

# DCニッセイターゲットデートファンド 2025/2030/2035/2040/ 2045/2050/2055/2060/2065

追加型投信／内外／資産複合

## 運用報告書(全体版)

作成対象期間：2021年12月21日～2022年12月20日

<2025/2035/2045>

第6期(決算日 2022年12月20日)

<2055>

第7期(決算日 2022年12月20日)

<2030/2040/2050/2060>

第4期(決算日 2022年12月20日)

作成対象期間：2022年1月11日～2022年12月20日

<2065>

第1期(決算日 2022年12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ニッセイターゲットデートファンド 2025/2030/2035/2040/2045/2050/2055/2060/2065」は、2022年12月20日に決算を行いました。

各ファンドは、複数のマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を含む各国の株式（リート（不動産投資信託）を含みます）、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

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

NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

東京都千代田区丸の内1-6-6

<2025>

第6期末 (2022年12月20日)	
基準価額	10,578円
純資産総額	25億円
騰落率	△4.8%
分配金	0円

<2035>

第6期末 (2022年12月20日)	
基準価額	13,354円
純資産総額	52億円
騰落率	△1.6%
分配金	0円

<2045>

第6期末 (2022年12月20日)	
基準価額	13,874円
純資産総額	23億円
騰落率	△0.9%
分配金	0円

<2055>

第7期末 (2022年12月20日)	
基準価額	16,932円
純資産総額	19億円
騰落率	△0.7%
分配金	0円

<2065>

第1期末 (2022年12月20日)	
基準価額	9,679円
純資産総額	101百万円
騰落率	△3.2%
分配金	0円

<2030>

第4期末 (2022年12月20日)	
基準価額	12,115円
純資産総額	34億円
騰落率	△3.0%
分配金	0円

<2040>

第4期末 (2022年12月20日)	
基準価額	13,899円
純資産総額	22億円
騰落率	△1.0%
分配金	0円

<2050>

第4期末 (2022年12月20日)	
基準価額	14,202円
純資産総額	961百万円
騰落率	△0.8%
分配金	0円

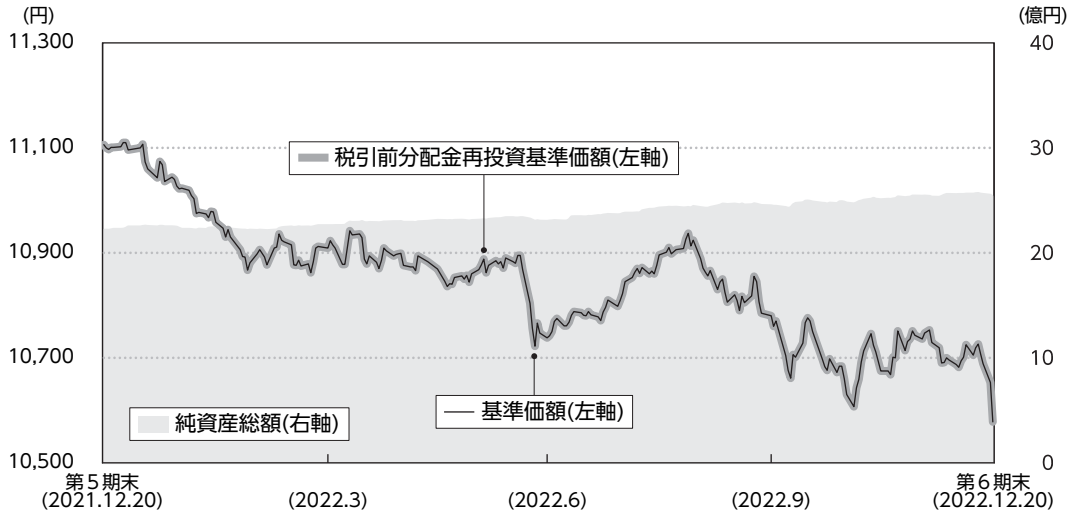
<2060>

第4期末 (2022年12月20日)	
基準価額	14,453円
純資産総額	13億円
騰落率	△0.6%
分配金	0円

# 運用経過

2021年12月21日～2022年12月20日

## 基準価額等の推移



第6期首	11,106円	既払分配金	0円
第6期末	10,578円	騰落率(分配金再投資ベース)	△4.8%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・2022年7月から8月中旬にかけて、海外の景気減速懸念の高まりや日銀の金融緩和策の現状維持が決定されたことなどをを受けて内外金利が低下(債券価格は上昇)し、内外株式市場が上昇したこと

#### <下落要因>

- ・2022年1月から2月中旬にかけて、米金融引き締め加速への警戒感の強まりなどを背景に国内金利が上昇したこと
- ・9月に市場予想を上回る米インフレ率の発表やイギリス政権が打ち出した大型減税策による財政悪化懸念などをを受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	4.7%	0.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1.9	△0.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	89.1	△5.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	4.3	△1.8

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	31円	0.283%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は10,844円です。</p>
(信託会社)	(14)	(0.127)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(14)	(0.127)	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)	(0.030)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.000	
(株式)	( 0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	( 0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.000	
(株式)	( 0)	(0.000)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.011	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)	( 0)	(0.002)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	( 1)	(0.009)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	( 0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <li>信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	32	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。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。

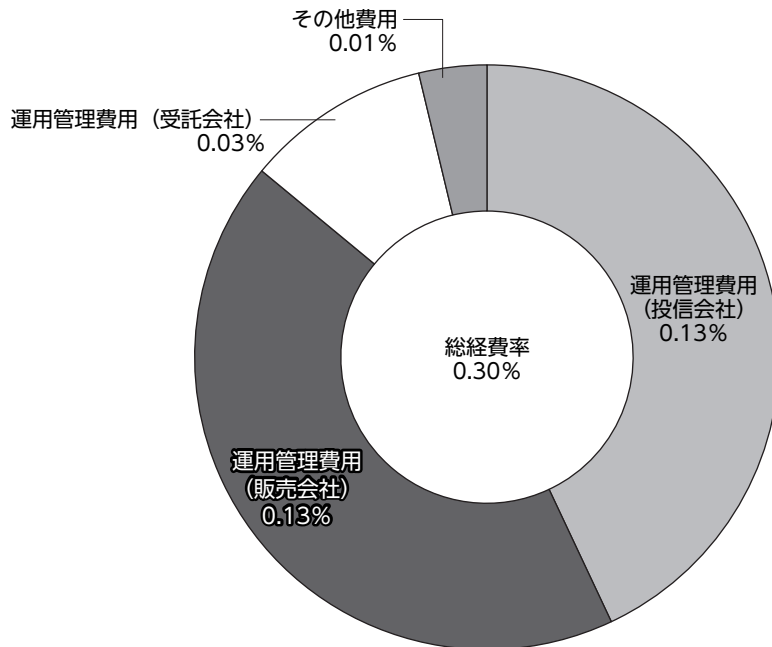
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.30%**です。



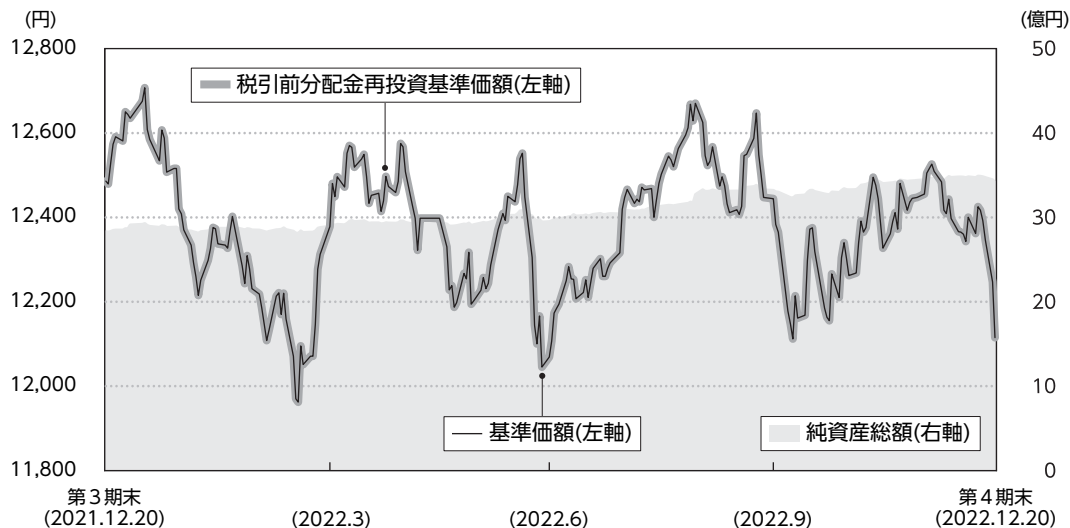
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

## 基準価額等の推移



第4期首	12,486円	既払分配金	0円
第4期末	12,115円	騰落率(分配金再投資ベース)	△3.0%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

## ■ 基準価額の主な変動要因

## &lt; 上昇要因 &gt;

- ・2022年7月から8月中旬にかけて、海外の景気減速懸念の高まりや日銀の金融緩和策の現状維持が決定されたことを受けて内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt; 下落要因 &gt;

- ・2022年1月から3月上旬にかけて、米金融引き締め加速への警戒感の強まりやロシアのウクライナ侵攻などを背景に内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと
- ・9月に市場予想を上回る米インフレ率の発表やイギリス政権が打ち出した大型減税策による財政悪化懸念などをを受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	15.5%	0.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	18.6	△0.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	57.2	△5.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	8.8	△1.8

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	36円	0.291%	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12,374円です。
(投信会社)	(16)	(0.131)	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)	(16)	(0.131)	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)	(4)	(0.030)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.000	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	2	0.017	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.007)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.009)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.001)	・ 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	38	0.310	

(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。

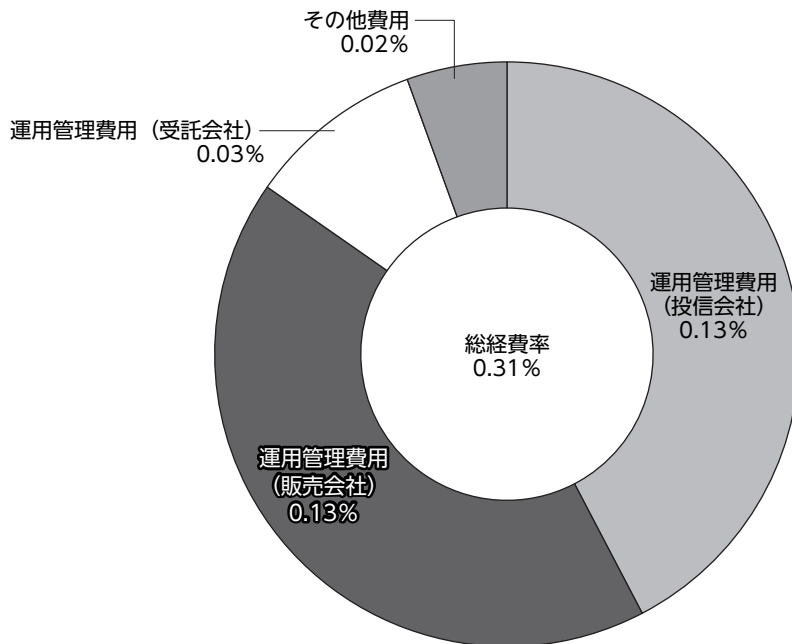
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.31%**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。



## 基準価額等の推移



第6期首	13,568円	既払分配金	0円
第6期末	13,354円	騰落率(分配金再投資ベース)	△1.6%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

## ■基準価額の主な変動要因

## &lt;上昇要因&gt;

- ・2022年7月から8月中旬にかけて、海外の景気減速懸念の高まりや日銀の金融緩和策の現状維持が決定されたことなどをを受けて内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2022年1月から3月上旬にかけて、米金融引き締め加速への警戒感の強まりやロシアのウクライナ侵攻などを背景に内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと
- ・9月に市場予想を上回る米インフレ率の発表やイギリス政権が打ち出した大型減税策による財政悪化懸念などをを受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	25.2%	0.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	33.8	△0.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	28.1	△5.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	12.9	△1.8

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	41円	0.300%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は13,606円です。</p>
(投信会社)	(18)	(0.135)	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)	(18)	(0.135)	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)	(4)	(0.030)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.002)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	3	0.022	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.012)	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)	(0.008)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.002)	<ul style="list-style-type: none"> <li>信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	44	0.324	

(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。

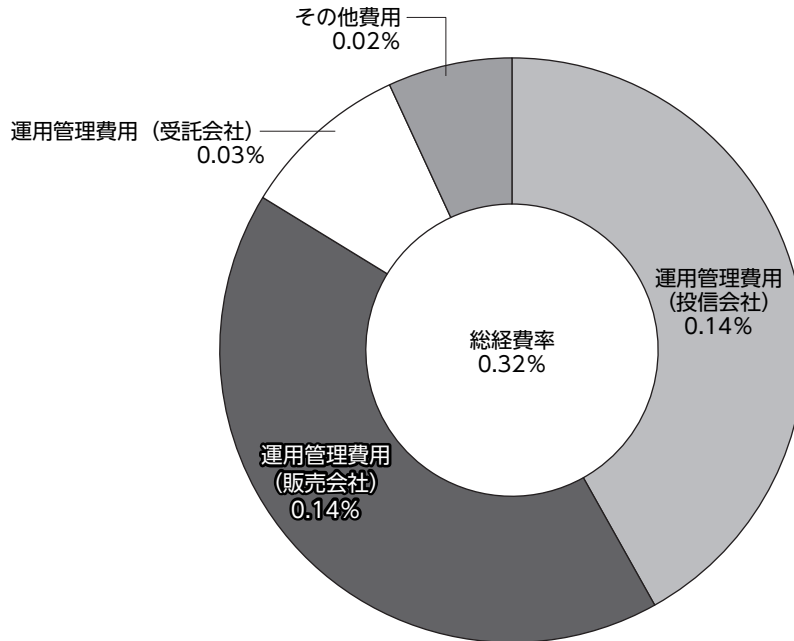
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.32%**です。



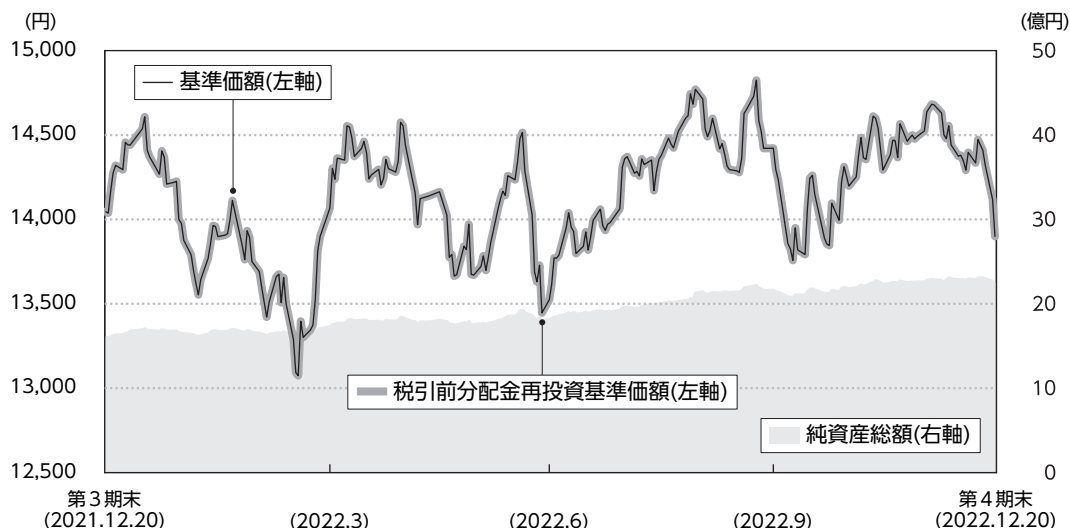
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

## 基準価額等の推移



第4期首	14,045円	既払分配金	0円
第4期末	13,899円	騰落率(分配金再投資ベース)	△1.0%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

## ■ 基準価額の主な変動要因

## &lt;上昇要因&gt;

- ・2022年7月から8月中旬にかけて、海外の景気減速懸念の高まりや日銀の金融緩和策の現状維持が決定されたことを受けて内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2022年1月から3月上旬にかけて、米金融引き締め加速への警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻などを背景に内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと
- ・9月に市場予想を上回る米インフレ率の発表やイギリス政権が打ち出した大型減税策による財政悪化懸念などをを受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	29.3%	0.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	40.0	△0.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	16.1	△5.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	14.6	△1.8

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	42円	0.299%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は14,148円です。</p>
(投信会社)	(19)	(0.135)	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)	(0.135)	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)	(4)	(0.030)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.002)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	0.025	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.014)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.009)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.002)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	46	0.328	

(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。

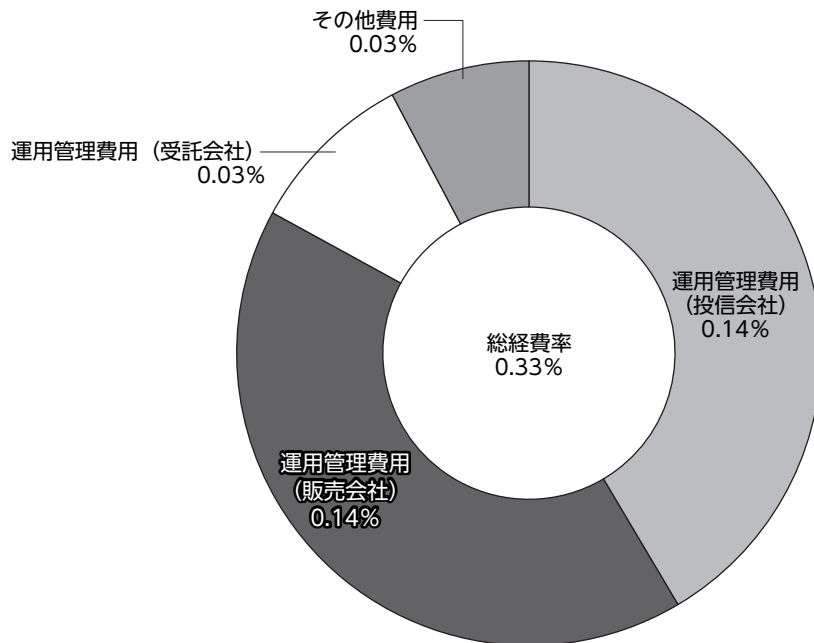
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.33%**です。



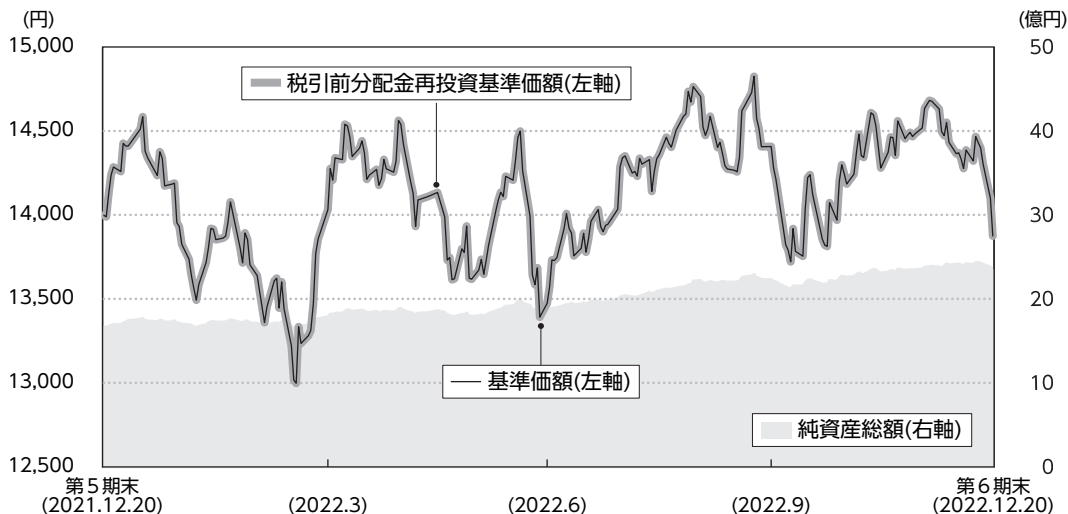
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

## 基準価額等の推移



第6期首	13,997円	既払分配金	0円
第6期末	13,874円	騰落率(分配金再投資ベース)	△0.9%

(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ご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

## ■基準価額の主な変動要因

## &lt;上昇要因&gt;

- ・2022年7月から8月中旬にかけて、海外の景気減速懸念の高まりや日銀の金融緩和策の現状維持が決定されたことなどをを受けて内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2022年1月から3月上旬にかけて、米金融引き締め加速への警戒感の強まりやロシアのウクライナ侵攻などを背景に内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと
- ・9月に市場予想を上回る米インフレ率の発表やイギリス政権が打ち出した大型減税策による財政悪化懸念などをを受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	30.5%	0.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	41.8	△0.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	12.6	△5.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15.1	△1.8

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	42円	0.299%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は14,119円です。</p>
(信託会社)	(19)	(0.135)	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)	(0.135)	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)	(4)	(0.030)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.002)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	0.026	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.014)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.009)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.002)	<ul style="list-style-type: none"> <li>信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	46	0.329	

(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。

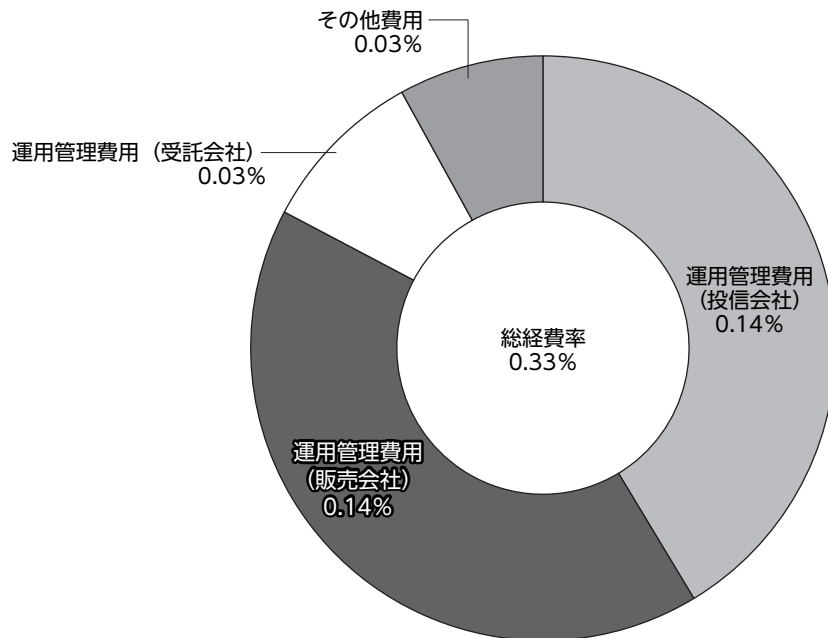
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。



## (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0.33%**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。

## 基準価額等の推移



第4期首	14,312円	既払分配金	0円
第4期末	14,202円	騰落率(分配金再投資ベース)	△0.8%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

## ■基準価額の主な変動要因

## &lt;上昇要因&gt;

- ・2022年7月から8月中旬にかけて、海外の景気減速懸念の高まりや日銀の金融緩和策の現状維持が決定されたことを受けて内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2022年1月から3月上旬にかけて、米金融引き締め加速への警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻などを背景に内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと
- ・9月に市場予想を上回る米インフレ率の発表やイギリス政権が打ち出した大型減税策による財政悪化懸念などをを受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	31.3%	0.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	43.1	△0.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	10.2	△5.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15.4	△1.8

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	43円	0.299%	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14,450円です。
(信託会社)	(19)	(0.135)	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)	(0.135)	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)	(4)	(0.030)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.002)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	0.028	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.015)	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)	(2)	(0.011)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.002)	・ 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	48	0.331	

(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。

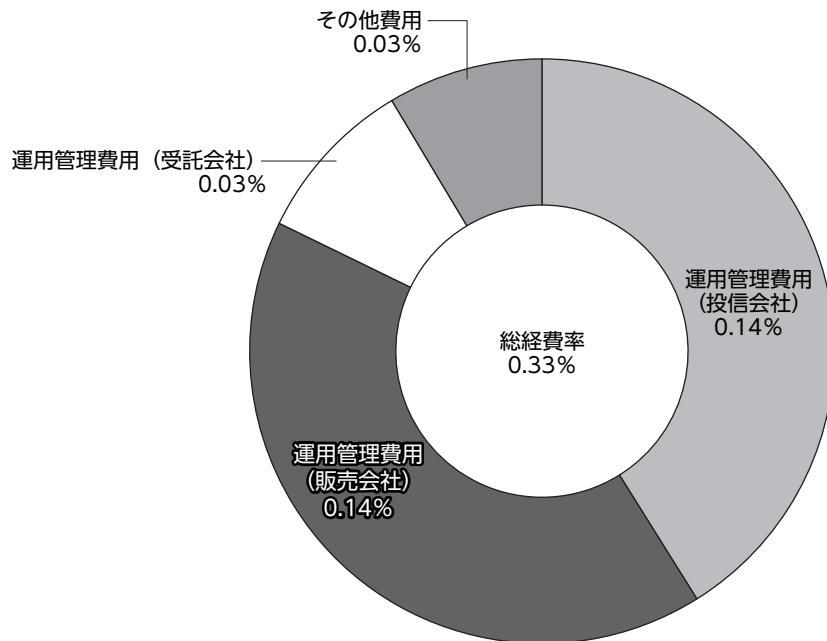
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.33%**です。



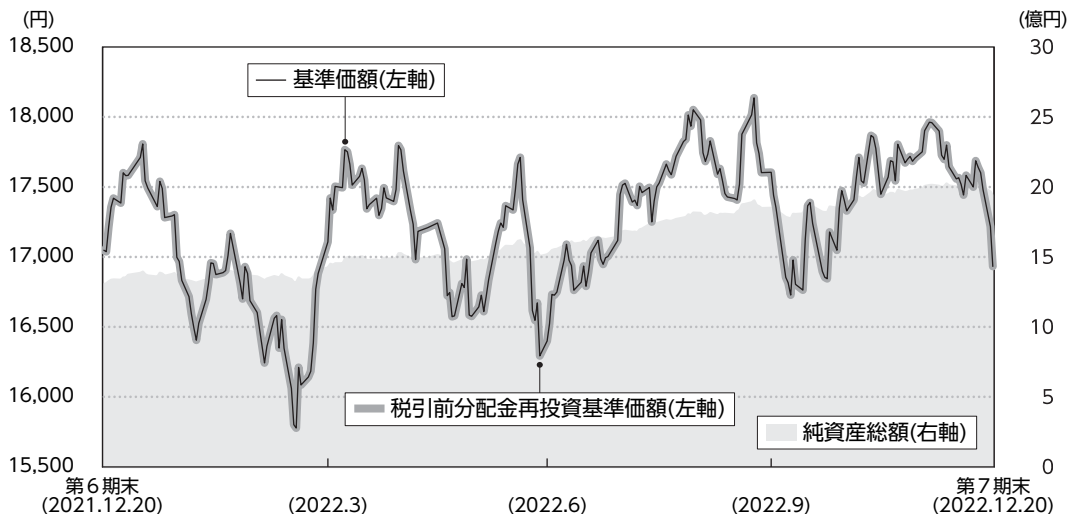
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

## 基準価額等の推移



第7期首	17,047円	既払分配金	0円
第7期末	16,932円	騰落率(分配金再投資ベース)	△0.7%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

## ■基準価額の主な変動要因

## &lt;上昇要因&gt;

- ・2022年7月から8月中旬にかけて、海外の景気減速懸念の高まりや日銀の金融緩和策の現状維持が決定されたことなどをを受けて内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2022年1月から3月上旬にかけて、米金融引き締め加速への警戒感の強まりやロシアのウクライナ侵攻などを背景に内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと
- ・9月に市場予想を上回る米インフレ率の発表やイギリス政権が打ち出した大型減税策による財政悪化懸念などをを受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	32.1%	0.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	44.3	△0.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	7.9	△5.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15.8	△1.8

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	52円	0.299%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は17,226円です。</p>
(投信会社)	(23)	(0.135)	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)	(23)	(0.135)	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)	( 5)	(0.030)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	( 0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	( 0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.002	
(株式)	( 0)	(0.002)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	5	0.027	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	( 3)	(0.015)	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)	( 2)	(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)	( 0)	(0.002)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	57	0.330	

(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。

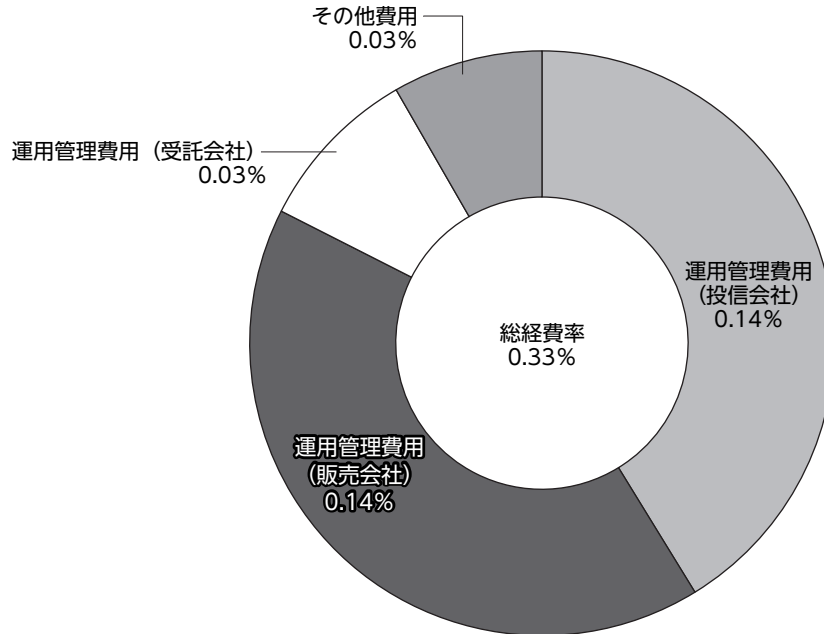
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.33%**です。



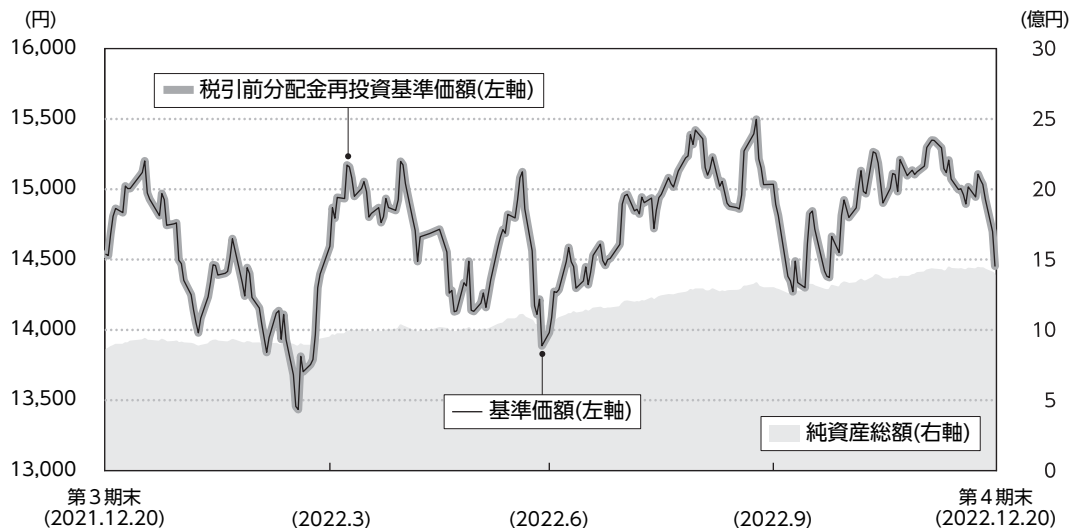
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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。

## 基準価額等の推移



第4期首	14,537円	既払分配金	0円
第4期末	14,453円	騰落率(分配金再投資ベース)	△0.6%

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

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

## ■基準価額の主な変動要因

## &lt;上昇要因&gt;

- 2022年7月から8月中旬にかけて、海外の景気減速懸念の高まりや日銀の金融緩和策の現状維持が決定されたことなどをを受けて内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- 2022年1月から3月上旬にかけて、米金融引き締め加速への警戒感の強まりやロシアのウクライナ侵攻などを背景に内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと
- 9月に市場予想を上回る米インフレ率の発表やイギリス政権が打ち出した大型減税策による財政悪化懸念などをを受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	32.8%	0.7%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	45.4	△0.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	5.8	△5.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	16.1	△1.8

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。



## 1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	44円	0.299%	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14,701円です。
(投信会社)	(20)	(0.135)	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)	(0.135)	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)	(4)	(0.030)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.002)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	0.028	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.015)	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)	(2)	(0.011)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.002)	・ 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	49	0.331	

(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。

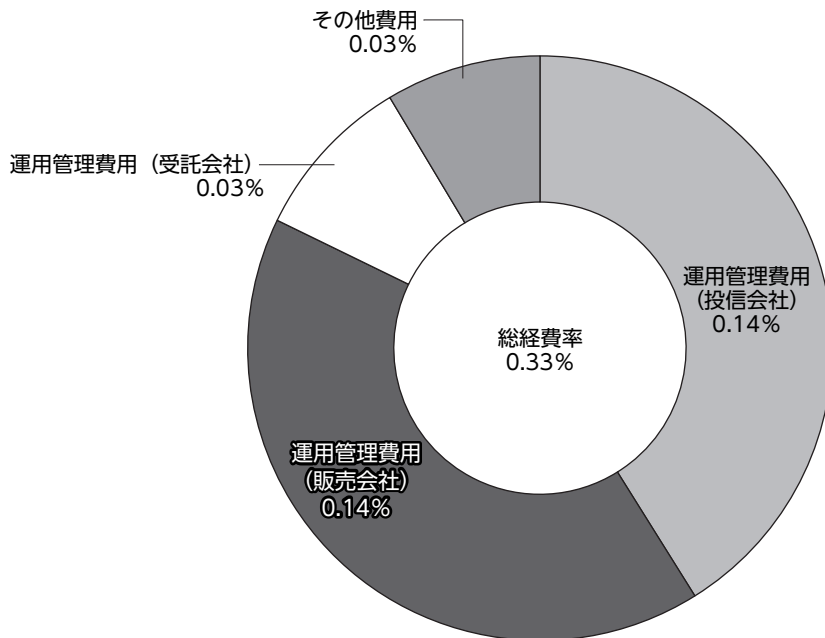
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.33%**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。

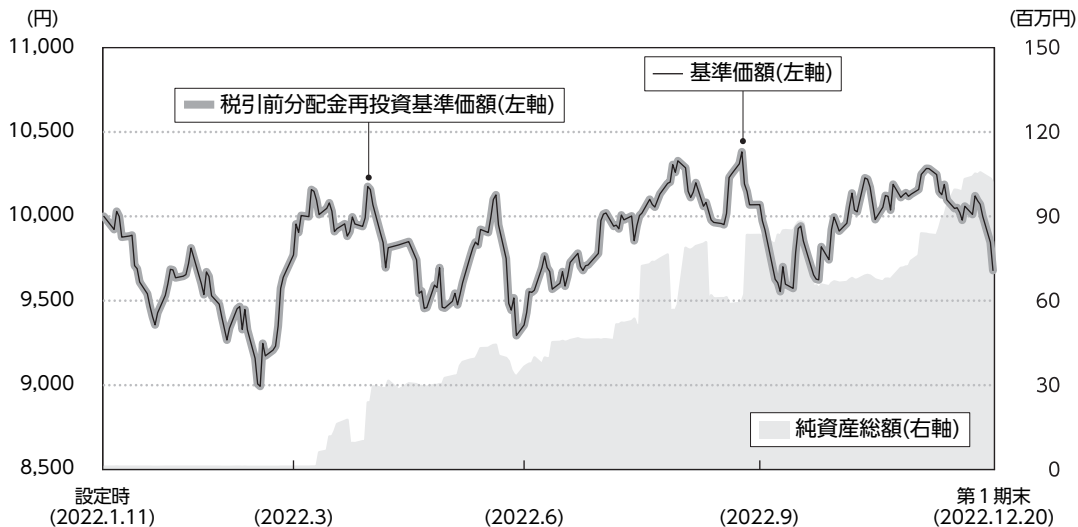
(注3) 各比率は年率換算した値です。

(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。

# 運用経過

2022年1月11日～2022年12月20日

## 基準価額等の推移



設定時	10,000円	既払分配金	0円
第1期末	9,679円	騰落率(分配金再投資ベース)	△3.2%

(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、設定時の基準価額にあわせて指数化しています。

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

(注3) 当ファンドはベンチマークを設けていません。

### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・2022年7月から8月中旬にかけて、海外の景気減速懸念の高まりや日銀の金融緩和策の現状維持が決定されたことを受けて内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

#### <下落要因>

- ・2022年1月から3月上旬にかけて、米金融引き締め加速への警戒感の強まりやロシアのウクライナ侵攻などを背景に内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと
- ・9月に市場予想を上回る米インフレ率の発表やイギリス政権が打ち出した大型減税策による財政悪化懸念などを受けて世界的に投資家のリスク回避姿勢が強まり内外金利が上昇し、内外株式市場が下落したこと

組入マザーファンド	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	33.1%	△2.1%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	45.9	△4.0
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	4.8	△4.4
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	16.2	△2.0

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第1期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	28円	0.281%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は9,837円です。</p>
(投信会社)	(12)	(0.126)	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)	(12)	(0.126)	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)	(0.028)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.003	
(株式)	(0)	(0.003)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(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	3	0.026	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.015)	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)	(0)	(0.001)	<ul style="list-style-type: none"> <li>信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul>
合計	31	0.311	

(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。

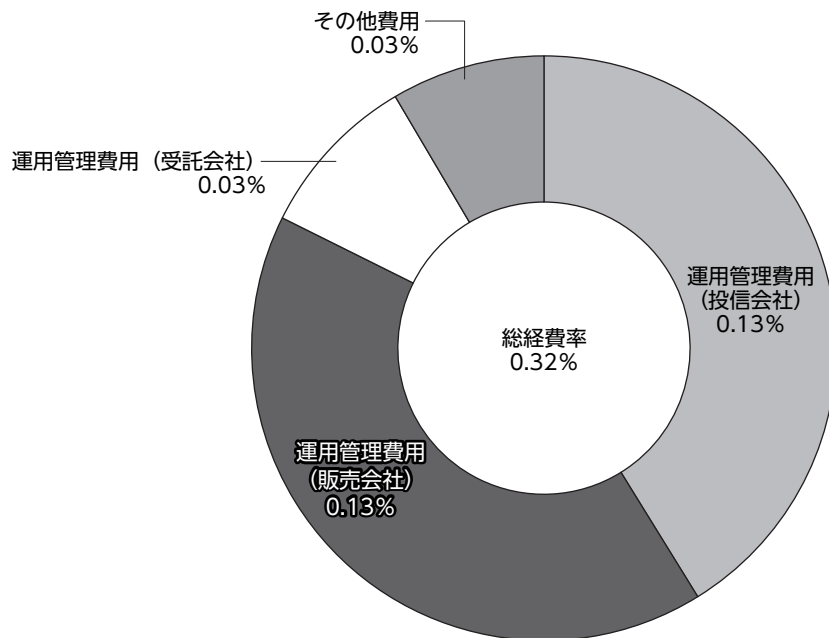
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.32%**です。



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

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

## 投資環境

### ■国内株式市況

当期の国内株式市場は米金融政策を巡る見方などから乱高下する展開となりましたが、前期末と比較すると下落しました。

期初以降、国内企業の良好な決算発表などから株価は上昇傾向となりましたが、2022年1月から3月上旬にかけては、高水準にあるインフレを沈静化させるために米金融政策が引き締め姿勢へ転換したことに加えて、ロシアのウクライナ侵攻を背景とした資源高によるインフレリスクの高まりを受けて下落しました。その後、3月末にかけては原油価格の上昇が一服したことやロシアとウクライナの停戦交渉進展への期待感などから上昇しました。

4月以降はインフレ加速に伴う米長期金利の上昇や金融引き締め政策に加えて、中国における新型コロナウイルスの感染拡大の影響が警戒され、株価は下落する展開となりました。5月中旬以降は国内企業の本決算発表の内容がおおむね想定内であったことや、米長期金利の上昇に一服感が出たことから上昇しましたが、6月中旬以降は米消費者物価指数（CPI）の高い伸びなどを受けてインフレ加速への警戒感が高まり下落しました。7月以降は米国による対中制裁関税の一部解除検討に関する報道などを受けて米国株が反発に転じたことや、参院選で自民党が改選議席の過半数を単独で確保したことなどが好感されて上昇しましたが、8月中旬以降は米長期金利の上昇懸念が再び重荷となったことから下落しました。10月から11月下旬にかけては米長期金利の上昇懸念がやや緩和し株価は上昇基調となりましたが、欧米の金融引き締めに伴う景気後退への警戒に加えて、12月20日に日銀が長期金利の許容変動幅をプラスマイナス0.25%程度からプラスマイナス0.5%程度に拡大したことを受けて、長期金利が上昇したことや円高が進行したことにより下落しました。

### ■海外株式市況

海外株式市場は期を通じて見ると下落しました。

期初から2022年3月上旬にかけては、世界的なインフレ懸念の中、ロシアのウクライナ侵攻を嫌気した投資家のリスク回避姿勢の強まりから、株価は下落基調で推移しました。その後、ロシアとウクライナの停戦協議への期待感などから株価は上昇に転じましたが、4月下旬以降はインフレの深刻化を受けて米欧中央銀行による利上げを含む金融引き締め姿勢が、世界景気の悪化を招くとの見方が強まり再び下落しました。6月中旬以降は米国のインフレ鈍化や大手ハイテク銘柄の良好な決算等を受けて株価は上昇基調で推移しましたが、9月中旬以降は米CPIが市場予想を上回り、米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げを加速するとの見方が強まったことなどから下落しました。当期末にかけては米国のインフレにピークアウトの兆しが見え、FRBの利上げペース鈍化への期待感が高まったことから株価は上昇基調で推移しました。

### ■国内債券市況

前期末を0.04%近辺でスタートした10年国債金利は、米早期利上げ観測の高まりや日銀内部での金融正常化に向けた動きへの思惑などから上昇基調で推移しました。2022年2月中旬から3月上旬にかけては、ウクライナ情勢の緊迫化とともに金利は急速に低下しましたが、3月中旬以降に、原油価格の急騰やFRBの一段の金融引き締めに積極的な姿勢から再び金利は上昇基調となり、長期金利はイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の上限を一時超過しながらおおむねレンジ内で横ばいに推移しました。7月中旬から8月中旬にか

けては材料の出尽くし等から内外金利ともに低下しましたが、8月中旬以降は主要中央銀行の金融引き締め積極的な姿勢が改めて意識される中、海外金利が大幅上昇し、国内金利はイールドカーブ・コントロールの上限を一時超過しながら、おおむねレンジ内で横ばいに推移しました。12月20日に日銀がイールドカーブ・コントロールのレンジ拡大を行ったことが金融市場におけるサプライズとなり、長期金利は大幅に上昇する展開となり、結局、10年国債金利は0.40%近辺で当期末を迎えました。

(注) イールドカーブとは、債券の償還までの期間（残存年数）ごとの利回りを線で結んだものをいい、通常は残存年数の長い債券ほど利回りが高く（順イールド）なりますが、金利低下が予想される場合には、反対に利回りが低く（逆イールド）なることもあります。イールドカーブ分析とは、一般的に経済情勢や市場動向を反映して金利は変動しますが、すべての債券が同じように変動するとは限らないため、異なる時点のイールドカーブの形状や曲線の傾きなどから債券の割高・割安を判断することをいいます。

## ■海外債券市況

米国10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2022年6月中旬にかけては、F R Bが利上げに前向きな姿勢を示したことなどから金利は上昇しました。8月初旬から11月上旬にかけても金利は上昇基調で推移しましたが、当期末にかけては米国の軟調な各種経済指標等を受けてF R Bの利上げペースが調整されるとの見方が強まり、低下基調で推移しました。

ドイツ10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2022年6月中旬にかけては、ロシアによるウクライナ侵攻を受けてインフレが加速する中、欧州中央銀行（E C B）が積極的な利上げ姿勢を示したことなどから金利は上昇しました。その後、7月末にかけては米景気の後退懸念や欧州景気の不透明感の高まりなどから金利は低下しましたが、8月から当期末にかけては、E C Bに加え、他の欧州圏の中央銀行による積極的な利上げ姿勢を受けて上昇基調で推移しました。

## ■為替市況

米ドル／円レートは期を通じて見ると上昇しました。

期初から2022年3月上旬にかけては、F R Bの積極的な利上げへの期待感が高まる一方、ロシアによるウクライナ侵攻への懸念から、米ドル／円レートは横ばいで推移しました。3月上旬から10月下旬にかけては、F R Bと日銀の金融政策の方向性の違いから日米金利差が拡大し、米ドル高円安基調で推移しましたが、当期末にかけては米国の軟調な各種経済指標等を受けてF R Bによる積極的な利上げ観測が後退し、米ドル安円高に転じました。

ユーロ／円レートは期を通じて見ると上昇しました。

2022年3月上旬から10月下旬にかけては、利上げに積極的なE C Bと金融緩和を維持する日銀との金融政策の方向性の違いから、ユーロ高円安基調で推移しました。当期末にかけては、E C Bによる積極的な利上げ観測が高まる一方、米金利主導で欧州金利も低下する場面もあり、ユーロ／円レートは横ばいで推移しました。

# ポートフォリオ

## ■各ファンド

当期の基本資産配分に則って、複数のマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を含む各国の株式、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行いました。

### <当期の基本資産配分>

	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
2025	4.8%	2.0%	88.9%	4.3%	0.0%
2030	15.5	19.3	56.5	8.7	0.0
2035	25.0	34.8	27.5	12.7	0.0
2040	29.0	41.0	15.7	14.3	0.0
2045	30.1	42.8	12.3	14.8	0.0
2050	30.9	44.1	9.9	15.1	0.0
2055	31.6	45.3	7.7	15.4	0.0
2060	32.3	46.4	5.6	15.7	0.0
2065	32.6	46.9	4.7	15.8	0.0

(注1) ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンドは国内株式、ニッセイグローバルリートマザーファンドは外国株式の資産配分に含まれます。以下同じです。

(注2) 基本資産配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合です。以下同じです。

## ■マザーファンド

### <ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

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

### <ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

### <ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

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



#### <ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く主要国の国債に投資することにより、ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

#### <ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークである東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

#### <ニッセイグローバルリートマザーファンド>

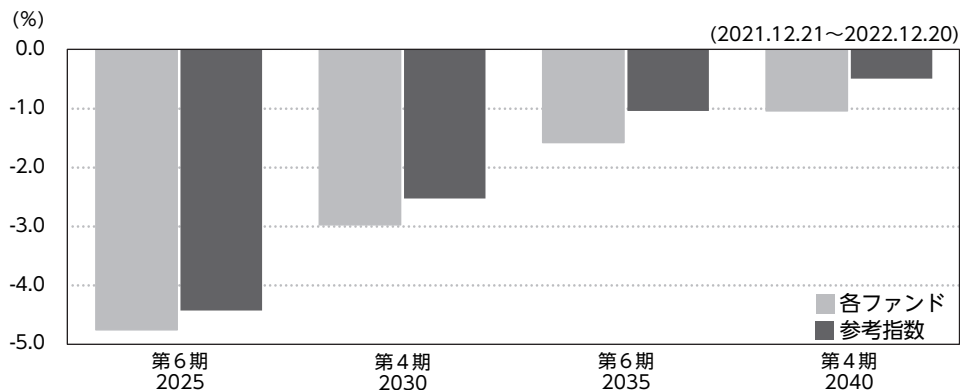
日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）しているリートを主要投資対象とし、ベンチマークであるS & Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

#### <ニッセイマネーマーケットマザーファンド>

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざしました。

\* ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。なお、期中において一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

## 参考指数との差異



各ファンドはベンチマークを設けていません。各ファンドとも参考指数は、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）、S&Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）、無担保コール翌日物の収益率に基本資産配分比率を乗じて合成したものです。

信託報酬等を控除した関係などから、各ファンドとも参考指数騰落率を下回る結果となりました。

### 2025

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-4.8%となり、参考指数騰落率（-4.4%）を下回りました。

### 2030

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-3.0%となり、参考指数騰落率（-2.5%）を下回りました。

### 2035

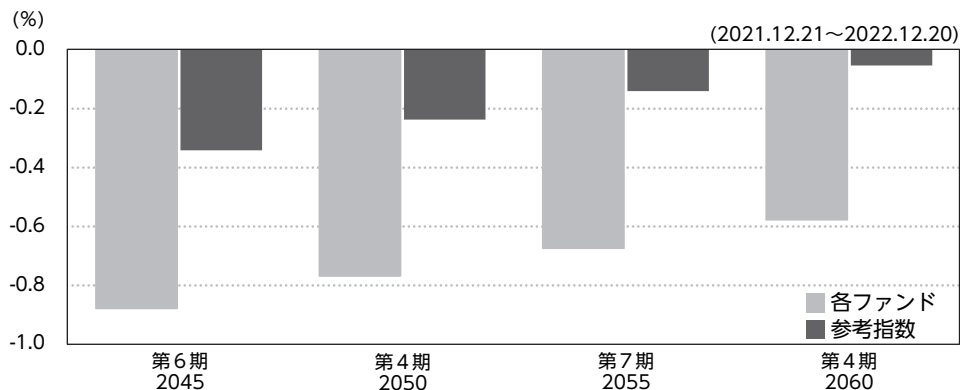
当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-1.6%となり、参考指数騰落率（-1.0%）を下回りました。

### 2040

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-1.0%となり、参考指数騰落率（-0.5%）を下回りました。

（注1）基準価額の騰落率は分配金込みです。

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



各ファンドはベンチマークを設けていません。各ファンドとも参考指数は、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、NOMURA-BPI総合、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）、東証REIT指数（配当込み）、S&Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）、無担保コール翌日物の収益率に基本資産配分比率を乗じて合成したものです。

信託報酬等を控除した関係などから、各ファンドとも参考指数騰落率を下回る結果となりました。

## ■ 2045

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-0.9%となり、参考指数騰落率（-0.3%）を下回りました。

## ■ 2050

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-0.8%となり、参考指数騰落率（-0.2%）を下回りました。

## ■ 2055

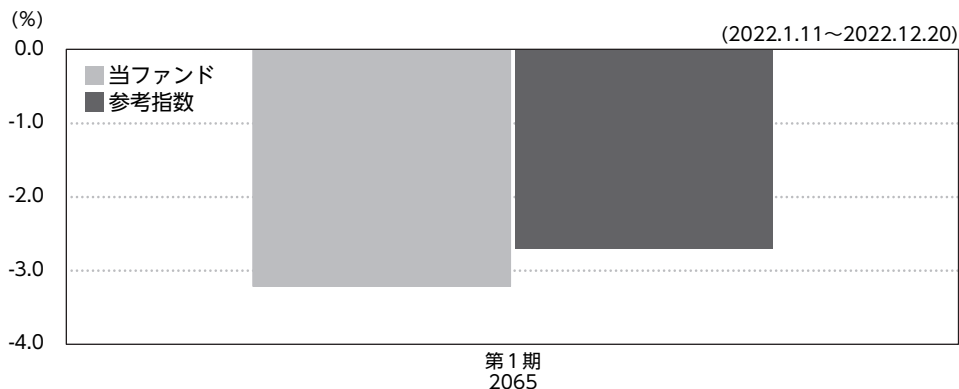
当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-0.7%となり、参考指数騰落率（-0.1%）を下回りました。

## ■ 2060

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-0.6%となり、参考指数騰落率（-0.1%）を下回りました。

（注1）基準価額の騰落率は分配金込みです。

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



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

信託報酬等を控除した関係などから、参考指数騰落率を下回る結果となりました。

## ■2065

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-3.2%となり、参考指数騰落率（-2.7%）を下回りました。

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

## 分配金

当期の分配金は、各ファンドとも基準価額水準、市況動向、残存信託期間等を勘案した結果、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	2021年12月21日～2022年12月20日			
	第6期	第4期	第6期	第4期
	2025	2030	2035	2040
当期分配金（税引前）	－	－	－	－
対基準価額比率	－	－	－	－
当期の収益	－	－	－	－
当期の収益以外	－	－	－	－
翌期繰越分配対象額	1,076円	2,114円	3,354円	3,898円

項目	2021年12月21日～2022年12月20日			
	第6期	第4期	第7期	第4期
	2045	2050	2055	2060
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	3,873円	4,201円	6,932円	4,453円

項目	2022年1月11日～2022年12月20日	
	第1期	
	2065	
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	－	

(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

## ■各ファンド

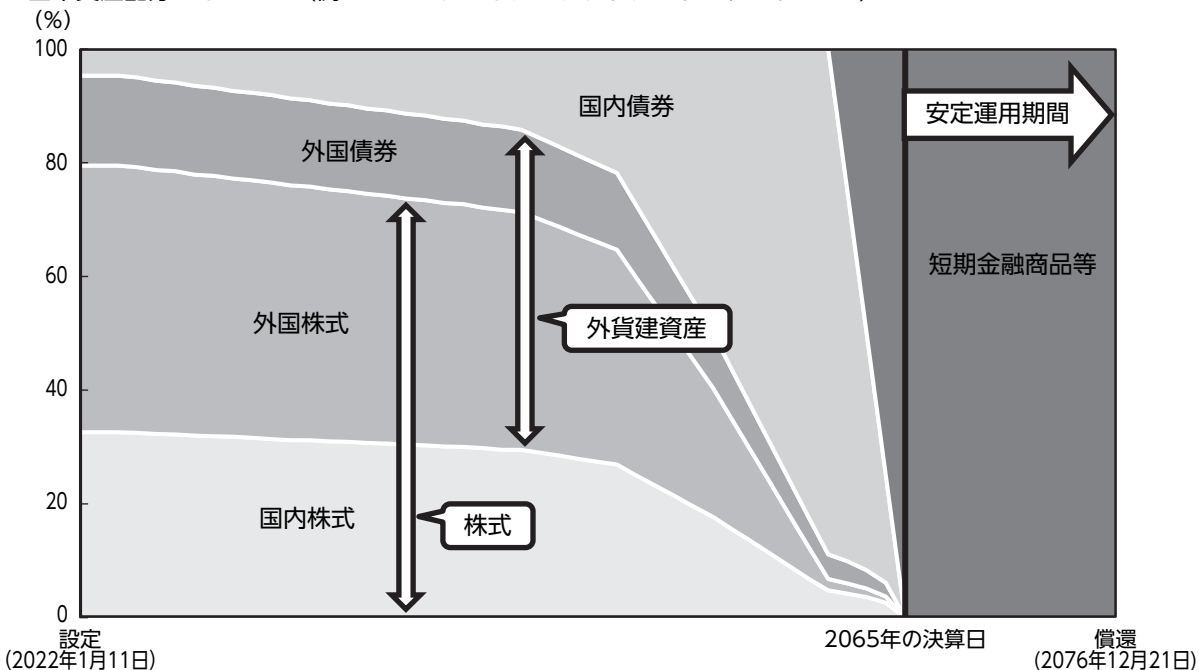
来期の基本資産配分に則り、複数のマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を含む各国の株式（リートを含みます）、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

今後も、安定運用開始時期（ターゲットデート）に近づくにしたがって株式の組み入れを漸減させ、国内債券や短期金融商品等の組み入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを低減させていく運用を行います。

### <来期の基本資産配分>

	国内株式	外国株式	国内債券	外国債券	短期金融商品等
2025	4.2%	1.8%	65.1%	3.9%	25.0%
2030	13.4	15.8	63.0	7.8	0.0
2035	23.2	31.8	33.1	11.9	0.0
2040	28.5	40.2	17.2	14.1	0.0
2045	30.0	42.7	12.6	14.7	0.0
2050	30.7	43.8	10.5	15.0	0.0
2055	31.4	45.1	8.1	15.4	0.0
2060	32.2	46.3	5.9	15.6	0.0
2065	32.6	46.9	4.7	15.8	0.0

### <基本資産配分のイメージ（例：DCニッセイターゲットデートファンド2065）>



(注1) 上図は当初設定時における基本資産配分のイメージ図であり、実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。

(注2) 上記の基本資産配分比率は、市場動向などにより変更となる場合があります。

## ■マザーファンド

### <ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

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

### <ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

### <ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド>

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

### <ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

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

### <ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### <ニッセイグローバルリートマザーファンド>

日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）しているリートを主要投資対象とし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### <ニッセイマネーマーケットマザーファンド>

円建ての短期公社債および短期金融商品に投資を行い、安定した収益と流動性の確保をめざします。

# ファンドデータ

## DCニッセイターゲットデットファンド2025の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第6期末 2022年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	4.7%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	1.9
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	89.1
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	4.3

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

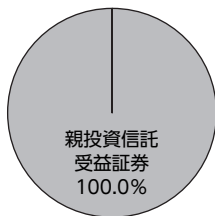
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

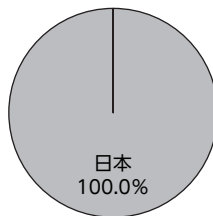
項目	第6期末 2022年12月20日
純資産総額	2,533,256,615円
受益権総口数	2,394,816,639口
1万口当たり基準価額	10,578円

(注) 当期間中における追加設定元本額は692,135,856円、同解約元本額は292,900,893円です。

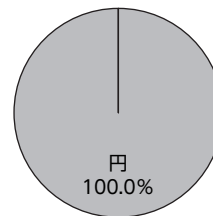
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年12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。



## DCニッセイターゲットデートファンド2030の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第4期末 2022年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	15.5%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	18.6
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	57.2
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	8.8

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

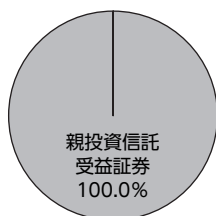
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

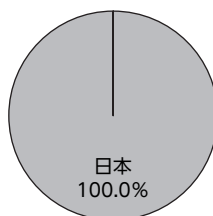
項目	第4期末 2022年12月20日
純資産総額	3,415,761,311円
受益権総口数	2,819,505,262口
1万口当たり基準価額	12,115円

(注) 当期間中における追加設定元本額は777,589,965円、同解約元本額は226,321,591円です。

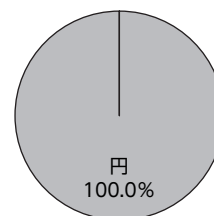
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年12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。

## DCニッセイターゲットデイトファンド2035の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第6期末 2022年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	25.2%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	33.8
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	28.1
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	12.9

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

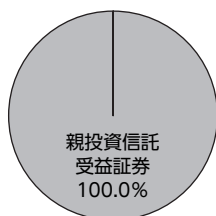
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

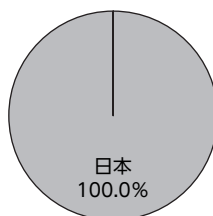
項目	第6期末 2022年12月20日
純資産総額	5,290,595,383円
受益権総口数	3,961,669,398口
1万口当たり基準価額	13,354円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,270,427,866円、同解約元本額は225,885,421円です。

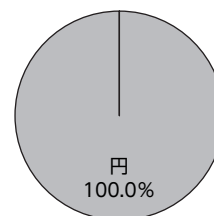
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年12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。

## DCニッセイターゲットデートファンド2040の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第4期末 2022年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	29.3%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	40.0
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	16.1
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	14.6

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

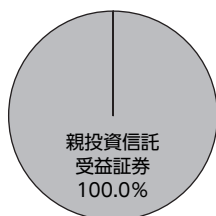
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

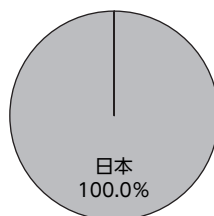
項目	第4期末 2022年12月20日
純資産総額	2,233,691,382円
受益権総口数	1,607,104,017口
1万口当たり基準価額	13,899円

(注) 当期間中における追加設定元本額は577,964,059円、同解約元本額は110,442,564円です。

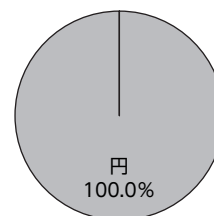
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年12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。

## DCニッセイターゲットデイトファンド2045の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第6期末 2022年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	30.5%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	41.8
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	12.6
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	15.1

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

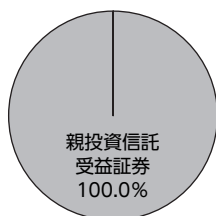
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

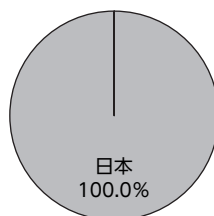
項目	第6期末 2022年12月20日
純資産総額	2,343,102,893円
受益権総口数	1,688,869,094口
1万口当たり基準価額	13,874円

(注) 当期間中における追加設定元本額は657,710,443円、同解約元本額は158,392,989円です。

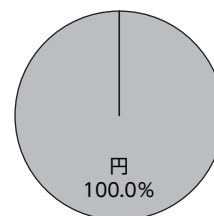
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年12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。

## DCニッセイターゲットデイトファンド2050の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第4期末 2022年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	31.3%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	43.1
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	10.2
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	15.4

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

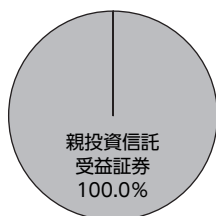
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

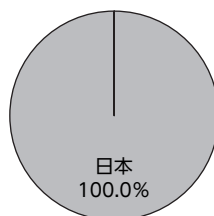
項目	第4期末 2022年12月20日
純資産総額	961,493,290円
受益権総口数	677,029,527口
1万口当たり基準価額	14,202円

(注) 当期間中における追加設定元本額は302,826,414円、同解約元本額は101,223,638円です。

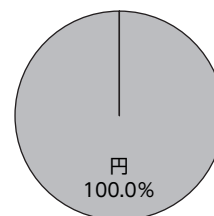
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年12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。

## DCニッセイターゲットデイトファンド2055の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第7期末 2022年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	32.1%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	44.3
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	7.9
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	15.8

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

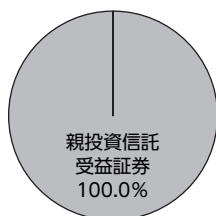
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

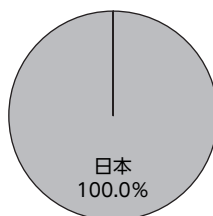
項目	第7期末 2022年12月20日
純資産総額	1,936,383,924円
受益権総口数	1,143,590,256口
1万口当たり基準価額	16,932円

(注) 当期間中における追加設定元本額は560,878,174円、同解約元本額は182,005,090円です。

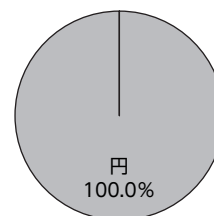
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年12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。

## DCニッセイターゲットデイトファンド2060の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第4期末 2022年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	32.8%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	45.4
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	5.8
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	16.1

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

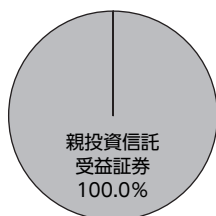
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

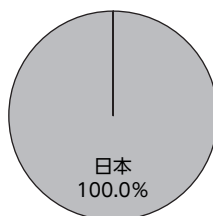
項目	第4期末 2022年12月20日
純資産総額	1,380,917,359円
受益権総口数	955,440,216口
1万口当たり基準価額	14,453円

(注) 当期間中における追加設定元本額は680,503,778円、同解約元本額は313,376,343円です。

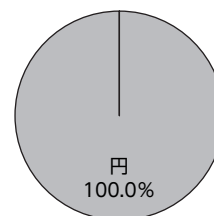
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年12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。

## DCニッセイターゲットデイトファンド2065の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第1期末 2022年12月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	33.1%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	45.9
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	4.8
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	16.2

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

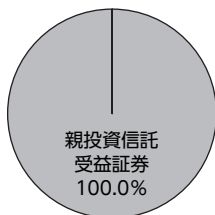
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

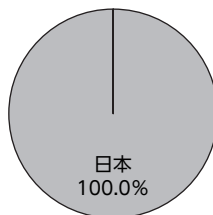
項目	第1期末 2022年12月20日
純資産総額	101,765,896円
受益権総口数	105,141,177口
1万口当たり基準価額	9,679円

(注) 当期間中における追加設定元本額は220,837,749円、同解約元本額は116,696,572円です。

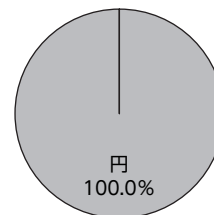
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分

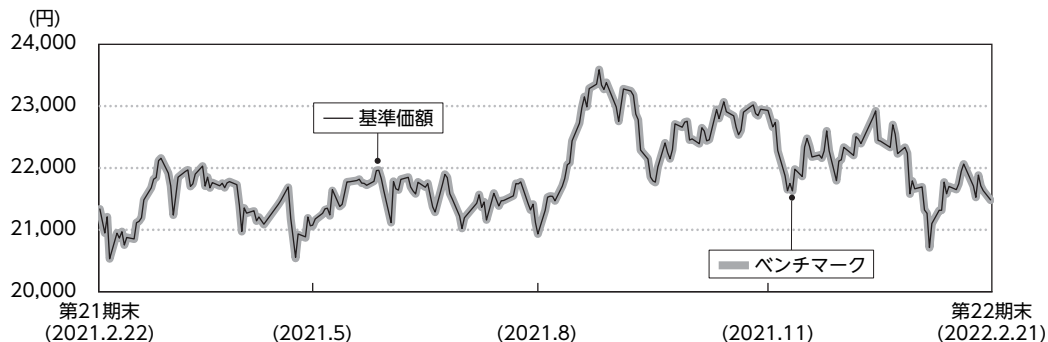


(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年12月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。



# ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

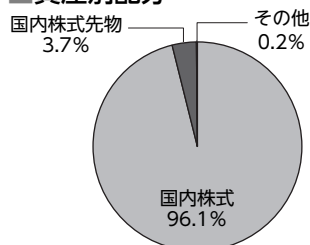
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	4.0%
TOPIX 先物 0403月	円	3.7
ソニーグループ	円	2.7
キーエンス	円	1.7
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.7
東京エレクトロン	円	1.3
リクルートホールディングス	円	1.3
日本電信電話	円	1.3
任天堂	円	1.2
ソフトバンクグループ	円	1.1
組入銘柄数		1,841

## ■ 1万口当たりの費用明細

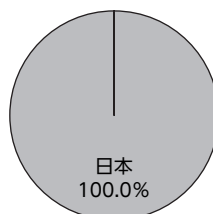
2021.2.23~2022.2.21

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

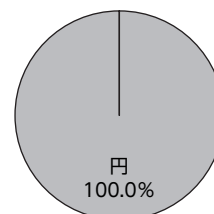
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



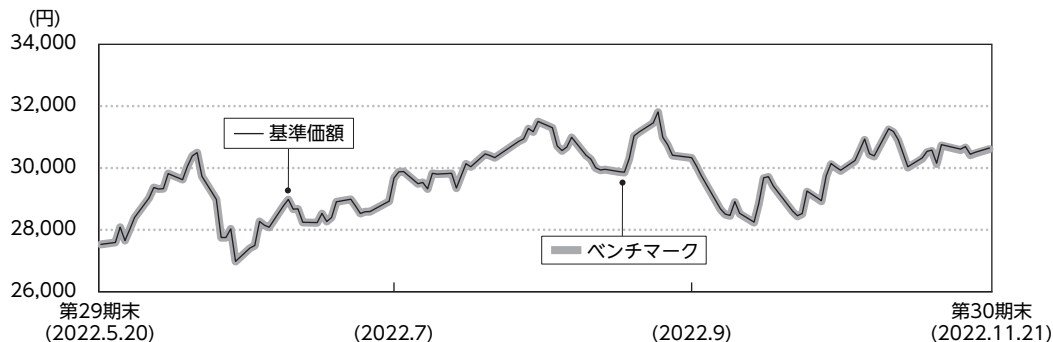
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2022年2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。

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

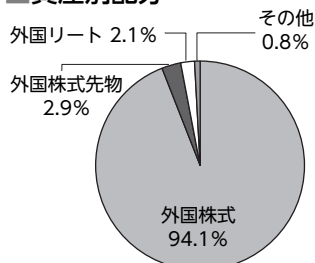
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	4.9%
MICROSOFT CORP	米ドル	3.4
S&P 500 EMINI FUTURE 202212 買	米ドル	2.2
AMAZON.COM INC	米ドル	1.7
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.2
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.1
UNITEDHEALTH GROUP INC	米ドル	1.0
TESLA, INC.	米ドル	1.0
EXXON MOBIL CORP	米ドル	0.9
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	0.9
組入銘柄数		1,271

## ■ 1万口当たりの費用明細

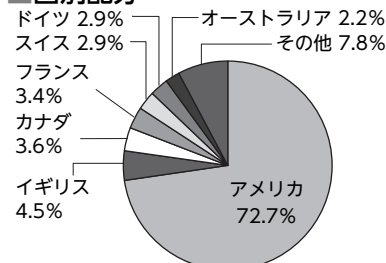
2022.5.21~2022.11.21

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

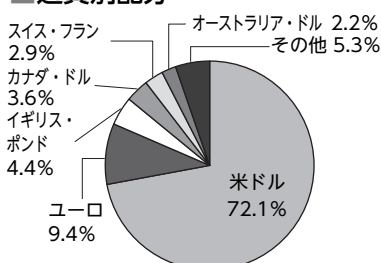
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



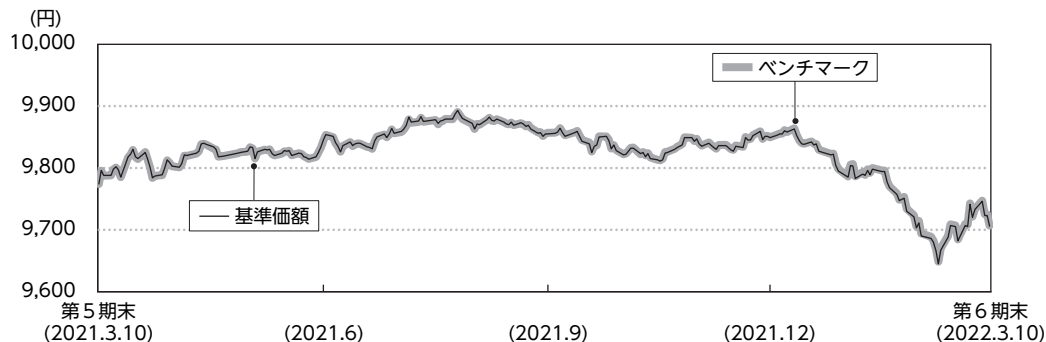
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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。

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

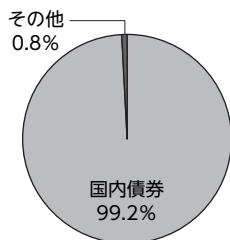
銘柄名	通貨	比率
第350回 利付国債 (10年)	円	1.0%
第 3 回 利付国債 (40年)	円	0.8
第363回 利付国債 (10年)	円	0.8
第361回 利付国債 (10年)	円	0.8
第430回 利付国債 (2年)	円	0.8
第431回 利付国債 (2年)	円	0.8
第364回 利付国債 (10年)	円	0.8
第429回 利付国債 (2年)	円	0.8
第428回 利付国債 (2年)	円	0.8
第340回 利付国債 (10年)	円	0.7
組入銘柄数		355

## ■ 1万口当たりの費用明細

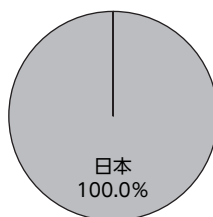
2021.3.11~2022.3.10

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

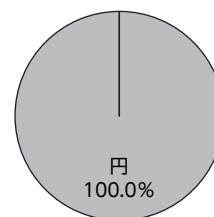
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



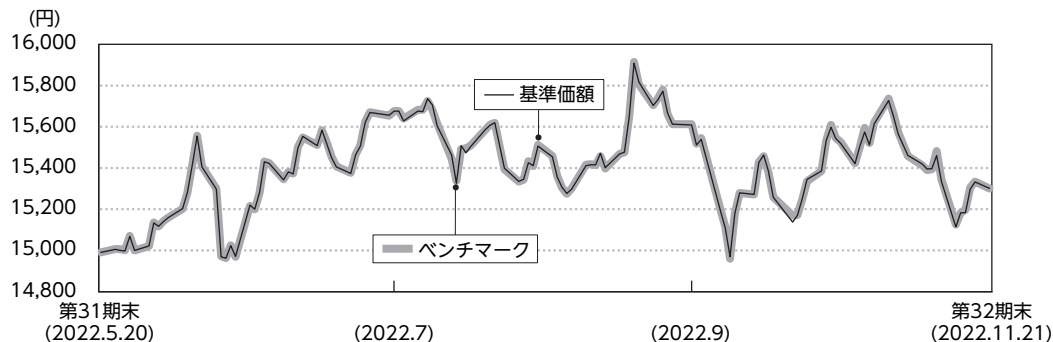
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2022年3月10日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

# ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

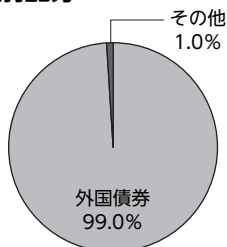
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.5% 2024/5/15	米ドル	2.0%
US TREASURY 2.25% 2024/11/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.0% 2025/2/15	米ドル	1.3
US TREASURY 2.375% 2024/8/15	米ドル	1.2
US TREASURY 2.75% 2024/2/15	米ドル	1.1
US TREASURY 2.125% 2025/5/15	米ドル	1.1
US TREASURY 0.25% 2024/3/15	米ドル	1.0
US TREASURY 2.625% 2029/2/15	米ドル	1.0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

## ■ 1万口当たりの費用明細

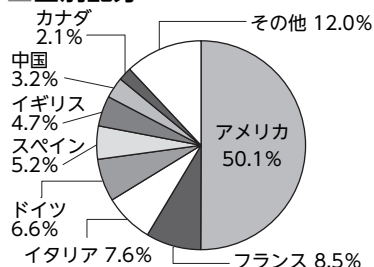
2022.5.21～2022.11.21

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

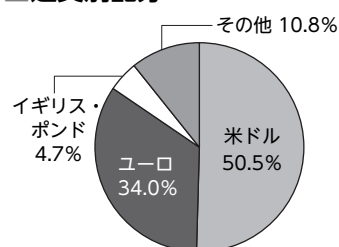
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



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

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

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	参考指数	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
				基準価額+ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2018年12月20日)	10,070	0	△3.4	10,070	10,119	△3.1	27.6	0.5	70.9	0.3	75
3期(2019年12月20日)	10,627	0	5.5	10,627	10,716	5.9	24.3	0.7	74.0	0.3	457
4期(2020年12月21日)	10,837	0	2.0	10,837	10,931	2.0	18.9	0.6	79.8	0.2	1,301
5期(2021年12月20日)	11,106	0	2.5	11,106	11,241	2.8	11.8	0.3	87.1	0.1	2,216
6期(2022年12月20日)	10,578	0	△4.8	10,578	10,743	△4.4	6.4	0.2	92.4	-	2,533

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 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)2021年12月20日	11,106	-	11,241	-	11.8	0.3	87.1	0.1
12月末	11,096	△0.1	11,234	△0.1	6.5	0.1	92.7	-
2022年1月1日	10,974	△1.2	11,112	△1.1	6.1	0.2	92.8	-
2月末	10,909	△1.8	11,051	△1.7	6.4	0.3	92.5	-
3月末	10,942	△1.5	11,086	△1.4	7.0	0.3	92.0	0.1
4月末	10,894	△1.9	11,041	△1.8	6.4	0.2	92.6	-
5月末	10,879	△2.0	11,028	△1.9	6.6	0.2	92.3	-
6月末	10,781	△2.9	10,935	△2.7	6.4	0.2	92.6	-
7月末	10,872	△2.1	11,031	△1.9	6.8	0.1	92.2	-
8月末	10,850	△2.3	11,011	△2.0	6.6	0.2	92.3	-
9月末	10,701	△3.6	10,862	△3.4	6.3	0.2	92.7	-
10月末	10,746	△3.2	10,914	△2.9	6.7	0.2	92.3	-
11月末	10,691	△3.7	10,859	△3.4	6.8	0.2	92.2	-
(期末)2022年12月20日	10,578	△4.8	10,743	△4.4	6.4	0.2	92.4	-

(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12月21日～2022年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	22,947	49,695	36,692	80,823
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	7,831	22,704	33,914	97,065
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	873,655	842,684	318,718	306,666
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25,859	39,362	29,058	44,180

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	ニッセイ国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ グローバルリート マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	126,355,552千円	111,223,960千円	64,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	153,195,142千円	526,139,558千円	67,573千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82	0.21	0.95

(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12月21日～2022年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイターゲットデットファンド2025

## 親投資信託残高

2022年12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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	68,483	54,739	120,174
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	42,951	16,868	48,238
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,853,785	2,408,722	2,256,249
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	76,082	72,883	108,611

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが80,706,172千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが195,884,516千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,528,911千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが37,781,398千口です。

## 投資信託財産の構成

2022年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	120,174	4.7
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	48,238	1.9
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,256,249	88.9
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	108,611	4.3
コール・ローン等、その他	3,472	0.1
投資信託財産総額	2,536,746	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル134.54円、1カナダ・ドル98.56円、1オーストラリア・ドル90.11円、1香港ドル17.29円、1シンガポール・ドル99.18円、1ニュージーランド・ドル85.39円、1イギリス・ポンド163.43円、1イスラエル・シェケル38.913円、1スイス・フラン144.68円、1デンマーク・クローネ19.17円、1ノルウェー・クローネ13.58円、1スウェーデン・クローナ12.94円、1メキシコ・ペソ6.802円、1人民元19.268円、1マレーシア・リンギット30.351円、1南アフリカ・ランド7.77円、1ポーランド・ズロチ30.456円、1ユーロ142.64円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（553,258,799千円）の投資信託財産総額（561,575,901千円）に対する比率は98.5%です。  
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（56,240,555千円）の投資信託財産総額（56,475,336千円）に対する比率は99.6%です。  
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（10,835,160千円）の投資信託財産総額（11,107,203千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# DCニッセイターゲットデットファンド2025

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>2,536,746,750円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,318,460
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	120,174,215
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	48,238,912
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	2,256,249,913
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	108,611,113
未 収 入 金	154,137
<b>(B)負債</b>	<b>3,490,135</b>
未 払 解 約 金	66,107
未 払 信 託 報 酬	3,312,760
そ の 他 未 払 費 用	111,268
<b>(C)純 資 産 総 額 (A-B)</b>	<b>2,533,256,615</b>
元 本	2,394,816,639
次 期 繰 越 損 益 金	138,439,976
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>2,394,816,639口</b>
1万円当たり基準価額 (C/D)	<b>10,578円</b>

(注) 期首元本額	1,995,581,676円
期中追加設定元本額	692,135,856円
期中一部解約元本額	292,900,893円

## 損益の状況

当期 (2021年12月21日~2022年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>△ 782円</b>
受 取 利 息	34
支 払 利 息	△ 816
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>△102,254,180</b>
売 買 益	8,963,907
売 買 損	△111,218,087
<b>(C)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 6,887,962</b>
<b>(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)</b>	<b>△109,142,924</b>
<b>(E)前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>57,837,254</b>
( 配 分 準 備 積 立 金 )	( 57,837,724)
( 繰 越 欠 損 金 )	(△ 470)
<b>(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *</b>	<b>189,745,646</b>
( 配 当 等 相 当 額 )	( 199,880,320)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 10,134,674)
<b>(G)合 計 (D + E + F)</b>	<b>138,439,976</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 (G)</b>	<b>138,439,976</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	189,745,646
( 配 当 等 相 当 額 )	( 199,880,320)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 10,134,674)
分 配 準 備 積 立 金	57,837,724
繰 越 欠 損 金	△109,143,394

- (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	199,880,320円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	57,837,724円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	257,718,044円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	1,076.15円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

## 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)	参考指数	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
				基準価額+ 累計分配金							
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2019年1月10日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	-	1
1期(2019年12月20日)	11,045	0	10.5	11,045	11,073	10.7	49.1	1.3	48.5	0.6	73
2期(2020年12月21日)	11,535	0	4.4	11,535	11,603	4.8	43.8	1.4	54.0	0.4	1,170
3期(2021年12月20日)	12,486	0	8.2	12,486	12,612	8.7	38.8	1.0	59.1	0.5	2,832
4期(2022年12月20日)	12,115	0	△ 3.0	12,115	12,294	△ 2.5	32.6	1.0	65.3	0.4	3,415

(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) 参考指数は設定時を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せん。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	騰落率	参考指数	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)2021年12月20日	12,486	-	12,612	-	38.8	1.0	59.1	0.5
12月末	12,635	1.2	12,766	1.2	33.8	0.8	64.7	0.4
2022年1月1月末	12,298	△1.5	12,427	△1.5	31.7	1.1	66.2	0.4
2月末	12,213	△2.2	12,352	△2.1	32.6	1.3	65.0	0.4
3月末	12,566	0.6	12,702	0.7	33.2	1.3	62.6	0.4
4月末	12,398	△0.7	12,538	△0.6	32.7	0.8	65.4	0.5
5月末	12,390	△0.8	12,535	△0.6	33.4	1.0	64.6	0.4
6月末	12,253	△1.9	12,407	△1.6	32.6	1.0	65.4	0.4
7月末	12,465	△0.2	12,629	0.1	34.2	0.9	63.9	0.5
8月末	12,474	△0.1	12,641	0.2	33.3	1.1	64.5	0.4
9月末	12,161	△2.6	12,329	△2.2	32.4	1.2	65.4	0.4
10月末	12,495	0.1	12,677	0.5	34.2	0.9	63.9	0.4
11月末	12,409	△0.6	12,593	△0.2	34.0	0.8	64.1	0.4
(期末)2022年12月20日	12,115	△3.0	12,294	△2.5	32.6	1.0	65.3	0.4

(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12月21日～2022年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	87,798	191,849	74,544	164,560
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	85,976	252,458	90,492	265,273
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	905,045	874,403	253,958	244,502
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	68,671	105,037	47,103	71,737

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	ニッセイ国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ グローバルリート マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	126,355,552千円	111,223,960千円	64,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	153,195,142千円	526,139,558千円	67,573千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82	0.21	0.95

(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12月21日～2022年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイターゲットデットファンド2030

## 親投資信託残高

2022年12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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	227,554	240,808	528,671
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	226,294	221,778	634,219
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,434,451	2,085,538	1,953,523
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	179,323	200,892	299,370

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが80,706,172千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが195,884,516千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,528,911千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが37,781,398千口です。

## 投資信託財産の構成

2022年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	528,671	15.5
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	634,219	18.5
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,953,523	57.1
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	299,370	8.7
コール・ローン等、その他	5,778	0.2
投資信託財産総額	3,421,563	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル134.54円、1カナダ・ドル98.56円、1オーストラリア・ドル90.11円、1香港ドル17.29円、1シンガポール・ドル99.18円、1ニュージーランド・ドル85.39円、1イギリス・ポンド163.43円、1イスラエル・シェケル38.913円、1スイス・フラン144.68円、1デンマーク・クローネ19.17円、1ノルウェー・クローネ13.58円、1スウェーデン・クローナ12.94円、1メキシコ・ペソ6.802円、1人民元19.268円、1マレーシア・リンギット30.351円、1南アフリカ・ランド7.77円、1ポーランド・ズロチ30.456円、1ユーロ142.64円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（553,258,799千円）の投資信託財産総額（561,575,901千円）に対する比率は98.5%です。  
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（56,240,555千円）の投資信託財産総額（56,475,336千円）に対する比率は99.6%です。  
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（10,835,160千円）の投資信託財産総額（11,107,203千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# DCニッセイターゲットファンド2030

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>3,421,563,430円</b>
コール・ローン等	4,495,808
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	528,671,477
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	634,219,513
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	1,953,523,885
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	299,370,106
未収入金	1,282,641
<b>(B)負債</b>	<b>5,802,119</b>
未払解約金	1,163,184
未払信託報酬	4,496,125
その他未払費用	142,810
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>3,415,761,311</b>
元本	2,819,505,262
次期繰越損益金	596,256,049
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>2,819,505,262口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	12,115円

(注) 期首元本額	2,268,236,888円
期中追加設定元本額	777,589,965円
期中一部解約元本額	226,321,591円

## 損益の状況

当期(2021年12月21日~2022年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 1,103円</b>
受取利息	40
支払利息	△ 1,143
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>△ 91,372,610</b>
売買益	16,458,853
売買損	△ 107,831,463
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 9,229,200</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 100,602,913</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>145,729,593</b>
(分配準備積立金)	(145,730,152)
(繰越欠損金)	(△ 559)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>551,129,369</b>
(配当等相当額)	(299,910,855)
(売買損益相当額)	(251,218,514)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>596,256,049</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>596,256,049</b>
追加信託差損益金	551,129,369
(配当等相当額)	(299,910,855)
(売買損益相当額)	(251,218,514)
分配準備積立金	145,730,152
繰越欠損金	△ 100,603,472

- (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	450,527,000円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	145,730,152円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	596,257,152円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	2,114.76円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	参考指数	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
				基準価額+ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2018年12月20日)	9,897	0	△ 8.6	9,897	9,955	△ 8.2	65.2	1.1	32.6	0.7	70
3期(2019年12月20日)	11,252	0	13.7	11,252	11,354	14.1	65.4	1.8	31.7	0.7	564
4期(2020年12月21日)	11,936	0	6.1	11,936	12,123	6.8	63.7	2.0	33.4	0.6	1,687
5期(2021年12月20日)	13,568	0	13.7	13,568	13,848	14.2	62.2	1.7	35.0	0.9	3,957
6期(2022年12月20日)	13,354	0	△ 1.6	13,354	13,704	△ 1.0	56.4	1.8	40.6	0.7	5,290

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 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)2021年12月20日	13,568	-	13,848	-	62.2	1.7	35.0	0.9
12月末	13,886	2.3	14,176	2.4	57.9	1.4	39.9	0.8
2022年1月末	13,321	△1.8	13,600	△1.8	55.4	2.0	41.5	0.7
2月末	13,218	△2.6	13,510	△2.4	56.3	2.3	40.1	0.8
3月末	13,897	2.4	14,200	2.5	58.7	2.3	37.8	0.8
4月末	13,597	0.2	13,900	0.4	56.6	1.4	40.7	0.8
5月末	13,594	0.2	13,906	0.4	57.3	1.7	39.8	0.8
6月末	13,418	△1.1	13,738	△0.8	56.3	1.8	40.7	0.8
7月末	13,757	1.4	14,094	1.8	58.2	1.5	39.1	0.8
8月末	13,800	1.7	14,142	2.1	57.1	2.0	39.7	0.8
9月末	13,315	△1.9	13,650	△1.4	56.1	2.0	40.7	0.8
10月末	13,962	2.9	14,324	3.4	58.2	1.5	39.1	0.8
11月末	13,843	2.0	14,206	2.6	58.2	1.4	39.2	0.8
(期末)2022年12月20日	13,354	△1.6	13,704	△1.0	56.4	1.8	40.6	0.7

(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12月21日～2022年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	224,808	492,241	100,457	221,412
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	248,574	731,085	149,574	440,190
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	918,356	888,128	204,699	197,353
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	194,134	296,592	87,835	133,506

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	ニッセイ国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ グローバルリート マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	126,355,552千円	111,223,960千円	64,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	153,195,142千円	526,139,558千円	67,573千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82	0.21	0.95

(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12月21日～2022年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。



# DCニッセイターゲットデットファンド2035

## 親投資信託残高

2022年12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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	482,868	607,219	1,333,090
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	526,220	625,220	1,787,943
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	873,270	1,586,926	1,486,474
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	352,112	458,411	683,124

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが80,706,172千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが195,884,516千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,528,911千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが37,781,398千口です。

## 投資信託財産の構成

2022年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	1,333,090	25.2
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,787,943	33.7
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,486,474	28.1
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	683,124	12.9
コール・ローン等、その他	7,590	0.1
投資信託財産総額	5,298,222	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル134.54円、1カナダ・ドル98.56円、1オーストラリア・ドル90.11円、1香港ドル17.29円、1シンガポール・ドル99.18円、1ニュージーランド・ドル85.39円、1イギリス・ポンド163.43円、1イスラエル・シェケル38.913円、1スイス・フラン144.68円、1デンマーク・クローネ19.17円、1ノルウェー・クローネ13.58円、1スウェーデン・クローナ12.94円、1メキシコ・ペソ6.802円、1人民元19.268円、1マレーシア・リンギット30.351円、1南アフリカ・ランド7.77円、1ポーランド・ズロチ30.456円、1ユーロ142.64円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（553,258,799千円）の投資信託財産総額（561,575,901千円）に対する比率は98.5%です。  
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（56,240,555千円）の投資信託財産総額（56,475,336千円）に対する比率は99.6%です。  
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（10,835,160千円）の投資信託財産総額（11,107,203千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# DCニッセイターゲットデットファンド2035

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A) 資産</b>	<b>5,298,222,268円</b>
コール・ローン等	7,018,088
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,333,090,087
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,787,943,484
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	1,486,474,471
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	683,124,113
未収入金	572,025
<b>(B) 負債</b>	<b>7,626,885</b>
未払解約金	385,694
未払信託報酬	7,032,199
その他未払費用	208,992
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>5,290,595,383</b>
元本	3,961,669,398
次期繰越損益金	1,328,925,985
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,961,669,398口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>13,354円</b>

(注) 期首元本額	2,917,126,953円
期中追加設定元本額	1,270,427,866円
期中一部解約元本額	225,885,421円

## 損益の状況

当期(2021年12月21日~2022年12月20日)

項目	当期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 1,775円</b>
受取利息	58
支払利息	△ 1,833
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 83,821,758</b>
売買益	27,293,673
売買損	△ 111,115,431
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 14,118,780</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 97,942,313</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>365,279,996</b>
(分配準備積立金)	(365,280,967)
(繰越欠損金)	(△ 971)
<b>(F) 追加信託差損益金*</b>	<b>1,061,588,302</b>
(配当等相当額)	(954,905,026)
(売買損益相当額)	(106,683,276)
<b>(G) 合計(D+E+F)</b>	<b>1,328,925,985</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>1,328,925,985</b>
追加信託差損益金	1,061,588,302
(配当等相当額)	(954,905,026)
(売買損益相当額)	(106,683,276)
分配準備積立金	365,280,967
繰越欠損金	△ 97,943,284

- (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	963,646,793円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	365,280,967円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	1,328,927,760円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	3,354.46円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

## 設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	参考指数	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
				基準価額+ 累計分配金							
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2019年1月10日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	-	1
1期(2019年12月20日)	11,461	0	14.6	11,461	11,494	14.9	69.9	1.9	27.1	0.8	46
2期(2020年12月21日)	12,197	0	6.4	12,197	12,329	7.3	69.0	2.1	27.9	0.6	520
3期(2021年12月20日)	14,045	0	15.2	14,045	14,268	15.7	68.5	1.8	28.4	1.0	1,600
4期(2022年12月20日)	13,899	0	△ 1.0	13,899	14,198	△ 0.5	66.3	2.1	30.4	0.9	2,233

(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)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) 参考指数は設定時を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せん。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	騰落率	参考指数	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)2021年12月20日	14,045	-	14,268	-	68.5	1.8	28.4	1.0
12月末	14,440	2.8	14,673	2.8	67.7	1.6	29.8	0.9
2022年1月1月末	13,769	△ 2.0	13,994	△ 1.9	65.3	2.3	31.2	0.9
2月末	13,660	△ 2.7	13,896	△ 2.6	66.1	2.7	29.9	0.9
3月末	14,484	3.1	14,733	3.3	68.1	2.6	28.1	1.0
4月末	14,122	0.5	14,374	0.7	66.5	1.6	30.5	1.0
5月末	14,121	0.5	14,383	0.8	67.1	2.0	29.6	0.9
6月末	13,927	△ 0.8	14,196	△ 0.5	66.0	2.1	30.6	0.9
7月末	14,325	2.0	14,611	2.4	67.9	1.8	29.0	1.0
8月末	14,384	2.4	14,674	2.8	66.8	2.3	29.6	0.9
9月末	13,819	△ 1.6	14,103	△ 1.2	66.0	2.4	30.4	0.9
10月末	14,611	4.0	14,921	4.6	67.8	1.8	29.1	0.9
11月末	14,478	3.1	14,790	3.7	68.0	1.7	29.2	0.9
(期末)2022年12月20日	13,899	△ 1.0	14,198	△ 0.5	66.3	2.1	30.4	0.9

(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12月21日～2022年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	118,660	260,768	34,254	75,020
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	130,705	385,888	53,809	159,029
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	209,008	201,680	54,989	53,048
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	103,502	158,029	37,640	57,212

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	ニッセイ国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ グローバルリート マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	126,355,552千円	111,223,960千円	64,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	153,195,142千円	526,139,558千円	67,573千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82	0.21	0.95

(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12月21日～2022年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイターゲットデットファンド2040

## 親投資信託残高

2022年12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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	214,096	298,502	655,332
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	235,281	312,177	892,734
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	229,945	383,964	359,659
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	152,887	218,749	325,980

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが80,706,172千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが195,884,516千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,528,911千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが37,781,398千口です。

## 投資信託財産の構成

2022年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	655,332	29.3
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	892,734	39.9
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	359,659	16.1
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	325,980	14.6
コール・ローン等、その他	3,144	0.1
投資信託財産総額	2,236,851	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル134.54円、1カナダ・ドル98.56円、1オーストラリア・ドル90.11円、1香港ドル17.29円、1シンガポール・ドル99.18円、1ニュージーランド・ドル85.39円、1イギリス・ポンド163.43円、1イスラエル・シェケル38.913円、1スイス・フラン144.68円、1デンマーク・クローネ19.17円、1ノルウェー・クローネ13.58円、1スウェーデン・クローナ12.94円、1メキシコ・ペソ6.802円、1人民元19.268円、1マレーシア・リンギット30.351円、1南アフリカ・ランド7.77円、1ポーランド・ズロチ30.456円、1ユーロ142.64円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（553,258,799千円）の投資信託財産総額（561,575,901千円）に対する比率は98.5%です。  
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（56,240,555千円）の投資信託財産総額（56,475,336千円）に対する比率は99.6%です。  
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（10,835,160千円）の投資信託財産総額（11,107,203千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# DCニッセイターゲットデットファンド2040

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>2,236,851,806円</b>
コール・ローン等	2,965,073
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	655,332,608
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	892,734,522
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	359,659,252
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	325,980,610
未収入金	179,741
<b>(B)負債</b>	<b>3,160,424</b>
未払解約金	100,486
未払信託報酬	2,961,694
その他未払費用	98,244
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>2,233,691,382</b>
元本	1,607,104,017
次期繰越損益金	626,587,365
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>1,607,104,017口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>13,899円</b>

(注) 期首元本額	1,139,582,522円
期中追加設定元本額	577,964,059円
期中一部解約元本額	110,442,564円

## 損益の状況

当期(2021年12月21日~2022年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 666円</b>
受取利息	18
支払利息	△ 684
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>△ 29,256,408</b>
売買益	10,435,570
売買損	△ 39,691,978
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 5,894,086</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 35,151,160</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>121,127,380</b>
(分配準備積立金)	(121,127,630)
(繰越欠損金)	(△ 250)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>540,611,145</b>
(配当等相当額)	(310,593,266)
(売買損益相当額)	(230,017,879)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>626,587,365</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>626,587,365</b>
追加信託差損益金	540,611,145
(配当等相当額)	(310,593,266)
(売買損益相当額)	(230,017,879)
分配準備積立金	121,127,630
繰越欠損金	△ 35,151,410

- (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	505,460,401円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	121,127,630円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	626,588,031円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	3,898.86円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円



## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	参考指数	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
				基準価額+ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2018年12月20日)	9,867	0	△ 9.3	9,867	9,925	△ 8.9	71.1	1.2	26.5	0.8	43
3期(2019年12月20日)	11,346	0	15.0	11,346	11,449	15.4	71.9	2.0	25.1	0.8	264
4期(2020年12月21日)	12,107	0	6.7	12,107	12,302	7.4	71.1	2.2	25.8	0.6	682
5期(2021年12月20日)	13,997	0	15.6	13,997	14,297	16.2	70.5	1.9	26.4	1.0	1,665
6期(2022年12月20日)	13,874	0	△ 0.9	13,874	14,248	△ 0.3	69.1	2.2	27.5	0.9	2,343

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 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)2021年12月20日	13,997	-	14,297	-	70.5	1.9	26.4	1.0
12月末	14,410	3.0	14,722	3.0	70.5	1.7	26.9	1.0
2022年1月末	13,717	△2.0	14,017	△2.0	68.2	2.4	28.2	0.9
2月末	13,607	△2.8	13,917	△2.7	68.8	2.8	27.0	0.9
3月末	14,463	3.3	14,792	3.5	70.7	2.7	25.3	1.0
4月末	14,089	0.7	14,418	0.8	69.3	1.7	27.6	1.0
5月末	14,089	0.7	14,427	0.9	69.9	2.1	26.7	1.0
6月末	13,892	△0.8	14,237	△0.4	68.8	2.1	27.7	1.0
7月末	14,302	2.2	14,666	2.6	70.7	1.8	26.2	1.0
8月末	14,364	2.6	14,733	3.1	69.5	2.4	26.7	1.0
9月末	13,783	△1.5	14,142	△1.1	68.7	2.5	27.5	0.9
10月末	14,608	4.4	14,998	4.9	70.5	1.9	26.3	0.9
11月末	14,472	3.4	14,863	4.0	70.7	1.7	26.3	0.9
(期末)2022年12月20日	13,874	△0.9	14,248	△0.3	69.1	2.2	27.5	0.9

(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12月21日～2022年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	138,803	304,763	42,193	92,055
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	152,199	448,388	62,332	183,801
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	172,057	165,632	53,287	51,358
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	121,203	185,012	46,901	71,173

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	ニッセイ国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ グローバルリート マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	126,355,552千円	111,223,960千円	64,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	153,195,142千円	526,139,558千円	67,573千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82	0.21	0.95

(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12月21日～2022年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイターゲットデットファンド2045

## 親投資信託残高

2022年12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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	228,757	325,367	714,312
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	252,344	342,211	978,621
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	197,115	315,885	295,890
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	163,448	237,750	354,295

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが80,706,172千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが195,884,516千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,528,911千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが37,781,398千口です。

## 投資信託財産の構成

2022年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	714,312	30.4
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	978,621	41.7
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	295,890	12.6
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	354,295	15.1
コール・ローン等、その他	3,553	0.2
投資信託財産総額	2,346,672	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル134.54円、1カナダ・ドル98.56円、1オーストラリア・ドル90.11円、1香港ドル17.29円、1シンガポール・ドル99.18円、1ニュージーランド・ドル85.39円、1イギリス・ポンド163.43円、1イスラエル・シェケル38.913円、1スイス・フラン144.68円、1デンマーク・クローネ19.17円、1ノルウェー・クローネ13.58円、1スウェーデン・クローナ12.94円、1メキシコ・ペソ6.802円、1人民元19.268円、1マレーシア・リンギット30.351円、1南アフリカ・ランド7.77円、1ポーランド・ズロチ30.456円、1ユーロ142.64円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（553,258,799千円）の投資信託財産総額（561,575,901千円）に対する比率は98.5%です。  
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（56,240,555千円）の投資信託財産総額（56,475,336千円）に対する比率は99.6%です。  
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（10,835,160千円）の投資信託財産総額（11,107,203千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# DCニッセイターゲットデットファンド2045

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>2,346,672,447円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,070,391
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	714,312,417
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	978,621,428
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	295,890,093
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	354,295,333
未 収 入 金	482,785
<b>(B)負債</b>	<b>3,569,554</b>
未 払 解 約 金	399,516
未 払 信 託 報 酬	3,068,816
そ の 他 未 払 費 用	101,222
<b>(C)純 資 産 総 額 (A-B)</b>	<b>2,343,102,893</b>
元 本	1,688,869,094
次 期 繰 越 損 益 金	654,233,799
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>1,688,869,094口</b>
1万口当たり基準価額 (C/D)	<b>13,874円</b>

(注) 期首元本額	1,189,551,640円
期中追加設定元本額	657,710,443円
期中一部解約元本額	158,392,989円

## 損益の状況

当期 (2021年12月21日~2022年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>△ 693円</b>
受 取 利 息	22
支 払 利 息	△ 715
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>△ 27,457,157</b>
売 買 益	13,033,394
売 買 損	△ 40,490,551
<b>(C)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 6,091,646</b>
<b>(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)</b>	<b>△ 33,549,496</b>
<b>(E)前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>155,813,228</b>
( 配 分 準 備 積 立 金 )	( 155,813,549)
( 繰 越 欠 損 金 )	(△ 321)
<b>(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *</b>	<b>531,970,067</b>
( 配 当 等 相 当 額 )	( 455,455,106)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 76,514,961)
<b>(G)合 計 (D + E + F)</b>	<b>654,233,799</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(G)</b>	<b>654,233,799</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	531,970,067
( 配 当 等 相 当 額 )	( 455,455,106)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 76,514,961)
分 配 準 備 積 立 金	155,813,549
繰 越 欠 損 金	△ 33,549,817

- (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	498,420,943円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	155,813,549円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	654,234,492円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	3,873.80円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

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)	参考指数	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
				基準価額+ 累計分配金							
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2019年1月10日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	-	1
1期(2019年12月20日)	11,540	0	15.4	11,540	11,572	15.7	73.8	2.0	23.1	0.8	25
2期(2020年12月21日)	12,328	0	6.8	12,328	12,455	7.6	73.0	2.2	23.8	0.7	146
3期(2021年12月20日)	14,312	0	16.1	14,312	14,533	16.7	72.3	1.9	24.5	1.0	680
4期(2022年12月20日)	14,202	0	△ 0.8	14,202	14,498	△ 0.2	71.1	2.2	25.4	0.9	961

(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) 参考指数は設定時を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	騰落率	参考指数	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12月20日	14,312	-	14,533	-	72.3	1.9	24.5	1.0
12月末	14,748	3.0	14,979	3.1	72.5	1.8	24.9	1.0
2022年1月1月末	14,022	△ 2.0	14,244	△ 2.0	70.3	2.5	26.0	0.9
2月末	13,909	△ 2.8	14,142	△ 2.7	70.9	2.9	24.9	1.0
3月末	14,809	3.5	15,058	3.6	72.5	2.8	23.4	1.0
4月末	14,416	0.7	14,667	0.9	71.4	1.7	25.5	1.1
5月末	14,416	0.7	14,677	1.0	71.9	2.2	24.7	1.0
6月末	14,212	△ 0.7	14,480	△ 0.4	70.8	2.2	25.6	1.0
7月末	14,641	2.3	14,926	2.7	72.7	1.9	24.1	1.1
8月末	14,709	2.8	14,998	3.2	71.5	2.5	24.6	1.0
9月末	14,101	△ 1.5	14,384	△ 1.0	70.8	2.6	25.4	1.0
10月末	14,970	4.6	15,279	5.1	72.5	1.9	24.3	1.0
11月末	14,829	3.6	15,139	4.2	72.7	1.8	24.2	1.0
(期末)2022年12月20日	14,202	△ 0.8	14,498	△ 0.2	71.1	2.2	25.4	0.9

(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12月21日～2022年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	66,488	146,062	24,953	54,731
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	72,598	214,017	33,773	99,649
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	61,896	59,568	23,583	22,693
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	57,373	87,519	25,458	38,585

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	ニッセイ国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ グローバルリート マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	126,355,552千円	111,223,960千円	64,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	153,195,142千円	526,139,558千円	67,573千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82	0.21	0.95

(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12月21日～2022年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイターゲットデットファンド2050

## 親投資信託残高

2022年12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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	95,631	137,166	301,135
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	105,987	144,812	414,119
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	66,100	104,413	97,804
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	67,696	99,611	148,440

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが80,706,172千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが195,884,516千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,528,911千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが37,781,398千口です。

## 投資信託財産の構成

2022年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	301,135	31.3
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	414,119	43.0
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	97,804	10.2
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	148,440	15.4
コール・ローン等、その他	1,412	0.1
投資信託財産総額	962,913	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル134.54円、1カナダ・ドル98.56円、1オーストラリア・ドル90.11円、1香港ドル17.29円、1シンガポール・ドル99.18円、1ニュージーランド・ドル85.39円、1イギリス・ポンド163.43円、1イスラエル・シェケル38.913円、1スイス・フラン144.68円、1デンマーク・クローネ19.17円、1ノルウェー・クローネ13.58円、1スウェーデン・クローナ12.94円、1メキシコ・ペソ6.802円、1人民元19.268円、1マレーシア・リンギット30.351円、1南アフリカ・ランド7.77円、1ポーランド・ズロチ30.456円、1ユーロ142.64円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（553,258,799千円）の投資信託財産総額（561,575,901千円）に対する比率は98.5%です。  
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（56,240,555千円）の投資信託財産総額（56,475,336千円）に対する比率は99.6%です。  
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（10,835,160千円）の投資信託財産総額（11,107,203千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。



# DCニッセイターゲットデットファンド2050

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>962,913,036円</b>
コール・ローン等	1,281,571
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	301,135,353
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	414,119,365
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	97,804,532
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	148,440,805
未収入金	131,410
<b>(B)負債</b>	<b>1,419,746</b>
未払解約金	97,021
未払信託報酬	1,272,616
その他未払費用	50,109
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>961,493,290</b>
元本	677,029,527
次期繰越損益金	284,463,763
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>677,029,527口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>14,202円</b>
(注) 期首元本額	475,426,751円
期中追加設定元本額	302,826,414円
期中一部解約元本額	101,223,638円

## 損益の状況

当期(2021年12月21日~2022年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 223円</b>
受取利息	7
支払利息	△ 230
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>△ 11,241,361</b>
売益	6,926,743
売買損	△ 18,168,104
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 2,540,459</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 13,782,043</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>31,057,308</b>
(分配準備積立金)	( 31,057,365)
(繰越欠損金)	(△ 57)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>267,188,498</b>
(配当等相当額)	( 136,049,031)
(売買損益相当額)	( 131,139,467)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>284,463,763</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>284,463,763</b>
追加信託差損益金	267,188,498
(配当等相当額)	( 136,049,031)
(売買損益相当額)	( 131,139,467)
分配準備積立金	31,057,365
繰越欠損金	△ 13,782,100

- (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	253,406,621円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	31,057,365円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	284,463,986円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	4,201.65円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	参考指数	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
				基準価額+ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
3期(2018年12月20日)	11,820	0	△ 9.8	11,820	11,953	△ 9.5	75.0	1.3	22.5	0.8	71
4期(2019年12月20日)	13,682	0	15.8	13,682	13,881	16.1	75.6	2.1	21.2	0.9	359
5期(2020年12月21日)	14,629	0	6.9	14,629	14,964	7.8	75.0	2.3	21.8	0.7	653
6期(2021年12月20日)	17,047	0	16.5	17,047	17,528	17.1	74.1	2.0	22.6	1.0	1,303
7期(2022年12月20日)	16,932	0	△ 0.7	16,932	17,503	△ 0.1	73.0	2.3	23.4	1.0	1,936

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 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)2021年12月20日	17,047	-	17,528	-	74.1	2.0	22.6	1.0
12月末	17,582	3.1	18,082	3.2	74.3	1.8	23.0	1.0
2022年1月末	16,696	△2.1	17,176	△2.0	72.1	2.6	24.1	1.0
2月末	16,561	△2.9	17,052	△2.7	72.7	3.0	23.0	1.0
3月末	17,662	3.6	18,186	3.8	74.2	2.8	21.6	1.1
4月末	17,182	0.8	17,701	1.0	73.2	1.8	23.6	1.1
5月末	17,183	0.8	17,714	1.1	73.7	2.2	22.8	1.0
6月末	16,937	△0.6	17,474	△0.3	72.6	2.3	23.7	1.0
7月末	17,459	2.4	18,023	2.8	74.5	1.9	22.3	1.1
8月末	17,542	2.9	18,112	3.3	73.3	2.5	22.8	1.0
9月末	16,804	△1.4	17,356	△1.0	72.6	2.6	23.5	1.0
10月末	17,867	4.8	18,465	5.3	74.2	2.0	22.4	1.0
11月末	17,697	3.8	18,294	4.4	74.5	1.8	22.4	1.0
(期末)2022年12月20日	16,932	△0.7	17,503	△0.1	73.0	2.3	23.4	1.0

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2021年12月21日～2022年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	149,036	326,265	54,248	118,661
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	162,172	476,305	70,499	207,939
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	104,143	100,222	38,057	36,664
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	126,106	192,401	53,577	81,358

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	ニッセイ国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ グローバルリート マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	126,355,552千円	111,223,960千円	64,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	153,195,142千円	526,139,558千円	67,573千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82	0.21	0.95

(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12月21日～2022年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイターゲットデットファンド2055

## 親投資信託残高

2022年12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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	187,929	282,717	620,678
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	208,101	299,775	857,267
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	97,584	163,671	153,310
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	132,235	204,765	305,140

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが80,706,172千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが195,884,516千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,528,911千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが37,781,398千口です。

## 投資信託財産の構成

2022年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	620,678	31.9
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	857,267	44.1
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	153,310	7.9
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	305,140	15.7
コール・ローン等、その他	8,463	0.4
投資信託財産総額	1,944,861	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル134.54円、1カナダ・ドル98.56円、1オーストラリア・ドル90.11円、1香港ドル17.29円、1シンガポール・ドル99.18円、1ニュージーランド・ドル85.39円、1イギリス・ポンド163.43円、1イスラエル・シェケル38.913円、1スイス・フラン144.68円、1デンマーク・クローネ19.17円、1ノルウェー・クローネ13.58円、1スウェーデン・クローナ12.94円、1メキシコ・ペソ6.802円、1人民元19.268円、1マレーシア・リンギット30.351円、1南アフリカ・ランド7.77円、1ポーランド・ズロチ30.456円、1ユーロ142.64円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（553,258,799千円）の投資信託財産総額（561,575,901千円）に対する比率は98.5%です。  
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（56,240,555千円）の投資信託財産総額（56,475,336千円）に対する比率は99.6%です。  
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（10,835,160千円）の投資信託財産総額（11,107,203千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# DCニッセイターゲットデットファンド2055

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A) 資産</b>	<b>1,944,861,423円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,551,789
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	620,678,519
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	857,267,322
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	153,310,698
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	305,140,928
未 収 入 金	5,912,167
<b>(B) 負債</b>	<b>8,477,499</b>
未 払 解 約 金	5,843,197
未 払 信 託 報 酬	2,547,428
そ の 他 未 払 費 用	86,874
<b>(C) 純 資 産 総 額 (A - B)</b>	<b>1,936,383,924</b>
元 本	1,143,590,256
次 期 繰 越 損 益 金	792,793,668
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>1,143,590,256口</b>
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	<b>16,932円</b>

(注) 期首元本額	764,717,172円
期中追加設定元本額	560,878,174円
期中一部解約元本額	182,005,090円

## 損益の状況

当期 (2021年12月21日~2022年12月20日)

項目	当期
<b>(A) 配 当 等 収 益</b>	<b>△ 531円</b>
受 取 利 息	22
支 払 利 息	△ 553
<b>(B) 有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>△ 19,695,426</b>
売 買 益	14,598,658
売 買 損	△ 34,294,084
<b>(C) 信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 4,975,959</b>
<b>(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)</b>	<b>△ 24,671,916</b>
<b>(E) 前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>127,911,213</b>
( 配 当 準 備 積 立 金 )	( 127,911,475)
( 繰 越 欠 損 金 )	(△ 262)
<b>(F) 追 加 信 託 差 損 益 金 *</b>	<b>689,554,371</b>
( 配 当 等 相 当 額 )	( 532,756,661)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 156,797,710)
<b>(G) 合 計 (D + E + F)</b>	<b>792,793,668</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 (G)</b>	<b>792,793,668</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	689,554,371
( 配 当 等 相 当 額 )	( 532,756,661)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	( 156,797,710)
分 配 準 備 積 立 金	127,911,475
繰 越 欠 損 金	△ 24,672,178

- (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	664,882,724円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	127,911,475円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	792,794,199円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	6,932.50円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

## 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)	参考指数	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
				基準価額+ 累計分配金							
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2019年1月10日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	-	1
1期(2019年12月20日)	11,609	0	16.1	11,609	11,641	16.4	77.0	2.1	19.7	0.9	32
2期(2020年12月21日)	12,428	0	7.1	12,428	12,568	8.0	76.7	2.4	20.0	0.7	175
3期(2021年12月20日)	14,537	0	17.0	14,537	14,778	17.6	76.0	2.0	20.6	1.1	855
4期(2022年12月20日)	14,453	0	△ 0.6	14,453	14,770	△ 0.1	74.7	2.3	21.6	1.0	1,380

(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) 参考指数は設定時を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せん。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	騰落率	参考指数	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)2021年12月20日	14,537	-	14,778	-	76.0	2.0	20.6	1.1
12月末	15,005	3.2	15,257	3.2	76.0	1.8	21.2	1.1
2022年1月1月末	14,235	△ 2.1	14,477	△ 2.0	73.9	2.7	22.2	1.0
2月末	14,119	△ 2.9	14,372	△ 2.8	74.4	3.0	21.2	1.0
3月末	15,079	3.7	15,351	3.9	75.8	2.9	19.9	1.1
4月末	14,661	0.9	14,933	1.0	75.0	1.8	21.7	1.1
5月末	14,662	0.9	14,944	1.1	75.4	2.3	21.0	1.1
6月末	14,450	△ 0.6	14,739	△ 0.3	74.4	2.3	21.9	1.1
7月末	14,904	2.5	15,211	2.9	76.2	2.0	20.5	1.1
8月末	14,977	3.0	15,289	3.5	75.0	2.6	21.0	1.1
9月末	14,336	△ 1.4	14,639	△ 0.9	74.4	2.7	21.6	1.0
10月末	15,266	5.0	15,597	5.5	75.9	2.0	20.7	1.0
11月末	15,118	4.0	15,451	4.6	76.3	1.9	20.6	1.0
(期末)2022年12月20日	14,453	△ 0.6	14,770	△ 0.1	74.7	2.3	21.6	1.0

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。



## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2021年12月21日～2022年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	154,319	337,473	74,096	161,873
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	166,700	489,642	87,986	259,260
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	74,894	72,132	33,214	31,983
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	122,738	187,181	62,791	95,413

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	ニッセイ国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ グローバルリート マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	126,355,552千円	111,223,960千円	64,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	153,195,142千円	526,139,558千円	67,573千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82	0.21	0.95

(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12月21日～2022年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイターゲットデットファンド2060

## 親投資信託残高

2022年12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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	125,999	206,222	452,741
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	140,407	219,121	626,621
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	43,265	84,945	79,568
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	89,023	148,970	221,996

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが80,706,172千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが195,884,516千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,528,911千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが37,781,398千口です。

## 投資信託財産の構成

2022年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	452,741	32.7
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	626,621	45.2
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	79,568	5.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	221,996	16.0
コール・ローン等、その他	4,997	0.4
投資信託財産総額	1,385,924	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル134.54円、1カナダ・ドル98.56円、1オーストラリア・ドル90.11円、1香港ドル17.29円、1シンガポール・ドル99.18円、1ニュージーランド・ドル85.39円、1イギリス・ポンド163.43円、1イスラエル・シェケル38.913円、1スイス・フラン144.68円、1デンマーク・クローネ19.17円、1ノルウェー・クローネ13.58円、1スウェーデン・クローナ12.94円、1メキシコ・ペソ6.802円、1人民元19.268円、1マレーシア・リンギット30.351円、1南アフリカ・ランド7.77円、1ポーランド・ズロチ30.456円、1ユーロ142.64円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（553,258,799千円）の投資信託財産総額（561,575,901千円）に対する比率は98.5%です。  
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（56,240,555千円）の投資信託財産総額（56,475,336千円）に対する比率は99.6%です。  
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（10,835,160千円）の投資信託財産総額（11,107,203千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# DCニッセイターゲットファンド2060

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>1,385,924,931円</b>
コール・ローン等	1,801,336
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	452,741,142
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	626,621,753
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	79,568,010
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	221,996,147
未収入金	3,196,543
<b>(B)負債</b>	<b>5,007,572</b>
未払解約金	3,147,185
未払信託報酬	1,794,326
その他未払費用	66,061
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>1,380,917,359</b>
元本	955,440,216
次期繰越損益金	425,477,143
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>955,440,216口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>14,453円</b>

(注) 期首元本額	588,312,781円
期中追加設定元本額	680,503,778円
期中一部解約元本額	313,376,343円

## 損益の状況

当期(2021年12月21日~2022年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 320円</b>
受取利息	18
支払利息	△ 338
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>△ 15,980,775</b>
売買益	17,915,501
売買損	△ 33,896,276
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 3,431,399</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 19,412,494</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>31,304,889</b>
(分配準備積立金)	( 31,304,985)
(繰越欠損金)	(△ 96)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>413,584,748</b>
(配当等相当額)	( 193,089,977)
(売買損益相当額)	( 220,494,771)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>425,477,143</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>425,477,143</b>
追加信託差損益金	413,584,748
(配当等相当額)	( 193,089,977)
(売買損益相当額)	( 220,494,771)
分配準備積立金	31,304,985
繰越欠損金	△ 19,412,590

- (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	394,172,478円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	31,304,985円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	425,477,463円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	4,453.21円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

## 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)	参考指数	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
				基準価額+ 累計分配金							
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2022年1月11日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	-	1
1期(2022年12月20日)	9,679	0	△3.2	9,679	9,730	△2.7	75.5	2.4	20.8	1.0	101

(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。以下同じです。

(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) 参考指数は設定時を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	騰落率	参考指数	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
(設定日)2022年1月11日	10,000	-	10,000	-	-	-	-	-
1月末	9,531	△4.7	9,532	△4.7	75.0	2.7	21.1	1.0
2月末	9,453	△5.5	9,462	△5.4	74.7	3.1	20.9	1.0
3月末	10,095	1.0	10,114	1.1	75.7	2.9	20.0	1.1
4月末	9,814	△1.9	9,836	△1.6	75.9	1.8	20.8	1.1
5月末	9,813	△1.9	9,843	△1.6	76.6	2.3	19.8	1.1
6月末	9,673	△3.3	9,708	△2.9	75.2	2.3	21.1	1.1
7月末	9,979	△0.2	10,021	0.2	76.9	2.0	19.8	1.1
8月末	10,030	0.3	10,073	0.7	75.8	2.6	20.2	1.1
9月末	9,598	△4.0	9,642	△3.6	75.1	2.7	20.9	1.0
10月末	10,227	2.3	10,279	2.8	76.7	2.0	19.9	1.0
11月末	10,128	1.3	10,182	1.8	76.9	1.9	19.9	1.0
(期末)2022年12月20日	9,679	△3.2	9,730	△2.7	75.5	2.4	20.8	1.0

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は設定日比です。

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2022年1月11日～2022年12月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	32,939	72,790	17,600	38,795
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	34,989	105,567	18,653	55,780
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	11,088	10,625	5,834	5,588
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	23,439	36,015	12,398	18,991

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期		
	ニッセイ国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ グローバルリート マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	124,332,490千円	111,163,096千円	64,431千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	156,457,700千円	527,762,115千円	67,573千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.79	0.21	0.95

(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1月11日～2022年12月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

# DCニッセイターゲットデットファンド2065

## 親投資信託残高

2022年12月20日現在

種類	当期末	
	口数	評価額
	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	15,338	33,674
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	16,336	46,718
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	5,253	4,921
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	11,040	16,452

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが80,706,172千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが195,884,516千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが72,528,911千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが37,781,398千口です。

## 投資信託財産の構成

2022年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	33,674	33.1
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	46,718	45.9
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	4,921	4.8
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	16,452	16.2
コール・ローン等、その他	89	0.1
投資信託財産総額	101,856	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12月20日における邦貨換算レートは、1米ドル134.54円、1カナダ・ドル98.56円、1オーストラリア・ドル90.11円、1香港ドル17.29円、1シンガポール・ドル99.18円、1ニュージーランド・ドル85.39円、1イギリス・ポンド163.43円、1イスラエル・シェケル38.913円、1スイス・フラン144.68円、1デンマーク・クローネ19.17円、1ノルウェー・クローネ13.58円、1スウェーデン・クローナ12.94円、1メキシコ・ペソ6.802円、1人民元19.268円、1マレーシア・リンギット30.351円、1南アフリカ・ランド7.77円、1ポーランド・ズロチ30.456円、1ユーロ142.64円です。

(注2) ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（553,258,799千円）の投資信託財産総額（561,575,901千円）に対する比率は98.5%です。  
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（56,240,555千円）の投資信託財産総額（56,475,336千円）に対する比率は99.6%です。  
ニッセイグローバルリートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（10,835,160千円）の投資信託財産総額（11,107,203千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## DCニッセイターゲットデットファンド2065

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>101,856,257円</b>
コール・ローン等	86,007
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	33,674,373
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	46,718,495
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	4,921,309
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	16,452,435
未収入金	3,638
<b>(B)負債</b>	<b>90,361</b>
未払信託報酬	86,916
その他未払費用	3,445
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>101,765,896</b>
元本	105,141,177
次期繰越損益金	△ 3,375,281
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>105,141,177口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>9,679円</b>

(注1) 設定元本額 1,000,000円  
 期中追加設定元本額 220,837,749円  
 期中一部解約元本額 116,696,572円

(注2) 元本の欠損  
 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は  
 3,375,281円です。

### 損益の状況

当期 (2022年1月11日~2022年12月20日)

項目	当期
<b>(A)有価証券売買損益</b>	<b>△3,944,997円</b>
売    買    益	1,985,574
売    買    損	△5,930,571
<b>(B)信託報酬等</b>	<b>△ 119,403</b>
<b>(C)当期損益金(A+B)</b>	<b>△4,064,400</b>
<b>(D)追加信託差損益金*</b>	<b>689,119</b>
(売買損益相当額)	( 689,119)
<b>(E)合計(C+D)</b>	<b>△3,375,281</b>
<b>次期繰越損益金(E)</b>	<b>△3,375,281</b>
追加信託差損益金	689,119
(売買損益相当額)	( 689,119)
繰越欠損金	△4,064,400

(注1) **(A)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) **(B)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) **(D)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。設定時の金額に、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	0円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	0円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	0円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	0.00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）

## ■各ファンドの約款変更

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。

（2022年9月21日）

## ■自社による<<2065>>の設定解約状況

当期 設定元本	当期 解約元本	当期末残高			取引の理由
		元本	評価額	比率	
百万円	百万円	百万円	百万円	%	
1	-	1	0.9	1.0	当初設定時における取得

(注) 元本および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、元本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。なお当社は自社による当ファンドの保有分を解約することがあります。

# 各ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合	
信 託 期 間	2025：2017年7月31日～2036年12月22日 2035：2017年7月31日～2046年12月20日 2045：2017年7月31日～2056年12月20日 2055：2016年7月29日～2066年12月20日 2065：2022年1月11日～2076年12月21日	2030：2019年1月10日～2041年12月20日 2040：2019年1月10日～2051年12月20日 2050：2019年1月10日～2061年12月20日 2060：2019年1月10日～2071年12月21日
運 用 方 針	下記マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を含む各国の株式（リート（不動産投資信託）を含みます）、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。	
主要運用対象	D Cニッセイターゲット デ ー ト フ ァ ン ド 2025/2030/2035/ 2040/2045/2050/ 2055/2060/2065	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」「ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド」「ニッセイグローバルリートマザーファンド」「ニッセイマネーマーケットマザーファンド」 受益証券 ※将来の市場構造の変化などによっては、マザーファンドの追加等の見直しを行う場合があります。なお、一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	国内の金融商品取引所上場株式等
	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド	日本を除く主要先進国の株式
	ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド	国内の公社債
	ニッセイ外国債券 インデックスマザーファンド	日本を除く主要国の国債
	ニッセイJ-R E I T インデックスマザーファンド	国内の金融商品取引所に上場しているJリート
	ニッセイグローバル リートマザーファンド	日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）しているリート
	ニッセイマネーマーケット マザーファンド	円建ての短期公社債および短期金融商品

運用方法	DCニッセイターゲット デ ー ト フ ァ ン ド 2025/2030/2035/ 2040/2045/2050/ 2055/2060/2065	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ外国株式 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。
	ニッセイ国内債券 パッシブマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに 限ります。
	ニッセイ外国債券 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得 に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下としま す。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイJ-REIT 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。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 30%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイグローバル リートマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 30%以下とします。ただし、S & Pグローバルリートインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース)における時価の構成割合が 30%を超えるリートがある場合には、当該リートを同インデックス における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
ニッセイマネーマーケット 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。 ・外貨建資産への投資は行いません。	
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、残存信託期間等を勘案し て決定します。	

# ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 22 期

(計算期間：2021年2月23日～2022年2月21日)

#### 運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

#### 主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

#### 運用方法

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



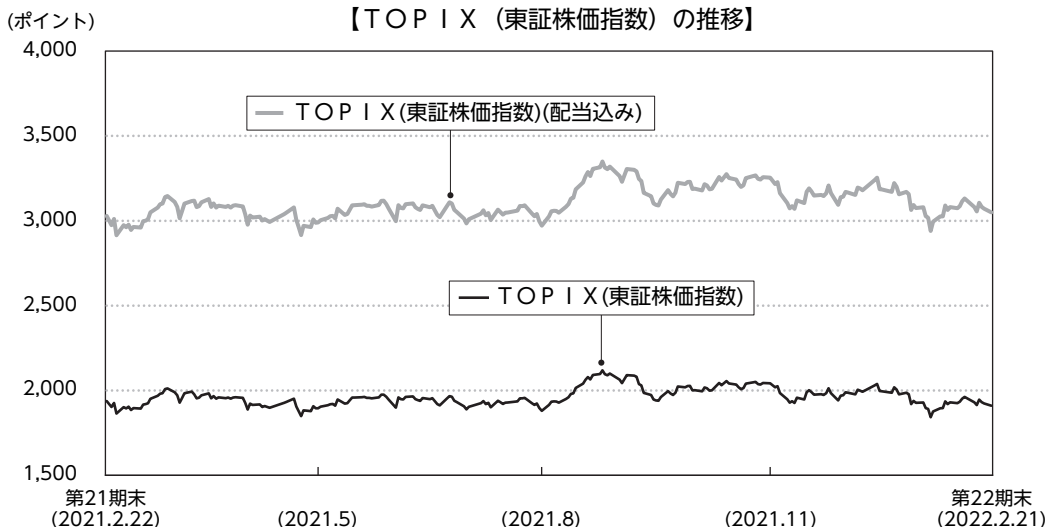
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2021年2月23日～2022年2月21日

## 国内株式市況

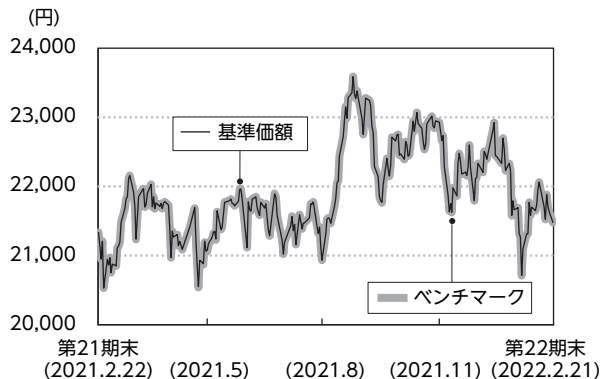


(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の国内株式市場はおおむね横ばいとなりました。

期初から8月下旬までは、新型コロナウイルスや米金融政策をめぐるニュースで一喜一憂する展開となりボックス圏での推移となりましたが、その後は良好な企業決算やワクチン接種拡大に伴う景気回復への思惑などから株価は上昇に転じました。9月には菅前首相が自民党総裁選への不出馬を表明したことで新政権に対する期待感から上昇が継続し、約31年ぶりの高値を付けましたが、その後は中国の不動産大手の債務問題やインフレ圧力の高まりによる米連邦準備制度理事会(FRB)の早期利上げ観測などを受け軟調な展開に転じました。年末にかけては国内企業の良好な決算発表が支援材料となる一方で、半導体不足や新型コロナウイルスの新たな変異型(オミクロン型)の感染拡大への警戒感から株価は一進一退の展開となりました。しかし、年明け以降は米金融政策の転換に伴う利上げ加速への警戒感やウクライナ情勢の緊迫化を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり、株価は再び軟調な展開となり当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

国内の金融商品取引所上場株式に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは前掲の「国内株式市況」をご参照ください。

## ポートフォリオ

当期も東証一部上場銘柄\*に分散投資を行いました。

銘柄選択については、一部信用不安銘柄を投資ユニバースから除外した後、層化抽出法にて行いました（市場での組入比率が大きな銘柄については、ベンチマークとの連動性を高めるために、信用不安銘柄であっても組み入れを行いました）。

また資金の流出入などに対応するため、TOPIX（東証株価指数）先物も一部利用しました。

\*東京証券取引所の東証一部、東証二部などの市場は、2022年4月に新しい市場区分への再編が予定されています。これに併せ、TOPIXの算出方法についても変更が予定されています。

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+0.7%となり、ベンチマーク騰落率（+0.7%）に連動しました。

## 今後の運用方針

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

## 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	純資産 総額
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
18期(2018年2月20日)	18,076	16.3	18,261	16.3	98.2	1.9	50,868
19期(2019年2月20日)	16,916	△6.4	17,088	△6.4	98.4	1.5	58,316
20期(2020年2月20日)	18,004	6.4	18,182	6.4	98.3	1.6	68,225
21期(2021年2月22日)	21,336	18.5	21,558	18.6	99.3	0.7	170,293
22期(2022年2月21日)	21,482	0.7	21,702	0.7	96.1	3.7	117,060

(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) 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
		%		%		
(期首)2021年2月22日	21,336	－	21,558	－	99.3	0.7
2月末	20,530	△3.8	20,743	△3.8	98.3	1.7
3月末	21,701	1.7	21,927	1.7	96.5	3.4
4月末	21,090	△1.2	21,305	△1.2	97.5	2.5
5月末	21,378	0.2	21,599	0.2	97.3	3.0
6月末	21,627	1.4	21,855	1.4	96.6	3.3
7月末	21,158	△0.8	21,379	△0.8	98.2	1.8
8月末	21,827	2.3	22,057	2.3	97.4	2.6
9月末	22,779	6.8	23,017	6.8	95.7	4.2
10月末	22,454	5.2	22,691	5.3	97.3	2.9
11月末	21,632	1.4	21,873	1.5	96.1	4.1
12月末	22,394	5.0	22,627	5.0	98.2	1.8
2022年1月末	21,315	△0.1	21,534	△0.1	97.2	2.8
(期末)2022年2月21日	21,482	0.7	21,702	0.7	96.1	3.7

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2021年2月23日～2022年2月21日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.002% (0.000) (0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	0	0.002	

(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（21,895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2月23日～2022年2月21日

## (1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		9,593 (2,776)	21,321,180	31,893	78,125,057

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

## (2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建		
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額	
国内	百万円	百万円	百万円	百万円	
国内	株式先物取引	43,239	40,129	-	-

(注) 単位未満は切り捨てています。



## 主要な売買銘柄

2021年2月23日～2022年2月21日

## 株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ソフトバンク	406	625,586	1,538	トヨタ自動車	928	2,571,349	2,770
トヨタ自動車	193	603,803	3,126	ソフトバンクグループ	286	2,165,826	7,549
東芝	131	501,122	3,816	ソニーグループ	167	2,154,577	12,832
リクルートホールディングス	73	497,629	6,816	キーエンス	29	1,848,888	62,887
ソニーグループ	38	470,172	12,276	リクルートホールディングス	192	1,303,706	6,786
三菱商事	118	414,142	3,488	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,999	1,236,815	618
キーエンス	5	360,666	62,183	日本電信電話	352	1,082,458	3,070
東京エレクトロン	6	337,934	51,989	信越化学工業	53	1,035,824	19,217
日本電産	25	321,823	12,522	日本電産	67	871,471	12,910
日本郵政	355	314,383	885	東京エレクトロン	16	860,406	52,145

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## 組入有価証券明細表

2022年2月21日現在

(1) 国内株式  
上場株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
極洋	2	2	6,730
日本水産	80	58	32,175
マルハニチロ	13	9	23,468
雪国まいたけ	5	4	5,250
カネコ種苗	2	2	3,092
サカタのタネ	10	7	23,800
ホフト	7	4	9,599
<b>鉱業(0.3%)</b>			
住石ホールディングス	2	11	1,630
日鉄鉱業	2	1	8,281
三井松島ホールディングス	5	2	3,931
I N P E X	318	234	264,281
石油資源開発	11	6	18,492
K&Oエナジーグループ	4	2	4,276

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>建設業(2.4%)</b>			
ヒノキヤグループ	2	1	3,099
ショーボンドホールディングス	12	8	43,409
ミライト・ホールディングス	30	18	36,378
タマホーム	5	3	8,011
ファーストコーポレーション	5	4	3,074
スペースバリューホールディングス	10	6	6,984
ダイセキ環境ソリューション	3	-	-
安藤・間	55	29	27,086
東急建設	25	17	12,465
コムシスホールディングス	30	18	52,640
ビーアールホールディングス	10	8	3,036
高松コンストラクショングループ	5	3	7,196
東建コーポレーション	2	1	16,596
ソネット	5	2	2,987

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤマウラ	4	3	3,081
オリエンタル白石	—	19	4,743
大成建設	62	39	148,395
大林組	199	135	130,815
清水建設	187	126	98,670
飛島建設	5	3	4,060
長谷工コーポレーション	65	40	60,782
松井建設	7	5	3,927
銭高組	1	0.800	3,268
鹿島建設	146	98	154,778
不動テトラ	4	2	4,495
大末建設	5	—	—
鉄建建設	4	2	5,579
西松建設	14	8	31,775
三井住友建設	48	30	13,619
大豊建設	4	2	7,350
前田建設工業	50	—	—
佐田建設	9	6	3,033
ナカノフドー建設	10	8	2,984
奥村組	11	8	25,800
東鉄工業	8	6	15,913
浅沼組	2	1	7,980
戸田建設	83	56	43,140
熊谷組	9	6	19,851
北野建設	1	1	3,008
植木組	1	2	3,158
矢作建設工業	8	6	4,698
ピーエス三菱	6	4	2,993
日本ハウスホールディングス	13	9	4,176
大東建託	21	13	176,088
新日本建設	8	5	4,235
NIPPPO	16	11	44,800
東亜道路工業	1	0.700	3,514
前田道路	12	—	—
日本道路	1	1	12,857
東亜建設工業	5	3	8,820
日本国土開発	19	13	6,969
若築建設	3	2	4,365
東洋建設	22	15	8,939
五洋建設	84	53	33,223
世紀東急工業	9	6	5,317

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
福田組	2	1	5,908
住友林業	47	34	78,315
日本基礎技術	8	5	3,596
巴コーポレーション	10	6	3,168
大和ハウス工業	184	124	417,994
ライト工業	11	8	16,507
積水ハウス	216	146	347,480
日特建設	5	4	3,385
北陸電気工事	3	3	2,576
ユアテック	11	7	5,490
日本リーテック	4	2	4,026
四電工	1	1	2,718
中電工	9	6	13,342
関電工	32	21	19,228
きんでん	43	30	49,377
東京エネシス	6	4	4,252
トーエネック	2	1	4,662
住友電設	5	3	7,395
日本電設工業	11	7	11,373
エクシオグループ	30	20	48,537
新日本空調	5	3	7,329
九電工	14	10	32,344
三機工業	14	8	13,217
日揮ホールディングス	66	41	45,468
中外炉工業	2	1	3,003
ヤマト	6	4	2,832
太平電業	4	3	8,064
高砂熱学工業	18	12	24,217
三晃金属工業	1	1	3,032
朝日工業社	1	0.700	2,131
明星工業	12	8	6,298
大気社	9	6	20,229
ダイダン	4	3	6,921
日比谷総合設備	6	4	8,118
テスホールディングス	—	2	3,132
インフロニア・ホールディングス	—	57	61,056
OSJBホールディングス	29	—	—
東洋エンジニアリング	—	5	3,226
レイズネクスト	10	6	7,280
<b>食料品(3.5%)</b>			
ニッポン	18	12	21,369

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日清製粉グループ本社	72	48	80,715
昭和産業	5	4	11,070
鳥越製粉	5	4	2,943
中部飼料	7	4	5,105
フィード・ワン	8	5	3,955
日本甜菜製糖	3	2	3,912
DM三井製糖ホールディングス	5	3	7,796
塩水港精糖	18	14	3,059
日新製糖	3	2	3,590
森永製菓	15	10	36,461
中村屋	1	1	3,375
江崎グリコ	17	11	46,112
名糖産業	3	1	3,184
井村屋グループ	3	2	5,414
不二家	4	2	6,040
山崎製パン	48	32	49,960
モロゾフ	1	1	3,823
亀田製菓	3	2	10,287
寿スピリッツ	6	4	26,124
カルビー	29	19	50,510
森永乳業	11	8	44,880
六甲バター	4	3	5,008
ヤクルト本社	44	32	197,120
明治ホールディングス	42	28	196,482
雪印メグミルク	15	10	20,716
プリマハム	9	5	13,111
日本ハム	24	16	72,600
林兼産業	7	5	2,961
丸大食品	6	4	6,505
S F o o d s	5	3	12,558
柿安本店	2	1	3,850
伊藤ハム米久ホールディングス	41	27	19,154
サッポロホールディングス	21	14	35,397
アサヒグループホールディングス	139	101	519,684
キリンホールディングス	271	158	319,505
宝ホールディングス	47	29	34,574
オエノンホールディングス	18	12	4,255
養命酒製造	2	1	3,017
コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス	49	30	45,965
サントリー食品インターナショナル	42	28	135,396
ダイドーグループホールディングス	3	2	11,440

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
伊藤園	19	13	87,901
キーコーヒー	6	4	8,698
日清オイリオグループ	8	5	16,173
不二製油グループ本社	15	9	21,018
かどや製油	1	-	-
J-オイルミルズ	3	4	6,968
キッコーマン	46	31	279,589
味の素	152	95	317,109
ブルドックソース	-	1	3,609
キューピー	35	22	55,410
ハウス食品グループ本社	23	16	48,843
カゴメ	26	16	49,774
アリアケジャパン	5	3	22,386
ピエトロ	2	1	3,068
エバラ食品工業	0.900	-	-
ニチレイ	30	19	50,806
東洋水産	32	20	101,947
イートアンドホールディングス	2	1	3,678
大冷	2	1	2,643
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4	4	2,503
日清食品ホールディングス	25	17	156,400
永谷園ホールディングス	3	1	3,828
一正蒲鉾	3	3	3,028
フジッコ	6	4	7,824
ロック・フィールド	6	4	7,473
日本たばこ産業	343	231	538,239
ケンコーマヨネーズ	3	2	3,374
わらべや日洋ホールディングス	4	2	5,132
なとり	3	2	4,968
ビッグルスコーポレーション	1	2	3,175
ファーマフーズ	-	4	6,416
ユーグレナ	27	22	16,588
紀文食品	-	3	3,695
ミヨシ油脂	3	2	2,610
理研ビタミン	6	4	8,010
<b>繊維製品(0.5%)</b>			
片倉工業	8	4	10,758
グンゼ	4	2	10,752
東洋紡	24	16	20,891
ユニチカ	18	11	3,584
富士紡ホールディングス	3	1	6,878

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
倉敷紡績	5	3	6,879
日本毛織	20	12	11,341
帝国繊維	7	4	9,158
帝人	58	39	56,294
東レ	452	305	201,498
サカイオーベックス	1	-	-
日本フェルト	9	6	3,060
イチカワ	3	-	-
アツギ	8	5	3,349
セーレン	15	8	19,117
ソトー	5	3	3,096
東海染工	3	2	3,029
小松マテーレ	10	6	8,914
ワコールホールディングス	15	10	21,136
ホグメディカル	8	5	18,810
クラウディアホールディングス	16	12	3,022
T S Iホールディングス	19	14	4,512
マツオカコーポレーション	2	2	2,791
ワールド	8	5	6,787
三陽商会	0.400	0.400	350
オンワードホールディングス	37	25	7,387
ゴールドウイン	10	7	45,524
デサント	10	8	23,616
ヤマトインターナショナル	12	10	3,007
<b>パルプ・紙(0.2%)</b>			
特種東海製紙	3	2	10,673
王子ホールディングス	281	176	106,777
日本製紙	27	20	23,189
三菱製紙	11	6	1,890
北越コーポレーション	44	27	20,755
中越パルプ工業	3	-	-
大王製紙	30	20	36,073
阿波製紙	0.200	9	3,003
レンゴー	64	39	34,267
トーモク	3	2	4,495
ザ・パック	4	3	8,640
<b>化学(6.6%)</b>			
北の達人コーポレーション	22	15	3,337
クラレ	98	61	66,882
旭化成	413	279	304,546
昭和電工	47	36	81,947

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友化学	491	309	170,080
住友精化	3	1	6,270
日産化学	34	22	148,621
ラサ工業	2	1	2,867
クレハ	5	3	29,436
多木化学	2	1	7,528
テイカ	4	3	4,085
石原産業	11	7	7,238
片倉コープアグリ	3	2	3,060
日本曹達	8	5	18,117
東ソー	96	60	111,264
トクヤマ	18	13	24,732
セントラル硝子	11	6	14,227
東亜合成	38	24	25,776
大阪ソーダ	6	3	12,168
関東電化工業	14	9	10,865
デンカ	22	15	54,285
信越化学工業	115	72	1,267,724
日本カーバイド工業	3	2	3,176
堺化学工業	4	3	5,988
第一稀元素化学工業	6	3	3,853
エア・ウォーター	63	39	66,912
日本酸素ホールディングス	51	40	92,016
日本化学工業	1	1	3,198
日本パーカライズニング	31	21	21,236
高压ガス工業	9	6	4,616
四国化成工業	8	5	7,903
戸田工業	-	0.900	2,291
ステラケミファ	3	2	5,016
保土谷化学工業	1	1	5,538
日本触媒	11	7	40,328
大日精化工業	5	3	7,703
カネカ	16	10	40,929
三菱瓦斯化学	62	39	77,694
三井化学	53	38	114,057
J S R	62	39	134,013
東京応化工業	10	7	51,912
大阪有機化学工業	5	3	10,746
三菱ケミカルホールディングス	417	281	232,992
K Hネオケム	10	7	19,544
ダイセル	83	60	52,748

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友ベークライト	9	6	32,208
積水化学工業	132	88	171,990
日本ゼオン	56	38	50,578
アイカ工業	17	11	37,323
宇部興産	31	19	43,322
積水樹脂	10	6	12,300
タキロンシーアイ	13	9	5,077
旭有機材	3	2	4,905
ニチバン	3	2	4,472
リケンテクノス	15	10	4,779
大倉工業	2	2	4,105
積水化成成品工業	8	6	2,802
群栄化学工業	1	1	3,505
タイガースポリマー	10	-	-
ダイキョーニシカワ	13	8	5,108
森六ホールディングス	3	2	4,268
恵和	-	1	4,878
日本化薬	38	33	37,416
カーリットホールディングス	6	2	2,001
日本精化	4	3	6,813
扶桑化学工業	4	3	17,024
トリケミカル研究所	5	4	11,936
ADEKA	28	19	50,420
日油	23	14	72,432
新日本理化	15	11	2,760
ハリマ化成グループ	4	3	2,944
花王	152	95	507,130
第一工業製薬	2	1	4,329
石原ケミカル	-	2	2,807
日華化学	4	3	2,660
ニイタカ	1	-	-
三洋化成工業	3	2	12,700
有機合成薬品工業	13	11	3,012
大日本塗料	7	5	4,253
日本ペイントホールディングス	51	158	167,904
関西ペイント	70	43	104,836
中国塗料	15	9	8,979
日本特殊塗料	4	3	2,988
藤倉化成	8	6	2,766
太陽ホールディングス	4	6	18,724
DIC	26	17	47,294

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サカタインクス	13	8	7,854
東洋インキSCホールディングス	13	8	16,821
T & K T O K A	5	-	-
富士フィルムホールディングス	112	75	570,096
資生堂	126	80	541,029
ライオン	82	52	78,832
高砂香料工業	4	3	8,133
マンダム	13	9	12,528
ミルボン	8	5	31,906
ファンケル	23	17	56,637
コーセー	12	8	108,216
コタ	3	2	4,311
シーボン	2	1	3,290
ポーラ・オルビスホールディングス	27	18	34,260
ノビアホールディングス	5	3	19,166
アジュバンホールディングス	4	2	2,977
エステー	4	2	4,370
アプロカネショウ	2	2	2,727
コニシ	10	7	11,054
長谷川香料	11	7	17,353
星光PMC	5	4	2,528
小林製薬	17	12	118,943
荒川化学工業	5	3	4,057
メック	4	3	9,148
日本高純度化学	1	1	3,037
タカラバイオ	16	11	27,402
JCU	7	4	22,056
新田ゼラチン	6	5	3,260
OATアグリオ	3	-	-
デクセリアルズ	17	11	33,152
アース製薬	4	3	19,845
北興化学工業	5	4	3,348
大成ラミック	2	1	3,595
クミアイ化学工業	26	16	12,688
日本農薬	11	7	4,104
アキレス	4	2	3,553
有沢製作所	8	6	6,255
日東電工	40	26	214,760
レック	7	5	5,280
三光合成	5	7	2,718
きもと	-	13	2,848

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
藤森工業	5	3	15,619
前澤化成工業	4	2	3,431
未来工業	2	1	2,888
ウェーブロックホールディングス	4	—	—
J S P	3	2	3,972
エフピコ	11	7	25,240
天馬	4	3	8,792
信越ポリマー	9	7	8,369
東リ	17	14	3,178
ニフコ	23	14	50,328
バルカー	5	3	8,907
ユニ・チャーム	135	83	361,465
<b>医薬品(4.9%)</b>			
協和キリン	64	50	154,025
武田薬品工業	530	338	1,182,020
アステラス製薬	552	373	742,854
大日本住友製薬	47	26	33,170
塩野義製薬	80	54	410,348
わかもと製薬	13	5	1,537
あすか製薬	7	—	—
日本新薬	18	11	85,541
中外製薬	199	134	526,151
科研製薬	10	6	28,152
エーザイ	70	51	297,309
ロート製薬	30	22	82,985
小野薬品工業	146	98	282,161
久光製薬	18	11	41,553
持田製薬	8	5	20,979
参天製薬	110	80	103,105
扶桑薬品工業	2	1	3,472
ツムラ	21	13	42,493
日医工	18	13	11,202
キッセイ薬品工業	11	7	18,293
生化学工業	11	7	6,817
栄研化学	11	7	13,216
日水製薬	4	2	2,868
鳥居薬品	4	2	6,805
J C R ファーマ	18	12	25,942
東和薬品	9	6	18,631
富士製薬工業	4	2	2,929
沢井製薬	14	—	—

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゼリア新薬工業	11	7	15,272
第一三共	547	338	862,495
キョーリン製薬ホールディングス	14	8	15,738
大幸薬品	7	6	3,906
ダイト	4	2	8,234
大塚ホールディングス	132	89	360,685
大正製薬ホールディングス	15	10	58,344
ペプチドリーム	32	22	46,171
あすか製薬ホールディングス	—	4	5,233
サワイグループホールディングス	—	9	41,595
<b>石油・石炭製品(0.4%)</b>			
日本コークス工業	53	36	4,914
ニチレキ	7	5	7,199
ユシロ化学工業	3	2	2,829
富士石油	18	11	3,162
M O R E S C O	3	2	2,969
出光興産	70	47	144,117
ENEOSホールディングス	959	647	294,204
コスモエネルギーホールディングス	20	12	31,487
<b>ゴム製品(0.7%)</b>			
横浜ゴム	36	24	43,948
T O Y O T I R E	33	22	36,365
ブリヂストン	169	124	636,616
住友ゴム工業	57	38	45,433
藤倉コンポジット	—	3	2,329
オカモト	3	2	10,413
フコク	5	1	1,558
ニッタ	6	4	12,303
住友理工	12	8	4,971
三ツ星ベルト	7	5	10,977
バンダー化学	11	6	5,878
<b>ガラス・土石製品(0.8%)</b>			
日東紡績	9	6	19,872
A G C	58	39	221,200
日本板硝子	32	20	10,536
日本山村硝子	4	3	3,059
日本電気硝子	23	17	48,855
オハラ	2	—	—
住友大阪セメント	11	8	28,360
太平洋セメント	37	24	56,864
日本ヒューム	5	4	3,010

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
日本コンクリート工業	13	10	3,259	
三谷セキサン	3	2	12,520	
アジアパイルホールディングス	9	6	2,930	
東海カーボン	62	36	41,045	
日本カーボン	3	2	9,152	
東洋炭素	3	2	8,806	
ノリタケカンパニーリミテド	3	2	10,692	
TOTO	45	30	155,649	
日本碍子	70	46	86,536	
日本特殊陶業	48	32	69,389	
MARUWA	2	1	21,435	
品川リフラクトリーズ	1	1	3,915	
黒崎播磨	1	0.700	3,062	
ヨータイ	4	2	3,407	
イソライト工業	7	2	3,038	
ニッカトー	5	4	2,459	
フジミンコーポレートッド	5	3	22,715	
クニミネ工業	3	2	2,943	
ニチアス	16	10	26,230	
ニチハ	8	6	15,510	
<b>鉄鋼(0.8%)</b>				
日本製鉄	300	190	395,097	
神戸製鋼所	115	79	48,813	
中山製鋼所	11	7	3,269	
合同製鐵	3	2	3,171	
ジェイエフイーホールディングス	182	115	196,305	
東京製鐵	24	14	16,588	
共英製鋼	7	4	7,742	
大和工業	13	8	29,727	
東京鐵鋼	2	2	3,151	
大阪製鐵	3	-	-	
淀川製鋼所	8	5	15,288	
丸一鋼管	20	15	44,831	
モリ工業	1	1	3,300	
大同特殊鋼	10	7	29,295	
日本高周波鋼業	12	9	3,164	
日本冶金工業	4	3	9,030	
山陽特殊製鋼	7	4	9,138	
愛知製鋼	3	2	6,312	
日立金属	59	45	95,196	
大平洋金属	4	2	8,723	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
新日本電工	40	27	9,425	
栗本鐵工所	2	1	2,924	
三菱製鋼	2	2	3,199	
日亜鋼業	14	11	3,096	
日本精線	1	0.700	3,090	
エンビプロ・ホールディングス	-	1	2,302	
シンニッタン	20	13	2,983	
<b>非鉄金属(0.8%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	9	6	10,707	
日本輕金属ホールディングス	17	10	19,699	
三井金属鋁業	17	11	38,237	
東邦亜鉛	3	2	6,465	
三菱マテリアル	41	28	58,700	
住友金属鋁山	80	54	295,881	
DOWAホールディングス	15	11	56,840	
古河機械金属	10	7	9,100	
大阪チタニウムテクノロジーズ	6	4	4,214	
東邦チタニウム	11	7	6,916	
UACJ	9	6	15,359	
CKサンエツ	1	0.900	3,622	
古河電氣工業	19	13	31,706	
住友電氣工業	220	159	251,536	
フジクラ	76	47	31,112	
昭和電線ホールディングス	6	3	6,870	
東京特殊電線	1	1	2,851	
タツタ電線	11	7	3,382	
平河ヒューテック	3	2	2,930	
リョービ	7	5	5,777	
アーレスティ	10	5	2,084	
アサヒホールディングス	11	17	36,601	
<b>金属製品(0.6%)</b>				
稲葉製作所	3	2	3,127	
宮地エンジニアリンググループ	2	1	4,654	
トーカロ	16	11	14,586	
アルファ	4	2	2,948	
SUMCO	80	65	128,444	
川田テクノロジーズ	1	0.900	3,442	
RSTechnologies	2	1	7,350	
東洋製鐵グループホールディングス	40	27	43,034	
ホッカンホールディングス	3	2	3,215	
コロナ	4	3	2,973	

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
横河ブリッジホールディングス	10	7	15,258
三和ホールディングス	59	40	51,368
文化シャッター	18	13	14,269
三協立山	8	5	3,514
アルインコ	4	3	2,827
L I X I L	86	67	174,460
日本フィルコン	8	5	2,802
ノーリツ	13	8	12,692
長府製作所	6	4	8,522
リンナイ	12	8	76,800
ダイニチ工業	4	3	2,718
日東精工	9	5	2,703
三洋工業	2	1	3,134
岡部	12	8	6,200
ジーテクト	7	5	7,716
東プレ	11	7	9,677
高周波熱錬	12	7	4,537
東京製綱	4	3	3,038
サンコール	6	5	2,607
モリテックスチール	9	8	2,612
パイオラックス	9	6	10,778
エイチワン	6	4	2,956
日本発条	62	39	34,955
立川プラインド工業	3	-	-
三益半導体工業	4	3	8,007
<b>機械(5.2%)</b>			
日本製鋼所	19	12	47,407
三浦工業	27	18	58,052
タクマ	21	14	20,822
ツガミ	13	9	11,938
オークマ	7	5	23,775
芝浦機械	6	4	14,664
アマダ	92	67	69,753
アイダエンジニアリング	16	11	10,811
滝澤鉄工所	4	2	3,130
F U J I	25	19	45,530
牧野フライス製作所	7	4	17,390
オーエスジー	31	19	38,868
ダイジェット工業	3	3	3,216
旭ダイヤモンド工業	16	11	6,417
DMG森精機	39	25	42,782

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ソディック	13	9	7,209
ディスコ	8	6	213,885
日東工器	3	2	3,689
日進工具	2	3	4,672
豊和工業	4	3	3,131
東洋機械金属	9	5	3,214
エンシュウ	4	5	3,315
島精機製作所	9	6	11,339
オプトラ	7	5	10,096
NCホールディングス	7	0.500	927
イワキ	5	2	2,759
フリーユ	6	3	3,849
ヤマシンフィルタ	12	8	3,087
日阪製作所	7	5	4,269
やまびこ	12	8	10,897
野村マイクロ・サイエンス	-	1	3,844
平田機工	3	2	10,540
ベガサスミシン製造	12	5	3,026
マルマエ	1	1	4,073
タツモ	2	2	3,150
ナプテスコ	37	24	76,666
三井海洋開発	6	4	5,292
レオン自動機	6	4	4,664
SMC	18	12	850,374
ホソカワミクロン	2	3	7,941
ユニオンツール	2	1	5,744
オイレス工業	8	6	9,336
日精エー・エス・ビー機械	1	1	4,139
サトーホールディングス	8	5	11,205
技研製作所	5	3	13,965
カワタ	4	3	3,027
日精樹脂工業	4	3	3,006
オカダアイオン	3	1	2,703
ワイエイシイホールディングス	-	2	3,100
小松製作所	288	195	531,745
住友重機械工業	36	24	67,576
日立建機	29	17	50,533
日工	9	5	3,613
巴工業	2	1	3,927
井関農機	6	4	4,872
TOWA	5	3	8,561



## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
丸山製作所	2	1	2,867	
北川鉄工所	3	2	2,688	
ローツェ	2	2	21,861	
タカキタ	6	4	2,767	
クボタ	334	210	432,180	
荏原実業	1	2	4,314	
三菱化工機	2	1	2,811	
月島機械	11	7	8,231	
帝国電機製作所	4	3	4,191	
新東工業	15	9	6,650	
澁谷工業	5	3	9,264	
アイチコーポレーション	11	6	5,239	
小森コーポレーション	16	10	8,022	
鶴見製作所	4	3	5,890	
荏原製作所	26	17	101,135	
石井鐵工所	1	1	3,005	
西島製作所	6	3	3,740	
北越工業	6	4	3,584	
ダイキン工業	81	54	1,175,460	
オルガノ	2	1	9,288	
トーヨーカネツ	2	1	3,844	
栗田工業	34	23	110,209	
椿本チエイン	9	5	18,396	
大同工業	5	3	2,775	
木村化工機	-	3	2,948	
アネスト岩田	10	6	5,467	
ダイフク	35	23	198,606	
サムコ	1	1	2,527	
加藤製作所	4	3	3,030	
タダノ	30	22	22,050	
フジテック	21	16	43,088	
CKD	14	12	25,654	
キトー	5	3	6,201	
平和	17	12	23,340	
理想科学工業	4	3	7,815	
SANKYO	15	9	29,992	
日本金銭機械	8	4	2,763	
マースグループホールディングス	4	2	4,414	
フクシマガリレイ	4	2	11,179	
ダイコク電機	4	2	3,107	
竹内製作所	10	6	16,913	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
アマノ	16	11	25,481	
JUKI	8	6	4,056	
ジャノメ	5	4	3,091	
マックス	8	5	9,752	
グローリー	16	11	23,165	
新晃工業	5	4	6,880	
大和冷機工業	10	6	6,987	
セガサミーホールディングス	58	42	91,591	
日本ピストンリング	4	2	3,151	
リケン	3	1	4,886	
TPR	8	5	8,212	
ツバキ・ナカシマ	12	9	9,061	
ホシザキ	20	12	99,162	
大豊工業	-	3	2,656	
日本精工	130	81	59,778	
NTN	147	92	20,905	
ジェイテクト	61	41	42,497	
不二越	5	3	15,503	
日本トムソン	17	11	6,301	
THK	39	24	65,707	
ユーシン精機	4	4	2,736	
前澤給装工業	2	3	3,136	
イーグル工業	7	5	5,633	
日本ピラー工業	6	4	12,438	
キッツ	19	14	9,729	
マキタ	83	52	216,726	
三井E&Sホールディングス	24	15	5,564	
日立造船	50	36	28,137	
三菱重工業	100	67	225,716	
IHI	42	26	72,038	
スター精密	9	6	9,704	
<b>電気機器(17.6%)</b>				
日清紡ホールディングス	39	26	27,378	
イビデン	30	22	122,944	
コニカミノルタ	129	94	47,144	
ブラザー工業	77	52	109,986	
ミネベアミツミ	109	74	186,687	
日立製作所	306	207	1,243,863	
東芝	-	75	339,603	
三菱電機	637	430	613,462	
富士電機	38	25	156,954	

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東洋電機製造	3	2	2,696
安川電機	68	46	215,989
シンフォニアテクノロジー	8	5	6,656
明電舎	10	7	17,279
オリジン	3	2	2,959
山洋電気	3	1	9,329
デンヨー	5	3	6,345
P H Cホールディングス	-	4	7,599
東芝テック	6	4	22,586
芝浦メカトロニクス	1	0.800	6,144
マブチモーター	17	10	42,218
日本電産	153	111	1,111,089
トレックス・セミコンダクター	3	2	5,467
東光高岳	3	2	3,444
ダブル・スコープ	12	12	13,230
ダイヘン	7	4	19,505
ヤーマン	10	7	6,517
J V Cケンウッド	55	35	6,633
ミマキエンジニアリング	8	3	2,831
I - P E X	3	2	2,932
日新電機	14	10	14,281
大崎電気工業	12	7	3,847
オムロン	53	35	281,638
日東工業	9	5	9,102
I D E C	8	5	12,757
不二電機工業	3	2	2,766
ジーエス・ユアサコーポレーション	22	14	33,530
サクサホールディングス	3	2	3,084
メルコホールディングス	2	1	4,476
日本電気	81	54	280,064
富士通	57	38	625,005
沖電気工業	25	17	15,522
岩崎通信機	-	3	2,937
電気興業	3	2	5,432
サンケン電気	7	4	20,880
アイホン	3	2	5,073
ルネサスエレクトロニクス	274	233	324,892
セイコーエプソン	79	53	98,149
ワコム	46	33	28,390
アルバック	11	7	45,820
E I Z O	5	3	12,094

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ジャパンディスプレイ	217	147	6,468
日本信号	14	11	9,691
京三製作所	13	9	3,882
能美防災	8	5	11,519
ホーチキ	4	3	3,760
エレコム	7	9	15,325
パナソニック	679	459	555,051
シャープ	73	49	57,987
アンリツ	38	27	44,984
富士通ゼネラル	19	11	30,033
ソニーグループ	399	269	3,206,733
T D K	30	62	297,024
帝国通信工業	3	-	-
タムラ製作所	22	16	9,976
アルプスアルパイン	52	38	46,062
池上通信機	4	4	2,889
日本電波工業	6	3	4,449
メイコー	-	3	13,475
日本トリム	1	0.900	2,430
ローランドディー・ジー・	3	2	7,097
フォスター電機	6	4	3,323
S M K	1	1	3,052
ヨコオ	4	3	8,396
ホシデン	17	10	12,542
ヒロセ電機	9	6	112,068
日本航空電子工業	14	9	18,285
T O A	7	4	3,528
マクセル	12	8	10,423
古野電気	8	5	5,365
ユニデンホールディングス	2	0.900	3,091
スミダコーポレーション	5	4	3,356
アイコム	2	1	3,772
リオン	2	1	3,326
横河電機	63	43	78,226
新電元工業	2	1	5,072
アズビル	43	25	103,572
東亜ディーケーケー	4	3	3,100
日本光電工業	26	17	55,892
共和電業	10	7	2,804
日本電子材料	2	2	4,384
堀場製作所	12	8	52,480

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アドバンテクト	47	32	300,160
小野測器	7	6	2,946
エスパック	5	3	7,122
キーエンス	62	39	2,047,500
日置電機	3	2	13,797
シスメックス	49	36	303,212
日本マイクロニクス	11	7	12,727
メガチップス	6	4	15,220
OBARAGROUP	3	2	6,280
澤藤電機	1	1	2,914
原田工業	4	3	2,973
コーセル	7	5	4,340
イリソ電子工業	5	3	14,760
オプテックスグループ	10	7	11,402
千代田インテグレ	2	1	3,450
アイ・オー・データ機器	-	3	5,058
レーザーテック	28	18	400,113
スタンレー電気	44	30	85,514
岩崎電気	3	1	3,649
ウシオ電機	32	22	41,304
岡谷電機産業	11	9	2,855
エノモト	2	-	-
日本セラミック	6	4	9,960
遠藤照明	7	2	2,825
古河電池	4	3	3,893
双信電機	9	-	-
山一電機	4	3	5,936
図研	4	2	8,366
日本電子	11	9	58,590
カシオ計算機	51	31	40,435
ファナック	55	37	813,645
日本シイエムケイ	13	8	4,989
エンプラス	2	1	2,880
大真空	2	5	6,223
ローム	26	19	177,753
浜松ホトニクス	45	30	174,276
三井ハイテック	6	4	34,272
新光電気工業	21	12	59,913
京セラ	97	60	415,352
太陽誘電	28	20	107,635
村田製作所	187	126	1,004,157

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
双葉電子工業	10	7	4,995
北陸電気工業	4	0.100	129
ニチコン	20	13	16,673
日本ケミコン	6	4	7,785
KOA	8	6	9,191
市光工業	9	5	2,884
小糸製作所	38	23	147,500
ミツバ	11	8	3,152
SCREENホールディングス	11	7	86,700
キャノン電子	5	3	6,286
キャノン	316	213	603,839
リコー	162	119	125,236
象印マホービン	17	11	16,553
MUTOHホールディングス	2	1	3,677
東京エレクトロン	37	27	1,505,322
<b>輸送用機器(8.6%)</b>			
トヨタ紡織	18	17	38,016
芦森工業	4	3	2,986
ユニプレス	10	6	5,209
豊田自動織機	51	34	316,332
モリタホールディングス	10	6	8,604
三櫻工業	8	6	4,278
デンソー	140	94	799,258
東海理化電機製作所	16	11	17,661
川崎重工業	49	31	65,437
日本車輛製造	2	1	3,368
三菱ロジスネクスト	8	5	5,340
近畿車輛	3	3	3,198
日産自動車	751	507	303,655
いすゞ自動車	184	135	221,293
トヨタ自動車	645	2,180	4,738,226
日野自動車	79	53	58,911
三菱自動車工業	236	159	51,805
エフテック	6	5	2,740
武蔵精密工業	14	9	18,000
日産車体	9	6	4,239
新明和工業	18	12	11,407
極東開発工業	11	8	11,808
トピー工業	5	3	3,913
ティラド	3	1	3,028
曙ブレーキ工業	35	23	4,035

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
タチエス	9	7	8,587	
NOK	30	20	25,646	
フタバ産業	16	10	4,352	
K Y B	7	4	13,927	
大同メタル工業	13	8	5,278	
プレス工業	31	21	8,094	
ミクニ	15	9	3,866	
太平洋工業	13	9	9,144	
河西工業	9	10	2,995	
アイシン	46	31	137,812	
マツダ	200	135	125,778	
今仙電機製作所	5	5	3,019	
本田技研工業	501	338	1,241,051	
スズキ	126	98	479,104	
S U B A R U	182	123	243,776	
ヤマハ発動機	90	56	148,705	
T B K	9	-	-	
エクセディ	8	6	11,186	
豊田合成	20	13	31,372	
愛三工業	10	6	5,018	
ヨロズ	5	4	3,892	
エフ・シー・シー	10	7	10,213	
シマノ	23	17	460,526	
テイ・エステック	14	18	28,537	
ジャムコ	6	3	2,514	
<b>精密機器(2.6%)</b>				
テルモ	195	121	442,864	
日機装	20	12	10,087	
日本エム・ディ・エム	3	2	3,910	
島津製作所	82	55	222,708	
JMS	5	5	3,045	
長野計器	4	3	3,971	
パイ・テクノロジ	3	1	6,697	
東京計器	4	3	3,138	
愛知時計電機	1	1	3,405	
インターアクション	3	2	4,404	
オーバル	4	12	3,348	
東京精密	10	7	34,492	
マニー	25	17	27,000	
ニコン	97	65	82,125	
トプコン	32	20	30,247	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
オリンパス	352	225	523,059	
理研計器	5	3	16,607	
タムロン	5	3	7,623	
HOYA	126	84	1,257,900	
ノーリツ鋼機	5	3	6,981	
エー・アンド・デイ	5	3	3,556	
朝日インテック	67	47	108,040	
シチズン時計	80	50	25,502	
リズム	6	2	3,492	
大研医器	7	-	-	
メニコン	9	14	41,398	
松風	2	1	3,211	
セイコーホールディングス	9	6	14,298	
ニプロ	47	32	35,342	
<b>その他製品(2.4%)</b>				
スノーピーク	3	5	14,274	
パラマウントベッドホールディングス	6	8	16,517	
トランザクション	-	2	2,727	
粧美堂	10	0.200	83	
ニホンフラッシュ	5	3	3,803	
前田工織	7	4	15,157	
永大産業	14	10	3,139	
アートネイチャー	6	4	2,972	
パンダイナムコホールディングス	52	38	300,694	
アイフェイスジャパン	-	4	2,822	
共立印刷	34	21	3,504	
S H O E I	5	4	18,360	
フランスベッドホールディングス	8	5	5,032	
パイロットコーポレーション	11	7	33,908	
萩原工業	3	2	3,396	
トッパン・フォームズ	11	-	-	
フジシールインターナショナル	13	10	18,301	
タカラトミー	28	18	22,806	
広済堂ホールディングス	4	3	3,306	
プロネクサス	5	3	3,567	
ホクシン	37	-	-	
大建工業	4	2	5,577	
凸版印刷	96	65	148,654	
大日本印刷	77	50	150,256	
共同印刷	2	1	3,400	
N I S S H A	13	8	11,932	

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
TAKARA&COMPANY	3	2	3,876
アシックス	56	38	85,801
ツツミ	2	1	2,803
ローランド	3	3	12,240
小松ウオール工業	2	1	2,815
ヤマハ	37	25	139,776
河合楽器製作所	1	1	3,565
ピジョン	40	26	60,086
オリバー	1	-	-
キングジム	5	3	3,083
リンテック	13	9	24,048
イトーキ	12	7	2,836
任天堂	36	24	1,428,111
三菱鉛筆	10	7	8,875
タカラスタンダード	13	8	11,979
コクヨ	30	20	32,774
ナカバヤシ	6	5	2,991
グローブライド	3	3	9,994
オカムラ	24	14	17,360
美津濃	6	4	9,769
<b>電気・ガス業(1.2%)</b>			
東京電力ホールディングス	540	322	118,247
中部電力	195	131	149,611
関西電力	241	163	189,196
中国電力	91	67	60,906
北陸電力	58	39	21,985
東北電力	149	100	74,491
四国電力	53	38	31,583
九州電力	140	88	74,951
北海道電力	59	37	18,924
沖縄電力	12	9	12,894
電源開発	50	36	67,968
エフオン	3	2	1,393
イーレックス	9	6	10,483
レノバ	10	8	11,314
東京瓦斯	122	82	191,647
大阪瓦斯	115	78	164,658
東邦瓦斯	31	19	59,241
北海道瓦斯	3	2	3,173
広島ガス	13	8	2,861
西部ガスホールディングス	7	4	10,737

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
静岡ガス	18	11	9,464
メタウォーター	7	4	9,189
<b>陸運業(3.1%)</b>			
SBSホールディングス	4	3	9,696
東武鉄道	66	42	123,058
相鉄ホールディングス	21	13	30,870
東急	160	108	171,913
京浜急行電鉄	81	55	70,231
小田急電鉄	102	64	136,128
京王電鉄	35	22	117,744
京成電鉄	47	30	102,000
富士急行	8	5	20,757
新京成電鉄	1	1	3,049
東日本旅客鉄道	112	75	543,713
西日本旅客鉄道	56	52	265,750
東海旅客鉄道	53	35	570,294
西武ホールディングス	76	56	69,294
鴻池運輸	10	6	8,024
西日本鉄道	17	11	31,606
ハマキョウレックス	4	3	8,697
サカイ引越センター	2	2	8,950
近鉄グループホールディングス	60	40	146,064
阪急阪神ホールディングス	80	51	179,010
南海電気鉄道	28	18	43,388
京阪ホールディングス	26	18	55,783
神戸電鉄	1	1	3,410
名古屋鉄道	49	33	71,355
山陽電気鉄道	4	3	6,187
アルプス物流	-	2	3,053
日本通運	20	-	-
ヤマトホールディングス	84	57	124,820
山九	15	10	42,693
丸全昭和運輸	4	3	10,527
センコーグループホールディングス	33	20	19,176
トナミホールディングス	1	1	3,810
ニッコンホールディングス	20	13	29,852
日本石油輸送	1	0.500	1,320
福山通運	7	6	27,470
セイノーホールディングス	45	27	33,832
神奈川中央交通	1	1	3,570
日立物流	13	7	47,005

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
丸和運輸機関	12	8	9,038
C&Fロジホールディングス	6	4	5,108
九州旅客鉄道	46	31	81,144
S Gホールディングス	114	77	193,809
NIPPONEXPRESSホールディングス	-	14	103,353
<b>海運業(0.6%)</b>			
日本郵船	50	34	347,479
商船三井	35	22	207,016
川崎汽船	18	12	96,012
N S ユナイテッド海運	2	2	9,119
明治海運	-	4	4,503
飯野海運	28	18	16,310
乾汽船	4	2	7,324
<b>空運業(0.4%)</b>			
日本航空	147	93	221,127
ANAホールディングス	162	103	270,655
パスコ	1	0.700	917
<b>倉庫・運輸関連業(0.2%)</b>			
トランコム	1	1	7,942
日新	4	3	5,662
三菱倉庫	20	13	35,932
三井倉庫ホールディングス	6	4	10,296
住友倉庫	21	14	30,729
澁澤倉庫	3	2	5,335
東陽倉庫	13	9	2,962
日本トランスシティ	13	9	5,553
ケイヒン	3	-	-
中央倉庫	-	3	2,940
安田倉庫	5	3	3,237
東洋埠頭	3	2	3,183
宇徳	9	-	-
上組	33	22	49,100
キューソー流通システム	2	-	-
近鉄エクスプレス	11	7	22,707
東海運	13	9	2,987
エーアイティー	2	2	3,658
内外トランスライン	3	1	3,016
日本コンセプト	-	1	2,620
<b>情報・通信業(7.9%)</b>			
NEC ネットズエスアイ	20	14	24,612
クロスキャット	3	-	-

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
システナ	22	60	23,275
デジタルアーツ	3	2	13,800
日鉄ソリューションズ	9	6	21,533
キューブシステム	3	0.900	816
コア	2	1	2,739
ラクーンホールディングス	4	3	3,351
ソリトンシステムズ	3	-	-
ソフトクリエイトホールディングス	2	1	7,335
T I S	62	40	104,135
電算システム	2	-	-
グリーン	38	25	20,927
コーエーテックモホールディングス	12	13	53,797
三菱総合研究所	2	1	6,678
電算	1	-	-
AGS	5	3	2,692
ファンデックス	5	3	2,498
ブレインパッド	1	3	3,498
K L a b	11	7	3,064
ポルトワイン・ビットクルホールディングス	8	6	6,276
イーブックイニシアティブジャパン	1	-	-
ネクソン	158	95	239,012
アイスタイル	19	12	2,438
エムアップホールディングス	1	4	4,326
エイチーム	4	3	2,410
エニグモ	5	4	3,100
テクノスジャパン	6	5	2,464
コロプラ	20	13	8,757
ブロードリーフ	31	20	6,855
クロス・マーケティンググループ	11	-	-
デジタルハーツホールディングス	-	1	2,794
システム情報	4	3	3,528
メディアドゥ	2	1	3,640
じげん	15	11	3,546
ブイキューブ	3	4	3,259
サイバーリンクス	2	2	2,610
フィックスターズ	6	4	3,051
CARTAHOLDINGS	3	1	4,000
オプティム	4	2	2,537
セレス	2	1	1,981
SHIFT	2	2	41,832
ティーガイア	6	3	6,378

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セック	1	-	-
日本アジアグループ	6	-	-
テクマトリックス	9	7	11,054
プロシップ	2	-	-
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	15	11	32,637
GMOペイメントゲートウェイ	13	8	83,558
ザップラス	8	5	2,607
インターネットイニシアティブ	16	11	38,476
さくらインターネット	6	5	2,821
ヴェインクス	3	3	3,398
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1	0.900	3,753
S R Aホールディングス	3	2	5,726
朝日ネット	5	5	3,044
e B A S E	7	5	3,090
アバント	6	4	4,698
アドソル日進	2	1	2,721
フリービット	4	2	2,592
コムチュア	5	4	12,981
サイバーコム	2	2	2,438
アステリア	4	3	2,118
アイル	3	2	2,978
マークラインズ	2	2	5,512
メディカル・データ・ビジョン	7	5	5,379
g u m i	8	5	3,203
モバイルファクトリー	3	-	-
テラスカイ	2	1	2,427
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2	2	2,893
P R T I M E S	1	1	2,882
ラクス	-	14	24,273
ランドコンピュータ	3	3	2,992
ダブルスタンダード	0.900	1	2,360
オープンドア	3	2	4,860
アカツキ	2	1	5,287
Ub i c o mホールディングス	1	1	2,246
カナミックネットワーク	5	6	2,841
ノムラシステムコーポレーション	-	10	2,408
チェンジ	8	7	12,565
シンクロ・フード	11	8	2,270
オークネット	3	2	3,379
キャピタル・アセット・プランニング	-	4	3,184
AOITYHOLDINGS	9	-	-

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マクロミル	12	8	10,130
ビーグリー	-	1	2,228
オロ	2	1	3,135
ユーザーローカル	1	1	2,502
マネーフォワード	-	6	28,704
電算システムホールディングス	-	1	4,683
プロトコーポレーション	5	4	5,530
ハイマックス	3	2	3,291
野村総合研究所	114	81	308,856
サイバネットシステム	4	4	2,633
C Eホールディングス	6	6	2,963
インテージホールディングス	7	5	9,322
東邦システムサイエンス	4	2	2,679
ソースネクスト	29	18	2,821
インフォコム	5	4	9,250
シンプレクス・ホールディングス	-	4	7,015
H E R O Z	1	2	2,042
ラクスル	5	4	14,076
F I G	16	8	2,388
イーソル	3	4	2,361
アルテリア・ネットワークス	6	5	6,953
E D U L A B	0.600	-	-
ウイングアーク1 s t	-	2	2,908
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2	-	-
サーバーワークス	-	0.900	2,071
トビラシステムズ	3	3	3,042
S a n s a n	-	15	14,730
ギフトィ	2	3	3,169
ベース	-	0.700	3,486
J M D C	-	4	21,920
フォーカスシステムズ	4	3	2,697
クレスコ	4	3	5,499
フジ・メディア・ホールディングス	64	40	51,078
オービック	19	13	234,878
ジャストシステム	8	6	31,980
T D Cソフト	5	3	4,088
Zホールディングス	859	614	342,489
トレンドマイクロ	33	22	133,114
I Dホールディングス	3	3	2,801
日本オラクル	12	8	69,918
アルファシステムズ	1	1	4,086

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
フューチャー	7	8	11,819	
CACHoldings	4	2	3,242	
S Bテクノロジー	2	1	4,530	
トーセ	5	4	3,019	
オービックビジネスコンサルタント	6	4	16,620	
伊藤忠テクノソリューションズ	28	19	55,814	
アイティフォー	8	5	3,972	
東計電算	1	0.600	2,985	
大塚商会	33	22	97,096	
サイボウズ	7	5	7,207	
電通国際情報サービス	7	6	22,661	
ACCESS	5	4	2,788	
デジタルガレージ	10	7	27,335	
イーエムシステムズ	10	7	4,942	
ウェザーニューズ	1	1	9,880	
C I J	4	3	2,747	
ビジネスエンジニアリング	1	0.800	2,872	
日本エンタープライズ	17	16	2,769	
WOWOW	3	2	3,496	
スカラ	5	4	2,948	
IMAGI CAGROUP	10	-	-	
ネットワンシステムズ	25	16	44,291	
システムソフト	44	-	-	
アルゴグラフィックス	4	3	10,477	
マーベラス	9	6	4,917	
エイベックス	10	7	9,957	
日本ユニシス	21	13	40,062	
兼松エレクトロニクス	3	2	8,958	
都築電気	2	2	3,047	
TBSホールディングス	41	25	48,547	
日本テレビホールディングス	52	35	46,878	
朝日放送グループホールディングス	6	4	3,183	
テレビ朝日ホールディングス	19	10	15,983	
スカパーJ SATホールディングス	41	35	15,895	
テレビ東京ホールディングス	4	3	6,360	
日本BS放送	3	2	2,769	
ビジョン	7	7	8,308	
USEN-NEXTHOLDINGS	2	4	9,296	
コネクシオ	3	3	4,173	
日本通信	55	35	6,072	
日本電信電話	731	441	1,471,527	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
KDDI	501	308	1,168,244	
ソフトバンク	568	639	941,785	
光通信	7	5	70,950	
エムティーアイ	6	4	2,275	
GMOインターネット	22	15	36,945	
ファイバーゲート	2	2	3,230	
アドマーケティングコミュニケーション	9	10	3,013	
KADOKAWA	16	23	57,957	
学研ホールディングス	8	6	6,006	
ゼンリン	11	6	7,410	
インプレスホールディングス	22	13	2,727	
アイネット	3	2	2,783	
松竹	4	2	32,704	
東宝	36	24	118,897	
東映	2	1	23,968	
エヌ・ティ・ティ・データ	166	112	239,962	
ピー・シー・エー	0.900	2	3,550	
ビジネスブレイン太田昭和	2	1	2,251	
DT S	13	8	22,080	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	26	19	109,138	
シーイーシー	6	4	4,905	
カプコン	26	39	112,196	
アイ・エス・ビー	3	2	2,842	
ジャストテック	4	2	3,036	
SCSK	14	29	55,859	
日本システムウエア	2	1	3,340	
アイネス	6	3	5,798	
TKC	5	7	21,584	
富士ソフト	6	4	24,885	
NSD	20	13	29,063	
コナミホールディングス	22	15	104,346	
福井コンピュータホールディングス	2	1	5,776	
J BCCホールディングス	4	2	4,193	
ミロク情報サービス	6	3	5,165	
ソフトバンクグループ	496	253	1,307,028	
<b>卸売業(5.8%)</b>				
オルパヘルスケアホールディングス	2	2	3,056	
伊藤忠食品	1	1	5,030	
エレマテック	5	3	3,627	
JALUX	-	1	3,069	
あらた	5	3	13,260	



## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	千円
	千株	千株	千円	千円
トーメンデバイス	1	0.600	3,708	
東京エレクトロンデバイス	2	1	6,968	
双日	346	46	91,634	
アルフレッサホールディングス	65	47	82,519	
横浜冷凍	16	11	10,317	
ラサ商事	4	3	3,042	
アルコニックス	6	5	7,123	
神戸物産	43	32	124,033	
ハイパー	-	5	2,618	
あいホールディングス	9	6	10,870	
ディーブイエックス	4	2	2,934	
ダイワボウホールディングス	5	20	36,462	
マクニカ・富士エレホールディングス	15	10	26,593	
ラクト・ジャパン	2	1	3,058	
グリムス	1	1	4,039	
バイタルケーエスケーホールディングス	10	7	5,979	
八洲電機	4	3	2,963	
メディアスホールディングス	5	3	2,824	
レスターホールディングス	6	4	7,908	
ジュテックホールディングス	4	2	3,321	
OCHIホールディングス	3	2	3,121	
TOKAIホールディングス	30	20	18,593	
Cominix	5	4	2,980	
三洋貿易	6	4	4,368	
ビューティガレージ	1	-	-	
ウイン・パートナーズ	4	3	3,236	
シップヘルスケアホールディングス	11	13	31,293	
明治電機工業	2	2	2,505	
コメダホールディングス	13	9	19,799	
アセンテック	2	3	2,166	
協栄産業	3	1	2,670	
フルサト・マルカホールディングス	-	4	9,635	
ヤマエグループホールディングス	-	2	2,951	
小野建	5	4	6,650	
南陽	-	1	3,116	
佐鳥電機	5	-	-	
伯東	3	2	6,117	
コンドーテック	4	3	3,369	
中山福	7	8	3,523	
ナガイレーベン	8	5	12,012	
三菱食品	6	4	12,915	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	千円
	千株	千株	千円	千円
松田産業	4	3	7,049	
第一興商	9	8	28,880	
メディパルホールディングス	62	45	95,905	
S P K	3	2	2,742	
萩原電気ホールディングス	2	1	3,339	
アズワン	4	6	40,626	
スズデン	3	1	3,468	
シモジマ	3	2	2,659	
ドウシシャ	5	4	6,188	
小津産業	2	1	3,007	
高速	3	2	3,802	
丸文	7	3	2,634	
ハピネット	5	3	5,561	
橋本総業ホールディングス	1	1	3,012	
日本ライフライン	20	12	13,066	
マルカ	2	-	-	
I DOM	21	12	8,475	
進和	3	2	5,062	
ダイトロン	2	1	3,220	
シークス	8	6	6,893	
田中商事	6	4	3,022	
オーハシテクニカ	3	2	3,137	
白銅	3	1	3,574	
ダイコー通産	2	-	-	
伊藤忠商事	439	296	1,136,781	
丸紅	619	418	517,104	
高島	2	-	-	
長瀬産業	35	23	43,244	
蝶理	4	2	4,274	
豊田通商	63	42	214,704	
三共生興	9	5	3,197	
兼松	25	15	22,230	
三井物産	509	329	1,012,597	
日本紙パルプ商事	3	2	9,152	
カメイ	8	5	5,210	
OUGホールディングス	1	1	2,993	
スターゼン	2	3	6,584	
山善	24	17	18,156	
椿本興業	1	0.900	3,703	
住友商事	396	267	508,172	
内田洋行	2	1	8,730	

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱商事	382	317	1,290,179
第一実業	2	1	8,189
キャノンマーケティングジャパン	15	10	25,893
西華産業	3	2	3,526
佐藤商事	5	3	4,287
菱洋エレクトロ	4	2	5,340
東京産業	6	3	2,722
ユアサ商事	6	4	11,944
神鋼商事	2	0.900	3,465
阪和興業	12	8	27,837
正栄食品工業	4	2	11,245
カナデン	5	3	3,451
菱電商事	4	3	5,987
フルサト工業	3	-	-
岩谷産業	15	10	54,672
ナイス	-	1	3,124
昭光通商	6	-	-
極東貿易	-	1	2,692
アステナホールディングス	8	6	2,579
三愛石油	15	10	9,703
稲畑産業	15	9	23,157
明和産業	9	3	4,344
ヤマエ久野	4	-	-
ワキタ	12	9	9,000
東邦ホールディングス	20	13	25,486
サンゲツ	16	11	17,684
ミツウロコグループホールディングス	9	6	6,466
シナネンホールディングス	2	1	5,272
伊藤忠エネクス	13	9	9,635
サンリオ	17	13	31,793
サンワテクノス	4	2	3,507
リョーサン	6	4	10,889
新光商事	8	6	5,868
トーホー	2	2	2,652
三信電気	3	2	3,390
東陽テクニカ	6	4	4,498
モスフードサービス	8	5	16,884
加賀電子	5	3	11,951
ソーダニッカ	7	4	3,263
立花エレテック	4	3	5,399
フォーバル	5	3	2,694

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
PALTAC	10	5	26,255
三谷産業	9	9	2,961
西本Wismettacホールディングス	-	1	2,815
国際紙パルプ商事	17	9	3,375
ヤマタネ	3	2	3,250
丸紅建材リース	2	1	2,992
日鉄物産	4	3	15,990
泉州電業	1	1	7,512
トラスコ中山	14	8	22,290
オートバックスセブン	23	14	20,434
モリト	6	4	2,997
加藤産業	9	6	19,062
イノテック	3	2	3,715
イエローハット	11	7	12,047
J Kホールディングス	5	3	3,600
日伝	5	3	7,822
北沢産業	15	12	2,887
杉本商事	3	2	4,312
因幡電機産業	16	11	29,617
東テク	2	1	3,409
ミスミグループ本社	78	53	191,786
タキヒヨー	2	1	2,422
蔵王産業	3	1	2,833
スズケン	26	16	59,843
ジェコス	4	3	2,980
<b>小売業(4.3%)</b>			
ローソン	15	9	45,637
サンエー	4	3	13,120
カワチ薬品	4	3	7,939
エービーシー・マート	9	6	34,452
ハードオフコーポレーション	5	4	3,280
アスクル	5	6	11,674
ゲオホールディングス	8	5	8,618
アダストリア	8	4	7,999
ジーフット	10	-	-
くら寿司	3	4	16,698
キャンドウ	3	2	4,132
アイケイ	-	7	2,978
バルグループホールディングス	5	3	5,912
エディオン	26	19	23,283
サーラコーポレーション	12	8	5,529

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ハローズ	2	1	5,249
フジオフードグループ本社	5	3	4,741
あみやき亭	1	1	3,020
大黒天物産	1	1	6,566
ハニーズホールディングス	5	3	3,485
アルペン	4	3	6,851
ハブ	-	4	2,736
クオールホールディングス	8	5	6,718
ジンズホールディングス	3	2	18,937
ビックカメラ	37	25	25,376
DCMホールディングス	38	26	29,003
MonotaRO	44	53	117,384
東京一番フーズ	7	5	3,054
きちりホールディングス	7	-	-
アークランドサービスホールディングス	5	3	6,987
J. フロントリテイリング	75	50	52,118
ドトール・日レスホールディングス	9	7	11,723
マツキヨココカラ&カンパニー	26	26	118,102
ブロンコピリー	3	2	5,378
ZOZO	37	29	95,776
トレジャー・ファクトリー	5	3	2,941
物語コーポレーション	1	2	15,272
ココカラファイン	5	-	-
三越伊勢丹ホールディングス	109	74	71,751
Hamee	2	0.300	340
ウエルシアホールディングス	33	22	69,216
クリエイトSDホールディングス	9	6	19,719
丸善CHIホールディングス	11	8	3,124
ミサワ	5	4	2,717
ティーライフ	3	2	2,961
チムニー	3	-	-
シュッピン	4	3	3,976
オイシックス・ラ・大地	6	6	15,957
ネクステージ	10	8	22,170
ジョイフル本田	18	12	19,294
鳥貴族ホールディングス	2	-	-
ホットランド	4	3	4,208
すかいらーくホールディングス	70	54	81,776
SFPホールディングス	2	2	2,971
綿半ホールディングス	4	3	4,227
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	18	12	13,001

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゴルフダイジェスト・オンライン	4	2	2,776
BEENOS	2	2	3,070
あさひ	4	3	4,571
日本調剤	3	2	3,590
コスモス薬品	6	4	67,768
オンリー	9	-	-
セブン&アイ・ホールディングス	245	165	949,943
クワイエット・レストランズ・ホールディングス	33	22	16,611
ツルハホールディングス	13	9	84,640
サンマルクホールディングス	5	3	5,382
フェリシモ	3	2	2,604
トリドールホールディングス	15	10	27,037
TOKYOBASE	9	4	2,165
ウイルプラスホールディングス	-	3	2,712
JMホールディングス	4	2	5,167
アレンザホールディングス	3	3	3,382
パロックジャパンリミテッド	5	3	2,975
クスリのアオキホールディングス	6	4	29,232
FOOD&LIFECOMPANIES	34	24	93,124
メディカルシステムネットワーク	7	5	2,616
ノジマ	11	6	17,595
カッパ・クリエイト	8	5	8,118
ライトオン	6	3	2,776
良品計画	83	48	86,083
アドヴァングループ	6	4	4,042
アルビス	2	1	3,101
コナカ	13	9	3,177
G-7ホールディングス	3	4	7,933
イオン北海道	8	7	8,580
コジマ	10	7	4,007
ヒマラヤ	4	3	3,103
コーナン商事	8	6	22,020
エコス	2	1	3,126
ワタミ	8	5	4,850
マルシェ	8	-	-
パ・パフィカ・インターナショナルホールディングス	125	84	159,084
西松屋チェーン	13	9	12,610
ゼンショーホールディングス	33	20	56,076
幸楽苑ホールディングス	4	2	3,852
サイゼリヤ	9	6	18,225
VTホールディングス	23	16	7,856

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フジ・コーポレーション	－	2	3,060
ユナイテッドアローズ	7	4	7,792
ハイデイ日高	9	6	10,498
YU-WACREATIONHOLDINGS	19	14	2,974
コロワイド	20	17	30,154
ピーシーデポコーポレーション	7	9	2,735
壱番屋	4	3	13,845
スギホールディングス	12	8	54,485
薬王堂ホールディングス	2	2	5,065
スクロール	9	6	6,077
ヨンドシーホールディングス	5	3	6,727
木曾路	8	5	12,443
S R S ホールディングス	7	5	4,773
千趣会	－	7	2,864
リテールパートナーズ	7	5	5,997
ケーヨー	11	7	6,856
上新電機	7	4	10,231
日本瓦斯	10	20	35,802
ロイヤルホールディングス	11	7	14,242
東天紅	4	3	2,948
いなげや	7	5	7,388
島忠	4	－	－
チヨダ	6	4	3,075
ライフコーポレーション	4	4	11,832
リンガーハット	7	5	11,554
Mr Max HD	8	5	3,201
テンアライド	12	－	－
AOKIホールディングス	12	8	5,002
オークワ	9	6	6,418
コメリ	9	6	18,044
青山商事	14	8	6,494
しまむら	7	4	49,392
はせがわ	14	－	－
高島屋	45	30	35,874
松屋	13	8	6,120
エイチ・ツー・オーリテイリング	29	20	17,366
近鉄百貨店	2	1	4,147
丸井グループ	53	33	76,849
アクシアルリテイリング	5	3	10,840
イオン	241	163	426,343
イズミ	12	7	24,640

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
平和堂	11	7	15,545
フジ	7	5	10,704
ヤオコー	7	4	31,536
ゼビオホールディングス	7	5	5,498
ケーズホールディングス	55	39	48,992
日産東京販売ホールディングス	－	13	3,078
GenkyDrugStores	2	1	7,087
ナルミヤ・インターナショナル	－	3	3,171
ブックオフグループホールディングス	4	2	2,987
アインホールディングス	9	6	40,114
元気寿司	1	1	3,120
ヤマダホールディングス	210	155	62,930
アークランドサカモト	9	6	10,190
ニトリホールディングス	24	16	277,620
グルメ杵屋	4	3	3,549
愛眼	18	17	3,145
吉野家ホールディングス	20	14	35,446
松屋フーズホールディングス	3	2	7,300
サガミホールディングス	8	6	7,936
関西フードマーケット	4	3	3,545
王将フードサービス	4	2	16,912
プレナス	7	4	9,381
ミニストップ	4	3	4,445
アークス	12	8	17,755
パローホールディングス	12	9	20,623
ベルク	3	1	10,089
大庄	4	－	－
ファーストリテイリング	8	5	367,137
サンドラッグ	23	15	50,880
サックスパーホールディングス	7	5	2,912
ヤマザワ	－	1	2,988
やまや	1	1	3,076
ベルーナ	13	9	6,615
<b>銀行業(5.5%)</b>			
島根銀行	6	5	3,052
じもとホールディングス	5	4	3,205
めぶきフィナンシャルグループ	326	220	61,988
東京きらぼしフィナンシャルグループ	7	5	10,992
九州フィナンシャルグループ	128	86	35,893
ゆうちょ銀行	178	100	101,602
富山第一銀行	15	10	3,264

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
コンソルディア・フィナンシャルグループ	383	242	118,825	
西日本フィナンシャルホールディングス	41	27	23,351	
関西みらいフィナンシャルグループ	29	-	-	
三十三フィナンシャルグループ	5	3	5,935	
第四北越フィナンシャルグループ	10	6	18,650	
ひろぎんホールディングス	92	62	42,881	
おきなわフィナンシャルグループ	-	3	9,165	
十六フィナンシャルグループ	-	5	13,833	
北國フィナンシャルホールディングス	-	3	12,909	
新生銀行	51	27	59,887	
あおぞら銀行	37	23	64,203	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,301	2,662	1,968,001	
りそなホールディングス	683	486	260,836	
三井住友トラスト・ホールディングス	118	80	333,887	
三井住友フィナンシャルグループ	435	293	1,257,010	
千葉銀行	209	141	109,675	
群馬銀行	129	81	32,476	
武蔵野銀行	9	6	12,152	
千葉興業銀行	17	11	3,229	
筑波銀行	26	-	-	
七十七銀行	19	13	20,694	
青森銀行	4	3	6,369	
秋田銀行	3	2	4,687	
山形銀行	7	4	4,795	
岩手銀行	4	2	5,457	
東邦銀行	56	35	7,894	
みちのく銀行	4	3	3,311	
ふくおかフィナンシャルグループ	56	35	85,311	
静岡銀行	153	103	93,060	
十六銀行	7	-	-	
スルガ銀行	55	37	16,777	
八十二銀行	141	95	42,064	
山梨中央銀行	7	4	4,429	
大垣共立銀行	12	8	17,262	
福井銀行	5	3	5,313	
北國銀行	5	-	-	
清水銀行	2	1	3,114	
富山銀行	1	1	3,865	
滋賀銀行	12	8	18,096	
南都銀行	9	6	14,051	
百五銀行	56	40	14,647	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
京都銀行	22	15	84,816	
紀陽銀行	22	14	22,334	
ほくほくフィナンシャルグループ	41	26	25,625	
山陰合同銀行	39	25	17,337	
中国銀行	54	33	30,815	
鳥取銀行	3	1	2,012	
伊予銀行	83	56	35,750	
百十四銀行	6	4	8,064	
四国銀行	8	6	5,265	
阿波銀行	9	6	15,047	
大分銀行	3	2	4,900	
宮崎銀行	3	2	6,064	
佐賀銀行	3	2	3,758	
沖縄銀行	5	-	-	
琉球銀行	13	9	7,912	
セブン銀行	210	126	31,146	
みずほフィナンシャルグループ	854	543	864,456	
山口フィナンシャルグループ	78	49	36,432	
長野銀行	3	2	3,175	
名古屋銀行	5	3	10,000	
北洋銀行	94	64	17,152	
愛知銀行	2	1	7,237	
中京銀行	2	1	2,943	
大光銀行	3	2	3,397	
愛媛銀行	8	5	5,787	
京葉銀行	26	18	9,412	
栃木銀行	30	20	4,776	
北日本銀行	2	1	3,309	
東和銀行	11	7	4,321	
トモニホールディングス	48	32	11,611	
フィデアホールディングス	61	3	5,506	
池田泉州ホールディングス	72	48	9,223	
<b>証券、商品先物取引業(0.8%)</b>				
F P G	19	14	12,512	
ジャパンインベストメントアドバイザー	3	3	3,785	
S B Iホールディングス	77	52	159,558	
ジャフコグループ	9	16	27,669	
大和証券グループ本社	470	318	219,865	
野村ホールディングス	960	648	348,926	
岡三証券グループ	53	33	13,059	
丸三証券	18	12	6,892	

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	千株	千円
東洋証券	27	15	2,433	
東海興フィナンシャル・ホールディングス	67	48	20,496	
光世証券	6	6	2,903	
水戸証券	16	11	3,164	
いちよし証券	12	7	5,237	
松井証券	30	20	16,993	
マネックスグループ	56	34	17,715	
極東証券	8	5	4,400	
岩井コスモホールディングス	6	4	5,664	
アイザワ証券グループ	11	7	6,286	
スパークス・グループ	29	19	5,115	
<b>保険業(2.3%)</b>				
かんぽ生命保険	77	42	88,773	
SOMPOホールディングス	110	69	372,128	
アニコムホールディングス	17	13	10,010	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	152	95	379,086	
第一生命ホールディングス	332	209	551,446	
東京海上ホールディングス	208	139	983,213	
T&Dホールディングス	187	110	195,164	
アドバンスクリエイト	1	2	2,407	
<b>その他金融業(1.2%)</b>				
全国保証	16	10	48,783	
ジェイリース	-	1	2,610	
イントラスト	5	3	1,943	
アルヒ	9	6	6,438	
プレミアグループ	2	2	8,736	
クレディセゾン	36	27	37,046	
芙蓉総合リース	6	4	34,650	
みずほリース	9	6	20,930	
東京センチュリー	14	8	46,740	
日本証券金融	26	16	15,130	
アイフル	105	71	25,845	
リコーリース	4	3	14,421	
イオンフィナンシャルサービス	38	23	28,644	
アコム	126	83	27,067	
ジャックス	6	4	15,345	
オリエントコーポレーション	170	114	14,247	
日立キャピタル	14	-	-	
オリックス	390	257	610,470	
三菱HCキャピタル	141	156	96,275	
九州リースサービス	6	5	3,010	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	千株	千円
日本取引所グループ	169	107	235,693	
イー・ギャランティ	7	6	12,889	
アサクス	5	4	2,885	
NECキャピタルソリューション	2	1	3,706	
<b>不動産業(2.0%)</b>				
いちご	70	47	13,196	
日本駐車場開発	62	46	6,477	
スター・マイカ・ホールディングス	3	2	2,849	
SREホールディングス	-	1	3,590	
ADワークスグループ	26	19	2,707	
ヒューリック	133	101	108,193	
三栄建築設計	2	1	2,745	
野村不動産ホールディングス	38	22	62,524	
三重交通グループホールディングス	12	8	4,042	
サムティ	8	6	14,511	
ディア・ライフ	9	5	2,843	
コーセーアールイー	6	4	2,365	
地主	4	2	4,814	
プレサンスコーポレーション	10	5	10,274	
日本管理センター	3	2	2,963	
サンセイランディック	5	0.200	161	
エストラスト	5	4	2,592	
フージャースホールディングス	10	5	3,731	
オープンハウスグループ	19	13	67,500	
東急不動産ホールディングス	171	125	83,066	
飯田グループホールディングス	52	35	77,667	
イーグランド	5	1	2,604	
ムゲンエステート	9	6	2,928	
ファーストブラザーズ	-	3	2,696	
AndDoホールディングス	3	3	2,912	
ケイアイスター不動産	2	1	9,500	
グッドコムアセット	3	2	3,067	
ジェイ・エス・ビー	-	0.700	2,247	
パーク24	33	22	40,310	
三井不動産	286	193	501,908	
三菱地所	413	279	505,966	
平和不動産	10	7	29,090	
東京建物	62	41	76,090	
ダイビル	16	10	23,716	
京阪神ビルディング	10	6	9,939	
住友不動産	141	89	324,234	

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	評価額
	千株	千株	千円	千円
テーオーシー	12	7	5,282	
東京楽天地	1	0.700	2,772	
レオパレス21	52	44	9,460	
スターツコーポレーション	7	5	14,819	
フジ住宅	7	4	3,229	
空港施設	8	5	3,024	
ゴールドクレスト	5	3	6,128	
エスリード	1	1	3,193	
日神グループホールディングス	10	6	3,505	
日本エスコン	11	7	5,988	
タカラレーベン	26	17	5,696	
A V A N T I A	4	3	2,845	
イオンモール	31	21	35,358	
毎日コムネット	6	-	-	
ファースト住建	3	2	2,992	
カチタス	15	10	34,230	
トーセイ	8	5	6,354	
穴吹興産	2	1	2,940	
サンフロンティア不動産	7	5	6,372	
FJネクストホールディングス	6	4	4,187	
グランディハウス	10	6	3,489	
日本空港ビルデング	20	16	89,910	
<b>サービス業(5.6%)</b>				
日本工営	3	2	7,190	
L I F U L L	21	12	3,011	
ミクシィ	11	9	21,056	
ジェイエイシーリクルートメント	4	3	5,897	
日本M&Aセンターホールディングス	49	67	113,805	
メンバーズ	1	1	3,452	
UTグループ	8	5	20,148	
アイティメディア	2	1	2,984	
タケエイ	6	-	-	
夢真ビーネックスグループ	7	10	16,895	
コシダカホールディングス	14	11	6,985	
アルトナー	4	3	3,062	
パソナグループ	6	4	11,056	
C D S	3	1	2,896	
リンクアンドモチベーション	11	9	3,940	
G C A	8	-	-	
エス・エム・エス	20	14	42,910	
サニーサイドアップグループ	6	4	2,924	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	評価額
	千株	千株	千円	千円
パーソルホールディングス	60	41	102,873	
リニカル	5	-	-	
クックパッド	19	12	3,276	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6	4	2,891	
学情	3	2	2,900	
スタジオアリス	3	1	3,951	
シミックホールディングス	3	2	3,470	
N J S	2	1	3,013	
総合警備保障	24	16	69,454	
カカクコム	45	30	77,100	
アイロムグループ	2	1	3,438	
セントケア・ホールディング	4	3	3,190	
ルネサンス	4	2	3,152	
ディップ	9	7	24,912	
デジタルホールディングス	4	2	4,500	
新日本科学	7	5	7,690	
ツクイホールディングス	14	-	-	
ベネフィット・ワン	22	15	36,825	
エムスリー	107	72	290,472	
ツカダ・グローバルホールディング	15	10	3,302	
アウトソーシング	34	23	30,916	
ウェルネット	8	6	2,905	
ワールドホールディングス	2	1	3,323	
ディー・エヌ・エー	25	15	27,223	
博報堂DYホールディングス	84	57	86,981	
ぐるなび	10	6	2,870	
タカミヤ	7	-	-	
ジャパンベストレスキューシステム	5	-	-	
ファンコミュニケーションズ	16	10	4,243	
ライク	2	-	-	
ビジネス・ブレークスルー	9	7	3,024	
エスプール	15	11	11,426	
W D Bホールディングス	2	1	5,069	
手間いらず	-	0.600	2,982	
アドウェイズ	7	6	3,916	
バリユーコマース	4	3	10,640	
インフォマート	61	45	27,871	
J Pホールディングス	17	12	2,757	
E P Sホールディングス	8	-	-	
C Lホールディングス	2	2	2,167	
プレステージ・インターナショナル	22	15	10,780	

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アミューズ	3	2	4,615
ドリームインキュベータ	3	1	4,810
クイック	3	2	4,418
TAC	16	13	3,028
ケネディクス	17	-	-
電通グループ	68	42	203,732
ぴあ	1	1	4,550
イオンファンタジー	2	1	3,332
シーティーエス	6	4	3,716
ネクシィーズグループ	4	4	2,459
H. U. グループホールディングス	17	10	32,528
アルプス技研	5	3	7,038
日本空調サービス	6	4	3,388
オリエンタルランド	64	48	1,028,133
ダスキン	14	9	26,353
明光ネットワークジャパン	7	5	3,015
ファルコホールディングス	2	2	4,012
秀英予備校	9	7	3,081
ラウンドワン	20	11	15,076
リゾートトラスト	27	18	37,251
ビー・エム・エル	7	5	17,304
りらいあコミュニケーションズ	9	6	6,386
リソー教育	30	18	7,332
早稲田アカデミー	4	2	2,802
ユー・エス・エス	68	46	90,309
東京個別指導学院	6	4	2,932
サイバーエージェント	37	101	151,187
楽天グループ	283	211	204,115
クリーク・アンド・リバー社	3	2	3,678
モーニングスター	-	7	4,161
テー・オー・ダブリュー	15	9	2,791
山田コンサルティンググループ	4	2	3,000
セントラルスポーツ	2	1	3,613
フルキャストホールディングス	5	3	7,955
エン・ジャパン	10	6	19,232
テクノプロ・ホールディングス	12	24	81,303
インターワークス	11	7	2,790
アイ・アールジャパンホールディングス	2	1	6,992
Keeper 技研	3	2	5,673
三機サービス	4	2	2,929
Gunosy	5	2	2,317
イー・ガーディアン	2	1	4,309
リブセンス	17	17	2,992
ジャパンマテリアル	18	12	21,772
ベクトル	7	5	6,368

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ウチヤマホールディングス	12	9	3,078
チャーム・ケア・コーポレーション	4	3	3,298
キャリアリンク	2	2	3,261
IBJ	5	3	2,696
アサンテ	2	1	2,809
N・フィールド	5	-	-
バリューHR	2	1	3,939
M&Aキャピタルパートナーズ	5	3	16,847
ライドオンエクスプレスホールディングス	2	1	2,608
ERIホールディングス	6	-	-
アビスト	1	1	2,911
シグマクス・ホールディングス	3	2	5,072
ウィルグループ	4	3	3,618
メドピア	2	3	9,072
リクルートホールディングス	436	317	1,473,223
エラン	8	5	5,352
日本郵政	460	537	520,718
バルシステム24ホールディングス	10	5	8,077
鎌倉新書	6	4	2,410
SMN	5	4	2,732
一蔵	12	-	-
LITALICO	2	-	-
エアトリ	3	2	8,653
アトラエ	1	2	5,727
ストライク	2	1	6,952
ソラスト	14	10	10,392
セラク	2	-	-
インソース	5	4	7,656
バイカレント・コンサルティング	4	2	123,830
OrchestraHoldings	-	0.800	2,168
MS-Japan	3	3	2,608
グレイステクノロジー	3	-	-
シャオエレベーターサービスホールディングス	17	13	19,318
グリーンズ	9	-	-
GAMEWITH	-	6	2,963
ウェルビー	-	2	3,213
ミダックホールディングス	1	1	4,181
日総工産	5	3	2,883
キュービネットホールディングス	3	1	3,233
RPAホールディングス	7	8	2,879
スプリックス	5	-	-
マネジメントソリューションズ	3	2	6,150
プロレド・パートナーズ	1	2	2,192
andfactory	5	7	3,017
カープスホールディングス	16	11	7,898



## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フォーラムエンジニアリング	－	3	3,159
ダイレクトマーケティングミックス	2	4	7,012
ポピンズホールディングス	－	1	2,247
L I T A L I C O	－	3	9,471
リログループ	33	22	38,520
東祥	3	3	5,294
T R Eホールディングス	－	5	8,562
人・夢・技術グループ	－	1	3,022
エイチ・アイ・エス	8	9	18,509
ラックランド	1	1	3,384
共立メンテナンス	10	7	32,083
イチネンホールディングス	6	4	5,464
建設技術研究所	3	2	5,800
スペース	5	3	3,024
燦ホールディングス	3	－	－
東京テアトル	3	2	2,968
タナベ経営	3	4	2,824
ナガワ	1	1	12,584
東京都競馬	4	3	12,555
カナモト	10	7	16,617
東京ドーム	24	－	－
西尾レントオール	5	3	10,681
トランス・コスモス	5	5	16,406
乃村工藝社	26	17	16,649
藤田観光	－	1	4,318
KNT-CTホールディングス	－	2	3,913
日本管財	6	4	12,320
トーカイ	5	3	6,732

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セコム	60	40	354,132
セントラル警備保障	2	2	4,720
丹青社	11	8	6,106
メイテック	7	5	34,750
応用地質	7	4	9,503
船井総研ホールディングス	12	8	18,328
進学会ホールディングス	8	10	3,905
学究社	3	1	3,123
ベネッセホールディングス	22	13	32,304
イオンディライト	7	5	15,504
ナック	4	3	3,053
ダイセキ	10	7	33,150
ステップ	2	1	2,953
合計	株数・金額	66,696	47,173 112,497,641
	銘柄数<比率>	1,853	1,840 <96.1%>

(注1) 銘柄欄の( )内は、当期末における国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

### (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国	百万円	百万円
内 TOPIX	4,378	－

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2022年2月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	112,497,641	95.9
コール・ローン等、その他	4,842,548	4.1
投資信託財産総額	117,340,189	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月21日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>117,322,043,462円</b>
コール・ローン等	4,404,203,781
株式(評価額)	112,497,641,670
未収配当金	174,543,011
差入委託証拠金	245,655,000
<b>(B)負債</b>	<b>261,046,172</b>
未払金	84,335,950
未払解約金	176,705,800
その他未払費用	4,422
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>117,060,997,290</b>
元本	54,493,461,224
次期繰越損益金	62,567,536,066
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>54,493,461,224口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>21,482円</b>

(注1) 期首元本額 79,813,755,893円  
 期中追加設定元本額 23,632,095,039円  
 期中一部解約元本額 48,952,389,708円

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

ニッセイTOPIXオープン	5,837,157,491円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	3,537,763,643円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,656,374円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,113,704,346円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,082,250,932円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,253,789,188円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	4,978,524円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	16,544,754円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	16,615,142円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,071,087,533円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	21,344,932,487円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	2,132,535,408円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	201,061,345円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	208,072,492円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	241,020,671円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	473,144,628円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	49,277,264円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	98,857,796円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,457,971円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	10,013,941円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	4,293,106円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	6,605,585円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	26,854,982円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	136,468,048円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	100,987,893円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	224,574,567円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	205,595,072円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	4,063,776,492円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型/スケット)	19,506,730円
ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(安定型)	80,115円
ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(積極型)	166,146円
FWニッセイ国内株インデックス	485,273円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	145,285円

### 損益の状況

当期(2021年2月23日~2022年2月21日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>3,131,277,457円</b>
受取配当金	3,132,392,288
受取利息	71,510
その他収益	929,647
支払利息	△ 2,115,988
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>189,595,162</b>
売買益	14,642,750,879
売買損	△ 14,453,155,717
<b>(C)先物取引等損益</b>	<b>7,511,400</b>
取引益	595,388,800
取引損	△ 587,877,400
<b>(D)信託報酬等</b>	<b>△ 95,813</b>
<b>(E)当期損益金(A+B+C+D)</b>	<b>3,328,288,206</b>
<b>(F)前期繰越損益金</b>	<b>90,480,120,612</b>
<b>(G)追加信託差損益金</b>	<b>28,088,108,591</b>
<b>(H)解約差損益金</b>	<b>△ 59,328,981,343</b>
<b>(I)合計(E+F+G+H)</b>	<b>62,567,536,066</b>
<b>次期繰越損益金(I)</b>	<b>62,567,536,066</b>

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

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

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

# ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 30 期

(計算期間：2022年5月21日～2022年11月21日)

#### 運用方針

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

#### 主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

#### 運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

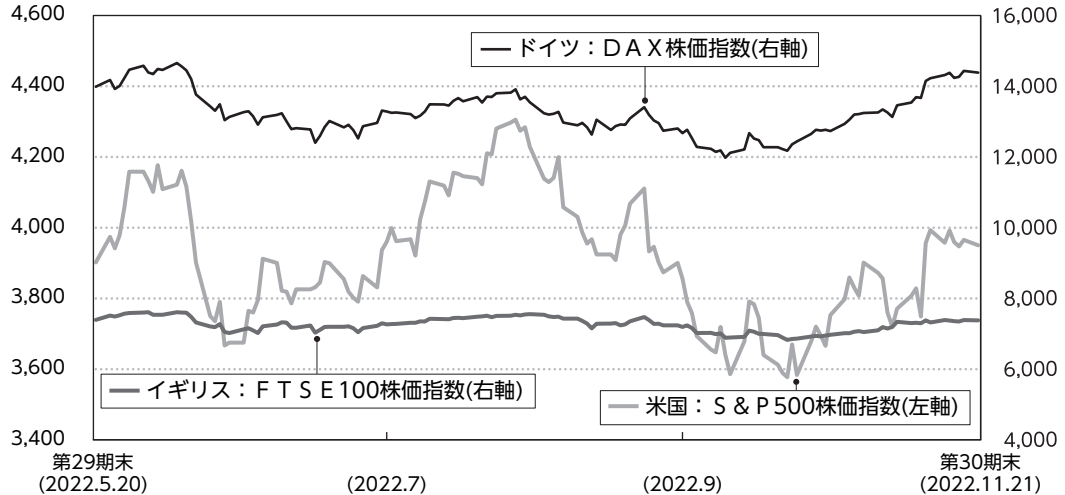
## 運用経過

2022年5月21日～2022年11月21日

## 投資環境

## ■ 海外株式市況

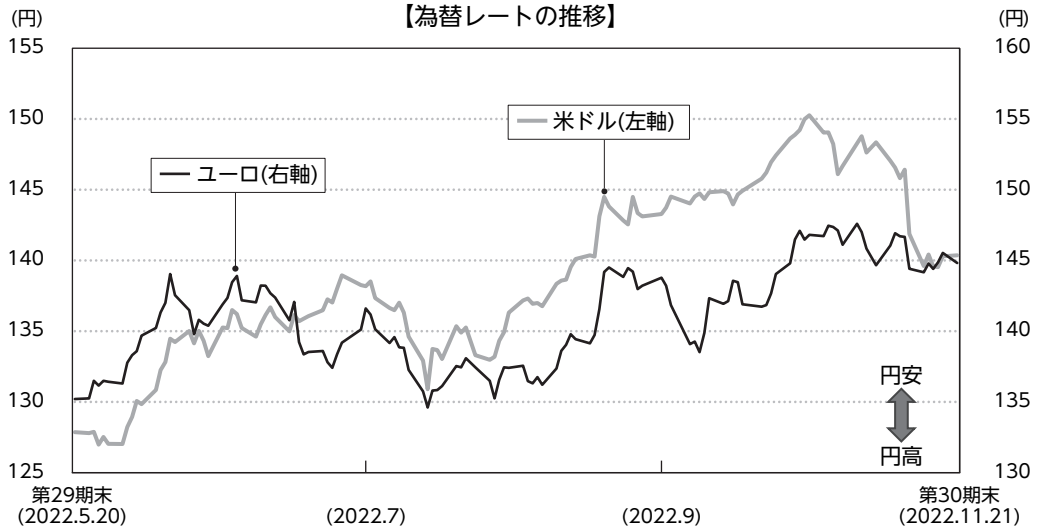
【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は、米金融政策の急激な引き締め観測の後退から一時上昇する場面もありましたが、期初から6月にかけては世界の主要な中央銀行が相次いで利上げを実施したことを懸念し下落しました。7月から8月中旬にかけては、米金融政策・景気の軟着陸（ソフトランディング）期待から上昇しましたが、8月下旬から9月にかけては、ジャクソンホール会議におけるパウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長の金融引き締めに積極的なスタンスが警戒されたことや、米消費者物価指数（CPI）が市場予想を上回ったことから米金融引き締めの長期化が懸念され、下落しました。その後は、イギリスにおける政治的混乱が沈静化したことや、10月の米CPIの上昇ペースが市場予想を下回り米利上げペース鈍化への期待感が高まったことを受けて株式市場は上昇基調となり、結局、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

## ■為替市況

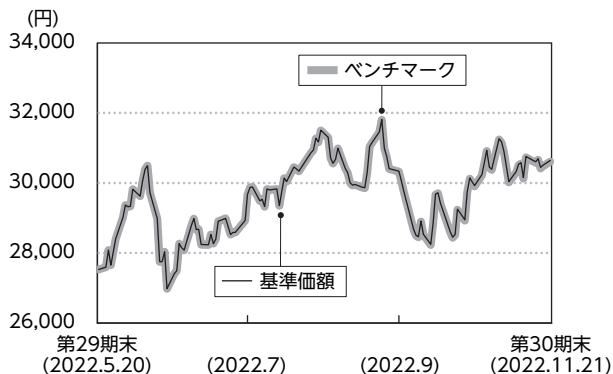


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 7月から8月中旬における米景気のソフトランディング期待や、10月以降の米利上げペース鈍化への期待感を受けて海外株式市場が上昇したこと
- ・ 期を通じて世界的に金融緩和縮小が進み、内外金利差の拡大などから円安が進んだこと

#### <下落要因>

- ・ 期初から6月にかけて世界の主要な中央銀行が相次いで利上げを実施したことや、8月下旬から9月における米金融引き締め長期化懸念を受けて海外株式市場が下落したこと

## ポートフォリオ

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

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+11.3%となり、ベンチマーク騰落率(+11.2%)にほぼ連動しました。

## 今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
26期(2020年11月20日)	20,729	20.1	20,257	19.9	94.9	2.8	2.2	300,923
27期(2021年5月20日)	25,274	21.9	24,672	21.8	94.7	3.2	2.1	392,650
28期(2021年11月22日)	29,525	16.8	28,808	16.8	94.9	2.9	2.1	513,761
29期(2022年5月20日)	27,529	△ 6.8	26,838	△ 6.8	94.8	2.8	2.3	510,207
30期(2022年11月21日)	30,643	11.3	29,840	11.2	94.1	2.9	2.1	601,452

(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) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
		%		%			
(期首)2022年5月20日	27,529	-	26,838	-	94.8	2.8	2.3
5月末	29,366	6.7	28,630	6.7	94.5	3.1	2.3
6月末	28,676	4.2	27,954	4.2	93.7	3.7	2.3
7月末	29,802	8.3	29,052	8.2	94.5	3.0	2.4
8月末	30,005	9.0	29,246	9.0	93.3	4.3	2.3
9月末	28,533	3.6	27,803	3.6	94.4	3.3	2.2
10月末	31,264	13.6	30,458	13.5	95.0	2.6	2.2
(期末)2022年11月21日	30,643	11.3	29,840	11.2	94.1	2.9	2.1

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2022年5月21日～2022年11月21日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)	0.001% (0.000)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税 (株式)	1 (1)	0.003 (0.003)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用 (保管費用)	3 (3)	0.011 (0.010)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.001)	
			・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	4	0.014	

(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（29,639円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。



## 売買および取引の状況

2022年5月21日～2022年11月21日

## (1) 株式

	買付		売付		
	株数	金額	株数	金額	
外国	アメリカ	百株 26,220 (19,680)	千米ドル 239,053 (△ 109)	百株 10,687	千米ドル 84,813
	カナダ	3,471 ( 841)	千カナダ・ドル 17,108	1,347	千カナダ・ドル 6,778
	オーストラリア	5,193 ( 2,884)	千オーストラリア・ドル 11,510	3,925	千オーストラリア・ドル 4,054
	香港	5,589	千香港ドル 21,852	1,454	千香港ドル 5,507
	シンガポール	2,423	千シンガポール・ドル 1,567	626	千シンガポール・ドル 449
	ニュージーランド	453	千ニュージーランド・ドル 315	464	千ニュージーランド・ドル 436
	イギリス	16,803 ( 3,599)	千イギリス・ポンド 10,803 (△ 194)	7,198	千イギリス・ポンド 3,890
	イスラエル	2,584	千イスラエル・シケル 5,109	139	千イスラエル・シケル 497
	スイス	1,501 ( 70)	千スイス・フラン 10,138 (△ 18)	453	千スイス・フラン 3,564
	デンマーク	308	千デンマーク・クローネ 15,057	253	千デンマーク・クローネ 8,597
	ノルウェー	711	千ノルウェー・クローネ 19,117	275	千ノルウェー・クローネ 5,065
スウェーデン	4,055 ( 1,645)	千スウェーデン・クローナ 55,966	3,819	千スウェーデン・クローナ 22,546	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

		買付		売付		
		株数	金額	株数	金額	
外国	ユーロ		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
		アイルランド	95	515	28	157
		オランダ	1,331	4,784	640	2,090
				(△ 56)		
		ベルギー	178	1,457	117	444
			( 25)			
		ルクセンブルグ	56	92	95	233
		フランス	1,688	9,159	859	3,852
			( 456)	(△ 38)		
		ドイツ	1,924	7,636	696	3,164
				(△ 40)		
		ポルトガル	271	211	73	57
		スペイン	2,952	2,684	931	782
			( 28)	( 2)		
イタリア	3,650	1,843	962	546		
		(△ 3)				
フィンランド	632	860	197	317		
オーストリア	42	156	131	200		
その他	13	53	3	11		

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	1	87	0.283	20
CROWN CASTLE INC	3	494	0.827	112
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	256	0.296	43
PROLOGIS INC	5	645	1	200
	( 15)			
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	32	220	0.832	17
	(△ 112)			
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.987	190	0.266	44
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.806	101	0.394	50
DUKE REALTY CORP	2	137	—	0.065
	(△ 33)			
EQUITY RESIDENTIAL	2	185	0.681	41
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.459	118	0.124	26
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3	100	1	25
WELLTOWER INC	4	362	0.866	59
HOST HOTELS AND RESORTS INC	4	86	1	25
KIMCO REALTY CORP	4	97	1	25
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.828	136	0.218	34
PUBLIC STORAGE	1	353	0.301	87
REGENCY CENTERS CORP	1	71	0.293	18
SIMON PROPERTY GROUP INC	2	227	0.626	72
SUN COMMUNITIES INC	1	196	0.232	32
UDR INC	2	130	0.606	24
VENTAS INC	2	132	0.761	33
VORNADO REALTY TRUST	1	33	0.315	7
WP CAREY INC	1	157	0.367	28
REALTY INCOME CORP	7	488	1	73
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1	96	0.336	21
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.974	176	0.256	40
DIGITAL REALTY TRUST INC	2	239	0.543	59
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4	59	1	14
IRON MOUNTAIN INC	2	104	0.555	28
AGNC INVESTMENT CORP	—	—	42	524
AMERICAN TOWER REIT INC	3	761	0.871	190
EQUINIX INC	0.704	445	0.174	112
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	33	815	0.731	14

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
<b>(アメリカ)</b>		千口	千口	千米ドル
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	27	1,002	0.592	18
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22	1,079	0.486	24
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.670	203	0.206	60
INVITATION HOMES INC	5	189	1	36
VICI PROPERTIES INC	33	1,048	1	58
<b>(カナダ)</b>		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.745	32	0.292	13
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.958	18	0.499	10
<b>(オーストラリア)</b>		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
GPT GROUP	19	85	4	18
GOODMAN GROUP	12	224	3	58
STOCKLAND	23	86	5	18
MIRVAC GROUP	33	70	8	17
VICINITY CENTRES	41	77	8	16
SCENTRE GROUP	52	148	10	30
DEXUS/AU	12	108	2	17
<b>(香港)</b>		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	17	1,057	4	229
<b>(シンガポール)</b>		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
CAPITALAND ASCENDAS REIT	20	56	6	17
		(△ 4)		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	69	148	10	20
		(△0.133)		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	25	42	6	9
		(△ 4)		
CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	—	5	7
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	31	56	4	7
		(△0.221)		
<b>(イギリス)</b>		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	4	20	1	6
LAND SECURITIES GROUP PLC	3	23	1	8
SEGRO PLC	7	71	2	18
<b>(ユーロ／ベルギー)</b>		千ユーロ		千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW SCA	12	435	0.275	7
<b>(ユーロ／フランス)</b>				
KLEPIERRE	2	48	0.408	9

外国

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(ユーロ/フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
外国 GECINA SA	0.224	18	0.156	15
COVIVIO	0.160	7	0.504	33
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.673	31	0.654	40

(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
	81,587	79,760	—	—

(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5月21日～2022年11月21日

### 株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC	93	1,939,637	20,667	APPLE INC	30	645,460	20,883
MICROSOFT CORP	46	1,680,792	35,882	TWITTER INC	68	521,050	7,639
AMAZON.COM INC	53	1,102,139	20,465	MICROSOFT CORP	13	460,331	33,927
TESLA, INC.	15	866,147	54,777	CERNER CORP	24	312,338	12,969
ALPHABET INC-CL A	25	630,428	24,895	AMAZON.COM INC	17	238,354	13,631
ALPHABET INC-CL C	20	498,045	24,484	CITRIX SYSTEMS INC	10	168,884	15,419
UNITEDHEALTH GROUP INC	6	444,372	71,893	ALPHABET INC-CL A	11	159,328	13,873
JOHNSON & JOHNSON	18	432,622	23,884	ALPHABET INC-CL C	10	149,690	13,893
NVIDIA CORP	17	365,702	20,772	CHEVRON CORP	6	149,689	24,697
EXXON MOBIL CORP	27	361,657	13,274	ALLEGHANY CORP	1	148,825	125,697

(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

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	
10X GENOMICS INC-CLASS A	63	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	467	489	6,208	871,436	資本財
ABBOTT LABORATORIES	1,432	1,505	15,641	2,195,451	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	1,432	1,520	23,559	3,306,759	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	36	38	1,467	206,000	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC	511	544	15,602	2,190,007	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	630	672	4,985	699,705	メディア・娯楽
ADOBE INC	385	406	13,435	1,885,769	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	50	52	769	108,028	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	1,323	1,393	10,249	1,438,689	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	108	116	689	96,840	資本財
AES CORP	541	575	1,591	223,406	公益事業
AFFIRM HOLDINGS INC	135	165	224	31,443	ソフトウェア・サービス
AFLAC INC	507	524	3,723	522,620	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	244	256	3,755	527,138	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	179	190	5,660	794,493	素材
AIRBNB INC-CLASS A	238	322	3,151	442,278	消費者サービス
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	131	137	1,251	175,720	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	94	100	2,785	390,985	素材
ALCOA CORP	-	157	745	104,699	素材
ALIGN TECHNOLOGY INC	60	63	1,238	173,767	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	11	-	-	-	保険
ALLEGION PLC	74	76	863	121,196	資本財
ALLIANT ENERGY CORP	203	215	1,192	167,357	公益事業
ALLSTATE CORP	231	235	3,127	438,936	保険
ALLY FINANCIAL INC	293	274	714	100,348	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	97	103	2,258	316,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	243	5,171	50,382	7,071,635	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	231	4,851	47,446	6,659,603	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	1,489	1,558	6,886	966,619	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	369	7,873	74,125	10,404,262	小売
AMC ENTERTAINMENT HLDGS	-	431	59	8,357	メディア・娯楽
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	417	431	327	45,964	メディア・娯楽
AMCOR PLC	1,257	1,308	1,546	217,035	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AMERCO	8	-	-	-	運輸
AMERCO-NON VOTING	-	82	481	67,553	運輸
AMEREN CORPORATION	209	222	1,918	269,286	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	408	441	4,033	566,113	公益事業
A M E R I C A N E X P R E S S C O	533	550	8,398	1,178,874	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	57	61	871	122,338	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	669	677	4,050	568,574	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	146	155	2,284	320,661	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	90	93	3,087	433,312	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	127	136	2,207	309,855	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	188	199	2,782	390,551	資本財
AMGEN INC	456	459	13,205	1,853,493	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	486	516	4,114	577,462	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES INC	435	448	7,251	1,017,756	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	70	74	1,820	255,477	ソフトウェア・サービス
AON PLC	178	182	5,500	772,106	保険
APA CORP	-	288	1,336	187,544	エネルギー
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	291	346	2,149	301,643	各種金融
APPLE INC	13,288	13,917	210,564	29,554,771	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	731	747	7,824	1,098,194	半導体・半導体製造装置
APPLOVIN CORP-CLASS A	-	101	142	19,969	ソフトウェア・サービス
APTIV PLC	219	233	2,517	353,360	自動車・自動車部品
ARAMARK	187	202	824	115,658	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	309	319	1,842	258,661	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	452	483	4,604	646,260	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	186	211	2,869	402,777	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	55	57	617	86,673	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	168	180	3,516	493,562	保険
ASANA INC - CL A	53	-	-	-	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	46	46	576	80,972	保険
AT&T INC	5,790	6,161	11,689	1,640,690	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	107	120	1,380	193,781	公益事業
AUTODESK INC	177	186	3,932	551,928	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	341	361	9,261	1,299,875	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	16	16	4,144	581,659	小売
AVALARA INC	70	-	-	-	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	444	525	1,097	154,064	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AVERY DENNISON CORP	67	70	1,323	185,801	素材
BAKER HUGHES COMPANY	669	847	2,469	346,630	エネルギー
BALL CORP	263	275	1,516	212,889	素材
BANK OF AMERICA CORP	5,963	6,232	23,180	3,253,577	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	634	659	2,940	412,686	各種金融
BATH & BODY WORKS INC	213	203	778	109,261	小売
BAXTER INTERNATIONAL INC	406	434	2,388	335,294	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	230	245	5,544	778,233	ヘルスケア機器・サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	142	166	640	89,845	ソフトウェア・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,056	1,106	34,384	4,826,231	各種金融
BEST BUY CO INC	178	173	1,248	175,277	小売
BILL.COM HOLDINGS INC	62	80	913	128,267	ソフトウェア・サービス
BIOGEN INC	118	125	3,811	535,034	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	148	159	1,408	197,628	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	17	19	765	107,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	31	33	1,104	154,975	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	126	134	817	114,806	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	122	130	9,376	1,316,096	各種金融
BLACKSTONE INC	555	601	5,518	774,537	各種金融
BLOCK INC	411	445	2,932	411,658	ソフトウェア・サービス
BOEING CO	453	484	8,416	1,181,381	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	33	34	6,769	950,186	消費者サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	108	113	1,219	171,172	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	195	205	869	122,057	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,155	1,230	5,285	741,902	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,798	1,832	14,194	1,992,404	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	333	347	17,897	2,512,047	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	95	101	1,469	206,248	ソフトウェア・サービス
BROWN & BROWN INC	193	204	1,166	163,718	保険
BROWN-FORMAN CORP -CL B	251	266	1,861	261,232	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	112	130	1,312	184,268	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	54	56	896	125,808	小売
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	108	112	1,089	152,942	運輸
CABLE ONE INC	4	4	317	44,600	メディア・娯楽
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	223	236	3,904	547,971	ソフトウェア・サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	173	183	917	128,728	消費者サービス
CAMPBELL SOUP CO	159	182	939	131,886	食品・飲料・タバコ



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	344	337	3,335	468,232	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	229	236	1,835	257,576	ヘルスケア機器・サービス
CARLISLE COS INC	-	44	1,120	157,217	資本財
CARLYLE GROUP INC/THE	128	169	479	67,280	各種金融
CARMAX INC	131	137	917	128,765	小売
CARNIVAL CORP	682	857	811	113,958	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	668	730	3,210	450,620	資本財
CARVANA CO	62	-	-	-	小売
CATALENT INC	138	146	630	88,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	438	458	10,619	1,490,538	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	86	91	1,117	156,804	各種金融
CBRE GROUP INC	270	280	2,115	296,875	不動産
CDW CORP/DE	110	116	2,163	303,726	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	87	92	933	131,088	素材
CENTENE CORP	472	502	4,157	583,520	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	511	545	1,619	227,326	公益事業
CENTURYLINK INC	710	805	472	66,370	電気通信サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	110	117	767	107,744	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	237	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	172	179	1,817	255,165	素材
CHARLES RIVER LABORATORIES	40	43	1,052	147,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHARLES SCHWAB CORP	1,173	1,250	9,976	1,400,344	各種金融
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	101	100	3,777	530,261	メディア・娯楽
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	85	88	1,139	159,930	ソフトウェア・サービス
CHENIERE ENERGY INC	194	197	3,307	464,268	エネルギー
CHEVRON CORP	1,561	1,605	29,374	4,123,051	エネルギー
CHEWY INC - CLASS A	73	79	325	45,620	小売
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	22	23	3,604	505,920	消費者サービス
CHUBB LTD	348	366	7,692	1,079,673	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	197	209	1,599	224,533	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	268	272	8,708	1,222,261	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	123	130	1,392	195,510	保険
CINTAS CORP	75	79	3,550	498,407	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	3,416	3,561	17,018	2,388,649	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CITIGROUP INC	1,606	1,669	8,123	1,140,241	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	343	423	1,710	240,053	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	101	-	-	-	ソフトウェア・サービス

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
CLARIVATE PLC	286	260	241	33,860	商業・専門サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	-	447	641	90,010	素材
CLOROX CO	99	105	1,555	218,293	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	210	217	1,021	143,355	ソフトウェア・サービス
CME GROUP INC	291	309	5,337	749,170	各種金融
CMS ENERGY CORP	236	250	1,503	211,070	公益事業
COCA-COLA CO	3,326	3,543	21,666	3,041,048	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	166	176	896	125,831	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	143	148	709	99,654	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	424	447	2,685	376,972	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	31	104	472	66,252	各種金融
COLGATE-PALMOLIVE CO	650	685	5,242	735,770	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	3,692	3,842	13,255	1,860,549	メディア・娯楽
CONAGRA BRANDS INC	389	412	1,483	208,271	食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	1,066	1,111	14,294	2,006,332	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	287	305	2,854	400,688	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	133	140	3,473	487,476	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION ENERGY	263	280	2,618	367,593	公益事業
COOPER COS INC/THE	39	42	1,298	182,251	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	172	366	2,358	331,036	商業・専門サービス
CORNING INC	656	691	2,341	328,709	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	589	622	4,061	570,109	素材
COSTAR GROUP INC	320	340	2,750	386,095	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	357	380	19,940	2,798,894	食品・生活必需品小売り
COTERRA ENERGY INC	623	692	1,843	258,725	エネルギー
COUPA SOFTWARE INC	60	64	295	41,546	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	158	174	2,419	339,625	ソフトウェア・サービス
CROWN HOLDINGS INC	104	106	856	120,162	素材
CSX CORP	1,815	1,890	5,837	819,337	運輸
CUMMINS INC	116	121	3,048	427,891	資本財
CVS HEALTH CORP	1,068	1,127	10,979	1,541,072	ヘルスケア機器・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	32	35	521	73,190	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	520	593	15,482	2,173,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DARDEN RESTAURANTS INC	104	106	1,570	220,404	消費者サービス
DATADOG INC - CLASS A	176	206	1,580	221,852	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	53	48	343	48,283	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	238	249	10,344	1,452,010	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
DELL TECHNOLOGIES -C	234	235	988	138,814	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	129	132	458	64,333	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	176	185	576	80,868	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	518	537	3,744	525,608	エネルギー
DEXCOM INC	78	337	3,832	537,926	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	138	144	2,257	316,823	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	237	241	2,589	363,412	各種金融
DISH NETWORK CORP	200	211	322	45,314	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	159	170	786	110,349	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	189	195	5,034	706,596	小売
DOLLAR TREE INC	182	193	3,155	442,923	小売
DOMINION ENERGY INC	658	699	4,138	580,934	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	29	30	1,136	159,506	消費者サービス
DOORDASH INC - A	88	165	963	135,298	小売
DOVER CORP	116	123	1,729	242,683	資本財
DOW INC	596	625	3,132	439,618	素材
DR HORTON INC	273	286	2,330	327,146	耐久消費財・アパレル
DRAFTKINGS INC	264	-	-	-	消費者サービス
DROPBOX INC-CLASS A	250	250	558	78,396	ソフトウェア・サービス
DTE ENERGY COMPANY	158	167	1,924	270,119	公益事業
DUKE ENERGY CORP	624	662	6,416	900,551	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	419	439	3,047	427,739	素材
DYNATRACE INC	149	172	630	88,504	ソフトウェア・サービス
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	108	110	930	130,598	素材
EATON CORP PLC	323	343	5,668	795,643	資本財
EBAY INC	505	480	2,195	308,118	小売
ECOLAB INC	209	221	3,280	460,511	素材
EDISON INTERNATIONAL	309	329	2,032	285,325	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	505	534	4,009	562,789	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	347	368	438	61,543	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	228	240	3,131	439,580	メディア・娯楽
ELEVANCE HEALTH, INC	196	207	10,260	1,440,171	ヘルスケア機器・サービス
ELI LILLY & CO	658	694	25,119	3,525,762	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	482	511	4,792	672,619	資本財
ENPHASE ENERGY INC	103	116	3,620	508,199	半導体・半導体製造装置
ENTEGRIS INC	109	128	939	131,855	半導体・半導体製造装置
ENTERGY CORP	163	175	1,963	275,553	公益事業

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
EOG RESOURCES INC	472	503	7,093	995,636	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	45	49	1,674	235,035	ソフトウェア・サービス
EQT CORP	-	285	1,171	164,401	エネルギー
EQUIFAX INC	98	105	2,104	295,330	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	295	327	1,004	141,020	各種金融
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	20	21	587	82,524	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	197	215	1,016	142,632	公益事業
ESTEE LAUDER COS INC	187	198	4,645	652,059	家庭用品・パーソナル用品
ETSY INC	102	108	1,241	174,272	小売
EVEREST RE GROUP LTD	31	33	1,080	151,607	保険
EVERGY INC	187	197	1,161	162,979	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	279	296	2,364	331,946	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	140	151	646	90,724	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	791	842	3,250	456,253	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	117	129	1,275	178,984	消費者サービス
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	140	148	1,678	235,653	運輸
EXXON MOBIL CORP	3,430	3,622	40,598	5,698,438	エネルギー
F5 INC	49	51	773	108,601	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	30	32	1,426	200,189	各種金融
FAIR ISAAC CORP	22	22	1,284	180,271	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	465	493	2,551	358,192	資本財
FEDEX CORP	206	213	3,723	522,575	運輸
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	216	227	904	126,964	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	493	525	3,228	453,144	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	553	588	2,096	294,330	銀行
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	9	10	810	113,754	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	143	154	1,885	264,695	銀行
FIRSTENERGY CORP	442	468	1,802	253,066	公益事業
FISERV INC	482	528	5,279	741,100	ソフトウェア・サービス
FIVERR INTERNATIONAL LTD	23	-	-	-	小売
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	62	63	1,191	167,301	ソフトウェア・サービス
FMC CORP	103	108	1,389	194,972	素材
FORD MOTOR CO	3,175	3,394	4,749	666,591	自動車・自動車部品
FORTINET INC	112	585	3,054	428,741	ソフトウェア・サービス
FORTUNE CORP	276	293	1,958	274,862	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	110	112	725	101,896	資本財
FOX CORP - CLASS A	246	256	794	111,559	メディア・娯楽

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FOX CORP- CLASS B	134	138	402	56,537	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	241	256	669	93,999	各種金融
FREEMONT-MCMORAN INC	1,185	1,242	4,515	633,764	素材
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	40	50	256	36,029	各種金融
GARMIN LTD	124	132	1,207	169,435	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	66	69	2,340	328,469	ソフトウェア・サービス
GEN DIGITAL INC	471	500	1,131	158,750	ソフトウェア・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	51	54	562	78,937	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	192	203	5,050	708,823	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	889	946	8,092	1,135,836	資本財
GENERAL MILLS INC	490	517	4,194	588,799	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	1,057	1,189	4,730	663,920	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	115	122	2,215	310,992	小売
GILEAD SCIENCES INC	1,016	1,079	9,027	1,267,057	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	235	242	2,374	333,296	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	77	80	914	128,428	保険
GODADDY INC - CLASS A	134	139	1,035	145,295	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	272	295	11,195	1,571,400	各種金融
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	885	1,144	367	51,578	運輸
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	65	70	404	56,815	ソフトウェア・サービス
HALLIBURTON CO	724	775	2,848	399,781	エネルギー
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	273	279	2,062	289,524	保険
HASBRO INC	106	114	683	95,898	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	201	202	4,669	655,342	ヘルスケア機器・サービス
HEICO CORP	34	37	618	86,838	資本財
HEICO CORP-CLASS A	59	62	800	112,333	資本財
HENRY SCHEIN INC	111	118	935	131,270	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	117	125	2,829	397,185	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	225	240	3,462	486,000	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,052	1,114	1,757	246,654	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	224	238	3,326	466,845	消費者サービス
HOLOGIC INC	202	214	1,572	220,784	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	845	883	27,677	3,884,827	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	558	586	12,571	1,764,590	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	964	999	396	55,667	不動産
HORIZON PHARMA PLC	174	187	1,428	200,472	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	242	258	1,258	176,594	食品・飲料・タバコ

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
HOWMET AEROSPACE INC	310	323	1,199	168,348	資本財
HP INC	931	904	2,665	374,157	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUBSPOT INC	36	38	1,059	148,686	ソフトウェア・サービス
HUMANA INC	103	108	5,757	808,103	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,172	1,240	1,847	259,341	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	32	34	783	109,913	資本財
IAC INC	64	69	327	46,035	メディア・娯楽
IDEX CORP	62	65	1,536	215,601	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	68	71	2,974	417,518	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	255	268	6,090	854,907	資本財
ILLUMINA INC	120	134	2,976	417,837	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	151	161	1,252	175,771	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	332	351	1,885	264,582	資本財
INMODE LTD	39	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
INSULET CORP	55	59	1,761	247,182	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	3,294	3,515	10,501	1,473,946	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	456	480	5,006	702,662	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	727	774	11,429	1,604,251	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	207	219	2,160	303,270	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	298	304	1,087	152,628	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	318	338	1,119	157,175	メディア・娯楽
INTUIT INC	217	230	8,751	1,228,359	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	288	308	8,079	1,134,044	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	275	287	544	76,408	各種金融
IPG PHOTONICS CORP	30	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IQVIA HOLDINGS INC	154	162	3,482	488,830	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	59	62	1,176	165,139	ソフトウェア・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	104	110	1,395	195,803	商業・専門サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	176	137	632	88,762	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	49	53	792	111,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	70	74	1,350	189,496	運輸
JM SMUCKER CO	87	93	1,360	190,968	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	2,132	2,263	39,885	5,598,380	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	572	599	4,013	563,401	資本財
JPMORGAN CHASE & CO	2,393	2,525	33,799	4,744,067	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	263	278	878	123,288	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KELLOGG CO	208	218	1,544	216,779	食品・飲料・タバコ

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
KEURIG DR PEPPER INC	578	677	2,533	355,605	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	752	799	1,488	208,897	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	149	156	2,690	377,673	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	274	290	3,818	535,943	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	1,653	1,757	3,237	454,451	エネルギー
KKR & CO INC -A	425	483	2,505	351,734	各種金融
KLA CORPORATION	122	128	4,835	678,670	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	136	143	782	109,858	運輸
KORNIT DIGITAL LTD	37	-	-	-	資本財
KRAFT HEINZ CO/THE	545	632	2,408	338,039	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	569	592	2,860	401,495	食品・生活必需品小売り
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	159	165	3,714	521,411	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	77	79	1,833	257,398	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	114	119	5,447	764,613	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	279	296	1,294	181,648	消費者サービス
LEAR CORP	48	51	750	105,337	自動車・自動車部品
LEIDOS HOLDINGS INC	108	112	1,190	167,166	商業・専門サービス
LENNAR CORP-CL A	219	221	1,876	263,361	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	27	27	749	105,173	資本財
LIBERTY BROADBAND-A	22	-	-	-	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	111	112	968	135,942	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-A	182	100	193	27,173	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	223	290	581	81,655	電気通信サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	66	58	249	35,023	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	138	146	616	86,505	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA GROUP-C	157	170	980	137,682	メディア・娯楽
LINCOLN NATIONAL CORP	136	137	519	72,938	保険
LINDE PLC	415	432	14,491	2,034,081	素材
LIVE NATION INC	134	148	981	137,809	メディア・娯楽
LKQ CORP	222	230	1,246	174,983	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	201	205	9,820	1,378,350	資本財
LOEWS CORP	172	178	1,012	142,135	保険
LOWE'S COS INC	545	549	11,536	1,619,262	小売
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	-	68	1,494	209,719	各種金融
LUCID GROUP INC	333	361	406	57,082	自動車・自動車部品
LULULEMON ATHLETICA INC	95	100	3,485	489,218	耐久消費財・アパレル
LYFT INC-A	221	271	303	42,668	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	215	224	1,845	259,056	素材
M&T BANK CORP	104	154	2,633	369,571	銀行
MARATHON OIL CORP	-	602	1,856	260,522	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	497	463	5,614	788,103	エネルギー
MARKEL CORP	11	11	1,470	206,448	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	30	32	841	118,070	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	223	238	3,855	541,201	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	409	431	7,235	1,015,527	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	50	53	1,916	268,970	素材
MARVELL TECHNOLOGY INC	666	731	3,219	451,824	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	198	202	1,010	141,894	資本財
MASIMO CORPORATION	41	44	635	89,229	ヘルスケア機器・サービス
MASTERCARD INC-CLASS A	710	746	25,664	3,602,298	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	217	244	1,135	159,424	メディア・娯楽
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	202	216	1,809	254,023	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	605	636	17,396	2,441,841	消費者サービス
MCKESSON CORP	123	125	4,636	650,818	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	1,089	1,144	9,305	1,306,156	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	178	-	-	-	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	36	38	3,748	526,106	小売
MERCK & CO INC	2,046	2,175	22,670	3,182,037	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
META PLATFORMS INC-A	1,916	1,971	22,092	3,100,912	メディア・娯楽
METLIFE INC	576	592	4,470	627,501	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	18	19	2,728	382,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	302	289	1,064	149,449	消費者サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	450	477	3,544	497,528	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	905	959	5,623	789,265	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	5,776	6,109	147,376	20,685,798	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	278	290	5,272	739,992	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC	46	43	434	60,996	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	47	50	1,602	224,870	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	154	154	828	116,340	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,130	1,190	7,739	1,086,283	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	48	58	934	131,166	ソフトウェア・サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	35	38	1,435	201,509	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	320	340	3,397	476,813	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	135	142	4,173	585,846	各種金融



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MORGAN STANLEY	1,089	1,128	10,062	1,412,356	各種金融
MOSAIC CO/THE	298	310	1,518	213,158	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	137	144	3,790	532,077	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	66	69	3,411	478,780	各種金融
NASDAQ INC	94	296	1,945	273,040	各種金融
NETAPP INC	181	191	1,411	198,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	358	381	10,992	1,542,905	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	76	82	988	138,720	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWELL BRANDS INC	310	338	452	63,480	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	644	681	3,075	431,629	素材
NEWS CORP - CLASS A	316	332	593	83,324	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	1,589	1,689	14,054	1,972,663	公益事業
NIKE INC	1,035	1,091	11,503	1,614,591	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	322	351	925	129,968	公益事業
NORDSON CORP	42	44	1,034	145,132	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	199	208	5,132	720,412	運輸
NORTHERN TRUST CORP	159	170	1,573	220,817	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	121	126	6,605	927,174	資本財
NOVAVAX INC	58	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOCURE LTD	75	80	625	87,827	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	196	202	853	119,773	公益事業
NUCOR CORP	230	228	3,238	454,605	素材
NVIDIA CORP	2,024	2,152	33,175	4,656,459	半導体・半導体製造装置
NVR INC	2	2	1,181	165,850	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	215	225	3,885	545,344	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	757	805	5,739	805,612	エネルギー
OKTA INC	119	129	645	90,649	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	80	84	2,518	353,550	運輸
OMNICOM GROUP	172	177	1,368	192,053	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	348	373	2,705	379,806	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	361	383	2,473	347,210	エネルギー
ORACLE CORP	1,328	1,376	10,977	1,540,741	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	54	56	4,737	665,011	小売
OTIS WORLDWIDE CORP	328	364	2,835	397,993	資本財
OWENS CORNING	80	82	747	104,893	資本財
PACCAR INC	281	300	3,116	437,448	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	76	80	1,042	146,381	素材

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,313	1,420	1,049	147,373	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	79	257	4,305	604,354	ソフトウェア・サービス
PARAMOUNT GLOBAL	489	522	974	136,759	メディア・娯楽
PARKER HANNIFIN CORP	104	110	3,375	473,725	資本財
PAYCHEX INC	262	279	3,376	473,921	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	41	43	1,390	195,175	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	903	945	8,029	1,126,976	ソフトウェア・サービス
PELOTON INTERACTIVE INC-A	229	-	-	-	耐久消費財・アパレル
PENTAIR PLC	133	141	635	89,225	資本財
PEPSICO INC	1,120	1,189	21,568	3,027,377	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	91	108	1,478	207,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	4,545	4,824	23,270	3,266,198	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	1,208	1,287	1,933	271,435	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,261	1,332	12,830	1,800,843	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	354	413	4,502	631,999	エネルギー
PINTEREST INC- CLASS A	454	493	1,202	168,771	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	187	197	4,935	692,720	エネルギー
PLUG POWER INC	421	447	709	99,532	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	342	355	5,734	804,902	銀行
POOL CORP	32	34	1,104	155,012	小売
PPG INDUSTRIES INC	192	203	2,609	366,230	素材
PPL CORPORATION	615	634	1,781	250,117	公益事業
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	213	215	1,963	275,562	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,960	2,063	29,423	4,129,896	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	473	502	6,448	905,100	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	304	322	3,460	485,690	保険
PTC INC	90	95	1,179	165,500	ソフトウェア・サービス
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	411	432	2,494	350,097	公益事業
PULTE GROUP INC	203	201	865	121,473	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	89	90	896	125,834	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	907	963	11,927	1,674,143	半導体・半導体製造装置
QUANTA SERVICES INC	-	123	1,841	258,486	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	99	101	1,480	207,816	ヘルスケア機器・サービス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	148	166	2,020	283,626	各種金融
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,213	1,280	12,207	1,713,446	資本財
REGENERON PHARMACEUTICALS	85	92	6,840	960,137	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	765	800	1,800	252,740	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
REPUBLIC SERVICES INC	180	190	2,554	358,566	商業・専門サービス
RESMED INC	117	125	2,820	395,883	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	63	69	249	35,073	ソフトウェア・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	145	270	819	115,018	自動車・自動車部品
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	89	93	707	99,306	商業・専門サービス
ROBINHOOD MARKETS INC - A	149	-	-	-	各種金融
ROBLOX CORP -CLASS A	-	302	960	134,750	メディア・娯楽
ROCKWELL AUTOMATION INC	94	100	2,649	371,849	資本財
ROKU INC	95	102	570	80,024	メディア・娯楽
ROLLINS INC	179	189	806	113,210	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	85	91	3,954	555,018	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	288	302	3,252	456,573	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	186	198	1,164	163,502	消費者サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	279	300	1,287	180,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RPM INTERNATIONAL INC	106	112	1,128	158,442	素材
S&P GLOBAL INC	280	298	10,322	1,448,864	各種金融
SALESFORCE INC	793	854	12,654	1,776,221	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,135	1,215	6,496	911,786	エネルギー
SEA LTD-ADR	259	310	1,765	247,795	メディア・娯楽
SEAGATE TECHNOLOGY	161	175	955	134,124	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEAGEN INC	111	118	1,567	220,039	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEALED AIR CORP	120	126	646	90,773	素材
SEI INVESTMENTS COMPANY	93	97	592	83,162	各種金融
SEMPRA ENERGY	259	270	4,272	599,720	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	129	136	600	84,351	資本財
SERVICENOW INC	161	172	6,881	965,861	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	202	212	5,101	716,056	素材
SIGNATURE BANK	48	53	710	99,682	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	813	689	440	61,805	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	134	137	1,301	182,621	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	108	112	688	96,574	資本財
SNAP INC - A	877	950	999	140,293	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	43	45	1,082	151,989	資本財
SNOWFLAKE INC-CLASS A	170	191	2,798	392,744	ソフトウェア・サービス
SOFI TECHNOLOGIES INC	428	-	-	-	各種金融
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	42	47	1,458	204,703	半導体・半導体製造装置
SOUTHERN CO	861	915	6,003	842,617	公益事業

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
SOUTHWEST AIRLINES CO	118	123	472	66,296	運輸
SPLUNK INC	131	138	1,072	150,530	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	186	197	1,032	144,935	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	132	129	1,039	145,956	資本財
STARBUCKS CORP	950	985	9,656	1,355,331	消費者サービス
STATE STREET CORP	295	314	2,375	333,381	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	158	160	1,619	227,298	素材
STERIS PLC	81	86	1,432	201,135	ヘルスケア機器・サービス
STRYKER CORP	275	292	6,545	918,728	ヘルスケア機器・サービス
SUNRUN INC	143	-	-	-	資本財
SVB FINANCIAL GROUP	47	50	1,127	158,222	銀行
SYNCHRONY FINANCIAL	441	428	1,537	215,822	各種金融
SYNOPSIS INC	123	131	4,283	601,186	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	415	437	3,722	522,475	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	180	193	2,357	330,852	各種金融
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	93	139	1,376	193,144	メディア・娯楽
TARGA RESOURCES CORP	-	184	1,336	187,552	エネルギー
TARGET CORP	387	398	6,486	910,495	小売
TE CONNECTIVITY LTD	264	277	3,508	492,429	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELADOC HEALTH INC	117	139	401	56,407	ヘルスケア機器・サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	37	40	1,648	231,413	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	38	40	874	122,728	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	131	137	1,275	179,044	半導体・半導体製造装置
TESLA, INC.	691	2,271	40,932	5,745,260	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	892	954	832	116,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	748	793	13,894	1,950,169	半導体・半導体製造装置
TEXAS PACIFIC LAND CORP	-	5	1,438	201,903	エネルギー
TEXTRON INC	177	183	1,287	180,757	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	319	336	18,021	2,529,502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TJX COS INC	974	1,008	7,879	1,105,906	小売
T-MOBILE US INC	507	539	8,033	1,127,651	電気通信サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	92	96	2,115	296,868	小売
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	352	379	1,889	265,226	メディア・娯楽
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	85	92	529	74,281	各種金融
TRANE TECHNOLOGIES PLC	193	201	3,554	498,872	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	42	44	2,768	388,592	資本財
TRANSUNION	155	165	997	140,000	商業・専門サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TRAVELERS COS INC/THE	198	205	3,796	532,862	保険
TRIMBLE INC	203	214	1,246	174,966	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRUIST FINANCIAL CORP	1,084	1,147	5,241	735,702	銀行
TWILIO INC - A	136	147	726	101,921	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	647	-	-	-	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	33	35	1,119	157,153	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	237	249	1,633	229,339	食品・飲料・タバコ
UBER TECHNOLOGIES INC	1,183	1,272	3,684	517,127	運輸
UGI CORP	169	179	693	97,352	公益事業
ULTA BEAUTY INC	41	44	1,958	274,951	小売
UNION PACIFIC CORP	523	543	11,450	1,607,132	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	592	633	11,336	1,591,215	運輸
UNITED RENTALS INC	58	61	2,114	296,860	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	762	806	42,754	6,001,031	ヘルスケア機器・サービス
UNITY SOFTWARE INC	46	165	572	80,331	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	58	56	728	102,184	ヘルスケア機器・サービス
UPSTART HOLDINGS INC	33	-	-	-	各種金融
US BANCORP	1,141	1,214	5,268	739,468	銀行
VAIL RESORTS INC	32	34	844	118,528	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	330	350	4,817	676,187	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	112	120	2,213	310,618	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	81	84	1,644	230,879	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	124	135	2,356	330,782	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,363	3,616	13,942	1,957,011	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	205	219	6,918	971,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	271	284	942	132,305	耐久消費財・アパレル
VIATRIS INC	982	1,042	1,147	161,019	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC-CLASS A SHARES	1,352	1,415	29,833	4,187,425	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	353	336	771	108,299	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	169	181	2,113	296,695	ソフトウェア・サービス
VULCAN MATERIALS CO	107	114	2,052	288,050	素材
WABTEC CORP	144	150	1,491	209,369	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	594	629	2,501	351,150	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,242	1,301	19,547	2,743,641	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	1,472	1,566	14,376	2,017,862	メディア・娯楽
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,789	1,979	2,132	299,256	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	211	221	3,109	436,468	商業・専門サービス

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC	339	357	5,760	808,554	商業・専門サービス
WATERS CORP	49	51	1,660	233,053	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	60	65	217	30,512	小売
WEBSTER FINANCIAL CORP	144	152	803	112,721	銀行
WEC ENERGY GROUP INC	256	271	2,600	365,026	公益事業
WELLS FARGO & CO	3,227	3,257	15,149	2,126,340	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	59	63	1,427	200,381	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTERN DIGITAL CORP	251	269	992	139,316	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	327	334	465	65,276	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	-	32	340	47,725	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	214	219	800	112,314	素材
WEYERHAEUSER CO	602	637	2,058	288,958	不動産
WHIRLPOOL CORP	49	48	714	100,355	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	984	1,049	3,504	491,848	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	100	95	2,222	311,927	保険
WIX.COM LTD	46	49	418	58,736	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	156	171	2,509	352,301	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	170	181	1,328	186,440	保険
WW GRAINGER INC	35	39	2,358	331,090	資本財
WYNN RESORTS LTD	84	95	728	102,267	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	437	469	3,208	450,281	公益事業
XYLEM INC	146	155	1,746	245,114	資本財
YUM! BRANDS INC	237	244	3,049	428,074	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	43	44	1,151	161,685	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZENDESK INC	97	105	815	114,452	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C W/I	136	139	490	68,856	不動産
ZILLOW GROUP INC - CL A	49	-	-	-	不動産
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	-	74	185	25,974	運輸
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	169	180	2,060	289,270	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	383	404	5,895	827,472	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	176	194	1,583	222,327	ソフトウェア・サービス
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	228	224	598	83,988	メディア・娯楽
ZSCALER INC	67	72	1,006	141,309	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	258,879 606	294,092 599	2,950,807 -	414,175,303 <68.9%>
<b>(カナダ)</b>			千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD		367	389	2,493	261,393 素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AIR CANADA	148	161	301	31,589	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	564	600	617	64,745	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	689	712	4,398	461,054	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	234	250	560	58,790	公益事業
ARC RESOURCES LTD	-	583	1,106	116,033	エネルギー
BALLARD POWER SYSTEMS INC	196	-	-	-	資本財
BANK OF MONTREAL	524	578	7,654	802,313	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	986	1,031	7,121	746,473	銀行
BARRICK GOLD CORP	1,439	1,527	3,193	334,709	素材
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	248	230	233	24,447	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	78	77	490	51,439	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD	439	475	301	31,628	ソフトウェア・サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	1,145	1,213	7,267	761,804	各種金融
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	107	113	468	49,127	公益事業
BRP INC/CA- SUB VOTING	-	32	305	32,012	耐久消費財・アパレル
CAE INC	257	273	777	81,445	資本財
CAMECO CORP	321	342	1,092	114,497	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	731	777	4,943	518,158	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	577	510	8,497	890,706	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	952	992	7,932	831,499	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	762	809	8,505	891,575	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	46	48	716	75,122	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	112	119	427	44,841	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	199	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	124	131	819	85,897	素材
CENOVUS ENERGY INC	1,058	1,192	3,236	339,221	エネルギー
CGI INC	177	187	2,138	224,109	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC	16	17	3,510	367,991	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC	236	240	1,868	195,859	小売
EMERA INC	219	236	1,211	127,006	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	137	140	488	51,232	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	1,648	1,751	9,453	990,954	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	20	19	1,489	156,112	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	472	502	1,482	155,395	素材
FIRSTSERVICE CORP	32	35	582	61,093	不動産
FORTIS INC	393	420	2,244	235,267	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	154	164	3,048	319,543	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
GEORGE WESTON LTD	61	63	999	104,763	食品・生活必需品小売り
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	134	160	595	62,443	商業・専門サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	158	162	623	65,346	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC	232	247	776	81,415	保険
HYDRO ONE LTD	279	298	1,059	111,043	公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	86	91	670	70,284	保険
IGM FINANCIAL INC	69	75	292	30,622	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	197	201	1,519	159,277	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	143	152	2,963	310,668	保険
IVANHOE MINES LTD-CL A	491	527	548	57,461	素材
KEYERA CORP	179	192	564	59,156	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	983	1,088	596	62,546	素材
LIGHTSPEED COMMERCE INC	90	114	231	24,249	ソフトウェア・サービス
LOBLAW COS LTD	135	143	1,590	166,686	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	530	558	429	44,977	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	232	242	2,007	210,457	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,574	1,656	3,903	409,142	保険
METRO INC	200	208	1,597	167,401	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	274	290	2,832	296,922	銀行
NORTHLAND POWER INC	187	200	741	77,687	公益事業
NUTRIEN LTD	461	474	4,935	517,376	素材
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	53	55	223	23,464	ソフトウェア・サービス
ONEX CORPORATION	61	65	452	47,453	各種金融
OPEN TEXT CORP	223	237	919	96,391	ソフトウェア・サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	170	184	365	38,345	素材
PARKLAND CORP	127	136	352	36,989	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	448	476	2,241	234,975	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	458	484	1,603	168,084	保険
QUEBECOR INC -CL B	140	141	383	40,226	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERN	231	253	2,268	237,799	消費者サービス
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	90	95	704	73,834	商業・専門サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	293	311	1,859	194,924	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,156	1,222	16,216	1,699,838	銀行
SAPUTO INC	205	217	749	78,592	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	372	415	1,516	158,921	メディア・娯楽
SHOPIFY INC - CLASS A	92	982	4,815	504,794	ソフトウェア・サービス



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
SUN LIFE FINANCIAL INC	477	507	3,138	328,988	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,181	1,234	5,883	616,721	エネルギー
TC ENERGY CORP	798	847	5,420	568,214	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	380	409	1,800	188,731	素材
TFI INTERNATIONAL INC	69	73	1,026	107,579	運輸
THOMSON REUTERS CORP	138	149	2,268	237,732	商業・専門サービス
TMX GROUP LTD	48	50	683	71,691	各種金融
TOROMONT INDUSTRIES LTD	68	72	722	75,769	資本財
TORONTO-DOMINION BANK	1,477	1,566	14,003	1,467,859	銀行
TOURMALINE OIL CORP	251	272	2,174	227,953	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD	75	52	568	59,587	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	363	386	1,913	200,596	素材
WSP GLOBAL INC	95	107	1,715	179,769	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	32,086 85	35,051 85	206,457 -	21,640,852 <3.6%>
<b>(オーストラリア)</b>			千オーストラリア・ドル		
AMPOL LTD	213	223	644	60,245	エネルギー
ARISTOCRAT LEISURE LTD	506	534	1,934	180,724	消費者サービス
ASX LTD	169	180	1,313	122,669	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD	1,748	1,894	699	65,309	運輸
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	2,335	2,630	6,445	602,088	銀行
BHP GROUP LIMITED	4,115	4,371	19,208	1,794,278	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	422	444	738	68,964	素材
BRAMBLES LTD	1,257	1,310	1,510	141,062	商業・専門サービス
COCHLEAR LTD	56	60	1,243	116,124	ヘルスケア機器・サービス
COLES GROUP LTD	1,124	1,211	2,051	191,627	食品・生活必需品小売り
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,392	1,478	15,649	1,461,840	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED	468	494	1,339	125,091	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD	331	-	-	-	消費者サービス
CSL LIMITED	390	417	12,292	1,148,258	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	52	56	360	33,677	消費者サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	1,146	1,226	878	82,020	食品・生活必需品小売り
EVOLUTION MINING LTD	1,559	1,656	424	39,610	素材
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,381	1,472	2,938	274,501	素材
IDP EDUCATION LTD	177	189	573	53,537	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	2,127	2,262	1,108	103,567	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	374	400	1,184	110,656	素材
LOTTERY CORP LTD/THE	-	2,099	944	88,266	消費者サービス

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	オーストラリアドル	千円	
MACQUARIE GROUP LTD	282	322	5,789	540,766	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,421	2,599	735	68,706	保険
MINERAL RESOURCES LTD	141	149	1,246	116,471	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,698	2,816	8,634	806,548	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	691	807	1,539	143,773	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	925	1,045	1,045	97,648	素材
ORICA LTD	365	429	648	60,591	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,547	1,652	1,239	115,741	公益事業
QANTAS AIRWAYS LTD	870	949	558	52,137	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,240	1,334	1,655	154,621	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	164	169	1,058	98,829	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	48	51	621	58,063	メディア・娯楽
REECE LTD	250	217	325	30,449	資本財
RIO TINTO LTD	305	325	3,463	323,547	素材
SANTOS LTD	2,707	2,877	2,123	198,396	エネルギー
SEEK LTD	295	323	696	65,069	メディア・娯楽
SONIC HEALTHCARE LTD	387	416	1,328	124,095	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	3,898	4,159	1,626	151,921	素材
SUNCORP GROUP LTD	1,112	1,178	1,408	131,590	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	1,979	-	-	-	消費者サービス
TELSTRA GROUP LTD	3,724	4,019	1,583	147,932	電気通信サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	615	668	899	84,040	食品・飲料・タバコ
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	192	213	585	54,732	エネルギー
WESFARMERS LIMITED	940	1,001	4,765	445,182	小売
WESTPAC BANKING CORP	3,019	3,063	7,235	675,878	銀行
WISETECH GLOBAL LTD	123	132	779	72,775	ソフトウェア・サービス
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	809	1,647	6,244	583,256	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,008	1,071	3,715	347,059	食品・生活必需品小売り
XERO LTD	113	121	835	78,019	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	54,231 50	58,384 49	135,873 -	12,691,970 <2.1%>
<b>(香港)</b>			千香港ドル		
AIA GROUP LTD	9,804	10,356	78,814	1,414,726	保険
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,005	3,205	7,692	138,088	銀行
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,389	1,477	3,308	59,387	食品・飲料・タバコ
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,616	1,728	2,833	50,868	小売
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,624	1,734	8,132	145,985	不動産

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港ドル	千円		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,194	2,324	10,121	181,679	資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	560	565	2,189	39,299	公益事業	
CLP HOLDINGS LTD	1,351	1,436	8,216	147,484	公益事業	
ESR GROUP LIMITED	1,616	1,748	2,985	53,591	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,768	1,888	8,666	155,561	消費者サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,701	1,801	2,316	41,586	不動産	
HANG SENG BANK LTD	624	666	8,133	145,993	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,236	1,306	3,017	54,169	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	9,194	9,764	6,434	115,503	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	976	1,037	31,217	560,345	各種金融	
MTR CORP	1,377	1,472	5,514	98,988	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,299	1,379	2,650	47,581	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,150	1,220	4,804	86,234	公益事業	
SANDS CHINA LTD	1,981	2,125	4,170	74,866	消費者サービス	
SINO LAND CO	2,760	3,120	3,113	55,891	不動産	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1,140	1,200	1,800	32,310	運輸	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	1,075	1,255	11,453	205,598	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD	413	433	2,634	47,288	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD	1,000	1,094	1,921	34,483	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,110	1,180	10,926	196,136	資本財	
WH GROUP LTD	6,695	7,090	3,069	55,105	食品・飲料・タバコ	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,367	1,457	5,341	95,873	不動産	
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	1,460	1,560	2,137	38,362	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	61,492 28	65,627 28	243,620 -	4,372,991 <0.7%>	
<b>(シンガポール)</b>			千シンガポールドル			
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	2,151	2,286	827	84,466	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	366	380	310	31,688	不動産	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,462	1,553	5,519	563,361	銀行	
GENTING SINGAPORE LTD	4,867	5,341	461	47,155	消費者サービス	
KEPPEL CORP LTD	1,197	1,283	950	97,038	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,740	2,906	3,647	372,252	銀行	
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,119	1,199	657	67,065	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	649	739	693	70,828	各種金融	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	1,304	1,373	476	48,629	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,802	7,218	1,934	197,446	電気通信サービス	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	952	1,013	3,064	312,775	銀行	

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等		
			株数	株数		評価額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
<b>(シンガポール)</b>				シンガポールドル	千円		
UOL Group Limited		百株 391	百株 400	264	26,987	不動産	
VENTURE CORP LTD		222	242	425	43,399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,541	1,627	670	68,419	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額	25,763	27,560	19,903	2,031,514		
	銘柄数<比率>	14	14	-	<0.3%>		
<b>(ニュージーランド)</b>				千ニュージーランドドル			
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		1,089	1,186	939	80,974	運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		466	495	1,014	87,492	ヘルスケア機器・サービス	
MERCURY NZ LTD		562	605	342	29,545	公益事業	
MERIDIAN ENERGY LTD		1,037	1,108	520	44,898	公益事業	
RYMAN HEALTHCARE LTD		351	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,617	1,717	879	75,814	電気通信サービス	
小計	株数・金額	5,124	5,112	3,697	318,725		
	銘柄数<比率>	6	5	-	<0.1%>		
<b>(イギリス)</b>				千イギリスポンド			
3I GROUP PLC		777	821	1,078	179,669	各種金融	
ABRDN PLC		1,741	1,814	367	61,195	各種金融	
ADMIRAL GROUP PLC		158	154	323	53,913	保険	
ANGLO AMERICAN PLC		1,032	1,088	3,439	573,014	素材	
ANTOFAGASTA PLC		317	336	445	74,256	素材	
ASHTED GROUP PLC		360	379	1,903	317,103	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		288	305	468	78,098	食品・飲料・タバコ	
ASTRAZENECA PLC		1,255	1,333	14,557	2,425,107	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AUTO TRADER GROUP PLC-WI		763	802	455	75,818	メディア・娯楽	
AVEVA GROUP PLC		99	104	330	54,986	ソフトウェア・サービス	
AVIVA PLC		2,360	2,443	1,111	185,228	保険	
BAE SYSTEMS PLC		2,571	2,713	2,089	348,164	資本財	
BARCLAYS PLC		13,501	14,344	2,269	378,037	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		829	876	349	58,267	耐久消費財・アパレル	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT		92	97	362	60,465	耐久消費財・アパレル	
BP PLC		16,005	16,648	7,924	1,320,152	エネルギー	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,765	1,852	6,132	1,021,685	食品・飲料・タバコ	
BT GROUP PLC		7,257	6,001	736	122,767	電気通信サービス	
BUNZL PLC		274	292	885	147,540	資本財	
BURBERRY GROUP PLC		328	342	717	119,530	耐久消費財・アパレル	
COCA-COLA HBC AG-CDI		162	170	340	56,768	食品・飲料・タバコ	
COMPASS GROUP PLC		1,442	1,532	2,836	472,489	消費者サービス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
CRODA INTERNATIONAL PLC	113	119	828	138,009	素材
DCC PLC	80	85	371	61,939	資本財
DIAGEO PLC	1,889	1,967	7,228	1,204,168	食品・飲料・タバコ
ENTAIN PLC	473	501	671	111,894	消費者サービス
EXPERIAN PLC	747	790	2,282	380,224	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	178	183	1,811	301,747	資本財
GLENCORE PLC	8,021	8,454	4,276	712,368	素材
GSK PLC	4,079	3,499	4,788	797,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HALEON PLC	-	4,352	1,250	208,239	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC	308	325	725	120,806	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARGREAVES LANSDOWN PLC	286	302	253	42,171	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	140	139	199	33,289	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	16,478	17,295	8,282	1,379,824	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	764	776	1,646	274,218	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	1,222	1,270	751	125,259	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	148	158	749	124,936	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	131	139	547	91,191	商業・専門サービス
JD SPORTS FASHION PLC	2,064	2,158	258	43,006	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	156	158	322	53,654	素材
KINGFISHER PLC	1,674	1,702	419	69,809	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,833	5,147	1,345	224,162	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	57,428	59,774	2,713	452,084	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	266	283	2,305	384,156	各種金融
M&G PLC	2,146	2,322	460	76,729	各種金融
MELROSE INDUSTRIES PLC	3,555	3,760	491	81,938	資本財
MONDI PLC/WI	394	414	652	108,627	素材
NATIONAL GRID PLC	2,936	3,144	3,199	532,934	公益事業
NATWEST GROUP PLC	4,561	4,497	1,160	193,362	銀行
NEXT PLC	107	111	641	106,785	小売
NMC HEALTH PLC	47	47	0.005	0.791	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	396	494	335	55,874	食品・生活必需品小売り
PEARSON PLC	609	576	562	93,761	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	260	273	355	59,221	耐久消費財・アパレル
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	589	697	415	69,245	保険
PRUDENTIAL PLC	2,227	2,360	2,309	384,756	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	579	615	3,579	596,385	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,569	1,657	3,783	630,365	商業・専門サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
<b>(イギリス)</b>		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
RENTOKIL INITIAL PLC		1,512	1,607	859	143,127	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC		907	963	5,188	864,307	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		6,787	7,240	618	103,012	資本財
SAGE GROUP PLC		828	878	703	117,155	ソフトウェア・サービス
SAINSBURY (J) PLC		1,399	1,476	320	53,319	食品・生活必需品小売り
SCHRODERS PLC		100	626	287	47,938	各種金融
SEVERN TRENT PLC		206	220	601	100,208	公益事業
SHELL PLC-NEW		6,233	6,394	14,990	2,497,325	エネルギー
SMITH & NEPHEW PLC		713	750	801	133,522	ヘルスケア機器・サービス
SMITHS GROUP PLC		323	323	508	84,772	資本財
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		60	63	722	120,347	資本財
SSE PLC		864	918	1,557	259,538	公益事業
ST JAMES'S PLACE PLC		439	470	559	93,124	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC		2,110	2,160	1,256	209,339	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC		2,973	3,065	316	52,653	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC		6,193	6,511	1,506	250,901	食品・生活必需品小売り
UNILEVER PLC		2,081	2,195	8,872	1,477,994	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC		562	600	615	102,561	公益事業
VODAFONE GROUP PLC		22,283	23,152	2,255	375,672	電気通信サービス
WHITBREAD PLC		164	175	440	73,333	消費者サービス
WPP PLC		949	940	816	136,089	メディア・娯楽
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	232,548 79	245,752 80	154,903 -	25,805,447 <4.3%>	
<b>(イスラエル)</b>				千イスラエル・シケル		
AZRIELI GROUP		35	37	988	39,958	不動産
BANK HAPOALIM BM		921	1,094	3,604	145,660	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		1,172	1,327	4,311	174,211	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		-	1,833	1,125	45,464	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		21	22	1,538	62,187	資本財
ICL GROUP LTD		572	610	1,728	69,843	素材
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		935	1,062	2,116	85,508	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		115	133	1,756	70,957	銀行
NICE LTD		51	54	3,759	151,897	ソフトウェア・サービス
TOWER SEMICONDUCTOR LTD		-	94	1,424	57,579	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,825 8	6,271 10	22,353 -	903,269 <0.2%>	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
ABB LTD	1,330	1,412	4,134	608,182	資本財
ADECCO GROUP AG-REG	129	138	458	67,475	商業・専門サービス
ALCON INC	404	430	2,675	393,625	ヘルスケア機器・サービス
BACHEM HOLDING AG-REG B	24	28	233	34,302	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BALOISE HOLDING AG	37	39	547	80,492	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	3	597	87,873	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.85	0.91	908	133,593	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.09	0.09	889	130,801	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	422	448	5,217	767,481	耐久消費財・アパレル
CLARIANT AG	176	187	301	44,319	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,147	2,297	932	137,099	各種金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	5	403	59,332	素材
GEBERIT AG-REG	29	30	1,434	211,064	資本財
GIVAUDAN-REG	7	7	2,544	374,335	素材
HOLCIM LTD	423	476	2,293	337,340	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	178	190	1,000	147,209	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	44	47	1,064	156,612	運輸
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	139	147	824	121,251	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG	60	63	3,167	465,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA	2,280	2,420	26,842	3,948,498	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG	1,774	1,860	15,163	2,230,486	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDING AG	18	19	1,875	275,928	各種金融
ROCHE HOLDING AG	568	603	18,595	2,735,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG-BR	26	23	845	124,442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	17	22	378	55,678	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	31	33	584	85,908	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	4	5	1,260	185,388	商業・専門サービス
SIG GROUP AG	-	264	531	78,236	素材
SIKA AG-BEARER	114	125	3,072	451,935	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	43	45	1,157	170,197	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG	83	95	1,036	152,474	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG	21	23	580	85,378	耐久消費財・アパレル
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	25	27	1,362	200,430	保険
SWISS PRIME SITE-REG	64	68	559	82,345	不動産
SWISS RE AG	244	258	2,082	306,334	保険
SWISSCOM AG	21	22	1,143	168,254	電気通信サービス
TEMENOS GROUP AG-REG	54	54	319	46,931	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(スイス)</b>		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
THE SWATCH GROUP AG-REG		51	53	243	35,884	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG		2,845	3,020	5,281	776,911	各種金融
VAT GROUP AG		21	22	597	87,841	資本財
VIFOR PHARMA AG		39	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		121	129	5,715	840,759	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,040 41	15,158 41	118,858 -	17,484,066 <2.9%>	
<b>(デンマーク)</b>				千デンマーク・クローネ		
A P MOLLER - MAERSK A/S		4	4	6,518	126,918	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S		2	2	4,116	80,138	運輸
AMBU A/S-B		134	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG AS-B		80	83	7,613	148,227	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S		85	91	3,980	77,492	素材
COLOPLAST-B		96	101	9,019	175,608	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S		555	590	7,224	140,668	銀行
DEMANT A/S		86	76	1,561	30,399	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S		167	164	17,857	347,682	運輸
GENMAB A/S		53	56	17,649	343,634	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GN STORE NORD A/S		100	110	1,912	37,237	ヘルスケア機器・サービス
NOVO-NORDISK A/S		1,362	1,422	115,543	2,249,632	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S		166	175	7,050	137,279	素材
ORSTED A/S		153	162	10,353	201,574	公益事業
PANDORA A/S		80	76	3,881	75,565	耐久消費財・アパレル
ROCKWOOL A/S-B SHS		6	7	1,235	24,053	資本財
TRYGVESTA AS		296	312	5,082	98,951	保険
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		817	867	15,031	292,656	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,249 18	4,305 17	235,630 -	4,587,721 <0.8%>	
<b>(ノルウェー)</b>				千ノルウェー・クローネ		
ADEVINTA ASA-B		239	248	1,988	27,324	メディア・娯楽
AKER BP ASA		101	271	9,160	125,862	エネルギー
DNB BANK ASA		757	809	14,898	204,705	銀行
EQUINOR ASA		791	840	28,789	395,564	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		166	178	3,380	46,443	保険
KONGSBERG GRUPPEN ASA		-	77	2,941	40,419	資本財
MOWI ASA		356	355	5,341	73,394	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		1,076	1,143	8,145	111,914	素材



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(ノルウェー)</b>	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円		
ORKLA ASA	610	651	4,448	61,124	食品・飲料・タバコ	
SALMAR ASA	-	50	1,724	23,697	食品・飲料・タバコ	
SCHIBSTED ASA	53	-	-	-	メディア・娯楽	
SCHIBSTED ASA-B SHS	83	-	-	-	メディア・娯楽	
TELENOR ASA	601	636	6,249	85,864	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	133	142	6,541	89,873	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,971 12	5,407 12	93,609 -	1,286,189 <0.2%>	
<b>(スウェーデン)</b>			千スウェーデン・クローナ			
ALFA LAVAL AB	254	248	7,365	97,073	資本財	
ASSA ABLOY AB	816	865	20,746	273,433	資本財	
ATLAS COPCO AB	1,265	1,347	15,742	207,491	資本財	
ATLAS COPCO AB- A RDS	549	-	-	-	資本財	
ATLAS COPCO AB-A SHS	2,173	2,297	29,740	391,977	資本財	
ATLAS COPCO AB-B RDS	319	-	-	-	資本財	
BIOVITRUM	-	146	3,106	40,948	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOLIDEN AB	218	231	8,578	113,062	素材	
BOLIDEN AB-RED SHS	220	-	-	-	素材	
ELECTROLUX AB	183	191	2,721	35,867	耐久消費財・アパレル	
EMBRACER GROUP AB	450	581	2,671	35,204	メディア・娯楽	
EPIROC AB-A	529	561	10,625	140,041	資本財	
EPIROC AB-B	320	339	5,503	72,534	資本財	
EQT AB	238	252	6,106	80,484	各種金融	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	495	524	13,001	171,355	家庭用品・パーソナル用品	
EVOLUTION AB	138	156	15,632	206,034	消費者サービス	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	84	527	2,431	32,051	不動産	
GETINGE AB-B SHS	182	192	4,549	59,965	ヘルスケア機器・サービス	
HENNES & MAURITZ AB	590	626	7,375	97,211	小売	
HEXAGON AB-B SHS	1,578	1,673	20,263	267,073	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HOLMEN AB-B SHARES	-	81	3,419	45,062	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	333	350	2,804	36,959	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	100	52	1,389	18,311	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	137	200	5,323	70,169	各種金融	
INDUTRADE AB	-	235	5,131	67,627	資本財	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	117	123	2,592	34,169	資本財	
INVESTOR AB	1,457	1,547	29,640	390,659	各種金融	
INVESTOR AB-A SHS	413	447	8,912	117,470	各種金融	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
<b>(スウェーデン)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
KINNEVIK AB - B		192	209	3,285	43,297	各種金融
LIFCO AB-B SHS		186	196	3,596	47,407	資本財
LUNDBERGS AB-B SHS		62	65	3,080	40,595	各種金融
LUNDIN ENERGY AB		161	-	-	-	エネルギー
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		1,152	1,300	12,859	169,489	資本財
NORDEA BANK ABP		2,599	2,937	31,820	419,393	銀行
SAGAX AB-B		128	160	3,642	48,007	不動産
SANDVIK AB		912	915	17,468	230,229	資本財
SECURITAS AB		253	260	2,353	31,017	商業・専門サービス
SINCH AB		419	-	-	-	ソフトウェア・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		1,324	1,404	16,595	218,731	銀行
SKANSKA AB-B SHS		278	296	5,367	70,742	資本財
SKF AB		308	328	5,687	74,958	資本財
SVENSKA CELLULOSA AB		491	522	7,250	95,567	素材
SVENSKA HANDELSBANKEN		1,193	1,264	13,422	176,913	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES		734	778	12,919	170,280	銀行
SWEDISH MATCH AB		1,277	1,308	15,065	198,567	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB		428	507	4,732	62,372	電気通信サービス
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON		2,360	2,509	16,291	214,720	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB		2,291	2,371	6,930	91,349	電気通信サービス
VOLVO AB		1,119	1,268	24,361	321,082	資本財
VOLVO AB-A SHS		196	200	4,058	53,486	資本財
VOLVO CAR AB-B		-	512	2,598	34,247	自動車・自動車部品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	31,244 47	33,126 46	448,763 -	5,914,700 <1.0%>	
<b>(ユーロ/アイルランド)</b>				千ユーロ		
CRH PLC		624	654	2,490	360,610	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.		134	143	1,912	277,017	消費者サービス
KERRY GROUP PLC-A		128	136	1,257	182,090	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC		124	132	770	111,595	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		198	210	739	107,029	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,210 5	1,277 5	7,170 -	1,038,342 <0.2%>	
<b>(ユーロ/オランダ)</b>						
ABN AMRO BANK NV		341	360	420	60,943	銀行
ADYEN NV		16	18	2,833	410,278	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ/オランダ)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
AEGON NV	1,427	1,523	716	103,745	保険
AIRBUS SE	477	508	5,824	843,381	資本財
AKZO NOBEL NV	151	155	1,091	158,081	素材
ASM INTERNATIONAL NV	37	40	1,012	146,661	半導体・半導体製造装置
ASML HOLDING NV	334	349	19,969	2,891,835	半導体・半導体製造装置
CNH INDUSTRIAL NV	823	880	1,310	189,824	資本財
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	422	449	450	65,252	食品・飲料・タバコ
EURONEXT NV	69	75	526	76,287	各種金融
EXOR NV	87	94	701	101,552	各種金融
FERRARI NV	102	108	2,262	327,664	自動車・自動車部品
HEINEKEN HOLDING NV	94	86	618	89,583	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN NV	210	222	1,952	282,706	食品・飲料・タバコ
IMCD NV	46	49	672	97,416	資本財
ING GROEP NV-CVA	3,155	3,348	3,829	554,574	銀行
INPOST SA	173	-	-	-	運輸
JDE PEET'S BV	82	86	244	35,430	食品・飲料・タバコ
JUST EAT TAKEAWAY	147	158	339	49,094	小売
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	842	893	2,465	356,997	食品・生活必需品小売り
KONINKLIJKE DSM NV	141	150	1,916	277,466	素材
KONINKLIJKE PHILIPS NV	741	755	1,036	150,157	ヘルスケア機器・サービス
NN GROUP NV	217	237	1,008	145,969	保険
OCI NV	-	91	326	47,275	素材
PROSUS	755	713	4,211	609,840	小売
QIAGEN NV	187	196	909	131,749	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD NV	96	101	557	80,800	商業・専門サービス
ROYAL KPN NV	2,798	2,931	821	118,955	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	551	586	2,171	314,400	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	587	623	1,292	187,165	メディア・娯楽
WOLTERS KLUWER NV	212	225	2,305	333,864	商業・専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,333 30	16,024 30	63,800 -	9,238,959 <1.5%>
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>					
AGEAS	138	137	520	75,443	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	703	747	4,003	579,723	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE	37	47	1,691	244,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT NV	41	-	-	-	食品・生活必需品小売り
D'IETEREN GROUP	-	21	372	53,989	小売

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円		
ELIA GROUP SA/NV	25	28	389	56,388	公益事業	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	90	89	700	101,484	各種金融	
KBC GROEP NV	201	213	1,119	162,091	銀行	
PROXIMUS	131	141	150	21,856	電気通信サービス	
SOFINA	11	12	282	40,839	各種金融	
SOLVAY SA	60	63	626	90,705	素材	
UCB SA	102	108	806	116,730	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UMICORE	159	179	613	88,827	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,704 12	1,790 12	11,276 -	1,632,971 <0.3%>	
<b>(ユーロ/ルクセンブルグ)</b>						
ARCELORMITTAL	512	446	1,118	161,962	素材	
TENARIS SA	378	405	666	96,470	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	890 2	851 2	1,784 -	258,432 <0.0%>	
<b>(ユーロ/フランス)</b>						
ACCOR	137	147	361	52,365	消費者サービス	
ADP	27	29	421	60,972	運輸	
AIR LIQUIDE	384	450	6,153	891,021	素材	
ALSTOM RGPT	257	274	671	97,221	資本財	
AMUNDI SA	50	52	283	41,012	各種金融	
ARKEMA	48	50	434	62,905	素材	
AXA SA	1,571	1,603	4,341	628,746	保険	
BIOMERIEUX	33	35	349	50,557	ヘルスケア機器・サービス	
BNP PARIBAS	908	952	5,077	735,204	銀行	
BOLLORE SE	728	765	388	56,219	メディア・娯楽	
BOUYGUES	186	202	584	84,612	資本財	
BUREAU VERITAS SA	241	256	667	96,588	商業・専門サービス	
CAPGEMINI SA	129	140	2,506	363,004	ソフトウェア・サービス	
CARREFOUR SA	498	515	837	121,253	食品・生活必需品小売り	
CIE DE SAINT-GOBAIN	409	427	1,893	274,177	資本財	
CNP ASSURANCES	137	-	-	-	保険	
CREDIT AGRICOLE SA	1,003	1,029	998	144,629	銀行	
DANONE	529	552	2,755	399,001	食品・飲料・タバコ	
DASSAULT AVIATION SA	19	21	315	45,655	資本財	
DASSAULT SYSTEMES SA	538	573	2,077	300,899	ソフトウェア・サービス	
EDENRED	204	216	1,104	159,969	ソフトウェア・サービス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
EDF	382	484	578	83,767	公益事業
EIFFAGE	68	72	680	98,509	資本財
ENGIE	1,481	1,571	2,259	327,181	公益事業
ESSILORLUXOTTICA	233	247	4,298	622,499	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO	32	37	224	32,448	各種金融
EUROFINS SCIENTIFIC	108	115	767	111,101	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FAURECIA	98	-	-	-	自動車・自動車部品
GETLINK SE - REGR	401	411	650	94,160	運輸
HERMES INTERNATIONAL	25	27	4,004	579,859	耐久消費財・アパレル
IPSEN	30	32	335	48,569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KERING	60	64	3,544	513,224	耐久消費財・アパレル
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	75	88	317	45,913	消費者サービス
LEGRAND SA	217	230	1,831	265,286	資本財
L'OREAL SA	203	207	7,212	1,044,511	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	224	238	16,668	2,413,711	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	136	581	1,526	221,120	自動車・自動車部品
ORANGE S.A.	1,650	1,751	1,717	248,670	電気通信サービス
ORPEA	41	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
PERNOD-RICARD	169	180	3,344	484,257	食品・飲料・タバコ
PUBLICIS GROUPE	183	195	1,213	175,658	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	18	19	318	46,088	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	154	165	548	79,372	自動車・自動車部品
SAFRAN SA	276	294	3,374	488,695	資本財
SANOFI	921	979	8,426	1,220,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	22	23	784	113,633	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	437	466	6,636	960,970	資本財
SEB SA	22	21	161	23,328	耐久消費財・アパレル
SOCIETE GENERALE	650	677	1,627	235,699	銀行
SODEXO	71	76	677	98,137	消費者サービス
TELEPERFORMANCE	47	50	1,131	163,784	商業・専門サービス
THALES SA	85	91	1,072	155,297	資本財
TOTALENERGIES SE	2,029	2,130	12,227	1,770,650	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT	75	81	210	30,414	メディア・娯楽
VALEO SA	186	176	322	46,730	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	530	572	1,420	205,705	公益事業
VINCI SA	436	460	4,398	636,939	資本財

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ/フランス)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
VIVENDI SA		623	616	520	75,440	メディア・娯楽
WENDEL		23	23	207	30,022	各種金融
WORLDLINE SA		193	205	909	131,685	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	20,682	21,967	128,370	18,589,285	
	銘柄数<比率>	60	57	-	<3.1%>	
<b>(ユーロ/ドイツ)</b>						
ADIDAS AG		154	148	1,919	277,947	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE		330	351	7,160	1,036,850	保険
AROUNDTOWN SA		828	874	217	31,516	不動産
BASF SE		743	788	3,911	566,495	素材
BAYER AG		796	845	4,547	658,533	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		267	284	2,390	346,099	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		46	50	407	58,963	自動車・自動車部品
BECHTLE AG		65	70	257	37,224	ソフトウェア・サービス
BEIERSDORF AG		81	86	887	128,589	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG SE		124	132	869	125,898	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		32	34	454	65,829	ヘルスケア機器・サービス
COMMERZBANK AG		807	905	730	105,739	銀行
CONTINENTAL AG		88	93	531	76,991	自動車・自動車部品
COVESTRO AG		154	163	592	85,737	素材
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		332	388	1,169	169,305	資本財
DELIVERY HERO SE		132	140	621	90,004	小売
DEUTSCHE BANK AG		1,671	1,769	1,806	261,670	各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG		154	164	2,794	404,729	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG		484	520	381	55,253	運輸
DEUTSCHE POST AG		807	860	3,329	482,189	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG		2,644	2,803	5,419	784,852	電気通信サービス
E.ON SE		1,819	1,933	1,762	255,239	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG		169	177	345	50,061	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA		339	358	875	126,804	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD		55	-	-	-	素材
GEA GROUP AG		123	130	520	75,398	資本財
HANNOVER RUECK SE		48	51	917	132,895	保険
HEIDELBERGCEMENT AG		120	120	623	90,296	素材
HELLOFRESH SE		132	139	334	48,374	食品・生活必需品小売り
HENKEL AG & CO KGAA		86	97	610	88,455	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG		142	147	986	142,803	家庭用品・パーソナル用品

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ/ドイツ)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,057	1,122	3,602	521,622	半導体・半導体製造装置
KION GROUP AG	58	60	164	23,863	資本財
KNORR-BREMSE AG	59	62	340	49,240	資本財
LANXESS	64	-	-	-	素材
LEG IMMOBILIEN SE	59	62	396	57,390	不動産
MERCEDES-BENZ GROUP AG	691	688	4,285	620,569	自動車・自動車部品
MERCK KGAA	104	111	1,955	283,222	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	43	45	886	128,314	資本財
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	112	120	3,524	510,437	保険
NEMETSCHKE SE	46	49	230	33,410	ソフトウェア・サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	123	129	765	110,841	自動車・自動車部品
PUMA AG	85	90	466	67,510	耐久消費財・アパレル
RATIONAL AG	4	4	257	37,250	資本財
RHEINMETALL AG	-	37	670	97,130	資本財
RWE AG	518	554	2,285	331,023	公益事業
SAP SE	845	898	9,447	1,368,088	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	21	20	787	113,972	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCOUT24 SE	67	69	381	55,270	メディア・娯楽
SIEMENS AG	619	657	8,715	1,262,123	資本財
SIEMENS ENERGY AG	323	377	553	80,160	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	228	242	1,265	183,225	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG	108	114	1,278	185,190	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	926	986	234	33,953	電気通信サービス
UNIPER SE	75	80	43	6,337	公益事業
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	80	86	169	24,490	電気通信サービス
VOLKSWAGEN AG	27	25	489	70,927	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG	149	159	2,260	327,369	自動車・自動車部品
VONOVIA SE	599	617	1,503	217,722	不動産
ZALANDO SE	179	189	567	82,115	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	21,070 59	22,297 58	94,907 -	13,743,527 <2.3%>
<b>(ユーロ/ポルトガル)</b>					
EDP RENOVAVEIS SA	230	245	547	79,259	公益事業
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,250	2,396	1,062	153,833	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	410	432	486	70,431	エネルギー
JERONIMO MARTINS	225	240	492	71,319	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,117 4	3,315 4	2,588 -	374,843 <0.1%>

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(ユーロ/スペイン)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円		
ACCIONA SA	-	20	378	54,755	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	192	201	532	77,152	資本財	
AENA SME SA	64	68	826	119,739	運輸	
AMADEUS IT GROUP SA	364	388	1,929	279,470	ソフトウェア・サービス	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	5,374	5,689	3,099	448,828	銀行	
BANCO SANTANDER SA	13,993	14,551	3,792	549,148	銀行	
CAIXABANK	3,550	3,771	1,281	185,530	銀行	
CELLNEX TELECOM SAU	416	468	1,561	226,127	電気通信サービス	
ENAGAS SA	203	219	379	54,932	公益事業	
ENDESA SA	255	270	504	73,074	公益事業	
FERROVIAL S.A.	402	425	1,059	153,421	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	406	-	-	-	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	-	435	19	2,835	資本財	
GRIFOLS SA	242	256	249	36,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA	4,709	5,108	5,409	783,346	公益事業	
INDITEX SA	880	936	2,257	326,980	小売	
NATURGY ENERGY GROUP SA	154	125	336	48,735	公益事業	
RED ELECTRICA DE ESPANA	350	348	603	87,376	公益事業	
REPSOL SA	1,158	1,232	1,699	246,132	エネルギー	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	192	205	371	53,739	資本財	
TELEFONICA SA	4,305	4,545	1,609	233,086	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	37,220 19	39,269 20	27,902 -	4,040,497 <0.7%>	
<b>(ユーロ/イタリア)</b>						
AMPLIFON SPA	99	106	293	42,507	ヘルスケア機器・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	891	949	1,637	237,195	保険	
ATLANTIA SPA	417	437	1,004	145,458	運輸	
DIASORIN ITALIA SPA	20	21	283	41,013	ヘルスケア機器・サービス	
ENEL SPA	6,581	6,983	3,601	521,530	公益事業	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	2,040	2,159	3,063	443,637	エネルギー	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,644	1,880	2,709	392,364	自動車・自動車部品	
FINCOBANK SPA	491	518	777	112,628	銀行	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	291	311	296	42,891	電気通信サービス	
INTESA SANPAOLO	13,358	14,122	3,129	453,195	銀行	
MEDIOBANCA SPA	500	518	527	76,453	銀行	
MONCLER SPA	165	175	875	126,819	耐久消費財・アパレル	
NEXI SPA	423	450	388	56,289	ソフトウェア・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	444	476	457	66,275	保険	
PRYSMIAN SPA	205	219	715	103,647	資本財	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	84	90	355	51,546	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
<b>(ユーロ/イタリア)</b>						
SNAM SPA	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELECOM ITALIA SPA	1,626	1,754	836	121,195	公益事業	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	8,152	8,810	196	28,451	電気通信サービス	
UNICREDIT SPA	1,139	1,213	887	128,514	公益事業	
	1,706	1,774	2,324	336,675	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	40,285 20	42,973 20	24,364 -	3,528,291 <0.6%>	
<b>(ユーロ/フィンランド)</b>						
ELISA OYJ	120	125	622	90,085	電気通信サービス	
FORTUM OYJ	358	382	576	83,465	公益事業	
KESKO OYJ-B SHS	217	230	484	70,195	食品・生活必需品小売り	
KONE OYJ	276	292	1,383	200,314	資本財	
NESTE OYJ	339	361	1,634	236,655	エネルギー	
NOKIA OYJ	4,359	4,646	2,182	315,981	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ORION OYJ-CLASS B	85	91	432	62,614	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAMPO OYJ	403	412	1,972	285,681	保険	
STORA ENSO OYJ	464	468	663	96,016	素材	
UPM-KYMMENE OYJ	431	458	1,577	228,398	素材	
WARTSILA OYJ	380	402	326	47,327	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,438 11	7,873 11	11,855 -	1,716,737 <0.3%>	
<b>(ユーロ/オーストリア)</b>						
ERSTE GROUP BANK AG	278	293	859	124,500	銀行	
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	54	58	515	74,648	公益事業	
OMV AG	116	124	604	87,545	エネルギー	
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	117	-	-	-	銀行	
VOESTALPINE AG	92	93	239	34,751	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	659 5	570 4	2,219 -	321,446 <0.1%>	
<b>(ユーロ/その他)</b>						
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	166	176	525	76,129	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	166 1	176 1	525 -	76,129 <0.0%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	149,777 228	158,388 224	376,765 -	54,559,464 <9.1%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	878,235 1,222	954,236 1,210	- -	565,772,218 <94.1%>	

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	□数	□数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	千□	千□	千米ドル	千円	
(アメリカ)					
BOSTON PROPERTIES INC	12	12	902	126,744	
CROWN CASTLE INC	35	37	5,057	709,826	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11	13	1,998	280,525	
PROLOGIS INC	59	79	9,077	1,274,102	
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	118	37	746	104,737	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11	11	2,027	284,637	
CAMDEN PROPERTY TRUST	8	8	988	138,792	
DUKE REALTY CORP	30	—	—	—	
EQUITY RESIDENTIAL	28	30	1,931	271,036	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	5	1,180	165,748	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	43	46	1,143	160,434	
WELLTOWER INC	35	38	2,641	370,811	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	58	61	1,131	158,852	
KIMCO REALTY CORP	49	53	1,174	164,865	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9	9	1,559	218,956	
PUBLIC STORAGE	12	13	3,982	558,920	
REGENCY CENTERS CORP	12	13	864	121,273	
SIMON PROPERTY GROUP INC	26	28	3,324	466,649	
SUN COMMUNITIES INC	9	10	1,492	209,465	
UDR INC	24	27	1,096	153,875	
VENTAS INC	32	34	1,510	211,982	
VORNADO REALTY TRUST	13	14	339	47,714	
WP CAREY INC	14	16	1,318	185,107	
REALTY INCOME CORP	45	51	3,349	470,129	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14	15	988	138,717	
EXTRA SPACE STORAGE INC	10	11	1,820	255,526	
DIGITAL REALTY TRUST INC	22	24	2,701	379,247	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	48	51	634	89,014	
IRON MOUNTAIN INC	23	24	1,306	183,395	
AGNC INVESTMENT CORP	42	—	—	—	
AMERICAN TOWER REIT INC	36	39	8,472	1,189,222	
EQUINIX INC	7	7	5,062	710,607	
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPOR	—	32	639	89,825	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	—	26	853	119,820	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	—	21	1,097	154,047	
SBA COMMUNICATIONS CORP	8	9	2,692	377,888	
INVITATION HOMES INC	48	52	1,632	229,196	
VICI PROPERTIES INC	50	82	2,668	374,581	
小計	□数・金額	1,022	1,056	79,412	11,146,282
	銘柄数<比率>	35	36	—	<1.9%>

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
<b>(カナダ)</b>		千□	千□	千カナダ・ドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		6	7	317	33,305
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		12	13	277	29,117
小計	□数・金額	19	20	595	62,423
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>
<b>(オーストラリア)</b>				千オーストラリア・ドル	
GPT GROUP		172	187	803	75,062
GOODMAN GROUP		139	148	2,717	253,874
STOCKLAND		209	228	836	78,181
MIRVAC GROUP		347	373	791	73,946
VICINITY CENTRES		338	372	713	66,604
SCENTRE GROUP		441	482	1,381	129,028
DEXUS/AU		96	106	802	74,950
小計	□数・金額	1,745	1,898	8,046	751,647
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>
<b>(香港)</b>				千香港ドル	
LINK REIT		170	183	10,098	181,263
小計	□数・金額	170	183	10,098	181,263
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>
<b>(シンガポール)</b>				千シンガポール・ドル	
CAPITALAND ASCENDAS REIT		273	287	791	80,783
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		395	455	924	94,399
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		253	273	451	46,078
CDL HOSPITALITY TRUSTS		5	—	—	—
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR		172	199	348	35,599
小計	□数・金額	1,101	1,216	2,516	256,860
	銘柄数<比率>	5	4	—	<0.0%>
<b>(イギリス)</b>				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		71	74	302	50,465
LAND SECURITIES GROUP PLC		57	59	372	62,018
SEGRO PLC		96	102	852	142,064
小計	□数・金額	225	236	1,527	254,548
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>				千ユーロ	
WAREHOUSES DE PAUW SCA		—	12	331	48,011
小計	□数・金額	—	12	331	48,011
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.0%>

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	□数	□数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	
KLEPIERRE	16	18	407	59,060	
GECINA SA	3	3	359	52,024	
COVIVIO	4	3	218	31,594	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10	10	520	75,390	
小計	□数・金額	34	36	1,505	218,068
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
ユーロ計	□数・金額	34	48	1,837	266,080
	銘柄数<比率>	4	5	—	<0.0%>
合計	□数・金額	4,319	4,659	—	12,919,106
	銘柄数<比率>	57	58	—	<2.1%>

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

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

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
外 S&P 500 EMINI FUTURE	13,108	—
国 FTSE 100	1,305	—
DJ EURO STOXX 50	3,283	—

(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	565,772,218	93.2
投資信託証券	12,919,106	2.1
コール・ローン等、その他	28,190,825	4.6
投資信託財産総額	606,882,149	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1カナダ・ドル104.82円、1オーストラリア・ドル93.41円、1香港ドル17.95円、1シンガポール・ドル102.07円、1ニュージーランド・ドル86.21円、1イギリス・ポンド166.59円、1イスラエル・シェケル40.408円、1スイス・フラン147.10円、1デンマーク・クローネ19.47円、1ノルウェー・クローネ13.74円、1スウェーデン・クローナ13.18円、1ユーロ144.81円です。

(注2) 外貨建純資産 (589,615,254千円) の投資信託財産総額 (606,882,149千円) に対する比率は97.2%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>622,328,238,403円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	18,364,308,361
株 式(評価額)	565,772,218,149
投 資 信 託 証 券(評価額)	12,919,106,397
未 収 入 金	16,446,812,968
未 収 配 当 金	700,778,656
差 入 委 託 証 拠 金	8,125,013,872
<b>(B)負債</b>	<b>20,875,843,929</b>
未 払 金	15,836,185,046
未 払 解 約 金	5,039,648,281
そ の 他 未 払 費 用	10,602
<b>(C)純 資 産 総 額(A - B)</b>	<b>601,452,394,474</b>
元 本	196,274,174,923
次 期 繰 越 損 益 金	405,178,219,551
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>196,274,174,923口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C / D)</b>	<b>30,643円</b>

(注1) 期首元本額	185,334,551,926円
期中追加設定元本額	24,836,221,270円
期中一部解約元本額	13,896,598,273円
(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペビーフンド別内訳は、次の通りです。	
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	825,022,663円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,718,273,868円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,185,594,884円
DCニッセイ外国株式インデックスA(適格機関投資家限定)	2,032,763,097円
ニッセイ外国株式インデックスA(適格機関投資家限定)	1,412,743円
ニッセイインデックスプラス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	6,943,163円
ニッセイインデックスプラス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	7,433,298円
ニッセイ外国株式インデックスファンドII(適格機関投資家限定)	3,496,818,251円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	142,849,511,480円
DCニッセイ外国株式インデックス	33,441,839,240円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
バランスファンド(4資産均等型)	2,076,464,020円
DCニッセイターゲットデットファンド2055	294,419,641円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	178,471,014円
DCニッセイターゲットデットファンド2045	330,717,293円
DCニッセイターゲットデットファンド2035	616,417,169円
DCニッセイターゲットデットファンド2025	16,828,661円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
バランスファンド(6資産均等型)	87,947,391円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,246,980円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	8,988,067円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	3,838,200円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス	
バランスファンド(8資産均等型)	21,274,392円
DCニッセイターゲットデットファンド2060	213,426,091円
DCニッセイターゲットデットファンド2050	140,608,871円
DCニッセイターゲットデットファンド2040	304,173,587円
DCニッセイターゲットデットファンド2030	219,200,953円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定)	195,635,840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	199,656,819円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適格機関投資家限定)	197,031,619円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01(適格機関投資家限定)	193,095,563円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05(適格機関投資家限定)	193,060,286円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08(適格機関投資家限定)	173,825,784円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)	28,452,808円
ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	979,463,778円
FWニッセイ先進国株式インデックス	17,645,667円
DCニッセイターゲットデットファンド2065	11,671,742円

### 損益の状況

当期(2022年5月21日~2022年11月21日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>5,060,935,024円</b>
受 取 配 当 金	5,013,437,177
受 取 利 息	13,899,753
受 取 そ の 他 収 益	35,946,992
支 払 利 息	△ 2,348,898
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>54,816,002,381</b>
売 買 損 益	86,284,932,039
売 買 損 益	△ 31,468,929,658
<b>(C)先 物 取 引 等 損 益</b>	<b>△ 172,058,869</b>
取 引 損 益	2,235,089,847
取 引 損 益	△ 2,407,148,716
<b>(D)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 61,945,344</b>
<b>(E)当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>59,642,933,192</b>
<b>(F)前期繰越損益金</b>	<b>324,872,915,991</b>
<b>(G)追加信託差損益金</b>	<b>48,473,060,431</b>
<b>(H)解約差損益金</b>	<b>△ 27,810,690,063</b>
<b>(I)合 計(E + F + G + H)</b>	<b>405,178,219,551</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(I)</b>	<b>405,178,219,551</b>

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

# ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

## 運用報告書

### 第 6 期

(計算期間：2021年3月11日～2022年3月10日)

#### 運用方針

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

#### 主要運用 対象

国内の公社債

#### 運用方法

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



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3月11日～2022年3月10日

## 国内債券市況

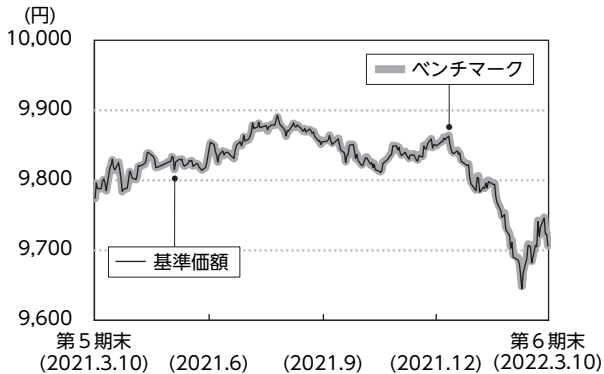


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は上昇しました。

期初以降、新型コロナウイルスの感染拡大を受けたまん延防止等重点措置の発令や緊急事態宣言の延長に加えて、5月には軟調な米経済指標を受けて米国の早期テーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）観測が後退したことなどから金利は低下基調が続きました。しかし、8月下旬に米連邦準備制度理事会（FRB）副議長がテーパリングに言及したことから、米金利の上昇とともに国内金利も上昇し、その後も原油価格をはじめとした商品価格の上昇や世界的なインフレ懸念から海外金利が上昇したことで国内金利も上昇しました。11月にオミクロン型の出現により投資家のリスク回避姿勢が強まり、金利は再度低下基調に転じる場面もありましたが、12月下旬以降は米国においてオミクロン型への懸念が後退したことやFRBの高官から金融引き締めに積極的な発言が相次いだことで早期利上げ観測が高まったこと、商品価格の上昇を受けて日銀の物価見通しが上方修正され金融政策正常化が早まるとの観測が高まったことなどから金利は大きく上昇しました。しかし、2月中旬以降はロシア・ウクライナ情勢の緊迫化から金利の上昇基調は途絶えました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 期初から2021年8月下旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大懸念などから金利が低下（債券価格は上昇）したこと

#### <下落要因>

- ・ 2021年8月下旬から10月下旬にかけて、米国の金融政策引き締め観測や世界的なインフレ懸念から海外金利が上昇し、国内金利も上昇したこと
- ・ 2021年12月下旬から2022年2月中旬にかけて、米国において新型コロナウイルスの新たな変異型（オミクロン型）への懸念が後退したことや、日米の金融政策が早期引き締め方向になるとの観測が高まったことなどから国内金利が上昇したこと

## ポートフォリオ

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

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

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

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-0.7%となり、ベンチマーク騰落率（-0.7%）に連動しました。

## 今後の運用方針

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



最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	債券組入比率	純資産総額
	円	%		%	%	百万円
2期(2018年3月12日)	9,687	1.1	9,688	1.1	99.1	126,324
3期(2019年3月11日)	9,828	1.5	9,825	1.4	99.2	91,526
4期(2020年3月10日)	9,979	1.5	9,970	1.5	99.3	82,399
5期(2021年3月10日)	9,774	△2.1	9,767	△2.0	99.2	80,558
6期(2022年3月10日)	9,706	△0.7	9,699	△0.7	99.2	78,005

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	債券組入比率
	円	%		%	%
(期首)2021年3月10日	9,774	—	9,767	—	99.2
3月末	9,801	0.3	9,793	0.3	98.0
4月末	9,819	0.5	9,812	0.5	99.2
5月末	9,824	0.5	9,816	0.5	99.1
6月末	9,831	0.6	9,823	0.6	99.4
7月末	9,879	1.1	9,872	1.1	99.2
8月末	9,871	1.0	9,863	1.0	99.1
9月末	9,837	0.6	9,829	0.6	99.2
10月末	9,825	0.5	9,819	0.5	99.2
11月末	9,849	0.8	9,842	0.8	99.1
12月末	9,827	0.5	9,822	0.6	99.2
2022年1月末	9,757	△0.2	9,751	△0.2	99.2
2月末	9,707	△0.7	9,702	△0.7	99.1
(期末)2022年3月10日	9,706	△0.7	9,699	△0.7	99.2

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2021年3月11日～2022年3月10日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（9,822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3月11日～2022年3月10日

## 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	22,020,128	20,987,458
	地方債証券	527,625	1,769,452
	特殊債券	1,875,857	3,232,591
	社債券	2,053,600	( 179,196)
			1,521,364

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

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

## 主要な売買銘柄

2021年3月11日～2022年3月10日

## 公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第70回 利付国債(20年)	995,861	第133回 住宅金融支援機構債券	1,011,410
第35回 利付国債(30年)	912,442	第70回 利付国債(20年)	846,571
第363回 利付国債(10年)	659,294	第35回 利付国債(30年)	835,452
第430回 利付国債(2年)	634,493	第328回 利付国債(10年)	785,879
第431回 利付国債(2年)	633,219	第110回 利付国債(20年)	708,229
第427回 利付国債(2年)	617,325	第327回 利付国債(10年)	598,009
第426回 利付国債(2年)	614,377	第190回 政保道路機構債券	505,465
第364回 利付国債(10年)	609,682	第127回 利付国債(20年)	452,839
第429回 利付国債(2年)	601,346	第358回 利付国債(10年)	418,718
第428回 利付国債(2年)	600,417	第48回 地方公共団体金融機構債券	404,540

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

## 組入有価証券明細表

2022年3月10日現在

## 国内(邦貨建)公社債

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	58,011,000	61,599,040	79.0	-	57.9	13.9	7.1
	(18,035,000)	(17,728,955)	(22.7)	-	(14.3)	(2.1)	(6.3)
地方債証券	4,481,000	4,688,555	6.0	-	2.7	1.8	1.6
	(4,481,000)	(4,688,555)	(6.0)	-	(2.7)	(1.8)	(1.6)
特殊債券 (除く金融債券)	5,271,466	5,542,760	7.1	-	4.6	1.8	0.7
	(5,271,466)	(5,542,760)	(7.1)	-	(4.6)	(1.8)	(0.7)
金融債券	500,000	499,981	0.6	-	-	0.4	0.3
	(500,000)	(499,981)	(0.6)	-	-	(0.4)	(0.3)
社債券	5,000,000	5,078,869	6.5	-	1.1	4.0	1.4
	(5,000,000)	(5,078,869)	(6.5)	-	(1.1)	(4.0)	(1.4)
合計	73,263,466	77,409,206	99.2	-	66.3	21.9	11.0
	(33,287,466)	(33,539,122)	(43.0)	-	(22.7)	(10.1)	(10.2)

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

(注2) ( )内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(国内公社債の内訳)

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第423回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/4/1	510,000	510,428
	第424回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/5/1	150,000	150,136
	第425回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/6/1	272,000	272,247
	第426回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/7/1	513,000	513,466
	第427回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/8/1	516,000	516,500
	第428回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/9/1	599,000	599,616
	第429回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/10/1	600,000	600,654
	第430回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/11/1	633,000	633,670
	第431回 利付国債 (2年)	0.0050	2023/12/1	632,000	632,650
	第432回 利付国債 (2年)	0.0050	2024/1/1	300,000	300,270
	第433回 利付国債 (2年)	0.0050	2024/2/1	200,000	200,170
	第137回 利付国債 (5年)	0.1000	2023/9/20	37,000	37,090
	第138回 利付国債 (5年)	0.1000	2023/12/20	81,000	81,208
	第139回 利付国債 (5年)	0.1000	2024/3/20	70,000	70,198
	第140回 利付国債 (5年)	0.1000	2024/6/20	259,000	259,766
	第141回 利付国債 (5年)	0.1000	2024/9/20	463,000	464,463
	第144回 利付国債 (5年)	0.1000	2025/6/20	512,000	513,930
	第145回 利付国債 (5年)	0.1000	2025/9/20	80,000	80,310
	第146回 利付国債 (5年)	0.1000	2025/12/20	80,000	80,332
	第150回 利付国債 (5年)	0.0050	2026/12/20	200,000	199,904
	第1回 利付国債 (40年)	2.4000	2048/3/20	90,000	123,817
	第2回 利付国債 (40年)	2.2000	2049/3/20	113,000	150,323
	第3回 利付国債 (40年)	2.2000	2050/3/20	490,000	655,286
	第4回 利付国債 (40年)	2.2000	2051/3/20	157,000	211,262
	第5回 利付国債 (40年)	2.0000	2052/3/20	159,000	206,692
	第6回 利付国債 (40年)	1.9000	2053/3/20	164,000	210,144
	第7回 利付国債 (40年)	1.7000	2054/3/20	177,000	218,166
	第8回 利付国債 (40年)	1.4000	2055/3/20	167,000	192,420
	第9回 利付国債 (40年)	0.4000	2056/3/20	333,000	287,012
	第10回 利付国債 (40年)	0.9000	2057/3/20	291,000	293,342
	第11回 利付国債 (40年)	0.8000	2058/3/20	249,000	243,218
	第12回 利付国債 (40年)	0.5000	2059/3/20	106,000	93,446
	第13回 利付国債 (40年)	0.5000	2060/3/20	170,000	149,254
第14回 利付国債 (40年)	0.7000	2061/3/20	136,000	127,774	
第329回 利付国債 (10年)	0.8000	2023/6/20	184,000	186,044	
第330回 利付国債 (10年)	0.8000	2023/9/20	3,000	3,039	
第332回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/12/20	138,000	139,570	
第333回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/3/20	92,000	93,183	

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第334回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/ 6 /20	496,000	503,117
	第335回 利付国債 (10年)	0.5000	2024/ 9 /20	243,000	246,227
	第337回 利付国債 (10年)	0.3000	2024/12/20	310,000	312,755
	第338回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 3 /20	357,000	361,480
	第339回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 6 /20	536,000	543,289
	第340回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 9 /20	566,000	574,190
	第341回 利付国債 (10年)	0.3000	2025/12/20	552,000	558,463
	第342回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 3 /20	510,000	512,152
	第343回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 6 /20	461,000	463,069
	第344回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 9 /20	533,000	535,291
	第345回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/12/20	532,000	534,154
	第346回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 3 /20	523,000	525,227
	第347回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 6 /20	433,000	434,822
	第348回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 9 /20	499,000	501,065
	第349回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/12/20	570,000	572,297
	第350回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 3 /20	744,000	746,901
	第351回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 6 /20	570,000	572,319
	第352回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/ 9 /20	556,000	558,168
	第353回 利付国債 (10年)	0.1000	2028/12/20	543,000	545,014
	第354回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/ 3 /20	518,000	519,813
	第355回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/ 6 /20	422,000	423,375
	第356回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/ 9 /20	418,000	419,095
	第357回 利付国債 (10年)	0.1000	2029/12/20	429,000	429,827
	第358回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/ 3 /20	525,000	525,624
	第359回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/ 6 /20	337,000	337,138
	第360回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/ 9 /20	297,000	296,747
	第361回 利付国債 (10年)	0.1000	2030/12/20	637,000	635,611
	第362回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/ 3 /20	534,000	532,093
	第363回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/ 6 /20	643,000	639,765
	第364回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/ 9 /20	608,000	604,005
	第365回 利付国債 (10年)	0.1000	2031/12/20	336,000	333,254
	第 1 回 利付国債 (30年)	2.8000	2029/ 9 /20	10,000	12,049
	第 2 回 利付国債 (30年)	2.4000	2030/ 2 /20	82,000	97,062
第 3 回 利付国債 (30年)	2.3000	2030/ 5 /20	123,000	145,163	
第 4 回 利付国債 (30年)	2.9000	2030/11/20	79,000	97,984	
第 5 回 利付国債 (30年)	2.2000	2031/ 5 /20	104,000	123,441	
第 6 回 利付国債 (30年)	2.4000	2031/11/20	78,000	94,636	
第 7 回 利付国債 (30年)	2.3000	2032/ 5 /20	39,000	47,203	
第 8 回 利付国債 (30年)	1.8000	2032/11/22	21,000	24,456	

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第 9 回 利付国債 (30年)	1.4000	2032/12/20	12,000	13,469
	第 10 回 利付国債 (30年)	1.1000	2033/ 3 /20	21,000	22,914
	第 11 回 利付国債 (30年)	1.7000	2033/ 6 /20	30,000	34,751
	第 12 回 利付国債 (30年)	2.1000	2033/ 9 /20	58,000	69,945
	第 13 回 利付国債 (30年)	2.0000	2033/12/20	62,000	74,200
	第 14 回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/ 3 /20	59,000	73,507
	第 15 回 利付国債 (30年)	2.5000	2034/ 6 /20	76,000	95,854
	第 16 回 利付国債 (30年)	2.5000	2034/ 9 /20	53,000	67,038
	第 17 回 利付国債 (30年)	2.4000	2034/12/20	75,000	94,150
	第 18 回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 3 /20	89,000	110,894
	第 19 回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 6 /20	67,000	83,681
	第 20 回 利付国債 (30年)	2.5000	2035/ 9 /20	76,000	97,169
	第 21 回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/12/20	76,000	95,354
	第 22 回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 3 /20	79,000	101,502
	第 23 回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 6 /20	85,000	109,402
	第 24 回 利付国債 (30年)	2.5000	2036/ 9 /20	70,000	90,307
	第 25 回 利付国債 (30年)	2.3000	2036/12/20	78,000	98,609
	第 26 回 利付国債 (30年)	2.4000	2037/ 3 /20	154,000	197,372
	第 27 回 利付国債 (30年)	2.5000	2037/ 9 /20	148,000	192,595
	第 28 回 利付国債 (30年)	2.5000	2038/ 3 /20	196,000	256,054
	第 29 回 利付国債 (30年)	2.4000	2038/ 9 /20	208,000	269,362
	第 30 回 利付国債 (30年)	2.3000	2039/ 3 /20	221,000	283,410
	第 31 回 利付国債 (30年)	2.2000	2039/ 9 /20	215,000	272,804
	第 32 回 利付国債 (30年)	2.3000	2040/ 3 /20	268,000	345,476
	第 33 回 利付国債 (30年)	2.0000	2040/ 9 /20	299,000	371,277
	第 34 回 利付国債 (30年)	2.2000	2041/ 3 /20	276,000	353,213
	第 35 回 利付国債 (30年)	2.0000	2041/ 9 /20	304,000	379,388
	第 36 回 利付国債 (30年)	2.0000	2042/ 3 /20	287,000	359,148
	第 37 回 利付国債 (30年)	1.9000	2042/ 9 /20	311,000	384,190
	第 38 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 3 /20	207,000	252,196
	第 39 回 利付国債 (30年)	1.9000	2043/ 6 /20	192,000	237,970
	第 40 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 9 /20	165,000	201,405
	第 41 回 利付国債 (30年)	1.7000	2043/12/20	162,000	194,634
	第 42 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 3 /20	151,000	181,545
	第 43 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 6 /20	143,000	172,049
	第 44 回 利付国債 (30年)	1.7000	2044/ 9 /20	147,000	176,983
	第 45 回 利付国債 (30年)	1.5000	2044/12/20	163,000	189,547
	第 46 回 利付国債 (30年)	1.5000	2045/ 3 /20	229,000	266,381
	第 47 回 利付国債 (30年)	1.6000	2045/ 6 /20	209,000	247,639

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第 48 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/ 9 /20	219,000	250,220
	第 49 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/12/20	216,000	246,821
	第 50 回 利付国債 (30年)	0.8000	2046/ 3 /20	219,000	221,452
	第 51 回 利付国債 (30年)	0.3000	2046/ 6 /20	220,000	197,839
	第 52 回 利付国債 (30年)	0.5000	2046/ 9 /20	228,000	214,853
	第 53 回 利付国債 (30年)	0.6000	2046/12/20	204,000	196,374
	第 54 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 3 /20	216,000	217,358
	第 55 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 6 /20	204,000	205,077
	第 56 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 9 /20	209,000	209,666
	第 57 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/12/20	213,000	213,455
	第 58 回 利付国債 (30年)	0.8000	2048/ 3 /20	261,000	261,000
	第 59 回 利付国債 (30年)	0.7000	2048/ 6 /20	203,000	197,947
	第 60 回 利付国債 (30年)	0.9000	2048/ 9 /20	184,000	187,819
	第 61 回 利付国債 (30年)	0.7000	2048/12/20	186,000	180,503
	第 62 回 利付国債 (30年)	0.5000	2049/ 3 /20	179,000	164,687
	第 63 回 利付国債 (30年)	0.4000	2049/ 6 /20	193,000	172,431
	第 64 回 利付国債 (30年)	0.4000	2049/ 9 /20	196,000	174,763
	第 65 回 利付国債 (30年)	0.4000	2049/12/20	171,000	152,167
	第 66 回 利付国債 (30年)	0.4000	2050/ 3 /20	175,000	155,590
	第 67 回 利付国債 (30年)	0.6000	2050/ 6 /20	222,000	208,160
	第 68 回 利付国債 (30年)	0.6000	2050/ 9 /20	226,000	211,809
	第 69 回 利付国債 (30年)	0.7000	2050/12/20	223,000	214,521
	第 70 回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/ 3 /20	215,000	206,529
	第 71 回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/ 6 /20	218,000	209,351
	第 72 回 利付国債 (30年)	0.7000	2051/ 9 /20	207,000	198,732
	第 62 回 利付国債 (20年)	0.8000	2023/ 6 /20	175,000	176,933
	第 70 回 利付国債 (20年)	2.4000	2024/ 6 /20	259,000	273,307
	第 71 回 利付国債 (20年)	2.2000	2024/ 6 /20	76,000	79,851
	第 72 回 利付国債 (20年)	2.1000	2024/ 9 /20	190,000	200,189
	第 73 回 利付国債 (20年)	2.0000	2024/12/20	122,000	128,832
	第 74 回 利付国債 (20年)	2.1000	2024/12/20	77,000	81,526
	第 75 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 3 /20	88,000	93,617
	第 76 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/ 3 /20	115,000	121,644
	第 77 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 3 /20	86,000	91,229
	第 78 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/ 6 /20	269,000	285,839
	第 79 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 6 /20	78,000	83,138
	第 80 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 6 /20	92,000	98,362
	第 81 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/ 9 /20	101,000	108,146
	第 82 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/ 9 /20	132,000	141,806

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第 83 回 利付国債 (20年)	2.1000	2025/12/20	111,000	119,828
	第 84 回 利付国債 (20年)	2.0000	2025/12/20	202,000	217,303
	第 85 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/ 3 /20	136,000	147,523
	第 86 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 3 /20	145,000	158,453
	第 87 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 3 /20	122,000	132,828
	第 88 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 6 /20	292,000	320,788
	第 89 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 6 /20	189,000	206,826
	第 90 回 利付国債 (20年)	2.2000	2026/ 9 /20	260,000	285,838
	第 91 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 9 /20	185,000	204,223
	第 92 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/12/20	336,000	369,536
	第 93 回 利付国債 (20年)	2.0000	2027/ 3 /20	219,000	240,825
	第 94 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 3 /20	267,000	294,949
	第 95 回 利付国債 (20年)	2.3000	2027/ 6 /20	229,000	256,521
	第 96 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 6 /20	134,000	148,690
	第 97 回 利付国債 (20年)	2.2000	2027/ 9 /20	196,000	219,535
	第 98 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 9 /20	166,000	185,016
	第 99 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/12/20	303,000	339,175
	第100回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 3 /20	202,000	228,290
	第101回 利付国債 (20年)	2.4000	2028/ 3 /20	125,000	142,772
	第102回 利付国債 (20年)	2.4000	2028/ 6 /20	182,000	208,956
	第103回 利付国債 (20年)	2.3000	2028/ 6 /20	131,000	149,582
	第104回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/ 6 /20	104,000	117,449
	第105回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/ 9 /20	88,000	99,836
	第106回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 9 /20	64,000	73,025
	第107回 利付国債 (20年)	2.1000	2028/12/20	85,000	96,803
	第108回 利付国債 (20年)	1.9000	2028/12/20	99,000	111,409
	第109回 利付国債 (20年)	1.9000	2029/ 3 /20	79,000	89,230
	第110回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 3 /20	191,000	218,408
	第111回 利付国債 (20年)	2.2000	2029/ 6 /20	137,000	158,298
	第112回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 6 /20	197,000	226,197
	第113回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 9 /20	333,000	383,912
	第114回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/12/20	200,000	231,408
	第115回 利付国債 (20年)	2.2000	2029/12/20	138,000	160,738
	第116回 利付国債 (20年)	2.2000	2030/ 3 /20	160,000	187,044
	第117回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/ 3 /20	238,000	276,332
	第118回 利付国債 (20年)	2.0000	2030/ 6 /20	155,000	179,321
	第119回 利付国債 (20年)	1.8000	2030/ 6 /20	140,000	159,667
	第120回 利付国債 (20年)	1.6000	2030/ 6 /20	145,000	162,987
	第121回 利付国債 (20年)	1.9000	2030/ 9 /20	221,000	254,532



## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第122回 利付国債 (20年)	1.8000	2030/ 9 /20	160,000	182,923
	第123回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/12/20	257,000	301,332
	第124回 利付国債 (20年)	2.0000	2030/12/20	170,000	197,847
	第125回 利付国債 (20年)	2.2000	2031/ 3 /20	193,000	228,635
	第126回 利付国債 (20年)	2.0000	2031/ 3 /20	179,000	208,857
	第127回 利付国債 (20年)	1.9000	2031/ 3 /20	189,000	218,839
	第128回 利付国債 (20年)	1.9000	2031/ 6 /20	253,000	293,641
	第129回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/ 6 /20	169,000	194,601
	第130回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/ 9 /20	250,000	288,480
	第131回 利付国債 (20年)	1.7000	2031/ 9 /20	164,000	187,702
	第132回 利付国債 (20年)	1.7000	2031/12/20	131,000	150,204
	第133回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/12/20	156,000	180,370
	第134回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/ 3 /20	164,000	189,974
	第135回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 3 /20	114,000	130,933
	第136回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/ 3 /20	118,000	134,366
	第137回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 6 /20	35,000	40,266
	第138回 利付国債 (20年)	1.5000	2032/ 6 /20	39,000	44,082
	第139回 利付国債 (20年)	1.6000	2032/ 6 /20	42,000	47,896
	第140回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/ 9 /20	104,000	119,838
	第141回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/12/20	163,000	188,199
	第142回 利付国債 (20年)	1.8000	2032/12/20	95,000	110,686
	第143回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/ 3 /20	216,000	247,417
	第144回 利付国債 (20年)	1.5000	2033/ 3 /20	98,000	111,202
	第145回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 6 /20	255,000	295,389
	第146回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 9 /20	243,000	282,008
	第147回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/12/20	266,000	306,033
	第148回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/ 3 /20	235,000	267,883
	第149回 利付国債 (20年)	1.5000	2034/ 6 /20	254,000	289,918
	第150回 利付国債 (20年)	1.4000	2034/ 9 /20	274,000	309,644
	第151回 利付国債 (20年)	1.2000	2034/12/20	267,000	295,299
	第152回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 3 /20	299,000	330,864
	第153回 利付国債 (20年)	1.3000	2035/ 6 /20	307,000	343,781
	第154回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 9 /20	290,000	321,009
	第155回 利付国債 (20年)	1.0000	2035/12/20	291,000	314,413
	第156回 利付国債 (20年)	0.4000	2036/ 3 /20	241,000	240,679
	第157回 利付国債 (20年)	0.2000	2036/ 6 /20	247,000	239,357
	第158回 利付国債 (20年)	0.5000	2036/ 9 /20	268,000	270,379
	第159回 利付国債 (20年)	0.6000	2036/12/20	245,000	250,265
	第160回 利付国債 (20年)	0.7000	2037/ 3 /20	208,000	215,317

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第161回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/ 6 /20	222,000	226,273
	第162回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/ 9 /20	212,000	215,676
	第163回 利付国債 (20年)	0.6000	2037/12/20	275,000	279,430
	第164回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/ 3 /20	334,000	333,749
	第165回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/ 6 /20	274,000	273,175
	第166回 利付国債 (20年)	0.7000	2038/ 9 /20	265,000	272,051
	第167回 利付国債 (20年)	0.5000	2038/12/20	281,000	279,055
	第168回 利付国債 (20年)	0.4000	2039/ 3 /20	245,000	238,720
	第169回 利付国債 (20年)	0.3000	2039/ 6 /20	273,000	260,791
	第170回 利付国債 (20年)	0.3000	2039/ 9 /20	245,000	233,340
	第171回 利付国債 (20年)	0.3000	2039/12/20	257,000	244,219
	第172回 利付国債 (20年)	0.4000	2040/ 3 /20	243,000	234,521
	第173回 利付国債 (20年)	0.4000	2040/ 6 /20	309,000	297,594
	第174回 利付国債 (20年)	0.4000	2040/ 9 /20	308,000	296,243
	第175回 利付国債 (20年)	0.5000	2040/12/20	287,000	280,499
	第176回 利付国債 (20年)	0.5000	2041/ 3 /20	292,000	284,822
	第177回 利付国債 (20年)	0.4000	2041/ 6 /20	276,000	263,952
	第178回 利付国債 (20年)	0.5000	2041/ 9 /20	273,000	265,672
	第179回 利付国債 (20年)	0.5000	2041/12/20	97,000	94,284
	小計	-	-	-	61,599,040
地方債証券	第730回 東京都公募公債	0.6640	2024/ 3 /19	300,000	303,388
	第 34 回 東京都公募公債 (20年)	0.6680	2037/ 6 /19	100,000	102,067
	平成27年度第1回 北海道公募公債	0.4300	2025/ 4 /30	300,000	302,965
	第 30 回 神奈川県公募公債 (20年)	1.1610	2035/ 9 /20	100,000	109,249
	第378回 大阪府公募公債 (10年)	0.7000	2023/11/28	144,000	145,503
	第448回 大阪府公募公債 (10年)	0.0010	2029/ 9 /27	38,000	37,386
	第455回 大阪府公募公債 (10年)	0.1160	2030/ 4 /26	180,000	178,291
	第 12 回 大阪府公募公債 (20年)	1.4530	2034/ 9 /26	100,000	112,443
	平成29年度第5回 京都府公募公債(20年)	0.6300	2037/ 8 /14	100,000	101,297
	第 21 回 兵庫県公募公債 (20年)	1.5400	2034/ 5 / 9	100,000	113,237
	平成26年度第11回 愛知県公募公債	0.9610	2029/10/16	100,000	105,753
	平成25年度第4回 埼玉県公募公債	0.9210	2023/ 7 /24	100,000	101,179
	平成25年度第10回 埼玉県公募公債	0.6700	2024/ 2 /26	119,000	120,322
	平成20年度第1回 福岡県公募公債	2.2600	2028/ 8 /18	100,000	113,404
	平成24年度第2回 福岡県公募公債	1.6350	2032/ 8 /16	100,000	113,869
	第 10 回 群馬県公募公債	0.6700	2023/11/24	300,000	302,985
	第123回 共同発行市場公募地方債	0.8700	2023/ 6 /23	300,000	303,160
	第133回 共同発行市場公募地方債	0.6890	2024/ 4 /25	300,000	303,747
	第 22 回 大阪市公募公債 (20年)	0.3470	2036/ 5 /30	100,000	98,020

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
地方債証券	第 1 回 名古屋市公募公債	2.5300	2035/ 3 /20	100,000	126,295
	第 1 回 京都市公募公債	2.1400	2024/12/20	300,000	316,892
	平成25年度第11回 神戸市公募公債	0.6890	2024/ 2 /19	100,000	101,142
	第 25 回 横浜市公募公債 (20年)	1.7200	2032/ 7 /16	100,000	114,688
	第 26 回 横浜市公募公債 (20年)	1.7760	2033/ 1 /28	100,000	115,597
	第 9 回 川崎市公募公債 (20年)	2.1500	2030/ 5 /24	100,000	115,695
	第 4 回 川崎市公募公債 (30年)	2.1000	2041/ 9 /20	100,000	125,740
	平成25年度第 3 回 北九州市公募公債	0.7280	2023/12/26	150,000	151,710
	平成26年度第 2 回 北九州市公募公債	0.4510	2024/12/24	150,000	151,407
	平成30年度第5回 広島市公募公債	0.1950	2028/12/25	200,000	200,218
	平成29年度第 1 回 仙台市公募公債 (20年)	0.6160	2037/10/19	100,000	100,890
		小計	-	-	-
特殊債券 (除く金融債券)	第 9 回 新関西国際空港	1.2310	2028/12/20	300,000	319,473
	第 22 回 政保日本政策投資銀行債券	2.2000	2023/ 6 /19	300,000	308,516
	第 16 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7000	2036/ 9 /19	100,000	130,257
	第115回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.7380	2023/ 9 /20	100,000	101,024
	第174回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6410	2032/ 9 /30	100,000	114,203
	第205回 政保道路機構債券	1.5320	2033/11/30	100,000	113,749
	第212回 政保道路機構債券	1.5000	2034/ 2 /28	100,000	113,425
	第218回 政保道路機構債券	0.6600	2024/ 5 /31	500,000	507,214
	第233回 政府道路機構債券	1.3150	2034/11/30	100,000	111,446
	第249回 政保道路機構債券	0.4840	2025/ 6 /30	179,000	181,675
	第278回 政保道路機構債券	0.2370	2036/ 5 /30	100,000	96,803
	第293回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.3970	2036/10/31	100,000	98,742
	第316回 政保道路機構債券	0.5690	2037/ 6 /30	100,000	100,771
	第 17 回 地方公共団体金融機構債券 (20年)	1.8700	2031/ 9 /26	200,000	230,411
	第 1 回 地方公共団体金融機構債券 (30年)	1.8640	2044/ 6 /28	100,000	121,829
	第 72 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5090	2025/ 5 /23	200,000	202,974
	第 83 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0200	2026/ 4 /17	103,000	102,827
	第120回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0010	2029/ 7 /13	100,000	98,961
	第136回 地方公共団体金融機構債券	0.1450	2030/ 9 /27	200,000	198,581
	第 16 回 公営企業債券	2.1000	2025/12/19	200,000	214,909
	第 97 回 都市再生債券	1.0170	2029/ 9 /20	100,000	105,834
	第 46 回 福祉医療機構債券	0.0800	2026/ 6 /19	200,000	199,617
	第 59 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	2030/10/22	200,000	229,069
	第143回 住宅金融支援機構債券	1.1920	2028/10/20	100,000	106,445
	第 37 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7100	2045/ 6 /10	22,035	23,174
	第 42 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4300	2045/11/10	55,408	58,111
第 46 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8500	2046/ 3 /10	64,764	68,326	

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
特殊債券 (除く金融債券)	第 54 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4700	2046/11/10	55,340	57,935
	第 55 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4100	2046/12/10	61,322	64,173
	第 60 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	2047/ 5 /10	69,558	72,910
	第 61 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2600	2047/ 6 /10	34,155	35,654
	第 62 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	2047/ 7 /10	295,760	308,122
	第 63 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1100	2047/ 8 /10	184,670	191,447
	第 73 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3000	2048/ 6 /10	122,091	127,621
	第 78 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0800	2048/11/10	106,800	110,420
	第 109回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	2051/ 6 /10	217,563	216,148
	第 116回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.0400	2023/ 9 /20	100,000	99,946
		小計	-	-	-
金融債券	い第845号 利付商工債券	0.1200	2025/10/27	200,000	199,891
	い第822号 利付農林債券	0.0900	2023/11/27	100,000	100,056
	第344回 利付しんぎん中金債券	0.1000	2023/ 7 /27	100,000	100,071
	第353回 利付しんぎん中金債券	0.0600	2024/ 4 /26	100,000	99,961
		小計	-	-	-
社債券	第 26 回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円債社債(2018)	0.4430	2023/10/12	300,000	300,490
	第 13 回 クレディ・アグリコル	0.3430	2024/ 6 / 7	100,000	99,817
	第 5 回 スウェンスカ・ハンデルスバンク	0.6790	2024/ 9 / 4	200,000	201,522
	第 25 回 首都高速道路債券	0.0300	2024/ 9 /20	400,000	399,141
	第 56 回 中日本高速道路債券	0.7590	2023/12/20	200,000	202,360
	第 60 回 中日本高速道路債券	0.5430	2024/12/20	100,000	101,147
	第 20 回 西日本高速道路債券	0.7590	2023/ 9 /20	100,000	101,044
	第 25 回 西日本高速道路債券	0.5240	2024/12/20	200,000	202,194
	第 26 回 西日本高速道路債券	0.6040	2025/ 5 /21	200,000	203,018
	第 14 回 森ヒルズリート投資法人無担保投資法人債	0.8200	2025/ 5 /26	100,000	101,447
	第 5 回 電通グループ	0.3200	2027/ 7 / 8	400,000	400,778
	第 24 回 豊田自動織機	0.7970	2023/ 6 /20	100,000	100,913
	第 1 回 オリックス銀行	0.1600	2026/ 3 /11	200,000	199,916
	第 1 回 三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	0.8570	2024/ 9 / 5	100,000	100,909
	第 29 回 三菱東京UFJ銀行劣後特約付	2.1600	2026/ 1 /20	100,000	106,504
	第 1 回 三井住友フィナンシャルグループ劣後特約付	0.8490	2024/ 9 /12	100,000	100,997
	第 8 回 三菱UFJ信託銀行劣後特約付	1.9200	2025/10/28	100,000	105,141
	第 18 回 NTTファイナンス	0.3800	2030/ 9 /20	100,000	100,381
	第 96 回 トヨタファイナンス	0.0600	2026/ 4 /15	100,000	99,600
	第 6 回 三井住友海上火災保険	0.1300	2024/ 7 /31	100,000	99,910
	第 66 回 三井不動産	0.2800	2026/ 3 /13	100,000	100,328
	第 7 回 野村不動産オフィスファンド投資法人	2.9000	2028/ 3 /17	200,000	228,210

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
社債券	第 77 回 東京急行電鉄	0.9870	2023/ 6 /12	100,000	101,162
	第 27 回 KDD I	0.2300	2026/ 4 /24	200,000	200,639
	第510回 関西電力	0.4900	2027/ 7 /23	100,000	100,836
	第381回 中国電力	0.9530	2024/ 4 /25	200,000	203,679
	第304回 北陸電力	0.9890	2023/10/25	100,000	101,489
	第306回 北陸電力	0.8750	2024/ 5 /24	100,000	101,749
	第253回 四国電力	1.0000	2023/ 6 /23	200,000	202,425
	第429回 九州電力	0.9090	2024/ 9 /25	200,000	204,184
	第331回 北海道電力	0.3700	2026/ 4 /24	100,000	100,641
	第 13 回 電源開発	2.0400	2025/ 6 /20	100,000	106,282
		小計	-	-	-
	合計	-	-	-	77,409,206

### 投資信託財産の構成

2022年3月10日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	77,409,206	99.0
コール・ローン等、その他	774,140	1.0
投資信託財産総額	78,183,347	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年3月10日現在)

項目		当期末
<b>(A)資産</b>	<b>産</b>	<b>78,183,347,603円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等		542,946,414
公 社 債 (評価額)		77,409,206,900
未 収 利 息		222,734,860
前 払 費 用		8,459,429
<b>(B)負債</b>	<b>債</b>	<b>177,441,151</b>
未 払 解 約 金		177,439,987
そ の 他 未 払 費 用		1,164
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>		<b>78,005,906,452</b>
元 本		80,372,485,061
次 期 繰 越 損 益 金		△ 2,366,578,609
<b>(D)受益権総口数</b>		<b>80,372,485,061口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>		<b>9,706円</b>

(注1) 期首元本額 82,422,375,045円  
 期中追加設定元本額 13,091,413,259円  
 期中一部解約元本額 15,141,303,243円

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

ニッセイ国内債券パッシブDB (適格機関投資家限定) 65,329,145,586円  
 DCニッセイ日本債券インデックス 3,451,719,435円  
 DCニッセイターゲットデットファンド2055 107,909,695円  
 DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) 5,636,145,522円  
 DCニッセイターゲットデットファンド2045 216,124,782円  
 DCニッセイターゲットデットファンド2035 1,147,396,165円  
 DCニッセイターゲットデットファンド2025 2,062,605,972円  
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス  
 バランスファンド(6資産均等型) 218,681,287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) 24,004,631円  
 ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券) 69,765,956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) 58,442,636円  
 DCニッセイターゲットデットファンド2060 51,955,149円  
 DCニッセイターゲットデットファンド2050 71,837,078円  
 DCニッセイターゲットデットファンド2040 266,777,033円  
 DCニッセイターゲットデットファンド2030 1,658,861,597円  
 FWニッセイ国内債インデックス 1,064,570円  
 DCニッセイターゲットデットファンド2065 47,967円

(注3) 元本の欠損  
 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は2,366,578,609円です。

### 損益の状況

当期(2021年3月11日~2022年3月10日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>703,363,183円</b>
受 取 利 息	703,752,030
支 払 利 息	△ 388,847
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>△1,271,822,728</b>
売 買 益	37,311,618
売 買 損	△ 1,309,134,346
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 16,779</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 568,476,324</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>△1,863,790,872</b>
<b>(F)追加信託差損益金</b>	<b>△ 223,558,184</b>
<b>(G)解約差損益金</b>	<b>289,246,771</b>
<b>(H)合計(D+E+F+G)</b>	<b>△2,366,578,609</b>
<b>次期繰越損益金(H)</b>	<b>△2,366,578,609</b>

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

# ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 32 期

(計算期間：2022年5月21日～2022年11月21日)

#### 運用方針

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

#### 主要運用 対象

日本を除く主要国の国債

#### 運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

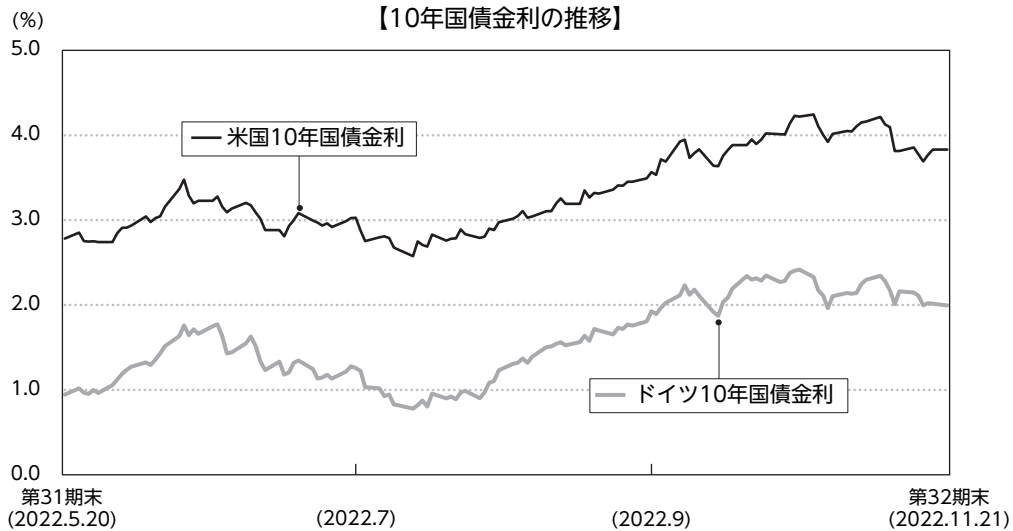
東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2022年5月21日～2022年11月21日

## 投資環境

### 海外債券市況



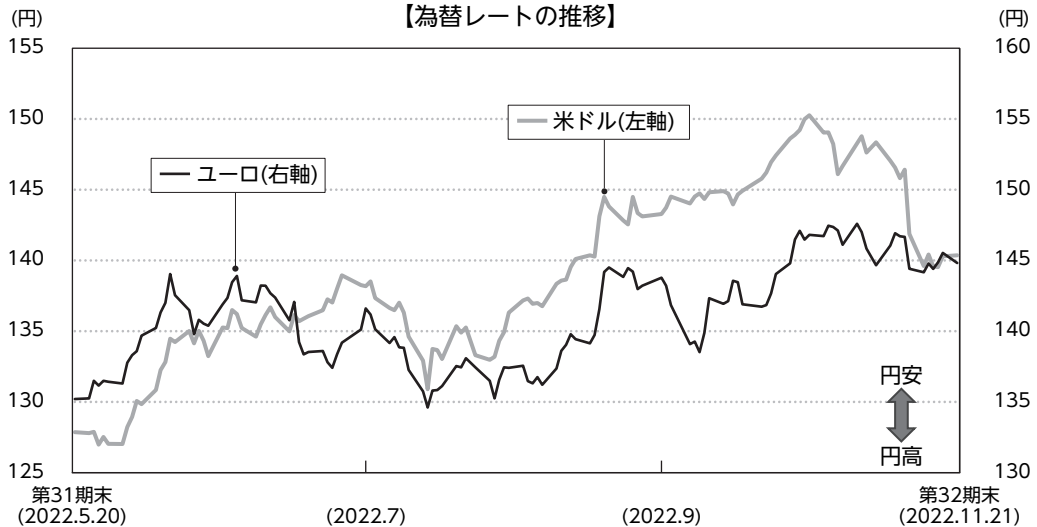
(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

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

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



## ■為替市況

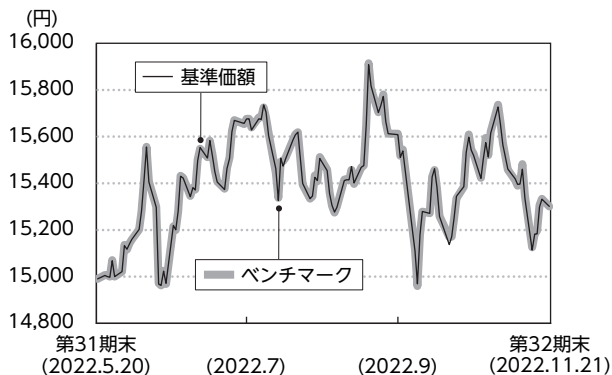


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

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

#### <下落要因>

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

## ポートフォリオ

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

## ベンチマークとの差異

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

## 今後の運用方針

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

## 最近5期の運用実績

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

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2022年5月21日～2022年11月21日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## 売買および取引の状況

2022年5月21日～2022年11月21日

## 公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

## 主要な売買銘柄

2022年5月21日～2022年11月21日

## 公社債

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

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

## 組入有価証券明細表

2022年11月21日現在

## 外国（外貨建）公社債

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

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

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

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

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

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



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						邦貨換算金額	
スウェーデン		%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2029/11/12	1,390	1,271	16,758	
	SWEDISH GOVERNMENT	0.1250	2031/05/12	1,070	914	12,059	
	SWEDISH GOVERNMENT	2.2500	2032/06/01	1,040	1,066	14,058	
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	890	1,089	14,359	
小計		-	-	-	-	143,144	
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2023/12/07	4,760	4,638	33,455	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2024/09/05	6,580	6,375	45,989	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/05	5,040	5,045	36,394	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0000	2025/03/06	2,100	1,892	13,651	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	8,870	7,958	57,403	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5000	2027/03/04	2,920	2,535	18,288	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	6,820	6,384	46,054	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	5,940	5,725	41,299	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	8,610	7,860	56,697	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	1,720	1,532	11,053	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	1,450	1,530	11,039	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	4,710	4,387	31,644	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	5,070	4,342	31,323	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	5,240	4,588	33,100	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2053/07/31	1,000	870	6,281	
小計		-	-	-	-	473,675	
中国				千人民元	千人民元		
国債証券	CHINAGOVERNMENTBOND	2.2800	2024/03/17	7,000	7,003	137,590	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.1800	2024/06/25	2,200	2,192	43,072	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.4700	2024/09/02	5,600	5,607	110,170	
	CHINAGOVERNMENTBOND	1.9900	2024/09/15	4,000	3,976	78,121	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.2400	2025/05/25	5,500	5,474	107,565	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.1800	2025/08/25	7,000	6,951	136,581	
	CHINAGOVERNMENTBOND	3.0300	2026/03/11	1,200	1,217	23,919	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.6900	2026/08/12	4,400	4,407	86,593	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.3700	2027/01/20	3,200	3,161	62,117	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.4800	2027/04/15	6,700	6,644	130,551	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.5000	2027/07/25	4,800	4,766	93,655	
	CHINAGOVERNMENTBOND	3.0100	2028/05/13	720	728	14,313	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.9100	2028/10/14	5,400	5,456	107,199	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.8000	2029/03/24	3,600	3,600	70,734	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

## 投資信託財産の構成

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	55,727,800	98.8
コール・ローン等、その他	681,629	1.2
投資信託財産総額	56,409,429	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1カナダ・ドル104.82円、1オーストラリア・ドル93.41円、1シンガポール・ドル102.07円、1ニュージーランド・ドル86.21円、1イギリス・ポンド166.59円、1イスラエル・シェケル40.408円、1デンマーク・クローネ19.47円、1ノルウェー・クローネ13.74円、1スウェーデン・クローナ13.18円、1メキシコ・ペソ7,213円、1人民元19,647円、1マレーシア・リンギット30.617円、1ポーランド・ズロチ30,809円、1ユーロ144.81円です。

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月21日現在)

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

(注1) 期首元本額 33,749,154,108円  
 期中追加設定元本額 6,095,504,207円  
 期中一部解約元本額 3,058,388,426円

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

### 損益の状況

当期(2022年5月21日~2022年11月21日)

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

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

## 指数に関して

### ■ ファンドのベンチマーク等について

#### ・ T O P I X（東証株価指数）（配当込み）

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

#### ・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

#### ・ N O M U R A - B P I 総合

N O M U R A - B P I 総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

#### ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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

#### ・ 東証 R E I T 指数（配当込み）

東証 R E I T 指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。J P X は、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。J P X は、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、



J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。J P Xは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。J P Xは、ニッセイアセットマネジメント株式会社または当ファンドの購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、J P Xは当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

- ・ S & P グローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）

S & P グローバルリートインデックス（除く日本）はS&P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがS P D J Iに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、同インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。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。