

第5期末（2023年11月20日）

基準価額	14,724円
純資産総額	21億円
騰落率	13.3%
分配金	0円

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



NISSAY
ASSET MANAGEMENT

ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

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:2022年11月22日～2023年11月20日

第5期(決算日 2023年11月20日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「DCニッセイ新興国株式インデックス」は、このたび第5期の決算を行いました。

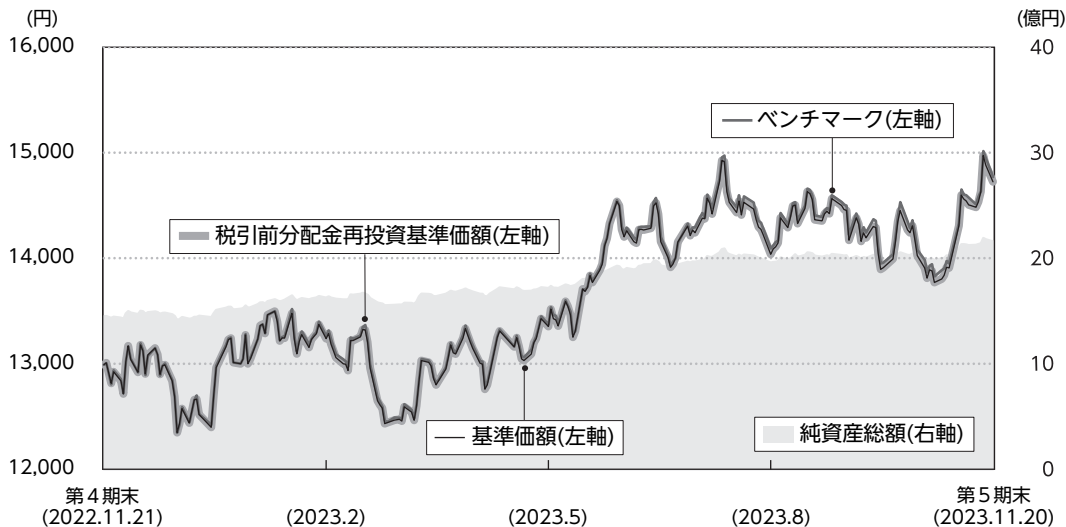
当ファンドは、「ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に新興国の株式等に投資することにより、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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

2022年11月22日～2023年11月20日

基準価額等の推移



第5期首	12,990円	既払分配金	0円
第5期末	14,724円	騰落率 (分配金再投資ベース)	13.3%

(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>

- ・2023年1月に中国における経済活動再開の動きや米金融政策転換への期待感の高まりを背景に株価が上昇したこと
- ・6月から7月にかけて、中国における景気支援策への期待感や米国の金融引き締めに対する過度な懸念の後退を受けて株価が上昇したこと

<下落要因>

- ・2023年9月から10月にかけて、中国における景気の見通しや不動産市場の不透明感、地政学リスクへの懸念等を背景に株価が下落したこと

1万口当たりの費用明細

項目	第5期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	40円	0.294%	信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は13,625円です。
(投信会社)	(19)	(0.136)	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)	(19)	(0.136)	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	4	0.030	
(株式)	(2)	(0.017)	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)	(2)	(0.012)	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)	(0.001)	
有価証券取引税	3	0.025	
(株式)	(3)	(0.025)	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	34	0.246	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)	(0.172)	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)	(9)	(0.065)	・ 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	81	0.595	

(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。

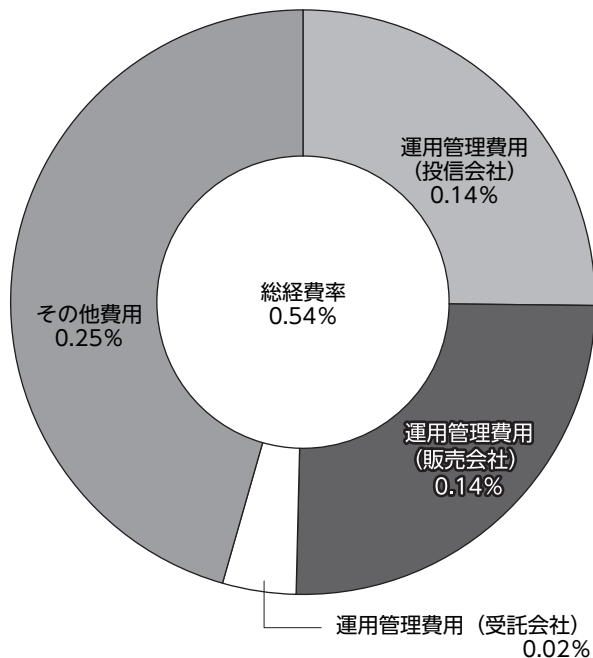
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.54%**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。

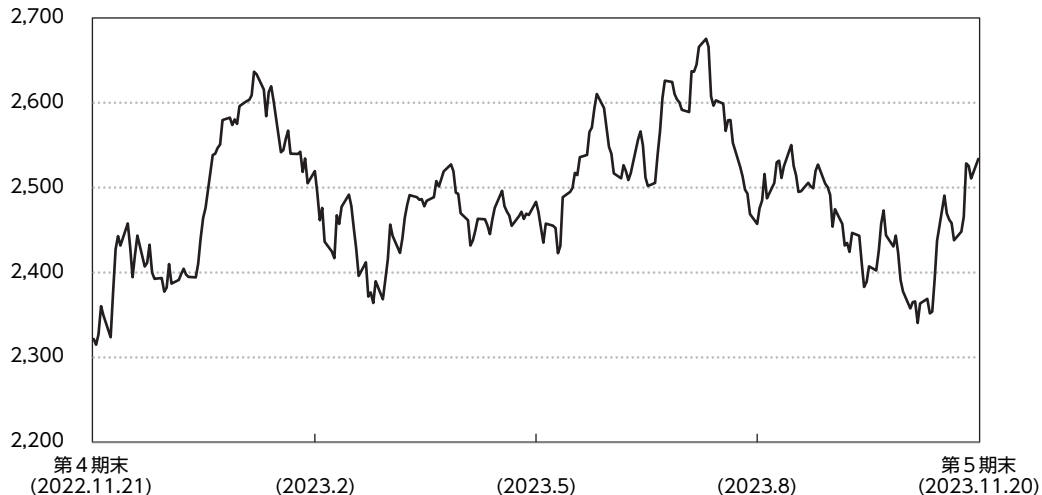
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(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。

新興国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2023年1月にかけては、米国の金融引き締め長期化や世界経済の減速が懸念された一方、中国における「ゼロコロナ」政策の緩和姿勢や大手不動産開発会社への支援等が好感され株価は上昇しました。2月から5月にかけては、米国の金融引き締めへの警戒感や欧米金融市場における信用不安、地政学リスクの高まりなどを受けて投資家心理が悪化し株価は軟調に推移しました。6月から10月にかけては、米国の金融引き締めに対する懸念の一服や中国における金融市場・景気への支援策が好感された一方、中国景気や不動産市場の不透明感は根強く株価は一進一退の展開となりました。11月に入ると米国の金融引き締めへの懸念の後退と中国における景気支援策への期待感から株価は上昇して当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

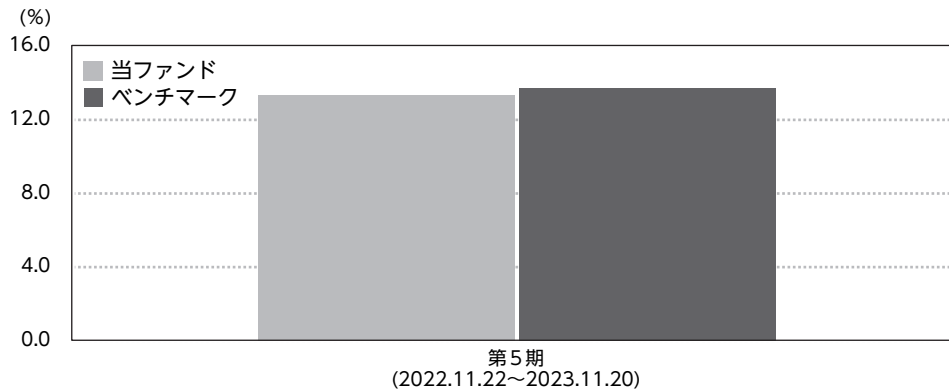
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■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+13.3%となり、ベンチマーク騰落率（+13.7%）におおむね連動しました。

（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

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

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	当期 2022年11月22日～2023年11月20日
当期分配金(税引前)	—
対基準価額比率	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,724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5期末 2023年11月20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。

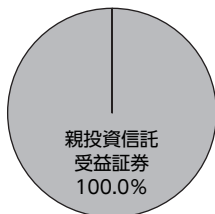
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

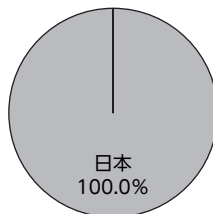
項目	第5期末 2023年11月20日
純資産総額	2,156,671,808円
受益権総口数	1,464,718,481口
1万口当たり基準価額	14,724円

(注) 当期間中における追加設定元本額は760,863,420円、同解約元本額は410,844,167円です。

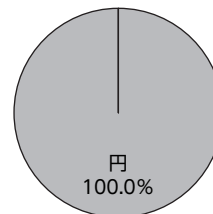
■資産別配分



■国別配分



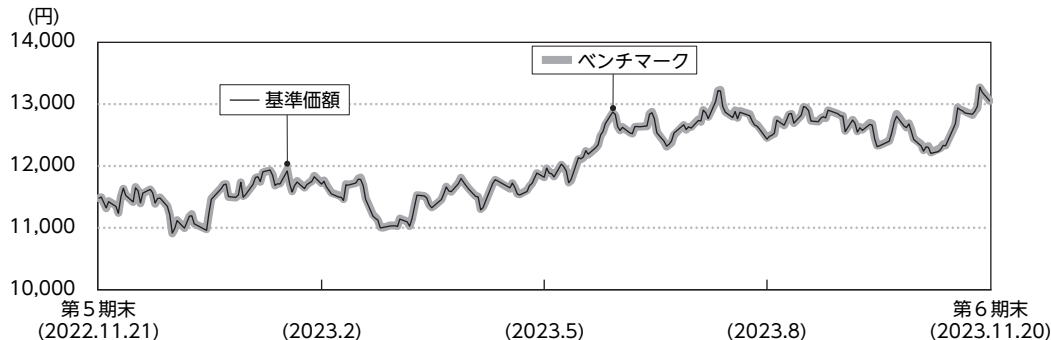
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ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

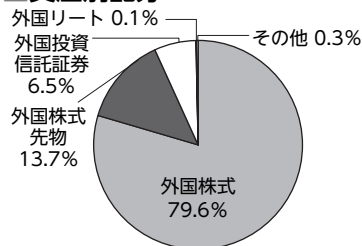
銘柄名	通貨	比率
MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202312 買	米ドル	13.7%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾ドル	5.8
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	米ドル	3.7
TENCENT HOLDINGS LTD	香港ドル	3.5
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国ウォン	3.4
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	香港ドル	2.0
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	米ドル	1.2
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	インド・ルピー	1.1
MEITUAN-B	香港ドル	0.9
PDD HOLDINGS INC(ADR)	米ドル	0.9
組入銘柄数		1,055

■ 1万口当たりの費用明細

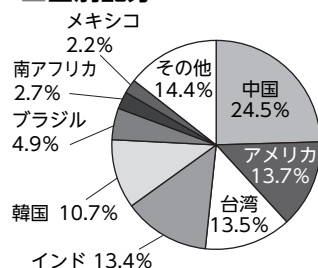
2022.11.22~2023.11.20

項目	金額
売買委託手数料 (株式)	4円 (2)
(先物・オプション) (投資信託証券)	(1) (0)
有価証券取引税 (株式)	3 (3)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	29 (21)
(その他)	(8)
合計	36

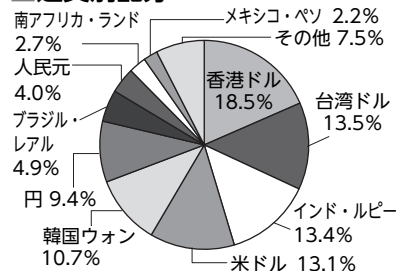
■ 資産別配分



■ 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。

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
5期(2023年11月20日)	14,724	0	13.3	14,724	15,149	13.7	79.6	13.7	-	6.6	2,156

(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				
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2022年11月21日	12,990	-	13,324	-	81.4	11.1	-	7.2
11月末	13,015	0.2	13,356	0.2	80.8	12.7	-	6.9
12月末	12,517	△ 3.6	12,843	△ 3.6	84.3	8.4	-	7.1
2023年 1 月末	13,396	3.1	13,767	3.3	82.9	10.5	-	6.5
2 月末	12,994	0.0	13,357	0.2	80.3	13.0	-	6.4
3 月末	13,029	0.3	13,380	0.4	85.3	7.4	-	7.0
4 月末	12,913	△ 0.6	13,256	△ 0.5	82.5	10.0	-	7.3
5 月末	13,461	3.6	13,842	3.9	80.3	13.5	-	7.0
6 月末	14,267	9.8	14,665	10.1	83.1	9.8	-	7.0
7 月末	14,727	13.4	15,129	13.5	79.0	14.2	-	6.5
8 月末	14,503	11.6	14,905	11.9	83.8	9.0	-	7.2
9 月末	14,193	9.3	14,609	9.7	84.0	8.7	-	7.1
10月末	13,838	6.5	14,261	7.0	81.3	11.9	-	6.6
(期末)2023年11月20日	14,724	13.3	15,149	13.7	79.6	13.7	-	6.6

(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

2022年11月22日～2023年11月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	859,624	1,039,569	468,557	571,249

(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	2,644,017千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,707,749千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.46

(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

2022年11月22日～2023年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2023年11月20日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	1,261,467	1,652,534	2,156,722

(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7,117,768千口です。

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	%
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	2,156,722	99.0
コール・ローン等、その他	20,698	1.0
投資信託財産総額	2,177,420	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香港ドル19.23円、1台湾ドル4.712円、1イギリス・ポンド186.69円、1トルコ・リラ5.234円、1メキシコ・ペソ8.704円、1フィリピン・ペソ2.692円、100チリ・ペソ16.87円、100コロンビア・ペソ3.662円、1インド・ルピー1.81円、100インドネシア・ルピア0.97円、1ブラジル・リアル30.529円、1チェコ・コルナ6.667円、100韓国ウォン11.56円、1人民元20.758円、1マレーシア・リンギット32.015円、1南アフリカ・ランド8.17円、1タイ・バーツ4.27円、1ポーランド・ズロチ37.264円、100ハンガリー・フォリント43.119円、1ユーロ163.54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（8,413,245千円）の投資信託財産総額（9,348,956千円）に対する比率は90.0%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

(2023年11月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	2,177,420,971円
コール・ローン等	2,629,579
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）	2,156,722,688
未収入金	18,068,704
(B) 負債	20,749,163
未払解約金	17,952,243
未払信託報酬	2,704,823
その他未払費用	92,097
(C) 純資産総額 (A - B)	2,156,671,808
元本	1,464,718,481
次期繰越損益金	691,953,327
(D) 受益権総口数	1,464,718,481口
1万口当たり基準価額 (C / D)	14,724円

(注) 期首元本額 1,114,699,228円
 期中追加設定元本額 760,863,420円
 期中一部解約元本額 410,844,167円

損益の状況

当期 (2022年11月22日~2023年11月20日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 335円
受取利息	51
支払利息	△ 386
(B) 有価証券売買損益	212,205,777
売買益	240,851,804
売買損	△ 28,646,027
(C) 信託報酬等	△ 5,371,906
(D) 当期損益金 (A + B + C)	206,833,536
(E) 前期繰越損益金	△ 25,525,680
(分配準備積立金)	(19,550,913)
(繰越欠損金)	(△ 45,076,593)
(F) 追加信託差損益金*	510,645,471
(配当等相当額)	(279,008,103)
(売買損益相当額)	(231,637,368)
(G) 合計 (D + E + F)	691,953,327
次期繰越損益金 (G)	691,953,327
追加信託差損益金	510,645,471
(配当等相当額)	(279,008,103)
(売買損益相当額)	(231,637,368)
分配準備積立金	181,308,191
繰越欠損金	△ 335

(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、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	161,757,278円
(c) 信託約款に定める収益調整金	510,645,471円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	19,550,913円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	691,953,662円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	4,724.14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

信託報酬率の引き下げに伴い、関連条項に所要の変更を行いました。

(2023年5月13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 6 期

(計算期間：2022年11月22日～2023年11月20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

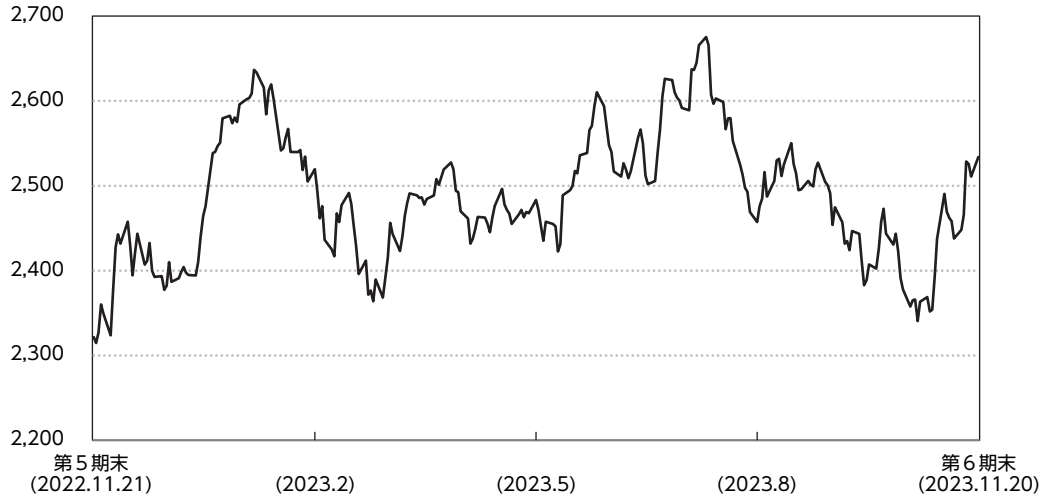
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年11月22日～2023年11月20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】

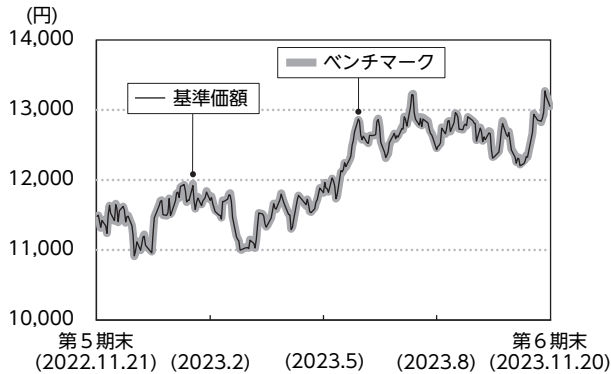


(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

新興国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2023年1月にかけては、米国の金融引き締め長期化や世界経済の減速が懸念された一方、中国における「ゼロコロナ」政策の緩和姿勢や大手不動産開発会社への支援等が好感され株価は上昇しました。2月から5月にかけては、米国の金融引き締めへの警戒感や欧米金融市場における信用不安、地政学リスクの高まりなどを受けて投資家心理が悪化し株価は軟調に推移しました。6月から10月にかけては、米国の金融引き締めに対する懸念の一服や中国における金融市場・景気への支援策が好感された一方、中国景気や不動産市場の不透明感は根強く株価は一進一退の展開となりました。11月に入ると米国の金融引き締めへの懸念の後退と中国における景気支援策への期待感から株価は上昇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>

- ・ 2023年1月に中国における経済活動再開の動きや米金融政策転換への期待感の高まりを背景に株価が上昇したこと
- ・ 6月から7月にかけて、中国における景気支援策への期待感や米国の金融引き締めに対する過度な懸念の後退を受けて株価が上昇したこと

<下落要因>

- ・ 2023年9月から10月にかけて、中国における景気の見通しや不動産市場の不透明感、地政学リスクへの懸念等を背景に株価が下落したこと

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+13.7%となり、ベンチマーク騰落率（+13.7%）に連動しました。

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。

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	債券 組入比率	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
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
6期(2023年11月20日)	13,051	13.7	14,414	13.7	79.6	13.7	-	6.6	9,289

(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	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
		%		%				
(期首) 2022年11月21日	円	%		%	%	%	%	%
11月末	11,479	-	12,677	-	81.4	11.1	-	7.2
12月末	11,502	0.2	12,708	0.2	80.8	12.7	-	6.9
2023年 1月末	11,065	△ 3.6	12,220	△ 3.6	84.3	8.4	-	7.1
2月末	11,845	3.2	13,099	3.3	82.9	10.5	-	6.5
3月末	11,493	0.1	12,709	0.2	80.3	13.0	-	6.4
4月末	11,527	0.4	12,731	0.4	85.3	7.4	-	7.0
5月末	11,427	△ 0.5	12,613	△ 0.5	82.5	10.0	-	7.3
6月末	11,915	3.8	13,171	3.9	80.3	13.5	-	7.0
7月末	12,632	10.0	13,953	10.1	83.1	9.8	-	7.0
8月末	13,042	13.6	14,395	13.5	79.0	14.2	-	6.5
9月末	12,847	11.9	14,182	11.9	83.8	9.0	-	7.2
10月末	12,575	9.5	13,901	9.7	84.0	8.7	-	7.1
(期末) 2023年11月20日	12,264	6.8	13,570	7.0	81.3	11.9	-	6.6
	13,051	13.7	14,414	13.7	79.6	13.7	-	6.6

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2022年11月22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	4円	0.030%	
(株式)	(2)	(0.017)	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)	(1)	(0.012)	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)	(0.001)	
有価証券取引税	3	0.025	
(株式)	(3)	(0.025)	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	29	0.240	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)	(21)	(0.174)	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)	(8)	(0.065)	・ 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	36	0.295	

(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（12,060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11月22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 367 (7)	千米ドル 521	百株 175	千米ドル 298
	香港	22,920 (106)	千香港ドル 35,314 (△ 26)	3,020	千香港ドル 1,139
	台湾	9,090 (175)	千台湾ドル 81,852 (△ 319)	40	千台湾ドル 776
	トルコ	874 (205)	千トルコ・リラ 4,284	107	千トルコ・リラ 556
	メキシコ	2,155 (179)	千メキシコ・ペソ 8,406	1,329	千メキシコ・ペソ 1,809
	フィリピン	700 (17)	千フィリピン・ペソ 4,593	1,031	千フィリピン・ペソ 812
	チリ	2,455 (1)	千チリ・ペソ 91,042	77	千チリ・ペソ 13,943
	コロンビア	28	千コロンビア・ペソ 76,723	180	千コロンビア・ペソ 41,390
	インド	4,373 (445)	千インド・ルピー 233,491	112	千インド・ルピー 8,258
	インドネシア	79,116 (1,938)	千インドネシア・ルピア 5,291,617	777	千インドネシア・ルピア 164,096

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 1,984 (14)	千ブラジル・リアル 4,432	百株 156	千ブラジル・リアル 214
	チェコ	3	千チェコ・コルナ 358	—	千チェコ・コルナ —
	韓国	376 (△ 0.56)	千韓国ウォン 2,969,206	24	千韓国ウォン 84,777
	中国	5,589 (89)	千人民元 7,476	931	千人民元 1,055
	マレーシア	1,744	千マレーシア・リングgit 1,177	399	千マレーシア・リングgit 35
	南アフリカ	817	千南アフリカ・ランド (△ 35)	88	千南アフリカ・ランド 1,058
	タイ	3,512 (△ 202)	千タイ・バーツ 13,907	295	千タイ・バーツ 871
	ポーランド	174	千ポーランド・ズロチ 777	27	千ポーランド・ズロチ 119
	ハンガリー	22	千ハンガリー・フォリント 12,382	—	千ハンガリー・フォリント —
	ユーロ ギリシャ	423	千ユーロ 135 (△ 0.819)	30	千ユーロ 45

(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) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	20	308	0.700	10
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	10	189	—	—
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	19	753	—	—
ISHARES MSCI KUWAIT ETF	6	211	—	—
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	1	1
	(1)	(1)		
(メキシコ)		千メキシコ・ペソ		千メキシコ・ペソ
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	2	63	—	—

(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 株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
	4,825	4,235	—	—

(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

2022年11月22日～2023年11月20日

株式

銘柄	買付			売付			
	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	60	144,172	2,402	TRIP.COM GROUP LTD	3	16,954	4,577
TENCENT HOLDINGS LTD	18	111,167	5,944	AMERICA MOVIL SAB DE CV	107	14,798	138
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	11	80,817	7,134	LI AUTO INC - ADR	3	9,192	2,918
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	47	73,336	1,550	BEIGENE LTD-ADR	0.239	6,074	25,415
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	7	31,857	4,291	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	0.100	3,797	37,977
MEITUAN-B	12	30,530	2,482	XPENG INC - ADR	2	3,459	1,433
PDD HOLDINGS INC(ADR)	1	23,595	12,490	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	25	2,973	118
ECOPRO CO LTD	0.159	22,208	139,677	TERNA ENERGY SA	1	2,666	2,621
TRIP.COM GROUP LTD	4	21,614	4,803	ZAI LAB LTD-ADR	0.559	2,632	4,709
ICICI BANK LTD	12	20,506	1,611	HDFC BANK LTD	0.919	2,607	2,837

(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	
AUTOHOME INC-ADR	5	5	14	2,147	メディア・娯楽
BEIGENE LTD-ADR	2	—	—	—	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5	5	4	701	素材
CREDICORP LTD	4	4	63	9,483	銀行
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4	4	10	1,618	半導体・半導体製造装置
H WORLD GROUP LIMITED(ADR)	10	14	53	8,093	消費者サービス
HUTCHMED CHINA LIMITED ADR	6	—	—	—	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	—	99	13	2,023	エネルギー
IQIYI INC-ADR	9	32	16	2,437	メディア・娯楽
JOYY INC	3	3	13	2,082	メディア・娯楽
KANZHUN LTD	11	19	31	4,718	メディア・娯楽
KE HOLDINGS INC	38	52	81	12,149	不動産管理・開発
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2	5	36	5,488	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LI AUTO INC - ADR	31	—	—	—	自動車・自動車部品
LUFAX HOLDING LTD	—	59	5	804	金融サービス
LUKOIL PJSC-SPON ADR	18	18	0.000	0.026	エネルギー
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	14	—	—	—	生活必需品流通・小売り
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	—	7	18	2,797	一般消費財・サービス流通・小売り
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	29	29	0.000	0.043	電気通信サービス
NIO INC - ADR	77	113	83	12,568	自動車・自動車部品
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	4	4	0.000	0.005	エネルギー
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	7	7	0.000	0.010	素材
OZON HOLDINGS PLC - ADR	3	3	0.000	0.004	一般消費財・サービス流通・小売り
PDD HOLDINGS INC(ADR)	28	47	545	81,861	一般消費財・サービス流通・小売り
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	5	5	0.000	0.007	素材
PJSC GAZPROM ADR	279	279	0.003	0.418	エネルギー
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	27	27	0.000	0.040	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	4	4	0.000	0.005	素材
QIFU TECHNOLOGY INC(ADR)	5	5	8	1,264	金融サービス
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	32	—	—	—	食品・飲料・タバコ
ROSNEFT OJSC-GDR	54	54	0.001	0.080	エネルギー
SBERBANK OF RUSSIA	498	498	0.005	0.746	銀行
SEVERSTAL PAO - GDR REG S	13	13	0.000	0.019	素材
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	—	43	9	1,408	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		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	22	—	—	—	不動産管理・開発	
SOUTHERN COPPER CORP	4	7	53	8,059	素材	
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	51	51	0.001	0.076	エネルギー	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	28	28	26	4,022	消費者サービス	
TATNEFT-SPONSORED ADR	12	12	0.000	0.017	エネルギー	
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	5	5	0.000	0.007	銀行	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	34	59	49	7,496	メディア・娯楽	
TRIP.COM GROUP LTD	31	—	—	—	消費者サービス	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	23	26	40	6,108	一般消費財・サービス流通・小売り	
VK COMPANY LTD-GDR	3	3	0.000	0.004	メディア・娯楽	
VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	66	66	0.001	0.098	銀行	
WEIBO CORP-SPON ADR	3	3	3	585	メディア・娯楽	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	4	4	0.000	0.005	生活必需品流通・小売り	
XPENG INC - ADR	24	—	—	—	自動車・自動車部品	
YANDEX NV-A	13	13	0.000	0.019	メディア・娯楽	
YUM CHINA HOLDINGS INC	22	34	157	23,575	消費者サービス	
ZAI LAB LTD-ADR	5	—	—	—	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	24	33	75	11,317	運輸	
小計	株数・金額	1,618	1,818	1,419	212,816	
	銘柄数<比率>	48	43	—	<2.3%>	
(香港)			千香港ドル			
3SBIO INC	40	155	109	2,113	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	71	1,373	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,580	2,170	616	11,851	銀行	
AIR CHINA LIMITED-H	100	100	53	1,026	運輸	
AKESO INC	—	40	187	3,599	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	848	1,312	9,610	184,807	一般消費財・サービス流通・小売り	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	300	520	238	4,589	生活必需品流通・小売り	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	400	—	—	—	メディア・娯楽	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO-H	15	—	—	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	240	240	95	1,841	素材	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	60	115	218	4,192	素材	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	7	7	90	1,733	食品・飲料・タバコ	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	70	108	881	16,957	耐久消費財・アパレル	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	40	40	14	275	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
BAIDU INC-CLASS A	125	186	1,925	37,019	メディア・娯楽
BANK OF CHINA LTD - H	4,210	6,180	1,748	33,632	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	380	770	352	6,781	銀行
BEIGENE LTD	—	58	667	12,826	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40	40	11	226	運輸
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	15	45	119	2,306	公益事業
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	160	160	26	501	公益事業
BILIBILI INC-CLASS Z	11	19	205	3,954	メディア・娯楽
BOC AVIATION LTD	5	19	100	1,925	資本財
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	160	160	49	947	耐久消費財・アパレル
BYD CO LTD	45	80	1,953	37,567	自動車・自動車部品
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	30	65	250	4,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	—	60	105	2,021	不動産管理・開発
CANSINO BIOLOGICS INC-H	4	—	—	—	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	650	650	121	2,337	公益事業
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	280	280	22	425	金融サービス
CHINA CITIC BANK	490	770	270	5,197	銀行
CHINA COAL ENERGY CO - H	—	200	122	2,357	エネルギー
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	80	80	26	518	資本財
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	85	85	52	1,005	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5,310	7,690	3,483	66,989	銀行
CHINA COSCO HOLDINGS-H	146	301	234	4,510	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	120	120	26	507	銀行
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	150	150	40	773	商業・専門サービス
CHINA FEIHE LTD	170	320	152	2,922	食品・飲料・タバコ
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	115	115	51	984	金融サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	150	268	191	3,684	公益事業
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	140	140	95	1,833	素材
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	116	132	182	3,502	金融サービス
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	560	560	48	936	不動産管理・開発
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	50	—	—	—	資本財
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	440	620	677	13,019	保険
CHINA LITERATURE LTD	36	36	103	1,993	メディア・娯楽
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	170	320	207	3,993	公益事業
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	80	80	109	2,098	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	20	20	10	193	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA MENGNIU DAIRY CO	170	280	686	13,191	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA MERCHANTS BANK - H	230	335	989	19,036	銀行
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	100	100	100	1,934	運輸
CHINA MINSHENG BANKING-H	229	559	144	2,784	銀行
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	200	420	155	2,988	素材
CHINA OILFIELD SERVICES-H	120	120	102	1,966	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	230	355	519	9,994	不動産管理・開発
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	50	50	33	643	不動産管理・開発
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	148	222	382	7,351	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,340	1,840	756	14,542	エネルギー
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	528	748	512	9,863	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA POWER INTERNATIONAL	330	330	98	1,897	公益事業
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	280	280	99	1,906	資本財
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	100	140	543	10,445	食品・飲料・タバコ
CHINA RESOURCES CEMENT	180	180	33	640	素材
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	40	82	202	3,894	公益事業
CHINA RESOURCES LAND LTD	180	260	754	14,499	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	44	44	128	2,470	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	-	180	88	1,703	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	100	160	252	4,855	公益事業
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	-	520	96	1,849	メディア・娯楽
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	185	260	646	12,424	エネルギー
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	-	140	111	2,142	エネルギー
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	240	240	92	1,781	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	120	120	107	2,067	資本財
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	140	-	-	-	エネルギー
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	66	66	47	917	保険
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	-	6	53	1,030	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA TOWER CORP LTD-H	2,160	4,020	313	6,029	電気通信サービス
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	60	60	21	409	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	138	138	108	2,093	不動産管理・開発
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	120	120	74	1,430	ソフトウェア・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	-	132	152	2,939	一般消費財・サービス流通・小売り
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	249	-	-	-	エクイティ不動産投資信託(REIT)
CITIC LTD	320	500	351	6,759	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	145	165	275	5,305	金融サービス
CMOC GROUP LIMITED-H	240	240	104	2,002	素材
COSCO PACIFIC LTD	60	60	30	581	運輸

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	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	480	—	—	—	不動産管理・開発
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	110	210	149	2,883	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD H	340	340	109	2,111	資本財
DALI FOODS GROUP CO LTD	215	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	180	180	66	1,277	自動車・自動車部品
DONGYUE GROUP	80	80	43	839	素材
EAST BUY HOLDING LIMITED	—	30	85	1,652	消費者サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	43	58	327	6,290	公益事業
FAR EAST HORIZON LTD	70	70	41	795	金融サービス
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	30	30	43	844	半導体・半導体製造装置
FOSUN INTERNATIONAL	170	170	77	1,487	資本財
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	32	32	116	2,239	自動車・自動車部品
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	22	22	61	1,180	素材
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	—	1,700	200	3,857	半導体・半導体製造装置
GDS HOLDINGS LTD-CL A	57	57	62	1,194	ソフトウェア・サービス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	350	570	544	10,467	自動車・自動車部品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	60	100	236	4,547	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	49	943	金融サービス
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	150	150	173	3,340	自動車・自動車部品
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	—	115	92	1,778	不動産管理・開発
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	60	—	—	—	不動産管理・開発
GUANGDONG INVESTMENT LTD	160	300	165	3,172	公益事業
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	196	196	71	1,371	自動車・自動車部品
H Aidilao INTERNATIONAL HOLDI	50	160	257	4,959	消費者サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	114	180	406	7,822	耐久消費財・アパレル
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	50	50	97	1,871	資本財
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	100	100	46	884	金融サービス
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	12	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	80	80	117	2,258	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	45	45	124	2,397	家庭用品・パーソナル用品
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	53	—	—	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	30	30	54	1,049	半導体・半導体製造装置
HUANENG POWER INTL INC-H	140	140	55	1,060	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	54	54	58	1,127	金融サービス
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	20	20	97	1,874	ヘルスケア機器・サービス
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,120	5,150	1,931	37,137	銀行
INNOVENT BIOLOGICS INC	55	90	401	7,727	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	69	105	399	7,678	生活必需品流通・小売り
JD LOGISTICS INC	—	221	217	4,173	運輸
JD.COM INC - CL A	122	191	2,019	38,828	一般消費財・サービス流通・小売り
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20	20	13	259	運輸
JIANGXI COPPER CO LTD-H	90	90	97	1,876	素材
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	40	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	30	90	74	1,433	消費者サービス
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	40	40	76	1,473	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	25	25	18	352	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	140	230	265	5,104	ソフトウェア・サービス
KINGSOFT CORP LTD	52	80	244	4,692	メディア・娯楽
KUAISHOU TECHNOLOGY	97	197	1,154	22,199	メディア・娯楽
KUNLUN ENERGY CO LTD	200	360	257	4,942	公益事業
LEGEND GROUP LTD	400	580	559	10,751	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LI AUTO INC-CLASS A	—	91	1,429	27,491	自動車・自動車部品
LI NING CO LTD	135	205	473	9,106	耐久消費財・アパレル
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	90	155	198	3,809	不動産管理・開発
MEITUAN-B	247	407	4,373	84,103	消費者サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	53	53	70	1,359	ヘルスケア機器・サービス
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	20	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MINITH GROUP LTD	40	40	72	1,389	自動車・自動車部品
NETEASE INC	118	156	2,798	53,817	メディア・娯楽
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	60	60	98	1,889	保険
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	98	111	594	11,430	消費者サービス
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	30	30	12	233	素材
NONGFU SPRING CO LTD-H	102	150	675	12,994	食品・飲料・タバコ
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	10	10	94	1,817	運輸
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	230	230	58	1,132	保険
PETROCHINA CO LTD-H	1,220	1,380	705	13,560	エネルギー
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	9	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	410	470	430	8,269	保険
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	16	16	29	568	生活必需品流通・小売り
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	365	550	2,095	40,296	保険
POP MART INTERNATIONAL GROUP	38	38	85	1,651	一般消費財・サービス流通・小売り
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	400	670	237	4,560	銀行
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	—	110	99	1,922	資本財
SEAZEN GROUP LTD	80	—	—	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)

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	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	57	57	84	1,627	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	164	164	130	2,500	ヘルスケア機器・サービス
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	30	30	54	1,053	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	31	604	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN INTL HOLDINGS	15	15	8	159	運輸
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	44	68	554	10,657	耐久消費財・アパレル
SINO BIOPHARMACEUTICAL	570	940	360	6,923	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOPHARM GROUP CO-H	88	100	187	3,596	ヘルスケア機器・サービス
SINOTRUK HONG KONG LTD	20	60	101	1,956	資本財
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	100	210	136	2,616	食品・飲料・タバコ
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	230	-	-	-	不動産管理・開発
SUNNY OPTICAL TECH	42	60	439	8,451	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TENCENT HOLDINGS LTD	348	535	16,863	324,279	メディア・娯楽
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	120	120	119	2,302	食品・飲料・タバコ
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	80	80	116	2,246	消費者サービス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	40	180	118	2,274	一般消費財・サービス流通・小売り
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	30	100	125	2,415	消費者サービス
TRIP.COM GROUP LTD	-	45	1,233	23,710	消費者サービス
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	40	40	218	4,199	食品・飲料・タバコ
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	30	30	16	313	食品・飲料・タバコ
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	280	280	125	2,412	食品・飲料・タバコ
WEICHAI POWER CO LTD-H	120	120	169	3,258	資本財
WHARF HOLDINGS LTD	70	-	-	-	エクイティ不動産投資信託(REIT)
WUXI APPTec CO LTD-H	25	28	264	5,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	205	325	1,535	29,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XIAOMI CORP-CLASS B	884	1,294	2,062	39,664	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	24	-	-	-	資本財
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	260	440	219	4,213	半導体・半導体製造装置
XPENG INC - CLASS A SHARES	-	74	482	9,270	自動車・自動車部品
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	90	90	46	893	耐久消費財・アパレル
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	40	100	148	2,857	自動車・自動車部品
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	100	150	205	3,951	エネルギー
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	20	20	25	499	食品・飲料・タバコ
YUEXIU PROPERTY CO LTD	32	172	129	2,497	不動産管理・開発
ZAI LAB LTD	-	78	168	3,232	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	-	125	118	2,273	素材
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	20	20	10	198	運輸

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	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H		31	77	158	3,042	保険
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS		35	65	125	2,407	一般消費財・サービス流通・小売り
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H		39	39	98	1,886	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H		300	480	565	10,873	素材
ZTE CORP-H		62	62	115	2,212	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額	43,708	63,715	89,174	1,714,820	
	銘柄数<比率>	185	186	-	<18.5%>	
(台湾)				千台湾ドル		
ACCTON TECHNOLOGY CORP		30	40	2,128	10,027	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC		130	210	717	3,379	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADVANTECH CO LTD		20	34	1,185	5,588	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP		10	10	1,100	5,183	資本財
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD		170	240	3,012	14,193	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP		70	160	663	3,125	素材
ASUSTEK COMPUTER INC		40	60	2,355	11,097	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUO CORPORATION		328	518	859	4,052	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD		40	40	766	3,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO		460	830	3,801	17,913	保険
CHAILEASE HOLDING CO LTD		78	130	2,319	10,929	金融サービス
CHANG HWA COMMERCIAL BANK		199	204	361	1,705	銀行
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD		130	130	605	2,851	自動車・自動車部品
CHINA AIRLINES LTD		-	200	436	2,054	運輸
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL		830	1,270	1,518	7,156	保険
CHINA STEEL CORP		700	990	2,494	11,756	素材
CHUNGHWA TELECOM CO LTD		210	280	3,276	15,437	電気通信サービス
COMPAL ELECTRONICS		130	360	1,092	5,148	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD		1,080	1,510	4,054	19,105	銀行
DELTA ELECTRONICS INC		110	150	4,575	21,558	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E INK HOLDINGS INC		50	60	1,086	5,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO		773	1,191	2,996	14,119	銀行
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD		10	10	578	2,723	耐久消費財・アパレル
EMEMORY TECHNOLOGY INC		-	10	2,475	11,662	半導体・半導体製造装置
EVA AIRWAYS CORP		-	180	578	2,727	運輸
EVERGREEN MARINE		56	56	650	3,067	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP		100	210	645	3,042	資本財
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD		80	80	633	2,985	電気通信サービス
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD		33	37	684	3,223	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	
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	560	865	2,383	11,232	銀行
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	180	270	1,733	8,168	素材
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	70	120	1,004	4,733	エネルギー
FORMOSA PLASTICS CORP	230	330	2,666	12,564	素材
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	427	606	3,831	18,053	保険
GIANT MANUFACTURING	10	20	347	1,635	耐久消費財・アパレル
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	-	40	922	4,344	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GLOBAL UNICHIP CORP	-	10	1,735	8,175	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	10	20	1,064	5,013	半導体・半導体製造装置
HON HAI PRECISION INDUSTRY	702	1,002	10,270	48,397	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	20	20	1,393	6,565	一般消費財・サービス流通・小売り
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	453	703	1,518	7,156	銀行
INNOLUX CORPORATION	425	755	967	4,557	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVENTEC CO LTD	80	230	980	4,622	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LARGAN PRECISION CO LTD	10	10	2,120	9,990	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	110	160	1,752	8,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC	90	120	10,848	51,119	半導体・半導体製造装置
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	594	941	3,692	17,400	銀行
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	40	50	830	3,911	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOMO.COM INC	-	11	558	2,633	一般消費財・サービス流通・小売り
NAN YA PLASTICS CORP	250	410	2,796	13,176	素材
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	10	20	474	2,233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	80	80	539	2,540	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10	10	334	1,573	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	30	50	2,475	11,662	半導体・半導体製造装置
PARADE TECHNOLOGIES LTD	10	10	1,050	4,947	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	100	160	1,292	6,092	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHARMAESSENTIA CORP	-	20	724	3,411	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
POU CHEN	70	70	215	1,015	耐久消費財・アパレル
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	150	320	929	4,380	半導体・半導体製造装置
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20	50	1,337	6,302	生活必需品流通・小売り
QUANTA COMPUTER INC	150	210	4,378	20,632	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	30	40	1,712	8,067	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	97	88	324	1,530	不動産管理・開発
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	562	562	509	2,398	保険
SILERGY CORP	20	30	1,255	5,916	半導体・半導体製造装置
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	600	694	1,308	6,167	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		
(台湾)		百株	百株	千台湾ドル	千円	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	80	80	536	2,529	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	508	911	1,640	7,729	銀行	
TAIWAN BUSINESS BANK	–	471	626	2,952	銀行	
TAIWAN CEMENT	340	500	1,662	7,836	素材	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	602	895	2,367	11,157	銀行	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	60	60	181	856	運輸	
TAIWAN MOBILE CO LTD	80	140	1,367	6,445	電気通信サービス	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,370	1,970	114,260	538,427	半導体・半導体製造装置	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	220	350	1,603	7,553	銀行	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	80	110	1,749	8,241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	250	350	2,485	11,710	食品・飲料・タバコ	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	680	930	4,626	21,802	半導体・半導体製造装置	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	40	80	590	2,782	半導体・半導体製造装置	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	–	10	1,495	7,044	資本財	
WALSIN LIHWA CORP	150	240	912	4,297	資本財	
WAN HAI LINES LIMITED	37	37	179	844	運輸	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	20	–	–	–	半導体・半導体製造装置	
WINBOND ELECTRONICS CORP	170	170	470	2,215	半導体・半導体製造装置	
WISTRON CORP	–	220	2,178	10,263	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WIWYNN CORP	10	10	1,830	8,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WPG HOLDINGS LTD	57	117	837	3,945	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YAGEO CORPORATION	23	23	1,305	6,152	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YANG MING MARINE TRANSPORT	90	90	376	1,772	運輸	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	595	685	1,738	8,191	金融サービス	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	40	40	418	1,969	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>	17,581 81	26,807 90	265,364 –	1,250,476 <13.5%>	
(イギリス)				千イギリス・ポンド		
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	19	19	0.000	0.035	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	19 1	19 1	0.000 –	0.035 <0.0%>	
(トルコ)				千トルコ・リラ		
AKBANK T.A.S.	258	293	881	4,614	銀行	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	21	116	492	2,577	資本財	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	25	25	786	4,117	生活必需品流通・小売り	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	81	81	311	1,629	素材	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1	5	503	2,635	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		
(トルコ)		百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
HACI OMER SABANCI HOLDING	–	68	400	2,097	銀行	
HEKTAS TICARET T.A.S	–	91	188	987	素材	
KOC HOLDING AS	87	58	832	4,356	資本財	
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	–	4	303	1,587	運輸	
SASA POLYESTER SANAYI	–	82	363	1,904	素材	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	–	10	268	1,405	自動車・自動車部品	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	10	85	1,318	6,898	エネルギー	
TURK HAVA YOLLARI AO	–	37	952	4,987	運輸	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	–	105	513	2,688	資本財	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	118	118	670	3,508	電気通信サービス	
TURKIYE IS BANKASI-C	325	325	669	3,502	銀行	
YAPI VE KREDI BANKASI	–	392	662	3,469	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	930 9	1,903 17	10,119 –	52,966 <0.6%>	
(メキシコ)				千メキシコ・ペソ		
ALFA S.A.B.-A	179	179	208	1,818	資本財	
AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,563	–	–	–	電気通信サービス	
AMERICA MOVIL SAB DE CV	–	1,586	2,415	21,025	電気通信サービス	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	18	40	712	6,199	食品・飲料・タバコ	
BANCO DEL BAJIO SA	–	59	345	3,004	銀行	
CEMEX SAB-CPO	782	1,254	1,512	13,163	素材	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	28	32	476	4,147	食品・飲料・タバコ	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	111	150	3,272	28,484	食品・飲料・タバコ	
GRUMA S.A.B.-B	12	12	389	3,388	食品・飲料・タバコ	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	10	15	627	5,463	運輸	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	19	28	684	5,959	運輸	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	89	101	843	7,346	食品・飲料・タバコ	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	9	53	727	6,328	資本財	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	152	212	3,413	29,709	銀行	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	146	166	689	6,005	銀行	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	169	243	1,905	16,589	素材	
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	140	140	111	972	メディア・娯楽	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3	11	270	2,353	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	100	100	340	2,967	家庭用品・パーソナル用品	
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	120	120	240	2,096	電気通信サービス	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	33	125	417	3,630	素材	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4	17	297	2,592	運輸	

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	
SITIOS LATINOAMERICA SAB DE		78	-	-	-	電気通信サービス
WALMART DE MEXICO-SER V		300	427	2,910	25,337	生活必需品流通・小売り
小計	株数・金額	4,067	5,072	22,814	198,585	
	銘柄数<比率>	22	22	-	<2.1%>	
(フィリピン)				千フィリピン・ペソ		
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		63	63	297	802	資本財
ACEN CORPORATION		469	-	-	-	公益事業
AYALA CORPORATION		17	17	1,161	3,127	資本財
AYALA LAND INC		488	553	1,642	4,422	不動産管理・開発
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN		125	152	1,604	4,319	銀行
BDO UNIBANK INC		111	214	2,793	7,523	銀行
GLOBE TELECOM INC		0.65	-	-	-	電気通信サービス
GT CAPITAL HOLDINGS INC		1	-	-	-	資本財
INTL CONTAINER TERM SVCS INC		56	92	1,947	5,244	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC		185	185	712	1,919	資本財
JOLLIBEE FOODS CORP		13	13	317	854	消費者サービス
MANILA ELECTRIC COMPANY		13	13	517	1,394	公益事業
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		281	-	-	-	金融サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST		151	151	788	2,122	銀行
MONDE NISSIN CORP		292	-	-	-	食品・飲料・タバコ
PLDT INC		5	5	725	1,953	電気通信サービス
SM INVESTMENTS CORP		15	17	1,534	4,132	資本財
SM PRIME HOLDINGS INC		603	1,057	3,329	8,966	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP		28	72	813	2,191	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	2,925	2,610	18,186	48,974	
	銘柄数<比率>	19	14	-	<0.5%>	
(チリ)				千チリ・ペソ		
BANCO DE CHILE		3,064	3,474	32,869	5,545	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION		1	6	15,719	2,651	銀行
BANCO SANTANDER CHILE		5,533	6,273	26,379	4,450	銀行
CENCOSUD SA		43	92	14,555	2,455	生活必需品流通・小売り
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		2	2	1,405	237	食品・飲料・タバコ
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES		928	928	4,790	808	運輸
EMPRESAS CMPC SA		37	101	17,889	3,017	素材
EMPRESAS COPEC SA		30	30	19,736	3,329	エネルギー
ENEL CHILE SA		904	904	5,003	844	公益事業
ENERSIS SA		994	2,052	20,116	3,393	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	
(チリ)		百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
FALABELLA SA		24	75	15,203	2,564	一般消費財・サービス流通・小売り
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		7	10	47,004	7,929	資本財
小計	株数・金額	11,573	13,953	220,672	37,227	
	銘柄数<比率>	12	12	-	<0.4%>	
(コロンビア)				千コロンビア・ペソ		
BANCOLOMBIA SA		25	25	76,013	2,783	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		16	45	126,121	4,618	銀行
ECOPETROL SA		180	-	-	-	エネルギー
INTERCONEXION ELECTRICA SA		14	14	23,187	849	公益事業
小計	株数・金額	237	85	225,321	8,251	
	銘柄数<比率>	4	3	-	<0.1%>	
(インド)				千インド・ルピー		
ABB INDIA LTD		-	5	2,215	4,009	資本財
ACC LTD		2	-	-	-	素材
ADANI ENTERPRISES LTD		15	15	3,450	6,244	資本財
ADANI GREEN ENERGY LTD		18	27	2,592	4,693	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON		33	38	3,082	5,578	運輸
ADANI POWER LTD		51	51	1,988	3,598	公益事業
ADANI TOTAL GAS LTD		16	-	-	-	公益事業
ADANI TRANSMISSION LTD		16	-	-	-	公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD		25	50	2,140	3,874	素材
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE		4	8	4,520	8,181	ヘルスケア機器・サービス
ASHOK LEYLAND LTD		-	114	1,996	3,614	資本財
ASIAN PAINTS LTD		22	30	9,665	17,493	素材
ASTRAL LTD		-	10	1,955	3,539	資本財
AU SMALL FINANCE BANK LTD		11	11	841	1,522	銀行
AUROBINDO PHARMA LTD		8	20	2,112	3,823	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVENUE SUPERMARTS LTD		8	13	5,049	9,139	生活必需品流通・小売り
AXIS BANK LTD		131	186	18,537	33,553	銀行
BAJAJ AUTO LTD		2	5	3,339	6,044	自動車・自動車部品
BAJAJ FINANCE LTD		15	22	16,420	29,721	金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD		21	32	5,214	9,438	金融サービス
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN		-	2	1,579	2,859	金融サービス
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD		3	3	875	1,583	自動車・自動車部品
BANDHAN BANK LTD		35	35	771	1,396	銀行
BANK OF BARODA		-	94	1,868	3,382	銀行
BERGER PAINTS INDIA LTD		19	23	1,390	2,517	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	
BHARAT ELECTRONICS LTD	212	240	3,517	6,366	資本財
BHARAT FORGE LTD	17	17	1,906	3,450	自動車・自動車部品
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	50	50	1,971	3,567	エネルギー
BHARTI AIRTEL LTD	120	181	17,236	31,197	電気通信サービス
BIOCON LTD	15	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5	8	4,142	7,498	食品・飲料・タバコ
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LIMITED	—	47	1,839	3,330	資本財
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	21	36	4,145	7,502	金融サービス
CIPLA LIMITED	25	43	5,486	9,929	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COAL INDIA LTD	120	136	4,708	8,523	エネルギー
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	7	7	1,602	2,900	家庭用品・パーソナル用品
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	16	16	1,271	2,301	運輸
CUMMINS INDIA LTD	—	10	1,954	3,536	資本財
DABUR INDIA LTD	37	42	2,322	4,203	家庭用品・パーソナル用品
DIVI'S LABORATORIES LTD	7	8	2,898	5,246	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DLF LTD	40	45	2,876	5,206	不動産管理・開発
DR. REDDY'S LABORATORIES	6	8	4,595	8,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EICHER MOTORS LTD	6	11	4,271	7,730	自動車・自動車部品
GAIL INDIA LTD	148	148	1,872	3,389	公益事業
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	26	29	2,976	5,388	家庭用品・パーソナル用品
GODREJ PROPERTIES LTD	6	6	1,128	2,043	不動産管理・開発
GRASIM INDUSTRIES LTD	14	16	3,294	5,963	素材
HAVELLS INDIA LTD	14	16	2,159	3,908	資本財
HCL TECHNOLOGIES LTD	61	77	10,194	18,451	ソフトウェア・サービス
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	7	2,287	4,140	金融サービス
HDFC BANK LTD	—	225	33,900	61,360	銀行
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	51	82	5,408	9,789	保険
HERO MOTOCORP LTD	7	8	2,757	4,991	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	88	100	4,997	9,046	素材
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	—	14	3,142	5,687	資本財
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	19	19	598	1,082	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	44	68	17,238	31,202	家庭用品・パーソナル用品
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	96	—	—	—	金融サービス
ICICI BANK LTD	288	415	38,348	69,409	銀行
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	14	16	2,387	4,321	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	23	23	1,313	2,377	保険
IDFC BANK LTD	—	262	2,234	4,043	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)	百株	百株	千ドル・ルピー	千円	
INDIAN HOTELS CO LTD	—	77	3,178	5,753	消費者サービス
INDIAN OIL CORPORATION LTD	89	256	2,635	4,770	エネルギー
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	13	13	941	1,704	商業・専門サービス
INDRAPRASTHA GAS LTD	10	10	422	765	公益事業
INDUS TOWERS LTD	41	—	—	—	電気通信サービス
INFO EDGE INDIA LTD	3	5	2,849	5,157	メディア・娯楽
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	187	267	38,396	69,498	ソフトウェア・サービス
INTERGLOBE AVIATION LTD	5	10	2,846	5,151	運輸
ITC LTD	159	235	10,351	18,736	食品・飲料・タバコ
JINDAL STEEL & POWER LTD	27	27	1,807	3,271	素材
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	—	215	4,753	8,603	金融サービス
JSW STEEL LTD	46	52	4,052	7,334	素材
JUBILANT FOODWORKS LTD	20	20	1,090	1,973	消費者サービス
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	32	88	15,528	28,106	銀行
LARSEN & TOUBRO LTD	40	53	16,664	30,162	資本財
LTIMINDTREE LIMITED	3	6	3,449	6,242	ソフトウェア・サービス
LUPIN LTD	9	9	1,085	1,963	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	50	76	12,148	21,989	自動車・自動車部品
MARICO LTD	28	46	2,445	4,426	食品・飲料・タバコ
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	6	11	11,670	21,123	自動車・自動車部品
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	—	65	3,970	7,186	ヘルスケア機器・サービス
MINDTREE LTD	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MPHASIS LTD	4	4	967	1,750	ソフトウェア・サービス
MRF LTD	0.07	0.07	780	1,412	自動車・自動車部品
MUTHOOT FINANCE LTD	4	4	600	1,086	金融サービス
NESTLE INDIA LTD	1	2	6,629	11,999	食品・飲料・タバコ
NTPC LTD	244	382	9,628	17,428	公益事業
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	145	279	5,488	9,934	エネルギー
PAGE INDUSTRIES LTD	0.33	0.55	2,062	3,732	耐久消費財・アパレル
PETRONET LNG LTD	18	66	1,312	2,375	エネルギー
PI INDUSTRIES LTD	3	7	2,671	4,836	素材
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8	15	3,820	6,915	素材
POWER FINANCE CORPORATION	—	95	3,027	5,479	金融サービス
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	166	394	8,259	14,950	公益事業
REC LTD	—	90	3,077	5,570	金融サービス
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	169	244	57,494	104,064	エネルギー
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	90	244	2,205	3,992	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	千インド・ルピー	千円	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	10	27	2,045	3,702	金融サービス	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	23	36	5,228	9,464	保険	
SHREE CEMENT LTD	0.75	0.75	1,964	3,556	素材	
SHRIRAM FINANCE LIMITED	12	22	4,500	8,145	金融サービス	
SIEMENS LTD	-	6	2,221	4,020	資本財	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	-	39	2,289	4,144	自動車・自動車部品	
SRF LTD	7	13	3,150	5,701	素材	
STATE BANK OF INDIA	105	148	8,333	15,082	銀行	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	51	71	8,599	15,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SUPREME INDUSTRIES LTD	-	5	2,106	3,812	素材	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	51	73	25,795	46,689	ソフトウェア・サービス	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	33	38	3,553	6,431	食品・飲料・タバコ	
TATA ELXSI LTD	2	2	1,744	3,157	ソフトウェア・サービス	
TATA MOTORS LTD	95	139	9,521	17,234	自動車・自動車部品	
TATA POWER CO LTD	-	138	3,637	6,584	公益事業	
TATA STEEL LTD	446	598	7,489	13,556	素材	
TECH MAHINDRA LTD	32	47	5,666	10,255	ソフトウェア・サービス	
TITAN CO LTD	19	26	8,841	16,002	耐久消費財・アパレル	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	5	5	1,070	1,937	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRENT LTD	11	12	3,346	6,057	一般消費財・サービス流通・小売り	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	-	8	2,842	5,144	自動車・自動車部品	
TVS MOTOR CO LTD	-	20	3,524	6,380	自動車・自動車部品	
ULTRATECH CEMENT LTD	5	9	8,175	14,797	素材	
UNITED SPIRITS LTD	18	18	1,903	3,445	食品・飲料・タバコ	
UPL LTD	25	46	2,616	4,736	素材	
VARUN BEVERAGES LTD	-	40	4,246	7,686	食品・飲料・タバコ	
VEDANTA LTD	47	47	1,129	2,043	素材	
WIPRO LTD	67	106	4,199	7,601	ソフトウェア・サービス	
YES BANK LTD	-	925	1,924	3,483	銀行	
ZOMATO LTD	78	260	3,183	5,762	消費者サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,875 105	9,581 122	687,767 -	1,244,859 <13.4%>	
(インドネシア)				千インドネシア・ルピア		
ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	842	842	213,868	2,074	エネルギー	
ADARO MINERALS INDONESIA TBK	529	-	-	-	素材	
ANEKA TAMBANG TBK	532	532	86,982	843	素材	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,220	1,734	988,380	9,587	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		
(インドネシア)		百株	百株	千円(₹7・此)	千円	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	3,297	4,642	4,212,615	40,862	銀行	
BANK JAGO TBK PT	224	—	—	—	銀行	
BANK MANDIRI TBK	1,081	3,107	1,833,130	17,781	銀行	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	487	1,104	549,792	5,332	銀行	
BANK RAKYAT INDONESIA	3,757	5,757	3,008,032	29,177	銀行	
BARITO PACIFIC TBK PT	885	2,725	317,576	3,080	素材	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	455	455	250,250	2,427	食品・飲料・タバコ	
GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	—	69,688	585,379	5,678	一般消費財・サービス流通・小売り	
GUDANG GARAM TBK PT	11	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	60	60	51,000	494	素材	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	96	96	100,560	975	食品・飲料・タバコ	
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	104	104	66,820	648	食品・飲料・タバコ	
INTERNATIONAL NICKEL INDONES	181	181	83,079	805	素材	
KALBE FARMA TBK PT	569	1,761	285,282	2,767	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	1,136	268,096	2,600	素材	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,626	1,626	159,348	1,545	電気通信サービス	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	94	94	62,275	604	素材	
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	998	998	288,422	2,797	生活必需品流通・小売り	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	2,690	4,000	1,420,000	13,774	電気通信サービス	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	491	491	170,377	1,652	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED TRACTORS TBK PT	106	106	242,475	2,352	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	20,963 24	101,239 22	15,243,739 —	147,864 <1.6%>	
(ブラジル)				千ブラジル・リアル		
AMBEV SA	268	365	496	15,154	食品・飲料・タバコ	
AMERICANAS SA	38	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
ATACADAO SA	19	19	20	618	生活必需品流通・小売り	
BANCO BRADESCO S.A.	63	172	236	7,216	銀行	
BANCO BRADESCO SA-PREF	329	413	638	19,492	銀行	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	69	92	307	9,397	金融サービス	
BANCO DO BRASIL SA	57	65	329	10,052	銀行	
BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	30	30	92	2,830	銀行	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	39	44	139	4,268	保険	
BM&FBOVESPA SA	349	477	607	18,537	金融サービス	
BRF SA	43	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
CCR SA	68	68	89	2,721	運輸	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	69	101	408	12,460	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	26	114	3,509	公益事業
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	84	84	113	3,459	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	22	25	161	4,935	公益事業
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	-	51	75	2,313	素材
COSAN SA	56	104	186	5,696	エネルギー
CPFL ENERGIA SA	-	30	109	3,341	公益事業
ENERGISA SA-UNITS	6	23	118	3,629	公益事業
ENEVA SA	-	83	106	3,253	公益事業
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6	6	29	887	公益事業
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	53	86	294	8,992	公益事業
GERDAU SA-PREF	62	100	245	7,497	素材
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	276	435	199	6,083	ヘルスケア機器・サービス
HYPERA S.A	26	29	98	3,005	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	282	406	1,237	37,788	銀行
ITAUUSA SA	282	413	406	12,411	銀行
JBS SA	42	71	153	4,690	食品・飲料・タバコ
KLABIN SA - UNIT	40	40	92	2,824	素材
LOCALIZA RENT A CAR	41	73	449	13,726	運輸
LOJAS RENNER S.A.	59	59	85	2,611	一般消費財・サービス流通・小売り
MAGAZINE LUIZA SA	152	152	33	1,030	一般消費財・サービス流通・小売り
NATURA &CO HOLDING SA	42	73	111	3,400	家庭用品・パーソナル用品
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	211	320	1,264	38,608	エネルギー
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	271	366	1,343	41,018	エネルギー
PRIO S.A.	38	67	311	9,507	エネルギー
RAIA DROGASIL SA	59	109	299	9,131	生活必需品流通・小売り
REDE D'OR SAO LUIZ SA	25	53	133	4,079	ヘルスケア機器・サービス
RUMO SA	72	82	190	5,820	運輸
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	-	117	153	4,682	生活必需品流通・小売り
SUZANO S.A.	37	56	297	9,086	素材
TELEFONICA BRASIL S.A.	27	31	156	4,766	電気通信サービス
TIM SA	35	35	58	1,771	電気通信サービス
TOTVS SA	25	44	143	4,369	ソフトウェア・サービス
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	22	52	128	3,908	エネルギー
VALE SA	228	275	2,045	62,450	素材
VIBRA ENERGIA SA	69	78	167	5,114	一般消費財・サービス流通・小売り
WEG SA	85	124	413	12,611	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,188 45	6,030 47	14,896 -	454,768 <4.9%>

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		10	13	1,379	9,201	公益事業
KOMERCNI BANKA AS		6	6	444	2,960	銀行
MONETA MONEY BANK AS		11	11	102	682	銀行
小計	株数・金額	27	31	1,926	12,844	
	銘柄数<比率>	3	3	-	<0.1%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
ALTEOGEN INC		0.98	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMOREPACIFIC CORP		1	3	47,902	5,537	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC GROUP		3	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品
BGF RETAIL CO LTD/NEW		0.15	0.15	2,002	231	生活必需品流通・小売り
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD		4	9	68,987	7,974	ヘルスケア機器・サービス
CELLTRION INC		5	9	154,591	17,870	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION PHARM INC		-	1	14,402	1,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEIL WORLDWIDE INC		1	-	-	-	メディア・娯楽
CJ CHEILJEDANG CORP		0.61	0.61	19,459	2,249	食品・飲料・タバコ
CJ CORP		0.53	-	-	-	資本財
CJ ENM CO LTD		0.28	-	-	-	メディア・娯楽
CJ LOGISTICS		0.16	-	-	-	運輸
COSMOAM&T CO LTD		-	2	32,595	3,767	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COWAY CO LTD		3	3	16,192	1,871	耐久消費財・アパレル
DAUM COMMUNICATIONS CORP		17	24	117,895	13,628	メディア・娯楽
DB INSURANCE CO LTD		1	3	29,620	3,424	保険
DOOSAN BOBCAT INC		2	2	11,124	1,286	資本財
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES		-	33	48,422	5,597	資本財
ECOPRO BM CO LTD		2	4	99,246	11,472	資本財
ECOPRO CO LTD		-	1	107,961	12,480	素材
E-MART CO LTD		0.63	-	-	-	生活必需品流通・小売り
F&F CO LTD / NEW		0.90	0.90	7,956	919	耐久消費財・アパレル
GREEN CROSS CORP		0.38	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GS ENGINEERING & CONSTRUCT		1	-	-	-	資本財
GS HOLDINGS CORP		4	4	17,297	1,999	資本財
HANA FINANCIAL GROUP		16	24	100,131	11,575	銀行
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD		5	5	23,815	2,753	自動車・自動車部品
HANMI PHARM CO LTD		0.58	0.59	17,788	2,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD		-	3	23,047	2,664	半導体・半導体製造装置
HANON SYSTEMS		9	9	6,902	797	自動車・自動車部品
HANWHA AEROSPACE CO LTD		-	3	40,029	4,627	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
HANWHA SOLUTIONS CORP	6	9	30,734	3,552	素材
HD HYUNDAI	3	3	21,407	2,474	エネルギー
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1	1	14,259	1,648	資本財
HD KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2	3	33,093	3,825	資本財
HLB INC	5	6	19,896	2,300	ヘルスケア機器・サービス
HLB INC-RIGHTS	0.52	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
HMM CO LTD	12	22	34,162	3,949	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD	0.99	2	17,371	2,008	一般消費財・サービス流通・小売り
HYBE CO LTD	0.99	1	29,877	3,453	メディア・娯楽
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	4	4	17,395	2,010	資本財
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1	1	22,990	2,657	運輸
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	-	2	15,984	1,847	資本財
HYUNDAI MOBIS	3	4	113,373	13,105	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	7	10	198,230	22,915	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2	2	25,764	2,978	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	1	1	18,258	2,110	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	5	5	18,559	2,145	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	22	22	25,754	2,977	銀行
JYP ENTERTAINMENT CORP	-	2	19,595	2,265	メディア・娯楽
KAKAO GAMES CORP	1	1	3,862	446	メディア・娯楽
KAKAOBANK CORP	7	16	39,579	4,575	銀行
KAKAOPAY CORP	-	2	10,366	1,198	金融サービス
KANGWON LAND INC	3	3	5,498	635	消費者サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	21	29	162,817	18,821	銀行
KIA CORPORATION	15	20	178,834	20,673	自動車・自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5	5	23,690	2,738	資本財
KOREA ELECTRIC POWER CORP	13	21	37,658	4,353	公益事業
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1	4	27,849	3,219	金融サービス
KOREA ZINC CO LTD	0.53	0.53	25,890	2,992	素材
KOREAN AIR LINES CO LTD	11	11	27,014	3,122	運輸
KRAFTON INC	1	2	46,344	5,357	メディア・娯楽
KT CORP	-	7	24,655	2,850	電気通信サービス
KT&G CORP	4	7	71,562	8,272	食品・飲料・タバコ
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1	1	13,241	1,530	素材
L&F CO LTD	1	1	29,175	3,372	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD	2	4	194,568	22,492	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	0.56	0.56	16,744	1,935	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
LG CORP	5	8	73,102	8,450	資本財
LG DISPLAY CO LTD	13	13	18,087	2,090	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG ELECTRONICS INC	6	9	96,926	11,204	耐久消費財・アパレル
LG ENERGY SOLUTION	1	3	165,456	19,126	資本財
LG H AND H CO LTD	0.64	1	33,750	3,901	家庭用品・パーソナル用品
LG H AND H CO LTD-PFD	0.04	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品
LG INNOTEK CO LTD	0.83	0.83	20,667	2,389	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13	13	13,936	1,611	金融サービス
LG UPLUS CORP	8	8	8,508	983	電気通信サービス
LOTTE CHEMICAL CORP	1	1	17,503	2,023	素材
LOTTE ENERGY MATERIALS CORPORATION	1	1	5,210	602	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LOTTE SHOPPING CO	0.22	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	-	8	47,403	5,479	金融サービス
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	2	-	-	-	保険
MERITZ SECURITIES CO LTD	10	-	-	-	金融サービス
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	13	13	9,669	1,117	金融サービス
NAVER CORP	7	10	219,574	25,382	メディア・娯楽
NCSOFT CORPORATION	0.86	1	33,428	3,864	メディア・娯楽
NETMARBLE CORPORATION	0.58	0.58	2,781	321	メディア・娯楽
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	0.92	2	28,220	3,262	食品・飲料・タバコ
PEARL ABYSS CORP	1	1	6,582	760	メディア・娯楽
POSCO FUTURE M CO LTD	1	2	77,220	8,926	資本財
POSCO HOLDINGS INC	4	5	272,538	31,505	素材
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	-	4	24,835	2,871	資本財
S-1 CORPORATION	0.32	-	-	-	商業・専門サービス
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1	1	104,835	12,118	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	7	82,647	9,554	資本財
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	3	5	69,978	8,089	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	266	379	2,750,940	318,008	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	46	67	387,895	44,840	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8	12	30,426	3,517	資本財
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	1	2	49,245	5,692	保険
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	32	51	37,754	4,364	資本財
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	4	4	34,204	3,954	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	3	4	198,912	22,994	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG SDS CO LTD	1	3	53,874	6,227	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4	4	17,537	2,027	金融サービス

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		
	SD BIOSENSOR INC	2	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
	SEEGENE INC	1	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	26	35	129,454	14,964	銀行	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1	1	13,026	1,505	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	1	7,716	892	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	-	-	-	素材	
	SK HYNIX INC	30	43	570,780	65,982	半導体・半導体製造装置	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1	1	12,217	1,412	素材	
	SK INC	2	3	54,768	6,331	資本財	
	SK INNOVATION CO LTD	3	4	66,961	7,740	エネルギー	
	SK SQUARE CO LTD	5	5	26,341	3,045	資本財	
	SKC CO LTD	1	1	12,693	1,467	素材	
	S-OIL CORPORATION	3	3	20,340	2,351	エネルギー	
	STX PAN OCEAN CO LTD	18	18	7,611	879	運輸	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	38	43	54,055	6,248	銀行	
	YUHAN CORP	1	4	27,596	3,190	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>	875 109	1,227 103	8,620,643 -	996,546 <10.7%>	
(中国)				千人民元			
	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	45	45	42	889	ソフトウェア・サービス	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	5	5	88	1,838	半導体・半導体製造装置	
	AECC AVIATION POWER CO-A	10	31	115	2,391	資本財	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	338	718	260	5,410	銀行	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	35	46	80	1,677	ヘルスケア機器・サービス	
	AIR CHINA LTD-A	-	101	82	1,704	運輸	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	-	148	86	1,788	素材	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	10	10	23	486	素材	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3	3	77	1,608	食品・飲料・タバコ	
	ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	1	1	20	422	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	31	658	金融サービス	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	86	86	38	797	銀行	
	BANK OF CHINA LTD-A	321	321	126	2,632	銀行	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	222	222	128	2,668	銀行	
	BANK OF JIANGSU CO LTD-A	78	78	52	1,081	銀行	
	BANK OF NANJING CO LTD -A	-	88	67	1,397	銀行	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	17	43	106	2,220	銀行	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45	45	27	560	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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	57	57	35	731	素材
BBMG CORPORATION-A	141	-	-	-	素材
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	2	2	71	1,481	ソフトウェア・サービス
BEIJING TONGRENTANG CO-A	-	20	100	2,082	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING UNITED INFORMATION-A	-	13	49	1,025	資本財
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	4	5	27	564	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	242	118	2,461	運輸
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	110	454	180	3,750	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BYD CO LTD -A	7	13	307	6,389	自動車・自動車部品
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	75	75	61	1,279	金融サービス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	1	1	15	328	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	123	123	71	1,480	金融サービス
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	96	96	61	1,271	銀行
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	32	32	82	1,707	資本財
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	68	68	28	594	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	97	370	108	2,242	銀行
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	69	69	92	1,923	金融サービス
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	-	24	105	2,189	金融サービス
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	10	10	31	655	保険
CHINA MERCHANTS BANK-A	69	108	327	6,799	銀行
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	27	105	150	3,121	金融サービス
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	19	19	20	425	不動産管理・開発
CHINA MINSHENG BANKING-A	212	212	80	1,672	銀行
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	106	106	74	1,553	公益事業
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	16	16	33	701	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	15	40	96	2,006	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	84	259	140	2,924	エネルギー
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	88	88	51	1,061	資本財
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	171	108	50	1,053	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	-	14	77	1,605	半導体・半導体製造装置
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20	48	147	3,068	エネルギー
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	47	47	28	598	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	108	229	116	2,419	資本財
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	128	128	60	1,254	公益事業
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	8	8	74	1,554	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA VANKE CO LTD -A	22	81	94	1,953	不動産管理・開発
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	90	134	303	6,291	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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	5	5	34	724	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	246	246	61	1,276	銀行
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	58	58	96	2,004	自動車・自動車部品
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4	6	38	801	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	67	150	3,132	金融サービス
CMOC GROUP LTD-A	113	113	59	1,231	素材
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	-	13	69	1,448	素材
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	9	22	412	8,553	資本財
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	50	50	49	1,019	運輸
CSC FINANCIAL CO LTD-A	26	26	68	1,421	金融サービス
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	-	42	63	1,320	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	50	60	91	1,909	金融サービス
EVE ENERGY CO LTD-A	9	9	40	850	資本財
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	59	59	39	813	メディア・娯楽
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	10	25	97	2,019	食品・飲料・タバコ
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	83	116	116	2,419	金融サービス
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	26	63	103	2,138	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	-	28	104	2,162	自動車・自動車部品
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	7	28	123	2,560	素材
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	132	132	51	1,065	公益事業
GEM CO LTD-A	-	133	79	1,639	素材
GF SECURITIES CO LTD-A	37	37	54	1,137	金融サービス
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	1	1	20	427	半導体・半導体製造装置
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2	2	13	289	資本財
GOERTEK INC -A	10	10	19	399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GOLDWIND SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A	39	39	35	732	資本財
GONGNIU GROUP CO LTD-A	-	7	68	1,419	資本財
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	18	18	42	874	資本財
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	7	35	97	2,029	自動車・自動車部品
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	32	32	104	2,158	耐久消費財・アパレル
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	10	10	44	929	食品・飲料・タバコ
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	54	54	40	836	エネルギー
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	-	87	86	1,793	自動車・自動車部品
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13	13	38	796	ヘルスケア機器・サービス
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	10	10	27	565	素材
GUANGZHOU YUJIXIU CAPITAL HOLDINGS GROUP CO LTD-A	98	98	64	1,348	金融サービス
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	112	112	110	2,287	金融サービス

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	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	33	33	50	1,046	金融サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A	20	55	122	2,536	耐久消費財・アパレル
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	29	126	126	2,618	金融サービス
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	8	11	30	634	半導体・半導体製造装置
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	8	8	20	421	食品・飲料・タバコ
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	28	79	110	2,304	素材
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	28	28	37	778	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	57	57	39	828	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	-	7	105	2,188	金融サービス
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	4	4	21	453	素材
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	13	13	53	1,115	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG POWER INTL INC-A	77	77	59	1,232	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	21	85	134	2,794	金融サービス
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	41	41	33	694	金融サービス
HUAXIA BANK CO LTD-A	62	62	34	715	銀行
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	14	14	24	512	自動車・自動車部品
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	5	5	69	1,434	自動車・自動車部品
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	11	11	38	798	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	12	12	59	1,225	ソフトウェア・サービス
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	1	1	32	677	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	544	260	5,397	銀行
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	89	140	205	4,274	銀行
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	324	324	51	1,076	素材
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	21	21	8	174	素材
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	28	28	75	1,566	食品・飲料・タバコ
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	9	13	31	652	半導体・半導体製造装置
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	29	29	30	627	素材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	10	10	58	1,217	資本財
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS CO LTD-A	33	33	159	3,311	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	-	13	70	1,465	食品・飲料・タバコ
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	4	9	104	2,174	食品・飲料・タバコ
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	22	22	31	649	資本財
JIANGXI COPPER CO LTD-A	20	20	35	742	素材
JINKO SOLAR CO LTD-A	-	60	60	1,265	半導体・半導体製造装置
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	-	66	96	1,996	資本財
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	4	6	1,052	21,838	食品・飲料・タバコ
LB GROUP CO LTD-A	29	29	51	1,064	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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	24	24	32	675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	139	139	94	1,956	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	30	64	152	3,173	半導体・半導体製造装置
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	30	30	98	2,045	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4	9	187	3,891	食品・飲料・タバコ
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	13	13	36	754	メディア・娯楽
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	4	4	65	1,353	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	205	205	66	1,370	資本財
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	-	9	58	1,211	半導体・半導体製造装置
MUYUAN FOODS CO LTD-A	21	21	80	1,679	食品・飲料・タバコ
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	25	31	69	1,433	資本財
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	2	2	49	1,025	半導体・半導体製造装置
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	9	9	29	602	保険
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	18	18	17	369	食品・飲料・タバコ
NINESTAR CORP-A	17	17	48	1,001	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	-	54	76	1,582	素材
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	7	7	51	1,059	自動車・自動車部品
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	44	44	63	1,311	素材
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	45	45	40	839	金融サービス
PETROCHINA CO LTD-A	69	297	209	4,340	エネルギー
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	4	6	23	479	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	77	1,617	保険
PING AN BANK CO LTD-A	97	97	98	2,043	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	37	49	209	4,339	保険
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	27	27	29	607	不動産管理・開発
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	122	122	54	1,139	銀行
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	100	100	51	1,062	資本財
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	27	27	45	936	素材
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	30	30	33	690	素材
S F HOLDING CO LTD-A	22	22	90	1,870	運輸
SAIC MOTOR CORP LTD-A	21	80	115	2,404	自動車・自動車部品
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	-	51	74	1,548	半導体・半導体製造装置
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	30	30	42	884	資本財
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	-	46	72	1,512	素材
SDIC CAPITAL CO LTD-A	-	137	97	2,021	金融サービス
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	57	-	-	-	公益事業
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	23	23	28	581	不動産管理・開発

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	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	47	47	86	1,802	エネルギー
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	4	4	10	217	素材
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	19	19	56	1,177	素材
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	-	302	89	1,855	素材
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	13	15	67	1,399	ソフトウェア・サービス
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	63	63	28	593	資本財
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	7	36	101	2,107	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	86	86	41	871	運輸
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	51	51	55	1,152	不動産管理・開発
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	-	55	99	2,056	ヘルスケア機器・サービス
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	67	189	129	2,691	銀行
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	8	11	28	593	素材
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	-	148	85	1,766	銀行
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	56	56	32	671	金融サービス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	4	4	113	2,351	食品・飲料・タバコ
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	-	79	84	1,749	素材
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	1	1	10	221	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	110	110	50	1,054	金融サービス
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	1	1	12	252	素材
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	15	15	92	1,911	資本財
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	4	4	14	298	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	142	2,963	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	3	3	41	861	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	-	18	41	862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	19	-	-	-	金融サービス
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	5	5	43	907	資本財
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	1	1	19	404	資本財
TBEA CO LTD-A	22	28	40	836	資本財
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	40	44	18	380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	15	18	34	723	半導体・半導体製造装置
TIANMA MICROELECTRONICS-A	72	72	76	1,594	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANQI LITHIUM CORP-A	-	13	70	1,460	素材
TONGWEI CO LTD-A	15	39	106	2,210	半導体・半導体製造装置
TRINA SOLAR CO LTD-A	10	10	33	690	半導体・半導体製造装置
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	6	6	47	977	食品・飲料・タバコ
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4	4	32	674	半導体・半導体製造装置
UNISPLENDOR CORP LTD-A	9	9	21	437	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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	15	15	123	2,562	素材
WEICHAI POWER CO LTD-A	34	34	49	1,029	資本財
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	18	18	32	682	食品・飲料・タバコ
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	97	97	65	1,367	金融サービス
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	4	4	43	899	半導体・半導体製造装置
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2	2	10	207	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	23	491	一般消費財・サービス流通・小売り
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	40	52	41	865	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	15	23	356	7,400	食品・飲料・タバコ
WUXI APPTec CO LTD-A	6	18	159	3,317	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	14	307	資本財
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	-	47	82	1,714	素材
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	-	52	102	2,128	エネルギー
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	13	13	44	931	食品・飲料・タバコ
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	16	16	29	612	ソフトウェア・サービス
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	25	25	33	702	運輸
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7	7	35	730	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	19	410	素材
ZHANGZHOU PIEN TZE HUANG PHA-A	3	3	74	1,548	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	11	25	531	資本財
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30	30	62	1,294	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	6	6	23	489	素材
ZHEJIANG JINGSHENG MECHAN-A	8	8	35	747	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	10	10	16	346	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	20	428	金融サービス
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	-	124	90	1,884	金融サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	71	71	84	1,764	素材
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	94	94	61	1,266	資本財
ZTE CORP-A	7	7	19	400	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>	9,244 201	13,991 229	17,861 -	370,771 <4.0%>
(マレーシア)			千マレーシア・リンギット		
AMBANK HOLDINGS BHD	97	97	38	1,220	銀行
AXIATA GROUP BERHAD	205	205	49	1,588	電気通信サービス
CELCOMDIGI BERHAD	225	225	95	3,068	電気通信サービス
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	403	593	343	11,011	銀行
DIALOG GROUP BHD	149	149	31	1,020	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		
(マレーシア)		百株	百株	マレーシア・リンギット	千円	
GAMUDA BHD	–	188	87	2,804	資本財	
GENTING BHD	67	67	29	928	消費者サービス	
GENTING MALAYSIA BHD	113	113	28	918	消費者サービス	
HAP SENG CONSOLIDATED	11	–	–	–	資本財	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	47	–	–	–	ヘルスケア機器・サービス	
HONG LEONG BANK BERHAD	45	45	85	2,751	銀行	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	19	19	31	1,015	銀行	
IHH HEALTHCARE BHD	63	172	102	3,276	ヘルスケア機器・サービス	
INARI AMERTRON BHD	166	166	49	1,578	半導体・半導体製造装置	
IOI CORPORATION BHD	197	197	78	2,522	食品・飲料・タバコ	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	34	34	74	2,394	食品・飲料・タバコ	
MALAYAN BANKING BHD	287	465	424	13,577	銀行	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	49	49	36	1,165	運輸	
MAXIS BHD	196	196	79	2,560	電気通信サービス	
MISC BHD	50	50	36	1,182	運輸	
MR DIY GROUP M BHD	163	163	25	829	一般消費財・サービス流通・小売り	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2	6	73	2,356	食品・飲料・タバコ	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	133	285	205	6,587	素材	
PETRONAS DAGANGAN BHD	7	33	75	2,402	エネルギー	
PETRONAS GAS BHD	22	54	92	2,963	公益事業	
PPB GROUP BERHAD	18	56	84	2,691	食品・飲料・タバコ	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	230	261	127	4,077	素材	
PUBLIC BANK BHD	874	1,226	518	16,603	銀行	
QL RESOURCES BHD	30	30	16	537	食品・飲料・タバコ	
RHB BANK BHD	49	170	95	3,064	銀行	
SIME DARBY BERHAD	48	48	11	374	資本財	
SIME DARBY PLANTATION BHD	77	190	83	2,664	食品・飲料・タバコ	
TELEKOM MALAYSIA BHD	22	125	65	2,093	電気通信サービス	
TENAGA NASIONAL BHD	129	236	235	7,525	公益事業	
TOP GLOVE CORP BHD	341	–	–	–	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,568 34	5,913 32	3,415 –	109,361 <1.2%>	
(南アフリカ)				千南アフリカ・ランド		
ABSA GROUP LTD	47	68	1,211	9,901	銀行	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	6	6	109	892	素材	
ANGLO PLATINUM LTD	2	7	513	4,193	素材	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28	–	–	–	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	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	–	31	999	8,163	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	22	22	386	3,158	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BID CORP LTD	19	26	1,094	8,944	生活必需品流通・小売り
BIDVEST GROUP LTD	17	19	550	4,497	資本財
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	5	8	1,621	13,244	銀行
CLICKS GROUP LTD	12	20	598	4,887	生活必需品流通・小売り
DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	24	50	697	5,694	保険
EXXARO RESOURCES LTD	15	15	285	2,330	エネルギー
FIRSTRAND LTD	299	392	2,549	20,829	金融サービス
GOLD FIELDS LTD	46	73	1,755	14,345	素材
HARMONY GOLD MINING CO LTD	38	38	389	3,179	素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	45	66	543	4,442	素材
KUMBA IRON ORE LTD	4	4	244	1,994	素材
MR PRICE GROUP LTD	13	–	–	–	一般消費財・サービス流通・小売り
MTN GROUP LTD	99	133	1,246	10,183	電気通信サービス
MULTICHOICE GROUP LTD	13	–	–	–	メディア・娯楽
NASPERS LTD-N SHS	12	15	5,248	42,881	一般消費財・サービス流通・小売り
NEDBANK GROUP LTD	25	38	802	6,559	銀行
NEPI ROCKCASTLE S.A.	12	33	368	3,012	不動産管理・開発
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	19	36	429	3,508	素材
OLD MUTUAL LTD	287	287	354	2,895	保険
OUTSURANCE GROUP LTD	–	66	289	2,368	保険
PEPKOR HOLDINGS LTD	–	145	271	2,221	一般消費財・サービス流通・小売り
REINET INVESTMENTS SCA	7	7	333	2,724	金融サービス
REMGRO LTD	27	31	447	3,654	金融サービス
SANLAM LIMITED	97	142	991	8,098	保険
SASOL LTD	30	42	965	7,891	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD	25	39	980	8,006	生活必需品流通・小売り
SIBANYE STILLWATER LTD	156	249	592	4,836	素材
SPAR GROUP LIMITED/THE	5	–	–	–	生活必需品流通・小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	78	121	2,345	19,160	銀行
VODACOM GROUP LTD	42	66	679	5,547	電気通信サービス
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	60	68	461	3,771	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>	1,650 34	2,378 33	30,357 –	248,024 <2.7%>
(タイ)			千タイ・パーツ		
ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG		66	112	2,441	10,425 電気通信サービス

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	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	255	380	2,622	11,195	運輸
ASSET WORLD CORP PCL-FOREIGN	881	881	320	1,369	消費者サービス
B GRIMM POWER PCL-FOREIGN	31	31	81	347	公益事業
BANGKOK COMMERCIAL-FOREIGN	90	—	—	—	金融サービス
BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	597	934	2,475	10,568	ヘルスケア機器・サービス
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	236	713	581	2,481	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-FOR REG	—	856	693	2,960	エネルギー
BERLI JUCKER PUB CO-FORGN	60	60	166	710	生活必需品流通・小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL	574	574	421	1,801	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	39	44	963	4,114	ヘルスケア機器・サービス
CARABAO GROUP PCL-F	26	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	126	143	950	4,060	不動産管理・開発
CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN	67	157	620	2,648	一般消費財・サービス流通・小売り
CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	268	268	503	2,151	食品・飲料・タバコ
CP ALL PCL-FOREIGN	343	505	2,865	12,237	生活必需品流通・小売り
CP AXTRA PUBLIC COMPANY LIMITED (F)	—	199	587	2,506	生活必需品流通・小売り
DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN	—	255	2,071	8,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R	10	10	127	544	公益事業
ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN	89	192	912	3,894	公益事業
GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F	24	88	415	1,775	公益事業
GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	173	196	911	3,891	公益事業
HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	184	444	541	2,312	一般消費財・サービス流通・小売り
INDORAMA VENTURES-FOREIGN	122	122	311	1,328	素材
INTOUCH HOLDINGS PCL-F	63	63	452	1,930	電気通信サービス
JMT NETWORK SERVICES-FOREIGN	57	—	—	—	金融サービス
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	49	49	651	2,782	銀行
KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	323	323	594	2,537	銀行
KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN	54	155	709	3,027	金融サービス
LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	285	285	218	930	不動産管理・開発
MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	185	185	508	2,172	消費者サービス
MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG	21	21	91	392	金融サービス
OSOTSPA PCL-FOREIGN	32	32	77	332	食品・飲料・タバコ
PTT EXPLORATION & PROD-FOR	79	90	1,426	6,091	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	143	143	543	2,320	素材
PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN	142	329	654	2,795	一般消費財・サービス流通・小売り
PTT PCL/FOREIGN	526	753	2,579	11,012	エネルギー
RATCH GROUP PCL-FOREIGN	23	165	536	2,289	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	
(タイ)		百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
	SCB X PCL-FOREIGN	68	68	673	2,874	銀行
	SCG PACKAGING PCL-FOREIGN	73	73	273	1,168	素材
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	42	70	2,037	8,697	素材
	SRISAWADCORP PCL - FOREIGN	24	—	—	—	金融サービス
	THAI OIL PCL-FRGN	93	93	465	1,985	エネルギー
	THAI UNION GROUP PCL-F	98	—	—	—	食品・飲料・タバコ
	TRUE CORP PCL/NEW-FOREIGN	—	607	370	1,583	電気通信サービス
	TRUE CORP PCL-FOREIGN	1,013	—	—	—	電気通信サービス
小計	株数・金額	7,654	10,668	34,449	147,100	
	銘柄数<比率>	42	40	—	<1.6%>	
(ポーランド)				千ポーランド・ズロチ		
	ALLEGRO.EU SA	16	34	101	3,774	一般消費財・サービス流通・小売り
	BANK PEKAO SA	11	13	185	6,897	銀行
	BUDIMEX	—	0.97	52	1,966	資本財
	CD PROJEKT SA	4	4	48	1,800	メディア・娯楽
	CYFROWY POLSAT SA	10	10	12	470	メディア・娯楽
	DINO POLSKA SA	2	3	146	5,446	生活必需品流通・小売り
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	8	15	183	6,836	素材
	LPP SA	0.04	0.09	137	5,114	耐久消費財・アパレル
	MBANK SA	—	1	63	2,374	銀行
	ORANGE POLSKA SA	13	—	—	—	電気通信サービス
	ORLEN SA	40	46	288	10,751	エネルギー
	PEPCO GROUP NV	—	15	29	1,088	一般消費財・サービス流通・小売り
	PGE SA	17	88	62	2,346	公益事業
	PKO BANK POLSKI SA	50	71	340	12,686	銀行
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	34	49	231	8,623	保険
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	1	3	176	6,575	銀行
小計	株数・金額	211	358	2,059	76,754	
	銘柄数<比率>	13	15	—	<0.8%>	
(ハンガリー)				千ハンガリー・フォリント		
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	26	42	11,976	5,164	エネルギー
	OTP BANK RT	11	18	25,192	10,862	銀行
	RICHTER GEDEON NYRT	8	8	7,638	3,293	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	46	69	44,807	19,320	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<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	
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	–	126	19	3,128	銀行
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	–	173	29	4,750	銀行
FF GROUP	1	1	0.619	101	耐久消費財・アパレル
HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	15	17	22	3,681	電気通信サービス
JUMBO SA	9	11	30	4,910	一般消費財・サービス流通・小売り
MOTOR OIL (HELLAS) SA	–	5	12	2,062	エネルギー
MYTILINEOS S.A.	13	7	24	4,015	資本財
NATIONAL BANK OF GREECE	–	46	28	4,604	銀行
OPAP SA	18	20	30	4,973	消費者サービス
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	–	55	17	2,828	銀行
PUBLIC POWER CORP	27	14	14	2,389	公益事業
小計	株数・金額	85	479	228	37,446
	銘柄数<比率>	6	11	–	<0.4%>
合計	株数・金額	137,055	267,956	–	7,389,780
	銘柄数<比率>	1,000	1,048	–	<79.6%>

(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		31	51	767	115,062
ISHARES MSCI QATAR CP ETF		19	29	521	78,163
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF		38	57	2,268	340,208
ISHARES MSCI KUWAIT ETF		8	14	443	66,483
小計	□数・金額	97	152	4,000	599,918
	銘柄数<比率>	4	4	—	<6.5%>
(メキシコ)				千メキシコ・ペソ	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		18	21	613	5,339
小計	□数・金額	18	21	613	5,339
	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		19	19	200	1,640
小計	□数・金額	19	19	200	1,640
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>
合計	□数・金額	136	193	—	606,898
	銘柄数<比率>	6	6	—	<6.5%>

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

(注2) □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	1,268	—

(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	7,389,780	79.0
投資信託証券	606,898	6.5
コール・ローン等、その他	1,352,276	14.5
投資信託財産総額	9,348,956	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香港ドル19.23円、1台湾ドル4.712円、1イギリス・ポンド186.69円、1トルコ・リラ5.234円、1メキシコ・ペソ8.704円、1フィリピン・ペソ2.692円、100チリ・ペソ16.87円、100コロンビア・ペソ3.662円、1インド・ルピー1.81円、100インドネシア・ルピア0.97円、1ブラジル・レアル30.529円、1チェコ・コルナ6.667円、100韓国ウォン11.56円、1人民元20.758円、1マレーシア・リングギット32.015円、1南アフリカ・ランド8.17円、1タイ・バーツ4.27円、1ポーランド・ズロチ37.264円、100ハンガリー・フォリント43.119円、1ユーロ163.54円です。

(注2) 外貨建純資産 (8,413,245千円) の投資信託財産総額 (9,348,956千円) に対する比率は90.0%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

(2023年11月20日現在)

項目		当期末
(A)資産	産	10,223,961,401円
コーポレート債		1,012,938,757
株式(評価額)		7,389,780,711
投資信託証券(評価額)		606,898,904
未収入金		910,597,799
未収配当金		8,747,913
差入委託証拠金		294,997,317
(B)負債	債	934,857,729
未払金		886,347,454
未払解約金		48,509,343
その他未払費用		932
(C)純資産総額(A-B)		9,289,103,672
元本		7,117,768,792
次期繰越損益金		2,171,334,880
(D)受益権総口数		7,117,768,792口
1万口当たり基準価額(C/D)		13,051円

(注1) 期首元本額 4,729,645,782円
 期中追加設定元本額 3,508,693,484円
 期中一部解約元本額 1,120,570,474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 2,915,896,360円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式) 21,977,301円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート) 29,170,813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) 10,602,726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) 60,797,503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) 613,202,841円
 ニッセイ新興国株式インデックス (ラップ専用) 1,803,005,099円
 FWニッセイ新興国株インデックス 10,439,849円
 DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト 141,867円
 DCニッセイ新興国株式インデックス 1,652,534,433円

損益の状況

当期 (2022年11月22日~2023年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	187,395,746円
受取配当金	175,723,318
受取利息	2,893,239
その他収益金	8,993,546
支払利息	△ 214,357
(B)有価証券売買損益	776,451,878
売買益	1,402,492,963
売買損	△ 626,041,085
(C)先物取引等損益	5,285,260
取引益	73,976,707
取引損	△ 68,691,447
(D)信託報酬等	△ 16,654,430
(E)当期損益金(A+B+C+D)	952,478,454
(F)前期繰越損益金	699,291,835
(G)追加信託差損益金	761,284,175
(H)解約差損益金	△ 241,719,584
(I)合計(E+F+G+H)	2,171,334,880
次期繰越損益金(I)	2,171,334,880

(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。