

第4期末(2022年11月21日)

基準価額	12,990円
純資産総額	14億円
騰落率	△6.5%
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 新興国株式インデックス

追加型投信/海外/株式/インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2021年11月23日~2022年11月21日

第4期(決算日 2022年11月21日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「DCニッセイ新興国株式インデックス」は、このたび第4期の決算を行いました。

当ファンドは、「ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に新興国の株式等に投資することにより、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

運用経過

2021年11月23日～2022年11月21日

基準価額等の推移



第4期首	13,900円	既払分配金	0円
第4期末	12,990円	騰落率 (分配金再投資ベース)	△6.5%

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

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

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

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2022年3月中旬から4月初旬にかけて、米経済におけるインフレ鈍化観測、地政学リスクの緩和や中国の景気刺激策への期待感から新興国株式市場が上昇したこと
- ・5月中旬から6月中旬にかけて、中国における経済活動再開や景気刺激策への期待感、米債券市場における金利上昇が一服したことを支えに、新興国株式市場が上昇したこと

<下落要因>

- ・2022年1月から3月中旬にかけて、米金融政策引き締めに対する懸念や地政学リスクの高まり、中国における新型コロナウイルス感染拡大を受け、新興国株式市場が下落したこと
- ・9月から10月にかけて、米金融政策引き締め長期化観測や米債券市場における金利上昇、米ドル高進行による新興国市場からの資金流出懸念により、新興国株式市場が軟調な展開となったこと

1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	42円	0.318%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は13,201円です。</p>
(投信会社)	(20)	(0.148)	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)	(20)	(0.148)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	6	0.043	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ <p>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</p>
(株式)	(4)	(0.033)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.009)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	3	0.021	$\text{有価証券取引税} = \text{期中の有価証券取引税} / \text{期中の平均受益権口数}$ <p>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</p>
(株式)	(3)	(0.021)	
(公社債)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	38	0.288	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)	(25)	(0.191)	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)	(0.010)	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)	(11)	(0.087)	<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	89	0.671	

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

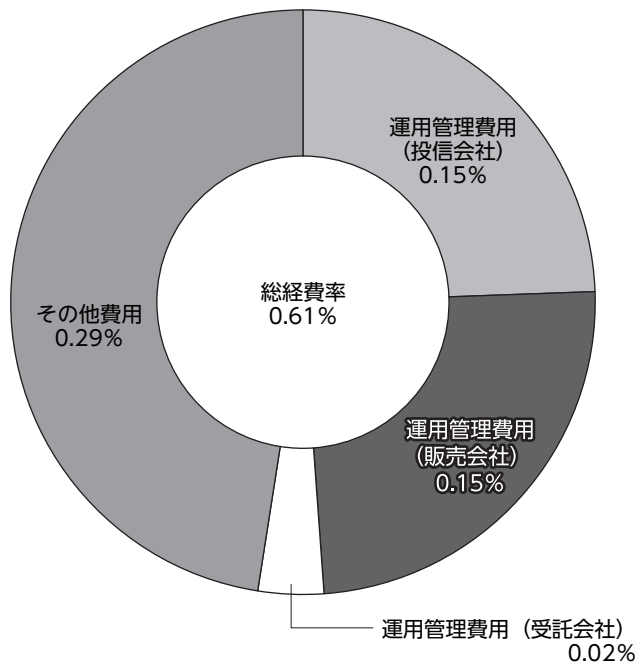
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(参考情報)

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.61%**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。

海外株式市況

【MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】



(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の新興国株式市場は下落しました。

新型コロナウイルス変異型の感染拡大に伴う経済正常化期待の後退により、新興国株式市場は軟調に始まりました。2022年1月から3月中旬にかけては、米金融政策引き締めへの懸念やロシア・ウクライナ間の地政学リスクの高まり、中国における同ウイルスの感染拡大を背景に下落基調を強めました。その後、4月から10月にかけては、地政学リスクの緩和や中国の景気刺激策への期待感から一時的に反発する場面も見られましたが、米金融政策引き締めの長期化観測や米債券市場における金利上昇、米ドル高進行による新興国市場からの資金流出懸念などにより、下落基調をたどりました。11月に入ると、米国を中心とするインフレ鈍化期待が高まり反発する展開となりましたが、結局、前期末と比較すると下落して当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

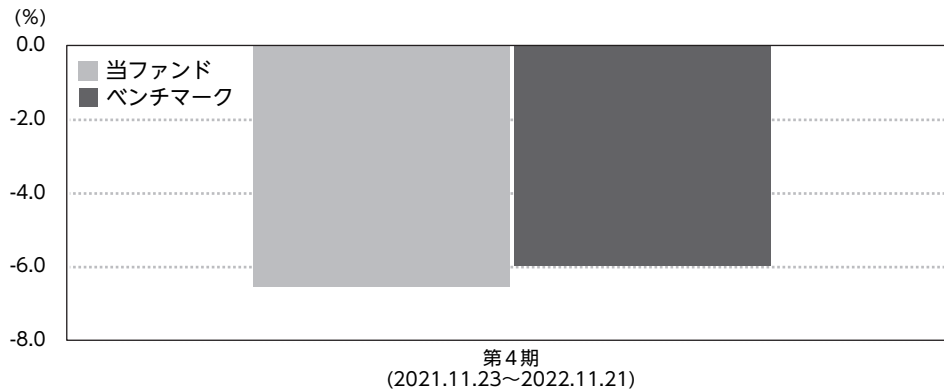
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

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

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-6.5%となり、ベンチマーク騰落率（-6.0%）を下回りました。これはマザーファンドにおける証券保管費用および売買費用等や、当ファンドの信託報酬等の費用を控除した影響などによるものです。

（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

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

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	当期
	2021年11月23日～2022年11月21日
当期分配金(税引前)	—
対基準価額比率	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,990円

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

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

今後の運用方針

■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に新興国の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。

■マザーファンド

新興国の株式等(DR(預託証券)を含みます)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4期末 2022年11月21日
ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	100.0%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

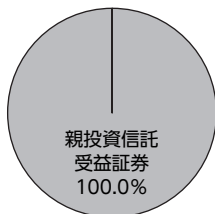
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

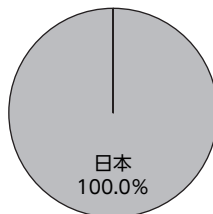
項目	第4期末 2022年11月21日
純資産総額	1,447,998,831円
受益権総口数	1,114,699,228口
1万口当たり基準価額	12,990円

(注) 当期間中における追加設定元本額は585,135,777円、同解約元本額は219,508,776円です。

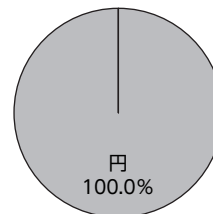
■資産別配分



■国別配分



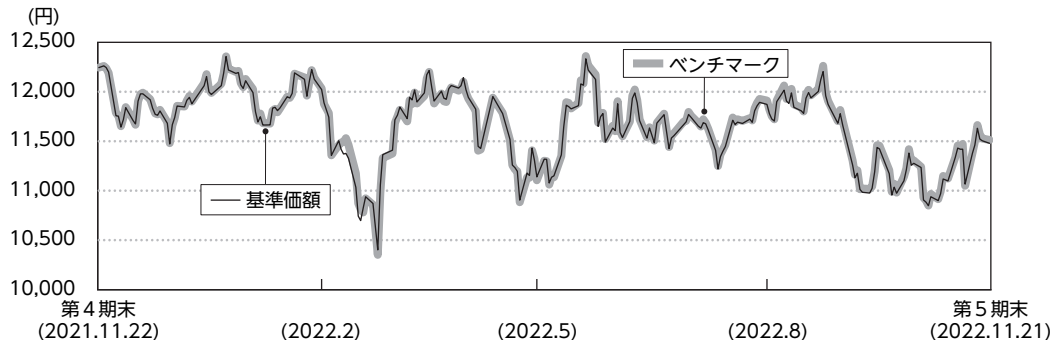
■通貨別配分



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

ニッセイ新興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

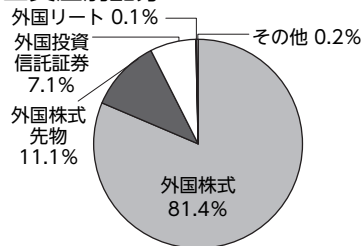
銘柄名	通貨	比率
MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202212 買	米ドル	11.1%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾ドル	5.5
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	米ドル	4.0
TENCENT HOLDINGS LTD	香港ドル	3.3
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国ウォン	3.2
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	香港ドル	2.2
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	インド・ルピー	1.4
MEITUAN-B	香港ドル	1.3
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	米ドル	1.3
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	米ドル	1.1
組入銘柄数		1,007

■ 1万口当たりの費用明細

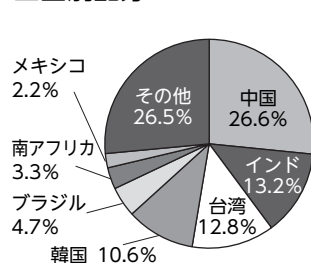
2021.11.23~2022.11.21

項目	金額
売買委託手数料	5円
(株式)	(4)
(新株予約権証券)	(0)
(先物・オプション)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	3
(株式)	(3)
(公社債)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	33
(保管費用)	(23)
(その他)	(10)
合計	40

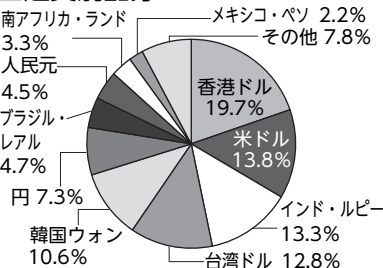
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

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

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2018年12月19日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	-	1
1期(2019年11月20日)	10,690	0	6.9	10,690	10,775	7.8	85.7	8.5	-	4.1	16
2期(2020年11月20日)	11,847	0	10.8	11,847	11,974	11.1	92.3	3.5	-	4.0	129
3期(2021年11月22日)	13,900	0	17.3	13,900	14,169	18.3	86.1	8.1	0.0	5.6	1,041
4期(2022年11月21日)	12,990	0	△ 6.5	12,990	13,324	△ 6.0	81.4	11.1	-	7.2	1,447

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注3) 「基準価額+累計分配金」は、当該決算期の基準価額(分配落)に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

(注4) 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5) 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6) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注7) 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。

(注8) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチ マーク		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
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率				
(期首)2021年11月22日	円	%		%	%	%	%	%
11月末	13,900	-	14,169	-	86.1	8.1	0.0	5.6
12月末	13,343	△ 4.0	13,607	△ 4.0	85.8	8.5	0.0	5.4
2022年1月末	13,481	△ 3.0	13,772	△ 2.8	86.4	9.5	0.0	5.5
2月末	13,234	△ 4.8	13,515	△ 4.6	83.0	10.8	0.0	5.8
3月末	13,051	△ 6.1	13,263	△ 6.4	81.5	12.4	0.0	6.0
4月末	13,628	△ 2.0	13,877	△ 2.1	84.9	7.9	0.0	7.0
5月末	13,074	△ 5.9	13,311	△ 6.1	83.2	8.7	0.0	7.9
6月末	13,199	△ 5.0	13,523	△ 4.6	81.8	11.1	-	7.0
7月末	13,470	△ 3.1	13,790	△ 2.7	84.5	8.3	-	6.9
8月末	13,154	△ 5.4	13,453	△ 5.1	82.2	10.3	-	7.2
9月末	13,456	△ 3.2	13,808	△ 2.5	80.4	12.2	-	7.2
10月末	12,435	△ 10.5	12,753	△ 10.0	84.6	7.1	-	8.1
(期末)2022年11月21日	12,337	△ 11.2	12,630	△ 10.9	82.1	9.3	-	8.4
	12,990	△ 6.5	13,324	△ 6.0	81.4	11.1	-	7.2

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2021年11月23日～2022年11月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	663,338	769,452	252,354	291,722

(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
	ニッセイ新興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	1,490,196千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,996,947千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.37

(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

2021年11月23日～2022年11月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2022年11月21日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	850,483	1,261,467	1,448,038

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド全体の口数は4,729,645千口です。

投資信託財産の構成

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	1,448,038	99.3
コール・ローン等、その他	9,680	0.7
投資信託財産総額	1,457,718	100.0

- (注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1香港ドル17.95円、1台湾ドル4.506円、1イギリス・ポンド166.59円、1トルコ・リラ7.54円、1メキシコ・ペソ7.213円、1フィリピン・ペソ2.45円、100チリ・ペソ14.899円、100コロンビア・ペソ2.81円、1インド・ルピー1.73円、100インドネシア・ルピア0.90円、1ブラジル・レアル26.066円、1チェコ・コルナ5.944円、100韓国ウォン10.43円、1人民元19.647円、1マレーシア・リンギット30.617円、1南アフリカ・ランド8.12円、1タイ・バーツ3.90円、1ポーランド・ズロチ30.809円、100ハンガリー・フォリント35.61円、1ユーロ144.81円です。
- (注2) ニッセイ新興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（5,031,270千円）の投資信託財産総額（5,475,936千円）に対する比率は91.9%です。
- (注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
(A) 資産	1,457,718,792円
コール・ローン等	2,149,345
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,448,038,068
未収入金	7,531,379
(B) 負債	9,719,961
未払解約金	7,441,354
未払信託報酬	2,208,654
その他未払費用	69,953
(C) 純資産総額(A-B)	1,447,998,831
元本	1,114,699,228
次期繰越損益金	333,299,603
(D) 受益権総口数	1,114,699,228口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,990円

- (注) 期首元本額 749,072,227円
 期中追加設定元本額 585,135,777円
 期中一部解約元本額 219,508,776円

損益の状況

当期(2021年11月23日~2022年11月21日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 313円
受取利息	17
支払利息	△ 330
(B) 有価証券売買損益	△ 57,433,479
売買益	12,397,842
売買損	△ 69,831,321
(C) 信託報酬等	△ 4,132,841
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 61,566,633
(E) 前期繰越損益金	26,703,060
(分配準備積立金)	(26,703,111)
(繰越欠損金)	(△ 51)
(F) 追加信託差損益金*	368,163,176
(配当等相当額)	(200,510,169)
(売買損益相当額)	(167,653,007)
(G) 合計(D+E+F)	333,299,603
次期繰越損益金(G)	333,299,603
追加信託差損益金	368,163,176
(配当等相当額)	(200,510,169)
(売買損益相当額)	(167,653,007)
分配準備積立金	26,703,111
繰越欠損金	△ 61,566,684

- (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	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	306,596,805円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	26,703,111円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	333,299,916円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	2,990.04円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■運用体制の変更について

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

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

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に新興国の株式等に投資することにより、MSCIEマーキング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。	
主要運用対象	DCニッセイ新興国株式インデックス	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）
運用方法	DCニッセイ新興国株式インデックス	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。	

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 5 期

(計算期間：2021年11月23日～2022年11月21日)

運用方針

主に新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

主要運用 対象

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）

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

2021年11月23日～2022年11月21日

海外株式市況

【MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】

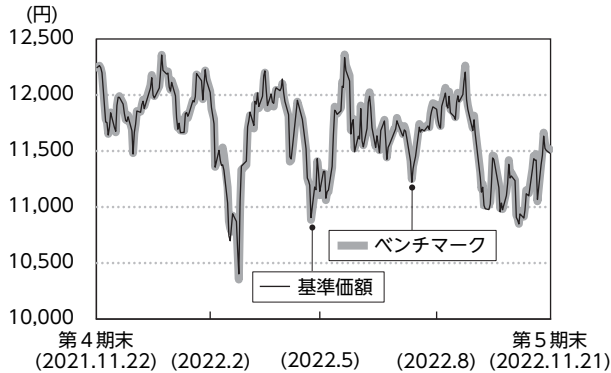


(注) 指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の新興国株式市場は下落しました。

新型コロナウイルス変異型の感染拡大に伴う経済正常化期待の後退により、新興国株式市場は軟調に始まりました。2022年1月から3月中旬にかけては、米金融政策引き締めへの懸念やロシア・ウクライナ間の地政学リスクの高まり、中国における同ウイルスの感染拡大を背景に下落基調を強めました。その後、4月から10月にかけては、地政学リスクの緩和や中国の景気刺激策への期待感から一時的に反発する場面も見られましたが、米金融政策引き締めの長期化観測や米債券市場における金利上昇、米ドル高進行による新興国市場からの資金流出懸念などにより、下落基調をたどりました。11月に入ると、米国を中心とするインフレ鈍化期待が高まり反発する展開となりましたが、結局、前期末と比較すると下落して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3月中旬から4月初旬にかけて、米経済におけるインフレ鈍化観測、地政学リスクの緩和や中国の景気刺激策への期待感から新興国株式市場が上昇したこと
- ・ 5月中旬から6月中旬にかけて、中国における経済活動再開や景気刺激策への期待感、米債券市場における金利上昇が一服したことを支えに、新興国株式市場が上昇したこと

<下落要因>

- ・ 2022年1月から3月中旬にかけて、米金融政策引き締めに対する懸念や地政学リスクの高まり、中国における新型コロナウイルス感染拡大を受け、新興国株式市場が下落したこと
- ・ 9月から10月にかけて、米金融政策引き締めの長期化観測や米債券市場における金利上昇、米ドル高進行による新興国市場からの資金流出懸念により、新興国株式市場が軟調な展開となったこと

ポートフォリオ

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）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-6.2%となり、ベンチマーク騰落率（-6.0%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）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。

設定以来の運用実績

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	債券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
(設定日)	円	%		%	%	%	%	%	百万円
2017年8月7日	10,000	-	10,000	-	-	-	-	-	1,000
1期(2018年11月20日)	8,898	△11.0	9,691	△ 3.1	88.6	8.8	-	2.2	1,641
2期(2019年11月20日)	9,354	5.1	10,252	5.8	85.7	8.5	-	4.1	2,160
3期(2020年11月20日)	10,400	11.2	11,393	11.1	92.3	3.5	-	4.0	2,353
4期(2021年11月22日)	12,243	17.7	13,481	18.3	86.1	8.1	0.0	5.6	4,467
5期(2022年11月21日)	11,479	△ 6.2	12,677	△ 6.0	81.4	11.1	-	7.2	5,428

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 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3) 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4) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

(注5) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

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	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
	円	%		%	%	%	%	%
(期首) 2021年11月22日	12,243	-	13,481	-	86.1	8.1	0.0	5.6
11月末	11,753	△ 4.0	12,947	△ 4.0	85.8	8.5	0.0	5.4
12月末	11,878	△ 3.0	13,104	△ 2.8	86.4	9.5	0.0	5.5
2022年 1月末	11,664	△ 4.7	12,859	△ 4.6	83.0	10.8	0.0	5.8
2月末	11,505	△ 6.0	12,620	△ 6.4	81.5	12.4	0.0	6.0
3月末	12,017	△ 1.8	13,204	△ 2.1	84.9	7.9	0.0	7.0
4月末	11,532	△ 5.8	12,666	△ 6.1	83.2	8.7	0.0	7.9
5月末	11,645	△ 4.9	12,867	△ 4.6	81.8	11.1	-	7.0
6月末	11,888	△ 2.9	13,122	△ 2.7	84.5	8.3	-	6.9
7月末	11,612	△ 5.2	12,800	△ 5.1	82.2	10.3	-	7.2
8月末	11,882	△ 2.9	13,139	△ 2.5	80.4	12.2	-	7.2
9月末	10,983	△10.3	12,135	△10.0	84.6	7.1	-	8.1
10月末	10,900	△11.0	12,018	△10.9	82.1	9.3	-	8.4
(期末) 2022年11月21日	11,479	△ 6.2	12,677	△ 6.0	81.4	11.1	-	7.2

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2021年11月23日～2022年11月21日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料	5円	0.043%	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
(株式)	(4)	(0.033)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.009)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	3	0.021	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
(株式)	(3)	(0.021)	
(公社債)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	33	0.280	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)	(23)	(0.193)	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)	(10)	(0.086)	・ 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	40	0.344	

(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（11,646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

2021年11月23日～2022年11月21日

(1) 株式

	買付		売付		
	株数	金額	株数	金額	
外国	アメリカ	百株 159 (325)	千米ドル 370	百株 152	千米ドル 947
	香港	11,281 (152)	千香港ドル 24,450 (△ 16)	3,105	千香港ドル 2,091
	台湾	4,350 (68)	千台湾ドル 41,021 (△ 679)	315	千台湾ドル 3,753
	トルコ	411 (37)	千トルコ・リラ 805	71	千トルコ・リラ 107
	メキシコ	574 (78)	千メキシコ・ペソ 2,674	64	千メキシコ・ペソ 292
	フィリピン	1,050 (53)	千フィリピン・ペソ 4,587	—	千フィリピン・ペソ —
	チリ	2,221 (0.14)	千チリ・ペソ 35,292	137	千チリ・ペソ 742
	コロンビア	17	千コロンビア・ペソ 56,767	6	千コロンビア・ペソ 29,480
	インド	959 (685)	千インド・ルピー 85,953	153	千インド・ルピー 9,240
	インドネシア	5,367 (33)	千インドネシア・ルピア 2,643,393	108	千インドネシア・ルピア 80,703

ニッセイ新興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	ブラジル	百株 914 (199)	千ブラジル・レアル 2,385 (△ 14)	百株 187	千ブラジル・レアル 270
	チェコ	4	千チェコ・コルナ 502	—	千チェコ・コルナ —
	韓国	231 (6)	千韓国ウォン 1,521,032	28	千韓国ウォン 149,311
	中国	3,152 (78)	千人民元 5,206	687	千人民元 577
	マレーシア	1,391	千マレーシア・リングギット 669	106	千マレーシア・リングギット 30
	南アフリカ	400 (15)	千南アフリカ・ランド 4,453	37	千南アフリカ・ランド 138
	タイ	2,117	千タイ・バーツ 8,100 (△ 2)	1,000	千タイ・バーツ 1,211
	ポーランド	113 (△ 118)	千ポーランド・ズロチ 314	—	千ポーランド・ズロチ —
	ハンガリー	21	千ハンガリー・フォリント 8,137	—	千ハンガリー・フォリント —
	ユーロ ギリシャ	40	千ユーロ 41 (△ 1)	—	千ユーロ —

(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。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。

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

(2) 新株予約権証券

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	タイ	証券	千タイ・バーツ	証券	千タイ・バーツ
		7,070	2	7,070	2

(注) 証券数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、証券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) 公社債

外国	インド	社債券	買付額	売付額
			千インド・ルピー	千インド・ルピー
			-	9

(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。ただし、金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(4) 投資信託証券

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	10	172	-	-
	ISHARES MSCI QATAR CP ETF	5	115	-	-
	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	8	379	0.300	11
	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	2	74	0.300	10
	(メキシコ)		千メキシコ・ペソ		千メキシコ・ペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	9	229	-	-
	(南アフリカ)		千南アフリカ・ランド		千南アフリカ・ランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	10	134	-	-

(注) 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。

(5) 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	2,589	2,370	-	-

(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

2021年11月23日～2022年11月21日

(1) 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
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	24	59,044	2,460	JD.COM INC-ADR	4	39,890	9,670
JD.COM INC - CL A	11	54,468	4,777	BAIDU INC - SPON ADR	1	28,395	19,044
TENCENT HOLDINGS LTD	8	53,127	6,324	NETEASE.COM INC -ADR	2	25,032	12,386
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4	32,916	6,805	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	3	7,412	2,470
BAIDU INC-CLASS A	12	32,188	2,575	GLOBANT SA	0.239	7,282	30,469
NETEASE INC	11	29,598	2,508	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	0.738	5,106	6,918
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	15	25,429	1,684	TENCENT HOLDINGS LTD	0.700	4,734	6,764
MEITUAN-B	5	18,999	3,220	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1	3,561	1,874
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	3	17,295	4,371	BANCO BRADESCO S.A.	8	3,435	424
KUAI SHOU TECHNOLOGY	8	11,175	1,314	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	1	3,105	3,053

(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。

(2) 新株予約権証券

銘柄	買付			銘柄	売付		
	証券数	金額	平均単価		証券数	金額	平均単価
	証券	千円	円		証券	千円	円
BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW24	2,020	3	1	BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW26	4,040	4	1
BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW26	4,040	2	0.739	BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW24	2,020	3	1
BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW22	1,010	2	2	BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW22	1,010	2	2

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 証券数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、証券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) 公社債

銘柄	買付		銘柄	売付	
	金額	金額		金額	金額
	千円	千円		千円	千円
—	—	—	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	—	15

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2022年11月21日現在

(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	
360 DIGITECH INC	5	5	7	982	各種金融
51JOB INC-ADR	1	—	—	—	商業・専門サービス
AUTOHOME INC-ADR	2	5	15	2,127	メディア・娯楽
BAIDU INC - SPON ADR	13	—	—	—	メディア・娯楽
BAOZUN INC-SPN ADR	1	—	—	—	小売
BEIGENE LTD-ADR	2	2	48	6,814	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	7	—	—	—	メディア・娯楽
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5	5	4	589	素材
CREDICORP LTD	3	4	66	9,270	銀行
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	2	4	21	2,980	半導体・半導体製造装置
DIDI GLOBAL INC	18	—	—	—	運輸
GAOTU TECHEDU INC- ADR	3	—	—	—	消費者サービス
GDS HOLDINGS LTD - ADR	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス
GLOBANT SA	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
H WORLD GROUP LIMITED(ADR)	7	10	38	5,335	消費者サービス
HELLO GROUP INC-SPON ADR	4	—	—	—	メディア・娯楽
HUTCHMED CHINA LIMITED ADR	2	6	6	907	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUYA INC-ADR	2	—	—	—	メディア・娯楽
I-MAB-SPONSORED ADR	2	—	—	—	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQIYI INC-ADR	9	9	2	351	メディア・娯楽
JD.COM INC-ADR	41	—	—	—	小売
JOYY INC	1	3	9	1,319	メディア・娯楽
KANZHUN LTD	—	11	17	2,457	メディア・娯楽
KE HOLDINGS INC	16	38	57	8,053	不動産
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	—	2	10	1,462	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LI AUTO INC - ADR	27	31	56	7,905	自動車・自動車部品
LUFAX HOLDING LTD	6	—	—	—	各種金融
LUKOIL PJSC-SPON ADR	20	18	0.000	0.025	エネルギー
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	14	14	0.000	0.019	食品・生活必需品小売り
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	16	29	0.000	0.040	電気通信サービス
NETEASE.COM INC -ADR	20	—	—	—	メディア・娯楽
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	53	—	—	—	消費者サービス
NIO INC - ADR	64	77	81	11,399	自動車・自動車部品

ニッセイ新興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	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	1	—	—	—	各種金融
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	4	4	0.000	0.005	エネルギー
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	11	7	0.000	0.009	素材
OZON HOLDINGS PLC - ADR	3	3	0.000	0.004	小売
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	5	5	0.000	0.007	素材
PINDUODUO INC-ADR	21	28	200	28,081	小売
PJSC GAZPROM ADR	279	279	0.003	0.391	エネルギー
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	27	27	0.000	0.037	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	4	4	0.000	0.005	素材
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	32	32	5	790	食品・飲料・タバコ
ROSNEFT OJSC-GDR	54	54	0.001	0.075	エネルギー
SBERBANK OF RUSSIA	—	498	0.005	0.698	銀行
SBERBANK PAO -SPONSORED ADR	124	—	—	—	銀行
SEVERSTAL PAO - GDR REG S	13	13	0.000	0.018	素材
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	22	22	1	251	不動産
SOUTHERN COPPER CORP	2	4	25	3,534	素材
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	30	51	0.001	0.071	エネルギー
TAL EDUCATION GROUP- ADR	13	28	15	2,199	消費者サービス
TATNEFT-SPONSORED ADR	14	12	0.000	0.016	エネルギー
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	5	5	0.000	0.007	銀行
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	34	34	19	2,716	メディア・娯楽
TRIP.COM GROUP LTD	23	31	87	12,351	消費者サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	14	23	21	3,041	小売
VK COMPANY LTD-GDR	3	3	0.000	0.004	メディア・娯楽
VNET GROUP INC-ADR	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	66	66	0.001	0.092	銀行
WEIBO CORP-SPON ADR	1	3	4	675	メディア・娯楽
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	4	4	0.000	0.005	食品・生活必需品小売り
XPENG INC - ADR	19	24	18	2,628	自動車・自動車部品
YANDEX NV-A	13	13	0.000	0.018	メディア・娯楽
YUM CHINA HOLDINGS INC	20	22	117	16,470	消費者サービス
ZAI LAB LTD-ADR	3	5	19	2,743	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	21	24	53	7,537	運輸
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,285 64	1,618 48	1,032 —	144,979 <2.7%>

ニッセイ新興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	
3SBIO INC	40	40	27	493	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	35	35	60	1,086	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	40	—	—	—	不動産
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	990	1,580	382	6,863	銀行
AIR CHINA LIMITED-H	100	100	58	1,046	運輸
AKESO INC	20	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	716	848	6,779	121,696	小売
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	160	300	176	3,166	小売
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	400	400	18	326	メディア・娯楽
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO-H	15	15	13	250	不動産
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	240	240	72	1,292	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	60	60	161	2,891	素材
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	7	7	77	1,382	食品・飲料・タバコ
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	60	70	621	11,151	耐久消費財・アパレル
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	40	40	13	249	資本財
BAIDU INC-CLASS A	—	125	1,171	21,035	メディア・娯楽
BANK OF CHINA LTD - H	3,800	4,210	1,103	19,799	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	620	380	157	2,823	銀行
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40	40	18	327	運輸
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	15	15	34	616	公益事業
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	160	160	30	545	公益事業
BILIBILI INC-CLASS Z	—	11	140	2,524	メディア・娯楽
BOC AVIATION LTD	5	5	28	514	資本財
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	160	160	61	1,111	耐久消費財・アパレル
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	80	—	—	—	自動車・自動車部品
BYD CO LTD	35	45	830	14,911	自動車・自動車部品
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	30	30	69	1,241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CANSINO BIOLOGICS INC-H	4	4	48	861	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CGN POWER CO LTD-H	340	650	114	2,053	公益事業
CHINA AOYUAN GROUP LTD	40	—	—	—	不動産
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	280	280	24	437	各種金融
CHINA CITIC BANK	290	490	156	2,814	銀行
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	80	80	19	357	資本財
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	85	85	135	2,428	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,580	5,310	2,394	42,986	銀行
CHINA COSCO HOLDINGS-H	71	146	136	2,445	運輸
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	20	—	—	—	消費者サービス

ニッセイ新興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	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	20	-	-	-	消費者サービス
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	120	120	26	473	銀行
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	150	150	48	869	商業・専門サービス
CHINA EVERBRIGHT LTD	40	-	-	-	各種金融
CHINA FEIHE LTD	170	170	97	1,754	食品・飲料・タバコ
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	115	115	41	741	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	150	150	129	2,326	公益事業
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	65	140	95	1,718	素材
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	210	-	-	-	各種金融
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	116	116	156	2,806	各種金融
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	180	560	91	1,638	不動産
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	50	50	43	785	資本財
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	370	440	462	8,308	保険
CHINA LITERATURE LTD	14	36	97	1,751	メディア・娯楽
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	120	170	161	2,898	公益事業
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	80	80	84	1,510	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	20	20	27	489	小売
CHINA MENGNIU DAIRY CO	170	170	556	9,993	食品・飲料・タバコ
CHINA MERCHANTS BANK - H	185	230	794	14,263	銀行
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	40	100	109	1,967	運輸
CHINA MINSHENG BANKING-H	229	229	56	1,011	銀行
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	120	200	120	2,161	素材
CHINA OILFIELD SERVICES-H	40	120	108	1,942	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	195	230	441	7,926	不動産
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	50	50	39	708	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	148	148	246	4,425	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,120	1,340	454	8,153	エネルギー
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	448	528	531	9,548	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA POWER INTERNATIONAL	100	330	92	1,652	公益事業
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	90	280	107	1,924	資本財
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	80	100	495	8,885	食品・飲料・タバコ
CHINA RESOURCES CEMENT	180	180	69	1,247	素材
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	40	40	109	1,970	公益事業
CHINA RESOURCES LAND LTD	160	180	585	10,500	不動産
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	22	44	149	2,685	不動産
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	40	-	-	-	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	60	100	140	2,523	公益事業

ニッセイ新興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	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	185	185	408	7,338	エネルギー
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	40	240	105	1,891	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	40	120	100	1,798	資本財
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	-	140	47	849	エネルギー
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	66	66	44	799	保険
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,340	2,160	172	3,101	電気通信サービス
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	60	60	23	427	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA VANKE CO LTD-H	89	138	179	3,220	不動産
CHINA YOUZAN LTD	440	-	-	-	ソフトウェア・サービス
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	120	120	79	1,423	ソフトウェア・サービス
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	50	-	-	-	銀行
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	60	-	-	-	不動産
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	240	249	29	537	不動産
CITIC LTD	190	320	240	4,308	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	70	145	211	3,800	各種金融
CMOC GROUP LIMITED-H	60	240	84	1,512	素材
COSCO PACIFIC LTD	60	60	33	603	運輸
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	480	480	125	2,248	不動産
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	70	110	187	3,368	不動産
CRRG CORP LTD H	-	340	98	1,769	資本財
DALI FOODS GROUP CO LTD	45	215	72	1,308	食品・飲料・タバコ
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	80	180	73	1,315	自動車・自動車部品
DONGYUE GROUP	-	80	63	1,134	素材
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	37	43	431	7,741	公益事業
FAR EAST HORIZON LTD	70	70	38	698	各種金融
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	30	30	63	1,136	半導体・半導体製造装置
FOSUN INTERNATIONAL	75	170	99	1,782	資本財
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	32	32	104	1,881	自動車・自動車部品
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	10	22	137	2,468	素材
GDS HOLDINGS LTD-CL A	-	57	82	1,487	ソフトウェア・サービス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	300	350	365	6,558	自動車・自動車部品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	80	60	121	2,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GF SECURITIES CO LTD-H	48	48	50	904	各種金融
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	200	-	-	-	小売
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	150	150	151	2,724	自動車・自動車部品
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	60	60	28	520	不動産
GUANGDONG INVESTMENT LTD	160	160	117	2,116	公益事業

ニッセイ新興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	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	96	196	102	1,832	自動車・自動車部品
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	32	—	—	—	不動産
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	50	50	82	1,484	消費者サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	114	114	278	5,003	耐久消費財・アパレル
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10	50	89	1,606	資本財
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	100	100	44	793	各種金融
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	4	12	92	1,660	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	40	80	118	2,122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGAN INTL GROUP CO LTD	20	45	156	2,810	家庭用品・パーソナル用品
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	44	53	44	800	不動産
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	10	30	79	1,429	半導体・半導体製造装置
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	50	—	—	—	素材
HUANENG POWER INTL INC-H	140	140	46	841	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	54	54	46	843	各種金融
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	—	20	94	1,703	ヘルスケア機器・サービス
IND & COMM BK OF CHINA - H	2,500	3,120	1,145	20,553	銀行
INNOVENT BIOLOGICS INC	55	55	178	3,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	11	69	465	8,358	小売
JD.COM INC - CL A	—	122	2,661	47,767	小売
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20	20	12	224	運輸
JIANGXI COPPER CO LTD-H	20	90	95	1,715	素材
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	40	40	22	397	ヘルスケア機器・サービス
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	30	30	50	902	消費者サービス
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	70	—	—	—	不動産
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	20	40	95	1,712	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	25	25	19	345	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	140	140	202	3,638	ソフトウェア・サービス
KINGSOFT CORP LTD	30	52	134	2,417	メディア・娯楽
KUAISHOU TECHNOLOGY	12	97	526	9,454	メディア・娯楽
KUNLUN ENERGY CO LTD	100	200	109	1,970	公益事業
KWG GROUP HOLDINGS LTD	40	—	—	—	不動産
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	30	—	—	—	素材
LEGEND GROUP LTD	400	400	261	4,688	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LI NING CO LTD	100	135	780	14,018	耐久消費財・アパレル
LOGAN GROUP CO LTD	40	—	—	—	不動産
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	90	90	180	3,247	不動産
MEITUAN-B	193	247	3,961	71,115	小売

ニッセイ新興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	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	20	53	99	1,784	ヘルスケア機器・サービス
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	20	20	12	215	ソフトウェア・サービス
MINTH GROUP LTD	20	40	77	1,385	自動車・自動車部品
NETEASE INC	—	118	1,266	22,727	メディア・娯楽
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	22	60	96	1,733	保険
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	—	98	208	3,746	消費者サービス
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	30	30	17	311	素材
NONGFU SPRING CO LTD-H	16	102	437	7,854	食品・飲料・タバコ
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	—	10	123	2,209	運輸
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	230	230	55	990	保険
PETROCHINA CO LTD-H	1,220	1,220	409	7,358	エネルギー
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	6	9	41	739	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	230	410	299	5,372	保険
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	16	16	31	562	小売
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	305	365	1,549	27,812	保険
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD	6	—	—	—	不動産
POP MART INTERNATIONAL GROUP	—	38	56	1,020	小売
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	260	400	175	3,152	銀行
SEAZEN GROUP LTD	80	80	22	403	不動産
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	57	57	83	1,494	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	80	164	184	3,302	ヘルスケア機器・サービス
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10	30	79	1,424	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	27	27	35	632	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN INTL HOLDINGS	15	15	10	184	運輸
SHENZHEN INVESTMENT LTD	80	—	—	—	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	38	44	296	5,315	耐久消費財・アパレル
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	40	—	—	—	不動産
SINO BIOPHARMACEUTICAL	570	570	256	4,604	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOPHARM GROUP CO-H	48	88	154	2,773	ヘルスケア機器・サービス
SINOTRUK HONG KONG LTD	20	20	19	345	資本財
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	100	100	123	2,211	食品・飲料・タバコ
SSY GROUP LTD	40	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUN ART RETAIL GROUP LTD	55	—	—	—	食品・生活必需品小売り
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	140	230	105	1,890	不動産
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	50	—	—	—	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	36	42	389	6,988	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TENCENT HOLDINGS LTD	271	348	10,015	179,777	メディア・娯楽

ニッセイ新興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	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60	120	140	2,520	食品・飲料・タバコ
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	44	80	128	2,311	消費者サービス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	40	40	19	350	小売
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	30	30	43	776	ソフトウェア・サービス
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20	40	277	4,972	食品・飲料・タバコ
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	30	30	19	354	食品・飲料・タバコ
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	15	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	150	280	142	2,563	食品・飲料・タバコ
WEICHAI POWER CO LTD-H	60	120	110	1,981	資本財
WEIMOB INC	60	-	-	-	ソフトウェア・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	40	70	140	2,519	不動産
WUXI APPTec CO LTD-H	18	25	213	3,829	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	175	205	1,058	19,005	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XIAOMI CORP-CLASS B	688	884	910	16,343	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	24	24	19	353	資本財
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	260	260	244	4,382	半導体・半導体製造装置
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	-	90	82	1,478	耐久消費財・アパレル
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	40	40	49	894	自動車・自動車部品
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	40	100	222	3,993	エネルギー
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	20	20	43	782	食品・飲料・タバコ
YUEXIU PROPERTY CO LTD	32	32	27	493	不動産
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	35	-	-	-	素材
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	20	20	11	202	運輸
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	70	-	-	-	不動産
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	31	31	57	1,032	保険
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	20	35	132	2,377	小売
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	17	39	140	2,527	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	220	300	294	5,282	素材
ZTE CORP-H	28	62	102	1,831	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	35,379 201	43,708 185	59,633 -	1,070,424 <19.7%>
(台湾)			千台湾ドル		
ACCTON TECHNOLOGY CORP	20	30	778	3,508	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC	130	130	325	1,467	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADVANTECH CO LTD	10	20	655	2,955	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10	10	845	3,807	資本財
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	170	170	1,613	7,270	半導体・半導体製造装置

ニッセイ新興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	
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
ASIA CEMENT CORP	70	70	288	1,301	素材
ASUSTEK COMPUTER INC	40	40	1,024	4,614	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUO CORPORATION	260	328	547	2,468	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	20	40	736	3,316	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	320	460	1,927	8,685	保険
CHAILEASE HOLDING CO LTD	55	78	1,459	6,578	各種金融
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	197	199	339	1,528	銀行
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	130	130	435	1,962	自動車・自動車部品
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	740	830	1,080	4,867	保険
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	113	-	-	-	保険
CHINA STEEL CORP	600	700	1,988	8,958	素材
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	140	210	2,289	10,315	電気通信サービス
COMPAL ELECTRONICS	130	130	281	1,268	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	870	1,080	2,311	10,415	銀行
DELTA ELECTRONICS INC	100	110	3,223	14,524	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E INK HOLDINGS INC	-	50	850	3,830	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	452	773	1,832	8,255	銀行
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	10	10	438	1,976	耐久消費財・アパレル
EVERGREEN MARINE	121	56	851	3,838	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	100	100	313	1,412	資本財
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	40	80	529	2,386	電気通信サービス
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	13	33	607	2,737	耐久消費財・アパレル
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	409	560	1,416	6,384	銀行
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	180	180	1,296	5,840	素材
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	40	70	579	2,611	エネルギー
FORMOSA PLASTICS CORP	190	230	2,017	9,089	素材
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	20	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	357	427	2,363	10,649	保険
GIANT MANUFACTURING	10	10	234	1,056	耐久消費財・アパレル
GLOBALWAFERS CO LTD	10	10	476	2,145	半導体・半導体製造装置
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	10	-	-	-	資本財
HON HAI PRECISION INDUSTRY	602	702	7,055	31,793	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	10	20	1,222	5,506	小売
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	248	453	983	4,431	銀行
INNOLUX CORPORATION	280	425	535	2,415	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVENTEC CO LTD	80	80	200	901	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LARGAN PRECISION CO LTD	-	10	2,280	10,274	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ新興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	
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	70	110	741	3,341	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC	70	90	6,498	29,282	半導体・半導体製造装置
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	490	594	1,795	8,090	銀行
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	20	40	522	2,352	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NAN YA PLASTICS CORP	250	250	1,830	8,246	素材
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	10	10	258	1,162	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	40	80	485	2,188	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10	10	282	1,270	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	20	30	904	4,076	半導体・半導体製造装置
ONENESS BIOTECH CO LTD	10	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARADE TECHNOLOGIES LTD	-	10	755	3,402	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	60	100	603	2,717	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHISON ELECTRONICS CORP	10	-	-	-	半導体・半導体製造装置
POU CHEN	70	70	226	1,020	耐久消費財・アパレル
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	-	150	504	2,274	半導体・半導体製造装置
POWERTECH TECHNOLOGY INC	20	-	-	-	半導体・半導体製造装置
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20	20	530	2,388	食品・生活必需品小売り
QUANTA COMPUTER INC	110	150	1,072	4,833	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	20	30	963	4,339	半導体・半導体製造装置
RUJENTEX DEVELOPMENT CO LTD	25	97	434	1,959	不動産
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	312	562	480	2,164	保険
SILERGY CORP	-	20	1,008	4,542	半導体・半導体製造装置
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	344	600	1,018	4,588	銀行
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	40	80	444	2,000	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	304	508	735	3,314	銀行
TAIWAN CEMENT	246	340	1,135	5,115	素材
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	368	602	1,554	7,005	銀行
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	60	60	168	757	運輸
TAIWAN MOBILE CO LTD	50	80	750	3,381	電気通信サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,160	1,370	66,719	300,662	半導体・半導体製造装置
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	220	220	986	4,446	銀行
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	50	80	1,232	5,551	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	250	250	1,602	7,221	食品・飲料・タバコ
UNITED MICROELECTRONICS CORP	540	680	3,100	13,973	半導体・半導体製造装置
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	40	40	352	1,588	半導体・半導体製造装置
WALSIN LIHWA CORP	-	150	655	2,953	資本財
WALSIN TECHNOLOGY CORP	10	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ新興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
(台湾)		百株	百株	千台湾ドル	千円	
WAN HAI LINES LIMITED		33	37	272	1,227	運輸
WIN SEMICONDUCTORS CORP		10	20	312	1,405	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP		90	170	372	1,677	半導体・半導体製造装置
WISTRON CORP		91	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WIWYNN CORP		—	10	852	3,839	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD		57	57	264	1,190	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YAGEO CORPORATION		20	23	1,082	4,878	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YANG MING MARINE TRANSPORT		70	90	567	2,555	運輸
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO		452	595	1,244	5,609	各種金融
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		20	40	474	2,136	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,478 82	17,581 81	154,022 —	694,087 <12.8%>	
(イギリス)				千イギリス・ポンド		
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC		19	19	0.000	0.031	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	19 1	19 1	0.000 —	0.031 <0.0%>	
(トルコ)				千トルコ・リラ		
AKBANK T.A.S.		258	258	420	3,167	銀行
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		21	21	83	628	資本財
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		25	25	333	2,514	食品・生活必需品小売り
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		81	81	300	2,263	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		1	1	66	503	自動車・自動車部品
KOC HOLDING AS		25	87	553	4,173	資本財
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		3	10	460	3,472	エネルギー
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		35	118	370	2,794	電気通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI		71	—	—	—	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C		30	325	311	2,345	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	553 10	930 9	2,899 —	21,864 <0.4%>	
(メキシコ)				千メキシコ・ペソ		
ALFA S.A.B.-A		—	179	253	1,826	資本財
AMERICA MOVIL SAB DE CV		1,563	1,563	3,041	21,939	電気通信サービス
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		18	18	298	2,153	食品・飲料・タバコ
BECLE SAB DE CV		56	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CEMEX SAB-CPO		782	782	685	4,941	素材
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		16	28	388	2,800	食品・飲料・タバコ
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		98	111	1,719	12,406	食品・飲料・タバコ

ニッセイ新興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		
(メキシコ)		百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
GRUMA S.A.B.-B	5	12	281	2,028	食品・飲料・タバコ	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	6	10	503	3,634	運輸	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	12	19	605	4,367	運輸	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	53	89	779	5,621	食品・飲料・タバコ	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	9	9	78	564	資本財	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	128	152	2,323	16,757	銀行	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	75	146	547	3,947	銀行	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	169	169	1,268	9,148	素材	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	140	140	294	2,127	メディア・娯楽	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3	3	101	732	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	49	100	329	2,373	家庭用品・パーソナル用品	
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	8	-	-	-	メディア・娯楽	
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	-	120	284	2,049	電気通信サービス	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	33	33	126	912	素材	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4	4	73	531	運輸	
SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	-	78	57	414	電気通信サービス	
WALMART DE MEXICO-SER V	251	300	2,139	15,433	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,479 21	4,067 22	16,180 -	116,712 <2.1%>	
(フィリピン)				千フィリピン・ペソ		
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	63	63	358	877	資本財	
ACEN CORPORATION	-	469	328	806	公益事業	
AYALA CORPORATION	17	17	1,194	2,927	資本財	
AYALA LAND INC	488	488	1,449	3,552	不動産	
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	48	125	1,225	3,003	銀行	
BDO UNIBANK INC	63	111	1,435	3,519	銀行	
GLOBE TELECOM INC	0.65	0.65	143	352	電気通信サービス	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	1	1	82	201	資本財	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	28	56	1,062	2,603	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	96	185	833	2,042	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORP	13	13	336	825	消費者サービス	
MANILA ELECTRIC COMPANY	13	13	419	1,028	公益事業	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	281	281	95	234	各種金融	
METROPOLITAN BANK & TRUST	55	151	781	1,914	銀行	
MONDE NISSIN CORP	-	292	371	910	食品・飲料・タバコ	
PLDT INC	2	5	923	2,263	電気通信サービス	
SM INVESTMENTS CORP	15	15	1,361	3,336	資本財	

ニッセイ新興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	
(フィリピン)		百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
SM PRIME HOLDINGS INC		603	603	2,050	5,024	不動産
UNIVERSAL ROBINA CORP		28	28	370	908	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,821	2,925	14,824	36,332	
		17	19	–	<0.7%>	
(チリ)				千チリ・ペソ		
BANCO DE CHILE		1,789	3,064	25,972	3,869	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION		1	1	4,776	711	銀行
BANCO SANTANDER CHILE		5,533	5,533	18,646	2,778	銀行
CENCOSUD SA		43	43	5,632	839	食品・生活必需品小売り
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		2	2	1,449	215	食品・飲料・タバコ
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES		–	928	6,778	1,009	運輸
COLBUN SA		137	–	–	–	公益事業
EMPRESAS CMPC SA		37	37	5,604	834	素材
EMPRESAS COPEC SA		12	30	19,205	2,861	エネルギー
ENEL CHILE SA		904	904	3,212	478	公益事業
ENERSIS SA		994	994	9,348	1,392	公益事業
FALABELLA SA		24	24	3,852	573	小売
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		7	7	66,953	9,975	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,489	11,573	171,431	25,541	
		12	12	–	<0.5%>	
(コロンビア)				千コロンビア・ペソ		
BANCOLOMBIA SA		7	25	104,455	2,935	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		16	16	52,915	1,487	銀行
ECOPELROL SA		180	180	44,646	1,254	エネルギー
GRUPO DE INV SURAMERICANA		6	–	–	–	各種金融
INTERCONEXION ELECTRICA SA		14	14	27,295	767	公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	226	237	229,313	6,444	
		5	4	–	<0.1%>	
(インド)				千インド・ルピー		
ACC LTD		2	2	701	1,213	素材
ADANI ENTERPRISES LTD		15	15	6,089	10,535	資本財
ADANI GREEN ENERGY LTD		12	18	3,849	6,659	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON		15	33	2,983	5,160	運輸
ADANI POWER LTD		–	51	1,727	2,988	公益事業
ADANI TOTAL GAS LTD		13	16	5,838	10,101	公益事業
ADANI TRANSMISSION LTD		13	16	5,038	8,717	公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD		25	25	1,488	2,575	素材

ニッセイ新興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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3	4	2,177	3,767	ヘルスケア機器・サービス
ASIAN PAINTS LTD	18	22	6,946	12,017	素材
AU SMALL FINANCE BANK LTD	—	11	705	1,220	銀行
AUROBINDO PHARMA LTD	8	8	376	650	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVENUE SUPERMARTS LTD	8	8	3,280	5,676	食品・生活必需品小売り
AXIS BANK LTD	112	131	11,310	19,567	銀行
BAJAJ AUTO LTD	2	2	977	1,690	自動車・自動車部品
BAJAJ FINANCE LTD	12	15	10,635	18,399	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD	1	21	3,474	6,010	各種金融
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	3	3	652	1,129	自動車・自動車部品
BANDHAN BANK LTD	13	35	768	1,330	銀行
BERGER PAINTS INDIA LTD	9	19	1,190	2,059	素材
BHARAT ELECTRONICS LTD	70	212	2,279	3,943	資本財
BHARAT FORGE LTD	4	17	1,504	2,602	自動車・自動車部品
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	50	50	1,536	2,657	エネルギー
BHARTI AIRTEL LTD	120	120	10,122	17,512	電気通信サービス
BIOCON LTD	15	15	456	790	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3	5	2,402	4,155	食品・飲料・タバコ
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	21	21	1,562	2,703	各種金融
CIPLA LIMITED	25	25	2,856	4,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COAL INDIA LTD	120	120	2,761	4,777	エネルギー
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2	7	1,171	2,026	家庭用品・パーソナル用品
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	6	16	1,252	2,166	運輸
DABUR INDIA LTD	37	37	2,077	3,594	家庭用品・パーソナル用品
DIVI'S LABORATORIES LTD	4	7	2,334	4,037	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DLF LTD	21	40	1,609	2,784	不動産
DR. REDDY'S LABORATORIES	6	6	2,738	4,736	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EICHER MOTORS LTD	3	6	2,295	3,970	自動車・自動車部品
GAIL INDIA LTD	42	148	1,339	2,317	公益事業
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	11	26	2,209	3,822	家庭用品・パーソナル用品
GODREJ PROPERTIES LTD	—	6	772	1,335	不動産
GRASIM INDUSTRIES LTD	8	14	2,520	4,360	素材
HAVELLS INDIA LTD	7	14	1,816	3,142	資本財
HCL TECHNOLOGIES LTD	52	61	6,838	11,830	ソフトウェア・サービス
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1	—	—	—	各種金融
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	38	51	2,737	4,735	保険
HERO MOTOCORP LTD	4	7	1,985	3,434	自動車・自動車部品

ニッセイ新興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	
(インド)	百株	百株	千ドル・ピー	千円	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	88	88	3,884	6,719	素材
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	19	19	403	698	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	40	44	11,151	19,292	家庭用品・パーソナル用品
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	81	96	25,670	44,409	各種金融
ICICI BANK LTD	244	288	26,576	45,976	銀行
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	8	14	1,655	2,863	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	11	23	1,101	1,906	保険
INDIAN OIL CORPORATION LTD	59	89	622	1,076	エネルギー
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	-	13	955	1,653	商業・専門サービス
INDRAPRASTHA GAS LTD	10	10	454	786	公益事業
INDUS TOWERS LTD	41	41	820	1,419	電気通信サービス
INFO EDGE INDIA LTD	2	3	1,417	2,452	メディア・娯楽
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	159	187	29,924	51,768	ソフトウェア・サービス
INTERGLOBE AVIATION LTD	2	5	1,002	1,733	運輸
IPCA LABORATORIES LTD	2	-	-	-	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ITC LTD	125	159	5,442	9,416	食品・飲料・タバコ
JINDAL STEEL & POWER LTD	-	27	1,446	2,501	素材
JSW STEEL LTD	30	46	3,292	5,695	素材
JUBILANT FOODWORKS LTD	1	20	1,137	1,968	消費者サービス
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	27	32	6,309	10,915	銀行
LARSEN & TOUBRO LTD	35	40	8,128	14,061	資本財
LTIMINDTREE LIMITED	1	3	1,600	2,769	ソフトウェア・サービス
LUPIN LTD	9	9	653	1,131	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	44	50	6,199	10,725	自動車・自動車部品
MARICO LTD	14	28	1,406	2,433	食品・飲料・タバコ
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	6	6	5,848	10,118	自動車・自動車部品
MINDTREE LTD	-	3	1,079	1,868	ソフトウェア・サービス
MPHASIS LTD	-	4	810	1,402	ソフトウェア・サービス
MRF LTD	0.07	0.07	616	1,066	自動車・自動車部品
MUTHOOT FINANCE LTD	4	4	475	822	各種金融
NESTLE INDIA LTD	1	1	3,546	6,135	食品・飲料・タバコ
NTPC LTD	244	244	4,061	7,026	公益事業
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	79	145	2,065	3,572	エネルギー
PAGE INDUSTRIES LTD	0.14	0.33	1,522	2,634	耐久消費財・アパレル
PETRONET LNG LTD	18	18	397	687	エネルギー
PI INDUSTRIES LTD	3	3	1,095	1,894	素材
PIDILITE INDUSTRIES LTD	12	8	2,256	3,903	素材

ニッセイ新興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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2	-	-	-	各種金融
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	166	166	3,637	6,293	公益事業
REC LTD	13	-	-	-	各種金融
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	134	169	44,118	76,324	エネルギー
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	60	90	653	1,130	自動車・自動車部品
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	10	10	817	1,414	各種金融
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	23	23	2,868	4,962	保険
SHREE CEMENT LTD	0.75	0.75	1,736	3,003	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	12	12	1,519	2,627	各種金融
SRF LTD	-	7	1,731	2,995	素材
STATE BANK OF INDIA	91	105	6,384	11,045	銀行
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	32	51	5,217	9,026	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	43	51	17,108	29,597	ソフトウェア・サービス
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	24	33	2,611	4,518	食品・飲料・タバコ
TATA ELXSI LTD	-	2	1,447	2,504	ソフトウェア・サービス
TATA MOTORS LTD	91	95	4,043	6,994	自動車・自動車部品
TATA STEEL LTD	36	446	4,710	8,149	素材
TECH MAHINDRA LTD	32	32	3,407	5,894	ソフトウェア・サービス
TITAN CO LTD	19	19	4,875	8,433	耐久消費財・アパレル
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2	5	833	1,442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRENT LTD	6	11	1,584	2,742	小売
ULTRATECH CEMENT LTD	4	5	3,666	6,342	素材
UNITED SPIRITS LTD	10	18	1,575	2,724	食品・飲料・タバコ
UPL LTD	16	25	1,963	3,397	素材
VEDANTA LTD	68	47	1,463	2,531	素材
WIPRO LTD	67	67	2,640	4,568	ソフトウェア・サービス
ZOMATO LTD	-	78	529	916	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,383 99	4,875 105	415,573 -	718,943 <13.2%>
(インドネシア)			千インドネシア・ルピア		
ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	271	842	302,278	2,720	エネルギー
ADARO MINERALS INDONESIA TBK	-	529	95,749	861	素材
ANEKA TAMBANG TBK	-	532	104,272	938	素材
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,220	1,220	759,450	6,835	自動車・自動車部品
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	2,684	3,297	2,909,602	26,186	銀行
BANK JAGO TBK PT	-	224	137,200	1,234	銀行
BANK MANDIRI TBK	1,081	1,081	1,099,917	9,899	銀行

ニッセイ新興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		
(インドネシア)		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER		232	487	448,040	4,032	銀行
BANK RAKYAT INDONESIA		2,834	3,757	1,731,977	15,587	銀行
BARITO PACIFIC TBK PT		885	885	72,570	653	素材
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT		226	455	266,175	2,395	食品・飲料・タバコ
GUDANG GARAM TBK PT		11	11	23,182	208	食品・飲料・タバコ
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK		60	60	59,250	533	素材
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA		75	-	-	-	素材
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T		96	96	92,640	833	食品・飲料・タバコ
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT		104	104	67,600	608	食品・飲料・タバコ
INTERNATIONAL NICKEL INDONES		-	181	124,890	1,124	素材
KALBE FARMA TBK PT		569	569	117,214	1,054	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT		628	628	276,948	2,492	素材
SARANA MENARA NUSANTARA PT		1,626	1,626	186,990	1,682	電気通信サービス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK		94	94	72,615	653	素材
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P		-	998	282,434	2,541	食品・生活必需品小売り
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT		2,690	2,690	1,078,690	9,708	電気通信サービス
UNILEVER INDONESIA TBK PT		235	491	227,824	2,050	家庭用品・パーソナル用品
UNITED TRACTORS TBK PT		50	106	305,280	2,747	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,671 20	20,963 24	10,842,788 -	97,585 <1.8%>	
(ブラジル)				千ブラジル・リアル		
ALPARGATAS SA - PREF		11	-	-	-	耐久消費財・アパレル
AMBEV SA		230	268	418	10,911	食品・飲料・タバコ
AMERICANAS SA		23	38	39	1,031	小売
ATACADAO SA		19	19	30	782	食品・生活必需品小売り
BANCO BRADESCO S.A.		102	63	83	2,178	銀行
BANCO BRADESCO SA-PREF		218	329	514	13,419	銀行
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		48	69	171	4,476	各種金融
BANCO DO BRASIL SA		57	57	195	5,108	銀行
BANCO INTER SA-UNITS		12	-	-	-	銀行
BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL		13	30	83	2,178	銀行
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES		22	39	117	3,066	保険
BM&FBOVESPA SA		269	349	414	10,798	各種金融
BRADESCO SA -PREF		5	-	-	-	素材
BRF SA		16	43	43	1,145	食品・飲料・タバコ
CCR SA		38	68	77	2,008	運輸
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIR		7	69	303	7,919	公益事業

ニッセイ新興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		
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7	7	33	867	公益事業	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	33	84	87	2,284	公益事業	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	30	-	-	-	公益事業	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	10	22	121	3,166	公益事業	
COSAN SA	56	56	95	2,488	エネルギー	
CPFL ENERGIA SA	6	-	-	-	公益事業	
ENERGISA SA-UNITS	6	6	26	695	公益事業	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6	6	26	697	公益事業	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	53	53	145	3,800	公益事業	
GERDAU SA-PREF	62	62	184	4,820	素材	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	35	276	156	4,087	ヘルスケア機器・サービス	
HYPERA S.A	11	26	116	3,029	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	239	282	752	19,617	銀行	
ITAUSA SA	244	282	251	6,553	銀行	
JBS SA	42	42	96	2,524	食品・飲料・タバコ	
KLABIN SA - UNIT	19	40	88	2,300	素材	
LOCALIZA RENT A CAR	19	41	252	6,585	運輸	
LOJAS RENNER S.A.	59	59	144	3,767	小売	
MAGAZINE LUIZA SA	152	152	47	1,248	小売	
NATURA &CO HOLDING SA	42	42	51	1,347	家庭用品・パーソナル用品	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	29	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
PETRO RIO SA	-	38	131	3,417	エネルギー	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	184	211	641	16,714	エネルギー	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	198	271	723	18,861	エネルギー	
RAIA DROGASIL SA	40	59	136	3,568	食品・生活必需品小売り	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	14	25	71	1,860	ヘルスケア機器・サービス	
RUMO SA	34	72	138	3,614	運輸	
SUZANO S.A.	37	37	214	5,585	素材	
TELEFONICA BRASIL S.A.	36	27	104	2,724	電気通信サービス	
TIM SA	35	35	44	1,169	電気通信サービス	
TOTVS SA	25	25	73	1,923	ソフトウェア・サービス	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	22	22	28	753	エネルギー	
VALE SA	188	228	1,847	48,152	素材	
VIA SA	38	-	-	-	小売	
VIBRA ENERGIA SA	69	69	118	3,088	小売	
WEG SA	85	85	334	8,723	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,262 51	4,188 45	9,785 -	255,065 <4.7%>	

ニッセイ新興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	
(チェコ)		百株	百株	千チェコ・コルナ	千円	
CEZ AS		5	10	832	4,945	公益事業
KOMERCNI BANKA AS		6	6	489	2,911	銀行
MONETA MONEY BANK AS		11	11	81	484	銀行
小計	株数・金額	23	27	1,403	8,342	
	銘柄数<比率>	3	3	-	<0.2%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
ALTEOGEN INC		0.82	0.98	4,027	420	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMOREPACIFIC CORP		1	1	20,500	2,138	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC GROUP		0.60	3	9,668	1,008	家庭用品・パーソナル用品
BGF RETAIL CO LTD/NEW		0.15	0.15	2,925	305	食品・生活必需品小売り
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD		4	4	28,251	2,946	ヘルスケア機器・サービス
CELLTRION INC		4	5	100,570	10,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEIL WORLDWIDE INC		1	1	3,207	334	メディア・娯楽
CJ CHEILJEDANG CORP		0.26	0.61	24,064	2,509	食品・飲料・タバコ
CJ CORP		0.53	0.53	4,096	427	資本財
CJ ENM CO LTD		0.28	0.28	2,301	240	メディア・娯楽
CJ LOGISTICS		0.16	0.16	1,432	149	運輸
COWAY CO LTD		1	3	18,033	1,880	耐久消費財・アパレル
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE		1	-	-	-	資本財
DAUM COMMUNICATIONS CORP		14	17	103,340	10,778	メディア・娯楽
DB INSURANCE CO LTD		1	1	9,418	982	保険
DOOSAN BOBCAT INC		2	2	10,988	1,146	資本財
DOUZONE BIZON CO LTD		0.95	-	-	-	ソフトウェア・サービス
ECOPRO BM CO LTD		0.69	2	30,166	3,146	資本財
E-MART CO LTD		0.63	0.63	5,808	605	食品・生活必需品小売り
F&F CO LTD / NEW		-	0.90	14,310	1,492	耐久消費財・アパレル
FILA HOLDINGS CORP		1	-	-	-	耐久消費財・アパレル
GREEN CROSS CORP		0.38	0.38	5,092	531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GS ENGINEERING & CONSTRUCT		1	1	4,389	457	資本財
GS HOLDINGS CORP		4	4	18,844	1,965	資本財
HANA FINANCIAL GROUP		16	16	68,558	7,150	銀行
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD		1	5	17,841	1,860	自動車・自動車部品
HANMI PHARM CO LTD		0.21	0.58	15,399	1,606	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS		9	9	8,419	878	自動車・自動車部品
HANWHA SOLUTIONS CORP		6	6	31,075	3,241	素材
HD HYUNDAI		1	3	22,706	2,368	エネルギー
HLB INC		3	5	21,394	2,231	ヘルスケア機器・サービス

ニッセイ新興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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
HLB INC-RIGHTS	－	0.52	333	34	ヘルスケア機器・サービス
HMM CO LTD	12	12	24,786	2,585	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD	0.99	0.99	7,167	747	小売
HYBE CO LTD	0.54	0.99	13,563	1,414	メディア・娯楽
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2	4	19,457	2,029	資本財
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	0.59	1	22,794	2,377	運輸
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	－	1	15,040	1,568	資本財
HYUNDAI MOBIS	3	3	74,736	7,794	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	6	7	132,379	13,807	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2	2	19,621	2,046	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	0.45	1	13,753	1,434	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	2	5	17,424	1,817	素材
ILJIN MATERIALS CO LTD	－	1	8,202	855	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	7	22	23,814	2,483	銀行
KAKAO GAMES CORP	－	1	6,805	709	メディア・娯楽
KAKAOBANK CORP	－	7	20,719	2,161	銀行
KANGWON LAND INC	3	3	8,609	898	消費者サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	18	21	106,036	11,059	銀行
KIA CORPORATION	12	15	99,528	10,380	自動車・自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3	5	23,612	2,462	資本財
KOREA ELECTRIC POWER CORP	7	13	25,826	2,693	公益事業
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1	1	7,728	806	各種金融
KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2	2	17,338	1,808	資本財
KOREA ZINC CO LTD	0.26	0.53	34,344	3,582	素材
KOREAN AIR LINES CO LTD	6	11	30,189	3,148	運輸
KRAFTON INC	－	1	34,500	3,598	メディア・娯楽
KT&G CORP	6	4	45,315	4,726	食品・飲料・タバコ
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1	1	14,847	1,548	素材
L&F CO LTD	－	1	24,595	2,565	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD	2	2	195,712	20,412	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	0.15	0.56	18,004	1,877	素材
LG CORP	2	5	46,981	4,900	資本財
LG DISPLAY CO LTD	7	13	19,735	2,058	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG ELECTRONICS INC	5	6	58,144	6,064	耐久消費財・アパレル
LG ENERGY SOLUTION	－	1	86,710	9,043	資本財
LG H AND H CO LTD	0.48	0.64	42,432	4,425	家庭用品・パーソナル用品
LG H AND H CO LTD-PFD	0.04	0.04	1,250	130	家庭用品・パーソナル用品

ニッセイ新興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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
LG INNOTEK CO LTD	0.42	0.83	25,522	2,661	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13	13	12,596	1,313	各種金融
LG UPLUS CORP	8	8	9,820	1,024	電気通信サービス
LOTTE CHEMICAL CORP	0.47	1	18,871	1,968	素材
LOTTE SHOPPING CO	0.22	0.22	1,922	200	小売
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	—	2	10,101	1,053	保険
MERITZ SECURITIES CO LTD	10	10	4,815	502	各種金融
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	13	13	8,567	893	各種金融
NAVER CORP	5	7	138,754	14,472	メディア・娯楽
NCSoft CORPORATION	0.86	0.86	38,786	4,045	メディア・娯楽
NETMARBLE CORPORATION	0.58	0.58	3,010	313	メディア・娯楽
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	0.92	0.92	10,166	1,060	食品・飲料・タバコ
PEARL ABYSS CORP	0.65	1	6,876	717	メディア・娯楽
POSCO CHEMICAL CO LTD	0.74	1	34,720	3,621	素材
POSCO HOLDINGS INC	3	4	123,616	12,893	素材
S-1 CORPORATION	0.32	0.32	2,057	214	商業・専門サービス
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	0.85	1	90,846	9,475	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG C&T CORP	4	4	55,525	5,791	資本財
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	3	3	46,536	4,853	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	225	266	1,644,930	171,566	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	38	46	265,971	27,740	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	3	8	20,976	2,187	資本財
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	1	1	34,338	3,581	保険
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	11	32	17,455	1,820	資本財
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	2	4	29,060	3,031	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	2	3	222,918	23,250	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG SDS CO LTD	1	1	23,715	2,473	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4	4	15,481	1,614	各種金融
SD BIOSENSOR INC	—	2	7,651	798	ヘルスケア機器・サービス
SEEGENE INC	1	1	3,613	376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	0.89	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	20	26	95,069	9,915	銀行
SHINSEGAE CO LTD	0.14	—	—	—	小売
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1	1	11,780	1,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SK BIOSCIENCE CO LTD	—	1	10,511	1,096	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	0.36	0.36	3,726	388	素材
SK HYNIX INC	26	30	273,156	28,490	半導体・半導体製造装置

ニッセイ新興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	
(韓国)		百株	百株	千韓国ウォン	千円	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD		0.91	1	11,167	1,164	素材
SK INC		1	2	42,833	4,467	資本財
SK INNOVATION CO LTD		2	3	57,960	6,045	エネルギー
SK SQUARE CO LTD		-	5	20,867	2,176	半導体・半導体製造装置
SK TELECOM CO LTD		0.68	-	-	-	電気通信サービス
SKC CO LTD		1	1	13,996	1,459	素材
S-OIL CORPORATION		1	3	26,460	2,759	エネルギー
STX PAN OCEAN CO LTD		4	18	9,667	1,008	運輸
WOORI FINANCIAL GROUP INC		34	38	44,779	4,670	銀行
YUHAN CORP		1	1	9,301	970	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	666	875	5,529,370	576,713	
	銘柄数<比率>	102	109	-	<10.6%>	
(中国)				千人民元		
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A		45	45	32	641	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A		-	5	54	1,069	半導体・半導体製造装置
AECC AVIATION POWER CO-A		10	10	43	861	資本財
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A		338	338	94	1,852	銀行
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A		9	35	100	1,970	ヘルスケア機器・サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A		10	10	27	547	素材
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A		-	3	71	1,398	食品・飲料・タバコ
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A		-	1	21	419	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS		92	92	29	576	各種金融
BANK OF BEIJING CO LTD -A		86	86	35	702	銀行
BANK OF CHINA LTD-A		45	321	97	1,917	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A		37	222	101	1,993	銀行
BANK OF JIANGSU CO LTD-A		-	78	54	1,078	銀行
BANK OF NINGBO CO LTD -A		17	17	48	957	銀行
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A		45	45	26	511	銀行
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A		57	57	30	595	素材
BBMG CORPORATION-A		141	141	35	703	素材
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A		-	2	59	1,160	ソフトウェア・サービス
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A		-	4	62	1,226	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A		197	197	93	1,830	運輸
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A		110	110	39	782	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BYD CO LTD -A		7	7	178	3,502	自動車・自動車部品
CAITONG SECURITIES CO LTD-A		-	75	56	1,112	各種金融
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A		1	1	17	346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	—	123	69	1,358	各種金融
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	—	96	51	1,012	銀行
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	57	32	79	1,557	資本財
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	68	68	34	677	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	97	97	27	537	銀行
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	69	69	66	1,316	各種金融
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	10	10	32	630	保険
CHINA MERCHANTS BANK-A	69	69	221	4,347	銀行
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	27	27	35	702	各種金融
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	19	19	27	531	不動産
CHINA MINSHENG BANKING-A	212	212	72	1,416	銀行
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	106	106	64	1,276	公益事業
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	16	16	41	816	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	15	15	34	676	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	84	84	35	701	エネルギー
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	88	88	46	904	資本財
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	171	171	78	1,533	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20	20	56	1,111	エネルギー
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	47	47	33	650	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	108	108	56	1,109	資本財
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	—	128	72	1,425	公益事業
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	5	8	152	2,998	小売
CHINA VANKE CO LTD -A	22	22	34	676	不動産
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	45	90	189	3,722	公益事業
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	—	5	59	1,166	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	—	246	70	1,391	銀行
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	—	58	69	1,359	自動車・自動車部品
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4	4	38	747	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITIC SECURITIES CO-A	28	28	53	1,053	各種金融
CMOC GROUP LTD-A	113	113	52	1,041	素材
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	7	9	342	6,733	資本財
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	50	50	59	1,177	運輸
CSC FINANCIAL CO LTD-A	26	26	66	1,314	各種金融
EAST MONEY INFORMATION CO-A	41	50	91	1,791	各種金融
EVE ENERGY CO LTD-A	9	9	75	1,481	資本財
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	59	59	35	694	メディア・娯楽
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	9	10	73	1,453	食品・飲料・タバコ

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	－	83	56	1,108	各種金融
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	26	26	23	457	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	5	7	56	1,104	素材
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	－	132	54	1,078	公益事業
GF SECURITIES CO LTD-A	37	37	57	1,133	各種金融
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	1	1	20	399	半導体・半導体製造装置
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	－	2	39	774	資本財
GOERTEK INC -A	10	10	18	363	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	－	18	58	1,149	資本財
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	7	7	20	399	自動車・自動車部品
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	－	32	101	1,996	耐久消費財・アパレル
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	－	10	59	1,172	食品・飲料・タバコ
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	－	54	55	1,089	エネルギー
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	33	13	38	764	ヘルスケア機器・サービス
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	5	10	44	878	素材
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	－	98	61	1,201	各種金融
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	112	112	101	1,984	各種金融
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	33	33	45	895	各種金融
HAIER SMART HOME CO LTD-A	20	20	48	943	耐久消費財・アパレル
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	29	29	25	501	各種金融
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	－	8	56	1,118	半導体・半導体製造装置
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	8	8	20	394	食品・飲料・タバコ
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	28	28	45	895	素材
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	－	28	45	886	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	－	57	40	791	素材
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	－	4	38	766	素材
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	29	－	－	－	各種金融
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	－	13	56	1,117	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG POWER INTL INC-A	－	77	57	1,127	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	21	21	27	534	各種金融
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	41	41	33	657	各種金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	62	62	30	602	銀行
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	14	14	24	490	自動車・自動車部品
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	61	－	－	－	保険
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	－	5	55	1,092	自動車・自動車部品
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	9	11	51	1,015	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	12	12	41	821	ソフトウェア・サービス

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	—	1	49	967	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IND & COMM BK OF CHINA-A	280	280	116	2,294	銀行
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	47	89	144	2,836	銀行
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	324	324	63	1,254	素材
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	21	21	8	172	素材
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	12	28	81	1,601	食品・飲料・タバコ
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	—	9	56	1,116	半導体・半導体製造装置
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	—	29	38	760	素材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	—	10	64	1,272	資本財
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	15	33	136	2,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	4	4	58	1,147	食品・飲料・タバコ
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	50	22	41	812	資本財
JIANGXI COPPER CO LTD-A	20	20	34	668	素材
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	4	4	626	12,316	食品・飲料・タバコ
LB GROUP CO LTD-A	—	29	50	984	素材
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	24	24	25	499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	—	139	68	1,343	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	14	30	144	2,844	半導体・半導体製造装置
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	16	30	100	1,979	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4	4	74	1,455	食品・飲料・タバコ
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	—	13	34	683	メディア・娯楽
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	—	4	58	1,150	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	205	205	63	1,248	資本財
MUYUAN FOODS CO LTD-A	11	21	103	2,030	食品・飲料・タバコ
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	21	25	68	1,344	資本財
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	2	2	46	905	半導体・半導体製造装置
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	9	9	24	472	保険
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	18	18	24	476	食品・飲料・タバコ
NINESTAR CORP-A	—	17	96	1,894	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	—	7	47	939	自動車・自動車部品
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	—	44	57	1,132	素材
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	—	45	39	779	各種金融
PETROCHINA CO LTD-A	69	69	34	677	エネルギー
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	—	4	31	615	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PICC HOLDING CO-A	149	149	73	1,449	保険
PING AN BANK CO LTD-A	44	97	112	2,208	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	37	37	155	3,064	保険

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	27	27	42	825	不動産
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	122	122	51	1,013	銀行
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	100	100	71	1,400	資本財
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	-	27	66	1,298	素材
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	30	30	36	713	素材
S F HOLDING CO LTD-A	10	22	115	2,268	運輸
SAIC MOTOR CORP LTD-A	21	21	30	594	自動車・自動車部品
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	12	-	-	-	半導体・半導体製造装置
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	30	30	46	912	資本財
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	-	57	59	1,160	公益事業
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	-	23	46	916	不動産
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	80	47	90	1,780	エネルギー
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	4	4	9	177	素材
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	-	19	56	1,109	素材
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	-	13	54	1,074	ソフトウェア・サービス
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	63	63	25	506	資本財
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	7	7	26	528	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	210	86	45	890	運輸
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	51	51	62	1,229	不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	67	67	46	909	銀行
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	-	8	44	873	素材
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	56	56	31	616	各種金融
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	2	4	126	2,482	食品・飲料・タバコ
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	1	1	11	217	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	110	110	44	881	各種金融
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	-	1	25	506	素材
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	1	-	-	-	半導体・半導体製造装置
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	15	15	106	2,092	資本財
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	3	4	18	357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5	5	163	3,207	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	-	3	25	492	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	19	19	16	331	各種金融
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	5	5	57	1,128	資本財
SUNING.COM CO LTD-A	44	-	-	-	小売
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	-	1	46	911	資本財
TBEA CO LTD-A	-	22	47	935	資本財
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	40	40	17	341	耐久消費財・アパレル

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	15	15	68	1,340	半導体・半導体製造装置
TIANMA MICROELECTRONICS-A	72	72	67	1,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGWEI CO LTD-A	15	15	65	1,294	食品・飲料・タバコ
TRINA SOLAR CO LTD-A	–	10	70	1,379	半導体・半導体製造装置
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	–	6	59	1,164	食品・飲料・タバコ
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	3	4	59	1,164	半導体・半導体製造装置
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	9	9	18	372	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	9	15	133	2,622	素材
WEICHAI POWER CO LTD-A	34	34	35	690	資本財
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	18	18	31	617	食品・飲料・タバコ
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	97	97	62	1,223	各種金融
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	1	4	34	679	半導体・半導体製造装置
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2	2	11	229	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	51	51	22	442	小売
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	–	40	49	965	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	12	15	230	4,527	食品・飲料・タバコ
WUXI APPTTEC CO LTD-A	6	6	58	1,142	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	26	26	13	256	資本財
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	–	39	44	878	資本財
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	–	13	55	1,084	食品・飲料・タバコ
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	16	16	43	863	ソフトウェア・サービス
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	–	25	49	967	運輸
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	5	7	40	798	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	3	3	46	906	素材
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3	3	78	1,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	–	11	31	618	資本財
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	–	30	37	738	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	5	6	40	803	素材
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	–	8	53	1,059	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	8	10	19	386	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	20	20	21	422	各種金融
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	71	71	68	1,344	素材
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	94	94	53	1,047	資本財
ZTE CORP-A	7	7	17	345	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,699 146	9,244 201	12,347 –	242,590 <4.5%>

ニッセイ新興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	
(マレーシア)	百株	百株	マレーシア・リンギット	千円	
AMBANK HOLDINGS BHD	97	97	38	1,182	銀行
AXIATA GROUP BERHAD	87	205	58	1,788	電気通信サービス
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	403	403	218	6,675	銀行
DIALOG GROUP BHD	149	149	31	958	エネルギー
DIGI.COM BHD	96	225	87	2,666	電気通信サービス
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	3	-	-	-	食品・飲料・タバコ
GENTING BHD	67	67	30	919	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BHD	113	113	30	937	消費者サービス
HAP SENG CONSOLIDATED	11	11	7	218	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	47	47	8	260	ヘルスケア機器・サービス
HONG LEONG BANK BERHAD	22	45	92	2,846	銀行
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	19	19	35	1,092	銀行
IHH HEALTHCARE BHD	63	63	37	1,151	ヘルスケア機器・サービス
INARI AMERTRON BHD	-	166	42	1,311	半導体・半導体製造装置
IOI CORPORATION BHD	54	197	80	2,472	食品・飲料・タバコ
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	38	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	11	34	72	2,229	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	233	287	245	7,521	銀行
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	49	49	29	910	運輸
MAXIS BHD	196	196	75	2,298	電気通信サービス
MISC BHD	50	50	36	1,102	運輸
MR DIY GROUP M BHD	-	163	32	998	小売
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2	2	26	797	食品・飲料・タバコ
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	78	133	114	3,510	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	7	7	15	489	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	22	22	37	1,149	公益事業
PPB GROUP BERHAD	18	18	30	938	食品・飲料・タバコ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	140	230	109	3,344	素材
PUBLIC BANK BHD	644	874	376	11,533	銀行
QL RESOURCES BHD	30	30	16	500	食品・飲料・タバコ
RHB BANK BHD	49	49	27	828	銀行
SIME DARBY BERHAD	48	48	10	323	資本財
SIME DARBY PLANTATION BHD	77	77	33	1,016	食品・飲料・タバコ
SUPERMAX CORP BHD	47	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
TELEKOM MALAYSIA BHD	22	22	11	360	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	129	129	108	3,309	公益事業
TOP GLOVE CORP BHD	144	341	31	965	ヘルスケア機器・サービス

ニッセイ新興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	
(マレーシア)		百株	百株	マレーシア・リンギット	千円	
WESTPORTS HOLDINGS BHD		18	-	-	-	運輸
小計	株数・金額	3,283	4,568	2,240	68,608	
	銘柄数<比率>	36	34	-	<1.3%>	
(南アフリカ)				千南アフリカ・ランド		
ABSA GROUP LTD		47	47	955	7,756	銀行
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD		6	6	186	1,515	素材
ANGLO PLATINUM LTD		1	2	472	3,840	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		21	28	837	6,800	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		22	22	336	2,735	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BID CORP LTD		19	19	594	4,826	食品・生活必需品小売り
BIDVEST GROUP LTD		8	17	371	3,017	資本財
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		4	5	1,066	8,663	銀行
CLICKS GROUP LTD		7	12	372	3,021	食品・生活必需品小売り
DISCOVERY HOLDINGS LIMITED		11	24	299	2,432	保険
EXXARO RESOURCES LTD		7	15	320	2,603	エネルギー
FIRSTSTRAND LTD		265	299	1,956	15,890	各種金融
GOLD FIELDS LTD		37	46	844	6,858	素材
HARMONY GOLD MINING CO LTD		14	38	220	1,794	素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD		45	45	897	7,287	素材
KUMBA IRON ORE LTD		2	4	212	1,728	素材
MR PRICE GROUP LTD		6	13	258	2,098	小売
MTN GROUP LTD		85	99	1,310	10,637	電気通信サービス
MULTICHOICE GROUP LTD		13	13	156	1,274	メディア・娯楽
NASPERS LTD-N SHS		10	12	3,152	25,597	小売
NEDBANK GROUP LTD		14	25	554	4,505	銀行
NEPI ROCKCASTLE S.A.		12	12	120	976	不動産
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT		12	19	375	3,050	素材
OLD MUTUAL LTD		151	287	320	2,600	保険
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL		18	-	-	-	保険
REINET INVESTMENTS SCA		3	7	226	1,838	各種金融
REMGRO LTD		16	27	376	3,056	各種金融
SANLAM LIMITED		97	97	533	4,334	保険
SASOL LTD		21	30	915	7,437	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD		14	25	627	5,093	食品・生活必需品小売り
SIBANYE STILLWATER LTD		124	156	695	5,650	素材
SPAR GROUP LIMITED/THE		5	5	81	664	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD		65	78	1,397	11,344	銀行

ニッセイ新興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	
(南アフリカ)		百株	百株	千円	千円	
TIGER BRANDS LTD		5	-	-	-	食品・飲料・タバコ
VODACOM GROUP LTD		42	42	513	4,167	電気通信サービス
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		29	60	407	3,308	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,272 36	1,650 34	21,971 -	178,409 <3.3%>	
(タイ)				千タイ・パーツ		
ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG		38	66	1,254	4,890	電気通信サービス
AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR		255	255	1,887	7,359	運輸
ASSET WORLD CORP PCL-FOREIGN		881	881	515	2,010	消費者サービス
B GRIMM POWER PCL-FOREIGN		31	31	113	444	公益事業
BANGKOK COMMERCIAL-FOREIGN		90	90	137	537	各種金融
BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F		597	597	1,746	6,810	ヘルスケア機器・サービス
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN		236	236	223	869	運輸
BERLI JUCKER PUB CO-FORGN		60	60	204	795	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL		202	574	464	1,813	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN		13	39	826	3,224	ヘルスケア機器・サービス
CARABAO GROUP PCL-F		-	26	250	978	食品・飲料・タバコ
CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI		72	126	866	3,378	不動産
CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN		67	67	281	1,097	消費者サービス
CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN		268	268	653	2,550	食品・飲料・タバコ
CP ALL PCL-FOREIGN		293	343	2,152	8,394	食品・生活必需品小売り
ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R		10	10	168	655	公益事業
ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN		42	89	836	3,262	公益事業
GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F		24	24	159	622	公益事業
GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN		75	173	873	3,407	公益事業
HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR		184	184	272	1,062	小売
INDORAMA VENTURES-FOREIGN		51	122	518	2,022	素材
INTOUCH HOLDINGS PCL-F		63	63	467	1,824	電気通信サービス
JMT NETWORK SERVICES-FOREIGN		-	57	370	1,444	各種金融
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN		-	49	700	2,732	銀行
KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI		114	323	562	2,191	銀行
KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN		54	54	315	1,232	各種金融
LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG		1,229	285	265	1,033	不動産
MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR		71	185	559	2,182	消費者サービス
MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG		21	21	74	288	各種金融
OSOTSPA PCL-FOREIGN		32	32	90	352	食品・生活必需品小売り
PTT EXPLORATION & PROD-FOR		48	79	1,477	5,761	エネルギー

ニッセイ新興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	
(タイ)		百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR		72	143	675	2,635	素材
PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN		142	142	343	1,340	小売
PTT PCL/FOREIGN		526	526	1,762	6,872	エネルギー
RATCH GROUP PCL-FOREIGN		23	23	92	361	公益事業
SCB X PCL-FOREIGN		-	68	717	2,797	銀行
SCG PACKAGING PCL-FOREIGN		73	73	410	1,601	素材
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG		42	42	1,444	5,634	素材
SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG		28	-	-	-	銀行
SRISAWADCORP PCL - FOREIGN		24	24	100	393	各種金融
THAI OIL PCL-FRGN		24	93	506	1,976	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-F		98	98	168	657	食品・飲料・タバコ
TRUE CORP PCL-FOREIGN		364	1,013	500	1,951	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,537 39	7,654 42	26,013 -	101,451 <1.9%>	
(ポーランド)				千ポーランド・ズロチ		
ALLEGRO.EU SA		16	16	39	1,207	小売
BANK PEKAO SA		6	11	98	3,038	銀行
CD PROJEKT SA		2	4	61	1,907	メディア・娯楽
CYFROWY POLSAT SA		10	10	18	561	メディア・娯楽
DINO POLSKA SA		2	2	104	3,211	食品・生活必需品小売り
KGHM POLSKA MIEDZ SA		4	8	95	2,942	素材
LPP SA		0.04	0.04	37	1,139	耐久消費財・アパレル
ORANGE POLSKA SA		13	13	8	269	電気通信サービス
PGE SA		17	17	11	359	公益事業
PKO BANK POLSKI SA		50	50	140	4,340	銀行
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		18	40	256	7,902	エネルギー
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO		54	-	-	-	エネルギー
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		19	34	101	3,133	保険
SANTANDER BANK POLSKA S.A.		1	1	42	1,315	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	216 14	211 13	1,016 -	31,330 <0.6%>	
(ハンガリー)				千ハンガリー・フォリント		
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL		9	26	7,123	2,536	エネルギー
OTP BANK RT		11	11	11,849	4,219	銀行
RICHTER GEDEON NYRT		4	8	7,000	2,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	24 3	46 3	25,973 -	9,249 <0.2%>	

ニッセイ新興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/ギリシャ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
	FF GROUP	1	1	0.619	89	小売
	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	15	15	23	3,444	電気通信サービス
	JUMBO SA	9	9	14	2,169	小売
	MYTILINEOS S.A.	–	13	22	3,238	資本財
	OPAP SA	18	18	23	3,353	消費者サービス
	PUBLIC POWER CORP	–	27	17	2,579	公益事業
小計	株数・金額	45	85	102	14,874	
	銘柄数<比率>	4	6	–	<0.3%>	
合計	株数・金額	106,818	137,055	–	4,419,549	
	銘柄数<比率>	966	1,000	–	<81.4%>	

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

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

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

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

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千□	千□	千米ドル	千円
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF		21	31	491	68,990
ISHARES MSCI QATAR CP ETF		14	19	406	57,094
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF		30	38	1,544	216,722
ISHARES MSCI KUWAIT ETF		6	8	306	43,026
小計	□数・金額	72	97	2,748	385,834
	銘柄数<比率>	4	4	—	<7.1%>
(メキシコ)				千メキシコ・ペソ	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		8	18	441	3,185
小計	□数・金額	8	18	441	3,185
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>
(南アフリカ)				千南アフリカ・ランド	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		9	19	271	2,205
小計	□数・金額	9	19	271	2,205
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>
合計	□数・金額	90	136	—	391,225
	銘柄数<比率>	6	6	—	<7.2%>

(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
外国		百万円	百万円
	MINI MSCI EM INDEX FUTURES	604	—

(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

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	4,419,549	80.7
投資信託証券	391,225	7.1
コール・ローン等、その他	665,161	12.1
投資信託財産総額	5,475,936	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相場の中値により邦貨換算したものです。なお11月21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1香港ドル17.95円、1台湾ドル4.506円、1イギリス・ポンド166.59円、1トルコ・リラ7.54円、1メキシコ・ペソ7.213円、1フィリピン・ペソ2.45円、100チリ・ペソ14.899円、100コロンビア・ペソ2.81円、1インド・ルピー1.73円、100インドネシア・ルピア0.90円、1ブラジル・レアル26.066円、1チェコ・コルナ5.944円、100韓国ウォン10.43円、1人民元19.647円、1マレーシア・リンギット30.617円、1南アフリカ・ランド8.12円、1タイ・バーツ3.90円、1ポーランド・ズロチ30.809円、100ハンガリー・フォリント35.61円、1ユーロ144.81円です。

(注2) 外貨建純資産 (5,031,270千円) の投資信託財産総額 (5,475,936千円) に対する比率は91.9%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ新興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

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	5,852,803,817円
コーポレート債	499,365,672
株式(評価額)	4,419,549,027
投資信託証券(評価額)	391,225,123
未収入金	398,473,458
未収配当金	2,170,315
差入委託証拠金	142,020,222
(B)負債	423,866,200
未払金	407,999,913
未払解約金	15,865,991
その他未払費用	296
(C)純資産総額(A-B)	5,428,937,617
元本	4,729,645,782
次期繰越損益金	699,291,835
(D)受益権総口数	4,729,645,782口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,479円

(注1) 期首元本額 3,649,078,821円
 期中追加設定元本額 1,909,977,624円
 期中一部解約元本額 829,410,663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。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド 2,726,076,259円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式) 16,946,776円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート) 24,304,522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) 10,380,272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) 57,534,817円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド (GDP型バスケット) 410,879,411円
 ニッセイ新興国株式インデックス (ラップ専用) 216,604,789円
 FWニッセイ新興国株インデックス 5,451,850円
 DCニッセイ新興国株インデックス 1,261,467,086円

損益の状況

当期 (2021年11月23日~2022年11月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	133,242,298円
受取配当金	132,280,832
受取利息	422,842
その他収益金	659,685
支払利息	△ 121,061
(B)有価証券売買損益	△ 312,829,512
売買益	1,045,493,161
売買損	△ 1,358,322,673
(C)先物取引等損益	△ 96,877,785
取引益	34,847,458
取引損	△ 131,725,243
(D)信託報酬等	△ 13,536,310
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△ 290,001,309
(F)前期繰越損益金	818,622,278
(G)追加信託差損益金	305,518,018
(H)解約差損益金	△ 134,847,152
(I)合計(E+F+G+H)	699,291,835
次期繰越損益金(I)	699,291,835

(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。

指数に関して

■ファンドのベンチマーク等について

- ・MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCI エマージング・マーケット・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。