配準備積立金) | (95,864,649) |
| (繰越欠損金) | (△ 155,060,965) |
| (F)追加信託差損益金* | 894,588,634 |
| (配当等相当額) | (478,245,476) |
| (売買損益相当額) | (416,343,158) |
| (G)合計(D+E+F) | 1,551,878,535 |
| 次期繰越損益金(G) | 1,551,878,535 |
| 追加信託差損益金 | 894,588,634 |
| (配当等相当額) | (478,245,476) |
| (売買損益相当額) | (416,343,158) |
| 分配準備積立金 | 657,525,243 |
| 繰越欠損金 | △ 235,342 |

- (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 | 561,660,594円 |
| (c) 信託約款に定める収益調整金 | 894,588,634円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金 | 95,864,649円 |
| (e) 分配対象額 (a + b + c + d) | 1,552,113,877円 |
| (f) 分配対象額 (1万口当たり) | 1,292.10円 |
| (g) 分配金 | 0円 |
| (h) 分配金 (1万口当たり) | 0円 |

お知らせ

■約款変更

マザーファンドのベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化しました。

(2023年11月22日)

当ファンドの概要

| | | |
|---------|--|--|
| 商 品 分 類 | 追加型投信／内外／資産複合 | |
| 信 託 期 間 | 無期限 | |
| 運 用 方 針 | 下記マザーファンド受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。 | |
| 主要運用対象 | DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」 受益証券 |
| | 国内株式マザーファンド | 国内の金融商品取引所上場株式等 |
| | 国内債券マザーファンド | 国内の公社債 |
| | 外国株式マザーファンド | 日本を除く主要先進国の株式 |
| | 外国債券マザーファンド | 日本を除く主要国の国債 |
| 運用方法 | DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 各マザーファンドへは、原則として下記の比率で投資し、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。また株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の25%以下とし、外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%以下とします。 ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド……………5% ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド……………60% ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド……………5% ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド……………25% 短期金融資産……………5% |
| | 国内株式マザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。 |
| | 国内債券マザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りです。 |
| | 外国株式マザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・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。 |
| | 外国債券マザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・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。 | |

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 24 期

(計算期間：2023年2月21日～2024年2月20日)

運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。
株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



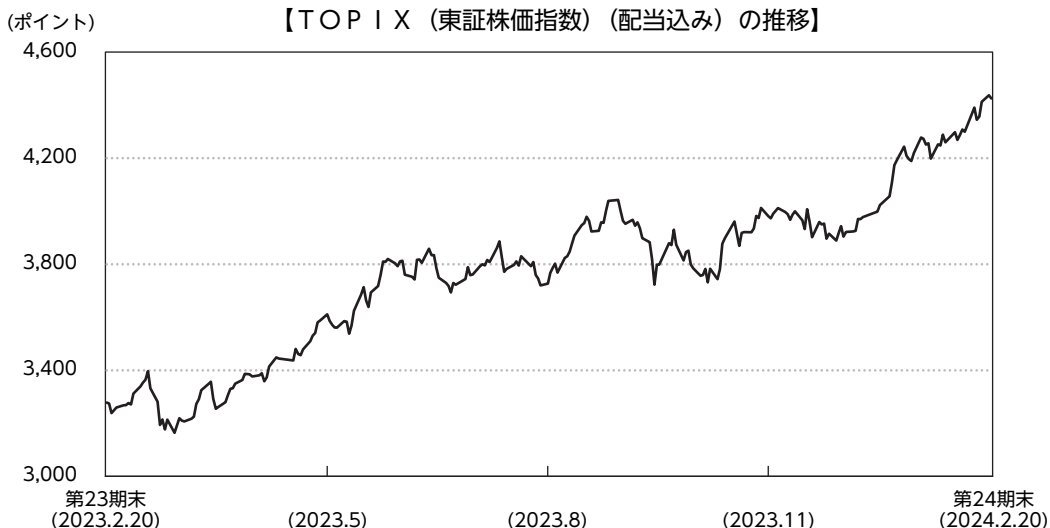
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年2月21日～2024年2月20日

国内株式市況



(注) FactSetのデータを使用しています。

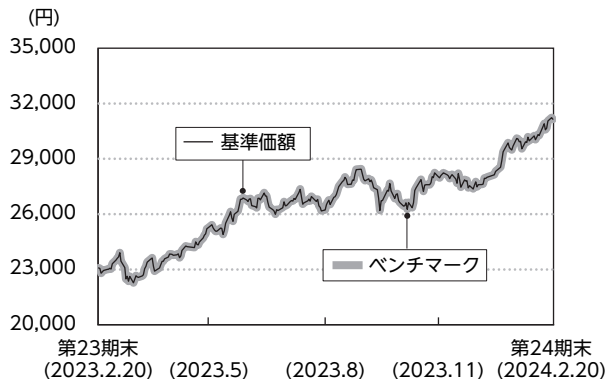
当期の国内株式市場はおおむね上昇基調で推移しました。

期初以降、欧米における金融引き締め長期化懸念が後退したことや、日銀の金融緩和の現状維持により市場に安心感が広がったことから株価は上昇しましたが、2023年3月中旬に米地銀の経営破綻や欧州大手投資銀行の信用不安等に伴う欧米金融システムに対する懸念を受けて下落しました。

3月下旬以降は外国人投資家の買い越しや東京証券取引所が株価純資産倍率（PBR）の低い企業に資本効率や株価を意識した経営を求めたことによる日本企業の資本コスト意識の高まりなど、国内独自のポジティブ要因に加えて、米経済の軟着陸（ソフトランディング）への期待感や人工知能（AI）ブームによる世界同時株高の追い風を受けて株価は上昇基調で推移しました。

7月に入ると米金利の上昇や日銀によるイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、YCC）の運用柔軟化等、金融政策への思惑が交錯し株価は上下する展開となりましたが、その後、9月中旬にかけては米追加利上げ観測の後退を背景に上昇しました。9月下旬から10月末にかけては米金利の上昇を受けて株価は下落しましたが、11月に入ると日銀の金融緩和姿勢の継続が示唆されたことや米金利が低下したため株価は上昇する展開となりました。その後は円高の進行などから下落する場面もありましたが、年明け以降は米株高や円安に加えて、海外投資家の買いや新しい少額投資非課税制度（NISA）に伴う資金流入への期待感等を背景に株価は大きく上昇し、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

国内の金融商品取引所上場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った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは前掲の「国内株式市況」をご参照ください。

ポートフォリオ

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

*ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）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

当期の基準価額騰落率は+34.9%となり、ベンチマーク騰落率（+35.0%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

お知らせ

■ 約款変更

ベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化しました。

(2023年8月19日)

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 期中騰落率 | | ベンチマーク | 期中騰落率 | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-------|--|--------|-------|--|--------|--------|---------|
| | | | | | | | | | |
| | 円 | % | | | % | | % | % | 百万円 |
| 20期(2020年2月20日) | 18,004 | 6.4 | | 18,182 | 6.4 | | 98.3 | 1.6 | 68,225 |
| 21期(2021年2月22日) | 21,336 | 18.5 | | 21,558 | 18.6 | | 99.3 | 0.7 | 170,293 |
| 22期(2022年2月21日) | 21,482 | 0.7 | | 21,702 | 0.7 | | 96.1 | 3.7 | 117,060 |
| 23期(2023年2月20日) | 23,077 | 7.4 | | 23,334 | 7.5 | | 97.9 | 2.1 | 187,428 |
| 24期(2024年2月20日) | 31,139 | 34.9 | | 31,493 | 35.0 | | 98.8 | 1.0 | 224,002 |

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | ベンチマーク | 騰落率 | | 株式組入比率 | 株式先物比率 |
|----------------|--------|------|-----|--------|------|-----|--------|--------|
| | | | | | | | | |
| | 円 | % | | | % | | % | % |
| (期首)2023年2月20日 | 23,077 | - | | 23,334 | - | | 97.9 | 2.1 |
| 2月末 | 23,009 | △ | 0.3 | 23,267 | △ | 0.3 | 98.0 | 1.7 |
| 3月末 | 23,396 | 1.4 | | 23,663 | 1.4 | | 97.3 | 2.7 |
| 4月末 | 24,024 | 4.1 | | 24,301 | 4.1 | | 97.1 | 2.7 |
| 5月末 | 24,892 | 7.9 | | 25,180 | 7.9 | | 96.9 | 3.1 |
| 6月末 | 26,770 | 16.0 | | 27,081 | 16.1 | | 97.2 | 2.8 |
| 7月末 | 27,171 | 17.7 | | 27,485 | 17.8 | | 98.3 | 1.8 |
| 8月末 | 27,286 | 18.2 | | 27,604 | 18.3 | | 97.6 | 2.4 |
| 9月末 | 27,429 | 18.9 | | 27,744 | 18.9 | | 96.5 | 3.6 |
| 10月末 | 26,611 | 15.3 | | 26,914 | 15.3 | | 97.4 | 2.5 |
| 11月末 | 28,049 | 21.5 | | 28,374 | 21.6 | | 97.9 | 2.1 |
| 12月末 | 27,989 | 21.3 | | 28,309 | 21.3 | | 97.4 | 2.8 |
| 2024年1月末 | 30,174 | 30.8 | | 30,521 | 30.8 | | 98.2 | 1.8 |
| (期末)2024年2月20日 | 31,139 | 34.9 | | 31,493 | 35.0 | | 98.8 | 1.0 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年2月21日～2024年2月20日

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------------------------------|------------------|------------------------------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) | 0円 (0) (0) | 0.001% (0.000) (0.001) | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料 |
| その他費用 (その他) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 0 | 0.001 | |

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（26,547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

2023年2月21日～2024年2月20日

(1) 株式

| | | 買付 | | 売付 | |
|----|----|-------------------|------------|--------|------------|
| | | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 |
| 国内 | 上場 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 7,499 (23,418) | 15,648,076 | 14,224 | 29,977,664 |

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種類別 | 買建 | | 売建 | | |
|-----|--------|--------|--------|-----|---|
| | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 | |
| 国内 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | |
| 国内 | 株式先物取引 | 37,374 | 40,391 | — | — |

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2023年2月21日～2024年2月20日

株式

| 銘柄 | 買付 | | | 銘柄 | 売付 | | |
|-------------------|-----|---------|--------|-------------------|-------|---------|--------|
| | 株数 | 金額 | 平均単価 | | 株数 | 金額 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| ゆうちょ銀行 | 488 | 660,469 | 1,352 | トヨタ自動車 | 452 | 822,585 | 1,817 |
| トヨタ自動車 | 211 | 526,041 | 2,491 | ソニーグループ | 58 | 713,686 | 12,241 |
| 三菱商事 | 61 | 354,452 | 5,791 | 日本電信電話 | 1,025 | 586,441 | 572 |
| ソニーグループ | 27 | 352,645 | 12,964 | 東芝 | 127 | 581,911 | 4,574 |
| 信越化学工業 | 75 | 348,046 | 4,616 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 607 | 554,558 | 912 |
| 伊藤忠商事 | 60 | 330,366 | 5,478 | キーエンス | 8 | 517,596 | 62,360 |
| 三井物産 | 55 | 300,804 | 5,400 | ソフトバンクグループ | 94 | 475,014 | 5,015 |
| キーエンス | 3 | 247,194 | 63,383 | 日立製作所 | 49 | 377,010 | 7,585 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 181 | 211,996 | 1,170 | 第一三共 | 72 | 343,238 | 4,767 |
| 東京エレクトロン | 8 | 178,198 | 21,469 | 三井住友フィナンシャルグループ | 59 | 335,202 | 5,633 |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

組入有価証券明細表

2024年2月20日現在

(1) 国内株式
上場株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業(0.1%) | | | |
| 極洋 | 3 | 3 | 11,036 |
| ニッセイ | 89 | 83 | 77,224 |
| マルハニチロ | 13 | 12 | 35,670 |
| 雪国まいたけ | 7 | 7 | 6,816 |
| カネコ種苗 | 3 | 2 | 4,079 |
| サカタのタネ | 11 | 9 | 35,530 |
| ホフト | 7 | 6 | 12,381 |
| 鉱業(0.3%) | | | |
| 住石ホールディングス | 13 | 9 | 20,012 |
| 日鉄鉱業 | 3 | 3 | 17,028 |
| 三井松島ホールディングス | 4 | 5 | 15,050 |
| I N P E X | 330 | 307 | 620,640 |
| 石油資源開発 | 10 | 9 | 58,656 |
| K&Oエナジーグループ | 4 | 3 | 9,359 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 建設業(2.0%) | | | |
| ショーボンドホールディングス | 12 | 11 | 69,935 |
| ミライト・ワン | 31 | 27 | 48,413 |
| タマホーム | 6 | 5 | 20,644 |
| ファーストコーポレーション | 1 | 1 | 1,027 |
| 安藤・間 | 51 | 48 | 59,237 |
| 東急建設 | 25 | 26 | 21,060 |
| コムシスホールディングス | 30 | 26 | 88,006 |
| ピーアールホールディングス | 14 | 17 | 6,446 |
| 高松コンストラクショングループ | 5 | 6 | 16,839 |
| 東建コーポレーション | 2 | 2 | 20,139 |
| ソネット | 4 | 1 | 1,387 |
| ヤマウラ | 4 | 4 | 6,300 |
| オリエンタル白石 | 32 | 30 | 11,827 |
| 大成建設 | 62 | 54 | 260,902 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 大林組 | 223 | 208 | 295,048 |
| 清水建設 | 187 | 164 | 147,321 |
| 飛鳥建設 | 6 | 6 | 8,820 |
| 長谷工コーポレーション | 64 | 53 | 100,097 |
| 松井建設 | 8 | 7 | 6,650 |
| 銭高組 | 1 | - | - |
| 鹿島建設 | 138 | 128 | 359,437 |
| 不動テトラ | 4 | 4 | 8,844 |
| 鉄建建設 | 4 | 4 | 10,378 |
| 西松建設 | 10 | 11 | 50,727 |
| 三井住友建設 | 50 | 43 | 18,575 |
| 大豊建設 | 2 | 2 | 6,400 |
| 佐田建設 | 10 | 2 | 1,505 |
| ナカノフドー建設 | 15 | 0.100 | 64 |
| 奥村組 | 10 | 9 | 47,470 |
| 東鉄工業 | 8 | 7 | 21,888 |
| 浅沼組 | 5 | 4 | 17,909 |
| 戸田建設 | 76 | 78 | 75,575 |
| 熊谷組 | 10 | 9 | 36,912 |
| 植木組 | 3 | 0.900 | 1,635 |
| 矢作建設工業 | 8 | 7 | 12,624 |
| ピーエス三菱 | 7 | 7 | 7,784 |
| 日本ハウスホールディングス | 13 | 21 | 6,447 |
| 新日本建設 | 8 | 8 | 10,184 |
| 東亜道路工業 | 1 | 2 | 14,858 |
| 日本道路 | 1 | 6 | 13,749 |
| 東亜建設工業 | 5 | 4 | 20,947 |
| 日本国土開発 | 18 | 16 | 8,613 |
| 若築建設 | 2 | 2 | 6,594 |
| 東洋建設 | 20 | 14 | 19,213 |
| 五洋建設 | 88 | 82 | 62,797 |
| 世紀東急工業 | 8 | 7 | 14,520 |
| 福田組 | 2 | 2 | 11,726 |
| 住友林業 | 47 | 50 | 205,374 |
| 日本基礎技術 | 8 | 8 | 3,661 |
| 巴コーポレーション | 10 | 6 | 3,960 |
| 大和ハウス工業 | 174 | 160 | 698,193 |
| ライト工業 | 11 | 12 | 22,596 |
| 積水ハウス | 195 | 176 | 580,356 |
| 日特建設 | 6 | 5 | 6,501 |
| 北陸電気工事 | 7 | 5 | 6,864 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ユアテック | 13 | 12 | 16,166 |
| 日本リーテック | 5 | 5 | 6,426 |
| 四電工 | 2 | 2 | 9,588 |
| 中電工 | 9 | 9 | 26,613 |
| 関電工 | 34 | 36 | 57,002 |
| きんでん | 44 | 40 | 107,158 |
| 東京エネシス | 6 | 6 | 7,167 |
| トーエネック | 2 | 1 | 10,222 |
| 住友電設 | 5 | 5 | 17,077 |
| 日本電設工業 | 10 | 10 | 22,781 |
| エクシオグループ | 28 | 28 | 88,721 |
| 新日本空調 | 3 | 3 | 10,833 |
| 九電工 | 15 | 12 | 70,043 |
| 三機工業 | 13 | 12 | 24,330 |
| 日揮ホールディングス | 61 | 57 | 80,413 |
| 中外炉工業 | 3 | 2 | 6,782 |
| ヤマト | 6 | 2 | 2,060 |
| 太平電業 | 3 | 3 | 15,444 |
| 高砂熱学工業 | 15 | 15 | 68,172 |
| 三晃金属工業 | 1 | - | - |
| 朝日工業社 | 2 | 2 | 8,235 |
| 明星工業 | 10 | 11 | 13,865 |
| 大気社 | 7 | 6 | 32,428 |
| ダイダン | 4 | 7 | 13,801 |
| 日比谷総合設備 | 5 | 4 | 10,764 |
| テスホールディングス | 6 | 13 | 6,160 |
| インフロニア・ホールディングス | 65 | 67 | 100,299 |
| 東洋エンジニアリング | - | 8 | 7,021 |
| レイズネクスト | 9 | 8 | 19,832 |
| 食料品(3.2%) | | | |
| ニッポン | 16 | 17 | 41,562 |
| 日清製粉グループ本社 | 58 | 54 | 114,696 |
| 日東富士製粉 | 1 | 1 | 6,360 |
| 昭和産業 | 5 | 5 | 19,494 |
| 中部飼料 | 8 | 8 | 10,214 |
| フィード・ワン | 9 | 8 | 8,857 |
| 日本甜菜製糖 | 3 | 3 | 7,214 |
| DM三井製糖ホールディングス | 6 | 5 | 18,821 |
| 塩水港精糖 | 23 | - | - |
| ウェルネオシュガー | 3 | 2 | 6,545 |
| 森永製菓 | 11 | 25 | 67,525 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 中村屋 | 1 | 2 | 6,270 |
| 江崎グリコ | 17 | 16 | 77,955 |
| 名糖産業 | 3 | 3 | 6,826 |
| 井村屋グループ | 3 | 3 | 8,620 |
| 不二家 | 4 | 4 | 10,040 |
| 山崎製パン | 42 | 39 | 149,401 |
| モロゾフ | 2 | 1 | 7,875 |
| 亀田製菓 | 4 | 3 | 14,520 |
| 寿スピリッツ | 6 | 27 | 53,889 |
| カルビー | 28 | 26 | 84,078 |
| 森永乳業 | 11 | 20 | 64,912 |
| 六甲バター | 4 | 4 | 6,495 |
| ヤクルト本社 | 44 | 83 | 263,877 |
| 明治ホールディングス | 38 | 71 | 244,728 |
| 雪印メグミルク | 15 | 14 | 31,851 |
| プリマハム | 8 | 7 | 17,924 |
| 日本ハム | 24 | 25 | 131,975 |
| 林兼産業 | 7 | 1 | 1,077 |
| 丸大食品 | 6 | 5 | 9,817 |
| S Foods | 6 | 6 | 20,448 |
| 柿安本店 | 2 | 2 | 6,577 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 48 | 8 | 37,380 |
| サッポロホールディングス | 20 | 19 | 129,196 |
| アサヒグループホールディングス | 144 | 134 | 718,342 |
| キリンホールディングス | 283 | 243 | 523,001 |
| 宝ホールディングス | 42 | 39 | 47,481 |
| オエノンホールディングス | 18 | 17 | 6,072 |
| 養命酒製造 | 2 | 3 | 6,351 |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 49 | 45 | 89,092 |
| サントリー食品インターナショナル | 44 | 41 | 198,184 |
| グアールグループホールディングス | 3 | 6 | 20,097 |
| 伊藤園 | 23 | 19 | 83,674 |
| キーコーヒー | 7 | 6 | 13,338 |
| 日清オイリオグループ | 8 | 8 | 41,000 |
| 不二製油グループ本社 | 14 | 13 | 32,402 |
| J-オイルミルズ | 6 | 6 | 12,971 |
| キッコーマン | 41 | 38 | 358,400 |
| 味の素 | 153 | 138 | 802,795 |
| ブルドックソース | 2 | 3 | 6,603 |
| キューピー | 33 | 31 | 85,517 |
| ハウス食品グループ本社 | 19 | 20 | 63,114 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| カゴメ | 29 | 25 | 89,908 |
| アリアケジャパン | 5 | 5 | 31,436 |
| エバラ食品工業 | 1 | 2 | 6,410 |
| ニチレイ | 28 | 26 | 101,893 |
| 東洋水産 | 31 | 29 | 248,360 |
| イートアンドホールディングス | 2 | 3 | 6,411 |
| ヨムラ・フード・ホールディングス | 7 | 6 | 7,833 |
| 日清食品ホールディングス | 22 | 61 | 275,598 |
| 永谷園ホールディングス | 3 | 2 | 6,458 |
| 一正蒲鉾 | 6 | - | - |
| フジッコ | 6 | 6 | 11,658 |
| ロック・フィールド | 7 | 7 | 11,842 |
| 日本たばこ産業 | 412 | 354 | 1,385,103 |
| ケンコーマヨネーズ | 4 | 4 | 8,400 |
| わらべや日洋ホールディングス | 4 | 3 | 11,056 |
| なとり | 3 | 3 | 8,025 |
| ファーマフーズ | 9 | 8 | 8,316 |
| ユーグレナ | 40 | 36 | 22,905 |
| 紀文食品 | 5 | 5 | 6,211 |
| ピックルスホールディングス | 4 | 5 | 6,446 |
| ミヨシ油脂 | 3 | - | - |
| 理研ビタミン | 5 | 5 | 11,940 |
| 繊維製品(0.4%) | | | |
| 片倉工業 | 5 | 5 | 10,043 |
| グンゼ | 4 | 4 | 23,436 |
| 東洋紡 | 27 | 25 | 27,935 |
| 富士紡ホールディングス | 2 | 2 | 11,635 |
| 倉敷紡績 | 4 | 4 | 13,167 |
| 日本毛織 | 16 | 15 | 20,550 |
| 帝国繊維 | 7 | 6 | 14,384 |
| 帝人 | 61 | 57 | 71,517 |
| 東レ | 427 | 397 | 274,630 |
| 日本フェルト | 11 | 5 | 2,409 |
| イチカワ | 3 | 3 | 5,871 |
| アツギ | 10 | 10 | 6,099 |
| セーレン | 12 | 11 | 28,175 |
| ソトー | 5 | 5 | 3,950 |
| 東海染工 | 1 | 1 | 1,318 |
| 小松マテーレ | 9 | 8 | 6,776 |
| ワコールホールディングス | 12 | 12 | 44,383 |
| ホギメディカル | 8 | 7 | 27,768 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| T S Iホールディングス | 22 | 19 | 13,452 |
| マツオカコーポレーション | 4 | 3 | 4,937 |
| ワールド | 8 | 8 | 16,615 |
| オンワードホールディングス | 41 | 35 | 18,340 |
| ゴールドウイン | 11 | 10 | 93,628 |
| デサント | 11 | 10 | 32,908 |
| ヤマトインターナショナル | 17 | 14 | 4,300 |
| パルプ・紙(0.2%) | | | |
| 特種東海製紙 | 2 | 3 | 12,192 |
| 王子ホールディングス | 265 | 247 | 137,183 |
| 日本製紙 | 33 | 33 | 38,223 |
| 三菱製紙 | 8 | 4 | 2,425 |
| 北越コーポレーション | 40 | 29 | 38,164 |
| 大王製紙 | 28 | 26 | 28,440 |
| 阿波製紙 | 11 | 3 | 1,950 |
| レンゴー | 58 | 54 | 54,424 |
| トーモク | 3 | 3 | 7,871 |
| ザ・パックス | 4 | 4 | 16,786 |
| 化学(5.8%) | | | |
| 北の達人コーポレーション | 26 | 26 | 6,015 |
| クラレ | 101 | 86 | 130,139 |
| 旭化成 | 398 | 401 | 422,693 |
| レゾナック・ホールディングス | 61 | 57 | 186,779 |
| 住友化学 | 473 | 440 | 137,498 |
| 住友精化 | 2 | 2 | 14,140 |
| 日産化学 | 30 | 27 | 175,267 |
| ラサ工業 | 2 | 2 | 6,320 |
| クレハ | 5 | 13 | 34,853 |
| 多木化学 | 2 | 2 | 8,349 |
| テイカ | 4 | 5 | 7,089 |
| 石原産業 | 11 | 9 | 14,827 |
| 片倉コープアグリ | 1 | - | - |
| 日本曹達 | 6 | 7 | 41,510 |
| 東ソー | 85 | 79 | 159,868 |
| トクヤマ | 20 | 19 | 45,100 |
| セントラル硝子 | 10 | 6 | 18,169 |
| 東亜合成 | 32 | 28 | 43,572 |
| 大阪ソーダ | 3 | 4 | 46,863 |
| 関東電化工業 | 12 | 11 | 10,683 |
| デンカ | 23 | 21 | 54,496 |
| 信越化学工業 | 107 | 538 | 3,298,851 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本カーバイド工業 | 3 | 4 | 7,749 |
| 堺化学工業 | 4 | 4 | 8,860 |
| 第一稀元素化学工業 | 5 | 6 | 5,999 |
| エア・ウォーター | 60 | 56 | 121,912 |
| 日本酸素ホールディングス | 61 | 57 | 237,542 |
| 日本化学工業 | 2 | 3 | 6,905 |
| 日本パーカラライジング | 31 | 26 | 33,549 |
| 高圧ガス工業 | 9 | 8 | 7,585 |
| 四国化成ホールディングス | 7 | 7 | 13,550 |
| ステラ ケミファ | 3 | 3 | 12,176 |
| 保土谷化学工業 | 1 | 1 | 6,811 |
| 日本触媒 | 9 | 8 | 48,753 |
| 大日精化工業 | 4 | 4 | 11,291 |
| カネカ | 14 | 15 | 55,734 |
| 三菱瓦斯化学 | 47 | 44 | 116,287 |
| 三井化学 | 53 | 49 | 198,499 |
| J S R | 59 | 64 | 263,911 |
| 東京応化工業 | 11 | 28 | 117,812 |
| 大阪有機化学工業 | 4 | 5 | 14,925 |
| 三菱ケミカルグループ | 430 | 434 | 375,279 |
| K Hネオケム | 10 | 9 | 20,748 |
| ダイセル | 93 | 76 | 110,215 |
| 住友ベークライト | 9 | 8 | 67,437 |
| 積水化学工業 | 130 | 119 | 248,800 |
| 日本ゼオン | 38 | 40 | 52,340 |
| アイカ工業 | 16 | 15 | 53,250 |
| UBE | 32 | 28 | 72,815 |
| 積水樹脂 | 9 | 8 | 22,525 |
| タキロンシーアイ | 13 | 15 | 9,528 |
| 旭有機材 | 4 | 4 | 16,500 |
| ニチバン | 4 | 3 | 6,870 |
| リケンテクノス | 13 | 12 | 12,352 |
| 大倉工業 | 3 | 2 | 8,904 |
| 積水化成成品工業 | 12 | 12 | 5,833 |
| 群栄化学工業 | 2 | 1 | 6,868 |
| ダイキョーニシカワ | 14 | 13 | 9,615 |
| 森六ホールディングス | 3 | 3 | 8,559 |
| 恵和 | 4 | 4 | 5,377 |
| 日本化薬 | 48 | 45 | 58,883 |
| カーリットホールディングス | 6 | 6 | 6,534 |
| 日本精化 | 3 | 3 | 10,276 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 扶桑化学工業 | 5 | 6 | 29,011 |
| トリケミカル研究所 | 8 | 7 | 29,988 |
| A D E K A | 22 | 20 | 60,537 |
| 日油 | 19 | 17 | 124,655 |
| 新日本理化 | 5 | 5 | 1,197 |
| ハリマ化成グループ | 5 | 7 | 6,657 |
| 花王 | 155 | 134 | 757,586 |
| 第一工業製薬 | 2 | 3 | 10,106 |
| 石原ケミカル | 3 | 3 | 5,742 |
| 日華化学 | 5 | - | - |
| 三洋化成工業 | 3 | 3 | 15,410 |
| 有機合成薬品工業 | 15 | - | - |
| 大日本塗料 | 7 | 6 | 7,180 |
| 日本ペイントホールディングス | 282 | 315 | 353,924 |
| 関西ペイント | 58 | 58 | 134,936 |
| 中国塗料 | 11 | 12 | 25,498 |
| 藤倉化成 | 11 | 14 | 6,384 |
| 太陽ホールディングス | 9 | 10 | 32,393 |
| D I C | 24 | 23 | 68,440 |
| サカタインクス | 14 | 13 | 18,229 |
| a r t i e n c e | 12 | 12 | 38,700 |
| T & K T O K A | 5 | 5 | 8,031 |
| 富士フィルムホールディングス | 122 | 110 | 1,033,180 |
| 資生堂 | 133 | 124 | 515,181 |
| ライオン | 76 | 77 | 102,696 |
| 高砂香料工業 | 4 | 4 | 15,615 |
| マンダム | 13 | 12 | 16,960 |
| ミルボン | 9 | 8 | 27,685 |
| ファンケル | 27 | 26 | 55,770 |
| コーセー | 13 | 12 | 103,733 |
| コタ | 5 | 5 | 8,745 |
| シーボン | 2 | - | - |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 32 | 30 | 44,606 |
| ノエビアホールディングス | 5 | 5 | 27,719 |
| アジュバンホールディングス | 5 | - | - |
| 新日本製薬 | 3 | 3 | 6,256 |
| エステー | 4 | 4 | 7,185 |
| アグロ カネショウ | 2 | 4 | 5,814 |
| コニシ | 10 | 17 | 23,873 |
| 長谷川香料 | 13 | 11 | 36,309 |
| 星光PMC | 8 | - | - |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 小林製薬 | 18 | 17 | 105,547 |
| 荒川化学工業 | 5 | 5 | 6,478 |
| メック | 5 | 4 | 20,653 |
| 日本高純度化学 | 2 | 2 | 6,592 |
| タカラバイオ | 17 | 16 | 17,376 |
| J C U | 7 | 6 | 27,291 |
| 新田ゼラチン | 0.500 | 0.500 | 337 |
| O A T アグリオ | 2 | 3 | 5,440 |
| デクセリアルズ | 18 | 14 | 87,165 |
| アース製薬 | 5 | 5 | 22,815 |
| 北興化学工業 | 6 | 6 | 6,490 |
| 大成ラミック | 2 | 2 | 6,447 |
| クミアイ化学工業 | 25 | 23 | 19,564 |
| 日本農薬 | 11 | 10 | 7,706 |
| アキレス | 4 | 4 | 5,912 |
| 有沢製作所 | 10 | 10 | 12,053 |
| 日東電工 | 46 | 38 | 529,070 |
| レック | 9 | 7 | 8,291 |
| きもと | 5 | 4 | 832 |
| 藤森工業 | 5 | 4 | 18,306 |
| 前澤化成工業 | 4 | 4 | 6,352 |
| 未来工業 | 3 | 2 | 10,962 |
| J S P | 4 | 4 | 9,193 |
| エフピコ | 12 | 11 | 31,757 |
| 天馬 | 5 | 4 | 10,320 |
| 信越ポリマー | 11 | 12 | 20,416 |
| 東リ | 20 | - | - |
| ニフコ | 23 | 17 | 66,429 |
| バルカー | 5 | 5 | 22,525 |
| ユニ・チャーム | 133 | 123 | 640,810 |
| 医薬品(4.6%) | | | |
| 協和キリン | 77 | 71 | 207,825 |
| 武田薬品工業 | 565 | 526 | 2,353,166 |
| アステラス製薬 | 612 | 521 | 878,896 |
| 住友ファーマ | 47 | 44 | 16,221 |
| 塩野義製薬 | 81 | 75 | 535,800 |
| わかもと製薬 | 5 | 3 | 657 |
| 日本新薬 | 15 | 15 | 77,220 |
| 中外製薬 | 199 | 186 | 1,087,196 |
| 科研製薬 | 10 | 10 | 36,556 |
| エーザイ | 77 | 72 | 453,176 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|----------------------|---------|-----|-----------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| ロート製薬 | 61 | 57 | 169,516 | |
| 小野薬品工業 | 123 | 126 | 310,136 | |
| 久光製薬 | 14 | 13 | 53,196 | |
| 持田製薬 | 7 | 6 | 21,692 | |
| 参天製薬 | 120 | 108 | 165,255 | |
| 扶桑薬品工業 | 2 | 2 | 6,397 | |
| ツムラ | 20 | 18 | 51,649 | |
| キッセイ薬品工業 | 9 | 9 | 32,438 | |
| 生化学工業 | 12 | 10 | 7,655 | |
| 栄研化学 | 10 | 10 | 20,426 | |
| 鳥居薬品 | 3 | 3 | 12,928 | |
| JCRファーマ | 21 | 20 | 18,632 | |
| 東和薬品 | 9 | 9 | 27,300 | |
| 富士製薬工業 | 4 | 4 | 7,792 | |
| ゼリア新薬工業 | 8 | 8 | 17,859 | |
| そーせいグループ | - | 19 | 28,060 | |
| 第一三共 | 556 | 518 | 2,550,632 | |
| 杏林製薬 | 13 | 12 | 23,013 | |
| 大幸薬品 | 12 | - | - | |
| ダイト | 4 | 4 | 9,167 | |
| 大塚ホールディングス | 146 | 123 | 687,648 | |
| 大正製薬ホールディングス | 14 | 13 | 113,440 | |
| ペプチドリーム | 31 | 28 | 46,483 | |
| セルソース | - | 3 | 5,062 | |
| あすか製薬ホールディングス | 6 | 6 | 12,511 | |
| サワイグループホールディングス | 14 | 13 | 81,681 | |
| 石油・石炭製品(0.5%) | | | | |
| 日本コークス工業 | 57 | 60 | 7,066 | |
| ニチレキ | 7 | 7 | 18,751 | |
| ユシロ化学工業 | 6 | 3 | 7,272 | |
| 富士石油 | 18 | 17 | 5,863 | |
| MORESCO | 0.800 | - | - | |
| 出光興産 | 70 | 330 | 306,029 | |
| ENEOSホールディングス | 1,154 | 941 | 608,520 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 25 | 17 | 115,899 | |
| ゴム製品(0.7%) | | | | |
| 横浜ゴム | 36 | 30 | 120,460 | |
| TOYO TIRE | 36 | 34 | 98,872 | |
| ブリヂストン | 204 | 174 | 1,096,830 | |
| 住友ゴム工業 | 62 | 58 | 102,724 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-------|---------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 藤倉コンポジット | 2 | 4 | 6,573 | |
| オカモト | 3 | 2 | 13,594 | |
| フコク | 4 | 3 | 5,022 | |
| ニッタ | 6 | 6 | 22,290 | |
| 住友理工 | 12 | 9 | 10,083 | |
| 三ツ星ベルト | 9 | 7 | 35,424 | |
| バンドー化学 | 10 | 8 | 15,180 | |
| ガラス・土石製品(0.7%) | | | | |
| 日東紡績 | 7 | 7 | 40,500 | |
| AGC | 65 | 53 | 287,472 | |
| 日本板硝子 | 32 | 28 | 15,307 | |
| 日本電気硝子 | 26 | 24 | 86,799 | |
| オハラ | 4 | 5 | 6,355 | |
| 住友大阪セメント | 9 | 9 | 35,630 | |
| 太平洋セメント | 40 | 35 | 112,464 | |
| 日本ヒューム | 7 | 7 | 6,262 | |
| 日本コンクリート工業 | 21 | 13 | 6,310 | |
| 三谷セキサン | 2 | 2 | 14,600 | |
| アジアパイルホールディングス | 10 | 8 | 6,636 | |
| 東海カーボン | 53 | 54 | 56,052 | |
| 日本カーボン | 3 | 3 | 16,802 | |
| 東洋炭素 | 4 | 4 | 30,114 | |
| ノリタケカンパニーリミテド | 3 | 3 | 26,499 | |
| TOTO | 42 | 39 | 146,137 | |
| 日本碍子 | 75 | 69 | 131,860 | |
| 日本特殊陶業 | 48 | 49 | 214,936 | |
| MARUWA | 2 | 2 | 67,980 | |
| 品川リフラクトリーズ | 1 | 7 | 14,935 | |
| 黒崎播磨 | 1 | 1 | 16,584 | |
| ヨータイ | 4 | 4 | 6,384 | |
| ニッカトー | 5 | 1 | 1,105 | |
| フジインコーポレーテッド | 5 | 16 | 53,120 | |
| クニミネ工業 | 0.900 | 0.900 | 910 | |
| ニチアス | 16 | 15 | 56,625 | |
| ニチハ | 8 | 7 | 25,567 | |
| 鉄鋼(1.0%) | | | | |
| 日本製鉄 | 294 | 273 | 988,779 | |
| 神戸製鋼所 | 132 | 123 | 251,965 | |
| 中山製鋼所 | 13 | 14 | 12,964 | |
| 合同製鐵 | 3 | 3 | 20,128 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|---------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| J F Eホールディングス | 175 | 170 | 399,905 | |
| 東京製鐵 | 18 | 17 | 29,068 | |
| 共英製鋼 | 7 | 7 | 16,037 | |
| 大和工業 | 10 | 11 | 97,520 | |
| 東京鐵鋼 | 3 | 2 | 14,202 | |
| 大阪製鐵 | 4 | 2 | 6,636 | |
| 淀川製鋼所 | 7 | 7 | 29,925 | |
| 中部鋼鉄 | - | 4 | 10,036 | |
| 丸一鋼管 | 20 | 18 | 75,255 | |
| 大同特殊鋼 | 8 | 38 | 68,838 | |
| 日本高周波鋼業 | 15 | - | - | |
| 日本冶金工業 | 4 | 4 | 20,835 | |
| 山陽特殊製鋼 | 6 | 6 | 13,560 | |
| 愛知製鋼 | 3 | 3 | 12,355 | |
| 大太平洋金属 | 4 | 5 | 7,316 | |
| 新日本電工 | 42 | 30 | 9,211 | |
| 栗本鐵工所 | 3 | 2 | 9,352 | |
| 三菱製鋼 | 4 | 4 | 6,498 | |
| 日亜鋼業 | 18 | 10 | 3,515 | |
| 日本精線 | 1 | 1 | 6,960 | |
| エンビプロ・ホールディングス | 0.300 | 10 | 5,019 | |
| シンニッタン | 14 | 14 | 3,946 | |
| 非鉄金属(0.7%) | | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 9 | 7 | 9,509 | |
| 日本軽金属ホールディングス | 17 | 17 | 30,758 | |
| 三井金属鉱業 | 19 | 17 | 78,729 | |
| 東邦亜鉛 | 3 | 5 | 5,929 | |
| 三菱マテリアル | 43 | 43 | 114,450 | |
| 住友金属鉱山 | 76 | 70 | 294,447 | |
| DOWAホールディングス | 14 | 15 | 84,469 | |
| 古河機械金属 | 9 | 8 | 14,199 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 9 | 10 | 28,662 | |
| 東邦チタニウム | 11 | 12 | 22,037 | |
| U A C J | 9 | 8 | 35,862 | |
| C K サンエツ | 1 | 1 | 6,621 | |
| 古河電気工業 | 21 | 20 | 57,568 | |
| 住友電気工業 | 226 | 228 | 491,576 | |
| フジクラ | 70 | 72 | 125,989 | |
| S W C C | 7 | 6 | 22,576 | |
| タツタ電線 | 13 | 10 | 7,575 | |
| 平河ヒューテック | 4 | 4 | 6,062 | |
| リヨービ | 7 | 6 | 16,646 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-------|---------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| アーレスティ | 7 | - | - | |
| A R Eホールディングス | 26 | 23 | 45,126 | |
| 金属製品(0.5%) | | | | |
| 稲葉製作所 | 3 | 4 | 6,346 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 1 | 3 | 12,338 | |
| トーカロ | 18 | 17 | 29,339 | |
| アルファ | 4 | - | - | |
| S U M C O | 125 | 108 | 244,194 | |
| 川田テクノロジーズ | 1 | 1 | 12,572 | |
| R S Technologies | 4 | 4 | 10,869 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 43 | 35 | 86,626 | |
| ホッカンホールディングス | 3 | 1 | 2,390 | |
| コロナ | 5 | 6 | 6,428 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 8 | 9 | 26,294 | |
| 三和ホールディングス | 60 | 61 | 159,100 | |
| 文化シャッター | 18 | 16 | 25,360 | |
| 三協立山 | 9 | 7 | 6,860 | |
| アルインコ | 5 | 6 | 6,300 | |
| L I X I L | 95 | 95 | 187,036 | |
| 日本フィルコン | 9 | 0.100 | 54 | |
| ノーリツ | 9 | 10 | 16,665 | |
| 長府製作所 | 6 | 6 | 12,785 | |
| リンナイ | 11 | 29 | 103,546 | |
| ダイニチ工業 | 7 | - | - | |
| 日東精工 | 9 | 11 | 6,786 | |
| 三洋工業 | 2 | - | - | |
| 岡部 | 10 | 10 | 8,785 | |
| ジーテクト | 7 | 7 | 15,678 | |
| 東プレ | 11 | 10 | 25,164 | |
| 高周波熱錬 | 10 | 9 | 10,105 | |
| 東京製鋼 | 5 | 4 | 7,256 | |
| サンコール | 2 | 13 | 6,264 | |
| モリテックスチール | 7 | 0.100 | 26 | |
| パイオラックス | 9 | 7 | 20,580 | |
| エイチワン | 7 | 7 | 5,297 | |
| 日本発条 | 58 | 54 | 78,363 | |
| 中央発条 | 4 | 8 | 6,450 | |
| 三益半導体工業 | 5 | 5 | 17,160 | |
| 機械(5.4%) | | | | |
| 日本製鋼所 | 17 | 16 | 41,844 | |
| 三浦工業 | 26 | 25 | 73,475 | |
| タクマ | 19 | 20 | 38,117 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ツガミ | 14 | 13 | 15,348 |
| オークマ | 6 | 5 | 37,398 |
| 芝浦機械 | 6 | 6 | 20,730 |
| アマダ | 102 | 95 | 155,712 |
| アイダエンジニアリング | 13 | 13 | 11,648 |
| TAKISAWA | 4 | - | - |
| FUJI | 28 | 28 | 74,039 |
| 牧野フライス製作所 | 7 | 6 | 38,874 |
| オーエスジー | 30 | 26 | 56,403 |
| ダイジェット工業 | 5 | - | - |
| 旭ダイヤモンド工業 | 18 | 13 | 12,019 |
| DMG森精機 | 39 | 36 | 121,641 |
| ソディック | 17 | 14 | 10,599 |
| ディスコ | 10 | 28 | 1,270,080 |
| 日東工器 | 3 | 3 | 6,385 |
| 日進工具 | 5 | 6 | 6,130 |
| パンチ工業 | 10 | 0.200 | 85 |
| リケンNPR | - | 6 | 18,609 |
| 東洋機械金属 | 7 | - | - |
| エンシュウ | 5 | - | - |
| 島精機製作所 | 10 | 9 | 13,328 |
| オプトラン | 9 | 9 | 18,081 |
| NCホールディングス | 2 | - | - |
| イワキ | 4 | 4 | 9,528 |
| フリュー | 6 | 5 | 6,944 |
| ヤマシンフィルタ | 15 | 18 | 6,730 |
| 日阪製作所 | 6 | 6 | 6,396 |
| やまびこ | 10 | 9 | 17,669 |
| 野村マイクロ・サイエンス | 2 | 2 | 29,020 |
| 平田機工 | 3 | 2 | 22,040 |
| PEGASUS | 7 | 14 | 6,471 |
| マルマエ | 3 | 3 | 6,354 |
| タツモ | 3 | 3 | 13,626 |
| ナブテスコ | 40 | 37 | 93,097 |
| 三井海洋開発 | 8 | 7 | 22,298 |
| レオン自動機 | 6 | 6 | 9,853 |
| SMC | 20 | 17 | 1,554,794 |
| ホソカワミクロン | 4 | 3 | 16,112 |
| ユニオンツール | 2 | 2 | 10,309 |
| 瑞光 | - | 4 | 7,576 |
| オイレス工業 | 9 | 8 | 16,621 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 3 | 2 | 10,572 |
| サトーホールディングス | 9 | 8 | 19,227 |
| 技研製作所 | 6 | 5 | 11,597 |
| 日本エアーテック | 4 | 5 | 5,890 |
| カワタ | 4 | - | - |
| 日精樹脂工業 | 5 | 5 | 6,384 |
| ワイエイシイホールディングス | - | 2 | 6,047 |
| 小松製作所 | 301 | 280 | 1,212,904 |
| 住友重機械工業 | 38 | 35 | 161,176 |
| 日立建機 | 25 | 23 | 100,650 |
| 日工 | 9 | 8 | 6,861 |
| 巴工業 | 2 | 2 | 8,728 |
| 井関農機 | 6 | 5 | 5,650 |
| TOWA | 6 | 6 | 52,059 |
| 北川鉄工所 | 4 | 4 | 6,420 |
| ローツェ | 3 | 3 | 62,806 |
| タカキタ | 9 | - | - |
| クボタ | 340 | 313 | 695,173 |
| 荏原実業 | 3 | 3 | 9,984 |
| 三菱化工機 | 2 | 2 | 7,885 |
| 月島ホールディングス | 8 | 8 | 10,692 |
| 帝国電機製作所 | 4 | 4 | 11,537 |
| 新東工業 | 13 | 12 | 14,157 |
| 澁谷工業 | 6 | 5 | 17,416 |
| アイチコーポレーション | 9 | 8 | 9,121 |
| 小森コーポレーション | 14 | 14 | 19,021 |
| 鶴見製作所 | 4 | 4 | 15,479 |
| 酒井重工業 | - | 0.900 | 5,796 |
| 荏原製作所 | 26 | 24 | 277,242 |
| 石井鐵工所 | 1 | - | - |
| 西島製作所 | 5 | 5 | 13,140 |
| 北越工業 | 6 | 6 | 14,730 |
| ダイキン工業 | 76 | 71 | 1,533,675 |
| オルガノ | 8 | 7 | 49,680 |
| トーヨーカネツ | 2 | 2 | 8,950 |
| 栗田工業 | 36 | 33 | 197,047 |
| 椿本チエイン | 9 | 8 | 39,992 |
| 大同工業 | 3 | - | - |
| 木村化工機 | 6 | 8 | 6,194 |
| アネスト岩田 | 10 | 9 | 12,396 |
| ダイフク | 33 | 101 | 341,414 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| サムコ | 2 | 1 | 7,992 |
| 加藤製作所 | 6 | - | - |
| タダノ | 33 | 34 | 45,816 |
| フジテック | 23 | 14 | 51,702 |
| CKD | 17 | 16 | 46,297 |
| 平和 | 21 | 17 | 37,028 |
| 理想科学工業 | 5 | 4 | 15,504 |
| SANKYO | 12 | 13 | 122,875 |
| 日本金銭機械 | 7 | 7 | 10,245 |
| マースグループホールディングス | 3 | 3 | 8,595 |
| フクシマガリレイ | 4 | 3 | 22,581 |
| ダイコク電機 | 3 | 2 | 12,325 |
| 竹内製作所 | 11 | 10 | 56,026 |
| アマノ | 18 | 17 | 63,563 |
| JUKI | 10 | 14 | 7,128 |
| ジャノメ | 8 | 9 | 6,251 |
| マックス | 7 | 8 | 26,334 |
| グローリー | 16 | 14 | 42,055 |
| 新晃工業 | 6 | 6 | 18,870 |
| 大和冷機工業 | 9 | 9 | 13,671 |
| セガサミーホールディングス | 51 | 53 | 96,353 |
| リケン | 2 | - | - |
| TPR | 7 | 7 | 16,058 |
| ツバキ・ナカシマ | 15 | 12 | 9,360 |
| ホシザキ | 41 | 35 | 187,548 |
| 大豊工業 | 7 | 7 | 6,240 |
| 日本精工 | 118 | 110 | 89,451 |
| NTN | 126 | 129 | 38,294 |
| ジェイテクト | 57 | 53 | 73,074 |
| 不二越 | 4 | 4 | 14,894 |
| 日本トムソン | 15 | 16 | 10,024 |
| THK | 37 | 34 | 110,193 |
| ユーシン精機 | 7 | 9 | 6,420 |
| 前澤給装工業 | 5 | 4 | 6,325 |
| イーグル工業 | 7 | 6 | 11,741 |
| 日本ピラー工業 | 6 | 5 | 30,576 |
| キッツ | 23 | 20 | 26,420 |
| マキタ | 80 | 68 | 264,867 |
| 三井E&S | 29 | 29 | 34,303 |
| 日立造船 | 52 | 52 | 57,129 |
| 三菱重工業 | 112 | 104 | 1,201,956 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| IHI | 40 | 44 | 140,311 |
| スター精密 | 12 | 11 | 18,715 |
| 電気機器(17.5%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | 52 | 45 | 56,182 |
| イビデン | 36 | 31 | 229,320 |
| コニカミノルタ | 143 | 133 | 62,945 |
| ブラザー工業 | 85 | 80 | 198,320 |
| ミネベアミツミ | 111 | 104 | 316,142 |
| 日立製作所 | 322 | 287 | 3,529,867 |
| 東芝 | 123 | - | - |
| 三菱電機 | 664 | 666 | 1,540,948 |
| 富士電機 | 39 | 36 | 323,778 |
| 東洋電機製造 | 5 | - | - |
| 安川電機 | 76 | 65 | 365,040 |
| シンフォニア テクノロジー | 7 | 6 | 16,929 |
| 明電舎 | 9 | 11 | 29,659 |
| オリジン | 1 | 1 | 1,948 |
| 山洋電気 | 2 | 2 | 15,938 |
| デンヨー | 4 | 4 | 10,662 |
| PHCホールディングス | 8 | 11 | 14,515 |
| KOKUSAI ELECTRIC | - | 23 | 107,415 |
| ソシオネクスト | 6 | 43 | 165,778 |
| 東芝テック | 9 | 7 | 23,677 |
| 芝浦メカトロニクス | 1 | 3 | 22,440 |
| マブチモーター | 16 | 29 | 80,423 |
| ニデック | 156 | 132 | 765,702 |
| トレックス・セミコンダクター | 3 | 3 | 6,566 |
| 東光高岳 | 3 | 3 | 8,604 |
| ダブル・スコープ | 21 | 17 | 13,235 |
| ダイヘン | 5 | 6 | 42,900 |
| ヤーマン | 12 | 11 | 11,727 |
| JVCケンウッド | 58 | 47 | 33,441 |
| IPEX | 4 | 4 | 7,728 |
| 日新電機 | 15 | - | - |
| 大崎電気工業 | 15 | 13 | 8,868 |
| オムロン | 58 | 45 | 261,449 |
| 日東工業 | 8 | 8 | 34,546 |
| IDEC | 9 | 8 | 25,247 |
| 不二電機工業 | 4 | 0.300 | 343 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 21 | 23 | 63,472 |
| サクサホールディングス | 3 | - | - |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| メルコホールディングス | 1 | 1 | 6,108 |
| テクノメディア | 2 | 3 | 5,676 |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディングス | - | 9 | 6,224 |
| 日本電気 | 91 | 78 | 766,664 |
| 富士通 | 64 | 55 | 1,272,534 |
| 沖電気工業 | 29 | 27 | 29,566 |
| 岩崎通信機 | 6 | - | - |
| 電気興業 | 2 | 2 | 5,691 |
| サンケン電気 | 6 | 5 | 43,568 |
| アイホン | 3 | 3 | 9,036 |
| ルネサスエレクトロニクス | 419 | 390 | 958,437 |
| セイコーエプソン | 85 | 76 | 187,238 |
| ワコム | 50 | 45 | 29,848 |
| アルバック | 15 | 13 | 114,048 |
| E I Z O | 4 | 4 | 22,264 |
| ジャパンディスプレイ | 247 | - | - |
| 日本信号 | 14 | 13 | 13,232 |
| 京三製作所 | 13 | 13 | 6,302 |
| 能美防災 | 8 | 8 | 18,103 |
| ホーチキ | 4 | 4 | 10,120 |
| 星和電機 | 10 | - | - |
| エレコム | 15 | 14 | 23,208 |
| パナソニック ホールディングス | 759 | 707 | 1,007,691 |
| シャープ | 77 | 100 | 83,262 |
| アンリツ | 45 | 42 | 49,289 |
| 富士通ゼネラル | 18 | 17 | 33,906 |
| ソニーグループ | 450 | 419 | 5,584,311 |
| T D K | 101 | 94 | 739,060 |
| 帝国通信工業 | 3 | 3 | 5,886 |
| タムラ製作所 | 27 | 23 | 13,551 |
| アルプスアルパイン | 57 | 53 | 56,255 |
| 池上通信機 | 8 | - | - |
| 日本電波工業 | 7 | 7 | 9,820 |
| 鈴木 | - | 5 | 6,269 |
| メイコー | 7 | 5 | 26,904 |
| ローランド ディー. ジー. | 3 | 3 | 16,566 |
| フォスター電機 | 6 | 5 | 6,310 |
| S M K | 2 | 2 | 6,092 |
| ヨコオ | 5 | 5 | 8,379 |
| ホシデン | 15 | 13 | 27,009 |
| ヒロセ電機 | 10 | 8 | 141,592 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本航空電子工業 | 13 | 14 | 38,338 |
| T O A | 7 | 6 | 7,677 |
| マクセル | 14 | 13 | 20,922 |
| 古野電気 | 8 | 7 | 16,793 |
| スミダコーポレーション | 5 | 8 | 9,624 |
| アイコム | 2 | 2 | 8,004 |
| リオン | 2 | 2 | 7,020 |
| 横河電機 | 70 | 65 | 198,923 |
| 新元元工業 | 2 | 2 | 7,095 |
| アズビル | 44 | 40 | 186,619 |
| 東亜ディーケーケー | 5 | - | - |
| 日本光電工業 | 29 | 25 | 105,384 |
| チノー | - | 2 | 6,282 |
| 共和電業 | 11 | 4 | 1,785 |
| 日本電子材料 | 4 | 3 | 7,156 |
| 堀場製作所 | 14 | 11 | 157,578 |
| アドバンテスト | 50 | 169 | 1,142,917 |
| 小野測器 | 11 | - | - |
| エスベック | 5 | 4 | 12,779 |
| キーエンス | 63 | 59 | 4,094,072 |
| 日置電機 | 3 | 2 | 19,320 |
| シスメックス | 54 | 51 | 409,036 |
| 日本マイクロニクス | 10 | 10 | 63,494 |
| メガチップス | 5 | 4 | 19,951 |
| O B A R A G R O U P | 3 | 3 | 11,904 |
| 澤藤電機 | 3 | 3 | 4,286 |
| 原田工業 | 5 | 4 | 3,420 |
| コーセル | 8 | 6 | 9,607 |
| イリソ電子工業 | 5 | 5 | 17,270 |
| オプテックスグループ | 11 | 10 | 20,023 |
| 千代田インテグレ | 2 | 2 | 6,088 |
| レーザーテック | 31 | 27 | 1,081,744 |
| スタンレー電気 | 45 | 38 | 97,755 |
| 岩崎電気 | 2 | - | - |
| ウシオ電機 | 33 | 30 | 60,967 |
| 岡谷電機産業 | 0.100 | 0.100 | 27 |
| 日本セラミック | 6 | 4 | 12,451 |
| 遠藤照明 | 6 | - | - |
| 古河電池 | 4 | 7 | 6,741 |
| 山一電機 | 5 | 5 | 11,665 |
| 図研 | 5 | 5 | 22,828 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本電子 | 16 | 14 | 96,164 |
| カシオ計算機 | 47 | 42 | 51,039 |
| ファナック | 62 | 289 | 1,219,423 |
| 日本シイエムケイ | 13 | 12 | 7,648 |
| エンプラス | 1 | 1 | 14,841 |
| 大真空 | 7 | 8 | 7,761 |
| ローム | 29 | 109 | 289,946 |
| 浜松ホトニクス | 51 | 47 | 257,040 |
| 三井ハイテック | 6 | 5 | 41,813 |
| 新光電気工業 | 22 | 21 | 115,500 |
| 京セラ | 98 | 368 | 816,190 |
| 太陽誘電 | 31 | 28 | 97,942 |
| 村田製作所 | 193 | 539 | 1,595,275 |
| 双葉電子工業 | 12 | 12 | 6,435 |
| 北陸電気工業 | 3 | 2 | 3,908 |
| ニチコン | 13 | 15 | 19,141 |
| 日本ケミコン | 6 | 6 | 8,511 |
| KOA | 9 | 9 | 13,599 |
| 市光工業 | - | 10 | 5,798 |
| 小糸製作所 | 76 | 61 | 121,050 |
| ミツバ | 11 | 11 | 14,807 |
| SCREENホールディングス | 10 | 20 | 374,535 |
| キャノン電子 | 7 | 6 | 14,823 |
| キャノン | 349 | 295 | 1,243,714 |
| リコー | 159 | 148 | 189,167 |
| 象印マホービン | 19 | 16 | 23,151 |
| MUTOHホールディングス | 2 | 1 | 4,132 |
| 東京エレクトロン | 44 | 125 | 4,348,575 |
| イノテック | 4 | 3 | 7,452 |
| 輸送用機器(9.1%) | | | |
| トヨタ紡織 | 26 | 25 | 60,700 |
| 芦森工業 | 4 | 1 | 4,973 |
| ユニプレス | 11 | 10 | 11,278 |
| 豊田自動織機 | 46 | 50 | 739,519 |
| モリタホールディングス | 11 | 10 | 16,972 |
| 三櫻工業 | 9 | 9 | 9,564 |
| デンソー | 131 | 489 | 1,322,770 |
| 東海理化電機製作所 | 18 | 16 | 39,245 |
| 川崎重工業 | 48 | 48 | 188,179 |
| 名村造船所 | 16 | 14 | 26,684 |
| 日本車輛製造 | 2 | 2 | 6,696 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-------|------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三菱ロジスネクスト | 10 | 9 | 13,927 |
| 日産自動車 | 904 | 800 | 453,016 |
| いすゞ自動車 | 185 | 172 | 371,263 |
| トヨタ自動車 | 3,497 | 3,255 | 11,113,935 |
| 日野自動車 | 82 | 89 | 42,200 |
| 三菱自動車工業 | 248 | 231 | 104,478 |
| エフテック | 1 | 1 | 987 |
| 武蔵精密工業 | 15 | 14 | 23,519 |
| 日産車体 | 11 | 6 | 6,220 |
| 新明和工業 | 20 | 17 | 20,366 |
| 極東開発工業 | 11 | 9 | 23,235 |
| トピー工業 | 5 | 4 | 14,054 |
| ティラド | 1 | 1 | 6,545 |
| 曙ブレーキ工業 | 38 | - | - |
| タチエス | 10 | 10 | 21,952 |
| NOK | 24 | 23 | 48,024 |
| フタバ産業 | 17 | 15 | 16,424 |
| カヤバ | 6 | 5 | 28,015 |
| 大同メタル工業 | 12 | 11 | 6,414 |
| プレス工業 | 28 | 23 | 15,499 |
| ミクニ | 13 | 3 | 1,666 |
| 太平洋工業 | 14 | 13 | 19,801 |
| アイシン | 49 | 45 | 249,384 |
| マツダ | 210 | 196 | 339,645 |
| 今仙電機製作所 | 2 | 2 | 1,672 |
| 本田技研工業 | 517 | 1,445 | 2,527,258 |
| スズキ | 117 | 108 | 716,453 |
| SUBARU | 201 | 183 | 617,720 |
| ヤマハ発動機 | 100 | 256 | 354,196 |
| エクセディ | 10 | 9 | 27,965 |
| 豊田合成 | 18 | 17 | 50,260 |
| 愛三工業 | 10 | 9 | 14,278 |
| 盟和産業 | 4 | 1 | 1,333 |
| ヨロズ | 7 | 6 | 6,358 |
| エフ・シー・シー | 11 | 10 | 22,218 |
| シマノ | 26 | 23 | 483,855 |
| テイ・エス テック | 29 | 21 | 41,387 |
| ジャムコ | 3 | 4 | 5,472 |
| 精密機器(2.3%) | | | |
| テルモ | 199 | 165 | 929,806 |
| 日機装 | 15 | 13 | 16,325 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本エム・ディ・エム | 5 | 8 | 5,826 |
| 島津製作所 | 77 | 78 | 302,986 |
| JMS | 9 | 12 | 6,168 |
| 長野計器 | 4 | 4 | 9,520 |
| ブイ・テクノロジー | 3 | 3 | 8,258 |
| 東京計器 | 4 | 4 | 10,237 |
| 愛知時計電機 | 3 | 2 | 6,669 |
| インターアクション | 3 | 4 | 4,867 |
| オーバル | 6 | - | - |
| 東京精密 | 14 | 12 | 116,535 |
| マニー | 28 | 23 | 49,059 |
| ニコン | 99 | 85 | 131,121 |
| トプコン | 33 | 28 | 51,019 |
| オリンパス | 398 | 364 | 791,833 |
| 理研計器 | 4 | 4 | 32,886 |
| タムロン | 4 | 3 | 22,644 |
| HOYA | 136 | 116 | 2,158,366 |
| シード | 2 | - | - |
| ノーリツ鋼機 | 6 | 5 | 17,024 |
| A&Dホロンホールディングス | 9 | 8 | 18,103 |
| 朝日インテック | 84 | 72 | 207,356 |
| シチズン時計 | 70 | 54 | 58,206 |
| リズム | 1 | - | - |
| メニコン | 21 | 20 | 35,628 |
| 松風 | 2 | 2 | 7,238 |
| セイコーグループ | 9 | 8 | 25,564 |
| ニプロ | 53 | 49 | 62,985 |
| その他製品(2.3%) | | | |
| KYORITSU | 25 | - | - |
| スノーピーク | 10 | 8 | 9,673 |
| パラマウントベッドホールディングス | 14 | 12 | 30,553 |
| トランザクション | 4 | 3 | 9,941 |
| 粧美堂 | 2 | - | - |
| ニホンフラッシュ | 6 | 6 | 6,500 |
| 前田工織 | 6 | 5 | 16,800 |
| 永大産業 | 18 | - | - |
| アートネイチャー | 6 | 7 | 6,233 |
| フルヤ金属 | - | 1 | 13,776 |
| パンダイナムコホールディングス | 58 | 162 | 474,045 |
| アイフィスジャパン | 7 | - | - |
| SHOEI | 6 | 13 | 28,113 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フランスベッドホールディングス | 7 | 7 | 10,048 |
| パイロットコーポレーション | 10 | 8 | 32,287 |
| 萩原工業 | 4 | - | - |
| フジシールインターナショナル | 12 | 12 | 24,300 |
| タカラトミー | 29 | 27 | 62,842 |
| 広済堂ホールディングス | 4 | 15 | 10,235 |
| プロネクサス | 5 | 6 | 7,448 |
| 大建工業 | 3 | - | - |
| TOPPANホールディングス | 83 | 72 | 256,024 |
| 大日本印刷 | 75 | 64 | 291,405 |
| 共同印刷 | 1 | 1 | 5,994 |
| NISSHA | 12 | 10 | 15,220 |
| TAKARA & COMPANY | 4 | 3 | 9,842 |
| アシックス | 58 | 50 | 295,374 |
| ツツミ | 2 | 3 | 6,288 |
| ローランド | 4 | 4 | 21,582 |
| 小松ウオール工業 | 2 | 2 | 8,016 |
| ヤマハ | 40 | 37 | 120,428 |
| 河合楽器製作所 | 1 | 1 | 6,102 |
| クリナップ | - | 7 | 5,306 |
| ピジョン | 40 | 37 | 60,309 |
| 兼松サステック | 0,400 | - | - |
| キングジム | 5 | 7 | 6,424 |
| リンテック | 12 | 11 | 35,938 |
| イトーキ | 13 | 12 | 24,151 |
| 任天堂 | 402 | 374 | 3,092,840 |
| 三菱鉛筆 | 9 | 8 | 20,487 |
| タカラスタンダード | 12 | 12 | 23,087 |
| コクヨ | 30 | 24 | 60,130 |
| ナカバヤシ | 9 | 11 | 6,236 |
| グローブライド | 5 | 5 | 10,743 |
| オカムラ | 19 | 17 | 38,928 |
| 美津濃 | 6 | 5 | 30,975 |
| 電気・ガス業(1.3%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 574 | 534 | 424,848 |
| 中部電力 | 234 | 218 | 418,646 |
| 関西電力 | 245 | 228 | 446,126 |
| 中国電力 | 101 | 103 | 101,928 |
| 北陸電力 | 60 | 60 | 43,662 |
| 東北電力 | 155 | 156 | 154,367 |
| 四国電力 | 54 | 55 | 57,463 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 九州電力 | 146 | 136 | 154,197 |
| 北海道電力 | 61 | 57 | 36,408 |
| 沖縄電力 | 14 | 15 | 16,519 |
| 電源開発 | 48 | 48 | 120,240 |
| エフオン | 4 | 14 | 5,795 |
| イーレックス | 11 | 10 | 7,875 |
| レノバ | 16 | 15 | 19,544 |
| 東京瓦斯 | 134 | 125 | 407,099 |
| 大阪瓦斯 | 129 | 120 | 370,988 |
| 東邦瓦斯 | 25 | 25 | 76,483 |
| 北海道瓦斯 | 3 | 3 | 7,959 |
| 広島ガス | 14 | 1 | 693 |
| 西部ガスホールディングス | 6 | 6 | 11,687 |
| 静岡ガス | 14 | 11 | 10,714 |
| メタウォーター | 8 | 7 | 15,698 |
| 陸運業(2.6%) | | | |
| SBSホールディングス | 5 | 5 | 12,757 |
| 東武鉄道 | 70 | 65 | 251,937 |
| 相鉄ホールディングス | 21 | 21 | 57,727 |
| 東急 | 178 | 166 | 294,849 |
| 京浜急行電鉄 | 72 | 73 | 95,713 |
| 小田急電鉄 | 96 | 98 | 206,486 |
| 京王電鉄 | 33 | 28 | 119,928 |
| 京成電鉄 | 41 | 38 | 284,666 |
| 富士急行 | 7 | 7 | 28,324 |
| 東日本旅客鉄道 | 108 | 108 | 974,546 |
| 西日本旅客鉄道 | 81 | 70 | 436,914 |
| 東海旅客鉄道 | 49 | 228 | 857,413 |
| 西武ホールディングス | 77 | 71 | 154,979 |
| 鴻池運輸 | 10 | 10 | 18,200 |
| 西日本鉄道 | 17 | 15 | 37,983 |
| ハマキョウレックス | 5 | 5 | 19,864 |
| サカイ引越センター | 3 | 6 | 17,047 |
| 近鉄グループホールディングス | 63 | 59 | 266,400 |
| 阪急阪神ホールディングス | 84 | 78 | 339,743 |
| 南海電気鉄道 | 30 | 26 | 77,035 |
| 京阪ホールディングス | 26 | 32 | 113,252 |
| 神戸電鉄 | 1 | 2 | 6,272 |
| 名古屋鉄道 | 70 | 61 | 130,295 |
| 山陽電気鉄道 | 4 | 4 | 9,558 |
| アルプス物流 | 5 | 4 | 8,930 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ヤマトホールディングス | 81 | 75 | 182,185 |
| 山九 | 16 | 15 | 80,830 |
| 丸全昭和運輸 | 3 | 3 | 16,391 |
| センコーグループホールディングス | 33 | 31 | 33,741 |
| トナミホールディングス | 1 | 1 | 4,420 |
| ニッコンホールディングス | 20 | 18 | 59,988 |
| 日本石油輸送 | 1 | - | - |
| 福山通運 | 4 | 6 | 28,662 |
| セイノーホールディングス | 39 | 33 | 74,358 |
| 神奈川中央交通 | 1 | 2 | 6,373 |
| AZ-COM和ホールディングス | 15 | 15 | 21,593 |
| C&Fロジホールディングス | 6 | 5 | 10,282 |
| 九州旅客鉄道 | 45 | 41 | 140,155 |
| SGホールディングス | 122 | 99 | 191,345 |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 23 | 20 | 162,026 |
| 海運業(0.9%) | | | |
| 日本郵船 | 170 | 169 | 818,632 |
| 商船三井 | 112 | 128 | 684,134 |
| 川崎汽船 | 54 | 47 | 339,435 |
| Nユナイテッド海運 | 3 | 3 | 16,832 |
| 明海グループ | 6 | 2 | 1,970 |
| 飯野海運 | 23 | 21 | 29,251 |
| 共栄タンカー | 0.600 | 0.600 | 678 |
| 乾汽船 | 8 | 6 | 7,258 |
| 空運業(0.4%) | | | |
| 日本航空 | 156 | 145 | 405,666 |
| ANAホールディングス | 173 | 161 | 520,191 |
| パスコ | 1 | 0.400 | 744 |
| 倉庫・運輸関連業(0.1%) | | | |
| トランコム | 1 | 1 | 10,778 |
| 日新 | 4 | 4 | 12,847 |
| 三菱倉庫 | 13 | 14 | 66,758 |
| 三井倉庫ホールディングス | 5 | 5 | 25,547 |
| 住友倉庫 | 17 | 16 | 41,760 |
| 澁澤倉庫 | 2 | 2 | 8,275 |
| 東陽倉庫 | 15 | - | - |
| 日本トランスシティ | 12 | 11 | 7,413 |
| 中央倉庫 | 5 | 2 | 2,633 |
| 安田倉庫 | 5 | 5 | 6,234 |
| 上組 | 30 | 27 | 93,993 |
| キューソー流通システム | 4 | 6 | 6,217 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東海運 | 13 | — | — |
| エーアイティ | 4 | 3 | 6,867 |
| 内外トランスライン | 2 | 2 | 6,294 |
| 日本コンセプト | 3 | 3 | 7,059 |
| 情報・通信業(7.6%) | | | |
| NECネットエスアイ | 21 | 23 | 55,680 |
| クロスキャット | 3 | 5 | 6,534 |
| システナ | 107 | 90 | 25,650 |
| デジタルアーツ | 4 | 3 | 17,898 |
| 日鉄ソリューションズ | 10 | 10 | 50,197 |
| キューブシステム | 4 | 5 | 6,266 |
| コア | 3 | 3 | 6,436 |
| 手間いらず | 1 | — | — |
| ラクーンホールディングス | 6 | 9 | 6,403 |
| ソリトンシステムズ | 4 | 4 | 6,394 |
| ソフトクリエイティブホールディングス | 2 | 4 | 9,393 |
| T I S | 71 | 65 | 218,985 |
| グリーン | 34 | 19 | 10,407 |
| コーエーテックホールディングス | 40 | 37 | 69,060 |
| 三菱総合研究所 | 3 | 2 | 14,355 |
| AGS | 6 | — | — |
| ファインデックス | 10 | — | — |
| ブレインパッド | 6 | — | — |
| K L a b | 12 | — | — |
| ポルトゥウィンホールディングス | 10 | 12 | 6,396 |
| ネクソン | 165 | 133 | 337,874 |
| アイスタイル | 20 | 19 | 8,885 |
| エムアップホールディングス | 7 | 7 | 7,519 |
| エイチーム | 6 | 11 | 6,460 |
| エニグモ | 8 | 17 | 6,247 |
| コロプラ | 24 | 23 | 13,513 |
| ブロードリーフ | 37 | 28 | 16,356 |
| クロス・マーケティンググループ | 5 | — | — |
| デジタルハーツホールディングス | 4 | 6 | 6,522 |
| システム情報 | 5 | — | — |
| メディアドゥ | 2 | 4 | 5,987 |
| じげん | 18 | 17 | 9,151 |
| ブイキューブ | 7 | 20 | 6,695 |
| サイバーリンクス | 3 | — | — |
| フィックスターズ | 7 | 6 | 12,187 |
| CARTA HOLDINGS | 3 | 0.200 | 291 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| オプティム | 5 | 6 | 7,222 |
| セレス | 5 | 5 | 9,036 |
| S H I F T | 4 | 4 | 106,540 |
| ティーガイア | 6 | 6 | 13,181 |
| テクマトリックス | 11 | 10 | 22,279 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 19 | 15 | 35,076 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 14 | 11 | 101,197 |
| システムリサーチ | — | 2 | 7,192 |
| インターネットイニシアティブ | 35 | 28 | 83,070 |
| ざくらインターネット | 9 | 6 | 35,443 |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 1 | 2 | 6,083 |
| S R Aホールディングス | 3 | 3 | 11,865 |
| 朝日ネット | 8 | 10 | 6,487 |
| e B A S E | 9 | 9 | 6,651 |
| アバントグループ | 8 | 7 | 10,222 |
| アドソル日進 | 3 | 4 | 6,732 |
| フリービット | 4 | — | — |
| コムチュア | 8 | 8 | 16,838 |
| サイバーコム | 0.600 | — | — |
| アステリア | 6 | 10 | 7,008 |
| アイル | 3 | 2 | 10,332 |
| マークライNZ | 3 | 3 | 10,576 |
| メディカル・データ・ビジョン | 9 | 9 | 5,771 |
| g u m i | 10 | 15 | 6,224 |
| テラスカイ | 2 | 4 | 6,560 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 3 | 3 | 7,030 |
| P R T I M E S | 2 | — | — |
| ラクス | 30 | 28 | 60,808 |
| ランドコンピュータ | 5 | — | — |
| ダブルスタンダード | 2 | 3 | 7,238 |
| オーブントア | 4 | 7 | 6,007 |
| アカツキ | 3 | 2 | 6,890 |
| Ubicomホールディングス | 2 | 4 | 6,075 |
| カナミックネットワーク | 9 | 15 | 7,910 |
| ノムラシステムコーポレーション | 39 | — | — |
| チェンジホールディングス | 15 | 12 | 19,569 |
| シンクロ・フード | 0.200 | — | — |
| オークネット | 3 | 3 | 6,258 |
| キャピタル・アセット・プランニング | 7 | — | — |
| マクロミル | 14 | 11 | 9,383 |
| ビーグリーン | 3 | — | — |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| オロ | 2 | 2 | 5,768 |
| ユーザーローカル | 3 | - | - |
| マネーフォワード | 15 | 13 | 75,886 |
| プラスアルファ・コンサルティング | - | 3 | 8,879 |
| 電算システムホールディングス | 3 | 2 | 6,947 |
| APPIER GROUP | - | 20 | 38,488 |
| ビジョナル | - | 4 | 43,102 |
| プロトコーポレーション | 8 | 6 | 8,515 |
| ハイマックス | - | 4 | 6,291 |
| 野村総合研究所 | 131 | 131 | 537,599 |
| サイバネットシステム | 5 | - | - |
| CEホールディングス | 9 | - | - |
| 日本システム技術 | - | 2 | 7,414 |
| インテージホールディングス | 8 | 6 | 12,106 |
| ソースネクスト | 32 | 42 | 5,837 |
| インフォコム | 8 | 7 | 17,378 |
| シンプレクス・ホールディングス | 10 | 9 | 22,968 |
| HEROZ | 5 | 3 | 7,273 |
| ラクスル | 18 | 14 | 15,486 |
| メルカリ | 28 | 28 | 61,976 |
| I P S | 2 | - | - |
| F I G | 12 | - | - |
| イーソル | 6 | 10 | 11,227 |
| アルテリア・ネットワークス | 6 | - | - |
| ウイングアーク1 s t | 6 | 6 | 18,724 |
| サーバーワークス | 2 | 1 | 6,876 |
| トピラシステムズ | 4 | - | - |
| Sansan | 23 | 19 | 29,523 |
| ギフト | 6 | 5 | 7,898 |
| メドレー | 6 | 8 | 39,040 |
| ベース | 2 | 2 | 7,570 |
| JMDC | 10 | 10 | 37,370 |
| フォーカスシステムズ | 4 | 6 | 6,462 |
| クレスコ | 4 | 4 | 9,442 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 61 | 57 | 110,774 |
| オービック | 21 | 19 | 441,780 |
| ジャストシステム | 9 | 8 | 21,887 |
| TDCソフト | 5 | 5 | 11,849 |
| LINEヤフー | 909 | 846 | 357,815 |
| トレンドマイクロ | 36 | 28 | 204,258 |
| IDホールディングス | 5 | 4 | 6,580 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|--------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本オラクル | 12 | 11 | 132,240 |
| アルファシステムズ | 2 | 2 | 7,350 |
| フューチャー | 15 | 12 | 21,043 |
| CAC Holdings | 3 | 3 | 6,480 |
| S Bテクノロジー | 2 | 2 | 5,538 |
| トーセ | 6 | - | - |
| オービックビジネスコンサルタント | 12 | 8 | 58,287 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 34 | - | - |
| アイティフォー | 8 | 7 | 10,624 |
| 東計電算 | 0.900 | - | - |
| エクスネット | 4 | - | - |
| 大塚商会 | 36 | 29 | 191,101 |
| サイボウズ | 8 | 8 | 16,637 |
| 電通総研 | 7 | 7 | 39,888 |
| ACCESS | 7 | 8 | 7,605 |
| デジタルガレージ | 11 | 9 | 32,015 |
| イーエムシステムズ | 10 | 9 | 7,375 |
| ウェザーニューズ | 2 | 1 | 9,234 |
| C I J | 5 | 9 | 7,009 |
| 日本エンタープライズ | 30 | - | - |
| WOWOW | 3 | 5 | 6,344 |
| スカラ | 6 | 8 | 5,942 |
| ANYCOLOR | - | 6 | 19,593 |
| ネットワンシステムズ | 23 | 24 | 61,860 |
| アルゴグラフィックス | 5 | 5 | 23,732 |
| マーベラス | 10 | 9 | 7,178 |
| エイベックス | 10 | 10 | 13,079 |
| B I P R O G Y | 23 | 19 | 90,226 |
| 兼松エレクトロニクス | 4 | - | - |
| 都築電気 | 3 | 3 | 7,418 |
| T B S ホールディングス | 32 | 29 | 127,194 |
| 日本テレビホールディングス | 56 | 52 | 114,931 |
| 朝日放送グループホールディングス | 7 | 9 | 6,555 |
| テレビ朝日ホールディングス | 15 | 14 | 30,182 |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 56 | 46 | 41,395 |
| テレビ東京ホールディングス | 4 | 4 | 12,964 |
| 日本BS放送 | 4 | - | - |
| ビジョン | 8 | 9 | 10,044 |
| USEN-NEXT HOLDINGS | 5 | 6 | 30,116 |
| 日本通信 | 58 | 58 | 12,811 |
| 日本電信電話 | 818 | 17,686 | 3,211,941 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|----------------------|---------|-----|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| KDDI | 493 | 459 | 2,123,809 | |
| ソフトバンク | 1,026 | 956 | 1,884,136 | |
| 光通信 | 7 | 6 | 152,790 | |
| エムティーアイ | 9 | 10 | 8,003 | |
| GMOインターネットグループ | 23 | 22 | 56,518 | |
| アドマーケティングコミュニケーション | 16 | - | - | |
| KADOKAWA | 33 | 31 | 98,376 | |
| 学研ホールディングス | 10 | 9 | 9,850 | |
| ゼンリン | 10 | 10 | 8,680 | |
| インプレスホールディングス | 22 | - | - | |
| アイネット | 3 | 3 | 7,855 | |
| 松竹 | 3 | 3 | 31,186 | |
| 東宝 | 40 | 33 | 163,845 | |
| 東映 | 1 | 2 | 39,820 | |
| NTTデータグループ | 200 | 155 | 363,248 | |
| ピー・シー・エー | 3 | 5 | 8,548 | |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 2 | 2 | 6,652 | |
| DT S | 13 | 12 | 48,562 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 32 | 27 | 179,900 | |
| シーイーシー | 9 | 7 | 13,612 | |
| カプコン | 63 | 53 | 312,656 | |
| アイ・エス・ビー | 4 | 4 | 5,612 | |
| ジャステック | 4 | 4 | 6,420 | |
| S C S K | 52 | 41 | 112,049 | |
| NSW | 2 | 2 | 7,664 | |
| アイネス | 4 | 4 | 6,844 | |
| T K C | 11 | 9 | 34,780 | |
| 富士ソフト | 7 | 12 | 73,680 | |
| NSD | 22 | 21 | 57,452 | |
| コナミグループ | 27 | 22 | 214,035 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 4 | 3 | 9,764 | |
| J B C Cホールディングス | 4 | 3 | 14,878 | |
| ミロク情報サービス | 5 | 5 | 10,767 | |
| ソフトバンクグループ | 369 | 293 | 2,504,488 | |
| 卸売業(7.4%) | | | | |
| 高千穂交易 | 2 | 2 | 7,860 | |
| 伊藤忠食品 | 1 | 1 | 10,794 | |
| エレマテック | 6 | 5 | 10,074 | |
| あらた | 5 | 9 | 30,432 | |
| トーマンデバイス | 1 | 1 | 6,132 | |
| 東京エレクトロン デバイス | 2 | 6 | 42,651 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 円谷フィールズホールディングス | 5 | 10 | 17,258 | |
| 双日 | 71 | 69 | 263,355 | |
| アルフレッサ ホールディングス | 67 | 63 | 146,097 | |
| 横浜冷凍 | 18 | 17 | 18,211 | |
| アルコニックス | 8 | 8 | 11,520 | |
| 神戸物産 | 52 | 48 | 182,505 | |
| ハイパー | 4 | 4 | 1,386 | |
| あい ホールディングス | 10 | 10 | 24,450 | |
| ディーブイエックス | 4 | 4 | 4,332 | |
| ダイワボウホールディングス | 27 | 27 | 74,337 | |
| マクニカホールディングス | 16 | 14 | 120,768 | |
| ラクト・ジャパン | 2 | 2 | 6,224 | |
| グリムス | 2 | 3 | 5,793 | |
| パイタルケーエスケー・ホールディングス | 9 | 9 | 12,331 | |
| 八洲電機 | 5 | 5 | 6,803 | |
| メディアスホールディングス | 7 | 8 | 6,158 | |
| レスターホールディングス | 6 | 5 | 15,746 | |
| ジオリーブグループ | 4 | - | - | |
| OCHIホールディングス | 3 | - | - | |
| TOKAIホールディングス | 33 | 34 | 34,202 | |
| Cominix | 6 | - | - | |
| 三洋貿易 | 6 | 7 | 9,478 | |
| ビューティガレージ | 1 | 2 | 6,522 | |
| ウイン・パートナーズ | 4 | 5 | 6,492 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 24 | 22 | 49,443 | |
| 明治電機工業 | 4 | 4 | 6,569 | |
| コメダホールディングス | 16 | 15 | 42,334 | |
| アセンテック | 11 | 10 | 6,478 | |
| フルサト・マルカホールディングス | 6 | 5 | 12,605 | |
| ヤマエグループホールディングス | 3 | 3 | 8,809 | |
| 小野建 | 6 | 6 | 10,924 | |
| 南陽 | 2 | 1 | 3,441 | |
| 佐鳥電機 | 4 | 3 | 8,970 | |
| 伯東 | 3 | 3 | 21,420 | |
| コンドーテック | 5 | 5 | 6,196 | |
| 中山福 | 14 | 0.100 | 36 | |
| ナガイレーベン | 8 | 7 | 18,675 | |
| 三菱食品 | 6 | 5 | 29,174 | |
| 松田産業 | 5 | 4 | 11,520 | |
| 第一興商 | 13 | 24 | 46,546 | |
| メディバルホールディングス | 69 | 63 | 151,237 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| S P K | 3 | 3 | 6,585 |
| 萩原電気ホールディングス | 2 | 2 | 13,311 |
| アズワン | 9 | 9 | 51,832 |
| スズデン | 2 | 2 | 5,764 |
| シモジマ | 5 | 4 | 6,134 |
| ドウシシャ | 7 | 5 | 12,342 |
| 小津産業 | 2 | 2 | 3,852 |
| 高速 | 3 | 3 | 8,924 |
| 丸文 | 6 | 5 | 8,484 |
| ハピネット | 5 | 5 | 17,357 |
| 橋本総業ホールディングス | 4 | 4 | 6,114 |
| 日本ライフライン | 19 | 18 | 23,404 |
| I D O M | 20 | 16 | 14,740 |
| 進和 | 4 | 3 | 9,226 |
| ダイトロン | 2 | 2 | 7,312 |
| シークス | 9 | 8 | 14,426 |
| 田中商事 | 8 | - | - |
| オーハシテクニカ | 3 | 3 | 6,249 |
| 白銅 | 2 | 2 | 6,843 |
| 伊藤忠商事 | 415 | 421 | 2,781,111 |
| 丸紅 | 532 | 523 | 1,287,887 |
| 長瀬産業 | 31 | 28 | 70,660 |
| 蝶理 | 3 | 3 | 11,649 |
| 豊田通商 | 59 | 54 | 503,652 |
| 三共生興 | 10 | 8 | 6,690 |
| 兼松 | 26 | 26 | 61,701 |
| 三井物産 | 493 | 472 | 3,010,462 |
| 日本紙パルプ商事 | 3 | 3 | 15,060 |
| カメイ | 7 | 6 | 12,582 |
| O U Gホールディングス | 1 | 1 | 4,515 |
| スターゼン | 5 | 4 | 11,876 |
| 山善 | 18 | 19 | 24,472 |
| 椿本興業 | 1 | 1 | 8,931 |
| 住友商事 | 417 | 379 | 1,354,792 |
| 内田洋行 | 3 | 2 | 19,675 |
| 三菱商事 | 421 | 1,242 | 3,889,034 |
| 第一実業 | 2 | 5 | 11,693 |
| キャノンマーケティングジャパン | 15 | 14 | 61,842 |
| 西華産業 | 3 | 2 | 7,450 |
| 佐藤商事 | 4 | 4 | 7,568 |
| 菱洋エレクトロ | 5 | 5 | 23,482 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東京産業 | 6 | 8 | 6,273 |
| ユアサ商事 | 6 | 4 | 24,745 |
| 神鋼商事 | 1 | 1 | 11,536 |
| 阪和興業 | 12 | 11 | 63,506 |
| 正栄食品工業 | 4 | 4 | 19,530 |
| カナデン | 5 | 4 | 7,299 |
| R Y O D E N | 5 | 5 | 13,428 |
| 岩谷産業 | 15 | 14 | 105,033 |
| ナイス | 2 | 2 | 4,640 |
| 極東貿易 | 4 | 3 | 7,921 |
| アステナホールディングス | 11 | 13 | 6,270 |
| 三愛オプリー | 18 | 15 | 29,037 |
| 稲畑産業 | 13 | 12 | 39,184 |
| G S Iクレオス | 3 | 3 | 8,166 |
| 明和産業 | 9 | 9 | 6,726 |
| クワザワホールディングス | 10 | - | - |
| ワキタ | 12 | 10 | 16,588 |
| 東邦ホールディングス | 16 | 17 | 56,306 |
| サンゲツ | 16 | 14 | 51,624 |
| ミツロコグループホールディングス | 8 | 8 | 12,096 |
| シナネンホールディングス | 2 | 1 | 7,097 |
| 伊藤忠エネクス | 16 | 15 | 23,482 |
| サンリオ | 19 | 17 | 133,037 |
| サンワ テクノス | 3 | 3 | 7,302 |
| リョーサン | 7 | 4 | 22,660 |
| 新光商事 | 9 | 8 | 10,315 |
| トーホー | 2 | 2 | 6,890 |
| 三信電気 | 2 | 2 | 6,024 |
| 東陽テクニカ | 7 | 6 | 9,600 |
| モスフードサービス | 9 | 9 | 31,970 |
| 加賀電子 | 5 | 5 | 36,936 |
| ソーダニッカ | - | 5 | 6,238 |
| 立花エレテック | 4 | 4 | 13,062 |
| P A L T A C | 10 | 8 | 37,051 |
| 三谷産業 | 15 | 17 | 6,776 |
| 西本Wismettacホールディングス | 1 | 1 | 10,768 |
| K P Pグループホールディングス | 15 | 16 | 10,238 |
| ヤマタネ | 3 | 2 | 7,154 |
| 丸紅建材リース | 2 | - | - |
| 日鉄物産 | 4 | - | - |
| 泉州電業 | 3 | 2 | 10,904 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| トラスコ中山 | 14 | 13 | 30,874 |
| オートバックスセブン | 23 | 21 | 35,839 |
| モリト | 6 | 4 | 6,376 |
| 加藤産業 | 8 | 7 | 37,479 |
| イエローハット | 11 | 10 | 18,910 |
| J Kホールディングス | 5 | 5 | 6,082 |
| 日伝 | 4 | 4 | 11,743 |
| 北沢産業 | 23 | 10 | 3,403 |
| 杉本商事 | 3 | 3 | 6,768 |
| 因幡電機産業 | 17 | 16 | 57,539 |
| 東テク | 2 | 2 | 14,679 |
| ミスミグループ本社 | 101 | 94 | 198,396 |
| 蔵王産業 | 2 | - | - |
| スズケン | 21 | 23 | 117,683 |
| ジェコス | 5 | 5 | 6,739 |
| 小売業(4.2%) | | | |
| ローソン | 16 | 13 | 136,391 |
| サンエー | 5 | 4 | 21,816 |
| カワチ薬品 | 5 | 4 | 13,445 |
| エービーシー・マート | 9 | 27 | 69,363 |
| ハードオフコーポレーション | 2 | 3 | 6,004 |
| アスクル | 16 | 15 | 30,939 |
| ゲオホールディングス | 7 | 7 | 14,175 |
| アダストリア | 8 | 7 | 26,486 |
| くら寿司 | 7 | 7 | 29,455 |
| キャンドゥ | 2 | 2 | 6,535 |
| パルグループホールディングス | 6 | 12 | 27,355 |
| エディオン | 26 | 24 | 37,125 |
| サーラコーポレーション | 14 | 13 | 10,731 |
| ハローズ | 3 | 2 | 12,012 |
| フジオフードグループ本社 | 5 | 7 | 9,555 |
| あみやき亭 | 1 | 1 | 6,517 |
| 大黒天物産 | 2 | 1 | 16,473 |
| ハニーズホールディングス | 6 | 5 | 9,027 |
| ファーマライズホールディングス | 7 | - | - |
| アルペン | 5 | 5 | 10,374 |
| クオールホールディングス | 9 | 8 | 14,155 |
| ジンズホールディングス | 4 | 3 | 14,134 |
| ビックカメラ | 44 | 33 | 43,420 |
| DCMホールディングス | 41 | 33 | 46,306 |
| MonotaRO | 95 | 88 | 136,906 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東京一番フーズ | 8 | 8 | 4,288 |
| アークランドサービスホールディングス | 5 | - | - |
| J. フロント リテイリング | 83 | 72 | 112,464 |
| ドトール・日レスホールディングス | 11 | 11 | 23,110 |
| マツキヨココカラ&カンパニー | 40 | 114 | 305,388 |
| ブロンコビリー | 3 | 3 | 12,117 |
| ZOZO | 44 | 40 | 137,040 |
| トレジャー・ファクトリー | 2 | 4 | 7,156 |
| 物語コーポレーション | 3 | 10 | 48,195 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 113 | 105 | 225,931 |
| Hamee | 7 | 5 | 6,241 |
| ウエルシアホールディングス | 35 | 32 | 86,043 |
| クリエイトSDホールディングス | 11 | 8 | 28,346 |
| 丸善CHIホールディングス | 12 | 12 | 4,132 |
| ミサワ | 2 | 2 | 1,439 |
| ティーライフ | 3 | - | - |
| シュッピン | 5 | 6 | 6,362 |
| オイシックス・ラ・大地 | 9 | 8 | 11,583 |
| ネクステージ | 15 | 14 | 31,174 |
| ジョイフル本田 | 21 | 18 | 36,618 |
| 鳥貴族ホールディングス | 2 | 2 | 9,372 |
| ホットランド | 5 | 4 | 8,784 |
| すかいらーくホールディングス | 92 | 85 | 187,383 |
| S F Pホールディングス | 3 | 3 | 7,116 |
| 綿半ホールディングス | 5 | 4 | 7,212 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 22 | 17 | 17,447 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 3 | - | - |
| B E E N O S | 3 | 4 | 5,934 |
| あさひ | 5 | 5 | 7,412 |
| 日本調剤 | 4 | 4 | 6,484 |
| コスモス薬品 | 7 | 5 | 79,659 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 232 | 216 | 1,379,788 |
| クリエイトレストランツ・ホールディングス | 50 | 42 | 46,070 |
| ツルハホールディングス | 16 | 13 | 145,794 |
| サンマルクホールディングス | 5 | 5 | 11,040 |
| フェリシモ | 4 | 4 | 4,070 |
| トリドールホールディングス | 16 | 17 | 73,057 |
| T O K Y O B A S E | 17 | 19 | 5,841 |
| J Mホールディングス | 5 | 4 | 11,453 |
| アレンザホールディングス | 5 | 5 | 6,641 |
| パロックジャパンリミテッド | 5 | 7 | 6,337 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| クスリのアオキホールディングス | 6 | 18 | 57,645 |
| 力の源ホールディングス | — | 4 | 7,591 |
| FOOD & LIFE COMPANIES | 38 | 33 | 102,007 |
| メディカルシステムネットワーク | 11 | 10 | 6,375 |
| はるやまホールディングス | 11 | 5 | 3,169 |
| ノジマ | 22 | 18 | 30,212 |
| カッパ・クリエイト | 10 | 9 | 16,513 |
| ライトオン | 6 | 6 | 2,725 |
| 良品計画 | 86 | 68 | 159,262 |
| アドヴァングループ | 6 | 6 | 6,996 |
| アルビス | 2 | 2 | 6,314 |
| コナカ | 14 | — | — |
| ハウス オブ ローゼ | 2 | 0.400 | 651 |
| G-7ホールディングス | 8 | 6 | 9,785 |
| イオン北海道 | 10 | 18 | 17,205 |
| コジマ | 13 | 10 | 7,820 |
| ヒマラヤ | 4 | 0.400 | 377 |
| コーナン商事 | 9 | 7 | 29,953 |
| エコス | 2 | 2 | 6,162 |
| ワタミ | 8 | 6 | 6,824 |
| パ・パ・フィック・インターナショナルホールディングス | 151 | 126 | 440,409 |
| 西松屋チェーン | 14 | 12 | 25,682 |
| ゼンショーホールディングス | 36 | 31 | 211,433 |
| サイゼリヤ | 11 | 9 | 45,942 |
| V Tホールディングス | 25 | 23 | 12,233 |
| 魚力 | 2 | 2 | 6,426 |
| フジ・コーポレーション | 3 | 3 | 6,271 |
| ユナイテッドアローズ | 7 | 7 | 13,246 |
| ハイデイ日高 | 10 | 9 | 25,212 |
| コロワイド | 31 | 27 | 60,345 |
| ピーシーデポコーポレーション | 17 | — | — |
| 壱番屋 | 5 | 5 | 30,450 |
| スギホールディングス | 13 | 12 | 91,539 |
| 薬王堂ホールディングス | 3 | 3 | 8,804 |
| スクロール | 10 | 9 | 8,639 |
| ヨンドシーホールディングス | 5 | 5 | 11,487 |
| 木曽路 | 10 | 9 | 24,595 |
| S R Sホールディングス | 11 | 10 | 12,133 |
| 千趣会 | 12 | — | — |
| リテールパートナーズ | 10 | 9 | 16,414 |
| ケーヨー | 10 | — | — |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 上新電機 | 6 | 6 | 14,656 |
| 日本瓦斯 | 36 | 33 | 77,804 |
| ロイヤルホールディングス | 13 | 11 | 26,706 |
| 東天紅 | 5 | — | — |
| いなげや | 6 | 6 | 7,893 |
| チヨダ | 6 | 7 | 6,379 |
| ライフコーポレーション | 5 | 6 | 24,519 |
| リンガーハット | 8 | 8 | 19,197 |
| MrMaxHD | 9 | 10 | 6,426 |
| AOKIホールディングス | 12 | 13 | 15,436 |
| オークワ | 10 | 9 | 7,812 |
| コメリ | 10 | 9 | 32,204 |
| 青山商事 | 14 | 13 | 21,882 |
| しまむら | 7 | 14 | 120,723 |
| 高島屋 | 50 | 43 | 99,125 |
| 松屋 | 11 | 10 | 10,207 |
| イチ・ツー・オー リテイリング | 32 | 27 | 50,762 |
| 近鉄百貨店 | 2 | 2 | 6,812 |
| 丸井グループ | 49 | 41 | 102,960 |
| アクシアル リテイリング | 4 | 4 | 17,350 |
| イオン | 228 | 212 | 762,808 |
| イズミ | 10 | 11 | 41,680 |
| 平和堂 | 11 | 10 | 21,672 |
| フジ | 10 | 9 | 19,046 |
| ヤオコー | 7 | 7 | 58,646 |
| ゼビオホールディングス | 9 | 8 | 8,228 |
| ケーズホールディングス | 53 | 42 | 51,972 |
| 日産東京販売ホールディングス | 4 | 4 | 2,400 |
| Genky DrugStores | 3 | 2 | 16,794 |
| ナルミヤ・インターナショナル | 5 | 3 | 4,098 |
| ブックオフグループホールディングス | 4 | — | — |
| ギフトホールディングス | 1 | 2 | 7,908 |
| アインホールディングス | 9 | 8 | 40,402 |
| 元氣寿司 | 2 | 3 | 12,215 |
| ヤマダホールディングス | 276 | 192 | 83,602 |
| アークランズ | 9 | 18 | 30,985 |
| ニトリホールディングス | 27 | 22 | 493,734 |
| グルメ杵屋 | 5 | — | — |
| 愛眼 | 27 | 1 | 257 |
| ケーユーホールディングス | 3 | 5 | 6,382 |
| 吉野家ホールディングス | 26 | 23 | 75,467 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 松屋フーズホールディングス | 3 | 3 | 16,710 | |
| サガミホールディングス | 10 | 9 | 14,043 | |
| 関西フードマーケット | 6 | 4 | 7,145 | |
| 王将フードサービス | 4 | 4 | 35,512 | |
| ミニストップ | 4 | 4 | 7,502 | |
| アークス | 12 | 11 | 34,960 | |
| パローホールディングス | 12 | 12 | 29,508 | |
| ベルク | 3 | 3 | 20,367 | |
| 大 庄 | 4 | 4 | 6,189 | |
| ファーストリテイリング | 10 | 28 | 1,175,940 | |
| サンドラッグ | 25 | 21 | 96,036 | |
| サックスパー ホールディングス | 6 | 7 | 6,520 | |
| ヤマザワ | 3 | 3 | 4,301 | |
| やまや | 1 | - | - | |
| ペルーナ | 16 | 15 | 9,301 | |
| 銀行業(7.2%) | | | | |
| いよぎんホールディングス | 74 | 69 | 75,129 | |
| しずおかフィナンシャルグループ | 141 | 129 | 187,286 | |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 52 | 49 | 55,473 | |
| 楽天銀行 | - | 20 | 54,099 | |
| 京都フィナンシャルグループ | - | 74 | 186,776 | |
| 島根銀行 | 9 | - | - | |
| じもとホールディングス | 8 | 2 | 1,365 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 311 | 289 | 127,207 | |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 8 | 7 | 30,862 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 110 | 113 | 109,011 | |
| ゆうちょ銀行 | 178 | 641 | 985,497 | |
| 富山第一銀行 | 15 | 18 | 16,058 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 345 | 313 | 228,395 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 39 | 32 | 53,396 | |
| 三十三フィナンシャルグループ | 5 | 5 | 10,046 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 9 | 9 | 38,778 | |
| ひろぎんホールディングス | 81 | 83 | 86,174 | |
| おきなわフィナンシャルグループ | 6 | 5 | 12,265 | |
| 十六フィナンシャルグループ | 8 | 7 | 32,300 | |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 5 | 6 | 28,731 | |
| プロクレアホールディングス | 7 | 6 | 12,267 | |
| あいちフィナンシャルグループ | 8 | 9 | 23,535 | |
| S B I 新生銀行 | 18 | - | - | |
| あおぞら銀行 | 39 | 42 | 93,030 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 3,982 | 3,555 | 5,289,401 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| りそなホールディングス | 800 | 680 | 556,771 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 114 | 209 | 623,001 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 458 | 415 | 3,349,833 | |
| 千葉銀行 | 174 | 162 | 191,335 | |
| 群馬銀行 | 121 | 113 | 87,977 | |
| 武蔵野銀行 | 8 | 8 | 22,428 | |
| 千葉興業銀行 | 14 | 11 | 9,163 | |
| 筑波銀行 | 27 | - | - | |
| 七十七銀行 | 20 | 17 | 62,645 | |
| 秋田銀行 | 4 | 3 | 7,983 | |
| 山形銀行 | 7 | 6 | 7,143 | |
| 岩手銀行 | 4 | 3 | 9,335 | |
| 東邦銀行 | 49 | 46 | 14,414 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 50 | 50 | 186,904 | |
| スルガ銀行 | 55 | 51 | 40,067 | |
| 八十二銀行 | 128 | 125 | 109,800 | |
| 山梨中央銀行 | 6 | 6 | 11,147 | |
| 大垣共立銀行 | 12 | 11 | 22,954 | |
| 福井銀行 | 5 | 5 | 9,235 | |
| 清水銀行 | 3 | 4 | 6,264 | |
| 富山銀行 | 1 | 1 | 1,976 | |
| 滋賀銀行 | 10 | 9 | 38,363 | |
| 南都銀行 | 9 | 8 | 23,698 | |
| 百五銀行 | 59 | 54 | 33,214 | |
| 京都銀行 | 19 | - | - | |
| 紀陽銀行 | 22 | 20 | 38,769 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 39 | 36 | 60,611 | |
| 山陰合同銀行 | 39 | 36 | 37,047 | |
| 百十四銀行 | 5 | 5 | 15,378 | |
| 四国銀行 | 10 | 8 | 9,116 | |
| 阿波銀行 | 9 | 8 | 19,983 | |
| 大分銀行 | 3 | 3 | 9,198 | |
| 宮崎銀行 | 4 | 3 | 9,534 | |
| 佐賀銀行 | 3 | 3 | 6,480 | |
| 琉球銀行 | 14 | 12 | 14,012 | |
| セブン銀行 | 224 | 183 | 54,717 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 907 | 788 | 2,156,241 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 69 | 57 | 85,835 | |
| 長野銀行 | 3 | - | - | |
| 名古屋銀行 | 4 | 3 | 22,382 | |
| 北洋銀行 | 95 | 88 | 30,621 | |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 大光銀行 | 3 | 1 | 1,677 |
| 愛媛銀行 | 8 | 7 | 8,769 |
| 京葉銀行 | 29 | 24 | 17,419 |
| 栃木銀行 | 28 | 29 | 8,906 |
| 北日本銀行 | 2 | 2 | 5,955 |
| 東和銀行 | 11 | 10 | 7,051 |
| トモニホールディングス | 50 | 55 | 22,175 |
| フィデアホールディングス | 6 | 6 | 9,534 |
| 池田泉州ホールディングス | 80 | 81 | 28,755 |
| 証券・商品先物取引業(0.9%) | | | |
| F P G | 25 | 19 | 36,287 |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 5 | 9 | 8,531 |
| マーキュリアホールディングス | 4 | 1 | 1,061 |
| S B I ホールディングス | 90 | 85 | 342,400 |
| ジャフコ グループ | 20 | 17 | 30,389 |
| 大和証券グループ本社 | 448 | 452 | 489,614 |
| 野村ホールディングス | 1,155 | 981 | 816,155 |
| 岡三証券グループ | 55 | 51 | 37,500 |
| 丸三証券 | 20 | 19 | 18,876 |
| 東洋証券 | 20 | 19 | 6,892 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 68 | 69 | 39,847 |
| 光世証券 | 5 | 1 | 715 |
| 水戸証券 | 23 | 17 | 8,084 |
| いちよし証券 | 11 | 10 | 8,589 |
| 松井証券 | 37 | 28 | 24,481 |
| マネックスグループ | 70 | 57 | 50,393 |
| 極東証券 | 8 | 8 | 8,144 |
| 岩井コスモホールディングス | 7 | 6 | 14,632 |
| アイザワ証券グループ | 9 | 8 | 9,870 |
| スパークス・グループ | 7 | 6 | 11,836 |
| 保険業(2.6%) | | | |
| かんぽ生命保険 | 76 | 59 | 159,370 |
| F P パートナー | - | 1 | 8,256 |
| S O M P O ホールディングス | 107 | 87 | 775,537 |
| アニコム ホールディングス | 21 | 19 | 11,840 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 127 | 130 | 962,082 |
| 第一生命ホールディングス | 319 | 285 | 970,590 |
| 東京海上ホールディングス | 631 | 577 | 2,534,485 |
| T & D ホールディングス | 168 | 156 | 396,076 |
| アドバンスクリエイト | 3 | 3 | 3,438 |
| その他金融業(1.2%) | | | |
| 全国保証 | 16 | 15 | 84,165 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ジェイリース | 2 | 1 | 4,759 |
| イントラスト | 4 | 0.100 | 80 |
| S B I アルヒ | 7 | 7 | 6,704 |
| プレミアグループ | 10 | 9 | 17,385 |
| ネットプロテクションズホールディングス | 20 | 34 | 6,747 |
| クレディセゾン | 39 | 37 | 104,340 |
| 芙蓉総合リース | 5 | 5 | 74,277 |
| みずほリース | 9 | 9 | 52,528 |
| 東京センチュリー | 11 | 43 | 69,738 |
| 日本証券金融 | 25 | 21 | 35,088 |
| アイフル | 103 | 86 | 37,152 |
| リコーリース | 6 | 5 | 28,050 |
| イオンフィナンシャルサービス | 36 | 33 | 44,957 |
| アコム | 111 | 104 | 41,419 |
| ジャックス | 6 | 6 | 34,348 |
| オリエントコーポレーション | 16 | 19 | 20,398 |
| オリックス | 419 | 355 | 1,096,883 |
| 三菱HCキャピタル | 244 | 260 | 270,868 |
| 九州リースサービス | 3 | - | - |
| 日本取引所グループ | 176 | 152 | 578,740 |
| イー・ギャランティ | 10 | 9 | 17,917 |
| アサックス | 8 | - | - |
| NECキャピタルソリューション | 3 | 2 | 10,730 |
| 不動産業(1.9%) | | | |
| 大東建託 | 23 | 21 | 367,545 |
| いちご | 72 | 67 | 27,216 |
| 日本駐車場開発 | 74 | 61 | 11,185 |
| S R E ホールディングス | 3 | 2 | 8,650 |
| ADワークスグループ | 20 | 20 | 4,763 |
| ヒューリック | 146 | 136 | 206,411 |
| 三栄建築設計 | 3 | - | - |
| 野村不動産ホールディングス | 39 | 32 | 120,412 |
| 三重交通グループホールディングス | 13 | 12 | 7,550 |
| サムティ | 10 | 9 | 23,212 |
| ディア・ライフ | 9 | 10 | 9,260 |
| コーセーアールイー | 6 | 3 | 3,307 |
| 地主 | 4 | 4 | 9,499 |
| プレサンスコーポレーション | 8 | 9 | 15,475 |
| ハウスコム | 4 | 4 | 3,864 |
| J P M C | 4 | 5 | 6,754 |
| サンセイランディック | 5 | 2 | 2,380 |
| エストラスト | 8 | 7 | 4,920 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フージャースホールディングス | 9 | 9 | 9,585 |
| オープンハウスグループ | 23 | 21 | 105,009 |
| 東急不動産ホールディングス | 188 | 175 | 171,586 |
| 飯田グループホールディングス | 54 | 55 | 108,222 |
| ムゲンエステート | 9 | - | - |
| And Doホールディングス | 6 | 5 | 6,165 |
| シーアールイー | 4 | 4 | 5,821 |
| ケイアイスター不動産 | 3 | 2 | 10,430 |
| グッドコムアセット | 5 | 8 | 6,166 |
| ジェイ・エス・ビー | 1 | 2 | 7,975 |
| ロードスターキャピタル | 3 | 3 | 8,329 |
| 霞ヶ関キャピタル | - | 1 | 21,296 |
| パーク24 | 48 | 37 | 65,377 |
| 三井不動産 | 272 | 270 | 1,099,440 |
| 三菱地所 | 378 | 381 | 814,166 |
| 平和不動産 | 10 | 9 | 38,190 |
| 東京建物 | 59 | 51 | 110,058 |
| 京阪神ビルディング | 7 | 10 | 17,254 |
| 住友不動産 | 113 | 84 | 387,902 |
| テーオーシー | 11 | 10 | 7,082 |
| 東京楽天地 | 1 | 1 | 6,700 |
| レオパレス21 | 70 | 58 | 24,703 |
| スターツコーポレーション | 9 | 8 | 25,494 |
| フジ住宅 | 8 | 8 | 6,327 |
| 空港施設 | 9 | 10 | 6,281 |
| ゴールドクレスト | 6 | 4 | 10,780 |
| エスリード | 2 | 2 | 9,207 |
| 日神グループホールディングス | 11 | 12 | 6,197 |
| 日本エスコン | 14 | 10 | 10,758 |
| MIRARTHホールディングス | 31 | 26 | 13,185 |
| AVANTIA | 5 | 3 | 3,122 |
| イオンモール | 32 | 30 | 55,342 |
| ファースト住建 | 4 | 1 | 1,651 |
| カチタス | 16 | 15 | 31,117 |
| トーセイ | 10 | 9 | 19,962 |
| 穴吹興産 | 2 | - | - |
| サンフロンティア不動産 | 10 | 8 | 14,706 |
| FJネクストホールディングス | 6 | 6 | 7,198 |
| グランディハウス | 8 | 9 | 6,295 |
| 日本空港ビルデング | 22 | 20 | 121,157 |
| サービス業(4.6%) | | | |
| 日本工営 | 4 | - | - |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| LIFULL | 22 | 32 | 5,377 |
| MIXI | 14 | 13 | 31,584 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 5 | 22 | 16,566 |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 112 | 97 | 101,518 |
| メンバーズ | 2 | 6 | 6,009 |
| UTグループ | 9 | 7 | 26,702 |
| アイティメディア | 3 | 6 | 11,796 |
| ケアネット | - | 9 | 6,439 |
| E・Jホールディングス | 4 | 3 | 6,055 |
| オープンアップグループ | 23 | 18 | 40,205 |
| コシダカホールディングス | 19 | 18 | 16,580 |
| アルトナー | 1 | - | - |
| パソナグループ | 7 | 7 | 20,290 |
| CDS | 2 | - | - |
| リンクアンドモチベーション | 18 | 17 | 10,710 |
| エス・エム・エス | 24 | 21 | 55,105 |
| サニーサイドアップグループ | 7 | - | - |
| パーソルホールディングス | 73 | 620 | 137,604 |
| クックパッド | 26 | 53 | 7,021 |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス | 3 | - | - |
| 学情 | 3 | 3 | 6,688 |
| スタジオアリス | 3 | 3 | 6,180 |
| シミックホールディングス | 3 | - | - |
| NJS | 2 | 2 | 6,249 |
| 総合警備保障 | 24 | 101 | 82,702 |
| カカクコム | 48 | 40 | 70,101 |
| アイロムグループ | 2 | - | - |
| セントケア・ホールディング | 5 | 6 | 6,157 |
| ルネサンス | 5 | 6 | 7,534 |
| ディップ | 11 | 9 | 25,110 |
| デジタルホールディングス | 5 | - | - |
| 新日本科学 | 6 | 5 | 9,025 |
| ベネフィット・ワン | 30 | 21 | 45,982 |
| エムスリー | 129 | 120 | 252,840 |
| アウトソーシング | 39 | 39 | 67,740 |
| ウエルネット | 7 | - | - |
| ワールドホールディングス | 2 | 2 | 6,750 |
| ディー・エヌ・エー | 27 | 21 | 27,287 |
| 博報堂DYホールディングス | 83 | 77 | 112,276 |
| ぐるなび | 12 | 23 | 7,120 |
| ジャパンバストレスキューシステム | 5 | - | - |
| ファンコミュニケーションズ | 12 | 15 | 6,455 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ライク | 2 | 4 | 6,581 |
| A o b a - B B T | 11 | - | - |
| エスプール | 18 | 20 | 6,457 |
| WDBホールディングス | 3 | 3 | 7,182 |
| アドウェイズ | 9 | 12 | 5,790 |
| バリューコマース | 4 | 5 | 6,153 |
| インフォマート | 68 | 63 | 24,813 |
| J Pホールディングス | 18 | 15 | 7,410 |
| C Lホールディングス | 6 | - | - |
| プレステージ・インターナショナル | 27 | 28 | 17,271 |
| アミューズ | 3 | 4 | 6,056 |
| ドリームインキュベータ | 2 | 2 | 6,468 |
| クイック | 5 | 4 | 10,101 |
| T A C | 22 | - | - |
| 電通グループ | 64 | 59 | 258,348 |
| びあ | 2 | 2 | 6,594 |
| イオンファンタジー | 2 | 2 | 6,220 |
| シーティーエス | 7 | 9 | 6,880 |
| H. U. グループホールディングス | 19 | 17 | 48,594 |
| アルプス技研 | 5 | 5 | 17,057 |
| 日本空調サービス | 7 | 7 | 6,727 |
| オリエンタルランド | 69 | 322 | 1,738,597 |
| ダスキン | 14 | 13 | 45,954 |
| 明光ネットワークジャパン | 8 | 8 | 6,505 |
| ファルコホールディングス | 3 | 2 | 6,664 |
| 秀英予備校 | 11 | - | - |
| ラウンドワン | 54 | 57 | 39,835 |
| リゾートトラスト | 25 | 26 | 67,190 |
| ビー・エム・エル | 8 | 7 | 20,580 |
| りらいあコミュニケーションズ | 10 | - | - |
| リソー教育 | 29 | 31 | 7,246 |
| 早稲田アカデミー | 4 | - | - |
| ユー・エス・エス | 67 | 68 | 178,318 |
| 東京個別指導学院 | 9 | 14 | 6,375 |
| サイバーエージェント | 156 | 134 | 141,704 |
| 楽天グループ | 302 | 522 | 391,643 |
| クリーク・アンド・リバー社 | 3 | 3 | 6,198 |
| S B I グローバルアセットマネジメント | 10 | 11 | 8,782 |
| テー・オー・ダブリュー | 16 | 18 | 6,822 |
| 山田コンサルティンググループ | 4 | 3 | 6,192 |
| セントラルスポーツ | 2 | 2 | 6,357 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フルキャストホールディングス | 6 | 5 | 8,572 |
| エン・ジャパン | 11 | 9 | 27,343 |
| テクノプロ・ホールディングス | 43 | 35 | 117,453 |
| インターワークス | 12 | - | - |
| アイ・アルジャパンホールディングス | 3 | 4 | 5,719 |
| K e e P e r 技研 | 4 | 3 | 25,156 |
| 三機サービス | 4 | - | - |
| イー・ガーディアン | 2 | 4 | 5,504 |
| リブセンス | 1 | - | - |
| ジャパンマテリアル | 20 | 18 | 49,159 |
| ベクトル | 10 | 7 | 9,420 |
| ウチヤマホールディングス | 15 | - | - |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 5 | 5 | 7,282 |
| キャリアリンク | 2 | 2 | 6,364 |
| I B J | 5 | 9 | 5,391 |
| アサンテ | 3 | 3 | 6,399 |
| バリューHR | 5 | 5 | 7,239 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 6 | 4 | 12,215 |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 4 | 6 | 6,502 |
| シグマシス・ホールディングス | 9 | 8 | 13,587 |
| ウィルグループ | 5 | 5 | 6,079 |
| メドピア | 5 | 9 | 7,443 |
| リクルートホールディングス | 484 | 451 | 2,657,568 |
| エラン | 8 | 8 | 7,743 |
| 日本郵政 | 858 | 716 | 1,006,977 |
| ベルシステム24ホールディングス | 8 | 6 | 11,615 |
| 鎌倉新書 | 7 | 10 | 5,990 |
| SMN | 8 | - | - |
| エアトリ | 4 | 4 | 7,236 |
| アトラエ | 5 | 9 | 4,557 |
| ストライク | 3 | 2 | 13,468 |
| ソラスト | 18 | 16 | 9,021 |
| インソース | 16 | 13 | 10,560 |
| バイカレント・コンサルティング | 51 | 44 | 142,374 |
| Orchestra Holdings | 2 | 6 | 7,125 |
| アイモバイル | 4 | 14 | 6,570 |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 23 | 19 | 44,837 |
| GAMEWITH | 10 | - | - |
| ウェルビー | 6 | - | - |
| ミダックホールディングス | 4 | 3 | 6,090 |
| キュービネットホールディングス | 3 | 4 | 5,636 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------------------|---------|-----|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| RPAホールディングス | 18 | 24 | 6,548 |
| マネジメントソリューションズ | 3 | 2 | 7,774 |
| プロレド・パートナーズ and factory | 10 | 17 | 6,301 |
| アンビスホールディングス | – | 6 | 16,932 |
| カーブスホールディングス | 20 | 16 | 12,267 |
| フォーラムエンジニアリング | 5 | 8 | 7,984 |
| ダイレクトマーケティングミックス ポピンズ | 7 | 14 | 4,847 |
| LITALICO | 3 | 5 | 8,047 |
| リログループ | 5 | 4 | 9,987 |
| 東祥 | 36 | 30 | 39,909 |
| ID&E ホールディングス | 4 | 7 | 5,621 |
| TREホールディングス | – | 3 | 13,764 |
| 人・夢・技術グループ | 13 | 11 | 14,402 |
| 大栄環境 | 2 | 3 | 5,817 |
| 日本管財ホールディングス | – | 11 | 29,403 |
| M&A総研ホールディングス | – | 6 | 16,531 |
| エイチ・アイ・エス | – | 2 | 19,633 |
| ラックランド | 17 | 17 | 29,824 |
| 共立メンテナンス | 2 | 2 | 7,257 |
| イチネンホールディングス | 11 | 9 | 60,537 |
| 建設技術研究所 | 6 | 6 | 10,809 |
| スペース | 3 | 3 | 18,755 |
| 燦ホールディングス | 5 | 6 | 6,606 |
| 東京テアトル | 2 | 5 | 5,916 |
| タナベコンサルティンググループ | 4 | – | – |
| ナガワ | 7 | – | – |
| 東京都競馬 | 1 | 1 | 13,585 |
| カナモト | 5 | 5 | 21,420 |
| ニシオホールディングス | 12 | 9 | 27,767 |
| トランス・コスモス | 6 | 5 | 21,916 |
| 乃村工藝社 | 8 | 7 | 22,724 |
| 藤田観光 | 28 | 26 | 23,354 |
| KNT-CTホールディングス | 2 | 2 | 15,816 |
| | 3 | – | – |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-------------------|---------|--------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本管財 | 6 | – | – |
| トーカイ | 5 | 5 | 11,545 |
| セコム | 66 | 62 | 686,205 |
| セントラル警備保障 | 3 | 3 | 8,619 |
| 丹青社 | 12 | 11 | 9,428 |
| メイテックグループホールディングス | 26 | 21 | 66,269 |
| 応用地質 | 6 | 5 | 13,366 |
| 船井総研ホールディングス | 13 | 12 | 33,794 |
| 進学会ホールディングス | 14 | – | – |
| 学究社 | 2 | 3 | 6,479 |
| ベネッセホールディングス | 24 | 20 | 53,207 |
| イオンディライト | 7 | 6 | 22,977 |
| ナック | 5 | 12 | 6,348 |
| ダイセキ | 13 | 12 | 49,662 |
| ステップ | 2 | 1 | 2,059 |
| 合計 | 株数・金額 | 74,409 | 91,102 221,415,671 |
| | 銘柄数<比率> | 1,821 | 1,708 <98.8%> |

- (注1) 銘柄欄の()内は、当期末における国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。
- (注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。
- (注3) 株数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 当期末 | |
|----------|-------|-----|
| | 買建額 | 売建額 |
| | 百万円 | 百万円 |
| 国内 TOPIX | 2,164 | – |

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2024年2月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 221,415,671 | 98.5 |
| コール・ローン等、その他 | 3,408,070 | 1.5 |
| 投資信託財産総額 | 224,823,742 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月20日現在)

| 項目 | | 当期末 |
|----------------------|----------|-------------------------|
| (A)資産 | 産 | 224,657,797,609円 |
| コール・ローン等 | | 2,826,521,934 |
| 株式(評価額) | | 221,415,671,790 |
| 未収入金 | | 160,569,900 |
| 未収配当金 | | 313,885,151 |
| 差入委託証拠金 | △ | 58,851,166 |
| (B)負債 | 債 | 655,207,961 |
| 未払解約金 | | 655,205,252 |
| その他未払費用 | | 2,709 |
| (C)純資産総額(A-B) | | 224,002,589,648 |
| 元本 | | 71,936,737,810 |
| 次期繰越損益金 | | 152,065,851,838 |
| (D)受益権総口数 | | 71,936,737,810口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | | 31,139円 |

(注1) 期首元本額 81,219,744,591円
 期中追加設定元本額 19,799,367,159円
 期中一部解約元本額 29,082,373,940円

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

| | |
|---|-----------------|
| ニッセイTOPIXオープン | 5,323,486,715円 |
| ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定) | 3,051,320,322円 |
| ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定) | 3,075,264円 |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) | 1,981,344,929円 |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(標準型) | 7,282,848,201円 |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) | 6,199,571,181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) | 2,308,680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) | 3,096,064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) | 9,707,823円 |
| D Cニッセイ国内株式インデックス | 3,111,356,570円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド | 24,329,146,106円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型) | 3,680,342,973円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2055 | 383,217,945円 |
| D Cニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 223,827,805円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2045 | 437,206,012円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2035 | 600,148,942円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2025 | 32,113,164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) | 118,398,630円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式) | 10,306,061円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート) | 13,314,440円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券) | 4,770,388円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券) | 9,699,744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) | 26,586,216円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2060 | 309,317,472円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2050 | 197,083,804円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2040 | 372,094,171円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2030 | 169,589,950円 |
| ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定) | 13,880,206,106円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型/バスケ) | 25,302,789円 |
| ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(安定型) | 34,366円 |
| ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(積極型) | 75,807円 |
| F Wニッセイ国内株インデックス | 68,973,915円 |
| D Cニッセイターゲットデートファンド2065 | 75,173,314円 |
| D Cニッセイ全世界株式インデックスコレクト | 1,691,941円 |

損益の状況

当期(2023年2月21日~2024年2月20日)

| 項目 | 当期 |
|--------------------------|-------------------------|
| (A)配当等収益 | 4,707,912,660円 |
| 受取配当金 | 4,701,904,210 |
| 受取利息 | 101,590 |
| その他収益 | 7,843,432 |
| 支払利息 | △ 1,936,572 |
| (B)有価証券売買損益 | 52,294,376,005 |
| 売買益 | 56,656,806,815 |
| 売買損 | △ 4,362,430,810 |
| (C)先物取引等損益 | 1,223,645,000 |
| 取引益 | 1,532,014,850 |
| 取引損 | △ 308,369,850 |
| (D)信託報酬等 | △ 86,233 |
| (E)当期損益金(A+B+C+D) | 58,225,847,432 |
| (F)前期繰越損益金 | 106,208,290,354 |
| (G)追加信託差損益金 | 33,039,622,448 |
| (H)解約差損益金 | △ 45,407,908,396 |
| (I)合計(E+F+G+H) | 152,065,851,838 |
| 次期繰越損益金(I) | 152,065,851,838 |

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (G)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。

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

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

運用報告書

第 7 期

(計算期間：2022年3月11日～2023年3月10日)

運用方針

- ① 国内の公社債に投資し、NOMURA－BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

主要運用 対象

国内の公社債

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。
・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りま



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年3月11日～2023年3月10日

国内債券市況



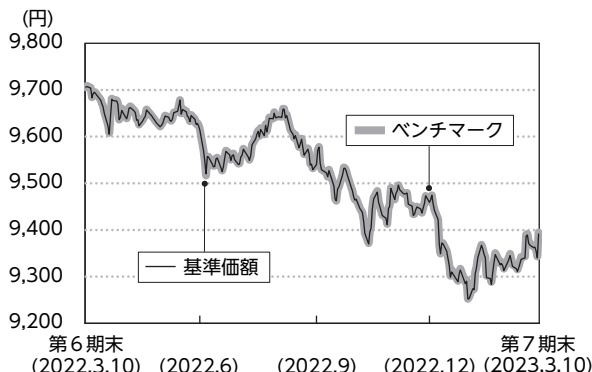
(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

期初は各国中央銀行の利上げ発表や日銀の金融政策修正期待も高まり、金利は上昇しました。4月以降はおおむね横ばいとなりましたが、7月下旬に日銀が金融政策の現状維持を決定したことに加え、海外の景気後退懸念も高まったことから金利は低下しました。

8月中旬以降はパウエルFRB議長による金融引き締めに向きな発言や、9月に開催されたECB理事会で利上げが実施されたことを受けて海外金利が上昇し、国内金利も上昇しました。10月以降はおおむね横ばいでの推移となりましたが、12月中旬に日銀が金融政策決定会合で長期金利の変動許容幅を従来のプラスマイナス0.25%からプラスマイナス0.5%程度に拡大したことを受けて金利は上昇しました。1月中旬には日銀が金融緩和を継続する姿勢を示したことから金利は一時低下したものの、1月下旬には再度上昇し、以降おおむね横ばいとなりました。当期末にかけては日銀の金融緩和姿勢が改めて示され金利は低下したものの、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

< 上昇要因 >

- ・ 2022年7月から8月中旬にかけて、日銀による金融政策の現状維持が決定されたことや海外の景気減速懸念を受けて金利が低下（債券価格は上昇）したこと

< 下落要因 >

- ・ 8月中旬から10月中旬にかけて、パウエル米連邦準備制度理事会（F R B）議長による金融引き締めに向けた発言や欧州中央銀行（E C B）の利上げを受けて金利が上昇したこと
- ・ 12月中旬から2023年1月中旬にかけて、日銀が金融政策決定会合（12月中旬開催）において長期金利の変動許容幅を従来のプラスマイナス0.25%からプラスマイナス0.5%程度に拡大したことを受けて金利が上昇したこと

ポートフォリオ

ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用して、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比等を調整し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

当期も上記クオンツモデルに基づき、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比（短期・中期・長期・超長期別の構成比）がベンチマークに対しおおむね中立となるよう、適宜売買を実施しました。

(注) デュレーションとは、債券投資におけるリスク度合いを表す主要な指標の一つで、金利変動に対する債券価格の反応の大きさ（リスクの大きさ）を表します。デュレーションが長いほど、金利変動に対する債券価格の反応は大きくなります。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-3.2%となり、ベンチマーク騰落率（-3.2%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

引き続き、クオンツモデルに基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

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 |
| 3期(2019年3月11日) | 9,828 | 1.5 | 9,825 | 1.4 | 99.2 | 91,526 |
| 4期(2020年3月10日) | 9,979 | 1.5 | 9,970 | 1.5 | 99.3 | 82,399 |
| 5期(2021年3月10日) | 9,774 | △2.1 | 9,767 | △2.0 | 99.2 | 80,558 |
| 6期(2022年3月10日) | 9,706 | △0.7 | 9,699 | △0.7 | 99.2 | 78,005 |
| 7期(2023年3月10日) | 9,391 | △3.2 | 9,388 | △3.2 | 99.4 | 66,191 |

(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3月10日 | 円 9,706 | % - | 9,699 | % - | % 99.2 |
| 3月末 | 9,680 | △0.3 | 9,674 | △0.3 | 99.3 |
| 4月末 | 9,657 | △0.5 | 9,651 | △0.5 | 99.2 |
| 5月末 | 9,643 | △0.6 | 9,636 | △0.6 | 99.1 |
| 6月末 | 9,553 | △1.6 | 9,549 | △1.6 | 99.2 |
| 7月末 | 9,615 | △0.9 | 9,611 | △0.9 | 99.2 |
| 8月末 | 9,594 | △1.2 | 9,589 | △1.1 | 99.1 |
| 9月末 | 9,492 | △2.2 | 9,486 | △2.2 | 99.2 |
| 10月末 | 9,481 | △2.3 | 9,477 | △2.3 | 99.2 |
| 11月末 | 9,434 | △2.8 | 9,428 | △2.8 | 99.1 |
| 12月末 | 9,310 | △4.1 | 9,308 | △4.0 | 99.2 |
| 2023年1月末 | 9,283 | △4.4 | 9,282 | △4.3 | 99.2 |
| 2月末 | 9,386 | △3.3 | 9,383 | △3.3 | 99.1 |
| (期末)2023年3月10日 | 9,391 | △3.2 | 9,388 | △3.2 | 99.4 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2022年3月11日～2023年3月10日

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------|-----|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| その他費用 | 0円 | 0.000% | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| (その他) | (0) | (0.000) | <ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 0 | 0.000 | |

(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（9,511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3月11日～2023年3月10日

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|-------|------------|------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 16,624,698 | 24,353,052 |
| | 地方債証券 | 944,956 | 1,828,954 |
| | 特殊債券 | 647,263 | 709,105 |
| | 社債券 | 1,599,691 | (165,366) |
| | | 1,599,691 | 1,310,592 |

(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) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(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3月11日～2023年3月10日

公社債

| 買付 | | 売付 | |
|------------------|---------|-----------------|---------|
| 銘柄 | 金額 | 銘柄 | 金額 |
| | 千円 | | 千円 |
| 第368回 利付国債 (10年) | 565,629 | 第430回 利付国債 (2年) | 633,831 |
| 第149回 利付国債 (5年) | 455,772 | 第431回 利付国債 (2年) | 632,826 |
| 第434回 利付国債 (2年) | 450,382 | 第432回 利付国債 (2年) | 600,857 |
| 第153回 利付国債 (5年) | 406,841 | 第429回 利付国債 (2年) | 600,784 |
| 第142回 利付国債 (5年) | 406,789 | 第428回 利付国債 (2年) | 599,783 |
| 第441回 利付国債 (2年) | 400,508 | 第3回 利付国債 (40年) | 523,659 |
| 第143回 利付国債 (5年) | 378,243 | 第427回 利付国債 (2年) | 516,702 |
| 第437回 利付国債 (2年) | 350,693 | 第426回 利付国債 (2年) | 513,599 |
| 第438回 利付国債 (2年) | 350,661 | 第423回 利付国債 (2年) | 510,402 |
| 第436回 利付国債 (2年) | 350,600 | 第433回 利付国債 (2年) | 500,735 |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2023年3月10日現在

国内(邦貨建)公社債

| 区分 | 額面金額 | 評価額 | 組入比率 | 当期末 | | | |
|------------------|----------------------------|----------------------------|----------------|-----------------|----------------|----------------|--------------|
| | | | | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | 千円 | 千円 | % | % | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 国債証券 | 50,701,000 (18,982,000) | 51,151,638 (17,952,162) | 77.3 (27.1) | - | 55.2 (19.2) | 16.5 (4.2) | 5.6 (3.7) |
| 地方債証券 | 3,568,000 (3,568,000) | 3,660,443 (3,660,443) | 5.5 (5.5) | - | 4.4 (4.4) | 0.5 (0.5) | 0.7 (0.7) |
| 特殊債券 (除く金融債券) | 4,944,100 (4,944,100) | 5,065,603 (5,065,603) | 7.7 (7.7) | - | 5.5 (5.5) | 1.4 (1.4) | 0.8 (0.8) |
| 金融債券 | 600,000 (600,000) | 599,343 (599,343) | 0.9 (0.9) | - | - | 0.8 (0.8) | 0.2 (0.2) |
| 社債券 | 5,300,000 (5,300,000) | 5,306,786 (5,306,786) | 8.0 (8.0) | - | 1.4 (1.4) | 4.1 (4.1) | 2.6 (2.6) |
| 合計 | 65,113,100 (33,394,100) | 65,783,815 (32,584,339) | 99.4 (49.2) | - | 66.5 (30.5) | 23.1 (10.8) | 9.8 (7.9) |

(注1) 評価については、原則として証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。ただし、残存期間1年以内の公社債については、償却原価法により評価しています。以下同じです。

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(国内公社債の内訳)

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|-----------------|------------------|-------------|-------------|---------|---------|
| | | % | | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | 第435回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2024/ 4 / 1 | 70,000 | 70,070 |
| | 第436回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2024/ 5 / 1 | 65,000 | 65,066 |
| | 第437回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2024/ 6 / 1 | 74,000 | 74,080 |
| | 第438回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2024/ 7 / 1 | 64,000 | 64,070 |
| | 第439回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2024/ 8 / 1 | 71,000 | 71,078 |
| | 第440回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2024/ 9 / 1 | 73,000 | 73,080 |
| | 第441回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2024/10/ 1 | 400,000 | 400,432 |
| | 第442回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2024/11/ 1 | 148,000 | 148,168 |
| | 第443回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2024/12/ 1 | 200,000 | 200,240 |
| | 第444回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2025/ 1 / 1 | 350,000 | 350,441 |
| | 第445回 利付国債 (2年) | 0.0050 | 2025/ 2 / 1 | 200,000 | 200,226 |
| | 第140回 利付国債 (5年) | 0.1000 | 2024/ 6 /20 | 169,000 | 169,387 |
| | 第141回 利付国債 (5年) | 0.1000 | 2024/ 9 /20 | 171,000 | 171,429 |
| | 第142回 利付国債 (5年) | 0.1000 | 2024/12/20 | 405,000 | 406,146 |
| | 第143回 利付国債 (5年) | 0.1000 | 2025/ 3 /20 | 367,000 | 368,075 |
| | 第144回 利付国債 (5年) | 0.1000 | 2025/ 6 /20 | 424,000 | 425,297 |
| | 第145回 利付国債 (5年) | 0.1000 | 2025/ 9 /20 | 290,000 | 290,913 |
| | 第146回 利付国債 (5年) | 0.1000 | 2025/12/20 | 80,000 | 80,254 |
| | 第149回 利付国債 (5年) | 0.0050 | 2026/ 9 /20 | 456,000 | 455,197 |
| | 第150回 利付国債 (5年) | 0.0050 | 2026/12/20 | 287,000 | 286,187 |
| | 第151回 利付国債 (5年) | 0.0050 | 2027/ 3 /20 | 63,000 | 62,747 |
| | 第152回 利付国債 (5年) | 0.1000 | 2027/ 3 /20 | 208,000 | 207,956 |
| | 第153回 利付国債 (5年) | 0.0050 | 2027/ 6 /20 | 408,000 | 405,833 |
| | 第155回 利付国債 (5年) | 0.3000 | 2027/12/20 | 167,000 | 167,908 |
| | 第 1 回 利付国債 (40年) | 2.4000 | 2048/ 3 /20 | 82,000 | 100,258 |
| | 第 2 回 利付国債 (40年) | 2.2000 | 2049/ 3 /20 | 106,000 | 125,034 |
| | 第 3 回 利付国債 (40年) | 2.2000 | 2050/ 3 /20 | 97,000 | 114,800 |
| | 第 4 回 利付国債 (40年) | 2.2000 | 2051/ 3 /20 | 136,000 | 161,304 |
| | 第 5 回 利付国債 (40年) | 2.0000 | 2052/ 3 /20 | 132,000 | 151,149 |
| | 第 6 回 利付国債 (40年) | 1.9000 | 2053/ 3 /20 | 151,000 | 168,559 |
| | 第 7 回 利付国債 (40年) | 1.7000 | 2054/ 3 /20 | 166,000 | 177,151 |
| | 第 8 回 利付国債 (40年) | 1.4000 | 2055/ 3 /20 | 180,000 | 178,225 |
| | 第 9 回 利付国債 (40年) | 0.4000 | 2056/ 3 /20 | 232,000 | 168,394 |
| | 第10回 利付国債 (40年) | 0.9000 | 2057/ 3 /20 | 211,000 | 179,850 |
| 第11回 利付国債 (40年) | 0.8000 | 2058/ 3 /20 | 174,000 | 142,918 | |
| 第12回 利付国債 (40年) | 0.5000 | 2059/ 3 /20 | 106,000 | 77,669 | |
| 第13回 利付国債 (40年) | 0.5000 | 2060/ 3 /20 | 170,000 | 124,355 | |
| 第14回 利付国債 (40年) | 0.7000 | 2061/ 3 /20 | 236,000 | 184,049 | |

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|------------------|-------------------|-------------|-------------|---------|---------|
| | | ％ | | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | 第 15 回 利付国債 (40年) | 1.0000 | 2062/ 3 /20 | 145,000 | 123,654 |
| | 第334回 利付国債 (10年) | 0.6000 | 2024/ 6 /20 | 243,000 | 245,101 |
| | 第335回 利付国債 (10年) | 0.5000 | 2024/ 9 /20 | 152,000 | 153,308 |
| | 第336回 利付国債 (10年) | 0.5000 | 2024/12/20 | 205,000 | 207,035 |
| | 第337回 利付国債 (10年) | 0.3000 | 2024/12/20 | 348,000 | 350,220 |
| | 第338回 利付国債 (10年) | 0.4000 | 2025/ 3 /20 | 506,000 | 510,548 |
| | 第339回 利付国債 (10年) | 0.4000 | 2025/ 6 /20 | 377,000 | 380,724 |
| | 第340回 利付国債 (10年) | 0.4000 | 2025/ 9 /20 | 458,000 | 462,914 |
| | 第341回 利付国債 (10年) | 0.3000 | 2025/12/20 | 480,000 | 484,190 |
| | 第342回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2026/ 3 /20 | 412,000 | 413,178 |
| | 第343回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2026/ 6 /20 | 332,000 | 332,813 |
| | 第344回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2026/ 9 /20 | 325,000 | 325,513 |
| | 第345回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2026/12/20 | 472,000 | 472,354 |
| | 第346回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2027/ 3 /20 | 328,000 | 327,931 |
| | 第347回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2027/ 6 /20 | 272,000 | 271,651 |
| | 第348回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2027/ 9 /20 | 338,000 | 337,087 |
| | 第349回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2027/12/20 | 518,000 | 515,912 |
| | 第350回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2028/ 3 /20 | 602,000 | 598,707 |
| | 第351回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2028/ 6 /20 | 445,000 | 441,982 |
| | 第352回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2028/ 9 /20 | 370,000 | 366,873 |
| | 第353回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2028/12/20 | 353,000 | 349,586 |
| | 第354回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2029/ 3 /20 | 333,000 | 329,353 |
| | 第355回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2029/ 6 /20 | 339,000 | 334,721 |
| | 第356回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2029/ 9 /20 | 380,000 | 374,657 |
| | 第357回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2029/12/20 | 481,000 | 473,510 |
| | 第358回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2030/ 3 /20 | 428,000 | 420,668 |
| | 第359回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2030/ 6 /20 | 508,000 | 497,403 |
| | 第360回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2030/ 9 /20 | 522,000 | 509,445 |
| | 第361回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2030/12/20 | 520,000 | 506,329 |
| | 第362回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2031/ 3 /20 | 466,000 | 452,672 |
| | 第363回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2031/ 6 /20 | 499,000 | 483,526 |
| | 第364回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2031/ 9 /20 | 584,000 | 564,903 |
| | 第365回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2031/12/20 | 562,000 | 543,105 |
| 第366回 利付国債 (10年) | 0.2000 | 2032/ 3 /20 | 286,000 | 278,955 | |
| 第367回 利付国債 (10年) | 0.2000 | 2032/ 6 /20 | 205,000 | 202,601 | |
| 第368回 利付国債 (10年) | 0.2000 | 2032/ 9 /20 | 552,000 | 560,909 | |
| 第 1 回 利付国債 (30年) | 2.8000 | 2029/ 9 /20 | 6,000 | 6,961 | |
| 第 2 回 利付国債 (30年) | 2.4000 | 2030/ 2 /20 | 64,000 | 73,015 | |
| 第 3 回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2030/ 5 /20 | 81,000 | 92,039 | |

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|------|-------------------|--------|-------------|---------|---------|
| | | % | | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | 第 4 回 利付国債 (30年) | 2.9000 | 2030/11/20 | 40,000 | 47,460 |
| | 第 5 回 利付国債 (30年) | 2.2000 | 2031/ 5 /20 | 52,000 | 59,207 |
| | 第 6 回 利付国債 (30年) | 2.4000 | 2031/11/20 | 39,000 | 45,322 |
| | 第 7 回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2032/ 5 /20 | 30,000 | 34,788 |
| | 第 8 回 利付国債 (30年) | 1.8000 | 2032/11/22 | 61,000 | 68,143 |
| | 第 9 回 利付国債 (30年) | 1.4000 | 2032/12/20 | 77,000 | 83,146 |
| | 第 10 回 利付国債 (30年) | 1.1000 | 2033/ 3 /20 | 36,000 | 37,772 |
| | 第 11 回 利付国債 (30年) | 1.7000 | 2033/ 6 /20 | 25,000 | 27,714 |
| | 第 12 回 利付国債 (30年) | 2.1000 | 2033/ 9 /20 | 73,000 | 83,921 |
| | 第 13 回 利付国債 (30年) | 2.0000 | 2033/12/20 | 14,000 | 15,958 |
| | 第 14 回 利付国債 (30年) | 2.4000 | 2034/ 3 /20 | 25,000 | 29,574 |
| | 第 15 回 利付国債 (30年) | 2.5000 | 2034/ 6 /20 | 41,000 | 48,991 |
| | 第 16 回 利付国債 (30年) | 2.5000 | 2034/ 9 /20 | 51,000 | 61,016 |
| | 第 17 回 利付国債 (30年) | 2.4000 | 2034/12/20 | 21,000 | 24,923 |
| | 第 18 回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2035/ 3 /20 | 63,000 | 74,092 |
| | 第 19 回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2035/ 6 /20 | 52,000 | 61,228 |
| | 第 20 回 利付国債 (30年) | 2.5000 | 2035/ 9 /20 | 59,000 | 70,941 |
| | 第 21 回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2035/12/20 | 60,000 | 70,798 |
| | 第 22 回 利付国債 (30年) | 2.5000 | 2036/ 3 /20 | 72,000 | 86,841 |
| | 第 23 回 利付国債 (30年) | 2.5000 | 2036/ 6 /20 | 73,000 | 88,152 |
| | 第 24 回 利付国債 (30年) | 2.5000 | 2036/ 9 /20 | 43,000 | 51,983 |
| | 第 25 回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2036/12/20 | 51,000 | 60,415 |
| | 第 26 回 利付国債 (30年) | 2.4000 | 2037/ 3 /20 | 108,000 | 129,455 |
| | 第 27 回 利付国債 (30年) | 2.5000 | 2037/ 9 /20 | 132,000 | 160,362 |
| | 第 28 回 利付国債 (30年) | 2.5000 | 2038/ 3 /20 | 177,000 | 215,180 |
| | 第 29 回 利付国債 (30年) | 2.4000 | 2038/ 9 /20 | 209,000 | 251,355 |
| | 第 30 回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2039/ 3 /20 | 226,000 | 268,417 |
| | 第 31 回 利付国債 (30年) | 2.2000 | 2039/ 9 /20 | 193,000 | 226,321 |
| | 第 32 回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2040/ 3 /20 | 242,000 | 287,336 |
| | 第 33 回 利付国債 (30年) | 2.0000 | 2040/ 9 /20 | 273,000 | 310,922 |
| | 第 34 回 利付国債 (30年) | 2.2000 | 2041/ 3 /20 | 252,000 | 294,794 |
| | 第 35 回 利付国債 (30年) | 2.0000 | 2041/ 9 /20 | 281,000 | 319,668 |
| | 第 36 回 利付国債 (30年) | 2.0000 | 2042/ 3 /20 | 271,000 | 308,389 |
| | 第 37 回 利付国債 (30年) | 1.9000 | 2042/ 9 /20 | 289,000 | 323,555 |
| | 第 38 回 利付国債 (30年) | 1.8000 | 2043/ 3 /20 | 191,000 | 210,346 |
| | 第 39 回 利付国債 (30年) | 1.9000 | 2043/ 6 /20 | 175,000 | 195,770 |
| | 第 40 回 利付国債 (30年) | 1.8000 | 2043/ 9 /20 | 145,000 | 159,588 |
| | 第 41 回 利付国債 (30年) | 1.7000 | 2043/12/20 | 141,000 | 152,594 |
| | 第 42 回 利付国債 (30年) | 1.7000 | 2044/ 3 /20 | 155,000 | 167,727 |

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|-------------------|-------------------|-------------|-------------|---------|---------|
| | | % | | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | 第 43 回 利付国債 (30年) | 1.7000 | 2044/ 6 /20 | 123,000 | 133,082 |
| | 第 44 回 利付国債 (30年) | 1.7000 | 2044/ 9 /20 | 127,000 | 137,391 |
| | 第 45 回 利付国債 (30年) | 1.5000 | 2044/12/20 | 139,000 | 145,070 |
| | 第 46 回 利付国債 (30年) | 1.5000 | 2045/ 3 /20 | 201,000 | 209,675 |
| | 第 47 回 利付国債 (30年) | 1.6000 | 2045/ 6 /20 | 185,000 | 196,449 |
| | 第 48 回 利付国債 (30年) | 1.4000 | 2045/ 9 /20 | 191,000 | 195,177 |
| | 第 49 回 利付国債 (30年) | 1.4000 | 2045/12/20 | 190,000 | 194,018 |
| | 第 50 回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2046/ 3 /20 | 197,000 | 177,502 |
| | 第 51 回 利付国債 (30年) | 0.3000 | 2046/ 6 /20 | 155,000 | 124,091 |
| | 第 52 回 利付国債 (30年) | 0.5000 | 2046/ 9 /20 | 197,000 | 165,040 |
| | 第 53 回 利付国債 (30年) | 0.6000 | 2046/12/20 | 184,000 | 157,463 |
| | 第 54 回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2047/ 3 /20 | 195,000 | 174,439 |
| | 第 55 回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2047/ 6 /20 | 182,000 | 162,364 |
| | 第 56 回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2047/ 9 /20 | 186,000 | 165,474 |
| | 第 57 回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2047/12/20 | 191,000 | 169,453 |
| | 第 58 回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2048/ 3 /20 | 224,000 | 197,995 |
| | 第 59 回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2048/ 6 /20 | 173,000 | 148,864 |
| | 第 60 回 利付国債 (30年) | 0.9000 | 2048/ 9 /20 | 158,000 | 142,340 |
| | 第 61 回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2048/12/20 | 159,000 | 135,987 |
| | 第 62 回 利付国債 (30年) | 0.5000 | 2049/ 3 /20 | 170,000 | 137,540 |
| | 第 63 回 利付国債 (30年) | 0.4000 | 2049/ 6 /20 | 182,000 | 142,791 |
| | 第 64 回 利付国債 (30年) | 0.4000 | 2049/ 9 /20 | 190,000 | 148,650 |
| | 第 65 回 利付国債 (30年) | 0.4000 | 2049/12/20 | 117,000 | 91,455 |
| | 第 66 回 利付国債 (30年) | 0.4000 | 2050/ 3 /20 | 154,000 | 119,930 |
| | 第 67 回 利付国債 (30年) | 0.6000 | 2050/ 6 /20 | 193,000 | 158,460 |
| | 第 68 回 利付国債 (30年) | 0.6000 | 2050/ 9 /20 | 195,000 | 159,720 |
| | 第 69 回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2050/12/20 | 196,000 | 164,773 |
| | 第 70 回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2051/ 3 /20 | 189,000 | 158,544 |
| | 第 71 回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2051/ 6 /20 | 192,000 | 160,707 |
| | 第 72 回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2051/ 9 /20 | 194,000 | 162,507 |
| 第 73 回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2051/12/20 | 174,000 | 145,437 | |
| 第 74 回 利付国債 (30年) | 1.0000 | 2052/ 3 /20 | 187,000 | 169,465 | |
| 第 75 回 利付国債 (30年) | 1.3000 | 2052/ 6 /20 | 194,000 | 189,380 | |
| 第 76 回 利付国債 (30年) | 1.4000 | 2052/ 9 /20 | 183,000 | 183,000 | |
| 第 77 回 利付国債 (30年) | 1.6000 | 2052/12/20 | 123,000 | 128,439 | |
| 第 70 回 利付国債 (20年) | 2.4000 | 2024/ 6 /20 | 41,000 | 42,293 | |
| 第 72 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2024/ 9 /20 | 54,000 | 55,782 | |
| 第 73 回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2024/12/20 | 105,000 | 108,837 | |
| 第 74 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2024/12/20 | 64,000 | 66,452 | |

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|------|-------------------|--------|-------------|---------|---------|
| | | % | | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | 第 75 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2025/ 3 /20 | 50,000 | 52,167 |
| | 第 76 回 利付国債 (20年) | 1.9000 | 2025/ 3 /20 | 68,000 | 70,672 |
| | 第 77 回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2025/ 3 /20 | 52,000 | 54,148 |
| | 第 78 回 利付国債 (20年) | 1.9000 | 2025/ 6 /20 | 74,000 | 77,254 |
| | 第 79 回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2025/ 6 /20 | 61,000 | 63,821 |
| | 第 80 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2025/ 6 /20 | 74,000 | 77,590 |
| | 第 81 回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2025/ 9 /20 | 49,000 | 51,504 |
| | 第 82 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2025/ 9 /20 | 89,000 | 93,774 |
| | 第 83 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2025/12/20 | 49,000 | 51,874 |
| | 第 84 回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2025/12/20 | 93,000 | 98,197 |
| | 第 85 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2026/ 3 /20 | 112,000 | 119,082 |
| | 第 86 回 利付国債 (20年) | 2.3000 | 2026/ 3 /20 | 119,000 | 127,243 |
| | 第 87 回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2026/ 3 /20 | 98,000 | 104,493 |
| | 第 88 回 利付国債 (20年) | 2.3000 | 2026/ 6 /20 | 154,000 | 165,449 |
| | 第 89 回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2026/ 6 /20 | 100,000 | 107,109 |
| | 第 90 回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2026/ 9 /20 | 189,000 | 203,254 |
| | 第 91 回 利付国債 (20年) | 2.3000 | 2026/ 9 /20 | 129,000 | 139,183 |
| | 第 92 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2026/12/20 | 289,000 | 311,013 |
| | 第 93 回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2027/ 3 /20 | 130,000 | 139,859 |
| | 第 94 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2027/ 3 /20 | 172,000 | 185,732 |
| | 第 95 回 利付国債 (20年) | 2.3000 | 2027/ 6 /20 | 221,000 | 241,420 |
| | 第 96 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2027/ 6 /20 | 134,000 | 145,242 |
| | 第 97 回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2027/ 9 /20 | 196,000 | 214,002 |
| | 第 98 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2027/ 9 /20 | 120,000 | 130,483 |
| | 第 99 回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2027/12/20 | 257,000 | 280,348 |
| | 第100回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2028/ 3 /20 | 116,000 | 127,528 |
| | 第101回 利付国債 (20年) | 2.4000 | 2028/ 3 /20 | 56,000 | 62,121 |
| | 第102回 利付国債 (20年) | 2.4000 | 2028/ 6 /20 | 69,000 | 76,837 |
| | 第103回 利付国債 (20年) | 2.3000 | 2028/ 6 /20 | 63,000 | 69,827 |
| | 第104回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2028/ 6 /20 | 49,000 | 53,800 |
| | 第105回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2028/ 9 /20 | 91,000 | 100,198 |
| | 第106回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2028/ 9 /20 | 53,000 | 58,646 |
| | 第107回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2028/12/20 | 80,000 | 88,396 |
| | 第108回 利付国債 (20年) | 1.9000 | 2028/12/20 | 111,000 | 121,387 |
| | 第109回 利付国債 (20年) | 1.9000 | 2029/ 3 /20 | 182,000 | 199,570 |
| | 第110回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2029/ 3 /20 | 209,000 | 231,651 |
| | 第111回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2029/ 6 /20 | 170,000 | 189,998 |
| | 第112回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2029/ 6 /20 | 238,000 | 264,532 |
| | 第113回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2029/ 9 /20 | 342,000 | 381,384 |

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|------|------------------|--------|-------------|---------|---------|
| | | % | | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | 第114回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2029/12/20 | 215,000 | 240,447 |
| | 第115回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2029/12/20 | 159,000 | 178,873 |
| | 第116回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2030/ 3 /20 | 110,000 | 124,110 |
| | 第117回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2030/ 3 /20 | 180,000 | 201,855 |
| | 第118回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2030/ 6 /20 | 109,000 | 121,537 |
| | 第119回 利付国債 (20年) | 1.8000 | 2030/ 6 /20 | 95,000 | 104,581 |
| | 第120回 利付国債 (20年) | 1.6000 | 2030/ 6 /20 | 124,000 | 134,703 |
| | 第121回 利付国債 (20年) | 1.9000 | 2030/ 9 /20 | 170,000 | 188,553 |
| | 第122回 利付国債 (20年) | 1.8000 | 2030/ 9 /20 | 113,000 | 124,507 |
| | 第123回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2030/12/20 | 242,000 | 272,600 |
| | 第124回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2030/12/20 | 169,000 | 189,097 |
| | 第125回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2031/ 3 /20 | 155,000 | 176,197 |
| | 第126回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2031/ 3 /20 | 165,000 | 184,936 |
| | 第127回 利付国債 (20年) | 1.9000 | 2031/ 3 /20 | 119,000 | 132,456 |
| | 第128回 利付国債 (20年) | 1.9000 | 2031/ 6 /20 | 232,000 | 258,619 |
| | 第129回 利付国債 (20年) | 1.8000 | 2031/ 6 /20 | 122,000 | 135,025 |
| | 第130回 利付国債 (20年) | 1.8000 | 2031/ 9 /20 | 189,000 | 209,599 |
| | 第131回 利付国債 (20年) | 1.7000 | 2031/ 9 /20 | 124,000 | 136,497 |
| | 第132回 利付国債 (20年) | 1.7000 | 2031/12/20 | 131,000 | 144,513 |
| | 第133回 利付国債 (20年) | 1.8000 | 2031/12/20 | 156,000 | 173,406 |
| | 第134回 利付国債 (20年) | 1.8000 | 2032/ 3 /20 | 157,000 | 174,764 |
| | 第135回 利付国債 (20年) | 1.7000 | 2032/ 3 /20 | 114,000 | 125,914 |
| | 第136回 利付国債 (20年) | 1.6000 | 2032/ 3 /20 | 118,000 | 129,312 |
| | 第137回 利付国債 (20年) | 1.7000 | 2032/ 6 /20 | 101,000 | 111,639 |
| | 第138回 利付国債 (20年) | 1.5000 | 2032/ 6 /20 | 110,000 | 119,640 |
| | 第139回 利付国債 (20年) | 1.6000 | 2032/ 6 /20 | 114,000 | 124,999 |
| | 第140回 利付国債 (20年) | 1.7000 | 2032/ 9 /20 | 104,000 | 114,978 |
| | 第141回 利付国債 (20年) | 1.7000 | 2032/12/20 | 210,000 | 232,827 |
| | 第142回 利付国債 (20年) | 1.8000 | 2032/12/20 | 142,000 | 158,756 |
| | 第143回 利付国債 (20年) | 1.6000 | 2033/ 3 /20 | 173,000 | 190,068 |
| | 第144回 利付国債 (20年) | 1.5000 | 2033/ 3 /20 | 123,000 | 133,967 |
| | 第145回 利付国債 (20年) | 1.7000 | 2033/ 6 /20 | 246,000 | 272,705 |
| | 第146回 利付国債 (20年) | 1.7000 | 2033/ 9 /20 | 194,000 | 215,122 |
| | 第147回 利付国債 (20年) | 1.6000 | 2033/12/20 | 214,000 | 235,057 |
| | 第148回 利付国債 (20年) | 1.5000 | 2034/ 3 /20 | 184,000 | 200,081 |
| | 第149回 利付国債 (20年) | 1.5000 | 2034/ 6 /20 | 199,000 | 216,195 |
| | 第150回 利付国債 (20年) | 1.4000 | 2034/ 9 /20 | 216,000 | 232,122 |
| | 第151回 利付国債 (20年) | 1.2000 | 2034/12/20 | 216,000 | 227,128 |
| | 第152回 利付国債 (20年) | 1.2000 | 2035/ 3 /20 | 198,000 | 207,937 |

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|------------------|-----------------------|-------------|-------------|---------|------------|
| | | % | | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | 第153回 利付国債 (20年) | 1.3000 | 2035/ 6 /20 | 234,000 | 248,182 |
| | 第154回 利付国債 (20年) | 1.2000 | 2035/ 9 /20 | 220,000 | 230,540 |
| | 第155回 利付国債 (20年) | 1.0000 | 2035/12/20 | 211,000 | 215,764 |
| | 第156回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2036/ 3 /20 | 180,000 | 170,505 |
| | 第157回 利付国債 (20年) | 0.2000 | 2036/ 6 /20 | 182,000 | 167,292 |
| | 第158回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2036/ 9 /20 | 192,000 | 183,181 |
| | 第159回 利付国債 (20年) | 0.6000 | 2036/12/20 | 197,000 | 189,990 |
| | 第160回 利付国債 (20年) | 0.7000 | 2037/ 3 /20 | 162,000 | 157,966 |
| | 第161回 利付国債 (20年) | 0.6000 | 2037/ 6 /20 | 166,000 | 159,298 |
| | 第162回 利付国債 (20年) | 0.6000 | 2037/ 9 /20 | 172,000 | 164,631 |
| | 第163回 利付国債 (20年) | 0.6000 | 2037/12/20 | 169,000 | 161,232 |
| | 第164回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2038/ 3 /20 | 309,000 | 289,390 |
| | 第165回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2038/ 6 /20 | 234,000 | 218,354 |
| | 第166回 利付国債 (20年) | 0.7000 | 2038/ 9 /20 | 234,000 | 224,265 |
| | 第167回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2038/12/20 | 244,000 | 225,992 |
| | 第168回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2039/ 3 /20 | 209,000 | 189,719 |
| | 第169回 利付国債 (20年) | 0.3000 | 2039/ 6 /20 | 235,000 | 208,907 |
| | 第170回 利付国債 (20年) | 0.3000 | 2039/ 9 /20 | 208,000 | 184,090 |
| | 第171回 利付国債 (20年) | 0.3000 | 2039/12/20 | 223,000 | 196,485 |
| | 第172回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2040/ 3 /20 | 206,000 | 183,877 |
| 第173回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2040/ 6 /20 | 264,000 | 234,622 | |
| 第174回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2040/ 9 /20 | 264,000 | 233,589 | |
| 第175回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2040/12/20 | 256,000 | 229,749 | |
| 第176回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2041/ 3 /20 | 230,000 | 205,537 | |
| 第177回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2041/ 6 /20 | 242,000 | 211,561 | |
| 第178回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2041/ 9 /20 | 238,000 | 211,470 | |
| 第179回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2041/12/20 | 248,000 | 219,718 | |
| 第180回 利付国債 (20年) | 0.8000 | 2042/ 3 /20 | 248,000 | 231,562 | |
| 第181回 利付国債 (20年) | 0.9000 | 2042/ 6 /20 | 249,000 | 236,198 | |
| 第182回 利付国債 (20年) | 1.1000 | 2042/ 9 /20 | 175,000 | 171,687 | |
| 第183回 利付国債 (20年) | 1.4000 | 2042/12/20 | 122,000 | 125,797 | |
| | 小計 | - | - | - | 51,151,638 |
| 地方債証券 | 第 34 回 東京都公募公債 (20年) | 0.6680 | 2037/ 6 /19 | 100,000 | 94,032 |
| | 平成27年度第1回 北海道公募公債 | 0.4300 | 2025/ 4 /30 | 300,000 | 302,139 |
| | 第 30 回 神奈川県公募公債 (20年) | 1.1610 | 2035/ 9 /20 | 100,000 | 101,668 |
| | 第448回 大阪府公募公債 | 0.0010 | 2029/ 9 /27 | 38,000 | 36,713 |
| | 第455回 大阪府公募公債 | 0.1160 | 2030/ 4 /26 | 180,000 | 173,971 |
| | 第 7 回 大阪府公募公債 (20年) | 1.8400 | 2031/ 9 /26 | 100,000 | 109,382 |

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|---------------------|-----------------------------|------------|-------------|---------|-----------|
| | | % | | 千円 | 千円 |
| 地方債証券 | 第 11 回 大阪府公募公債 (20年) | 1.6930 | 2033/ 9 /27 | 100,000 | 107,425 |
| | 第 12 回 大阪府公募公債 (20年) | 1.4530 | 2034/ 9 /26 | 100,000 | 104,888 |
| | 平成29年度第 5 回 京都府公募公債 (20年) | 0.6300 | 2037/ 8 /14 | 100,000 | 93,332 |
| | 第 15 回 兵庫県公募公債 (20年) | 1.6400 | 2032/ 7 /23 | 100,000 | 110,629 |
| | 第 21 回 兵庫県公募公債 (20年) | 1.5400 | 2034/ 5 / 9 | 100,000 | 105,870 |
| | 平成26年度第11回 愛知県公募公債 (15年) | 0.9610 | 2029/10/16 | 100,000 | 103,084 |
| | 令和 4 年度第 3 回 愛知県公募公債 | 0.3040 | 2032/ 5 /31 | 200,000 | 194,954 |
| | 平成20年度第 1 回 福岡県公募公債 (20年) | 2.2600 | 2028/ 8 /18 | 100,000 | 110,123 |
| | 平成24年度第 2 回 福岡県公募公債 (20年) | 1.6350 | 2032/ 8 /16 | 100,000 | 111,611 |
| | 令和 4 年度第 1 回 千葉県公募公債 | 0.3040 | 2032/ 5 /25 | 300,000 | 292,220 |
| | 第 22 回 大阪市公募公債 (20年) | 0.3470 | 2036/ 5 /30 | 100,000 | 91,202 |
| | 第 1 回 名古屋市公募公債 (30年) | 2.5300 | 2035/ 3 /20 | 100,000 | 117,498 |
| | 第 1 回 京都市公募公債 (20年) | 2.1400 | 2024/12/20 | 300,000 | 311,083 |
| | 第 25 回 横浜市公募公債 (20年) | 1.7200 | 2032/ 7 /16 | 100,000 | 111,364 |
| | 第 26 回 横浜市公募公債 (20年) | 1.7760 | 2033/ 1 /28 | 100,000 | 109,494 |
| | 第 31 回 横浜市公募公債 (20年) | 1.1800 | 2035/ 4 /20 | 100,000 | 102,165 |
| | 第 9 回 川崎市公募公債 (20年) | 2.1500 | 2030/ 5 /24 | 100,000 | 111,149 |
| | 第 4 回 川崎市公募公債 (30年) | 2.1000 | 2041/ 9 /20 | 100,000 | 112,806 |
| | 平成26年度第 2 回 北九州市公募公債 | 0.4510 | 2024/12/24 | 150,000 | 151,047 |
| | 平成30年度第 5 回 広島市公募公債 | 0.1950 | 2028/12/25 | 200,000 | 197,624 |
| 平成29年度第 1 回 仙台市公募公債 | 0.6160 | 2037/10/19 | 100,000 | 92,957 | |
| | 小計 | - | - | - | 3,660,443 |
| 特殊債券 (除く金融債券) | 第 9 回 新関西国際空港 | 1.2310 | 2028/12/20 | 300,000 | 309,969 |
| | 第 16 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.7000 | 2036/ 9 /19 | 100,000 | 120,298 |
| | 第 174 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.6410 | 2032/ 9 /30 | 100,000 | 112,876 |
| | 第 205 回 政保道路機構債券 | 1.5320 | 2033/11/30 | 100,000 | 106,767 |
| | 第 212 回 政保道路機構債券 | 1.5000 | 2034/ 2 /28 | 100,000 | 106,615 |
| | 第 218 回 政保道路機構債券 | 0.6600 | 2024/ 5 /31 | 500,000 | 503,936 |
| | 第 233 回 政府道路機構債券 | 1.3150 | 2034/11/30 | 100,000 | 104,700 |
| | 第 249 回 政保道路機構債券 | 0.4840 | 2025/ 6 /30 | 179,000 | 180,814 |
| | 第 278 回 政保道路機構債券 | 0.2370 | 2036/ 5 /30 | 100,000 | 90,888 |
| | 第 293 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.3970 | 2036/10/31 | 100,000 | 92,420 |
| | 第 316 回 政保道路機構債券 | 0.5690 | 2037/ 6 /30 | 100,000 | 93,802 |
| | 第 319 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.6300 | 2037/ 7 /31 | 100,000 | 94,602 |
| | 第 17 回 地方公共団体金融機構債券 (20年) | 1.8700 | 2031/ 9 /26 | 200,000 | 217,824 |
| | 第 36 回 地方公共団体金融機構債券 (20年) | 1.5660 | 2034/ 4 /28 | 100,000 | 106,069 |
| | 第 1 回 地方公共団体金融機構債券 (30年) | 1.8640 | 2044/ 6 /28 | 100,000 | 107,663 |
| | 第 72 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.5090 | 2025/ 5 /23 | 200,000 | 202,064 |
| | 第 83 回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.0200 | 2026/ 4 /17 | 103,000 | 102,805 |

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|------------------|---|--------|-------------|---------|-----------|
| | | % | | 千円 | 千円 |
| 特殊債券 (除く金融債券) | 第116回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.0950 | 2029/ 1 /22 | 138,000 | 135,942 |
| | 第120回 政保地方公共団体金融機構債券 | 0.0010 | 2029/ 7 /13 | 100,000 | 97,503 |
| | 第136回 地方公共団体金融機構債券 | 0.1450 | 2030/ 9 /27 | 200,000 | 191,882 |
| | 第 16 回 公営企業債券 (20年) | 2.1000 | 2025/12/19 | 200,000 | 210,521 |
| | 第 97 回 都市再生債券 | 1.0170 | 2029/ 9 /20 | 100,000 | 103,041 |
| | 第 46 回 福祉医療機構債券 | 0.0800 | 2026/ 6 /19 | 200,000 | 198,940 |
| | 第 59 回 住宅金融支援機構債券 | 1.9500 | 2030/10/22 | 200,000 | 218,434 |
| | 第143回 住宅金融支援機構債券 | 1.1920 | 2028/10/20 | 100,000 | 103,950 |
| | 第 37 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.7100 | 2045/ 6 /10 | 19,813 | 20,704 |
| | 第 42 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.4300 | 2045/11/10 | 49,402 | 51,467 |
| | 第 46 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.8500 | 2046/ 3 /10 | 57,048 | 59,814 |
| | 第 54 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.4700 | 2046/11/10 | 47,556 | 49,496 |
| | 第 55 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.4100 | 2046/12/10 | 53,240 | 55,396 |
| | 第 60 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.3400 | 2047/ 5 /10 | 55,348 | 57,473 |
| | 第 61 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.2600 | 2047/ 6 /10 | 27,945 | 28,925 |
| | 第 62 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.2100 | 2047/ 7 /10 | 249,536 | 257,845 |
| | 第 63 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.1100 | 2047/ 8 /10 | 154,895 | 159,340 |
| | 第 73 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.3000 | 2048/ 6 /10 | 110,133 | 114,274 |
| | 第 78 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.0800 | 2048/11/10 | 95,775 | 98,408 |
| | 第109回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.3600 | 2051/ 6 /10 | 203,409 | 198,120 |
| | 小計 | - | - | - | 5,065,603 |
| 金融債券 | い第845号 利付商工債券 | 0.1200 | 2025/10/27 | 200,000 | 200,241 |
| | い第854号 利付商工債券 | 0.0800 | 2026/ 7 /27 | 200,000 | 199,455 |
| | い第862号 利付商工債券 | 0.1800 | 2027/ 3 /26 | 100,000 | 99,620 |
| | 第353回 利付信金中金債券 | 0.0600 | 2024/ 4 /26 | 100,000 | 100,027 |
| | 小計 | - | - | - | 599,343 |
| 社債券 | 第 29 回 フランス相互信用連合銀行(B.F.C.M.)円貨社債(2019) | 0.2500 | 2024/10/10 | 100,000 | 99,244 |
| | 第 13 回 クレディ・アグリコル・エス・イー | 0.3430 | 2024/ 6 / 7 | 100,000 | 99,340 |
| | 第 5 回 スヴェンスカ・ハンデルスバンク | 0.6790 | 2024/ 9 / 4 | 200,000 | 200,576 |
| | 第 25 回 首都高速道路 | 0.0300 | 2024/ 9 /20 | 400,000 | 399,254 |
| | 第 38 回 成田国際空港 | 0.1950 | 2030/10/28 | 200,000 | 189,938 |
| | 第 60 回 中日本高速道路 | 0.5430 | 2024/12/20 | 100,000 | 100,667 |
| | 第 25 回 西日本高速道路 | 0.5240 | 2024/12/20 | 200,000 | 201,257 |
| | 第 26 回 西日本高速道路 | 0.6040 | 2025/ 5 /21 | 200,000 | 201,767 |
| | 第 13 回 日本たばこ産業 | 0.3550 | 2028/ 9 / 8 | 100,000 | 98,897 |
| | 第 14 回 森ヒルズリート投資法人 | 0.8200 | 2025/ 5 /26 | 100,000 | 100,942 |
| | 第 5 回 電通グループ | 0.3200 | 2027/ 7 / 8 | 400,000 | 397,994 |
| | 第 1 回 オリックス銀行 | 0.1600 | 2026/ 3 /11 | 200,000 | 199,225 |

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|-------------|------------------------------|-------------|-------------|---------|------------|
| | | % | | 千円 | 千円 |
| 社債券 | 第 19 回 豊田通商 | 0.9540 | 2026/ 7 /10 | 100,000 | 101,772 |
| | 第 1 回 三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付 | 0.8570 | 2024/ 9 / 5 | 100,000 | 100,537 |
| | 第 29 回 三菱東京UFJ銀行劣後特約付 | 2.1600 | 2026/ 1 /20 | 100,000 | 104,762 |
| | 第 1 回 三井住友フィナンシャルグループ劣後特約付 | 0.8490 | 2024/ 9 /12 | 100,000 | 100,550 |
| | 第 8 回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付 | 1.9200 | 2025/10/28 | 100,000 | 104,048 |
| | 第 16 回 NTTファイナンス | 0.1800 | 2025/12/19 | 200,000 | 199,344 |
| | 第 18 回 NTTファイナンス | 0.3800 | 2030/ 9 /20 | 100,000 | 96,823 |
| | 第 96 回 トヨタファイナンス | 0.0600 | 2026/ 4 /15 | 100,000 | 99,290 |
| | 第 2 回 三菱HCキャピタル | 0.1900 | 2027/ 3 / 1 | 100,000 | 98,236 |
| | 第 40 回 三菱UFJリース | 0.3100 | 2026/ 6 / 9 | 300,000 | 297,730 |
| | 第 6 回 三井住友海上火災保険 | 0.1300 | 2024/ 7 /31 | 100,000 | 99,860 |
| | 第 66 回 三井不動産 | 0.2800 | 2026/ 3 /13 | 100,000 | 100,084 |
| | 第132回 三菱地所 | 0.4300 | 2030/ 4 /16 | 100,000 | 97,790 |
| | 第 7 回 野村不動産オフィスファンド投資法人 | 2.9000 | 2028/ 3 /17 | 200,000 | 220,850 |
| | 第106回 東日本旅客鉄道 | 0.9810 | 2035/ 1 /29 | 100,000 | 97,069 |
| | 第 3 回 東日本旅客鉄道(サステナビリティボンド) | 0.2640 | 2032/ 1 /21 | 100,000 | 94,294 |
| | 第 27 回 KDDI | 0.2300 | 2026/ 4 /24 | 200,000 | 199,536 |
| | 第510回 関西電力 | 0.4900 | 2027/ 7 /23 | 100,000 | 99,480 |
| | 第306回 北陸電力 | 0.8750 | 2024/ 5 /24 | 100,000 | 100,767 |
| | 第429回 九州電力 | 0.9090 | 2024/ 9 /25 | 200,000 | 201,863 |
| | 第451回 九州電力 | 0.4500 | 2027/ 5 /25 | 100,000 | 99,445 |
| | 第331回 北海道電力 | 0.3700 | 2026/ 4 /24 | 100,000 | 99,846 |
| | 第352回 北海道電力 | 0.3200 | 2025/11/25 | 100,000 | 99,841 |
| 第 13 回 電源開発 | 2.0400 | 2025/ 6 /20 | 100,000 | 103,852 | |
| | 小計 | - | - | - | 5,306,786 |
| | 合計 | - | - | - | 65,783,815 |

投資信託財産の構成

2023年3月10日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 65,783,815 | 99.3 |
| コール・ローン等、その他 | 435,624 | 0.7 |
| 投資信託財産総額 | 66,219,439 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年3月10日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------------------|------------------------|
| (A)資産 | 66,219,439,587円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 235,628,795 |
| 公 社 債 (評価額) | 65,783,815,052 |
| 未 収 利 息 | 193,844,712 |
| 前 払 費 用 | 6,151,028 |
| (B)負債 | 27,573,877 |
| 未 払 解 約 金 | 27,572,838 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 1,039 |
| (C)純 資 産 総 額 (A - B) | 66,191,865,710 |
| 元 本 | 70,484,284,906 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △ 4,292,419,196 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 70,484,284,906口 |
| 1万口当たり基準価額 (C / D) | 9,391円 |

(注1) 期首元本額 80,372,485,061円
 期中追加設定元本額 9,215,870,521円
 期中一部解約元本額 19,104,070,676円

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

ニッセイ国内債券パッシブDB (適格機関投資家限定)
 51,084,508,245円
 DCニッセイ日本債券インデックス 4,376,565,929円
 DCニッセイターゲットデットファンド2055 184,254,353円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型) 7,128,880,475円
 DCニッセイターゲットデットファンド2045 349,794,886円
 DCニッセイターゲットデットファンド2035 2,006,258,528円
 DCニッセイターゲットデットファンド2025 1,778,441,326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) 305,813,488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)
 32,647,069円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (国内・株式/リート/債券)
 102,108,625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) 70,746,283円
 DCニッセイターゲットデットファンド2060 95,997,486円
 DCニッセイターゲットデットファンド2050 121,545,116円
 DCニッセイターゲットデットファンド2040 444,032,744円
 DCニッセイターゲットデットファンド2030 2,365,333,858円
 FWニッセイ国内債インデックス 31,516,014円
 DCニッセイターゲットデットファンド2065 5,840,481円

(注3) 元本の欠損
 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は4,292,419,196円です。

損益の状況

当期 (2022年3月11日~2023年3月10日)

| 項目 | 当期 |
|---------------------------------|-----------------------|
| (A)配 当 等 収 益 | 629,378,589円 |
| 受 取 利 息 | 629,671,064 |
| 支 払 利 息 | △ 292,475 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | △3,074,930,138 |
| 売 買 益 | 32,615,280 |
| 売 買 損 | △ 3,107,545,418 |
| (C)信 託 報 酬 等 | △ 15,093 |
| (D)当 期 損 益 金 (A + B + C) | △2,445,566,642 |
| (E)前 期 繰 越 損 益 金 | △2,366,578,609 |
| (F)追 加 信 託 差 損 益 金 | △ 444,694,736 |
| (G)解 約 差 損 益 金 | 964,420,791 |
| (H)合 計 (D + E + F + G) | △4,292,419,196 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | △4,292,419,196 |

(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。

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 32 期

(計算期間：2023年5月23日～2023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

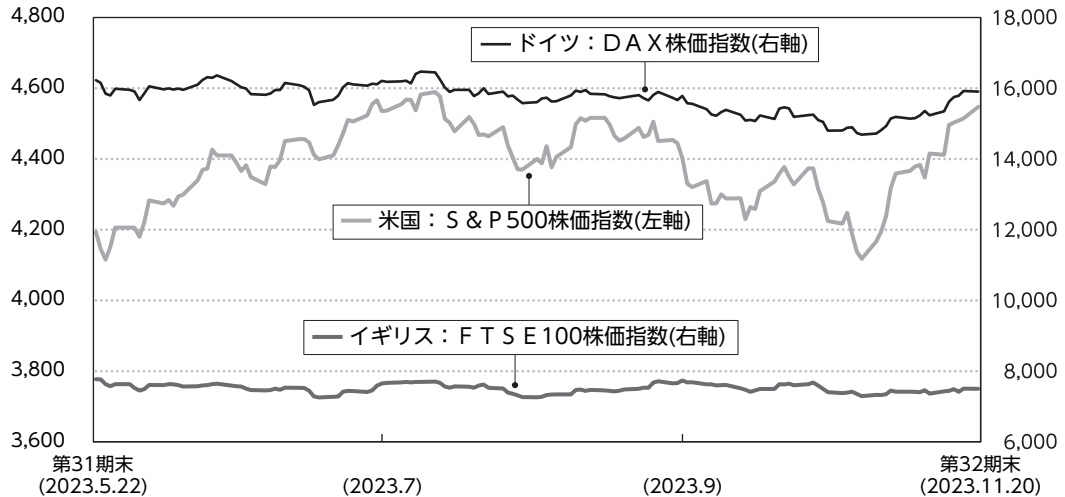
運用経過

2023年5月23日～2023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】

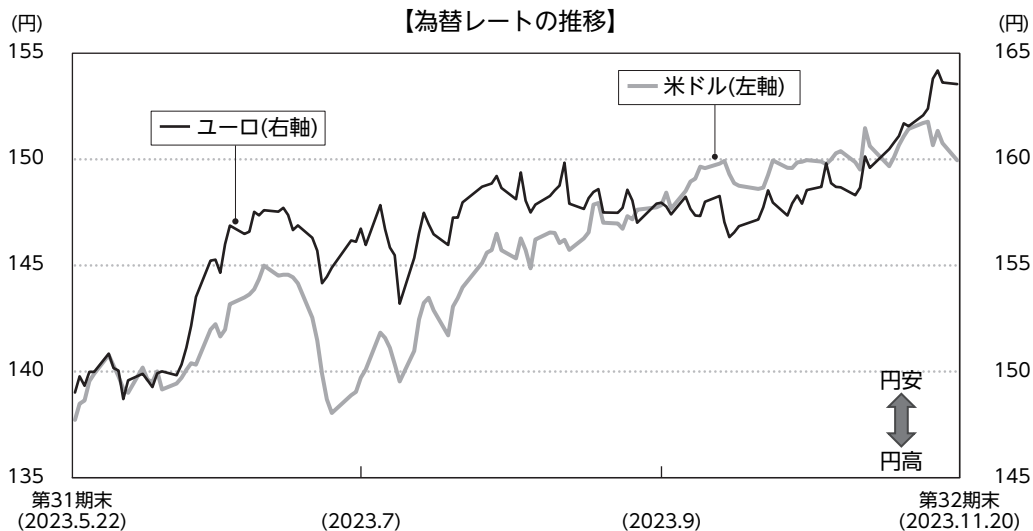


(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は米長期金利の上昇や地政学リスクの高まりから下落する一方、世界の主要な中央銀行による利上げの最終局面入りが意識されたことなどから当期末にかけて上昇し、期を通じて見ると米国は上昇、ドイツとイギリスは下落しました。

期初から7月にかけては、米国における債務上限法案の上下院での可決や米消費者物価指数（CPI）がおおむね市場の予想通りとなったこと、堅調な経済指標を背景とした景気の軟着陸（ソフトランディング）への期待感が強まったことなどから株価はおおむね上昇しました。8月以降は米国債の格下げや堅調な経済指標を受けて米金利が上昇したことへの懸念等から株価は下落し、その後も米連邦準備制度理事会（FRB）による金融引き締めに向き姿勢を受けて米金利が上昇したことや米国の政府閉鎖問題、中東情勢の緊迫化を背景に下落しました。11月に入ると米連邦公開市場委員会（FOMC）で追加利上げ観測が後退したことなどを受けて株価は反発しました。結局、前期末と比較すると米国は上昇、ドイツとイギリスは下落して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、7月に日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けて大きく円高に振れる場面があったものの、その後は米国が利上げ方向である一方で日本が金融緩和方向であっ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りました。11月には米国の将来の利下げ観測が意識される一方で日本の金融政策正常化観測が高まったことでやや米ドル安円高となりましたが、結局、期を通じて見ると米ドル高円安で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、欧州中央銀行（ECB）が物価上昇リスクを警戒していたことや米金利の上昇に連れて欧州金利が上昇したことなどからユーロ高円安基調で始まりました。7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けてユーロ安円高に転じましたが、その後は日・欧中央銀行の金融政策の影響を受けて上下に振れつつも横ばい圏での推移となりました。11月には大手格付け機関によるイタリア国債の格下げが回避されたことなどをを受けてユーロに対する懸念が後退したことや日銀の金融緩和政策継続への見方が強まったことなどからユーロ高円安となり、結局、期を通じて見ると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>

- ・ 6月にFOMCにおいて市場の予想通り利上げが見送られたことに加えて、堅調な経済指標やCPIの減速を受けて米景気のソフトランディングへの期待感が強まったことなどから株価が上昇したこと
- ・ 11月にFOMCで追加利上げ観測が後退したことなどをを受けて株価が上昇したこと
- ・ 期を通じて内外金利差の拡大などから円安が進行したこと

<下落要因>

- ・ 9月にFRBによる金融引き締めに前向きな姿勢を受けて米金利が上昇する中、幅広いセクターで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+15.3%となり、ベンチマーク騰落率(+15.2%)にほぼ連動しました。

今後の運用方針

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

お知らせ

■ 約款変更

- ・ 以下の変更に伴い、関連条項に所要の変更を行いました。
 - ① 信託金の限度額を変更
 - ② ベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化

(2023年8月19日)

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 期中 | ベンチ マーク | 期中 | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 投資信託 証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|------------------|--------|-------|------------|-------|------------|------------|--------------------|-----------|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 28期(2021年11月22日) | 29,525 | 16.8 | 28,808 | 16.8 | 94.9 | 2.9 | 2.1 | 513,761 |
| 29期(2022年5月20日) | 27,529 | △ 6.8 | 26,838 | △ 6.8 | 94.8 | 2.8 | 2.3 | 510,207 |
| 30期(2022年11月21日) | 30,643 | 11.3 | 29,840 | 11.2 | 94.1 | 2.9 | 2.1 | 601,452 |
| 31期(2023年5月22日) | 32,472 | 6.0 | 31,568 | 5.8 | 95.1 | 2.9 | 2.0 | 668,843 |
| 32期(2023年11月20日) | 37,454 | 15.3 | 36,382 | 15.2 | 94.4 | 3.6 | 1.9 | 827,057 |

(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 |
|-----------------|--------|------|------------|------|------------|------------|--------------------|
| | | % | | % | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % |
| (期首)2023年5月22日 | 32,472 | — | 31,568 | — | 95.1 | 2.9 | 2.0 |
| 5月末 | 32,757 | 0.9 | 31,845 | 0.9 | 95.7 | 2.9 | 2.0 |
| 6月末 | 35,334 | 8.8 | 34,344 | 8.8 | 94.3 | 3.5 | 1.9 |
| 7月末 | 35,870 | 10.5 | 34,865 | 10.4 | 95.1 | 2.8 | 1.9 |
| 8月末 | 36,493 | 12.4 | 35,466 | 12.3 | 93.8 | 4.2 | 1.9 |
| 9月末 | 35,612 | 9.7 | 34,608 | 9.6 | 94.5 | 3.5 | 1.8 |
| 10月末 | 34,419 | 6.0 | 33,440 | 5.9 | 95.0 | 3.0 | 1.8 |
| (期末)2023年11月20日 | 37,454 | 15.3 | 36,382 | 15.2 | 94.4 | 3.6 | 1.9 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023年11月20日

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-----------------|-----|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 売買委託手数料 (株式) | 0円 | 0.001% | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料 |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| 有価証券取引税 (株式) | 1 | 0.003 | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| その他費用 (保管費用) | 3 | 0.008 | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | |
| | | | ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 5 | 0.013 | |

(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（35,267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

2023年5月23日～2023年11月20日

(1) 株式

| | 買付 | | 売付 | | |
|--------|-----------------|--------------------------|--------------------------------|------------------------|----------------------|
| | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 | |
| 外国 | アメリカ | 百株 30,057 (1,299) | 千米ドル 282,332 (△ 135) | 百株 5,304 | 千米ドル 28,957 |
| | カナダ | 3,162 (224) | 千カナダ・ドル 18,932 (△ 96) | 135 | 千カナダ・ドル 678 |
| | オーストラリア | 5,194 (△ 456) | 千オーストラリア・ドル 11,696 | 131 | 千オーストラリア・ドル 54 |
| | 香港 | 5,551 | 千香港ドル 17,481 | 486 | 千香港ドル 1,242 |
| | シンガポール | 21,395 | 千シンガポール・ドル 2,625 (△ 23) | 263 | 千シンガポール・ドル 344 |
| | ニュージーランド | 384 | 千ニュージーランド・ドル 334 | 6 | 千ニュージーランド・ドル 28 |
| | イギリス | 24,825 | 千イギリス・ポンド 17,312 (△ 261) | 4,652 | 千イギリス・ポンド 953 |
| | イスラエル | 411 | 千イスラエル・シェケル 1,651 | 2,120 | 千イスラエル・シェケル 2,816 |
| | スイス | 1,174 (398) | 千スイス・フラン 9,750 (△ 8) | 3,614 | 千スイス・フラン 1,849 |
| | デンマーク | 348 (1,587) | 千デンマーク・クローネ 20,170 | 6 | 千デンマーク・クローネ 390 |
| ノルウェー | 421 | 千ノルウェー・クローネ 7,476 | 29 | 千ノルウェー・クローネ 960 | |
| スウェーデン | 2,914 (161) | 千スウェーデン・クローナ 46,530 | 2,433 | 千スウェーデン・クローナ 23,525 | |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| | | 買付 | | 売付 | | |
|--------|--------|-----------|---------|--------|-------|-------|
| | | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 | |
| 外国 | ユーロ | | 百株 | 千ユーロ | 百株 | 千ユーロ |
| | | アイルランド | 591 | 956 | 705 | 3,553 |
| | | オランダ | 1,496 | 7,389 | 480 | 1,216 |
| | | | (804) | (△ 26) | | |
| | | ベルギー | 129 | 1,189 | 7 | 95 |
| | | ルクセンブルグ | 91 | 188 | 37 | 87 |
| | | フランス | 1,527 | 10,327 | 706 | 2,101 |
| | | | | (△ 58) | | |
| | | ドイツ | 1,917 | 9,193 | 1,333 | 1,007 |
| | | | | (△ 30) | | |
| | | ポルトガル | 669 | 432 | 31 | 54 |
| | | | (△ 265) | (△ 6) | | |
| | | スペイン | 2,729 | 2,623 | 773 | 579 |
| | | (△ 0.886) | | | | |
| イタリア | 3,013 | 1,959 | 545 | 554 | | |
| | | (△ 1) | | | | |
| フィンランド | 666 | 872 | 477 | 217 | | |
| | (447) | | | | | |
| オーストリア | 46 | 179 | — | — | | |
| その他 | 117 | 108 | 82 | 35 | | |

(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 | |
|--|-------|-------|-------|------|
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| (アメリカ) | 千□ | 千米ドル | 千□ | 千米ドル |
| BOSTON PROPERTIES INC | 1 | 61 | — | — |
| CROWN CASTLE INC | 3 | 322 | — | — |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 1 | 215 | — | — |
| PROLOGIS INC | 6 | 773 | — | — |
| ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT | 5 | 112 | — | — |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 1 | 214 | — | — |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 1 | 131 | — | — |
| EQUITY RESIDENTIAL | 2 | 162 | — | — |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 0.390 | 89 | — | — |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 4 | 93 | — | — |
| WELLTOWER INC | 5 | 447 | — | — |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 4 | 75 | — | — |
| KIMCO REALTY CORP | 4 | 82 | — | — |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 0.921 | 132 | — | — |
| PUBLIC STORAGE | 1 | 312 | — | — |
| REGENCY CENTERS CORP | 2 | 138 | — | — |
| 外国 SIMON PROPERTY GROUP INC | 2 | 253 | — | — |
| SUN COMMUNITIES INC | 0.914 | 112 | — | — |
| UDR INC | 1 | 76 | 0.944 | 37 |
| VENTAS INC | 2 | 124 | — | — |
| WP CAREY INC | 2 | 131 | — | — |
| REALTY INCOME CORP | 8 | 508 | — | — |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 1 | 80 | — | — |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 8 | 1,114 | — | — |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 2 | 279 | — | — |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | — | — | 55 | 450 |
| IRON MOUNTAIN INC | 2 | 124 | — | — |
| AMERICAN TOWER REIT INC | 3 | 588 | — | — |
| EQUINIX INC | 0.740 | 563 | — | — |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A | 2 | 47 | — | — |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 2 | 101 | — | — |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 2 | 107 | — | — |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 0.793 | 174 | — | — |
| INVITATION HOMES INC | 4 | 142 | — | — |
| VICI PROPERTIES INC | 10 | 327 | — | — |

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 | |
|--|--|--|--------------------------------------|---|
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| (アメリカ) NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I | 千□ — (1) | 千米ドル — | 千□ 1 | 千米ドル 15 |
| (カナダ) CAN APARTMENT PROP REAL ESTA RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 0.402 0.895 | 千カナダ・ドル 19 16 | — — | 千カナダ・ドル — — |
| (オーストラリア) GPT GROUP GOODMAN GROUP STOCKLAND MIRVAC GROUP VICINITY CENTRES LENDLEASE GROUP SCENTRE GROUP DEXUS/AU | 13 12 16 27 27 4 35 7 | 千オーストラリア・ドル 53 263 67 61 49 37 94 58 | — — — — — — — — | 千オーストラリア・ドル — — — — — — — — |
| (香港) LINK REIT | 52 | 千香港ドル 2,345 | — | 千香港ドル — |
| (シンガポール) CAPITALAND ASCENDAS REIT CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST KEPPEL REIT MAPLETREE LOGISTICS TRUST MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST | 58 38 — 32 17 | 千シンガポール・ドル 162 (△ 3) 72 (△ 1) — (23) 53 (△ 6) 27 (△0.822) | — — 28 — — | 千シンガポール・ドル — — 23 — — |
| (イギリス) BRITISH LAND CO PLC LAND SECURITIES GROUP PLC SEGRO PLC | 2 4 5 | 千イギリス・ポンド 7 29 44 | 83 — 1 | 千イギリス・ポンド 270 — 13 |
| (ユーロ/ベルギー) WAREHOUSES DE PAUW SCA | 1 | 千ユーロ 35 | — | 千ユーロ — |
| (ユーロ/フランス) KLEPIERRE | 1 | 34 (△ 17) | — | — |

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| | 銘柄 | 買付 | | 売付 | |
|----|---------------------------|-------|------|----|------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| | (ユーロ/フランス) | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| 外国 | GECINA SA | 0.322 | 31 | — | — |
| | COVIVIO | 0.711 | 31 | — | — |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 1 | 50 | — | — |

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

| 種類別 | 買建 | | 売建 | |
|--------|--------|--------|-------|-----|
| | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 外国 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式先物取引 | 97,989 | 90,245 | — | — |

(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

2023年5月23日～2023年11月20日

株式

| 銘柄 | 買付 | | | 銘柄 | 売付 | | |
|----------------------|-----|-----------|--------|-------------------------|----|-----------|--------|
| | 株数 | 金額 | 平均単価 | | 株数 | 金額 | 平均単価 |
| | 千株 | 千円 | 円 | | 千株 | 千円 | 円 |
| APPLE INC | 92 | 2,510,403 | 27,085 | ACTIVISION BLIZZARD INC | 81 | 1,142,174 | 14,095 |
| MICROSOFT CORP | 47 | 2,295,263 | 48,417 | CRH PLC | 70 | 561,446 | 7,953 |
| AMAZON.COM INC | 69 | 1,318,611 | 19,099 | HORIZON PHARMA PLC | 21 | 368,563 | 17,417 |
| NVIDIA CORP | 18 | 1,191,988 | 65,921 | JOHNSON & JOHNSON | 12 | 309,700 | 24,180 |
| TESLA, INC. | 35 | 1,191,716 | 33,671 | BLACK KNIGHT INC | 14 | 163,686 | 11,348 |
| ALPHABET INC-CL A | 38 | 736,291 | 19,291 | INVESTOR AB-A SHS | 47 | 135,483 | 2,863 |
| META PLATFORMS INC-A | 13 | 601,398 | 44,750 | TOTALENERGIES SE | 15 | 133,366 | 8,506 |
| CRH PLC | 72 | 589,050 | 8,174 | T-MOBILE US INC | 6 | 120,738 | 20,052 |
| KENVUE INC | 152 | 523,567 | 3,437 | NOVARTIS AG | 8 | 120,099 | 13,427 |
| ALPHABET INC-CL C | 24 | 481,667 | 19,351 | ALPHABET INC-CL C | 5 | 98,669 | 17,420 |

(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

2023年11月20日現在

(1) 外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|--------------------------------|---------|-------|---------|------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| 3M CO | 511 | 548 | 5,230 | 784,248 | 資本財 |
| ABBOTT LABORATORIES | 1,612 | 1,728 | 17,206 | 2,580,162 | ヘルスケア機器・サービス |
| ABBVIE INC | 1,635 | 1,753 | 24,252 | 3,636,713 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ACCENTURE PLC | 582 | 626 | 20,553 | 3,082,065 | ソフトウェア・サービス |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 723 | — | — | — | メディア・娯楽 |
| ADOBE INC | 429 | 453 | 27,300 | 4,093,709 | ソフトウェア・サービス |
| ADVANCE AUTO PARTS | 54 | — | — | — | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC | 1,490 | 1,600 | 19,306 | 2,895,000 | 半導体・半導体製造装置 |
| AECOM | 121 | 131 | 1,140 | 171,067 | 資本財 |
| AERCAP HOLDINGS NV | 124 | 153 | 1,050 | 157,484 | 資本財 |
| AES CORP | 617 | 665 | 1,132 | 169,745 | 公益事業 |
| AFLAC INC | 545 | 570 | 4,663 | 699,243 | 保険 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 272 | 293 | 3,322 | 498,265 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 205 | 220 | 5,961 | 893,949 | 素材 |
| AIRBNB INC-CLASS A | 349 | 409 | 5,211 | 781,502 | 消費者サービス |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 145 | 151 | 1,698 | 254,753 | ソフトウェア・サービス |
| ALBEMARLE CORP | 108 | 116 | 1,485 | 222,788 | 素材 |
| ALBERTSONS COS INC - CLASS A | — | 314 | 660 | 99,097 | 生活必需品流通・小売り |
| ALCOA CORP | 163 | — | — | — | 素材 |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 68 | 72 | 1,492 | 223,871 | ヘルスケア機器・サービス |
| ALLEGION PLC | 81 | 87 | 929 | 139,442 | 資本財 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 231 | 249 | 1,228 | 184,277 | 公益事業 |
| ALLSTATE CORP | 245 | 261 | 3,507 | 525,923 | 保険 |
| ALLY FINANCIAL INC | 275 | 269 | 740 | 110,982 | 金融サービス |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 113 | 123 | 2,027 | 303,994 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALPHABET INC-CL A | 5,521 | 5,902 | 79,870 | 11,976,583 | メディア・娯楽 |
| ALPHABET INC-CL C | 5,064 | 5,256 | 71,980 | 10,793,510 | メディア・娯楽 |
| ALTRIA GROUP INC | 1,657 | 1,774 | 7,243 | 1,086,237 | 食品・飲料・タバコ |
| AMAZON.COM INC | 8,487 | 9,178 | 133,248 | 19,980,616 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| AMCOR PLC | 1,379 | 1,465 | 1,373 | 205,918 | 素材 |
| AMEREN CORPORATION | 238 | 260 | 2,011 | 301,662 | 公益事業 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC | 474 | 511 | 3,959 | 593,727 | 公益事業 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 587 | 627 | 10,207 | 1,530,682 | 金融サービス |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 66 | 71 | 785 | 117,820 | 保険 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|-------------------------------|---------|--------|---------|------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 686 | 718 | 4,634 | 694,885 | 保険 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 167 | 193 | 2,554 | 383,114 | 公益事業 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 98 | 103 | 3,597 | 539,513 | 金融サービス |
| AMETEK INC | 212 | 229 | 3,565 | 534,677 | 資本財 |
| AMGEN INC | 493 | 531 | 14,094 | 2,113,524 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMPHENOL CORP-CL A | 550 | 591 | 5,307 | 795,920 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ANALOG DEVICES INC | 470 | 498 | 9,124 | 1,368,190 | 半導体・半導体製造装置 |
| ANSYS INC | 80 | 86 | 2,579 | 386,803 | ソフトウェア・サービス |
| AON PLC | 191 | 203 | 6,694 | 1,003,773 | 保険 |
| APA CORP | 296 | 306 | 1,128 | 169,276 | エネルギー |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 370 | 394 | 3,428 | 514,095 | 金融サービス |
| APPLE INC | 14,706 | 15,633 | 296,542 | 44,466,586 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| APPLIED MATERIALS INC | 795 | 834 | 12,401 | 1,859,555 | 半導体・半導体製造装置 |
| APTIV PLC | 250 | 281 | 2,283 | 342,376 | 自動車・自動車部品 |
| ARAMARK | 215 | 245 | 681 | 102,207 | 消費者サービス |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 341 | 369 | 3,090 | 463,474 | 保険 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 507 | 541 | 4,003 | 600,340 | 食品・飲料・タバコ |
| ARES MANAGEMENT CORP - A | 144 | 159 | 1,708 | 256,264 | 金融サービス |
| ARISTA NETWORKS INC | 225 | 260 | 5,590 | 838,258 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 56 | 57 | 704 | 105,641 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 194 | 212 | 5,226 | 783,767 | 保険 |
| ASPEN TECHNOLOGY INC | 26 | 29 | 533 | 79,975 | ソフトウェア・サービス |
| ASSURANT INC | 48 | 52 | 851 | 127,715 | 保険 |
| AT&T INC | 6,592 | 7,118 | 11,318 | 1,697,177 | 電気通信サービス |
| ATLISSIAN CORP-CL A | 138 | 150 | 2,792 | 418,751 | ソフトウェア・サービス |
| ATMOS ENERGY CORP | 130 | 143 | 1,634 | 245,019 | 公益事業 |
| AUTODESK INC | 199 | 212 | 4,616 | 692,215 | ソフトウェア・サービス |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | 383 | 410 | 9,419 | 1,412,514 | 商業・専門サービス |
| AUTOZONE INC | 17 | 18 | 4,739 | 710,642 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| AVANTOR INC | 623 | 671 | 1,298 | 194,685 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AVERY DENNISON CORP | 74 | 80 | 1,524 | 228,673 | 素材 |
| AXON ENTERPRISE INC | 62 | 69 | 1,559 | 233,838 | 資本財 |
| BAKER HUGHES COMPANY | 925 | 1,006 | 3,391 | 508,574 | エネルギー |
| BALL CORP | 290 | 312 | 1,637 | 245,536 | 素材 |
| BANK OF AMERICA CORP | 6,674 | 7,128 | 21,371 | 3,204,631 | 銀行 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 709 | 773 | 3,652 | 547,667 | 金融サービス |
| BATH & BODY WORKS INC | 210 | 216 | 634 | 95,151 | 一般消費財・サービス流通・小売り |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 466 | 502 | 1,782 | 267,286 | ヘルスケア機器・サービス |
| BECTON DICKINSON & CO | 262 | 282 | 6,584 | 987,382 | ヘルスケア機器・サービス |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | 179 | 210 | 1,110 | 166,587 | ソフトウェア・サービス |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 1,203 | 1,288 | 46,231 | 6,932,431 | 金融サービス |
| BEST BUY CO INC | 187 | 195 | 1,331 | 199,671 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| BILL HOLDINGS, INC. | 87 | 95 | 605 | 90,866 | ソフトウェア・サービス |
| BIOGEN INC | 133 | 143 | 3,279 | 491,734 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 171 | 186 | 1,633 | 244,913 | 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 | 20 | 21 | 657 | 98,666 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIO-TECHNE CORP | 145 | 156 | 955 | 143,322 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACK KNIGHT INC | 144 | - | - | - | ソフトウェア・サービス |
| BLACKROCK INC | 138 | 148 | 10,670 | 1,600,035 | 金融サービス |
| BLACKSTONE INC | 648 | 701 | 7,366 | 1,104,577 | 金融サービス |
| BLOCK INC | 496 | 541 | 3,148 | 472,176 | 金融サービス |
| BOEING CO | 523 | 568 | 11,817 | 1,771,972 | 資本財 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 35 | 36 | 11,509 | 1,725,849 | 消費者サービス |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 122 | 130 | 1,650 | 247,444 | 商業・専門サービス |
| BORGWARNER INC | 216 | 232 | 801 | 120,185 | 自動車・自動車部品 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 1,324 | 1,428 | 7,763 | 1,164,161 | ヘルスケア機器・サービス |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 1,965 | 2,088 | 10,617 | 1,592,044 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BROADCOM INC | 385 | 410 | 40,103 | 6,013,527 | 半導体・半導体製造装置 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 108 | 117 | 2,142 | 321,298 | 商業・専門サービス |
| BROWN & BROWN INC | 222 | 239 | 1,749 | 262,288 | 保険 |
| BROWN-FORMAN CORP -CL B | 286 | 308 | 1,804 | 270,585 | 食品・飲料・タバコ |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC | - | 127 | 1,700 | 254,965 | 資本財 |
| BUNGE GLOBAL SA | 138 | 149 | 1,597 | 239,611 | 食品・飲料・タバコ |
| BURLINGTON STORES INC | 60 | 64 | 877 | 131,556 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 108 | 115 | 955 | 143,304 | 運輸 |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | 253 | 270 | 7,269 | 1,090,113 | ソフトウェア・サービス |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 198 | 213 | 981 | 147,239 | 消費者サービス |
| CAMPBELL SOUP CO | 194 | 192 | 788 | 118,228 | 食品・飲料・タバコ |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 352 | 379 | 4,085 | 612,634 | 金融サービス |
| CARDINAL HEALTH INC | 242 | 252 | 2,614 | 392,048 | ヘルスケア機器・サービス |
| CARLISLE COS INC | 47 | 50 | 1,384 | 207,540 | 資本財 |
| CARLYLE GROUP INC/THE | 184 | 215 | 687 | 103,059 | 金融サービス |
| CARMAX INC | 146 | 157 | 1,005 | 150,800 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CARNIVAL CORP | 925 | 1,000 | 1,480 | 221,980 | 消費者サービス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|-------------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| CARRIER GLOBAL CORP | 773 | 829 | 4,415 | 662,120 | 資本財 |
| CATALENT INC | 158 | 179 | 714 | 107,176 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CATERPILLAR INC | 481 | 512 | 12,962 | 1,943,764 | 資本財 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 98 | 104 | 1,852 | 277,855 | 金融サービス |
| CBRE GROUP INC | 292 | 308 | 2,413 | 361,964 | 不動産管理・開発 |
| CDW CORP/DE | 125 | 133 | 2,884 | 432,556 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 100 | 102 | 1,334 | 200,090 | 素材 |
| CENCORA, INC. | 142 | 170 | 3,330 | 499,364 | ヘルスケア機器・サービス |
| CENTENE CORP | 523 | 545 | 3,961 | 594,085 | ヘルスケア機器・サービス |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 581 | 626 | 1,741 | 261,067 | 公益事業 |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | 127 | 146 | 1,014 | 152,089 | 商業・専門サービス |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 181 | 193 | 1,499 | 224,857 | 素材 |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | 47 | 50 | 962 | 144,255 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHARLES SCHWAB CORP | 1,342 | 1,494 | 8,486 | 1,272,552 | 金融サービス |
| CHARTER COMMUNICATIONS-CL A | 100 | 97 | 3,965 | 594,595 | メディア・娯楽 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 92 | 92 | 1,322 | 198,333 | ソフトウェア・サービス |
| CHENIERE ENERGY INC | 206 | 241 | 4,187 | 627,877 | エネルギー |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP | 105 | 112 | 921 | 138,195 | エネルギー |
| CHEVRON CORP | 1,698 | 1,803 | 26,051 | 3,906,419 | エネルギー |
| CHEWY INC - CLASS A | 87 | 115 | 237 | 35,606 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 25 | 27 | 5,928 | 889,024 | 消費者サービス |
| CHUBB LTD | 383 | 411 | 9,163 | 1,374,059 | 保険 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 225 | 242 | 2,243 | 336,422 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 138 | 156 | 1,576 | 236,366 | 保険 |
| CINTAS CORP | 84 | 90 | 4,984 | 747,483 | 商業・専門サービス |
| CISCO SYSTEMS INC | 3,797 | 4,050 | 19,342 | 2,900,442 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CITIGROUP INC | 1,790 | 1,934 | 8,776 | 1,316,026 | 銀行 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 455 | 480 | 1,334 | 200,173 | 銀行 |
| CLARIVATE PLC | 281 | 337 | 243 | 36,476 | 商業・専門サービス |
| CLEVELAND-CLIFFS INC | 476 | 512 | 870 | 130,505 | 素材 |
| CLOROX CO | 114 | 122 | 1,710 | 256,516 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | 236 | 273 | 1,986 | 297,915 | ソフトウェア・サービス |
| CME GROUP INC | 332 | 357 | 7,631 | 1,144,307 | 金融サービス |
| CMS ENERGY CORP | 268 | 289 | 1,662 | 249,296 | 公益事業 |
| COCA-COLA CO | 3,798 | 4,083 | 23,384 | 3,506,526 | 食品・飲料・タバコ |
| COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC | 190 | 204 | 1,230 | 184,558 | 食品・飲料・タバコ |
| COGNEX CORP | 159 | 171 | 634 | 95,085 | 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 | |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP | 474 | 504 | 3,506 | 525,773 | ソフトウェア・サービス |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 115 | 167 | 1,655 | 248,304 | 金融サービス |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 733 | 783 | 5,923 | 888,173 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| COMCAST CORP | 3,987 | 4,134 | 17,536 | 2,629,663 | メディア・娯楽 |
| CONAGRA BRANDS INC | 443 | 474 | 1,337 | 200,559 | 食品・飲料・タバコ |
| CONFLUENT INC-CLASS A | - | 162 | 309 | 46,367 | ソフトウェア・サービス |
| CONOCOPHILLIPS | 1,151 | 1,202 | 13,781 | 2,066,468 | エネルギー |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 327 | 344 | 3,144 | 471,589 | 公益事業 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 153 | 163 | 3,863 | 579,279 | 食品・飲料・タバコ |
| CONSTELLATION ENERGY | 302 | 322 | 3,922 | 588,150 | 公益事業 |
| COOPER COS INC/THE | 45 | 49 | 1,657 | 248,610 | ヘルスケア機器・サービス |
| COPART INC | 396 | 853 | 4,288 | 643,058 | 商業・専門サービス |
| CORNING INC | 743 | 803 | 2,287 | 342,978 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CORTEVA INC | 660 | 706 | 3,343 | 501,384 | 素材 |
| COSTAR GROUP INC | 375 | 406 | 3,359 | 503,769 | 不動産管理・開発 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 409 | 440 | 25,421 | 3,811,901 | 生活必需品流通・小売り |
| COTERRA ENERGY INC | 728 | 752 | 2,013 | 301,980 | エネルギー |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 188 | 222 | 4,613 | 691,770 | ソフトウェア・サービス |
| CROWN HOLDINGS INC | 110 | 119 | 997 | 149,559 | 素材 |
| CSX CORP | 1,943 | 2,035 | 6,436 | 965,186 | 運輸 |
| CUMMINS INC | 130 | 140 | 3,173 | 475,894 | 資本財 |
| CVS HEALTH CORP | 1,214 | 1,274 | 8,769 | 1,314,995 | ヘルスケア機器・サービス |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 37 | 41 | 785 | 117,724 | ソフトウェア・サービス |
| DANAHER CORP | 639 | 696 | 14,477 | 2,170,930 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 113 | 120 | 1,873 | 280,898 | 消費者サービス |
| DARLING INTERNATIONAL INC | 148 | 158 | 690 | 103,581 | 食品・飲料・タバコ |
| DATADOG INC - CLASS A | 229 | 250 | 2,741 | 411,147 | ソフトウェア・サービス |
| DAVITA INC | 49 | 53 | 518 | 77,805 | ヘルスケア機器・サービス |
| DECKERS OUTDOOR CORP | - | 25 | 1,612 | 241,732 | 耐久消費財・アパレル |
| DEERE & CO | 265 | 276 | 10,634 | 1,594,689 | 資本財 |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 239 | 254 | 1,872 | 280,775 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DELTA AIR LINES INC | 147 | 159 | 575 | 86,255 | 運輸 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 198 | 211 | 626 | 94,013 | ヘルスケア機器・サービス |
| DEVON ENERGY CORPORATION | 573 | 637 | 2,893 | 433,875 | エネルギー |
| DEXCOM INC | 357 | 385 | 4,044 | 606,456 | ヘルスケア機器・サービス |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 154 | 170 | 2,667 | 399,946 | エネルギー |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | - | 62 | 734 | 110,202 | 一般消費財・サービス流通・小売り |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|-----------------------------|---------|-----|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 252 | 252 | 2,179 | 326,860 | 金融サービス |
| DISH NETWORK CORP | 230 | - | - | - | メディア・娯楽 |
| DOCUSIGN INC | 185 | 201 | 863 | 129,554 | ソフトウェア・サービス |
| DOLLAR GENERAL CORP | 208 | 218 | 2,640 | 396,006 | 生活必需品流通・小売り |
| DOLLAR TREE INC | 204 | 208 | 2,393 | 358,835 | 生活必需品流通・小売り |
| DOMINION ENERGY INC | 770 | 831 | 3,887 | 582,872 | 公益事業 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 32 | 35 | 1,307 | 196,125 | 消費者サービス |
| DOORDASH INC - A | 216 | 251 | 2,391 | 358,664 | 消費者サービス |
| DOVER CORP | 129 | 139 | 1,916 | 287,320 | 資本財 |
| DOW INC | 650 | 703 | 3,635 | 545,157 | 素材 |
| DR HORTON INC | 302 | 304 | 3,904 | 585,525 | 耐久消費財・アパレル |
| DRAFTKINGS INC | - | 413 | 1,586 | 237,939 | 消費者サービス |
| DROPBOX INC-CLASS A | 253 | 257 | 697 | 104,646 | ソフトウェア・サービス |
| DTE ENERGY COMPANY | 179 | 204 | 2,121 | 318,168 | 公益事業 |
| DUKE ENERGY CORP | 711 | 766 | 6,896 | 1,034,059 | 公益事業 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 459 | 455 | 3,247 | 486,918 | 素材 |
| DYNATRACE INC | 199 | 247 | 1,267 | 190,055 | ソフトウェア・サービス |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 111 | 118 | 965 | 144,841 | 素材 |
| EATON CORP PLC | 367 | 396 | 9,024 | 1,353,261 | 資本財 |
| EBAY INC | 501 | 531 | 2,132 | 319,837 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ECOLAB INC | 237 | 254 | 4,695 | 704,129 | 素材 |
| EDISON INTERNATIONAL | 352 | 380 | 2,507 | 376,051 | 公益事業 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 571 | 602 | 4,031 | 604,467 | ヘルスケア機器・サービス |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 394 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ELECTRONIC ARTS INC | 255 | 256 | 3,435 | 515,101 | メディア・娯楽 |
| ELEVANCE HEALTH, INC | 220 | 235 | 10,908 | 1,635,728 | ヘルスケア機器・サービス |
| ELI LILLY & CO | 746 | 801 | 47,453 | 7,115,632 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EMERSON ELECTRIC CO | 546 | 567 | 5,070 | 760,313 | 資本財 |
| ENPHASE ENERGY INC | 125 | 136 | 1,265 | 189,761 | 半導体・半導体製造装置 |
| ENTEGRIS INC | 137 | 148 | 1,530 | 229,537 | 半導体・半導体製造装置 |
| ENERGY CORP | 188 | 210 | 2,083 | 312,389 | 公益事業 |
| EOG RESOURCES INC | 542 | 581 | 7,207 | 1,080,746 | エネルギー |
| EPAM SYSTEMS INC | 53 | 57 | 1,486 | 222,928 | ソフトウェア・サービス |
| EQT CORP | 305 | 359 | 1,450 | 217,501 | エネルギー |
| EQUIFAX INC | 113 | 121 | 2,501 | 375,162 | 商業・専門サービス |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 340 | 353 | 1,002 | 150,290 | 金融サービス |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 23 | 25 | 707 | 106,102 | 保険 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|---|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 230 | 249 | 888 | 133,279 | 公益事業 |
| ESTEE LAUDER COS INC | 213 | 230 | 2,855 | 428,171 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| ETSY INC | 116 | 122 | 889 | 133,425 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| EVEREST GROUP LTD | 36 | 42 | 1,687 | 252,973 | 保険 |
| EVERGY INC | 212 | 228 | 1,149 | 172,412 | 公益事業 |
| EVERSOURCE ENERGY | 321 | 346 | 2,029 | 304,302 | 公益事業 |
| EXACT SCIENCES CORP | 164 | 179 | 1,188 | 178,254 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EXELON CORP | 918 | 988 | 3,848 | 577,064 | 公益事業 |
| EXPEDIA GROUP INC | 139 | 141 | 1,932 | 289,738 | 消費者サービス |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC | 146 | 151 | 1,805 | 270,755 | 運輸 |
| EXXON MOBIL CORP | 3,807 | 4,017 | 42,171 | 6,323,657 | エネルギー |
| F5 INC | 55 | 60 | 979 | 146,869 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 35 | 37 | 1,733 | 259,979 | 金融サービス |
| FAIR ISAAC CORP | 23 | 24 | 2,587 | 388,064 | ソフトウェア・サービス |
| FASTENAL CO | 529 | 567 | 3,450 | 517,399 | 資本財 |
| FEDEX CORP | 228 | 237 | 6,073 | 910,711 | 運輸 |
| FERGUSON PLC | 192 | 203 | 3,383 | 507,336 | 資本財 |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 238 | 257 | 1,158 | 173,704 | 保険 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 548 | 589 | 3,220 | 482,971 | 金融サービス |
| FIFTH THIRD BANCORP | 634 | 676 | 1,865 | 279,683 | 銀行 |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 9 | 10 | 1,568 | 235,145 | 銀行 |
| FIRST HORIZON NATIONAL CORP | 496 | 528 | 652 | 97,790 | 銀行 |
| FIRST SOLAR INC | 88 | 100 | 1,563 | 234,451 | 半導体・半導体製造装置 |
| FIRSTENERGY CORP | 502 | 540 | 2,010 | 301,548 | 公益事業 |
| FISERV INC | 557 | 613 | 7,613 | 1,141,614 | 金融サービス |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 64 | 69 | 1,622 | 243,356 | 金融サービス |
| FMC CORP | 116 | 124 | 667 | 100,085 | 素材 |
| FORD MOTOR CO | 3,651 | 3,906 | 4,011 | 601,547 | 自動車・自動車部品 |
| FORTINET INC | 613 | 663 | 3,399 | 509,818 | ソフトウェア・サービス |
| FORTIVE CORP | 310 | 351 | 2,392 | 358,723 | 資本財 |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC | 118 | 125 | 846 | 126,910 | 資本財 |
| FOX CORP - CLASS A | 275 | 263 | 800 | 120,080 | メディア・娯楽 |
| FOX CORP- CLASS B | 138 | 144 | 410 | 61,524 | メディア・娯楽 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 276 | 298 | 724 | 108,589 | 金融サービス |
| FREPORT-MCMORAN INC | 1,321 | 1,424 | 5,127 | 768,849 | 素材 |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR | 55 | 54 | 326 | 48,959 | 金融サービス |
| GARMIN LTD | 141 | 152 | 1,819 | 272,839 | 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 | |
| GARTNER INC | 73 | 78 | 3,279 | 491,822 | ソフトウェア・サービス |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY | 336 | 406 | 2,968 | 445,122 | ヘルスケア機器・サービス |
| GEN DIGITAL INC | 541 | 572 | 1,183 | 177,501 | ソフトウェア・サービス |
| GENERAC HOLDINGS INC | 58 | 61 | 705 | 105,839 | 資本財 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 215 | 231 | 5,672 | 850,613 | 資本財 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 1,010 | 1,082 | 12,978 | 1,946,120 | 資本財 |
| GENERAL MILLS INC | 548 | 581 | 3,768 | 565,030 | 食品・飲料・タバコ |
| GENERAL MOTORS CO | 1,313 | 1,381 | 3,872 | 580,628 | 自動車・自動車部品 |
| GENUINE PARTS CO | 130 | 139 | 1,919 | 287,867 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| GILEAD SCIENCES INC | 1,159 | 1,239 | 9,354 | 1,402,698 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 249 | 260 | 2,917 | 437,504 | 金融サービス |
| GLOBAL-E ONLINE LTD | - | 89 | 274 | 41,096 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| GLOBE LIFE INC | 85 | 90 | 1,064 | 159,651 | 保険 |
| GODADDY INC - CLASS A | 143 | 145 | 1,339 | 200,866 | ソフトウェア・サービス |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 313 | 330 | 11,206 | 1,680,363 | 金融サービス |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A | 1,204 | 1,863 | 616 | 92,468 | 運輸 |
| GRACO INC | 155 | 167 | 1,349 | 202,354 | 資本財 |
| HALLIBURTON CO | 839 | 896 | 3,405 | 510,711 | エネルギー |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC | 293 | 308 | 2,357 | 353,542 | 保険 |
| HASBRO INC | 121 | 131 | 591 | 88,690 | 耐久消費財・アパレル |
| HCA HEALTHCARE INC | 196 | 205 | 5,053 | 757,809 | ヘルスケア機器・サービス |
| HEICO CORP | 40 | 43 | 734 | 110,180 | 資本財 |
| HEICO CORP-CLASS A | 68 | 74 | 1,007 | 151,096 | 資本財 |
| HENRY SCHEIN INC | 125 | 130 | 894 | 134,182 | ヘルスケア機器・サービス |
| HERSHEY CO/THE | 135 | 146 | 2,870 | 430,390 | 食品・飲料・タバコ |
| HESS CORP | 256 | 274 | 3,966 | 594,791 | エネルギー |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS | 1,189 | 1,283 | 2,043 | 306,473 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HF SINCLAIR CORP | 138 | 152 | 819 | 122,896 | エネルギー |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 250 | 262 | 4,425 | 663,556 | 消費者サービス |
| HOLOGIC INC | 227 | 244 | 1,757 | 263,538 | ヘルスケア機器・サービス |
| HOME DEPOT INC | 942 | 999 | 30,705 | 4,604,242 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 621 | 661 | 12,653 | 1,897,365 | 資本財 |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 1,031 | 1,103 | 362 | 54,414 | 不動産管理・開発 |
| HORIZON PHARMA PLC | 199 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HORMEL FOODS CORP | 278 | 299 | 972 | 145,901 | 食品・飲料・タバコ |
| HOWMET AEROSPACE INC | 344 | 389 | 2,005 | 300,775 | 資本財 |
| HP INC | 929 | 881 | 2,496 | 374,323 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|--|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| HUBBELL INC | 49 | 53 | 1,602 | 240,231 | 資本財 |
| HUBSPOT INC | 42 | 46 | 2,195 | 329,283 | ソフトウェア・サービス |
| HUMANA INC | 117 | 124 | 6,185 | 927,557 | ヘルスケア機器・サービス |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 1,333 | 1,435 | 1,590 | 238,520 | 銀行 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 36 | 39 | 938 | 140,760 | 資本財 |
| HYATT HOTELS CORP - CL A | - | 46 | 535 | 80,294 | 消費者サービス |
| IDEX CORP | 69 | 75 | 1,488 | 223,162 | 資本財 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 76 | 82 | 3,824 | 573,555 | ヘルスケア機器・サービス |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 284 | 302 | 7,248 | 1,086,907 | 資本財 |
| ILLUMINA INC | 145 | 157 | 1,482 | 222,332 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INCYTE CORP | 174 | 188 | 1,023 | 153,405 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INGERSOLL-RAND INC | 374 | 402 | 2,828 | 424,120 | 資本財 |
| INSULET CORP | 64 | 69 | 1,206 | 180,875 | ヘルスケア機器・サービス |
| INTEL CORP | 3,815 | 4,145 | 18,162 | 2,723,418 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 516 | 556 | 6,198 | 929,501 | 金融サービス |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | 835 | 902 | 13,799 | 2,069,196 | ソフトウェア・サービス |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC | 235 | 253 | 1,877 | 281,517 | 素材 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 312 | 327 | 1,094 | 164,134 | 素材 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 359 | 383 | 1,164 | 174,613 | メディア・娯楽 |
| INTUIT INC | 246 | 278 | 15,592 | 2,338,112 | ソフトウェア・サービス |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 326 | 348 | 10,631 | 1,594,174 | ヘルスケア機器・サービス |
| INVESCO LTD | 314 | 341 | 472 | 70,848 | 金融サービス |
| IQVIA HOLDINGS INC | 171 | 184 | 3,776 | 566,321 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JABIL CIRCUIT INC | - | 129 | 1,706 | 255,888 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 67 | 72 | 1,103 | 165,502 | 金融サービス |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 116 | 126 | 1,705 | 255,730 | 商業・専門サービス |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 147 | 158 | 628 | 94,294 | 資本財 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 58 | 63 | 768 | 115,174 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 76 | 82 | 1,466 | 219,899 | 運輸 |
| JM SMUCKER CO | 98 | 101 | 1,133 | 169,907 | 食品・飲料・タバコ |
| JOHNSON & JOHNSON | 2,417 | 2,393 | 35,848 | 5,375,503 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 634 | 682 | 3,562 | 534,252 | 資本財 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 2,711 | 2,904 | 44,385 | 6,655,582 | 銀行 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 299 | 319 | 863 | 129,452 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| KELLANOVA | 236 | 272 | 1,440 | 216,009 | 食品・飲料・タバコ |
| KENVUE INC | - | 1,523 | 2,997 | 449,451 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| KEURIG DR PEPPER INC | 721 | 907 | 2,879 | 431,766 | 食品・飲料・タバコ |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|-------------------------------------|---------|-------|--------|-----------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| KEYCORP | 861 | 930 | 1,146 | 171,947 | 銀行 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN | 165 | 177 | 2,361 | 354,114 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 312 | 335 | 4,066 | 609,790 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| KINDER MORGAN INC | 1,869 | 2,005 | 3,400 | 509,975 | エネルギー |
| KKR & CO INC -A | 517 | 600 | 4,018 | 602,520 | 金融サービス |
| KLA CORPORATION | 131 | 136 | 7,424 | 1,113,349 | 半導体・半導体製造装置 |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 140 | 159 | 822 | 123,371 | 運輸 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 679 | 854 | 2,874 | 431,066 | 食品・飲料・タバコ |
| KROGER CO | 628 | 677 | 2,875 | 431,229 | 生活必需品流通・小売り |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 176 | 188 | 3,499 | 524,724 | 資本財 |
| LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | 81 | 88 | 1,864 | 279,535 | ヘルスケア機器・サービス |
| LAM RESEARCH CORP | 126 | 133 | 9,350 | 1,402,173 | 半導体・半導体製造装置 |
| LAMB WESTON HOLDING INC | 132 | 144 | 1,387 | 207,993 | 食品・飲料・タバコ |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 317 | 341 | 1,677 | 251,512 | 消費者サービス |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP | - | 136 | 794 | 119,102 | 半導体・半導体製造装置 |
| LEAR CORP | 54 | 58 | 787 | 118,074 | 自動車・自動車部品 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 119 | 129 | 1,362 | 204,367 | 商業・専門サービス |
| LENNAR CORP-CL A | 235 | 250 | 3,197 | 479,457 | 耐久消費財・アパレル |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 29 | 31 | 1,287 | 192,985 | 資本財 |
| LIBERTY BROADBAND-C | 111 | 118 | 990 | 148,569 | メディア・娯楽 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 142 | - | - | - | 電気通信サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 253 | 251 | 439 | 65,967 | 電気通信サービス |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 63 | - | - | - | メディア・娯楽 |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 155 | 162 | 423 | 63,445 | メディア・娯楽 |
| LIBERTY MEDIA GROUP-C | 182 | 196 | 1,254 | 188,059 | メディア・娯楽 |
| LINDE PLC | 456 | 486 | 19,849 | 2,976,368 | 素材 |
| LIVE NATION INC | 160 | 159 | 1,433 | 214,914 | メディア・娯楽 |
| LKQ CORP | 234 | 265 | 1,208 | 181,262 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 218 | 226 | 10,075 | 1,510,763 | 資本財 |
| LOEWS CORP | 186 | 191 | 1,285 | 192,704 | 保険 |
| LOWE'S COS INC | 559 | 582 | 11,863 | 1,778,899 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 73 | 77 | 1,732 | 259,737 | 金融サービス |
| LUCID GROUP INC | 388 | 905 | 384 | 57,729 | 自動車・自動車部品 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 107 | 115 | 4,864 | 729,416 | 耐久消費財・アパレル |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 240 | 258 | 2,514 | 377,058 | 素材 |
| M&T BANK CORP | 159 | 164 | 2,089 | 313,305 | 銀行 |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC | - | 61 | 1,366 | 204,863 | ソフトウェア・サービス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|---------------------------------|---------|-------|---------|------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| MARATHON OIL CORP | 585 | 612 | 1,565 | 234,784 | エネルギー |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 432 | 421 | 6,231 | 934,409 | エネルギー |
| MARKEL GROUP INC | 12 | 12 | 1,766 | 264,958 | 保険 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 34 | 37 | 854 | 128,137 | 金融サービス |
| MARRIOTT INTERNATIONAL INC | 248 | 256 | 5,272 | 790,572 | 消費者サービス |
| MARSH & MCLENNAN COS INC | 458 | 491 | 9,729 | 1,458,889 | 保険 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 57 | 61 | 2,845 | 426,662 | 素材 |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 788 | 854 | 4,751 | 712,434 | 半導体・半導体製造装置 |
| MASCO CORP | 208 | 223 | 1,344 | 201,568 | 資本財 |
| MASIMO CORPORATION | 46 | - | - | - | ヘルスケア機器・サービス |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 793 | 841 | 33,670 | 5,048,941 | 金融サービス |
| MATCH GROUP INC | 258 | 276 | 897 | 134,594 | メディア・娯楽 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 231 | 249 | 1,656 | 248,418 | 食品・飲料・タバコ |
| MCDONALD'S CORP | 677 | 725 | 20,011 | 3,000,758 | 消費者サービス |
| MCKESSON CORP | 131 | 134 | 6,061 | 908,920 | ヘルスケア機器・サービス |
| MEDTRONIC PLC | 1,229 | 1,322 | 9,886 | 1,482,512 | ヘルスケア機器・サービス |
| MERCADOLIBRE INC | 41 | 44 | 6,502 | 975,120 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| MERCK & CO INC | 2,343 | 2,522 | 25,662 | 3,848,041 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| META PLATFORMS INC-A | 2,078 | 2,198 | 73,663 | 11,045,852 | メディア・娯楽 |
| METLIFE INC | 616 | 646 | 4,046 | 606,789 | 保険 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 20 | 21 | 2,296 | 344,340 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MGM MIRAGE | 283 | 288 | 1,149 | 172,385 | 消費者サービス |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 508 | 541 | 4,518 | 677,620 | 半導体・半導体製造装置 |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 1,004 | 1,088 | 8,443 | 1,266,101 | 半導体・半導体製造装置 |
| MICROSOFT CORP | 6,546 | 7,020 | 259,661 | 38,936,271 | ソフトウェア・サービス |
| MODERNA INC | 301 | 322 | 2,462 | 369,265 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 46 | 53 | 453 | 67,982 | 耐久消費財・アパレル |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 53 | 57 | 2,047 | 307,012 | ヘルスケア機器・サービス |
| MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B | 175 | 188 | 1,119 | 167,903 | 食品・飲料・タバコ |
| MONDAY.COM LTD | - | 21 | 366 | 54,939 | ソフトウェア・サービス |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 1,262 | 1,353 | 9,560 | 1,433,582 | 食品・飲料・タバコ |
| MONGODB INC | 63 | 70 | 2,753 | 412,885 | ソフトウェア・サービス |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 41 | 44 | 2,418 | 362,691 | 半導体・半導体製造装置 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 723 | 780 | 4,275 | 641,092 | 食品・飲料・タバコ |
| MOODY'S CORP | 152 | 164 | 5,854 | 877,811 | 金融サービス |
| MORGAN STANLEY | 1,171 | 1,244 | 9,994 | 1,498,669 | 金融サービス |
| MOSAIC CO/THE | 314 | 329 | 1,192 | 178,817 | 素材 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|-------|---------|------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 154 | 166 | 5,305 | 795,566 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MSCI INC | 73 | 79 | 4,148 | 622,133 | 金融サービス |
| NASDAQ INC | 317 | 341 | 1,826 | 273,859 | 金融サービス |
| NETAPP INC | 200 | 211 | 1,636 | 245,431 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| NETFLIX INC | 411 | 441 | 20,585 | 3,086,765 | メディア・娯楽 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 88 | 97 | 1,056 | 158,454 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NEWELL BRANDS INC | 363 | - | - | - | 耐久消費財・アパレル |
| NEWMONT CORP | 733 | 789 | 2,869 | 430,244 | 素材 |
| NEWS CORP - CLASS A | 353 | 378 | 795 | 119,317 | メディア・娯楽 |
| NEXTERA ENERGY INC | 1,836 | 2,011 | 11,538 | 1,730,204 | 公益事業 |
| NIKE INC | 1,164 | 1,224 | 12,977 | 1,945,984 | 耐久消費財・アパレル |
| NISOURCE INC | 375 | 409 | 1,068 | 160,264 | 公益事業 |
| NORDSON CORP | 47 | 51 | 1,190 | 178,572 | 資本財 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 213 | 226 | 4,774 | 715,978 | 運輸 |
| NORTHERN TRUST CORP | 182 | 207 | 1,561 | 234,112 | 金融サービス |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 135 | 143 | 6,657 | 998,236 | 資本財 |
| NOVOCURE LTD | 87 | - | - | - | ヘルスケア機器・サービス |
| NRG ENERGY INC | 212 | 228 | 1,099 | 164,905 | 公益事業 |
| NUCOR CORP | 237 | 249 | 3,913 | 586,854 | 素材 |
| NVIDIA CORP | 2,274 | 2,454 | 121,024 | 18,147,641 | 半導体・半導体製造装置 |
| NVR INC | 2 | 3 | 2,034 | 305,036 | 耐久消費財・アパレル |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 239 | 258 | 5,186 | 777,679 | 半導体・半導体製造装置 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 672 | 664 | 4,052 | 607,626 | エネルギー |
| OKTA INC | 140 | 154 | 1,082 | 162,301 | ソフトウェア・サービス |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 86 | 98 | 3,921 | 588,016 | 運輸 |
| OMNICOM GROUP | 188 | 198 | 1,568 | 235,144 | メディア・娯楽 |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 399 | 429 | 3,005 | 450,639 | 半導体・半導体製造装置 |
| ONEOK INC | 413 | 444 | 2,962 | 444,217 | エネルギー |
| ORACLE CORP | 1,495 | 1,618 | 18,672 | 2,799,874 | ソフトウェア・サービス |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 57 | 60 | 5,858 | 878,520 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 385 | 410 | 3,473 | 520,825 | 資本財 |
| OVINTIV INC | 229 | 246 | 1,110 | 166,527 | エネルギー |
| OWENS CORNING | 86 | 89 | 1,173 | 176,009 | 資本財 |
| PACCAR INC | 482 | 519 | 4,745 | 711,548 | 資本財 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 85 | 89 | 1,387 | 208,108 | 素材 |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 1,554 | 1,801 | 3,690 | 553,417 | ソフトウェア・サービス |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 279 | 303 | 7,526 | 1,128,559 | ソフトウェア・サービス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| PARAMOUNT GLOBAL | 562 | 486 | 641 | 96,182 | メディア・娯楽 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 118 | 127 | 5,515 | 827,083 | 資本財 |
| PAYCHEX INC | 299 | 322 | 3,790 | 568,454 | 商業・専門サービス |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 47 | 51 | 919 | 137,844 | 商業・専門サービス |
| PAYLOCITY HOLDING CORP | 38 | 44 | 677 | 101,534 | 商業・専門サービス |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 1,001 | 1,053 | 5,957 | 893,277 | 金融サービス |
| PENTAIR PLC | 151 | 163 | 1,030 | 154,582 | 資本財 |
| PEPSICO INC | 1,273 | 1,368 | 22,818 | 3,421,574 | 食品・飲料・タバコ |
| PFIZER INC | 5,189 | 5,611 | 16,789 | 2,517,561 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PG&E CORP | 1,377 | 1,883 | 3,374 | 506,070 | 公益事業 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 1,433 | 1,543 | 14,187 | 2,127,487 | 食品・飲料・タバコ |
| PHILLIPS 66 | 436 | 455 | 5,304 | 795,461 | エネルギー |
| PINTEREST INC- CLASS A | 543 | 590 | 1,859 | 278,867 | メディア・娯楽 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 208 | 232 | 5,532 | 829,627 | エネルギー |
| PLUG POWER INC | 485 | - | - | - | 資本財 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 372 | 396 | 5,169 | 775,107 | 銀行 |
| POOL CORP | 36 | 38 | 1,358 | 203,760 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| PPG INDUSTRIES INC | 217 | 234 | 3,179 | 476,805 | 素材 |
| PPL CORPORATION | 680 | 731 | 1,909 | 286,302 | 公益事業 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 225 | 240 | 1,748 | 262,133 | 保険 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 2,190 | 2,342 | 35,391 | 5,307,019 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PROGRESSIVE CORP | 540 | 581 | 9,166 | 1,374,560 | 保険 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 340 | 362 | 3,473 | 520,840 | 保険 |
| PTC INC | 103 | 111 | 1,719 | 257,817 | ソフトウェア・サービス |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 461 | 495 | 3,160 | 473,922 | 公益事業 |
| PULTE GROUP INC | 210 | 221 | 1,955 | 293,173 | 耐久消費財・アパレル |
| QORVO INC | 93 | 97 | 921 | 138,209 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUALCOMM INC | 1,036 | 1,107 | 14,335 | 2,149,656 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUANTA SERVICES INC | 132 | 144 | 2,641 | 396,099 | 資本財 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 105 | 111 | 1,501 | 225,204 | ヘルスケア機器・サービス |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 178 | 199 | 2,085 | 312,793 | 金融サービス |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 98 | 107 | 8,604 | 1,290,238 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 862 | 931 | 1,529 | 229,281 | 銀行 |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM | 54 | 58 | 1,590 | 238,437 | 素材 |
| REPLIGEN CORP | 48 | 52 | 792 | 118,806 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REPUBLIC SERVICES INC | 204 | 220 | 3,491 | 523,625 | 商業・専門サービス |
| RESMED INC | 135 | 146 | 2,176 | 326,360 | ヘルスケア機器・サービス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| REVVITY INC | 116 | 124 | 1,097 | 164,572 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A | 295 | 648 | 1,083 | 162,442 | 自動車・自動車部品 |
| ROBERT HALF INC | 100 | 107 | 866 | 129,890 | 商業・専門サービス |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A | - | 424 | 343 | 51,503 | 金融サービス |
| ROBLOX CORP -CLASS A | 330 | 418 | 1,584 | 237,661 | メディア・娯楽 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 106 | 114 | 3,142 | 471,239 | 資本財 |
| ROKU INC | 112 | 122 | 1,140 | 170,998 | メディア・娯楽 |
| ROLLINS INC | 204 | 245 | 966 | 144,893 | 商業・専門サービス |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 98 | 105 | 5,558 | 833,554 | ソフトウェア・サービス |
| ROSS STORES INC | 320 | 338 | 4,361 | 653,981 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 212 | 228 | 2,413 | 361,839 | 消費者サービス |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A | 326 | 379 | 1,008 | 151,178 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RPM INTERNATIONAL INC | 119 | 128 | 1,305 | 195,804 | 素材 |
| RTX CORPORATION | 1,359 | 1,452 | 11,575 | 1,735,676 | 資本財 |
| S&P GLOBAL INC | 307 | 326 | 13,305 | 1,995,225 | 金融サービス |
| SALESFORCE INC | 924 | 968 | 21,415 | 3,211,275 | ソフトウェア・サービス |
| SCHLUMBERGER LTD | 1,310 | 1,416 | 7,486 | 1,122,635 | エネルギー |
| SEA LTD-ADR | 334 | 362 | 1,363 | 204,432 | メディア・娯楽 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 181 | 185 | 1,406 | 210,872 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SEAGEN INC | 128 | 139 | 2,963 | 444,384 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEALED AIR CORP | 133 | 143 | 478 | 71,714 | 素材 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 105 | 112 | 650 | 97,582 | 金融サービス |
| SEMPRA | 290 | 625 | 4,519 | 677,720 | 公益事業 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 141 | 152 | 495 | 74,373 | 資本財 |
| SERVICENOW INC | 187 | 202 | 13,247 | 1,986,465 | ソフトウェア・サービス |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 227 | 243 | 6,581 | 986,909 | 素材 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 718 | 770 | 391 | 58,682 | メディア・娯楽 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 148 | 158 | 1,490 | 223,476 | 半導体・半導体製造装置 |
| SMITH (A.O.) CORP | 117 | 123 | 945 | 141,824 | 資本財 |
| SNAP INC - A | 1,005 | 1,009 | 1,200 | 180,005 | メディア・娯楽 |
| SNAP-ON INC | 49 | 52 | 1,461 | 219,121 | 資本財 |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 207 | 259 | 4,194 | 628,893 | ソフトウェア・サービス |
| SOLAREdge TECHNOLOGIES INC | 51 | 56 | 442 | 66,388 | 半導体・半導体製造装置 |
| SOUTHERN CO | 1,006 | 1,083 | 7,561 | 1,133,799 | 公益事業 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 137 | 148 | 368 | 55,309 | 運輸 |
| SPLUNK INC | 150 | 156 | 2,360 | 353,970 | ソフトウェア・サービス |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 209 | 222 | 1,225 | 183,781 | 商業・専門サービス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|--------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 136 | 152 | 1,397 | 209,528 | 資本財 |
| STARBUCKS CORP | 1,061 | 1,139 | 12,029 | 1,803,885 | 消費者サービス |
| STATE STREET CORP | 339 | 332 | 2,331 | 349,566 | 金融サービス |
| STEEL DYNAMICS INC | 162 | 159 | 1,769 | 265,378 | 素材 |
| STERIS PLC | 92 | 98 | 1,963 | 294,420 | ヘルスケア機器・サービス |
| STRYKER CORP | 314 | 339 | 9,792 | 1,468,345 | ヘルスケア機器・サービス |
| SUPER MICRO COMPUTER INC | - | 46 | 1,354 | 203,171 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 416 | 425 | 1,271 | 190,632 | 金融サービス |
| SYNOPSIS INC | 141 | 151 | 8,086 | 1,212,637 | ソフトウェア・サービス |
| SYSCO CORP | 468 | 503 | 3,571 | 535,558 | 生活必需品流通・小売り |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 206 | 223 | 2,182 | 327,321 | 金融サービス |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 155 | 168 | 2,598 | 389,627 | メディア・娯楽 |
| TARGA RESOURCES CORP | 198 | 212 | 1,831 | 274,677 | エネルギー |
| TARGET CORP | 425 | 458 | 5,960 | 893,702 | 生活必需品流通・小売り |
| TE CONNECTIVITY LTD | 293 | 313 | 4,117 | 617,491 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 43 | 46 | 1,827 | 274,032 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELEFLEX INC | 43 | 46 | 992 | 148,882 | ヘルスケア機器・サービス |
| TERADYNE INC | 143 | 154 | 1,419 | 212,795 | 半導体・半導体製造装置 |
| TESLA, INC. | 2,481 | 2,835 | 66,429 | 9,961,094 | 自動車・自動車部品 |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 1,026 | 1,112 | 1,007 | 151,019 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 839 | 902 | 13,950 | 2,091,937 | 半導体・半導体製造装置 |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP | 5 | 6 | 1,011 | 151,603 | エネルギー |
| TEXTRON INC | 192 | 200 | 1,550 | 232,493 | 資本財 |
| THE CIGNA GROUP | 282 | 294 | 8,308 | 1,245,928 | ヘルスケア機器・サービス |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 362 | 383 | 17,882 | 2,681,487 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TJX COS INC | 1,073 | 1,142 | 10,147 | 1,521,614 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| T-MOBILE US INC | 576 | 538 | 7,959 | 1,193,593 | 電気通信サービス |
| TOAST INC-CLASS A | 231 | 307 | 442 | 66,376 | 金融サービス |
| TORO CO | 96 | 103 | 882 | 132,302 | 資本財 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 102 | 108 | 2,206 | 330,853 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 411 | 442 | 2,938 | 440,688 | メディア・娯楽 |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 102 | 108 | 1,011 | 151,724 | 金融サービス |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 212 | 226 | 5,182 | 777,094 | 資本財 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 47 | 54 | 5,227 | 783,893 | 資本財 |
| TRANSUNION | 178 | 192 | 1,119 | 167,856 | 商業・専門サービス |
| TRAVELERS COS INC/THE | 216 | 229 | 3,943 | 591,396 | 保険 |
| TRIMBLE INC | 228 | 246 | 1,067 | 160,094 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|-------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 1,227 | 1,324 | 4,234 | 634,889 | 銀行 |
| TWILIO INC - A | 161 | 170 | 1,078 | 161,775 | ソフトウェア・サービス |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 38 | 41 | 1,714 | 257,022 | ソフトウェア・サービス |
| TYSON FOODS INC-CL A | 267 | 284 | 1,384 | 207,614 | 食品・飲料・タバコ |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 1,382 | 1,810 | 9,855 | 1,477,798 | 運輸 |
| UGI CORP | 193 | - | - | - | 公益事業 |
| U-HAUL HOLDING CO | 81 | 96 | 512 | 76,861 | 運輸 |
| UIPATH INC - CLASS A | - | 357 | 652 | 97,827 | ソフトウェア・サービス |
| ULTA BEAUTY INC | 47 | 49 | 2,025 | 303,658 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| UNION PACIFIC CORP | 568 | 605 | 13,283 | 1,991,888 | 運輸 |
| UNITED PARCEL SERVICE INC | 674 | 720 | 10,660 | 1,598,561 | 運輸 |
| UNITED RENTALS INC | 64 | 68 | 3,285 | 492,599 | 資本財 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 42 | 46 | 1,065 | 159,804 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 863 | 925 | 49,629 | 7,441,920 | ヘルスケア機器・サービス |
| UNITY SOFTWARE INC | 229 | 225 | 659 | 98,906 | ソフトウェア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 59 | 62 | 850 | 127,460 | ヘルスケア機器・サービス |
| US BANCORP | 1,304 | 1,523 | 5,735 | 860,039 | 銀行 |
| VAIL RESORTS INC | 37 | 40 | 905 | 135,725 | 消費者サービス |
| VALERO ENERGY CORP | 356 | 359 | 4,457 | 668,370 | エネルギー |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 129 | 144 | 2,557 | 383,555 | ヘルスケア機器・サービス |
| VERALTO CORP | - | 232 | 1,648 | 247,228 | 商業・専門サービス |
| VERISIGN INC | 88 | 93 | 1,955 | 293,177 | ソフトウェア・サービス |
| VERISK ANALYTICS INC | 144 | 143 | 3,411 | 511,510 | 商業・専門サービス |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 3,887 | 4,187 | 15,169 | 2,274,666 | 電気通信サービス |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 237 | 255 | 8,972 | 1,345,366 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VF CORP | 305 | 329 | 566 | 85,011 | 耐久消費財・アパレル |
| VIATRIS INC | 1,120 | 1,190 | 1,125 | 168,755 | 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 | 1,505 | 1,608 | 40,139 | 6,018,915 | 金融サービス |
| VISTRA CORP | 330 | 333 | 1,161 | 174,104 | 公益事業 |
| VMWARE INC-CLASS A | 196 | 235 | 3,519 | 527,705 | ソフトウェア・サービス |
| VULCAN MATERIALS CO | 122 | 132 | 2,807 | 420,949 | 素材 |
| WABTEC CORP | 159 | 178 | 2,064 | 309,607 | 資本財 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 679 | 729 | 1,548 | 232,272 | 生活必需品流通・小売り |
| WALMART INC | 1,380 | 1,472 | 22,868 | 3,429,147 | 生活必需品流通・小売り |
| WALT DISNEY CO | 1,685 | 1,816 | 17,101 | 2,564,355 | メディア・娯楽 |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 2,132 | 2,300 | 2,464 | 369,490 | メディア・娯楽 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 237 | 256 | 3,452 | 517,633 | 商業・専門サービス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|------------------------------|------------------|----------------|----------------|----------------|------------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 379 | 404 | 6,896 | 1,034,185 | 商業・専門サービス | |
| WATERS CORP | 54 | 58 | 1,536 | 230,469 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| WATSCO INC | – | 33 | 1,295 | 194,203 | 資本財 | |
| WEBSTER FINANCIAL CORP | 160 | 173 | 749 | 112,332 | 銀行 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 291 | 313 | 2,562 | 384,229 | 公益事業 | |
| WELLS FARGO & CO | 3,522 | 3,645 | 15,660 | 2,348,261 | 銀行 | |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 68 | 73 | 2,528 | 379,194 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 293 | 318 | 1,483 | 222,380 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 35 | 37 | 493 | 74,050 | 素材 | |
| WESTROCK CO-WHEN ISSUED | 235 | 254 | 966 | 144,877 | 素材 | |
| WEYERHAEUSER CO | 680 | 727 | 2,321 | 348,119 | エクイティ不動産投資信託 (REIT) | |
| WHIRLPOOL CORP | 50 | 54 | 613 | 91,946 | 耐久消費財・アパレル | |
| WILLIAMS COS INC | 1,126 | 1,210 | 4,288 | 643,116 | エネルギー | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 100 | 105 | 2,559 | 383,864 | 保険 | |
| WIX.COM LTD | 52 | 53 | 518 | 77,778 | ソフトウェア・サービス | |
| WOLFSPEED INC | 114 | 123 | 454 | 68,180 | 半導体・半導体製造装置 | |
| WORKDAY INC-CLASS A | 185 | 204 | 4,742 | 711,074 | ソフトウェア・サービス | |
| WR BERKLEY CORP | 195 | 207 | 1,454 | 218,118 | 保険 | |
| WW GRAINGER INC | 42 | 44 | 3,599 | 539,740 | 資本財 | |
| WYNN RESORTS LTD | 99 | 101 | 883 | 132,515 | 消費者サービス | |
| XCEL ENERGY INC | 505 | 546 | 3,312 | 496,711 | 公益事業 | |
| XYLEM INC | 166 | 237 | 2,406 | 360,869 | 資本財 | |
| YUM! BRANDS INC | 260 | 278 | 3,554 | 533,026 | 消費者サービス | |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 47 | 51 | 1,114 | 167,187 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| ZILLOW GROUP INC - C W/I | 144 | 152 | 596 | 89,417 | 不動産管理・開発 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 193 | 207 | 2,316 | 347,356 | ヘルスケア機器・サービス | |
| ZOETIS INC | 430 | 459 | 8,029 | 1,203,961 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 204 | 237 | 1,520 | 227,928 | ソフトウェア・サービス | |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC | 242 | 260 | 349 | 52,336 | メディア・娯楽 | |
| ZSCALER INC | 80 | 87 | 1,631 | 244,594 | ソフトウェア・サービス | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 313,393 601 | 339,445 605 | 3,882,866 – | 582,235,857 <70.4%> | |
| (カナダ) | | | 千カナダ・ドル | | | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 421 | 489 | 3,250 | 355,142 | 素材 | |
| AIR CANADA | 166 | 176 | 316 | 34,574 | 運輸 | |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 630 | 657 | 537 | 58,740 | 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 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 750 | 777 | 6,085 | 664,824 | 生活必需品流通・小売り |
| ALTAGAS LTD | 263 | 282 | 777 | 84,918 | 公益事業 |
| ARC RESOURCES LTD | 587 | 608 | 1,302 | 142,254 | エネルギー |
| BANK OF MONTREAL | 627 | 710 | 7,963 | 870,029 | 銀行 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 1,104 | 1,188 | 7,257 | 792,894 | 銀行 |
| BARRICK GOLD CORP | 1,629 | 1,746 | 3,764 | 411,253 | 素材 |
| BCE INC | 79 | 87 | 473 | 51,719 | 電気通信サービス |
| BROOKFIELD ASSET MGMT-A | 328 | 349 | 1,611 | 176,071 | 金融サービス |
| BROOKFIELD CORPORATION-A | 1,312 | 1,401 | 6,511 | 711,386 | 金融サービス |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A | 121 | 136 | 484 | 52,976 | 公益事業 |
| BRP INC/CA- SUB VOTING | 33 | 36 | 374 | 40,869 | 耐久消費財・アパレル |
| CAE INC | 295 | 317 | 915 | 100,068 | 資本財 |
| CAMECO CORP | 400 | 430 | 2,636 | 287,983 | エネルギー |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 840 | 904 | 4,903 | 535,724 | 銀行 |
| CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO | 531 | 560 | 8,868 | 968,830 | 運輸 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 1,025 | 1,101 | 10,058 | 1,098,852 | エネルギー |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED | 861 | 926 | 9,116 | 995,969 | 運輸 |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 51 | 52 | 778 | 85,042 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A | 123 | 135 | 424 | 46,342 | 公益事業 |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 139 | 149 | 871 | 95,258 | 素材 |
| CENOVUS ENERGY INC | 1,332 | 1,425 | 3,536 | 386,311 | エネルギー |
| CGI INC | 196 | 211 | 2,933 | 320,469 | ソフトウェア・サービス |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 18 | 20 | 6,320 | 690,564 | ソフトウェア・サービス |
| DESCARTES SYSTEMS GRP/THE | 79 | 85 | 948 | 103,591 | ソフトウェア・サービス |
| DOLLARAMA INC | 253 | 282 | 2,788 | 304,691 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP | 366 | 389 | 815 | 89,045 | 金融サービス |
| EMERA INC | 251 | 274 | 1,349 | 147,420 | 公益事業 |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 151 | 147 | 570 | 62,306 | 生活必需品流通・小売り |
| ENBRIDGE INC | 1,877 | 2,018 | 9,327 | 1,019,031 | エネルギー |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 21 | 21 | 2,546 | 278,253 | 保険 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 545 | 585 | 897 | 98,010 | 素材 |
| FIRSTSERVICE CORP | 37 | 40 | 846 | 92,430 | 不動産管理・開発 |
| FORTIS INC | 449 | 485 | 2,742 | 299,641 | 公益事業 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 177 | 191 | 3,158 | 345,086 | 素材 |
| GEORGE WESTON LTD | 66 | 62 | 1,033 | 112,874 | 生活必需品流通・小売り |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 170 | 232 | 960 | 104,934 | 商業・専門サービス |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 167 | 178 | 875 | 95,614 | 耐久消費財・アパレル |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|----------------------------|---------|-------|---------|-----------|-------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 264 | 282 | 1,204 | 131,601 | 保険 |
| HYDRO ONE LTD | 309 | 332 | 1,274 | 139,285 | 公益事業 |
| IA FINANCIAL CORP INC | 98 | 102 | 898 | 98,184 | 保険 |
| IGM FINANCIAL INC | 80 | 86 | 292 | 31,927 | 金融サービス |
| IMPERIAL OIL LTD | 196 | 204 | 1,614 | 176,390 | エネルギー |
| INTACT FINANCIAL CORP | 162 | 175 | 3,661 | 400,000 | 保険 |
| IVANHOE MINES LTD-CL A | 564 | 607 | 669 | 73,112 | 素材 |
| KEYERA CORP | 207 | 230 | 740 | 80,914 | エネルギー |
| KINROSS GOLD CORP | 1,163 | 1,219 | 889 | 97,223 | 素材 |
| LOBLAW COS LTD | 151 | 159 | 1,947 | 212,730 | 生活必需品流通・小売り |
| LUNDIN MINING CORP | 609 | 655 | 588 | 64,285 | 素材 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 252 | 271 | 2,086 | 227,906 | 自動車・自動車部品 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 1,749 | 1,835 | 4,824 | 527,108 | 保険 |
| METRO INC | 220 | 232 | 1,631 | 178,256 | 生活必需品流通・小売り |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 313 | 337 | 3,083 | 336,857 | 銀行 |
| NORTHLAND POWER INC | 228 | 254 | 572 | 62,546 | 公益事業 |
| NUTRIEN LTD | 481 | 493 | 3,829 | 418,361 | 素材 |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG | 60 | 63 | 170 | 18,589 | 金融サービス |
| ONEX CORPORATION | 66 | 68 | 607 | 66,334 | 金融サービス |
| OPEN TEXT CORP | 251 | 270 | 1,436 | 156,935 | ソフトウェア・サービス |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 195 | 362 | 712 | 77,817 | 素材 |
| PARKLAND CORP | 132 | 141 | 614 | 67,175 | エネルギー |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 513 | 551 | 2,451 | 267,816 | エネルギー |
| POWER CORP OF CANADA | 516 | 580 | 2,124 | 232,142 | 保険 |
| QUEBECOR INC -CL B | 145 | 155 | 480 | 52,481 | 電気通信サービス |
| RB GLOBAL INC | 103 | 181 | 1,531 | 167,311 | 商業・専門サービス |
| RESTAURANT BRANDS INTERN | 270 | 294 | 2,876 | 314,231 | 消費者サービス |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC | 332 | 357 | 2,097 | 229,108 | 電気通信サービス |
| ROYAL BANK OF CANADA | 1,280 | 1,379 | 16,622 | 1,815,988 | 銀行 |
| SAPUTO INC | 233 | 254 | 686 | 75,048 | 食品・飲料・タバコ |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 1,100 | 1,192 | 11,193 | 1,222,882 | ソフトウェア・サービス |
| STANTEC INC | - | 111 | 1,074 | 117,382 | 資本財 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 545 | 586 | 4,074 | 445,140 | 保険 |
| SUNCOR ENERGY INC | 1,253 | 1,312 | 6,080 | 664,298 | エネルギー |
| TC ENERGY CORP | 937 | 1,013 | 5,104 | 557,631 | エネルギー |
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 420 | 453 | 2,239 | 244,643 | 素材 |
| TFI INTERNATIONAL INC | 72 | 76 | 1,195 | 130,556 | 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 | 156 | 158 | 2,988 | 326,454 | 商業・専門サービス |
| TMX GROUP LTD | 52 | 280 | 812 | 88,760 | 金融サービス |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | 77 | 82 | 940 | 102,742 | 資本財 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 1,678 | 1,829 | 15,511 | 1,694,670 | 銀行 |
| TOURMALINE OIL CORP | 297 | 320 | 2,128 | 232,591 | エネルギー |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 53 | 56 | 596 | 65,186 | 素材 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 418 | 450 | 2,826 | 308,777 | 素材 |
| WSP GLOBAL INC | 115 | 124 | 2,369 | 258,882 | 資本財 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 36,824 84 | 40,075 85 | 242,290 - | 26,470,279 <3.2%> |
| (オーストラリア) | | | 千オーストラリア・ドル | | |
| AMPOL LTD | 219 | 236 | 793 | 77,427 | エネルギー |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 2,764 | 2,986 | 7,189 | 701,445 | 銀行 |
| APA GROUP | 1,090 | 1,253 | 1,045 | 101,967 | 公益事業 |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 548 | 584 | 2,352 | 229,571 | 消費者サービス |
| ASX LTD | 179 | 192 | 1,101 | 107,475 | 金融サービス |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 1,699 | 1,827 | 665 | 64,911 | 運輸 |
| BHP GROUP LIMITED | 4,683 | 5,035 | 23,468 | 2,289,849 | 素材 |
| BLUESCOPE STEEL LTD | 427 | 451 | 923 | 90,091 | 素材 |
| BRAMBLES LTD | 1,282 | 1,379 | 1,816 | 177,219 | 商業・専門サービス |
| COCHLEAR LTD | 60 | 65 | 1,694 | 165,368 | ヘルスケア機器・サービス |
| COLES GROUP LTD | 1,237 | 1,330 | 2,051 | 200,137 | 生活必需品流通・小売り |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 1,566 | 1,666 | 17,072 | 1,665,746 | 銀行 |
| COMPUTERSHARE LIMITED | 502 | 570 | 1,348 | 131,536 | 商業・専門サービス |
| CSL LIMITED | 445 | 479 | 12,400 | 1,209,952 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA | 1,323 | 1,425 | 701 | 68,436 | 生活必需品流通・小売り |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 1,565 | 1,683 | 4,246 | 414,318 | 素材 |
| IDP EDUCATION LTD | 193 | 249 | 593 | 57,867 | 消費者サービス |
| IGO LTD | 629 | 677 | 602 | 58,792 | 素材 |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD | 2,275 | 2,422 | 1,419 | 138,518 | 保険 |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | 411 | 437 | 2,103 | 205,267 | 素材 |
| LOTTERY CORP LTD/THE | 2,056 | 2,208 | 1,007 | 98,267 | 消費者サービス |
| MACQUARIE GROUP LTD | 339 | 364 | 6,108 | 596,053 | 金融サービス |
| MEDIBANK PRIVATE LTD | 2,546 | 2,736 | 971 | 94,793 | 保険 |
| MINERAL RESOURCES LTD | 157 | 173 | 1,103 | 107,693 | 素材 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 2,914 | 3,121 | 8,654 | 844,455 | 銀行 |
| NEWCREST MINING LIMITED | 824 | - | - | - | 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 | オーストラリアドル | 千円 | |
| NEWMONT CORP-CDI | - | 354 | 2,001 | 195,313 | 素材 |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 1,068 | 1,139 | 1,340 | 130,771 | 素材 |
| ORICA LTD | 418 | 452 | 712 | 69,535 | 素材 |
| ORIGIN ENERGY LIMITED | 1,592 | 1,710 | 1,471 | 143,546 | 公益事業 |
| PILBARA MINERALS LTD | 2,354 | 2,680 | 954 | 93,102 | 素材 |
| QANTAS AIRWAYS LTD | 851 | 836 | 438 | 42,765 | 運輸 |
| QBE INSURANCE GROUP LTD | 1,371 | 1,481 | 2,225 | 217,143 | 保険 |
| RAMSAY HEALTH CARE LIMITED | 169 | 182 | 942 | 91,962 | ヘルスケア機器・サービス |
| REA GROUP LTD | 48 | 52 | 831 | 81,097 | メディア・娯楽 |
| REECE LTD | 209 | 224 | 437 | 42,685 | 資本財 |
| RIO TINTO LTD | 343 | 368 | 4,630 | 451,783 | 素材 |
| SANTOS LTD | 2,917 | 3,227 | 2,255 | 220,113 | エネルギー |
| SEEK LTD | 311 | 353 | 819 | 79,999 | メディア・娯楽 |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 422 | 444 | 1,310 | 127,906 | ヘルスケア機器・サービス |
| SOUTH32 LTD | 4,236 | 4,512 | 1,430 | 139,581 | 素材 |
| SUNCORP GROUP LTD | 1,168 | 1,257 | 1,679 | 163,906 | 保険 |
| TELSTRA GROUP LTD | 3,816 | 4,112 | 1,579 | 154,083 | 電気通信サービス |
| TRANSURBAN GROUP | 2,843 | 3,063 | 3,980 | 388,334 | 運輸 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 666 | 718 | 762 | 74,366 | 食品・飲料・タバコ |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 200 | 233 | 780 | 76,165 | 金融サービス |
| WESFARMERS LIMITED | 1,048 | 1,127 | 5,977 | 583,250 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| WESTPAC BANKING CORP | 3,236 | 3,488 | 7,360 | 718,182 | 銀行 |
| WISETECH GLOBAL LTD | 136 | 164 | 1,108 | 108,141 | ソフトウェア・サービス |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 1,755 | 1,887 | 5,925 | 578,190 | エネルギー |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 1,124 | 1,211 | 4,277 | 417,383 | 生活必需品流通・小売り |
| XERO LTD | 124 | 142 | 1,446 | 141,116 | ソフトウェア・サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 64,384 51 | 68,991 51 | 158,118 - | 15,427,596 <1.9%> |
| (香港) | | | 千香港ドル | | |
| AIA GROUP LTD | 10,926 | 11,480 | 83,694 | 1,609,448 | 保険 |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 3,420 | 3,680 | 7,839 | 150,748 | 銀行 |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 1,590 | 1,713 | 2,607 | 50,136 | 食品・飲料・タバコ |
| CK ASSET HOLDINGS LTD | 1,834 | 1,959 | 7,522 | 144,665 | 不動産管理・開発 |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 2,484 | 2,664 | 10,709 | 205,946 | 資本財 |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED | 585 | 630 | 2,406 | 46,278 | 公益事業 |
| CLP HOLDINGS LTD | 1,521 | 1,631 | 9,715 | 186,822 | 公益事業 |
| ESR GROUP LIMITED | 1,842 | 2,178 | 2,195 | 42,218 | 不動産管理・開発 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|--|------------------|--------------|--------------|--------------|---------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 2,008 | 2,168 | 9,344 | 179,694 | 消費者サービス |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 1,871 | 1,791 | 1,974 | 37,965 | 不動産管理・開発 |
| HANG SENG BANK LTD | 707 | 760 | 6,795 | 130,676 | 銀行 |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 1,346 | 1,446 | 3,160 | 60,774 | 不動産管理・開発 |
| HKT TRUST AND HKT LTD | 3,580 | 3,900 | 3,217 | 61,872 | 電気通信サービス |
| HONG KONG & CHINA GAS | 10,364 | 11,154 | 6,146 | 118,188 | 公益事業 |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 1,114 | 1,196 | 34,136 | 656,454 | 金融サービス |
| MTR CORP | 1,432 | 1,547 | 4,580 | 88,087 | 運輸 |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 1,399 | 1,499 | 2,287 | 43,993 | 不動産管理・開発 |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 1,285 | 1,380 | 5,495 | 105,685 | 公益事業 |
| SANDS CHINA LTD | 2,237 | 2,409 | 5,156 | 99,168 | 消費者サービス |
| SINO LAND CO | 3,220 | 3,660 | 2,957 | 56,868 | 不動産管理・開発 |
| SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | 1,240 | 1,330 | 1,630 | 31,356 | 運輸 |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD | 1,340 | 1,440 | 11,327 | 217,826 | 不動産管理・開発 |
| SWIRE PACIFIC LTD | 443 | 423 | 2,122 | 40,816 | 不動産管理・開発 |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 1,082 | 1,162 | 1,773 | 34,098 | 不動産管理・開発 |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 1,275 | 1,370 | 11,117 | 213,790 | 資本財 |
| WH GROUP LTD | 7,690 | 8,270 | 3,878 | 74,586 | 食品・飲料・タバコ |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 1,537 | 1,667 | 4,418 | 84,966 | 不動産管理・開発 |
| XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD | 1,710 | 1,640 | 1,539 | 29,613 | 資本財 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 71,089 28 | 76,154 28 | 249,752 - | 4,802,749 <0.6%> |
| (シンガポール) | | | 千シンガポールドル | | |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 2,402 | 2,585 | 798 | 89,118 | 不動産管理・開発 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 375 | 494 | 305 | 34,061 | 不動産管理・開発 |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 1,674 | 1,800 | 5,884 | 656,500 | 銀行 |
| GENTING SINGAPORE LTD | 5,577 | 6,003 | 561 | 62,622 | 消費者サービス |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 91 | 98 | 291 | 32,550 | 資本財 |
| KEPPEL CORP LTD | 1,349 | 1,445 | 934 | 104,308 | 資本財 |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 3,130 | 3,364 | 4,363 | 486,791 | 銀行 |
| SEATRIUM LTD | 26,052 | 44,030 | 471 | 52,563 | 資本財 |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD | - | 883 | 449 | 50,144 | 公益事業 |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 1,240 | 1,477 | 921 | 102,828 | 運輸 |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 793 | 852 | 812 | 90,684 | 金融サービス |
| SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD | 1,448 | 1,555 | 601 | 67,141 | 資本財 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 7,687 | 8,288 | 1,931 | 215,453 | 電気通信サービス |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 1,090 | 1,256 | 3,435 | 383,260 | 銀行 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|---------|--------|-------------|-----------|------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | | 百株 | 百株 | シンガポールドル | 千円 | |
| UOL Group Limited | | 428 | 459 | 282 | 31,494 | 不動産管理・開発 |
| VENTURE CORP LTD | | 256 | - | - | - | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | | 1,774 | 1,909 | 702 | 78,379 | 食品・飲料・タバコ |
| 小計 | 株数・金額 | 55,366 | 76,498 | 22,747 | 2,537,903 | |
| | 銘柄数<比率> | 16 | 16 | - | <0.3%> | |
| (ニュージーランド) | | | | 千ニュージーランドドル | | |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | | 1,152 | 1,237 | 956 | 86,034 | 運輸 |
| EBOS GROUP LTD | | 149 | 152 | 588 | 52,899 | ヘルスケア機器・サービス |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | | 533 | 575 | 1,263 | 113,673 | ヘルスケア機器・サービス |
| MERCURY NZ LTD | | 638 | 685 | 414 | 37,299 | 公益事業 |
| MERIDIAN ENERGY LTD | | 1,187 | 1,276 | 638 | 57,413 | 公益事業 |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | | 1,764 | 1,877 | 943 | 84,861 | 電気通信サービス |
| 小計 | 株数・金額 | 5,426 | 5,803 | 4,804 | 432,181 | |
| | 銘柄数<比率> | 6 | 6 | - | <0.1%> | |
| (イギリス) | | | | 千イギリスポンド | | |
| 3I GROUP PLC | | 897 | 965 | 2,095 | 391,146 | 金融サービス |
| ABRDN PLC | | 1,867 | 1,936 | 333 | 62,269 | 金融サービス |
| ADMIRAL GROUP PLC | | 167 | 211 | 548 | 102,446 | 保険 |
| ANGLO AMERICAN PLC | | 1,174 | 1,263 | 2,822 | 526,907 | 素材 |
| ANTOFAGASTA PLC | | 364 | 391 | 539 | 100,771 | 素材 |
| ASHTAD GROUP PLC | | 405 | 435 | 2,283 | 426,286 | 資本財 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | | 329 | 345 | 822 | 153,464 | 食品・飲料・タバコ |
| ASTRAZENECA PLC | | 1,432 | 1,540 | 15,804 | 2,950,619 | 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 | | 861 | 911 | 644 | 120,335 | メディア・娯楽 |
| AVIVA PLC | | 2,592 | 2,726 | 1,151 | 214,916 | 保険 |
| BAE SYSTEMS PLC | | 2,854 | 3,029 | 3,197 | 596,882 | 資本財 |
| BARCLAYS PLC | | 14,648 | 15,453 | 2,206 | 411,974 | 銀行 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | | 928 | 970 | 469 | 87,680 | 耐久消費財・アパレル |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT | | 100 | 105 | 477 | 89,171 | 耐久消費財・アパレル |
| BP PLC | | 16,779 | 17,242 | 8,236 | 1,537,687 | エネルギー |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | | 1,966 | 2,112 | 5,325 | 994,252 | 食品・飲料・タバコ |
| BT GROUP PLC | | 6,454 | 6,470 | 769 | 143,627 | 電気通信サービス |
| BUNZL PLC | | 312 | 335 | 988 | 184,634 | 資本財 |
| BURBERRY GROUP PLC | | 355 | 374 | 586 | 109,458 | 耐久消費財・アパレル |
| CENTRICA PLC | | - | 5,515 | 836 | 156,215 | 公益事業 |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | | 186 | 219 | 464 | 86,739 | 食品・飲料・タバコ |
| COMPASS GROUP PLC | | 1,624 | 1,723 | 3,604 | 672,934 | 消費者サービス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|-----------------------------------|---------|--------|-----------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| CRH PLC | - | 720 | 3,473 | 648,392 | 素材 |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 129 | 138 | 638 | 119,223 | 素材 |
| DCC PLC | 91 | 98 | 525 | 98,014 | 資本財 |
| DIAGEO PLC | 2,101 | 2,233 | 6,275 | 1,171,540 | 食品・飲料・タバコ |
| ENDEAVOUR MINING PLC | - | 183 | 316 | 59,172 | 素材 |
| ENTAIN PLC | 544 | 634 | 543 | 101,432 | 消費者サービス |
| EXPERIAN PLC | 851 | 914 | 2,681 | 500,591 | 商業・専門サービス |
| GLENCORE PLC | 9,519 | 10,466 | 4,893 | 913,654 | 素材 |
| GSK PLC | 3,759 | 4,069 | 5,740 | 1,071,653 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HALEON PLC | 4,694 | 5,505 | 1,799 | 335,919 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HALMA PLC | 350 | 377 | 774 | 144,663 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 328 | 353 | 256 | 47,945 | 金融サービス |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 152 | 164 | 289 | 53,996 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HSBC HOLDINGS PLC | 18,456 | 19,644 | 12,089 | 2,256,928 | 銀行 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 827 | 858 | 1,589 | 296,719 | 食品・飲料・タバコ |
| INFORMA PLC | 1,317 | 1,389 | 1,040 | 194,300 | メディア・娯楽 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 161 | 167 | 1,018 | 190,136 | 消費者サービス |
| INTERTEK GROUP PLC | 149 | 160 | 610 | 113,996 | 商業・専門サービス |
| JD SPORTS FASHION PLC | 2,384 | 2,575 | 357 | 66,680 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 169 | 182 | 277 | 51,898 | 素材 |
| KINGFISHER PLC | 1,803 | 1,892 | 441 | 82,375 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 5,522 | 5,947 | 1,365 | 254,918 | 保険 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 62,167 | 63,969 | 2,769 | 517,104 | 銀行 |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 302 | 397 | 3,396 | 634,026 | 金融サービス |
| M&G PLC | 2,075 | 2,241 | 459 | 85,851 | 金融サービス |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | - | 1,341 | 700 | 130,776 | 資本財 |
| MONDI PLC/WI | 448 | 482 | 671 | 125,319 | 素材 |
| NATIONAL GRID PLC | 3,383 | 3,658 | 3,717 | 693,946 | 公益事業 |
| NATWEST GROUP PLC | 4,907 | 5,774 | 1,199 | 224,026 | 銀行 |
| NEXT PLC | 119 | 119 | 923 | 172,339 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| NMC HEALTH PLC | 47 | 47 | 0.005 | 0.886 | ヘルスケア機器・サービス |
| OCADO GROUP PLC | 534 | 575 | 322 | 60,276 | 生活必需品流通・小売り |
| PEARSON PLC | 597 | 640 | 609 | 113,856 | 消費者サービス |
| PERSIMMON PLC | 295 | 318 | 394 | 73,682 | 耐久消費財・アパレル |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 699 | 752 | 368 | 68,882 | 保険 |
| PRUDENTIAL PLC | 2,540 | 2,735 | 2,585 | 482,643 | 保険 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 661 | 713 | 3,847 | 718,362 | 家庭用品・パーソナル用品 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | 業種等 | |
|------------------------------|------------------|---------------|---------------|--------------|----------------------|--------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| (イギリス) | | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| RELX PLC | | 1,770 | 1,881 | 5,615 | 1,048,318 | 商業・専門サービス |
| RENTOKIL INITIAL PLC | | 2,328 | 2,503 | 1,161 | 216,763 | 商業・専門サービス |
| RIO TINTO PLC | | 1,039 | 1,118 | 6,093 | 1,137,682 | 素材 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | | 7,735 | 8,362 | 2,040 | 380,934 | 資本財 |
| SAGE GROUP PLC | | 942 | 1,016 | 1,000 | 186,848 | ソフトウェア・サービス |
| SAINSBURY (J) PLC | | 1,623 | 1,643 | 437 | 81,693 | 生活必需品流通・小売り |
| SCHRODERS PLC | | 817 | 799 | 325 | 60,793 | 金融サービス |
| SEVERN TRENT PLC | | 232 | 250 | 675 | 126,147 | 公益事業 |
| SHELL PLC-NEW | | 6,524 | 6,663 | 17,381 | 3,244,933 | エネルギー |
| SMITH & NEPHEW PLC | | 804 | 867 | 888 | 165,871 | ヘルスケア機器・サービス |
| SMITHS GROUP PLC | | 327 | 347 | 573 | 107,097 | 資本財 |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | | 68 | 73 | 655 | 122,455 | 資本財 |
| SSE PLC | | 997 | 1,082 | 1,943 | 362,848 | 公益事業 |
| ST JAMES'S PLACE PLC | | 503 | 546 | 375 | 70,118 | 金融サービス |
| STANDARD CHARTERED PLC | | 2,273 | 2,355 | 1,554 | 290,215 | 銀行 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | | 3,270 | 3,517 | 442 | 82,550 | 耐久消費財・アパレル |
| TESCO PLC | | 6,842 | 7,122 | 1,965 | 366,989 | 生活必需品流通・小売り |
| UNILEVER PLC | | 2,343 | 2,499 | 9,539 | 1,780,844 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | | 629 | 676 | 733 | 136,953 | 公益事業 |
| VODAFONE GROUP PLC | | 24,274 | 23,169 | 1,737 | 324,414 | 電気通信サービス |
| WHITBREAD PLC | | 186 | 196 | 655 | 122,450 | 消費者サービス |
| WISE PLC - A | | - | 611 | 436 | 81,534 | 金融サービス |
| WPP PLC | | 990 | 1,068 | 761 | 142,168 | メディア・娯楽 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 254,927 77 | 275,100 82 | 180,171 - | 33,636,305 <4.1%> | |
| (イスラエル) | | | | 千イスラエル・シケル | | |
| AZRIELI GROUP | | 39 | 42 | 829 | 33,453 | 不動産管理・開発 |
| BANK HAPOALIM BM | | 1,173 | 1,261 | 3,788 | 152,783 | 銀行 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | | 1,426 | 1,525 | 4,099 | 165,321 | 銀行 |
| BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP | | 1,965 | - | - | - | 電気通信サービス |
| ELBIT SYSTEMS LTD | | 24 | 26 | 1,961 | 79,118 | 資本財 |
| FIRST INTL BANK ISRAEL | | 51 | - | - | - | 銀行 |
| ICL GROUP LTD | | 655 | 769 | 1,481 | 59,766 | 素材 |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A | | 1,141 | 1,227 | 2,229 | 89,931 | 銀行 |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | | 142 | 153 | 1,994 | 80,428 | 銀行 |
| NICE LTD | | 58 | 62 | 4,535 | 182,903 | 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 | |
| (イスラエル) | | 百株 | 百株 | 千イスラエル・シケル | 千円 | |
| TOWER SEMICONDUCTOR LTD | | 101 | - | - | - | 半導体・半導体製造装置 |
| 小計 | 株数・金額 | 6,780 | 5,070 | 20,920 | 843,706 | |
| | 銘柄数<比率> | 11 | 8 | - | <0.1%> | |
| (スイス) | | | | 千スイス・フラン | | |
| ABB LTD | | 1,452 | 1,589 | 5,368 | 908,495 | 資本財 |
| ADECCO GROUP AG-REG | | 147 | 158 | 656 | 111,058 | 商業・専門サービス |
| ALCON INC | | 461 | 496 | 3,101 | 524,900 | ヘルスケア機器・サービス |
| BACHEM HOLDING AG-REG B | | 30 | 33 | 240 | 40,698 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BALOISE HOLDING AG | | 42 | 45 | 596 | 100,939 | 保険 |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | | 27 | 29 | 303 | 51,337 | 銀行 |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | | 3 | 3 | 527 | 89,208 | 食品・飲料・タバコ |
| BKW AG | | 19 | 20 | 325 | 55,031 | 公益事業 |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | | 0.96 | 0.95 | 1,030 | 174,423 | 食品・飲料・タバコ |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | | 0.10 | 0.10 | 1,084 | 183,434 | 食品・飲料・タバコ |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG | | 482 | 518 | 5,841 | 988,549 | 耐久消費財・アパレル |
| CLARIANT AG | | 199 | 214 | 286 | 48,486 | 素材 |
| CREDIT SUISSE GROUP AG | | 3,329 | - | - | - | 金融サービス |
| DUFREY AG-REG | | - | 95 | 303 | 51,277 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | | 6 | 7 | 434 | 73,546 | 素材 |
| GEBERIT AG-REG | | 33 | 33 | 1,584 | 268,049 | 資本財 |
| GIVAUDAN-REG | | 8 | 9 | 2,960 | 501,059 | 素材 |
| HELVETIA HOLDING AG-REG | | - | 36 | 454 | 76,885 | 保険 |
| HOLCIM LTD | | 512 | 517 | 3,196 | 540,945 | 素材 |
| JULIUS BAER GROUP LTD | | 197 | 204 | 1,139 | 192,897 | 金融サービス |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | | 50 | 54 | 1,330 | 225,157 | 運輸 |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG | | 159 | 163 | 1,234 | 208,885 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LONZA GROUP AG | | 68 | 74 | 2,628 | 444,721 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NESTLE SA | | 2,542 | 2,653 | 26,270 | 4,445,437 | 食品・飲料・タバコ |
| NOVARTIS AG | | 1,999 | 2,037 | 17,131 | 2,899,007 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | | 20 | 22 | 2,540 | 429,862 | 金融サービス |
| ROCHE HOLDING AG | | 649 | 698 | 16,588 | 2,807,149 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ROCHE HOLDING AG-BR | | 24 | 31 | 808 | 136,786 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SANDOZ GROUP AG | | - | 407 | 1,040 | 176,077 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | | 22 | 23 | 440 | 74,489 | 資本財 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | | 37 | 40 | 775 | 131,198 | 資本財 |
| SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE | | 147 | 149 | 1,099 | 186,077 | 商業・専門サービス |
| SIG GROUP AG | | 282 | 304 | 637 | 107,838 | 素材 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|---------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (スイス) | | 百株 | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | |
| SIKA AG-BEARER | 135 | 145 | 3,424 | 579,510 | 素材 | |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 48 | 51 | 1,198 | 202,860 | ヘルスケア機器・サービス | |
| STRAUMANN HOLDING AG | 103 | 110 | 1,330 | 225,144 | ヘルスケア機器・サービス | |
| SWATCH GROUP AG | 26 | 28 | 674 | 114,216 | 耐久消費財・アパレル | |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 28 | 29 | 1,692 | 286,480 | 保険 | |
| SWISS PRIME SITE-REG | 70 | 76 | 647 | 109,560 | 不動産管理・開発 | |
| SWISS RE AG | 278 | 299 | 2,996 | 507,000 | 保険 | |
| SWISSCOM AG | 24 | 26 | 1,333 | 225,582 | 電気通信サービス | |
| TEMENOS GROUP AG-REG | 58 | 63 | 439 | 74,370 | ソフトウェア・サービス | |
| THE SWATCH GROUP AG-REG | 50 | 53 | 237 | 40,271 | 耐久消費財・アパレル | |
| UBS GROUP AG | 3,094 | 3,267 | 7,561 | 1,279,628 | 金融サービス | |
| VAT GROUP AG | 24 | 26 | 1,016 | 171,955 | 資本財 | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 139 | 149 | 6,534 | 1,105,761 | 保険 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 17,045 43 | 15,004 45 | 131,049 - | 22,176,253 <2.7%> | |
| (デンマーク) | | | | 千デンマーク・クローネ | | |
| A P MOLLER - MAERSK A/S | 4 | 4 | 4,928 | 108,074 | 運輸 | |
| A P MOLLER - MAERSK A/S | 2 | 3 | 3,103 | 68,067 | 運輸 | |
| CARLSBERG AS-B | 89 | 97 | 8,297 | 181,966 | 食品・飲料・タバコ | |
| CHR HANSEN HOLDING A/S | 97 | 104 | 5,737 | 125,821 | 素材 | |
| COLOPLAST-B | 109 | 118 | 8,803 | 193,053 | ヘルスケア機器・サービス | |
| DANSKE BANK A/S | 637 | 685 | 12,152 | 266,498 | 銀行 | |
| DEMANT A/S | 85 | 100 | 2,754 | 60,415 | ヘルスケア機器・サービス | |
| DSV A/S | 173 | 184 | 20,067 | 440,070 | 運輸 | |
| GENMAB A/S | 60 | 65 | 14,552 | 319,133 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| NOVO-NORDISK A/S | 1,530 | 3,243 | 225,195 | 4,938,537 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| NOVOZYMES A/S | 189 | 203 | 7,323 | 160,603 | 素材 | |
| ORSTED A/S | 174 | 188 | 5,882 | 128,996 | 公益事業 | |
| PANDORA A/S | 83 | 83 | 7,736 | 169,652 | 耐久消費財・アパレル | |
| ROCKWOOL A/S-B SHS | 8 | 9 | 1,511 | 33,146 | 資本財 | |
| TRYGVESTA AS | 333 | 348 | 4,987 | 109,365 | 保険 | |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 933 | 1,003 | 17,834 | 391,114 | 資本財 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 4,515 16 | 6,444 16 | 350,867 - | 7,694,519 <0.9%> | |
| (ノルウェー) | | | | 千ノルウェー・クローネ | | |
| ADEVINTA ASA-B | 269 | 289 | 3,156 | 43,777 | メディア・娯楽 | |
| AKER BP ASA | 291 | 313 | 9,659 | 133,975 | エネルギー | |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 | |
|-----------------------------|------------------|-------------|--------------|--------------|------------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ノルウェー) | 百株 | 百株 | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | | |
| DNB BANK ASA | 859 | 917 | 18,678 | 259,064 | 銀行 | |
| EQUINOR ASA | 879 | 894 | 31,231 | 433,183 | エネルギー | |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 184 | 198 | 3,508 | 48,661 | 保険 | |
| KONGSBERG GRUPPEN ASA | 81 | 86 | 4,060 | 56,321 | 資本財 | |
| MOWI ASA | 382 | 436 | 8,135 | 112,839 | 食品・飲料・タバコ | |
| NORSK HYDRO ASA | 1,242 | 1,316 | 8,544 | 118,512 | 素材 | |
| ORKLA ASA | 693 | 743 | 5,786 | 80,263 | 食品・飲料・タバコ | |
| SALMAR ASA | 60 | 72 | 4,156 | 57,649 | 食品・飲料・タバコ | |
| TELENOR ASA | 659 | 715 | 8,092 | 112,242 | 電気通信サービス | |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 152 | 163 | 6,115 | 84,821 | 素材 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 5,757 12 | 6,149 12 | 111,125 - | 1,541,313 <0.2%> | |
| (スウェーデン) | | | 千スウェーデン・クローナ | | | |
| ALFA LAVAL AB | 267 | 287 | 10,952 | 156,078 | 資本財 | |
| ASSA ABLOY AB | 926 | 995 | 26,229 | 373,771 | 資本財 | |
| ATLAS COPCO AB | 1,447 | 1,551 | 21,228 | 302,505 | 資本財 | |
| ATLAS COPCO AB-A SHS | 2,478 | 2,668 | 42,460 | 605,068 | 資本財 | |
| BEIJER REF AB | - | 382 | 4,634 | 66,043 | 資本財 | |
| BIOVITRUM | 157 | 194 | 4,712 | 67,149 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| BOLIDEN AB | 252 | 271 | 8,004 | 114,067 | 素材 | |
| BOLIDEN AB RED SHS | 252 | - | - | - | 素材 | |
| ELECTROLUX AB | 203 | - | - | - | 耐久消費財・アパレル | |
| EMBRACER GROUP AB | 605 | - | - | - | メディア・娯楽 | |
| EPIROC AB-A | 607 | 653 | 12,524 | 178,474 | 資本財 | |
| EPIROC AB-B | 362 | 388 | 6,292 | 89,669 | 資本財 | |
| EQT AB | 328 | 353 | 8,749 | 124,686 | 金融サービス | |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B | 562 | 604 | 15,455 | 220,240 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| EVOLUTION AB | 169 | 182 | 19,456 | 277,250 | 消費者サービス | |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 581 | 647 | 4,007 | 57,105 | 不動産管理・開発 | |
| GETINGE AB-B SHS | 211 | 227 | 4,976 | 70,911 | ヘルスケア機器・サービス | |
| HENNES & MAURITZ AB | 675 | 641 | 10,769 | 153,469 | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| HEXAGON AB-B SHS | 1,799 | 2,063 | 21,020 | 299,536 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| HOLMEN AB-B SHARES | 86 | 92 | 3,996 | 56,946 | 素材 | |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 387 | 346 | 2,726 | 38,854 | 資本財 | |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | 118 | 130 | 3,984 | 56,783 | 金融サービス | |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 143 | 150 | 4,575 | 65,196 | 金融サービス | |
| INDUTRADE AB | 252 | 272 | 6,137 | 87,455 | 資本財 | |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|---------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|---------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (スウェーデン) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 137 | 147 | 3,249 | 46,307 | 資本財 | |
| INVESTOR AB | 1,680 | 1,718 | 36,313 | 517,464 | 金融サービス | |
| INVESTOR AB-A SHS | 464 | - | - | - | 金融サービス | |
| KINNEVIK AB - B | 223 | - | - | - | 金融サービス | |
| LIFCO AB-B SHS | 215 | 231 | 5,235 | 74,603 | 資本財 | |
| LUNDBERGS AB-B SHS | 70 | 74 | 3,595 | 51,238 | 金融サービス | |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 1,400 | 1,506 | 9,854 | 140,421 | 資本財 | |
| NORDEA BANK ABP | 3,057 | 3,200 | 38,531 | 549,066 | 銀行 | |
| SAAB AB-B | - | 79 | 4,413 | 62,885 | 資本財 | |
| SAGAX AB-B | 176 | 196 | 4,568 | 65,105 | 不動産管理・開発 | |
| SANDVIK AB | 984 | 1,058 | 21,421 | 305,257 | 資本財 | |
| SECURITAS AB | 453 | 487 | 4,381 | 62,433 | 商業・専門サービス | |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 1,492 | 1,574 | 19,874 | 283,216 | 銀行 | |
| SKANSKA AB-B SHS | 314 | 337 | 5,622 | 80,124 | 資本財 | |
| SKF AB | 353 | 338 | 6,425 | 91,559 | 資本財 | |
| SVENSKA CELLULOOSA AB | 559 | 601 | 9,725 | 138,589 | 素材 | |
| SVENSKA HANDELSBANKEN | 1,347 | 1,447 | 14,259 | 203,201 | 銀行 | |
| SWEDBANK AB - A SHARES | 836 | 842 | 15,530 | 221,305 | 銀行 | |
| TELE2 AB | 538 | 554 | 4,511 | 64,290 | 電気通信サービス | |
| TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON | 2,696 | 2,909 | 15,192 | 216,489 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| TELIA CO AB | 2,527 | 2,474 | 5,977 | 85,182 | 電気通信サービス | |
| VOLVO AB | 1,388 | 1,494 | 34,777 | 495,575 | 資本財 | |
| VOLVO AB-A SHS | 190 | 203 | 4,862 | 69,293 | 資本財 | |
| VOLVO CAR AB-B | 550 | 592 | 2,148 | 30,616 | 自動車・自動車部品 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 34,536 46 | 35,179 43 | 513,368 - | 7,315,494 <0.9%> | |
| (ユーロ/アイルランド) | | | | 千ユーロ | | |
| AIB GROUP PLC | 985 | 1,427 | 598 | 97,890 | 銀行 | |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 988 | 1,048 | 901 | 147,377 | 銀行 | |
| CRH PLC | 690 | - | - | - | 素材 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC. | 154 | 175 | 2,545 | 416,239 | 消費者サービス | |
| KERRY GROUP PLC-A | 147 | 158 | 1,153 | 188,706 | 食品・飲料・タバコ | |
| KINGSPAN GROUP PLC | 142 | 153 | 1,061 | 173,517 | 資本財 | |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 228 | 258 | 820 | 134,155 | 素材 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,336 7 | 3,222 6 | 7,080 - | 1,157,886 <0.1%> | |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|-------------------------------|------------------|--------------|--------------|-------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ/オランダ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ABN AMRO BANK NV | 372 | 399 | 507 | 83,006 | 銀行 |
| ADYEN NV | 20 | 21 | 2,239 | 366,189 | 金融サービス |
| AIRBUS SE | 546 | 589 | 7,792 | 1,274,319 | 資本財 |
| AKZO NOBEL NV | 167 | 169 | 1,165 | 190,667 | 素材 |
| ASM INTERNATIONAL NV | 43 | 46 | 2,171 | 355,060 | 半導体・半導体製造装置 |
| ASML HOLDING NV | 372 | 400 | 25,190 | 4,119,695 | 半導体・半導体製造装置 |
| ASR NEDERLAND NV | - | 158 | 583 | 95,401 | 保険 |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES | - | 76 | 916 | 149,957 | 半導体・半導体製造装置 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 945 | 1,016 | 952 | 155,745 | 資本財 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 482 | 518 | 533 | 87,187 | 食品・飲料・タバコ |
| DSM-FIRMENICH AG | 158 | 184 | 1,699 | 277,936 | 素材 |
| EURONEXT NV | 79 | 85 | 625 | 102,239 | 金融サービス |
| EXOR NV | 99 | 107 | 924 | 151,218 | 金融サービス |
| FERRARI NV | 116 | 125 | 4,128 | 675,132 | 自動車・自動車部品 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 106 | 128 | 913 | 149,368 | 食品・飲料・タバコ |
| HEINEKEN NV | 239 | 286 | 2,381 | 389,430 | 食品・飲料・タバコ |
| IMCD NV | 52 | 56 | 760 | 124,444 | 資本財 |
| ING GROEP NV-CVA | 3,443 | 3,595 | 4,585 | 749,974 | 銀行 |
| JDE PEET'S BV | 92 | 124 | 318 | 52,125 | 食品・飲料・タバコ |
| JUST EAT TAKEAWAY | 169 | - | - | - | 消費者サービス |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 965 | 964 | 2,567 | 419,889 | 生活必需品流通・小売り |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 858 | 922 | 1,789 | 292,647 | ヘルスケア機器・サービス |
| NN GROUP NV | 257 | 249 | 799 | 130,702 | 保険 |
| OCI NV | 97 | 104 | 222 | 36,396 | 素材 |
| PROSUS | 740 | 1,519 | 4,594 | 751,406 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| QIAGEN NV | 210 | 226 | 816 | 133,540 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RANDSTAD NV | 110 | 109 | 585 | 95,797 | 商業・専門サービス |
| ROYAL KPN NV | 3,123 | 3,297 | 1,044 | 170,770 | 電気通信サービス |
| STMICROELECTRONICS NV | 631 | 679 | 2,846 | 465,557 | 半導体・半導体製造装置 |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP BV | 670 | 814 | 1,951 | 319,182 | メディア・娯楽 |
| WOLTERS KLUWER NV | 237 | 255 | 3,133 | 512,380 | 商業・専門サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 15,413 29 | 17,234 30 | 78,741 - | 12,877,372 <1.6%> |
| (ユーロ/ベルギー) | | | | | |
| AGEAS | 148 | 158 | 610 | 99,819 | 保険 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 802 | 863 | 4,854 | 793,841 | 食品・飲料・タバコ |
| ARGENX SE | 51 | 55 | 2,515 | 411,416 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|-----------------------------|------------------|-------------|-------------|-------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ/ベルギー) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| D'IETTEREN GROUP | 23 | 21 | 332 | 54,449 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ELIA GROUP SA/NV | 30 | 29 | 298 | 48,837 | 公益事業 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 92 | 94 | 687 | 112,443 | 金融サービス |
| KBC GROEP NV | 231 | 248 | 1,324 | 216,548 | 銀行 |
| LOTUS BAKERIES | - | 0,41 | 308 | 50,489 | 食品・飲料・タバコ |
| SOFINA | 14 | 15 | 308 | 50,387 | 金融サービス |
| SOLVAY SA | 68 | 73 | 759 | 124,177 | 素材 |
| UCB SA | 116 | 125 | 860 | 140,710 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UMICORE | 193 | 208 | 485 | 79,376 | 素材 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,773 11 | 1,894 12 | 13,345 - | 2,182,500 <0.3%> |
| (ユーロ/ルクセンブルグ) | | | | | |
| ARCELORMITTAL | 485 | 507 | 1,112 | 181,869 | 素材 |
| TENARIS SA | 435 | 468 | 733 | 119,940 | エネルギー |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 921 2 | 975 2 | 1,845 - | 301,810 <0.0%> |
| (ユーロ/フランス) | | | | | |
| ACCOR | 157 | 183 | 576 | 94,268 | 消費者サービス |
| ADP | 27 | 29 | 341 | 55,866 | 運輸 |
| AIR LIQUIDE | 483 | 520 | 8,861 | 1,449,269 | 素材 |
| ALSTOM RGPT | 295 | 284 | 352 | 57,583 | 資本財 |
| AMUNDI SA | 56 | 60 | 338 | 55,438 | 金融サービス |
| ARKEMA | 55 | 59 | 555 | 90,843 | 素材 |
| AXA SA | 1,738 | 1,823 | 5,176 | 846,562 | 保険 |
| BIOMERIEUX | 38 | 41 | 394 | 64,510 | ヘルスケア機器・サービス |
| BNP PARIBAS | 1,026 | 1,042 | 5,914 | 967,266 | 銀行 |
| BOLLORE SE | 818 | 732 | 389 | 63,746 | メディア・娯楽 |
| BOUYGUES | 208 | 189 | 661 | 108,106 | 資本財 |
| BUREAU VERITAS SA | 271 | 293 | 648 | 105,996 | 商業・専門サービス |
| CAPGEMINI SA | 151 | 163 | 2,915 | 476,788 | ソフトウェア・サービス |
| CARREFOUR SA | 547 | 592 | 1,008 | 164,915 | 生活必需品流通・小売り |
| CIE DE SAINT-GOBAIN | 452 | 459 | 2,682 | 438,659 | 資本財 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 1,125 | 1,201 | 1,413 | 231,219 | 銀行 |
| DANONE | 593 | 639 | 3,681 | 602,067 | 食品・飲料・タバコ |
| DASSAULT AVIATION SA | 23 | 20 | 384 | 62,802 | 資本財 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 616 | 665 | 2,799 | 457,895 | ソフトウェア・サービス |
| EDENRED | 230 | 248 | 1,240 | 202,878 | 金融サービス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|-------------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ/フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| EIFFAGE | 77 | 72 | 661 | 108,240 | 資本財 |
| ENGIE | 1,688 | 1,815 | 2,832 | 463,156 | 公益事業 |
| ESSILORLUXOTTICA | 268 | 293 | 5,256 | 859,597 | ヘルスケア機器・サービス |
| EURAZEO | 40 | 43 | 254 | 41,699 | 金融サービス |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 124 | 134 | 706 | 115,494 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GETLINK SE - REGR | 405 | 355 | 578 | 94,603 | 運輸 |
| HERMES INTERNATIONAL | 29 | 31 | 6,058 | 990,830 | 耐久消費財・アパレル |
| IPSEN | 34 | 37 | 401 | 65,611 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KERING | 69 | 74 | 2,992 | 489,348 | 耐久消費財・アパレル |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 97 | 104 | 341 | 55,886 | 消費者サービス |
| LEGRAND SA | 246 | 265 | 2,321 | 379,582 | 資本財 |
| L'OREAL SA | 223 | 239 | 10,162 | 1,662,045 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 255 | 274 | 19,530 | 3,194,030 | 耐久消費財・アパレル |
| MICHELIN (C.G.D.E.) | 627 | 674 | 1,999 | 326,941 | 自動車・自動車部品 |
| ORANGE S.A. | 1,867 | 1,882 | 2,084 | 340,899 | 電気通信サービス |
| PERNOD-RICARD | 190 | 203 | 3,401 | 556,208 | 食品・飲料・タバコ |
| PUBLICIS GROUPE | 211 | 227 | 1,680 | 274,826 | メディア・娯楽 |
| REMY COINTREAU | 21 | 22 | 256 | 41,893 | 食品・飲料・タバコ |
| RENAULT SA | 177 | 190 | 677 | 110,854 | 自動車・自動車部品 |
| SAFRAN SA | 315 | 339 | 5,453 | 891,852 | 資本財 |
| SANOFI | 1,054 | 1,129 | 9,698 | 1,586,026 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 25 | 27 | 550 | 90,036 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 501 | 540 | 8,980 | 1,468,592 | 資本財 |
| SEB SA | 23 | 24 | 250 | 40,952 | 耐久消費財・アパレル |
| SOCIETE GENERALE | 745 | 722 | 1,632 | 267,054 | 銀行 |
| SODEXO | 81 | 87 | 891 | 145,725 | 消費者サービス |
| TELEPERFORMANCE | 54 | 58 | 794 | 129,958 | 商業・専門サービス |
| THALES SA | 98 | 104 | 1,442 | 235,894 | 資本財 |
| TOTALENERGIES SE | 2,299 | 2,234 | 13,811 | 2,258,753 | エネルギー |
| VALEO SA | 191 | 205 | 277 | 45,401 | 自動車・自動車部品 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 615 | 675 | 1,895 | 310,005 | 公益事業 |
| VINCI SA | 497 | 528 | 5,778 | 945,023 | 資本財 |
| VIVENDI SA | 664 | 673 | 592 | 96,880 | メディア・娯楽 |
| WENDEL | 24 | 26 | 194 | 31,799 | 金融サービス |
| WORLDLINE SA | 221 | 238 | 328 | 53,705 | 金融サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 22,991 55 | 23,812 55 | 155,106 - | 25,366,102 <3.1%> |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|-------|-------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ/ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ADIDAS AG | 149 | 161 | 2,892 | 473,020 | 耐久消費財・アパレル |
| ALLIANZ SE | 372 | 400 | 9,157 | 1,497,558 | 保険 |
| AROUNDTOWN SA | 924 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| BASF SE | 848 | 888 | 3,935 | 643,556 | 素材 |
| BAYER AG | 908 | 976 | 4,046 | 661,787 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 305 | 298 | 2,844 | 465,155 | 自動車・自動車部品 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 54 | 57 | 501 | 81,953 | 自動車・自動車部品 |
| BECHTLE AG | 75 | 81 | 383 | 62,732 | ソフトウェア・サービス |
| BEIERSDORF AG | 93 | 100 | 1,246 | 203,934 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| BRENNTAG SE | 142 | 145 | 1,112 | 181,922 | 資本財 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 37 | 40 | 347 | 56,762 | ヘルスケア機器・サービス |
| COMMERZBANK AG | 982 | 1,056 | 1,181 | 193,190 | 銀行 |
| CONTINENTAL AG | 101 | 109 | 752 | 123,041 | 自動車・自動車部品 |
| COVESTRO AG | 178 | 191 | 921 | 150,639 | 素材 |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 418 | 490 | 1,431 | 234,156 | 資本財 |
| DELIVERY HERO SE | 158 | 174 | 573 | 93,767 | 消費者サービス |
| DEUTSCHE BANK AG | 1,908 | 1,923 | 2,149 | 351,511 | 金融サービス |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 175 | 188 | 3,185 | 520,983 | 金融サービス |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG | 551 | 593 | 474 | 77,574 | 運輸 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG | 3,008 | 3,234 | 6,972 | 1,140,219 | 電気通信サービス |
| DHL GROUP | 916 | 984 | 3,990 | 652,610 | 運輸 |
| DR ING HC F PORSCHE AG | 105 | 113 | 1,029 | 168,332 | 自動車・自動車部品 |
| E.ON SE | 2,074 | 2,229 | 2,576 | 421,368 | 公益事業 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 193 | 209 | 386 | 63,224 | 素材 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 390 | 419 | 1,146 | 187,495 | ヘルスケア機器・サービス |
| GEA GROUP AG | 139 | 152 | 532 | 87,136 | 資本財 |
| HANNOVER RUECK SE | 55 | 59 | 1,250 | 204,468 | 保険 |
| HEIDELBERG MATERIALS AG | 133 | 143 | 1,022 | 167,268 | 素材 |
| HELLOFRESH SE | 150 | 154 | 247 | 40,447 | 生活必需品流通・小売り |
| HENKEL AG & CO KGAA | 97 | 104 | 654 | 107,111 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HENKEL KGAA-VORZUG | 163 | 167 | 1,194 | 195,280 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 1,206 | 1,297 | 4,357 | 712,665 | 半導体・半導体製造装置 |
| KNORR-BREMSE AG | 67 | 72 | 401 | 65,700 | 資本財 |
| LEG IMMOBILIEN SE | 68 | 73 | 520 | 85,069 | 不動産管理・開発 |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 741 | 797 | 4,672 | 764,087 | 自動車・自動車部品 |
| MERCK KGAA | 119 | 128 | 2,015 | 329,649 | 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 | 49 | 53 | 994 | 162,647 | 資本財 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|-----------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ/ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG | 129 | 135 | 5,122 | 837,661 | 保険 |
| NEMETSCHKE SE | 53 | 57 | 455 | 74,502 | ソフトウェア・サービス |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF | 141 | 152 | 702 | 114,810 | 自動車・自動車部品 |
| PUMA AG | 97 | 104 | 555 | 90,777 | 耐久消費財・アパレル |
| RATIONAL AG | 4 | 5 | 309 | 50,694 | 資本財 |
| RHEINMETALL AG | 40 | 43 | 1,207 | 197,501 | 資本財 |
| RWE AG | 593 | 627 | 2,407 | 393,694 | 公益事業 |
| SAP SE | 965 | 1,037 | 14,239 | 2,328,765 | ソフトウェア・サービス |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 22 | 26 | 712 | 116,599 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCOUT24 SE | 73 | 74 | 469 | 76,714 | メディア・娯楽 |
| SIEMENS AG | 707 | 755 | 11,213 | 1,833,804 | 資本財 |
| SIEMENS ENERGY AG | 402 | 516 | 603 | 98,657 | 資本財 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 260 | 280 | 1,402 | 229,441 | ヘルスケア機器・サービス |
| SYMRISE AG | 122 | 132 | 1,280 | 209,482 | 素材 |
| TALANX AG | - | 62 | 400 | 65,438 | 保険 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 1,017 | 956 | 224 | 36,724 | 電気通信サービス |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 91 | - | - | - | 電気通信サービス |
| VOLKSWAGEN AG | 27 | 29 | 358 | 58,560 | 自動車・自動車部品 |
| VOLKSWAGEN AG | 171 | 204 | 2,227 | 364,235 | 自動車・自動車部品 |
| VONOVIA SE | 662 | 729 | 1,837 | 300,461 | 不動産管理・開発 |
| WACKER CHEMIE AG | - | 18 | 219 | 35,836 | 素材 |
| ZALANDO SE | 206 | 222 | 513 | 84,034 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 23,862 57 | 24,445 57 | 117,564 - | 19,226,433 <2.3%> |
| (ユーロ/ポルトガル) | | | | | |
| EDP RENOVAVEIS SA | 265 | 305 | 499 | 81,671 | 公益事業 |
| EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH | 265 | - | - | - | 公益事業 |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 2,565 | 3,117 | 1,334 | 218,182 | 公益事業 |
| GALP ENERGIA SGPS SA | 462 | 487 | 656 | 107,344 | エネルギー |
| JERONIMO MARTINS | 261 | 281 | 611 | 100,029 | 生活必需品流通・小売り |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,820 5 | 4,192 4 | 3,101 - | 507,227 <0.1%> |
| (ユーロ/スペイン) | | | | | |
| ACCIONA SA | 22 | 24 | 317 | 51,853 | 公益事業 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 201 | 217 | 779 | 127,484 | 資本財 |
| AENA SME SA | 69 | 74 | 1,140 | 186,446 | 運輸 |
| AMADEUS IT GROUP SA | 416 | 447 | 2,800 | 458,068 | 消費者サービス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|------------------------------------|------------------|--------------|--------------|-------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ/スペイン) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | 5,570 | 5,926 | 4,909 | 802,889 | 銀行 |
| BANCO SANTANDER SA | 15,514 | 16,076 | 5,985 | 978,850 | 銀行 |
| CAIXABANK | 4,095 | 4,100 | 1,660 | 271,527 | 銀行 |
| CELLNEX TELECOM SAU | 524 | 564 | 1,836 | 300,322 | 電気通信サービス |
| CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA | 60 | 65 | 176 | 28,943 | 公益事業 |
| ENAGAS SA | 230 | 247 | 400 | 65,463 | 公益事業 |
| ENDESA SA | 292 | 314 | 616 | 100,783 | 公益事業 |
| FERROVIAL S.A. | 450 | - | - | - | 資本財 |
| FERROVIAL SE | - | 505 | 1,528 | 249,989 | 資本財 |
| GRIFOLS SA | 275 | 296 | 375 | 61,340 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| IBERDROLA SA | 5,677 | 6,048 | 6,695 | 1,094,922 | 公益事業 |
| INDITEX SA | 1,008 | 1,083 | 3,865 | 632,130 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 134 | 124 | 336 | 55,003 | 公益事業 |
| REDEIA CORPORACION SA | 376 | 405 | 613 | 100,276 | 公益事業 |
| REPSOL SA | 1,269 | 1,266 | 1,747 | 285,774 | エネルギー |
| TELEFONICA SA | 4,857 | 5,212 | 1,956 | 319,941 | 電気通信サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 41,047 19 | 43,002 19 | 37,740 - | 6,172,011 <0.7%> |
| (ユーロ/イタリア) | | | | | |
| AMPLIFON SPA | 115 | 123 | 340 | 55,704 | ヘルスケア機器・サービス |
| ASSICURAZIONI GENERALI SPA | 1,025 | 1,006 | 1,957 | 320,158 | 保険 |
| DIASORIN ITALIA SPA | 23 | 22 | 197 | 32,355 | ヘルスケア機器・サービス |
| ENEL SPA | 7,515 | 8,080 | 5,175 | 846,426 | 公益事業 |
| ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA | 2,308 | 2,346 | 3,522 | 576,149 | エネルギー |
| FINECOBANK SPA | 563 | 607 | 746 | 122,130 | 銀行 |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 324 | 347 | 371 | 60,745 | 電気通信サービス |
| INTESA SANPAOLO | 14,919 | 15,442 | 4,144 | 677,830 | 銀行 |
| MEDIOBANCA SPA | 549 | 547 | 644 | 105,358 | 銀行 |
| MONCLER SPA | 189 | 204 | 1,032 | 168,839 | 耐久消費財・アパレル |
| NEXI SPA | 545 | 587 | 406 | 66,543 | 金融サービス |
| POSTE ITALIANE SPA | 482 | 518 | 527 | 86,261 | 保険 |
| PRYSMIAN SPA | 235 | 260 | 932 | 152,520 | 資本財 |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA | 96 | 103 | 469 | 76,768 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SNAM SPA | 1,860 | 2,002 | 900 | 147,302 | 公益事業 |
| STELLANTIS NV | 2,078 | 2,198 | 4,060 | 664,039 | 自動車・自動車部品 |
| TELECOM ITALIA SPA | 9,330 | 10,078 | 261 | 42,689 | 電気通信サービス |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA | 1,298 | 1,395 | 1,049 | 171,560 | 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 | |
| (ユーロ/イタリア) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| UNICREDIT SPA | | 1,775 | 1,831 | 4,585 | 749,840 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 45,238 19 | 47,705 19 | 31,327 - | 5,123,226 <0.6%> | |
| (ユーロ/フィンランド) | | | | | | |
| ELISA OYJ | | 134 | 145 | 610 | 99,865 | 電気通信サービス |
| FORTUM OYJ | | 414 | 445 | 565 | 92,420 | 公益事業 |
| KESKO OYJ-B SHS | | 252 | 271 | 465 | 76,083 | 生活必需品流通・小売り |
| KONE OYJ | | 314 | 337 | 1,395 | 228,267 | 資本財 |
| METSO CORPORATION | | 613 | 658 | 596 | 97,522 | 資本財 |
| NESTE OYJ | | 390 | 420 | 1,449 | 237,097 | エネルギー |
| NOKIA OYJ | | 4,998 | 5,313 | 1,737 | 284,172 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ORION OYJ-CLASS B | | 98 | 107 | 402 | 65,866 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SAMPO OYJ | | 443 | 456 | 1,774 | 290,135 | 保険 |
| STORA ENSO OYJ | | 508 | 577 | 703 | 115,057 | 素材 |
| UPM-KYMMENE OYJ | | 493 | 530 | 1,749 | 286,139 | 素材 |
| WARTSILA OYJ | | 436 | 469 | 557 | 91,247 | 資本財 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 9,098 12 | 9,735 12 | 12,008 - | 1,963,877 <0.2%> | |
| (ユーロ/オーストリア) | | | | | | |
| ERSTE GROUP BANK AG | | 317 | 341 | 1,225 | 200,386 | 銀行 |
| OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A | | 62 | 67 | 577 | 94,524 | 公益事業 |
| OMV AG | | 136 | 146 | 597 | 97,762 | エネルギー |
| VOESTALPINE AG | | 106 | 115 | 301 | 49,304 | 素材 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 623 4 | 670 4 | 2,702 - | 441,978 <0.1%> | |
| (ユーロ/その他) | | | | | | |
| AEGON LTD | | 1,654 | 1,674 | 831 | 135,919 | 保険 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA | | 189 | 203 | 730 | 119,528 | ヘルスケア機器・サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,844 2 | 1,878 2 | 1,561 - | 255,448 <0.0%> | |
| ユーロ計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 169,971 222 | 178,770 222 | 462,124 - | 75,575,875 <9.1%> | |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,040,017 1,213 | 1,128,688 1,219 | - - | 780,690,036 <94.4%> | |

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | |
|----------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------|
| | □数 | □数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 千口 | 千口 | 千米ドル | 千円 | |
| (アメリカ) | | | | | |
| BOSTON PROPERTIES INC | 13 | 14 | 815 | 122,319 | |
| CROWN CASTLE INC | 40 | 43 | 4,481 | 672,039 | |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 14 | 16 | 1,695 | 254,272 | |
| PROLOGIS INC | 85 | 91 | 10,103 | 1,514,977 | |
| ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT | 43 | 49 | 875 | 131,231 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 12 | 14 | 2,384 | 357,577 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 9 | 10 | 927 | 139,023 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 33 | 35 | 1,982 | 297,268 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 5 | 6 | 1,345 | 201,752 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 49 | 54 | 895 | 134,254 | |
| WELLTOWER INC | 43 | 49 | 4,321 | 648,006 | |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 66 | 70 | 1,219 | 182,844 | |
| KIMCO REALTY CORP | 57 | 61 | 1,158 | 173,724 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 10 | 11 | 1,407 | 211,072 | |
| PUBLIC STORAGE | 14 | 15 | 4,052 | 607,724 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 14 | 16 | 1,018 | 152,690 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 30 | 32 | 3,953 | 592,882 | |
| SUN COMMUNITIES INC | 11 | 12 | 1,518 | 227,649 | |
| UDR INC | 30 | 31 | 1,019 | 152,941 | |
| VENTAS INC | 36 | 39 | 1,770 | 265,454 | |
| WP CAREY INC | 19 | 21 | 1,202 | 180,305 | |
| REALTY INCOME CORP | 58 | 66 | 3,542 | 531,258 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 16 | 17 | 1,221 | 183,128 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 12 | 21 | 2,693 | 403,903 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 26 | 28 | 3,895 | 584,183 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 55 | — | — | — | |
| IRON MOUNTAIN INC | 26 | 28 | 1,802 | 270,330 | |
| AMERICAN TOWER REIT INC | 43 | 46 | 9,161 | 1,373,736 | |
| EQUINIX INC | 8 | 9 | 7,200 | 1,079,681 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPOR | 35 | 37 | 540 | 81,112 | |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 29 | 32 | 1,166 | 174,845 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 23 | 26 | 1,184 | 177,584 | |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 9 | 10 | 2,517 | 377,432 | |
| INVITATION HOMES INC | 56 | 60 | 2,038 | 305,646 | |
| VICI PROPERTIES INC | 89 | 99 | 2,853 | 427,918 | |
| 小計 | □数・金額 | 1,133 | 1,185 | 87,967 | 13,190,775 |
| | 銘柄数<比率> | 35 | 34 | — | <1.6%> |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | | 期首(前期末) | | 当期末 | | |
|----------------------------------|---------|---------|-------|--------|-------------|--------|
| | | □数 | □数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | | | 千□ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千円 |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | | | 8 | 8 | 380 | 41,606 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | | | 14 | 15 | 267 | 29,258 |
| 小計 | □数・金額 | 22 | 23 | 648 | 70,865 | |
| | 銘柄数<比率> | 2 | 2 | — | <0.0%> | |
| (オーストラリア) | | | | | 千オーストラリア・ドル | |
| GPT GROUP | | 176 | 189 | 790 | 77,115 | |
| GOODMAN GROUP | | 156 | 168 | 3,896 | 380,163 | |
| STOCKLAND | | 220 | 236 | 943 | 92,088 | |
| MIRVAC GROUP | | 364 | 391 | 802 | 78,273 | |
| VICINITY CENTRES | | 356 | 383 | 710 | 69,313 | |
| LENDLEASE GROUP | | 63 | 68 | 469 | 45,776 | |
| SCENTRE GROUP | | 479 | 515 | 1,369 | 133,663 | |
| DEXUS/AU | | 99 | 106 | 764 | 74,544 | |
| 小計 | □数・金額 | 1,916 | 2,060 | 9,746 | 950,939 | |
| | 銘柄数<比率> | 8 | 8 | — | <0.1%> | |
| (香港) | | | | | 千香港ドル | |
| LINK REIT | | 199 | 251 | 10,013 | 192,552 | |
| 小計 | □数・金額 | 199 | 251 | 10,013 | 192,552 | |
| | 銘柄数<比率> | 1 | 1 | — | <0.0%> | |
| (シンガポール) | | | | | 千シンガポール・ドル | |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT | | 311 | 370 | 1,036 | 115,648 | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | | 490 | 528 | 983 | 109,713 | |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | 311 | 343 | 542 | 60,570 | |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR | | 217 | 235 | 325 | 36,305 | |
| 小計 | □数・金額 | 1,330 | 1,478 | 2,888 | 322,238 | |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 4 | — | <0.0%> | |
| (イギリス) | | | | | 千イギリス・ポンド | |
| BRITISH LAND CO PLC | | 81 | — | — | — | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 65 | 70 | 457 | 85,405 | |
| SEGRO PLC | | 111 | 115 | 952 | 177,792 | |
| 小計 | □数・金額 | 257 | 185 | 1,409 | 263,197 | |
| | 銘柄数<比率> | 3 | 2 | — | <0.0%> | |
| (ユーロ/ベルギー) | | | | | 千ユーロ | |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | | 15 | 16 | 420 | 68,833 | |
| 小計 | □数・金額 | 15 | 16 | 420 | 68,833 | |
| | 銘柄数<比率> | 1 | 1 | — | <0.0%> | |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | |
|---------------------------|---------|-------|-------|---------|------------|
| | □数 | □数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ/フランス) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | |
| KLEPIERRE | 19 | 21 | 492 | 80,601 | |
| GECINA SA | 4 | 4 | 454 | 74,317 | |
| COVIVIO | 4 | 5 | 226 | 36,969 | |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 10 | 11 | 641 | 104,934 | |
| 小計 | □数・金額 | 39 | 42 | 1,814 | 296,824 |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 4 | — | <0.0%> |
| ユーロ計 | □数・金額 | 54 | 59 | 2,235 | 365,657 |
| | 銘柄数<比率> | 5 | 5 | — | <0.0%> |
| 合計 | □数・金額 | 4,914 | 5,244 | — | 15,356,225 |
| | 銘柄数<比率> | 58 | 56 | — | <1.9%> |

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 当期末 | |
|--------------------------|--------|-----|
| | 買建額 | 売建額 |
| | 百万円 | 百万円 |
| 外 国 S&P 500 EMINI FUTURE | 22,132 | — |
| FTSE 100 | 2,204 | — |
| DJ EURO STOXX 50 | 5,574 | — |

(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

2023年11月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 780,690,036 | 94.2 |
| 投資信託証券 | 15,356,225 | 1.9 |
| コール・ローン等、その他 | 32,982,118 | 4.0 |
| 投資信託財産総額 | 829,028,380 | 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149.95円、1カナダ・ドル109.25円、1オーストラリア・ドル97.57円、1香港ドル19.23円、1シンガポール・ドル111.57円、1ニュージーランド・ドル89.96円、1イギリス・ポンド186.69円、1イスラエル・シケル40.328円、1スイス・フラン169.22円、1デンマーク・クローネ21.93円、1ノルウェー・クローネ13.87円、1スウェーデン・クローナ14.25円、1ユーロ163.54円です。

(注2) 外貨建純資産 (810,509,466千円) の投資信託財産総額 (829,028,380千円) に対する比率は97.8%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

| 項目 | 当期末 |
|----------------------------|-------------------------|
| (A)資産 | 843,905,268,660円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 19,901,926,195 |
| 株 式(評価額) | 780,690,036,233 |
| 投 資 信 託 証 券(評価額) | 15,356,225,963 |
| 未 収 入 金 | 16,020,545,503 |
| 未 収 配 当 金 | 950,156,766 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 10,986,378,000 |
| (B)負債 | 16,847,404,762 |
| 未 払 金 | 15,040,401,421 |
| 未 払 解 約 金 | 1,806,984,938 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 18,403 |
| (C)純 資 産 総 額(A - B) | 827,057,863,898 |
| 元 本 | 220,818,463,085 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 606,239,400,813 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 220,818,463,085口 |
| 1万口当たり基準価額(C / D) | 37,454円 |

| | |
|--|------------------|
| (注1) 期首元本額 | 205,978,181,520円 |
| 期中追加設定元本額 | 26,115,488,072円 |
| 期中一部解約元本額 | 11,275,206,507円 |
| (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペビーフンド別内訳は、次の通りです。 | |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) | 794,706,462円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) | 3,806,956,625円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) | 3,508,595,111円 |
| ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定) | 2,154,739,003円 |
| ニッセイインデックスバランス(債券重視型) S A(適格機関投資家限定) | 949,369円 |
| ニッセイインデックスバランス(標準型) S A(適格機関投資家限定) | 5,648,440円 |
| ニッセイインデックスバランス(成長型) S A(適格機関投資家限定) | 5,790,300円 |
| ニッセイ外国株式インデックスA II(適格機関投資家限定) | 326,433,259円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド | 158,220,790,915円 |
| DCニッセイ外国株式インデックス | 39,070,481,438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) | 2,629,645,151円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2055 | 395,039,390円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 177,542,196円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2045 | 454,908,719円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2035 | 677,865,953円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2025 | 13,655,388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) | 94,377,931円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式) | 7,675,694円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式・リート) | 10,219,362円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式・リート・債券) | 3,714,441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) | 21,299,634円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2060 | 312,220,561円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2050 | 199,356,481円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2040 | 390,015,492円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2030 | 184,195,638円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定) | 161,299,099円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケッ) | 253,851,314円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適格機関投資家限定) | 162,468,312円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01(適格機関投資家限定) | 159,155,707円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05(適格機関投資家限定) | 158,496,026円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08(適格機関投資家限定) | 141,595,628円 |
| ニッセイ先進国株式インデックス(高成長ヘッジあり)(ラップ専用) | 30,410,953円 |
| ニッセイ先進国株式インデックス(高成長ヘッジなし)(ラップ専用) | 6,069,453,038円 |
| FWニッセイ先進国株式インデックス | 56,059,397円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2065 | 58,158,827円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンドⅡ2023-05(適格機関投資家限定) | 100,296,022円 |
| DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト | 395,809円 |

損益の状況

当期(2023年5月23日~2023年11月20日)

| 項目 | 当期 |
|--------------------------------|-------------------------|
| (A)配 当 等 収 益 | 6,521,239,758円 |
| 受 取 配 当 金 | 6,238,208,851 |
| 受 取 利 息 | 61,970,427 |
| 受 取 他 収 益 | 224,459,610 |
| 支 払 利 息 | △ 3,399,130 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 98,381,228,951 |
| 売 買 損 益 | 129,007,619,592 |
| 売 買 損 益 | △ 30,626,390,641 |
| (C)先 物 取 引 等 損 益 | 1,018,859,721 |
| 取 引 損 益 | 1,903,646,971 |
| 取 引 損 益 | △ 884,787,250 |
| (D)信 託 報 酬 等 | △ 63,394,060 |
| (E)当期損益金(A + B + C + D) | 105,857,934,370 |
| (F)前期繰越損益金 | 462,865,060,071 |
| (G)追加信託差損益金 | 65,902,196,199 |
| (H)解約差損益金 | △ 28,385,789,827 |
| (I)合 計(E + F + G + H) | 606,239,400,813 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I) | 606,239,400,813 |

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

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 34 期

(計算期間：2023年5月23日～2023年11月20日)

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

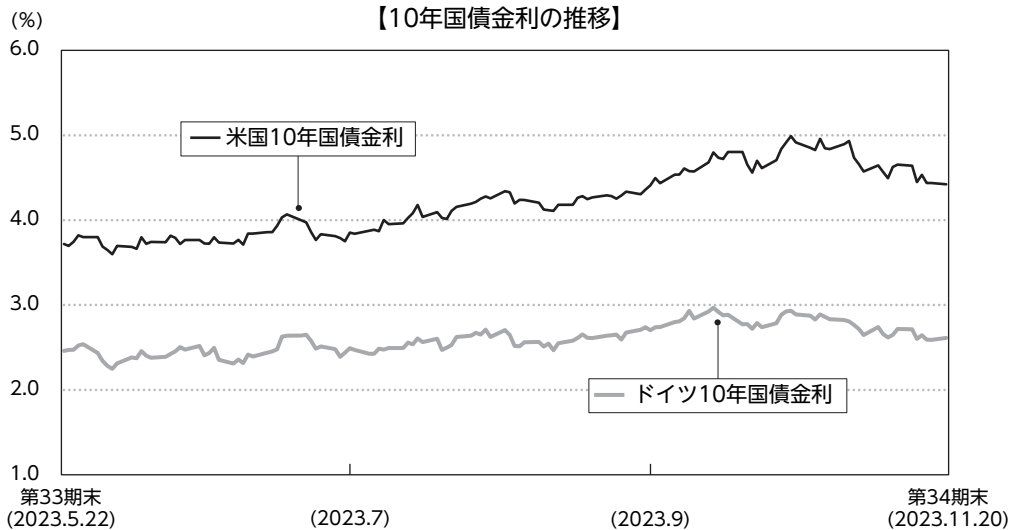
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年5月23日～2023年11月20日

投資環境

海外債券市況

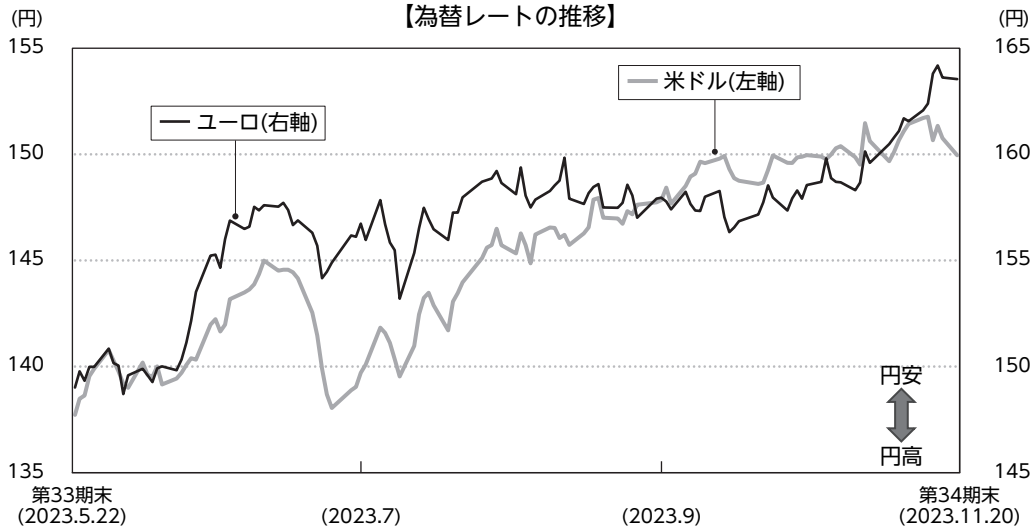


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、期初から10月中旬にかけて堅調な米経済指標を背景に利上げの継続が意識されたことから上昇基調となりました。その後は中東情勢の悪化により投資家のリスク回避姿勢が強まったことや物価上昇率の鈍化を受けて将来の利下げ観測が強まったことから金利は低下に転じましたが、結局、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初以降、各国の利上げや米金利の上昇を受けて上昇基調となり、9月には欧州中央銀行（ECB）が利上げ休止を示唆し、成長率予測を引き下げたことなどから上昇幅を縮小する動きとなりました。その後は中東情勢の悪化により投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを受けて低下に転じましたが、結局、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

■為替市況

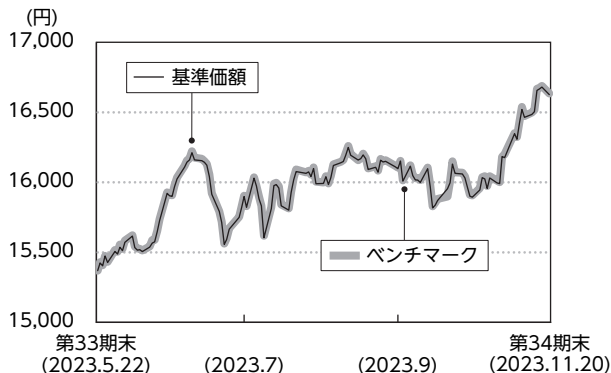


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、7月に日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けて大きく円高に振れる場面があったものの、その後は米国が利上げ方向である一方で日本が金融緩和方向であっ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りました。11月には米国の将来の利下げ観測が意識される一方で日本の金融政策正常化観測が高まったことでやや米ドル安円高となりましたが、結局、期を通じて見ると米ドル高円安で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、ECBが物価上昇リスクを警戒していたことや米金利の上昇に連れて欧州金利が上昇したことなどからユーロ高円安基調で始まりました。7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けてユーロ安円高に転じましたが、その後は日・欧中央銀行の金融政策の影響を受けて上下に振れつつも横ばい圏での推移となりました。11月には大手格付け機関によるイタリア国債の格下げが回避されたことなどをを受けてユーロに対する懸念が後退したことや日銀の金融緩和と政策継続への見方が強まったことなどからユーロ高円安となり、結局、期を通じて見ると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6月にかけて、米金融政策が利上げ方向であった一方で、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大幅な米ドル高円安基調となったこと

<下落要因>

- ・ 7月上旬から中旬にかけて、日銀の金融政策が修正されるとの見方が強まったことや米国の物価指標が鈍化し利上げ期待が後退したことで米ドル安円高となったこと

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+8.2%となり、ベンチマーク騰落率(+8.2%)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 |
| 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 |
| 33期(2023年5月22日) | 15,369 | 0.4 | 15,569 | 0.5 | 99.0 | 61,820 |
| 34期(2023年11月20日) | 16,626 | 8.2 | 16,850 | 8.2 | 98.9 | 72,121 |

(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)2023年5月22日 | 円 | % | | % | % |
| | 15,369 | — | 15,569 | — | 99.0 |
| 5月末 | 15,536 | 1.1 | 15,757 | 1.2 | 99.1 |
| 6月末 | 16,160 | 5.1 | 16,386 | 5.2 | 98.9 |
| 7月末 | 15,811 | 2.9 | 16,028 | 3.0 | 99.2 |
| 8月末 | 16,249 | 5.7 | 16,470 | 5.8 | 98.9 |
| 9月末 | 15,998 | 4.1 | 16,224 | 4.2 | 99.2 |
| 10月末 | 15,990 | 4.0 | 16,209 | 4.1 | 99.0 |
| (期末)2023年11月20日 | 16,626 | 8.2 | 16,850 | 8.2 | 98.9 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023年11月20日

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|--------|-----|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| その他費用 | 3円 | 0.018% | 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) | (0.018) | 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | <ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 3 | 0.018 | |

(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（15,977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

2023年5月23日～2023年11月20日

公社債

| | | 買付額 | 売付額 | |
|--------|----------|-----------------------|---------------------|------------|
| 外国 | アメリカ | 千米ドル 45,934 | 千米ドル 31,181 | |
| | カナダ | 千カナダ・ドル 2,352 | 千カナダ・ドル 1,575 | |
| | オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 809 | 千オーストラリア・ドル 149 | |
| | シンガポール | 千シンガポール・ドル 363 | 千シンガポール・ドル 227 | |
| | ニュージーランド | 千ニュージーランド・ドル 318 | 千ニュージーランド・ドル 142 | |
| | イギリス | 千イギリス・ポンド 3,209 | 千イギリス・ポンド 677 | |
| | イスラエル | 千イスラエル・シケル 765 | 千イスラエル・シケル - | |
| | デンマーク | 千デンマーク・クローネ 1,154 | 千デンマーク・クローネ 494 | |
| | ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 1,358 | 千ノルウェー・クローネ 153 | |
| | スウェーデン | 千スウェーデン・クローナ 769 | 千スウェーデン・クローナ 109 | |
| | メキシコ | 千メキシコ・ペソ 12,620 | 千メキシコ・ペソ 9,652 | |
| | 中国 | 千人民元 95,906 | 千人民元 11,808 | |
| | マレーシア | 千マレーシア・リンギット 1,343 | 千マレーシア・リンギット 898 | |
| | ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 1,656 | 千ポーランド・ズロチ 1,027 | |
| | ユーロ | アイルランド | 千ユーロ 179 | 千ユーロ 99 |
| | | オランダ | 728 | 566 |
| | | ベルギー | 957 | 892 |
| | | フランス | 4,686 | 1,961 |
| | | ドイツ | 4,705 | 2,969 |
| | | スペイン | 2,717 | 1,872 |
| イタリア | | 4,114 | 2,597 | |
| フィンランド | | 330 | 133 | |
| オーストリア | 681 | 608 | | |

(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

2023年5月23日～2023年11月20日

公社債

| 買付 | | 売付 | |
|-----------------------|---------|-----------------------|-----------|
| 銘柄 | 金額 | 銘柄 | 金額 |
| | 千円 | | 千円 |
| US TREASURY | 583,684 | US TREASURY | 1,489,814 |
| US TREASURY | 513,310 | US TREASURY | 997,560 |
| US TREASURY | 465,255 | US TREASURY | 566,698 |
| US TREASURY | 443,347 | US TREASURY | 285,027 |
| US TREASURY | 431,366 | US TREASURY | 266,439 |
| US TREASURY | 410,156 | US TREASURY | 226,269 |
| US TREASURY | 381,800 | FRANCE (GOVT OF) | 118,720 |
| CHINA GOVERNMENT BOND | 354,137 | CHINA GOVERNMENT BOND | 115,046 |
| US TREASURY | 334,300 | US TREASURY | 100,990 |
| US TREASURY | 316,543 | US TREASURY | 91,027 |

(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

2023年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

| 区分 | 当期末 | | | | | | | |
|-----------|---------------|---------------|------------|------|-----------------|-----------|------|------|
| | 額面金額 | 評価額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 261,780 | 227,170 | 34,064,156 | 47.2 | — | 19.2 | 17.6 | 10.4 |
| | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | | | | | | |
| カナダ | 14,150 | 12,794 | 1,397,794 | 1.9 | — | 1.0 | 0.4 | 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 | 12,140 | 10,689 | 1,042,944 | 1.4 | — | 1.0 | 0.3 | 0.1 |
| | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | | | | | | |
| シンガポール | 2,890 | 2,782 | 310,487 | 0.4 | — | 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 | 2,140 | 1,849 | 166,401 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | 0.0 |
| | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | | | | | | |
| イギリス | 23,780 | 19,415 | 3,624,647 | 5.0 | — | 3.6 | 0.9 | 0.6 |
| | 千イスラエル・シケル | 千イスラエル・シケル | | | | | | |
| イスラエル | 6,010 | 5,511 | 222,259 | 0.3 | — | 0.1 | 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 11,260 | 千デンマーク・クローネ 10,387 | 千円 227,799 | % 0.3 | % - | % 0.2 | % 0.0 | % 0.1 | |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 9,770 | 千ノルウェー・クローネ 9,006 | 124,924 | 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 10,890 | 千スウェーデン・クローナ 10,268 | 146,325 | 0.2 | - | 0.1 | 0.1 | 0.0 | |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ 82,270 | 千メキシコ・ペソ 75,107 | 653,762 | 0.9 | - | 0.5 | 0.3 | 0.1 | |
| 中国 | 千人民元 241,970 | 千人民元 243,949 | 5,063,949 | 7.0 | - | 3.1 | 2.8 | 1.2 | |
| マレーシア | 千マレーシア・リンギット 11,450 | 千マレーシア・リンギット 11,601 | 371,431 | 0.5 | - | 0.3 | 0.1 | 0.0 | |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 10,660 | 千ポーランド・ズロチ 9,821 | 366,007 | 0.5 | - | 0.2 | 0.3 | 0.1 | |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | | |
| | アイルランド | 2,930 | 2,530 | 413,911 | 0.6 | - | 0.4 | 0.1 | 0.1 |
| | オランダ | 7,360 | 6,591 | 1,078,018 | 1.5 | - | 0.9 | 0.5 | 0.1 |
| | ベルギー | 8,590 | 7,693 | 1,258,182 | 1.7 | - | 1.2 | 0.5 | 0.1 |
| | フランス | 40,920 | 36,907 | 6,035,786 | 8.4 | - | 5.0 | 2.4 | 0.9 |
| | ドイツ | 30,720 | 28,173 | 4,607,563 | 6.4 | - | 3.4 | 2.1 | 0.9 |
| | スペイン | 23,770 | 21,775 | 3,561,212 | 4.9 | - | 2.8 | 1.5 | 0.7 |
| | イタリア | 35,540 | 32,922 | 5,384,213 | 7.5 | - | 4.1 | 2.3 | 1.1 |
| | フィンランド | 2,670 | 2,269 | 371,179 | 0.5 | - | 0.3 | 0.2 | 0.1 |
| | オーストリア | 5,890 | 5,150 | 842,327 | 1.2 | - | 0.7 | 0.4 | 0.1 |
| 合計 | - | - | 71,335,288 | 98.9 | - | 48.6 | 33.1 | 17.2 | |

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|------|-------------|--------|------------|-------|-------|-----------|
| | | | | | 千米ドル | 千円 |
| アメリカ | | % | | 千米ドル | 千米ドル | 千円 |
| 国債証券 | US TREASURY | 6.0000 | 2026/02/15 | 100 | 102 | 15,354 |
| | US TREASURY | 6.1250 | 2027/11/15 | 120 | 126 | 19,012 |
| | US TREASURY | 5.2500 | 2028/11/15 | 120 | 123 | 18,587 |
| | US TREASURY | 5.3750 | 2031/02/15 | 180 | 190 | 28,531 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2024/11/15 | 7,280 | 7,069 | 1,060,033 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2024/12/31 | 3,320 | 3,213 | 481,848 |
| | US TREASURY | 2.0000 | 2025/02/15 | 8,420 | 8,100 | 1,214,727 |
| | US TREASURY | 2.6250 | 2025/03/31 | 2,870 | 2,776 | 416,266 |
| | US TREASURY | 2.1250 | 2025/05/15 | 7,710 | 7,386 | 1,107,603 |
| | US TREASURY | 2.7500 | 2025/06/30 | 4,920 | 4,749 | 712,131 |
| | US TREASURY | 2.0000 | 2025/08/15 | 5,760 | 5,476 | 821,165 |
| | US TREASURY | 3.5000 | 2025/09/15 | 2,590 | 2,524 | 378,583 |
| | US TREASURY | 3.0000 | 2025/09/30 | 1,050 | 1,013 | 152,040 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2025/11/15 | 7,890 | 7,498 | 1,124,447 |
| | US TREASURY | 2.6250 | 2025/12/31 | 1,900 | 1,816 | 272,317 |
| | US TREASURY | 1.6250 | 2026/02/15 | 7,490 | 6,991 | 1,048,359 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2026/03/31 | 2,580 | 2,436 | 365,411 |
| | US TREASURY | 1.6250 | 2026/05/15 | 6,880 | 6,382 | 957,098 |
| | US TREASURY | 1.8750 | 2026/06/30 | 2,140 | 1,993 | 298,966 |
| | US TREASURY | 1.5000 | 2026/08/15 | 6,890 | 6,331 | 949,366 |
| | US TREASURY | 0.7500 | 2026/08/31 | 1,360 | 1,222 | 183,306 |
| | US TREASURY | 1.6250 | 2026/09/30 | 1,260 | 1,159 | 173,880 |
| | US TREASURY | 2.0000 | 2026/11/15 | 4,160 | 3,855 | 578,174 |
| | US TREASURY | 1.7500 | 2026/12/31 | 2,130 | 1,955 | 293,203 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2027/02/15 | 3,590 | 3,339 | 500,718 |
| | US TREASURY | 0.6250 | 2027/03/31 | 2,070 | 1,817 | 272,493 |
| | US TREASURY | 2.3750 | 2027/05/15 | 4,460 | 4,146 | 621,721 |
| | US TREASURY | 0.5000 | 2027/06/30 | 2,170 | 1,879 | 281,831 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2027/08/15 | 5,270 | 4,858 | 728,463 |
| | US TREASURY | 0.3750 | 2027/09/30 | 1,460 | 1,246 | 186,924 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2027/11/15 | 6,090 | 5,587 | 837,856 |
| | US TREASURY | 0.6250 | 2027/12/31 | 1,170 | 1,000 | 150,028 |
| | US TREASURY | 2.7500 | 2028/02/15 | 5,640 | 5,259 | 788,657 |
| | US TREASURY | 1.1250 | 2028/02/29 | 1,240 | 1,078 | 161,691 |
| | US TREASURY | 1.2500 | 2028/03/31 | 1,150 | 1,002 | 150,381 |
| | US TREASURY | 1.2500 | 2028/04/30 | 1,390 | 1,209 | 181,382 |
| | US TREASURY | 2.8750 | 2028/05/15 | 5,770 | 5,390 | 808,358 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|------|-------------|--------|------------|-------|-------|---------|
| | | | | | 千米ドル | 千円 |
| アメリカ | | % | | 千米ドル | 千米ドル | 千円 |
| 国債証券 | US TREASURY | 1.2500 | 2028/05/31 | 900 | 781 | 117,151 |
| | US TREASURY | 2.8750 | 2028/08/15 | 6,900 | 6,426 | 963,677 |
| | US TREASURY | 1.1250 | 2028/08/31 | 1,720 | 1,473 | 220,918 |
| | US TREASURY | 1.3750 | 2028/10/31 | 1,940 | 1,674 | 251,107 |
| | US TREASURY | 3.1250 | 2028/11/15 | 2,330 | 2,188 | 328,228 |
| | US TREASURY | 1.5000 | 2028/11/30 | 1,520 | 1,317 | 197,553 |
| | US TREASURY | 2.6250 | 2029/02/15 | 4,740 | 4,329 | 649,154 |
| | US TREASURY | 2.3750 | 2029/05/15 | 4,050 | 3,636 | 545,237 |
| | US TREASURY | 1.6250 | 2029/08/15 | 3,630 | 3,118 | 467,580 |
| | US TREASURY | 1.7500 | 2029/11/15 | 3,200 | 2,754 | 413,017 |
| | US TREASURY | 1.5000 | 2030/02/15 | 3,790 | 3,182 | 477,176 |
| | US TREASURY | 0.6250 | 2030/08/15 | 4,980 | 3,875 | 581,091 |
| | US TREASURY | 0.8750 | 2030/11/15 | 2,420 | 1,907 | 286,090 |
| | US TREASURY | 1.1250 | 2031/02/15 | 2,330 | 1,862 | 279,258 |
| | US TREASURY | 1.6250 | 2031/05/15 | 2,250 | 1,849 | 277,379 |
| | US TREASURY | 1.2500 | 2031/08/15 | 2,520 | 1,997 | 299,465 |
| | US TREASURY | 1.3750 | 2031/11/15 | 2,390 | 1,899 | 284,855 |
| | US TREASURY | 1.8750 | 2032/02/15 | 2,330 | 1,917 | 287,490 |
| | US TREASURY | 2.8750 | 2032/05/15 | 2,260 | 2,006 | 300,867 |
| | US TREASURY | 2.7500 | 2032/08/15 | 2,190 | 1,918 | 287,725 |
| | US TREASURY | 4.1250 | 2032/11/15 | 2,200 | 2,143 | 321,395 |
| | US TREASURY | 3.5000 | 2033/02/15 | 2,190 | 2,031 | 304,555 |
| | US TREASURY | 3.3750 | 2033/05/15 | 2,210 | 2,026 | 303,841 |
| | US TREASURY | 3.8750 | 2033/08/15 | 2,100 | 2,004 | 300,526 |
| | US TREASURY | 4.5000 | 2036/02/15 | 180 | 181 | 27,208 |
| | US TREASURY | 5.0000 | 2037/05/15 | 140 | 147 | 22,067 |
| | US TREASURY | 4.3750 | 2038/02/15 | 150 | 147 | 22,075 |
| | US TREASURY | 4.5000 | 2038/05/15 | 170 | 168 | 25,276 |
| | US TREASURY | 3.5000 | 2039/02/15 | 170 | 148 | 22,337 |
| | US TREASURY | 4.2500 | 2039/05/15 | 270 | 257 | 38,672 |
| | US TREASURY | 4.5000 | 2039/08/15 | 280 | 274 | 41,201 |
| | US TREASURY | 4.3750 | 2039/11/15 | 300 | 289 | 43,429 |
| | US TREASURY | 4.6250 | 2040/02/15 | 300 | 297 | 44,659 |
| | US TREASURY | 1.1250 | 2040/05/15 | 890 | 520 | 78,080 |
| | US TREASURY | 1.1250 | 2040/08/15 | 1,090 | 632 | 94,791 |
| | US TREASURY | 3.8750 | 2040/08/15 | 290 | 261 | 39,167 |
| | US TREASURY | 1.3750 | 2040/11/15 | 1,210 | 731 | 109,705 |
| | US TREASURY | 4.2500 | 2040/11/15 | 280 | 264 | 39,601 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------------|--------|------------|-------|-------|---------|
| | | | | 千米ドル | 千円 |
| アメリカ | % | | 千米ドル | 千米ドル | 千円 |
| 国債証券 | | | | | |
| US TREASURY | 1.8750 | 2041/02/15 | 1,480 | 974 | 146,104 |
| US TREASURY | 4.7500 | 2041/02/15 | 300 | 300 | 45,093 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2041/05/15 | 1,260 | 881 | 132,159 |
| US TREASURY | 1.7500 | 2041/08/15 | 1,670 | 1,061 | 159,227 |
| US TREASURY | 2.0000 | 2041/11/15 | 1,390 | 920 | 138,068 |
| US TREASURY | 3.1250 | 2041/11/15 | 300 | 240 | 36,037 |
| US TREASURY | 2.3750 | 2042/02/15 | 1,140 | 803 | 120,413 |
| US TREASURY | 3.1250 | 2042/02/15 | 310 | 247 | 37,132 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2042/05/15 | 290 | 226 | 33,919 |
| US TREASURY | 3.2500 | 2042/05/15 | 1,000 | 808 | 121,272 |
| US TREASURY | 2.7500 | 2042/08/15 | 330 | 246 | 36,946 |
| US TREASURY | 3.3750 | 2042/08/15 | 870 | 715 | 107,263 |
| US TREASURY | 2.7500 | 2042/11/15 | 500 | 372 | 55,797 |
| US TREASURY | 4.0000 | 2042/11/15 | 880 | 791 | 118,707 |
| US TREASURY | 3.1250 | 2043/02/15 | 420 | 330 | 49,622 |
| US TREASURY | 3.8750 | 2043/02/15 | 870 | 767 | 115,086 |
| US TREASURY | 2.8750 | 2043/05/15 | 670 | 505 | 75,792 |
| US TREASURY | 3.8750 | 2043/05/15 | 860 | 758 | 113,662 |
| US TREASURY | 3.6250 | 2043/08/15 | 480 | 407 | 61,038 |
| US TREASURY | 4.3750 | 2043/08/15 | 580 | 548 | 82,214 |
| US TREASURY | 3.7500 | 2043/11/15 | 490 | 422 | 63,380 |
| US TREASURY | 3.6250 | 2044/02/15 | 530 | 447 | 67,167 |
| US TREASURY | 3.3750 | 2044/05/15 | 480 | 389 | 58,373 |
| US TREASURY | 3.1250 | 2044/08/15 | 610 | 473 | 71,045 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2044/11/15 | 540 | 409 | 61,440 |
| US TREASURY | 2.5000 | 2045/02/15 | 700 | 483 | 72,552 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2045/05/15 | 360 | 271 | 40,779 |
| US TREASURY | 2.8750 | 2045/08/15 | 480 | 353 | 53,028 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2045/11/15 | 280 | 210 | 31,584 |
| US TREASURY | 2.5000 | 2046/02/15 | 580 | 395 | 59,370 |
| US TREASURY | 2.5000 | 2046/05/15 | 590 | 401 | 60,218 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2046/08/15 | 710 | 457 | 68,661 |
| US TREASURY | 2.8750 | 2046/11/15 | 330 | 240 | 36,115 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2047/02/15 | 650 | 484 | 72,643 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2047/05/15 | 500 | 372 | 55,818 |
| US TREASURY | 2.7500 | 2047/08/15 | 690 | 488 | 73,282 |
| US TREASURY | 2.7500 | 2047/11/15 | 730 | 516 | 77,479 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2048/02/15 | 820 | 608 | 91,219 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------------|---------------------|------------|------------|---------|---------|------------|
| | | | | | 千米ドル | 千円 |
| アメリカ | | % | | 千米ドル | 千米ドル | 千円 |
| 国債証券 | US TREASURY | 3.1250 | 2048/05/15 | 870 | 660 | 99,038 |
| | US TREASURY | 3.0000 | 2048/08/15 | 940 | 696 | 104,420 |
| | US TREASURY | 3.3750 | 2048/11/15 | 990 | 786 | 117,970 |
| | US TREASURY | 3.0000 | 2049/02/15 | 1,050 | 777 | 116,583 |
| | US TREASURY | 2.8750 | 2049/05/15 | 1,000 | 722 | 108,385 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2049/08/15 | 970 | 612 | 91,872 |
| | US TREASURY | 2.3750 | 2049/11/15 | 910 | 591 | 88,679 |
| | US TREASURY | 2.0000 | 2050/02/15 | 1,130 | 671 | 100,666 |
| | US TREASURY | 1.3750 | 2050/08/15 | 1,450 | 722 | 108,354 |
| | US TREASURY | 1.6250 | 2050/11/15 | 1,470 | 786 | 117,901 |
| | US TREASURY | 1.8750 | 2051/02/15 | 1,610 | 920 | 137,976 |
| | US TREASURY | 2.3750 | 2051/05/15 | 1,660 | 1,072 | 160,832 |
| | US TREASURY | 2.0000 | 2051/08/15 | 1,600 | 941 | 141,156 |
| | US TREASURY | 1.8750 | 2051/11/15 | 1,530 | 870 | 130,457 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2052/02/15 | 1,400 | 876 | 131,369 |
| | US TREASURY | 2.8750 | 2052/05/15 | 1,330 | 960 | 144,018 |
| | US TREASURY | 3.0000 | 2052/08/15 | 1,260 | 934 | 140,159 |
| | US TREASURY | 4.0000 | 2052/11/15 | 1,290 | 1,161 | 174,128 |
| | US TREASURY | 3.6250 | 2053/02/15 | 1,260 | 1,059 | 158,809 |
| | US TREASURY | 3.6250 | 2053/05/15 | 1,260 | 1,059 | 158,913 |
| | US TREASURY | 4.1250 | 2053/08/15 | 1,130 | 1,041 | 156,125 |
| | US TREASURY | 6.2500 | 2030/05/15 | 150 | 164 | 24,666 |
| | US TREASURY | 0.6250 | 2030/05/15 | 4,270 | 3,350 | 502,445 |
| | US TREASURY | 4.3750 | 2040/05/15 | 290 | 278 | 41,810 |
| US TREASURY | 4.3750 | 2041/05/15 | 280 | 267 | 40,135 | |
| US TREASURY | 3.7500 | 2041/08/15 | 280 | 246 | 36,926 | |
| US TREASURY | 1.2500 | 2050/05/15 | 1,330 | 640 | 96,077 | |
| 小計 | | - | - | - | - | 34,064,156 |
| カナダ | | | | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | |
| 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2024/11/01 | 320 | 314 | 34,356 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.7500 | 2025/02/01 | 320 | 316 | 34,533 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2025/03/01 | 190 | 181 | 19,875 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2025/04/01 | 270 | 258 | 28,261 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.7500 | 2025/05/01 | 340 | 335 | 36,663 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.2500 | 2025/06/01 | 250 | 241 | 26,375 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5000 | 2025/08/01 | 420 | 412 | 45,077 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.5000 | 2025/09/01 | 610 | 568 | 62,128 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2025/10/01 | 230 | 223 | 24,453 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|---------|-----------------------|--------|------------|-------------|-------------|-----------|
| | | | | | 千カナダ・ドル | 千円 |
| カナダ | | % | | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 |
| 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 4.5000 | 2025/11/01 | 370 | 370 | 40,437 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.2500 | 2026/03/01 | 400 | 365 | 39,896 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2026/04/01 | 220 | 213 | 23,333 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2026/06/01 | 170 | 159 | 17,381 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0000 | 2026/09/01 | 390 | 358 | 39,113 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2027/03/01 | 360 | 329 | 35,983 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0000 | 2027/06/01 | 170 | 153 | 16,806 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2027/09/01 | 350 | 335 | 36,625 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5000 | 2028/03/01 | 320 | 315 | 34,421 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0000 | 2028/06/01 | 150 | 138 | 15,183 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.2500 | 2028/09/01 | 440 | 428 | 46,862 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0000 | 2029/03/01 | 70 | 70 | 7,719 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.2500 | 2029/06/01 | 140 | 129 | 14,183 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.7500 | 2029/06/01 | 170 | 186 | 20,417 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.2500 | 2029/12/01 | 110 | 101 | 11,083 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2030/06/01 | 720 | 616 | 67,348 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.5000 | 2030/12/01 | 620 | 496 | 54,236 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2031/06/01 | 780 | 666 | 72,790 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2031/12/01 | 650 | 550 | 60,126 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0000 | 2032/06/01 | 540 | 472 | 51,615 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5000 | 2032/12/01 | 460 | 417 | 45,582 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2033/06/01 | 420 | 388 | 42,405 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.7500 | 2033/06/01 | 190 | 220 | 24,116 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.2500 | 2033/12/01 | 340 | 327 | 35,802 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0000 | 2037/06/01 | 120 | 135 | 14,857 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0000 | 2041/06/01 | 180 | 188 | 20,547 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5000 | 2045/12/01 | 220 | 216 | 23,683 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2048/12/01 | 240 | 208 | 22,777 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0000 | 2051/12/01 | 880 | 641 | 70,113 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2053/12/01 | 690 | 466 | 51,017 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2055/12/01 | 170 | 144 | 15,813 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2064/12/01 | 150 | 126 | 13,782 |
| 小計 | | - | - | - | - | 1,397,794 |
| オーストラリア | | | | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | |
| 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 0.2500 | 2024/11/21 | 600 | 576 | 56,238 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.2500 | 2025/04/21 | 450 | 443 | 43,311 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 0.2500 | 2025/11/21 | 440 | 407 | 39,740 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.2500 | 2026/04/21 | 450 | 451 | 44,065 |

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 | 0.5000 | 2026/09/21 | 550 | 497 | 48,558 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.7500 | 2027/04/21 | 490 | 500 | 48,812 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2027/11/21 | 400 | 380 | 37,104 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.2500 | 2028/05/21 | 350 | 323 | 31,556 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2028/11/21 | 320 | 300 | 29,276 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.2500 | 2029/04/21 | 440 | 420 | 41,017 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2029/11/21 | 410 | 378 | 36,913 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.5000 | 2030/05/21 | 510 | 459 | 44,811 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.0000 | 2030/12/21 | 440 | 351 | 34,318 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2031/06/21 | 540 | 441 | 43,052 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.0000 | 2031/11/21 | 690 | 533 | 52,070 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2032/05/21 | 640 | 497 | 48,554 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2032/11/21 | 600 | 481 | 46,941 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5000 | 2033/04/21 | 530 | 532 | 51,912 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2033/11/21 | 500 | 441 | 43,064 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.7500 | 2034/05/21 | 420 | 394 | 38,509 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.5000 | 2034/12/21 | 360 | 328 | 32,098 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2035/06/21 | 300 | 252 | 24,638 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.7500 | 2037/04/21 | 270 | 247 | 24,123 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.2500 | 2039/06/21 | 230 | 193 | 18,891 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2041/05/21 | 320 | 244 | 23,810 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2047/03/21 | 310 | 231 | 22,561 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2051/06/21 | 430 | 230 | 22,447 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.7500 | 2054/06/21 | 150 | 149 | 14,540 |
| 小計 | | | - | - | - | 1,042,944 |
| 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 | 2.3750 | 2025/06/01 | 220 | 216 | 24,135 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 0.5000 | 2025/11/01 | 170 | 161 | 17,964 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.1250 | 2026/06/01 | 160 | 155 | 17,387 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.2500 | 2026/11/01 | 130 | 123 | 13,742 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5000 | 2027/03/01 | 210 | 212 | 23,741 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.8750 | 2027/09/01 | 70 | 69 | 7,794 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.6250 | 2028/05/01 | 140 | 138 | 15,408 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.8750 | 2028/08/01 | 60 | 59 | 6,672 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.8750 | 2029/07/01 | 160 | 159 | 17,785 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.8750 | 2030/09/01 | 200 | 198 | 22,175 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.6250 | 2031/07/01 | 120 | 109 | 12,170 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.6250 | 2032/08/01 | 120 | 116 | 13,040 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|----------|------------------------|--------|------------|--------------|--------------|---------|
| | | | | | 千シンガポール・ドル | 千円 |
| シンガポール | | % | | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | 千円 |
| 国債証券 | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.3750 | 2033/09/01 | 200 | 206 | 23,089 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.2500 | 2036/08/01 | 180 | 166 | 18,556 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.3750 | 2039/07/01 | 120 | 111 | 12,402 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.7500 | 2042/04/01 | 120 | 116 | 13,001 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.7500 | 2046/03/01 | 160 | 153 | 17,155 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.8750 | 2050/03/01 | 140 | 112 | 12,495 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.8750 | 2051/10/01 | 100 | 80 | 9,004 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0000 | 2072/08/01 | 110 | 114 | 12,763 |
| | 小計 | | - | - | - | - |
| 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 | 240 | 232 | 20,903 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 0.5000 | 2026/05/15 | 290 | 261 | 23,480 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4.5000 | 2027/04/15 | 80 | 79 | 7,145 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 0.2500 | 2028/05/15 | 140 | 115 | 10,346 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 3.0000 | 2029/04/20 | 250 | 229 | 20,657 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4.5000 | 2030/05/15 | 110 | 108 | 9,746 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 1.5000 | 2031/05/15 | 140 | 111 | 9,993 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 2.0000 | 2032/05/15 | 180 | 144 | 13,019 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 3.5000 | 2033/04/14 | 270 | 242 | 21,786 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4.2500 | 2034/05/15 | 90 | 85 | 7,657 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 2.7500 | 2037/04/15 | 130 | 100 | 9,080 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 1.7500 | 2041/05/15 | 100 | 61 | 5,504 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 2.7500 | 2051/05/15 | 120 | 78 | 7,078 |
| | 小計 | | - | - | - | - |
| イギリス | | | | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | |
| 国債証券 | UK TREASURY | 0.2500 | 2025/01/31 | 680 | 645 | 120,507 |
| | UK TREASURY | 5.0000 | 2025/03/07 | 390 | 391 | 73,144 |
| | UK TREASURY | 0.6250 | 2025/06/07 | 340 | 320 | 59,892 |
| | UK TREASURY | 2.0000 | 2025/09/07 | 310 | 296 | 55,431 |
| | UK TREASURY | 3.5000 | 2025/10/22 | 650 | 637 | 119,061 |
| | UK TREASURY | 0.1250 | 2026/01/30 | 340 | 311 | 58,132 |
| | UK TREASURY | 1.5000 | 2026/07/22 | 360 | 335 | 62,716 |
| | UK TREASURY | 0.3750 | 2026/10/22 | 590 | 528 | 98,730 |
| | UK TREASURY | 4.1250 | 2027/01/29 | 710 | 707 | 132,172 |
| | UK TREASURY | 1.2500 | 2027/07/22 | 330 | 298 | 55,795 |
| | UK TREASURY | 4.2500 | 2027/12/07 | 330 | 332 | 62,027 |
| | UK TREASURY | 0.1250 | 2028/01/31 | 340 | 289 | 54,014 |
| | UK TREASURY | 4.5000 | 2028/06/07 | 290 | 294 | 55,018 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------------|--------|------------|------|-----|---------|
| | | | | 千円 | 千円 |
| イギリス | % | | 千円 | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | | | | | |
| UK TREASURY | 1.6250 | 2028/10/22 | 320 | 286 | 53,567 |
| UK TREASURY | 6.0000 | 2028/12/07 | 260 | 283 | 52,898 |
| UK TREASURY | 0.5000 | 2029/01/31 | 600 | 502 | 93,735 |
| UK TREASURY | 0.8750 | 2029/10/22 | 340 | 285 | 53,270 |
| UK TREASURY | 0.3750 | 2030/10/22 | 400 | 313 | 58,605 |
| UK TREASURY | 4.7500 | 2030/12/07 | 450 | 471 | 88,008 |
| UK TREASURY | 0.2500 | 2031/07/31 | 610 | 459 | 85,775 |
| UK TREASURY | 1.0000 | 2032/01/31 | 780 | 615 | 114,975 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2032/06/07 | 480 | 488 | 91,173 |
| UK TREASURY | 3.2500 | 2033/01/31 | 740 | 692 | 129,234 |
| UK TREASURY | 0.8750 | 2033/07/31 | 490 | 363 | 67,906 |
| UK TREASURY | 4.6250 | 2034/01/31 | 80 | 82 | 15,478 |
| UK TREASURY | 4.5000 | 2034/09/07 | 310 | 317 | 59,361 |
| UK TREASURY | 0.6250 | 2035/07/31 | 470 | 313 | 58,600 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2036/03/07 | 370 | 369 | 68,950 |
| UK TREASURY | 1.7500 | 2037/09/07 | 480 | 350 | 65,452 |
| UK TREASURY | 3.7500 | 2038/01/29 | 420 | 390 | 72,859 |
| UK TREASURY | 4.7500 | 2038/12/07 | 330 | 342 | 63,867 |
| UK TREASURY | 1.1250 | 2039/01/31 | 510 | 324 | 60,577 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2039/09/07 | 290 | 283 | 52,884 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2040/12/07 | 330 | 320 | 59,885 |
| UK TREASURY | 1.2500 | 2041/10/22 | 550 | 332 | 61,997 |
| UK TREASURY | 4.5000 | 2042/12/07 | 410 | 409 | 76,365 |
| UK TREASURY | 3.2500 | 2044/01/22 | 470 | 389 | 72,775 |
| UK TREASURY | 3.5000 | 2045/01/22 | 450 | 385 | 71,980 |
| UK TREASURY | 0.8750 | 2046/01/31 | 370 | 181 | 33,924 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2046/12/07 | 380 | 363 | 67,824 |
| UK TREASURY | 1.5000 | 2047/07/22 | 420 | 236 | 44,085 |
| UK TREASURY | 1.7500 | 2049/01/22 | 260 | 152 | 28,435 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2049/12/07 | 300 | 286 | 53,437 |
| UK TREASURY | 0.6250 | 2050/10/22 | 380 | 152 | 28,387 |
| UK TREASURY | 1.2500 | 2051/07/31 | 590 | 288 | 53,806 |
| UK TREASURY | 3.7500 | 2052/07/22 | 290 | 254 | 47,425 |
| UK TREASURY | 1.5000 | 2053/07/31 | 370 | 189 | 35,318 |
| UK TREASURY | 3.7500 | 2053/10/22 | 480 | 418 | 78,105 |
| UK TREASURY | 1.6250 | 2054/10/22 | 310 | 162 | 30,355 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2055/12/07 | 380 | 363 | 67,939 |
| UK TREASURY | 1.7500 | 2057/07/22 | 420 | 225 | 42,011 |

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 | 4.0000 | 2060/01/22 | 300 | 276 | 51,676 |
| | UK TREASURY | 0.5000 | 2061/10/22 | 470 | 141 | 26,424 |
| | UK TREASURY | 4.0000 | 2063/10/22 | 230 | 211 | 39,490 |
| | UK TREASURY | 2.5000 | 2065/07/22 | 350 | 225 | 42,118 |
| | UK TREASURY | 3.5000 | 2068/07/22 | 350 | 291 | 54,459 |
| | UK TREASURY | 1.6250 | 2071/10/22 | 310 | 146 | 27,304 |
| | UK TREASURY | 1.1250 | 2073/10/22 | 220 | 81 | 15,279 |
| | 小計 | | - | - | - | - |
| イスラエル | | | | 千イスラエル・シケル | 千イスラエル・シケル | |
| 国債証券 | ISRAEL FIXED BOND | 0.4000 | 2024/10/31 | 300 | 290 | 11,719 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 0.5000 | 2025/04/30 | 520 | 497 | 20,044 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.7500 | 2025/08/31 | 630 | 609 | 24,576 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 0.5000 | 2026/02/27 | 420 | 390 | 15,755 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 6.2500 | 2026/10/30 | 330 | 352 | 14,212 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 2.0000 | 2027/03/31 | 560 | 534 | 21,574 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 2.2500 | 2028/09/28 | 520 | 482 | 19,454 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 3.7500 | 2029/02/28 | 180 | 181 | 7,327 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.0000 | 2030/03/31 | 530 | 442 | 17,831 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.3000 | 2032/04/30 | 360 | 288 | 11,615 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.5000 | 2037/05/31 | 480 | 333 | 13,460 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 5.5000 | 2042/01/31 | 430 | 489 | 19,733 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 3.7500 | 2047/03/31 | 560 | 486 | 19,604 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 2.8000 | 2052/11/29 | 190 | 132 | 5,350 |
| | 小計 | | - | - | - | - |
| デンマーク | | | | 千デンマーク・クローネ | 千デンマーク・クローネ | |
| 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK | 0.0000 | 2024/11/15 | 1,400 | 1,355 | 29,717 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 1.7500 | 2025/11/15 | 1,370 | 1,338 | 29,348 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.5000 | 2027/11/15 | 1,450 | 1,333 | 29,244 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.5000 | 2029/11/15 | 1,250 | 1,102 | 24,172 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.0000 | 2031/11/15 | 1,550 | 1,251 | 27,439 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 2.2500 | 2033/11/15 | 640 | 608 | 13,340 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 4.5000 | 2039/11/15 | 2,330 | 2,778 | 60,925 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.2500 | 2052/11/15 | 1,270 | 620 | 13,610 |
| | 小計 | | - | - | - | - |
| 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 | 1.7500 | 2025/03/13 | 1,350 | 1,310 | 18,175 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2026/02/19 | 1,070 | 1,015 | 14,089 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2027/02/17 | 1,060 | 994 | 13,797 |

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 |
| ノルウェー | | % | | 千円 | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0000 | 2028/04/26 | 850 | 792 | 10,986 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2029/09/06 | 940 | 848 | 11,770 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.3750 | 2030/08/19 | 1,240 | 1,074 | 14,901 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2031/09/17 | 880 | 739 | 10,252 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.1250 | 2032/05/18 | 920 | 819 | 11,360 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2033/08/15 | 1,020 | 965 | 13,394 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.5000 | 2042/10/06 | 440 | 446 | 6,197 |
| 小計 | | - | - | - | - | 124,924 |
| スウェーデン | | | | 千円 | 千円 | |
| 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT | 2.5000 | 2025/05/12 | 1,780 | 1,758 | 25,055 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.0000 | 2026/11/12 | 1,850 | 1,752 | 24,967 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.7500 | 2028/05/12 | 1,610 | 1,480 | 21,091 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.7500 | 2029/11/12 | 1,530 | 1,373 | 19,575 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.1250 | 2031/05/12 | 1,220 | 1,016 | 14,482 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 2.2500 | 2032/06/01 | 1,110 | 1,077 | 15,348 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.7500 | 2033/11/11 | 830 | 765 | 10,910 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5000 | 2039/03/30 | 960 | 1,045 | 14,894 |
| 小計 | | - | - | - | - | 146,325 |
| メキシコ | | | | 千円 | 千円 | |
| 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0000 | 2024/12/05 | 4,840 | 4,801 | 41,794 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.0000 | 2025/03/06 | 3,200 | 3,006 | 26,170 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.7500 | 2026/03/05 | 9,850 | 9,047 | 78,754 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.0000 | 2026/09/03 | 2,000 | 1,872 | 16,303 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.5000 | 2027/03/04 | 8,020 | 7,122 | 61,997 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5000 | 2027/06/03 | 7,620 | 7,158 | 62,313 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2029/03/01 | 1,050 | 1,016 | 8,846 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2029/05/31 | 6,240 | 6,023 | 52,433 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500 | 2031/05/29 | 9,310 | 8,503 | 74,020 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5000 | 2033/05/26 | 4,950 | 4,363 | 37,979 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500 | 2034/11/23 | 2,120 | 1,883 | 16,392 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000 | 2035/05/24 | 600 | 542 | 4,720 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0000 | 2036/11/20 | 1,650 | 1,721 | 14,983 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2038/11/18 | 4,810 | 4,418 | 38,463 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500 | 2042/11/13 | 6,670 | 5,632 | 49,023 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000 | 2047/11/07 | 5,840 | 5,007 | 43,589 |
| MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000 | 2053/07/31 | 3,500 | 2,984 | 25,974 | |
| 小計 | | - | - | - | - | 653,762 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|----|-----------------------|--------|------------|--------|--------|---------|
| | | | | | 千人民元 | 千円 |
| 中国 | | % | | 千人民元 | 千人民元 | 千円 |
| | 国債証券 | | | | | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.2900 | 2024/12/25 | 14,000 | 14,001 | 290,638 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.3500 | 2025/03/15 | 3,000 | 3,000 | 62,281 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.2400 | 2025/05/25 | 5,500 | 5,489 | 113,946 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.0000 | 2025/06/15 | 6,000 | 5,969 | 123,907 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.1800 | 2025/08/25 | 8,300 | 8,280 | 171,886 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.2200 | 2025/09/25 | 4,000 | 3,992 | 82,877 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.2800 | 2025/11/25 | 7,500 | 7,487 | 155,418 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.4600 | 2026/02/15 | 7,000 | 7,014 | 145,612 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.0300 | 2026/03/11 | 1,200 | 1,221 | 25,353 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.3000 | 2026/05/15 | 17,600 | 17,587 | 365,081 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6900 | 2026/08/12 | 4,400 | 4,437 | 92,112 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.1800 | 2026/08/15 | 1,500 | 1,491 | 30,966 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.3700 | 2027/01/20 | 3,200 | 3,196 | 66,345 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.4800 | 2027/04/15 | 6,700 | 6,703 | 139,159 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2027/07/25 | 4,800 | 4,807 | 99,791 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.4400 | 2027/10/15 | 10,300 | 10,287 | 213,546 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6400 | 2028/01/15 | 4,400 | 4,432 | 92,017 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6200 | 2028/04/15 | 10,200 | 10,261 | 213,008 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.0100 | 2028/05/13 | 720 | 737 | 15,300 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.4000 | 2028/07/15 | 11,300 | 11,255 | 233,650 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.9100 | 2028/10/14 | 5,400 | 5,498 | 114,132 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8000 | 2029/03/24 | 3,600 | 3,646 | 75,685 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2029/06/15 | 4,500 | 4,535 | 94,158 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6200 | 2029/09/25 | 5,300 | 5,302 | 110,064 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7900 | 2029/12/15 | 6,900 | 6,964 | 144,562 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8000 | 2030/03/25 | 8,400 | 8,480 | 176,046 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6200 | 2030/06/25 | 7,400 | 7,394 | 153,486 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6000 | 2030/09/15 | 4,000 | 3,989 | 82,823 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.0200 | 2031/05/27 | 1,000 | 1,028 | 21,354 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8900 | 2031/11/18 | 3,340 | 3,394 | 70,463 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2032/02/17 | 2,600 | 2,613 | 54,260 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.7600 | 2032/05/15 | 4,100 | 4,130 | 85,743 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6900 | 2032/08/15 | 1,000 | 1,001 | 20,793 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6000 | 2032/09/01 | 3,500 | 3,477 | 72,192 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8000 | 2032/11/15 | 5,700 | 5,763 | 119,641 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8800 | 2033/02/25 | 4,100 | 4,186 | 86,912 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6700 | 2033/05/25 | 7,900 | 7,899 | 163,983 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.5200 | 2033/08/25 | 6,400 | 6,334 | 131,485 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------|-----------------------|--------|------------|--------------|--------------|-----------|
| | | | | | 千人民元 | 千円 |
| 中国 | | % | | 千人民元 | 千人民元 | 千円 |
| 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.8100 | 2050/09/14 | 1,200 | 1,372 | 28,486 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.7200 | 2051/04/12 | 1,260 | 1,419 | 29,469 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.5300 | 2051/10/18 | 3,650 | 4,006 | 83,162 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.3200 | 2052/04/15 | 5,400 | 5,704 | 118,408 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.1200 | 2052/10/25 | 5,800 | 5,887 | 122,208 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.1900 | 2053/04/15 | 7,900 | 8,262 | 171,521 |
| 小計 | | - | - | - | - | 5,063,949 |
| 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 | 3.8820 | 2025/03/14 | 340 | 342 | 10,960 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.9550 | 2025/09/15 | 680 | 685 | 21,947 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.3920 | 2026/04/15 | 360 | 366 | 11,742 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.9060 | 2026/07/15 | 250 | 252 | 8,083 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.9000 | 2026/11/30 | 370 | 373 | 11,943 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8920 | 2027/03/15 | 610 | 615 | 19,705 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8990 | 2027/11/16 | 530 | 535 | 17,133 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.7330 | 2028/06/15 | 550 | 550 | 17,615 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.5040 | 2029/04/30 | 160 | 165 | 5,283 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8850 | 2029/08/15 | 440 | 440 | 14,109 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.4980 | 2030/04/15 | 490 | 507 | 16,250 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 2.6320 | 2031/04/15 | 340 | 312 | 9,995 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.2320 | 2031/06/30 | 380 | 387 | 12,399 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.5820 | 2032/07/15 | 390 | 379 | 12,138 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8440 | 2033/04/15 | 410 | 408 | 13,065 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.6420 | 2033/11/07 | 340 | 361 | 11,583 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8280 | 2034/07/05 | 460 | 451 | 14,470 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.2540 | 2035/05/31 | 320 | 326 | 10,447 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.7620 | 2037/04/07 | 590 | 630 | 20,198 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.8930 | 2038/06/08 | 500 | 545 | 17,480 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.7570 | 2040/05/22 | 540 | 507 | 16,259 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.6960 | 2042/10/15 | 420 | 445 | 14,255 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.9350 | 2043/09/30 | 190 | 206 | 6,603 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.7360 | 2046/03/15 | 240 | 252 | 8,078 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.9210 | 2048/07/06 | 360 | 389 | 12,460 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.0650 | 2050/06/15 | 610 | 579 | 18,555 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.4570 | 2053/03/31 | 240 | 244 | 7,825 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.5020 | 2027/05/31 | 340 | 338 | 10,840 |
| 小計 | | - | - | - | - | 371,431 |

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 | |
|-------------------------|--------|------------|----------|----------|--------|---------|
| | | | 千ポランド・ズチ | 千ポランド・ズチ | 邦貨換算金額 | |
| | % | | | | | 千円 |
| ポーランド | | | | | | |
| 国債証券 | | | | | | |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 0.7500 | 2025/04/25 | 770 | 723 | | 26,960 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 3.2500 | 2025/07/25 | 1,030 | 997 | | 37,162 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2026/07/25 | 1,200 | 1,120 | | 41,767 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 0.2500 | 2026/10/25 | 730 | 634 | | 23,642 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 3.7500 | 2027/05/25 | 730 | 696 | | 25,973 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2027/07/25 | 710 | 647 | | 24,123 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2028/04/25 | 820 | 741 | | 27,639 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 7.5000 | 2028/07/25 | 930 | 1,013 | | 37,755 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 5.7500 | 2029/04/25 | 570 | 581 | | 21,660 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2029/10/25 | 1,040 | 911 | | 33,983 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 1.2500 | 2030/10/25 | 880 | 680 | | 25,371 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 1.7500 | 2032/04/25 | 800 | 604 | | 22,532 |
| POLAND GOVERNMENT BOND | 6.0000 | 2033/10/25 | 450 | 467 | | 17,434 |
| 小計 | | | - | - | | 366,007 |
| ユーロ | | | | | | |
| | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| アイルランド | | | | | | |
| 国債証券 | | | | | | |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 5.4000 | 2025/03/13 | 250 | 257 | | 42,057 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.0000 | 2026/05/15 | 250 | 238 | | 39,011 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.2000 | 2027/05/15 | 170 | 155 | | 25,389 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.9000 | 2028/05/15 | 180 | 165 | | 27,101 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.1000 | 2029/05/15 | 210 | 191 | | 31,343 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 2.4000 | 2030/05/15 | 210 | 203 | | 33,346 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.2000 | 2030/10/18 | 180 | 149 | | 24,518 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.3500 | 2031/03/18 | 150 | 134 | | 22,071 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2031/10/18 | 200 | 159 | | 26,077 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.3000 | 2033/05/15 | 120 | 103 | | 16,905 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.4000 | 2035/05/15 | 120 | 88 | | 14,550 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.7000 | 2037/05/15 | 170 | 140 | | 23,046 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.5500 | 2041/04/22 | 90 | 56 | | 9,320 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 3.0000 | 2043/10/18 | 80 | 76 | | 12,558 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 2.0000 | 2045/02/18 | 240 | 187 | | 30,657 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 1.5000 | 2050/05/15 | 200 | 132 | | 21,596 |
| IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.3500 | 2032/10/18 | 110 | 87 | | 14,358 |
| 小計 | | | - | - | | 413,911 |
| オランダ | | | | | | |
| 国債証券 | | | | | | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.2500 | 2025/07/15 | 440 | 420 | | 68,705 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2026/01/15 | 300 | 281 | | 46,069 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5000 | 2026/07/15 | 420 | 394 | | 64,586 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | | |
|-------------|------------------------|--------|------------|------|-----|-----------|
| | | | | 千ユーロ | 千円 | |
| ユーロ | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| オランダ | | | | | | |
| 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2027/01/15 | 350 | 320 | 52,487 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.7500 | 2027/07/15 | 370 | 344 | 56,339 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5000 | 2028/01/15 | 290 | 320 | 52,437 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.7500 | 2028/07/15 | 430 | 393 | 64,299 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2029/01/15 | 270 | 234 | 38,414 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.2500 | 2029/07/15 | 270 | 235 | 38,480 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5000 | 2030/01/15 | 170 | 167 | 27,371 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2030/07/15 | 310 | 258 | 42,316 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2031/07/15 | 330 | 267 | 43,711 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5000 | 2032/07/15 | 300 | 246 | 40,351 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5000 | 2033/01/15 | 350 | 340 | 55,633 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5000 | 2033/07/15 | 250 | 241 | 39,497 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0000 | 2037/01/15 | 390 | 430 | 70,394 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2038/01/15 | 230 | 149 | 24,510 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5000 | 2040/01/15 | 350 | 237 | 38,829 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.7500 | 2042/01/15 | 410 | 448 | 73,345 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.2500 | 2044/01/15 | 100 | 103 | 16,844 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.7500 | 2047/01/15 | 450 | 429 | 70,276 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2052/01/15 | 390 | 172 | 28,257 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0000 | 2054/01/15 | 190 | 152 | 24,858 |
| 小計 | | | | | | 1,078,018 |
| ベルギー | | | | | | |
| 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | 0.8000 | 2025/06/22 | 490 | 472 | 77,232 |
| | BELGIUM KINGDOM | 4.5000 | 2026/03/28 | 270 | 279 | 45,655 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.0000 | 2026/06/22 | 350 | 333 | 54,505 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.8000 | 2027/06/22 | 360 | 335 | 54,813 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.0000 | 2027/10/22 | 240 | 214 | 35,153 |
| | BELGIUM KINGDOM | 5.5000 | 2028/03/28 | 460 | 510 | 83,443 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.8000 | 2028/06/22 | 380 | 347 | 56,828 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.9000 | 2029/06/22 | 420 | 378 | 61,822 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.1000 | 2030/06/22 | 310 | 257 | 42,191 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.0000 | 2031/06/22 | 380 | 328 | 53,701 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.0000 | 2031/10/22 | 310 | 244 | 39,919 |
| | BELGIUM KINGDOM | 4.0000 | 2032/03/28 | 200 | 213 | 34,918 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.3500 | 2032/06/22 | 360 | 285 | 46,730 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.2500 | 2033/04/22 | 240 | 203 | 33,320 |
| | BELGIUM KINGDOM | 3.0000 | 2033/06/22 | 390 | 384 | 62,803 |

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 | 3.0000 | 2034/06/22 | 210 | 205 | 33,592 |
| | BELGIUM KINGDOM | 5.0000 | 2035/03/28 | 440 | 509 | 83,244 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.4500 | 2037/06/22 | 150 | 118 | 19,304 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.9000 | 2038/06/22 | 190 | 155 | 25,471 |
| | BELGIUM KINGDOM | 2.7500 | 2039/04/22 | 120 | 109 | 17,844 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.4000 | 2040/06/22 | 200 | 121 | 19,857 |
| | BELGIUM KINGDOM | 4.2500 | 2041/03/28 | 370 | 402 | 65,744 |
| | BELGIUM KINGDOM | 3.4500 | 2043/06/22 | 90 | 87 | 14,298 |
| | BELGIUM KINGDOM | 3.7500 | 2045/06/22 | 220 | 223 | 36,494 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.6000 | 2047/06/22 | 240 | 162 | 26,573 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.7000 | 2050/06/22 | 250 | 166 | 27,238 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.4000 | 2053/06/22 | 240 | 142 | 23,237 |
| | BELGIUM KINGDOM | 3.3000 | 2054/06/22 | 210 | 192 | 31,539 |
| | BELGIUM KINGDOM | 2.2500 | 2057/06/22 | 160 | 117 | 19,136 |
| | BELGIUM KINGDOM | 2.1500 | 2066/06/22 | 200 | 139 | 22,819 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.6500 | 2071/06/22 | 140 | 53 | 8,744 |
| 小計 | | | | | | |
| | | - | - | - | - | 1,258,182 |
| フランス | | | | | | |
| 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 1.7500 | 2024/11/25 | 800 | 786 | 128,581 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2025/02/25 | 700 | 671 | 109,881 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2025/03/25 | 1,070 | 1,025 | 167,654 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2025/05/25 | 1,020 | 980 | 160,341 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 6.0000 | 2025/10/25 | 630 | 664 | 108,637 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.0000 | 2025/11/25 | 830 | 797 | 130,418 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2026/02/25 | 1,010 | 944 | 154,543 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 3.5000 | 2026/04/25 | 980 | 991 | 162,227 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2026/05/25 | 1,110 | 1,044 | 170,840 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.5000 | 2026/09/24 | 930 | 918 | 150,207 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.2500 | 2026/11/25 | 880 | 813 | 133,039 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2027/02/25 | 900 | 820 | 134,117 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.0000 | 2027/05/25 | 900 | 844 | 138,066 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.7500 | 2027/10/25 | 1,230 | 1,224 | 200,299 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2028/02/25 | 1,010 | 925 | 151,289 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2028/05/25 | 1,380 | 1,258 | 205,779 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2028/11/25 | 1,310 | 1,182 | 193,417 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.7500 | 2029/02/25 | 610 | 605 | 99,034 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 5.5000 | 2029/04/25 | 880 | 993 | 162,434 |

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 | |
|------|-------------------|--------|------------|-------|-------|-----------|
| | | | | | 千ユーロ | 千円 |
| ユーロ | | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| フランス | | | | | | |
| 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2029/05/25 | 1,220 | 1,074 | 175,794 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2029/11/25 | 1,050 | 885 | 144,796 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.5000 | 2030/05/25 | 1,340 | 1,308 | 214,013 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2030/11/25 | 1,270 | 1,037 | 169,610 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.5000 | 2031/05/25 | 1,340 | 1,211 | 198,169 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2031/11/25 | 1,160 | 916 | 149,811 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2032/05/25 | 780 | 605 | 98,991 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 5.7500 | 2032/10/25 | 780 | 941 | 154,033 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.0000 | 2032/11/25 | 1,000 | 917 | 150,057 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 3.0000 | 2033/05/25 | 830 | 823 | 134,625 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 3.5000 | 2033/11/25 | 140 | 144 | 23,582 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.2500 | 2034/05/25 | 980 | 812 | 132,943 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.7500 | 2035/04/25 | 640 | 730 | 119,542 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.2500 | 2036/05/25 | 1,030 | 814 | 133,175 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.2500 | 2038/05/25 | 370 | 278 | 45,576 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.0000 | 2038/10/25 | 590 | 630 | 103,165 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.7500 | 2039/06/25 | 730 | 585 | 95,821 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2040/05/25 | 560 | 352 | 57,714 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.5000 | 2041/04/25 | 840 | 950 | 155,508 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.5000 | 2043/05/25 | 280 | 238 | 38,991 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2044/06/25 | 430 | 241 | 39,419 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 3.2500 | 2045/05/25 | 670 | 639 | 104,562 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.0000 | 2048/05/25 | 660 | 491 | 80,325 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.5000 | 2050/05/25 | 720 | 465 | 76,069 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2052/05/25 | 730 | 364 | 59,576 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2053/05/25 | 690 | 336 | 55,024 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 3.0000 | 2054/05/25 | 400 | 352 | 57,587 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.0000 | 2055/04/25 | 440 | 469 | 76,715 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.0000 | 2060/04/25 | 440 | 472 | 77,260 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.7500 | 2066/05/25 | 370 | 230 | 37,684 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2072/05/25 | 260 | 90 | 14,825 |
| 小計 | | - | - | - | - | 6,035,786 |
| ドイツ | | | | | | |
| 国債証券 | BUNDES Obligation | 0.0000 | 2025/04/11 | 480 | 459 | 75,155 |
| | BUNDES Obligation | 0.0000 | 2025/10/10 | 160 | 151 | 24,783 |
| | BUNDES Obligation | 0.0000 | 2025/10/10 | 610 | 577 | 94,372 |
| | BUNDES Obligation | 0.0000 | 2026/04/10 | 610 | 571 | 93,409 |

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 | 2026/10/09 | 530 | 490 | 80,240 |
| BUNDESobligation | 0.0000 | 2027/04/16 | 490 | 448 | 73,393 |
| BUNDESobligation | 1.3000 | 2027/10/15 | 190 | 181 | 29,677 |
| BUNDESobligation | 1.3000 | 2027/10/15 | 650 | 620 | 101,478 |
| BUNDESobligation | 2.2000 | 2028/04/13 | 550 | 542 | 88,675 |
| BUNDESobligation | 2.4000 | 2028/10/19 | 500 | 497 | 81,300 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5000 | 2025/02/15 | 680 | 657 | 107,560 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0000 | 2025/08/15 | 640 | 618 | 101,097 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5000 | 2026/02/15 | 750 | 712 | 116,481 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2026/08/15 | 720 | 669 | 109,434 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.2500 | 2027/02/15 | 650 | 602 | 98,554 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5000 | 2027/08/15 | 720 | 668 | 109,259 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2027/11/15 | 490 | 443 | 72,536 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5000 | 2028/02/15 | 640 | 588 | 96,305 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.2500 | 2028/08/15 | 630 | 567 | 92,882 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2028/11/15 | 600 | 531 | 86,882 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.2500 | 2029/02/15 | 620 | 553 | 90,526 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2029/08/15 | 650 | 565 | 92,491 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.1000 | 2029/11/15 | 570 | 557 | 91,194 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.2500 | 2030/01/04 | 260 | 315 | 51,549 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2030/02/15 | 610 | 524 | 85,774 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2030/08/15 | 210 | 178 | 29,213 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2030/08/15 | 720 | 611 | 100,028 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.4000 | 2030/11/15 | 180 | 178 | 29,214 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2031/02/15 | 620 | 519 | 84,984 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2031/08/15 | 200 | 165 | 27,074 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2031/08/15 | 710 | 587 | 96,097 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2032/02/15 | 670 | 546 | 89,407 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.7000 | 2032/08/15 | 620 | 580 | 94,942 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.3000 | 2033/02/15 | 140 | 137 | 22,449 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.3000 | 2033/02/15 | 850 | 833 | 136,235 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.6000 | 2033/08/15 | 480 | 480 | 78,605 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.7500 | 2034/07/04 | 540 | 645 | 105,497 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2035/05/15 | 500 | 369 | 60,360 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2036/05/15 | 570 | 407 | 66,656 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0000 | 2037/01/04 | 610 | 693 | 113,353 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0000 | 2038/05/15 | 450 | 354 | 58,006 |

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 | 4.2500 | 2039/07/04 | 420 | 495 | 81,043 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.7500 | 2040/07/04 | 470 | 589 | 96,451 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.2500 | 2042/07/04 | 420 | 444 | 72,686 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5000 | 2044/07/04 | 660 | 626 | 102,415 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5000 | 2046/08/15 | 690 | 653 | 106,927 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.2500 | 2048/08/15 | 810 | 590 | 96,604 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2050/08/15 | 220 | 107 | 17,540 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2050/08/15 | 870 | 421 | 68,995 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2052/08/15 | 600 | 275 | 45,023 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.8000 | 2053/08/15 | 100 | 80 | 13,118 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.8000 | 2053/08/15 | 530 | 424 | 69,379 |
| | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 2.2000 | 2024/12/12 | 190 | 187 | 30,690 |
| | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 2.5000 | 2025/03/13 | 390 | 386 | 63,179 |
| | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 2.8000 | 2025/06/12 | 400 | 397 | 65,051 |
| | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 3.1000 | 2025/09/18 | 370 | 370 | 60,554 |
| | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 3.1000 | 2025/12/12 | 50 | 50 | 8,200 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5000 | 2027/07/04 | 300 | 339 | 55,485 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.6250 | 2028/01/04 | 380 | 425 | 69,556 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.7500 | 2028/07/04 | 300 | 328 | 53,796 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5000 | 2031/01/04 | 480 | 573 | 93,717 |
| 小計 | | - | - | - | - | 4,607,563 |
| スペイン | | | | | | |
| 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7500 | 2024/10/31 | 510 | 505 | 82,735 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2025/01/31 | 480 | 460 | 75,378 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.6000 | 2025/04/30 | 490 | 477 | 78,122 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2025/05/31 | 530 | 503 | 82,370 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.6500 | 2025/07/30 | 430 | 439 | 71,833 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.1500 | 2025/10/31 | 600 | 588 | 96,217 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2026/01/31 | 470 | 438 | 71,697 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.9500 | 2026/04/30 | 510 | 495 | 81,001 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.8000 | 2026/05/31 | 480 | 475 | 77,709 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9000 | 2026/07/30 | 530 | 566 | 92,582 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.3000 | 2026/10/31 | 620 | 588 | 96,179 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2027/01/31 | 480 | 434 | 71,051 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.5000 | 2027/04/30 | 570 | 539 | 88,257 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8000 | 2027/07/30 | 510 | 468 | 76,647 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4500 | 2027/10/31 | 560 | 525 | 85,895 |

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 | 0.0000 | 2028/01/31 | 600 | 526 | 86,146 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4000 | 2028/04/30 | 620 | 575 | 94,126 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4000 | 2028/07/30 | 540 | 499 | 81,658 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.1500 | 2028/10/31 | 450 | 490 | 80,192 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 6.0000 | 2029/01/31 | 590 | 668 | 109,392 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4500 | 2029/04/30 | 470 | 429 | 70,280 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.5000 | 2029/05/31 | 80 | 81 | 13,262 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8000 | 2029/07/30 | 590 | 516 | 84,472 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.6000 | 2029/10/31 | 540 | 464 | 75,930 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5000 | 2030/04/30 | 550 | 463 | 75,763 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.9500 | 2030/07/30 | 530 | 488 | 79,884 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.2500 | 2030/10/31 | 540 | 472 | 77,261 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.1000 | 2031/04/30 | 540 | 426 | 69,755 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5000 | 2031/10/31 | 490 | 392 | 64,259 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.7000 | 2032/04/30 | 520 | 417 | 68,280 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.7500 | 2032/07/30 | 540 | 633 | 103,593 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.5500 | 2032/10/31 | 500 | 464 | 76,032 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.1500 | 2033/04/30 | 540 | 523 | 85,609 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.3500 | 2033/07/30 | 440 | 397 | 65,025 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.5500 | 2033/10/31 | 480 | 478 | 78,258 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.8500 | 2035/07/30 | 490 | 404 | 66,173 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.2000 | 2037/01/31 | 500 | 520 | 85,104 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8500 | 2037/07/30 | 320 | 218 | 35,706 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.9000 | 2039/07/30 | 190 | 187 | 30,725 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9000 | 2040/07/30 | 450 | 498 | 81,455 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.2000 | 2040/10/31 | 440 | 289 | 47,289 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7000 | 2041/07/30 | 470 | 510 | 83,539 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0000 | 2042/07/30 | 230 | 139 | 22,775 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.4500 | 2043/07/30 | 210 | 191 | 31,325 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.1500 | 2044/10/31 | 350 | 402 | 65,787 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.9000 | 2046/10/31 | 440 | 361 | 59,166 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7000 | 2048/10/31 | 400 | 311 | 50,972 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0000 | 2050/10/31 | 500 | 248 | 40,707 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.9000 | 2052/10/31 | 370 | 228 | 37,414 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.4500 | 2066/07/30 | 320 | 268 | 43,965 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4500 | 2071/10/31 | 170 | 74 | 12,236 |
| 小計 | - | - | - | - | 3,561,212 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|--------------------------|--------|------------|------|------|---------|
| | | | | 千ユーロ | 千円 |
| ユーロ | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| イタリア | | | | | |
| 国債証券 | | | | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.4500 | 2024/11/15 | 360 | 352 | 57,649 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5000 | 2024/12/01 | 500 | 494 | 80,875 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.0000 | 2024/12/15 | 350 | 337 | 55,113 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.3500 | 2025/02/01 | 460 | 442 | 72,404 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2025/03/01 | 480 | 488 | 79,861 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.4000 | 2025/03/28 | 400 | 398 | 65,211 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.4500 | 2025/05/15 | 370 | 359 | 58,723 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5000 | 2025/06/01 | 470 | 455 | 74,536 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.8500 | 2025/07/01 | 410 | 399 | 65,291 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.2000 | 2025/08/15 | 360 | 345 | 56,578 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.6000 | 2025/09/29 | 220 | 220 | 36,013 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5000 | 2025/11/15 | 430 | 422 | 69,060 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0000 | 2025/12/01 | 440 | 427 | 69,904 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5000 | 2026/01/15 | 380 | 380 | 62,186 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.5000 | 2026/02/01 | 460 | 431 | 70,510 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5000 | 2026/03/01 | 460 | 469 | 76,833 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.0000 | 2026/04/01 | 480 | 442 | 72,355 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8000 | 2026/04/15 | 350 | 352 | 57,656 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.6000 | 2026/06/01 | 500 | 477 | 78,087 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1000 | 2026/07/15 | 390 | 376 | 61,559 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.0000 | 2026/08/01 | 440 | 400 | 65,569 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8500 | 2026/09/15 | 190 | 191 | 31,345 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.2500 | 2026/12/01 | 460 | 430 | 70,440 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.8500 | 2027/01/15 | 440 | 405 | 66,328 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.1000 | 2027/04/01 | 320 | 295 | 48,374 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.2000 | 2027/06/01 | 410 | 392 | 64,148 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0500 | 2027/08/01 | 430 | 408 | 66,755 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2027/09/15 | 480 | 435 | 71,302 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5000 | 2027/11/01 | 600 | 664 | 108,634 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.6500 | 2027/12/01 | 400 | 386 | 63,163 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0000 | 2028/02/01 | 530 | 497 | 81,382 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.2500 | 2028/03/15 | 410 | 355 | 58,153 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.4000 | 2028/04/01 | 400 | 396 | 64,858 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.5000 | 2028/07/15 | 360 | 312 | 51,074 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8000 | 2028/08/01 | 370 | 372 | 60,851 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.7500 | 2028/09/01 | 550 | 576 | 94,277 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8000 | 2028/12/01 | 500 | 480 | 78,565 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|--------------------------|--------|------------|------|------|---------|
| | | | | 千ユーロ | 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 | 4.1000 | 2029/02/01 | 100 | 101 | 16,623 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.4500 | 2029/02/15 | 360 | 304 | 49,813 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8000 | 2029/06/15 | 350 | 333 | 54,465 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.0000 | 2029/08/01 | 510 | 490 | 80,215 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.2500 | 2029/11/01 | 680 | 732 | 119,854 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8500 | 2029/12/15 | 410 | 410 | 67,080 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5000 | 2030/03/01 | 600 | 589 | 96,390 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.3500 | 2030/04/01 | 500 | 430 | 70,328 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.7000 | 2030/06/15 | 310 | 306 | 50,091 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2030/08/01 | 420 | 347 | 56,850 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0000 | 2030/11/15 | 120 | 120 | 19,677 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.6500 | 2030/12/01 | 520 | 447 | 73,154 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9000 | 2031/04/01 | 540 | 435 | 71,213 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0000 | 2031/05/01 | 700 | 792 | 129,648 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.6000 | 2031/08/01 | 470 | 365 | 59,750 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0000 | 2031/10/30 | 220 | 219 | 35,947 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2031/12/01 | 460 | 363 | 59,493 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.6500 | 2032/03/01 | 550 | 458 | 74,952 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2032/06/01 | 460 | 357 | 58,463 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5000 | 2032/12/01 | 400 | 351 | 57,470 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.7500 | 2033/02/01 | 540 | 605 | 98,958 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.4000 | 2033/05/01 | 470 | 477 | 78,152 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.4500 | 2033/09/01 | 440 | 378 | 61,949 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.3500 | 2033/11/01 | 440 | 443 | 72,540 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.2000 | 2034/03/01 | 160 | 158 | 25,951 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2034/08/01 | 590 | 623 | 101,928 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.3500 | 2035/03/01 | 350 | 317 | 51,923 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0000 | 2035/04/30 | 250 | 241 | 39,539 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.4500 | 2036/03/01 | 290 | 208 | 34,108 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.2500 | 2036/09/01 | 380 | 298 | 48,865 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0000 | 2037/02/01 | 690 | 657 | 107,509 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2037/03/01 | 380 | 247 | 40,452 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.2500 | 2038/03/01 | 230 | 198 | 32,391 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.9500 | 2038/09/01 | 330 | 273 | 44,661 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2039/08/01 | 560 | 582 | 95,259 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.1000 | 2040/03/01 | 320 | 264 | 43,204 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2040/09/01 | 510 | 529 | 86,618 |

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 | 1.8000 | 2041/03/01 | 340 | 226 | 37,035 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.4500 | 2043/09/01 | 200 | 192 | 31,507 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.7500 | 2044/09/01 | 410 | 411 | 67,283 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5000 | 2045/04/30 | 300 | 174 | 28,507 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.2500 | 2046/09/01 | 390 | 313 | 51,210 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.7000 | 2047/03/01 | 420 | 305 | 49,946 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.4500 | 2048/03/01 | 400 | 329 | 53,940 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8500 | 2049/09/01 | 340 | 296 | 48,515 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.4500 | 2050/09/01 | 320 | 213 | 34,948 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.7000 | 2051/09/01 | 330 | 183 | 30,075 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1500 | 2052/09/01 | 200 | 121 | 19,856 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5000 | 2053/10/01 | 180 | 171 | 28,075 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8000 | 2067/03/01 | 210 | 138 | 22,650 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1500 | 2072/03/01 | 110 | 60 | 9,815 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.2500 | 2026/11/01 | 220 | 242 | 39,702 |
| 小計 | | - | - | - | - | 5,384,213 |
| フィンランド | | | | | | |
| 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | 4.0000 | 2025/07/04 | 100 | 101 | 16,554 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.8750 | 2025/09/15 | 140 | 134 | 22,012 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.5000 | 2026/04/15 | 140 | 132 | 21,638 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.0000 | 2026/09/15 | 90 | 82 | 13,567 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1.3750 | 2027/04/15 | 100 | 95 | 15,555 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.5000 | 2027/09/15 | 150 | 137 | 22,463 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2.7500 | 2028/07/04 | 120 | 119 | 19,533 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.5000 | 2028/09/15 | 150 | 133 | 21,902 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2.8750 | 2029/04/15 | 70 | 69 | 11,427 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.5000 | 2029/09/15 | 150 | 130 | 21,423 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.0000 | 2030/09/15 | 130 | 106 | 17,415 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.7500 | 2031/04/15 | 110 | 93 | 15,358 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.1250 | 2031/09/15 | 140 | 112 | 18,326 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1.5000 | 2032/09/15 | 130 | 114 | 18,707 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 3.0000 | 2033/09/15 | 110 | 108 | 17,794 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1.1250 | 2034/04/15 | 100 | 82 | 13,449 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.1250 | 2036/04/15 | 110 | 74 | 12,253 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2.7500 | 2038/04/15 | 90 | 83 | 13,689 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.2500 | 2040/09/15 | 90 | 54 | 8,925 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2.6250 | 2042/07/04 | 120 | 108 | 17,700 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | | |
|--------|---------------------|--------|------------|------|-----|------------|
| | | | | 千ユーロ | 千円 | |
| ユーロ | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フィンランド | | | | | | |
| 国債証券 | | | | | | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.5000 | 2043/04/15 | 100 | 59 | 9,736 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1.3750 | 2047/04/15 | 130 | 89 | 14,703 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.1250 | 2052/04/15 | 100 | 43 | 7,039 |
| | 小計 | - | - | - | - | 371,179 |
| オーストリア | | | | | | |
| 国債証券 | | | | | | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2025/04/20 | 200 | 191 | 31,264 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.2000 | 2025/10/20 | 290 | 280 | 45,806 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.8500 | 2026/03/15 | 190 | 197 | 32,321 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.0000 | 2026/07/15 | 130 | 126 | 20,741 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7500 | 2026/10/20 | 330 | 309 | 50,691 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.5000 | 2027/04/20 | 320 | 295 | 48,291 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.2500 | 2027/07/15 | 210 | 234 | 38,269 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7500 | 2028/02/20 | 280 | 256 | 41,921 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2028/10/20 | 180 | 156 | 25,535 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.5000 | 2029/02/20 | 300 | 264 | 43,327 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.9000 | 2029/05/23 | 70 | 69 | 11,447 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2030/02/20 | 300 | 249 | 40,787 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.4500 | 2030/10/20 | 90 | 92 | 15,094 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2031/02/20 | 330 | 265 | 43,410 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.9000 | 2032/02/20 | 270 | 227 | 37,167 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.9000 | 2033/02/20 | 280 | 274 | 44,903 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.4000 | 2034/05/23 | 210 | 195 | 31,955 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.2500 | 2036/10/20 | 150 | 102 | 16,733 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.1500 | 2037/03/15 | 340 | 369 | 60,449 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2040/10/20 | 140 | 80 | 13,102 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.1500 | 2044/06/20 | 190 | 183 | 30,021 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5000 | 2047/02/20 | 220 | 153 | 25,104 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.8500 | 2049/05/23 | 110 | 81 | 13,280 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7500 | 2051/03/20 | 210 | 112 | 18,472 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.1500 | 2053/10/20 | 80 | 75 | 12,401 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.8000 | 2062/01/26 | 100 | 108 | 17,714 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7000 | 2071/04/20 | 80 | 32 | 5,378 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5000 | 2086/11/02 | 60 | 33 | 5,397 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.1000 | 2117/09/20 | 130 | 88 | 14,531 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.8500 | 2120/06/30 | 100 | 41 | 6,801 |
| | 小計 | - | - | - | - | 842,327 |
| | ユーロ小計 | - | - | - | - | 23,552,394 |
| | 合計 | - | - | - | - | 71,335,288 |

投資信託財産の構成

2023年11月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 71,335,288 | 98.5 |
| コール・ローン等、その他 | 1,073,573 | 1.5 |
| 投資信託財産総額 | 72,408,861 | 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149.95円、1カナダ・ドル109.25円、1オーストラリア・ドル97.57円、1シンガポール・ドル111.57円、1ニュージーランド・ドル89.96円、1イギリス・ポンド186.69円、1イスラエル・シケル40.328円、1デンマーク・クローネ21.93円、1ノルウェー・クローネ13.87円、1スウェーデン・クローナ14.25円、1メキシコ・ペソ8,704円、1人民元20,758円、1マレーシア・リンギット32,015円、1ポーランド・ズロチ37,264円、1ユーロ163.54円です。

(注2) 外貨建純資産（72,065,479千円）の投資信託財産総額（72,408,861千円）に対する比率は99.5%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

| 項目 | 当期末 |
|----------------------|------------------------|
| (A)資産 | 72,444,606,071円 |
| コーポレート債(評価額) | 605,236,430 |
| 未収入金 | 71,335,288,110 |
| 未収利息 | 36,295,942 |
| 前払費用 | 429,300,020 |
| | 38,485,569 |
| (B)負債 | 323,415,867 |
| 未払金 | 177,113,599 |
| 未払解約金 | 146,301,983 |
| その他未払費用 | 285 |
| (C)純資産総額(A-B) | 72,121,190,204 |
| 元本 | 43,378,960,163 |
| 次期繰越損益金 | 28,742,230,041 |
| (D)受益権総口数 | 43,378,960,163口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 16,626円 |

| | | |
|------|---|-----------------|
| (注1) | 期首元本額 | 40,223,772,028円 |
| | 期中追加設定元本額 | 6,712,335,044円 |
| | 期中一部解約元本額 | 3,557,146,909円 |
| (注2) | 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。 | |
| | DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) | 3,461,059,032円 |
| | DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) | 6,218,098,531円 |
| | DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) | 2,547,097,324円 |
| | ニッセイ外国債券インデックスS A(適格機関投資家限定) | 912,607,004円 |
| | ニッセイインデックスバランス(債券重視型) | |
| | S A(適格機関投資家限定) | 2,067,561円 |
| | ニッセイインデックスバランス(標準型) | |
| | S A(適格機関投資家限定) | 6,149,747円 |
| | ニッセイインデックスバランス(成長型) | |
| | S A(適格機関投資家限定) | 4,503,470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 | 15,831,877,263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) | 5,727,201,586円 |
| | DCニッセイ外国債券インデックス | 4,257,065,641円 |
| | DCニッセイターゲットデートファンド2055 | 293,816,747円 |
| | DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 1,933,271,698円 |
| | DCニッセイターゲットデートファンド2045 | 341,078,933円 |
| | DCニッセイターゲットデートファンド2035 | 552,481,112円 |
| | DCニッセイターゲットデートファンド2025 | 64,415,551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) | 205,521,429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) | 20,223,791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) | 46,373,044円 |
| | DCニッセイターゲットデートファンド2060 | 229,109,652円 |
| | DCニッセイターゲットデートファンド2050 | 148,732,633円 |
| | DCニッセイターゲットデートファンド2040 | 297,949,699円 |
| | DCニッセイターゲットデートファンド2030 | 198,032,837円 |
| | FWニッセイ外国債券インデックス | 37,526,371円 |
| | DCニッセイターゲットデートファンド2065 | 42,699,507円 |

損益の状況

当期(2023年5月23日~2023年11月20日)

| 項目 | 当期 |
|------------------------|------------------------|
| (A)配当等収益 | 834,723,988円 |
| 受取利息 | 834,786,873 |
| その他収益金 | 1,295 |
| 支払利息 | △ 64,180 |
| (B)有価証券売買損益 | 4,471,632,159 |
| 売買益 | 5,971,897,645 |
| 売買損 | △ 1,500,265,486 |
| (C)信託報酬等 | △ 12,212,316 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | 5,294,143,831 |
| (E)前期繰越損益金 | 21,597,154,622 |
| (F)追加信託差損益金 | 3,985,363,819 |
| (G)解約差損益金 | △ 2,134,432,231 |
| (H)合計(D+E+F+G) | 28,742,230,041 |
| 次期繰越損益金(H) | 28,742,230,041 |

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ T O P I X（東証株価指数）（配当込み）

T O P I X（東証株価指数）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

- ・ N O M U R A - B P I 総合

N O M U R A - B P I 総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。"

- ・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

M S C I コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同インデックスの内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

- ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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