

# 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：2022年12月21日～2023年12月20日

<2025/2035/2045>

第7期(決算日 2023年12月20日)

<2055>

第8期(決算日 2023年12月20日)

<2030/2040/2050/2060>

第5期(決算日 2023年12月20日)

<2065>

第2期(決算日 2023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、2023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。



NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

<2025>

第7期末 (2023年12月20日)	
基準価額	10,816円
純資産総額	27億円
騰落率	2.2%
分配金	0円

<2035>

第7期末 (2023年12月20日)	
基準価額	15,656円
純資産総額	79億円
騰落率	17.2%
分配金	0円

<2045>

第7期末 (2023年12月20日)	
基準価額	17,092円
純資産総額	40億円
騰落率	23.2%
分配金	0円

<2055>

第8期末 (2023年12月20日)	
基準価額	21,081円
純資産総額	33億円
騰落率	24.5%
分配金	0円

<2065>

第2期末 (2023年12月20日)	
基準価額	12,148円
純資産総額	499百万円
騰落率	25.5%
分配金	0円

<2030>

第5期末 (2023年12月20日)	
基準価額	13,221円
純資産総額	43億円
騰落率	9.1%
分配金	0円

<2040>

第5期末 (2023年12月20日)	
基準価額	16,933円
純資産総額	36億円
騰落率	21.8%
分配金	0円

<2050>

第5期末 (2023年12月20日)	
基準価額	17,581円
純資産総額	17億円
騰落率	23.8%
分配金	0円

<2060>

第5期末 (2023年12月20日)	
基準価額	18,090円
純資産総額	25億円
騰落率	25.2%
分配金	0円

## 運用経過

2022年12月21日～2023年12月20日

## 基準価額等の推移



第7期首	10,578円	既払分配金	0円
第7期末	10,816円	騰落率 (分配金再投資ベース)	2.2%

(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、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;

- ・2023年1月から6月にかけて、世界的なインフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の改善期待などを背景に内外株式市場が上昇したことに加えて、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月から当期末にかけて、米国で利上げ打ち止め観測が高まり内外金利が低下(債券価格は上昇)し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年7月に日銀のイールドカーブ・コントロール(長短金利操作、YCC)の運用柔軟化策の発表を受けて国内長期金利が大幅に上昇し、その後も10月にかけて金融政策正常化への思惑などを背景に国内債券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	4.2%	26.4%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1.8	33.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	65.3	0.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	3.9	11.8
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	24.8	△ 0.0

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	16円	0.154%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は10,692円です。</p>
(信託会社)	( 7)	(0.066)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	( 7)	(0.066)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	( 2)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.000	
(株式)	( 0)	(0.000)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	( 0)	(0.000)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.000	
(株式)	( 0)	(0.000)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	( 0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	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	18	0.165	

(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。

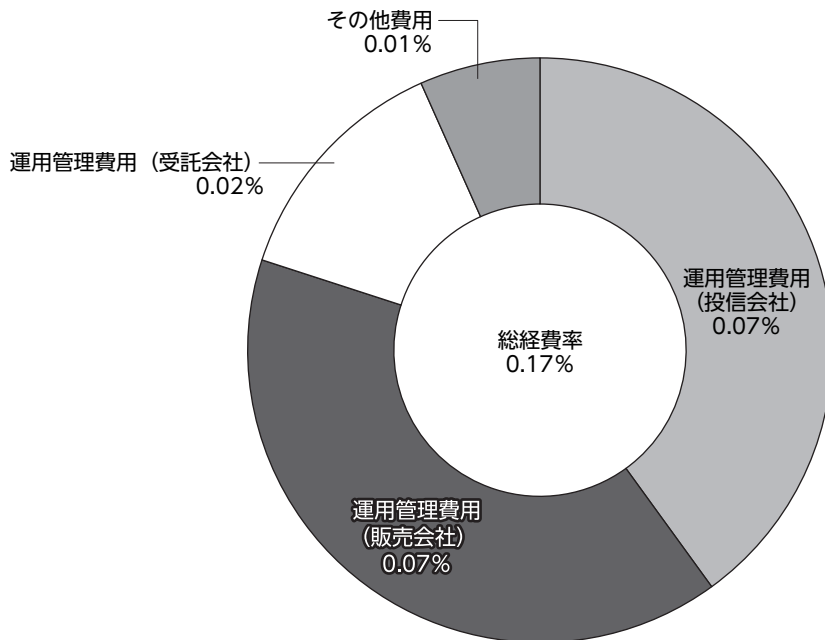
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.17%**です。



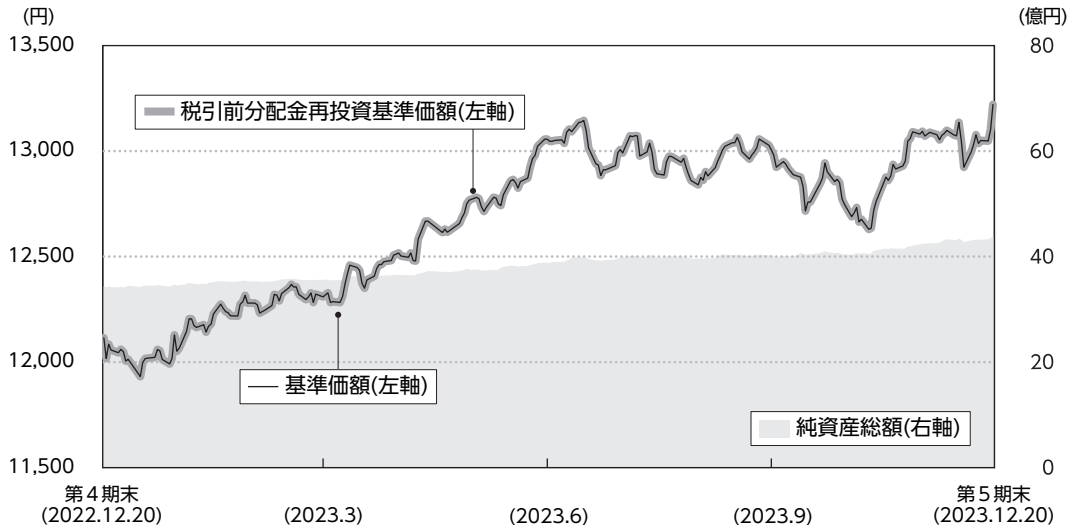
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

## 基準価額等の推移



第5期首	12,115円	既払分配金	0円
第5期末	13,221円	騰落率(分配金再投資ベース)	9.1%

(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;

- ・2023年1月から6月にかけて、世界的なインフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の改善期待などを背景に内外株式市場が上昇したことに加えて、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月から当期末にかけて、米国で利上げ打ち止め観測が高まり内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月中旬から10月にかけて、米欧の金融引き締め長期化観測などを受けて内外金利が上昇し、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	13.3%	26.4%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	15.9	33.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	63.0	0.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	7.8	11.8

(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5期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	31円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は12,688円です。</p>
(投信会社)	(14)	(0.110)	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)	(0.110)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	( 3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	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	0.014	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)	(0.006)	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	33	0.257	

(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。

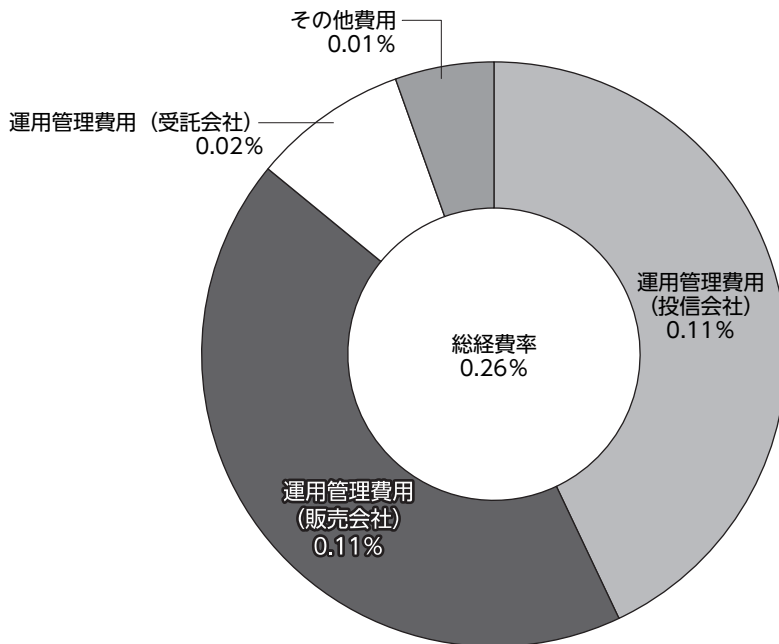
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.26%**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。

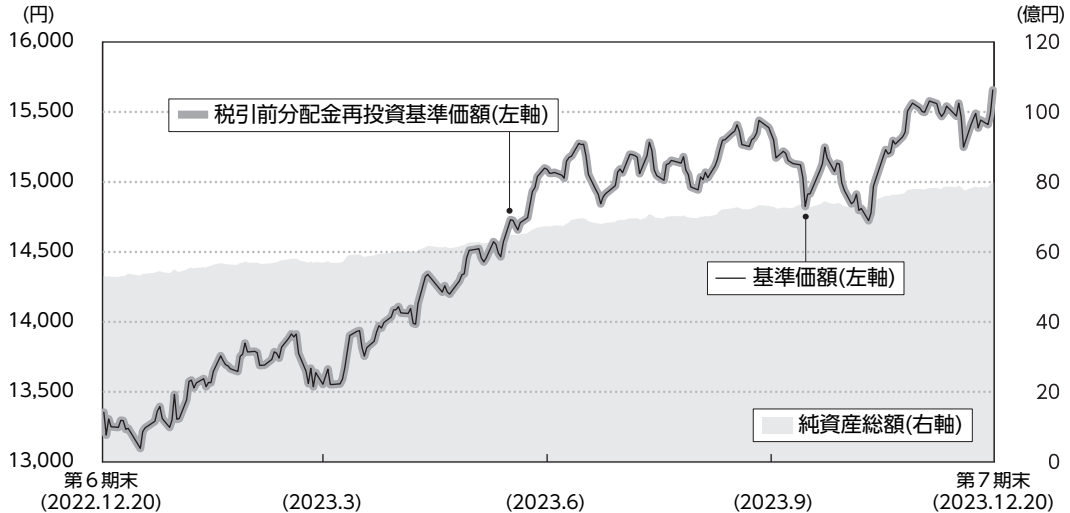
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(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	13,354円	既払分配金	0円
第7期末	15,656円	騰落率 (分配金再投資ベース)	17.2%

(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、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;

- ・2023年1月から6月にかけて、世界的なインフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の改善期待などを背景に内外株式市場が上昇したことに加えて、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月から当期末にかけて、米国で利上げ打ち止め観測が高まり内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月中旬から10月にかけて、米欧の金融引き締め長期化観測などを受けて内外金利が上昇し、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	23.0%	26.4%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	32.1	33.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	33.1	0.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	11.9	11.8

(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	35円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は14,560円です。</p>
(信託会社)	(16)	(0.110)	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)	(0.110)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	( 3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	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	0.018	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	( 1)	(0.010)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	( 1)	(0.008)	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)	(0.000)	<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	38	0.262	

(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。

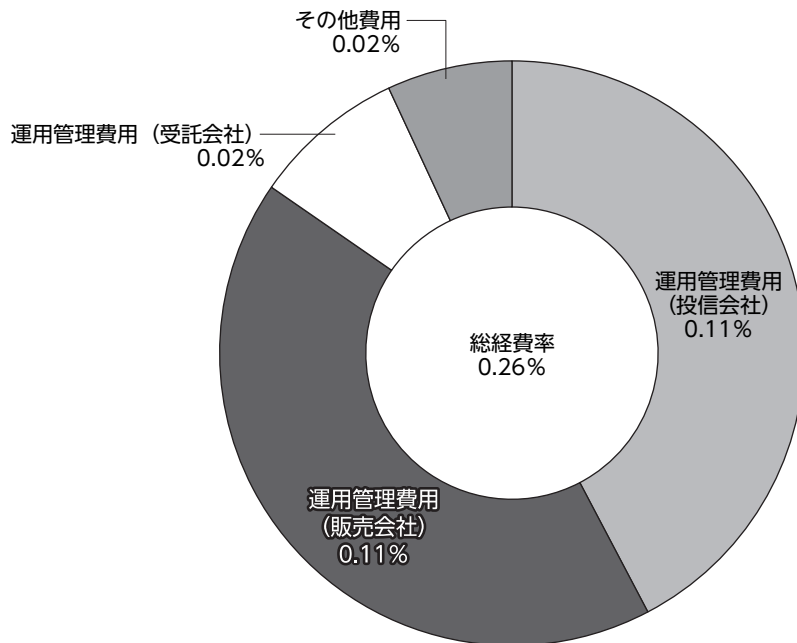
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.26%**です。



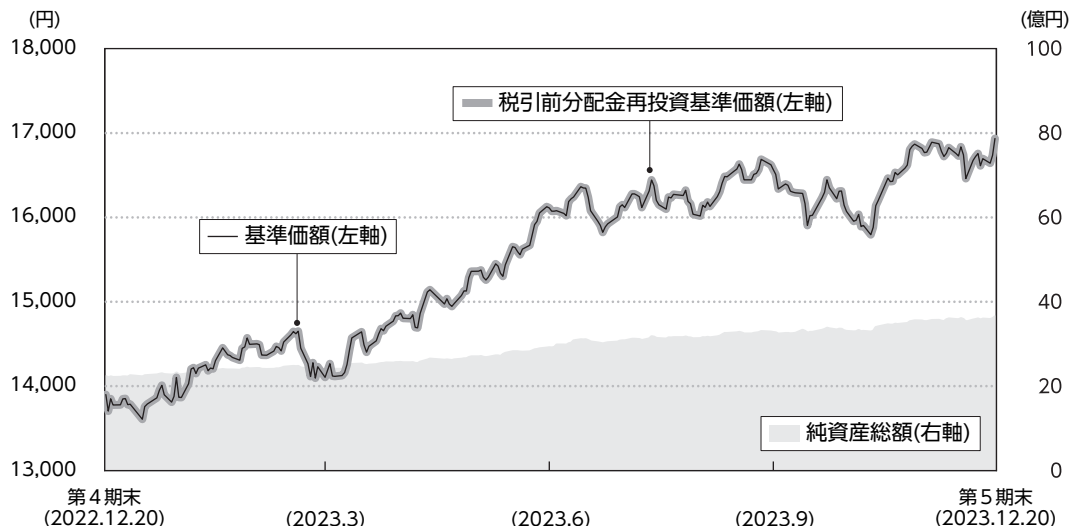
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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5期首	13,899円	既払分配金	0円
第5期末	16,939円	騰落率 (分配金再投資ベース)	21.8%

(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;

- ・2023年1月から6月にかけて、世界的なインフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の改善期待などを背景に内外株式市場が上昇したことに加えて、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月から当期末にかけて、米国で利上げ打ち止め観測が高まり内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月中旬から10月にかけて、米欧の金融引き締め長期化観測などを受けて内外金利が上昇し、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	28.2%	26.4%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	40.5	33.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	17.2	0.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	14.1	11.8

(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5期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	37円	0.242%	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15,493円です。
(投信会社)	(17)	(0.110)	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)	(17)	(0.110)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	( 3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	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	0.021	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)	( 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)	(0.009)	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)	・ 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	41	0.267	

(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。

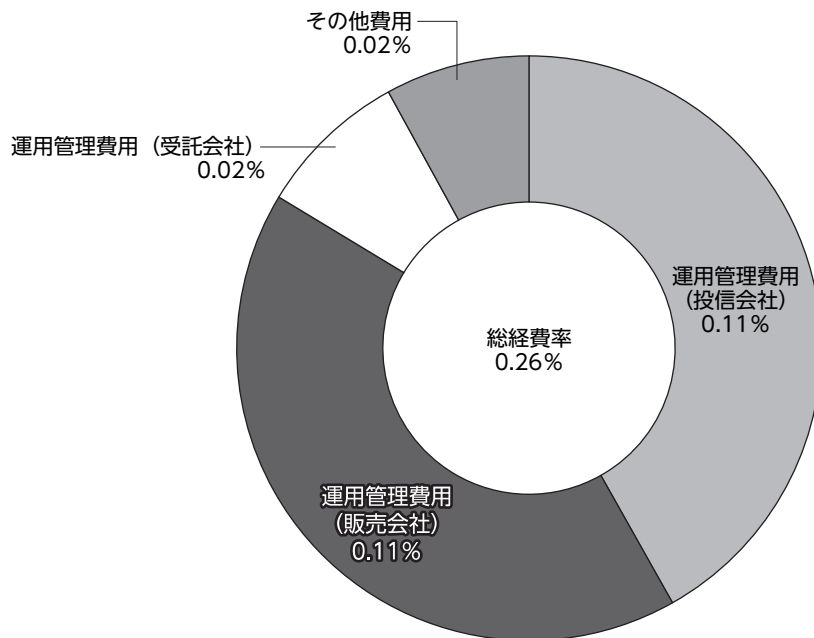
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.26%**です。



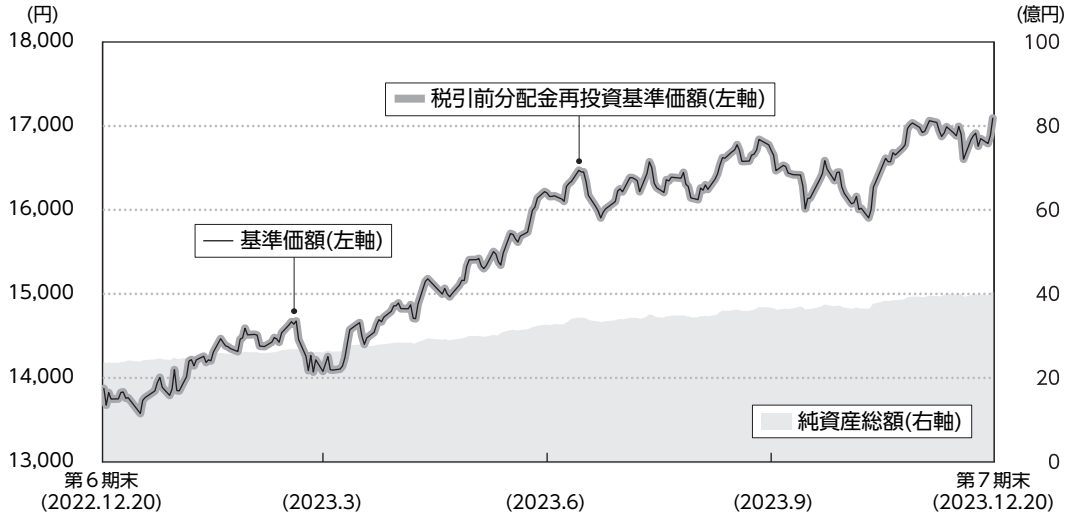
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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	13,874円	既払分配金	0円
第7期末	17,092円	騰落率 (分配金再投資ベース)	23.2%

(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、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;

- ・2023年1月から6月にかけて、世界的なインフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の改善期待などを背景に内外株式市場が上昇したことに加えて、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月から当期末にかけて、米国で利上げ打ち止め観測が高まり内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月中旬から10月にかけて、米欧の金融引き締め長期化観測などを受けて内外金利が上昇し、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	29.7%	26.4%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	43.1	33.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	12.6	0.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	14.7	11.8

(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	38円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は15,564円です。</p>
(投信会社)	(17)	(0.110)	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)	(17)	(0.110)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	( 3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	( 0)	(0.001)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(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	0.022	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)	(0.013)	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	42	0.268	

(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。

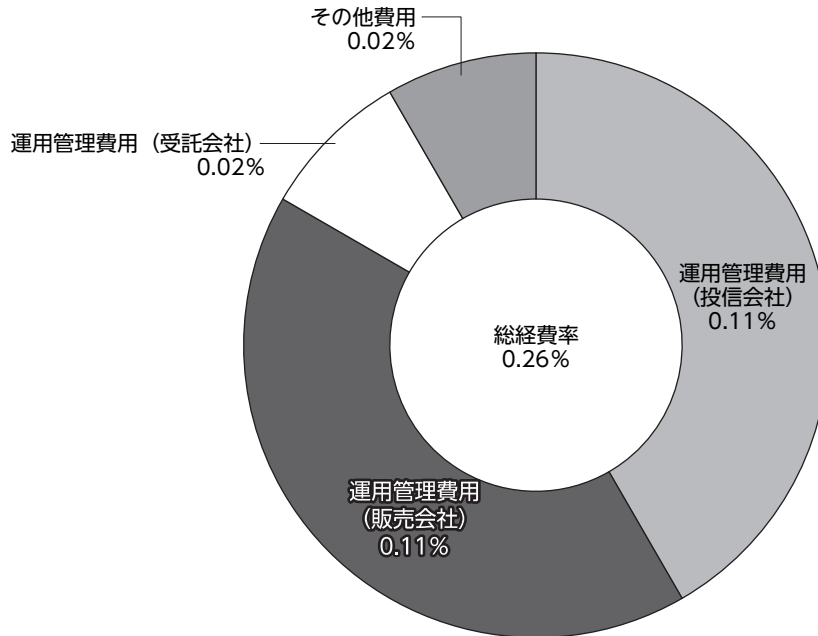
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。



## (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0.26%**です。



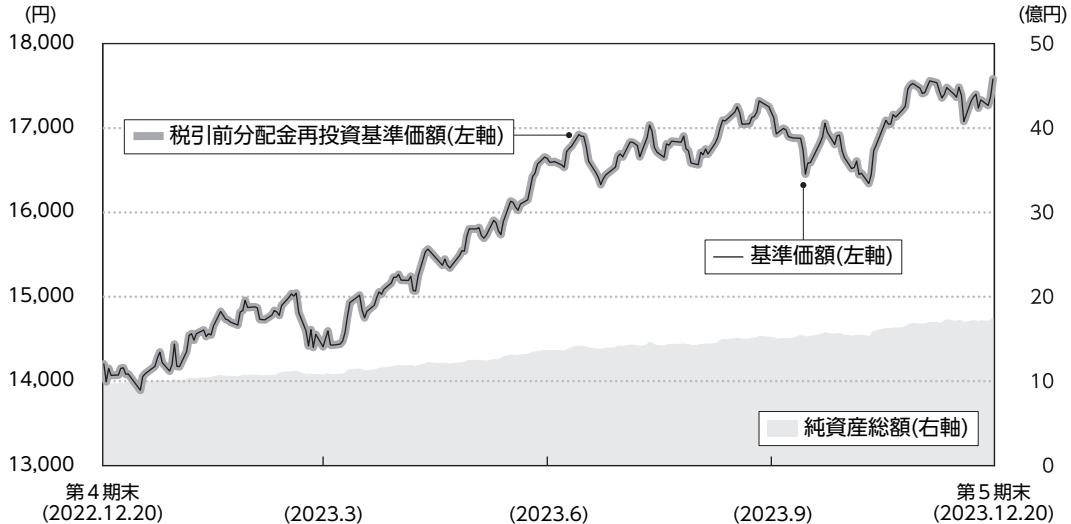
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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5期首	14,202円	既払分配金	0円
第5期末	17,581円	騰落率 (分配金再投資ベース)	23.8%

(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;

- ・2023年1月から6月にかけて、世界的なインフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の改善期待などを背景に内外株式市場が上昇したことに加えて、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月から当期末にかけて、米国で利上げ打ち止め観測が高まり内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月中旬から10月にかけて、米欧の金融引き締め長期化観測などを受けて内外金利が上昇し、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	30.4%	26.4%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	44.2	33.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	10.5	0.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	14.9	11.8

(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5期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	39円	0.242%	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15,976円です。
(投信会社)	(18)	(0.110)	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)	(0.110)	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)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(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	4	0.023	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)	(0.013)	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)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	43	0.269	

(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。

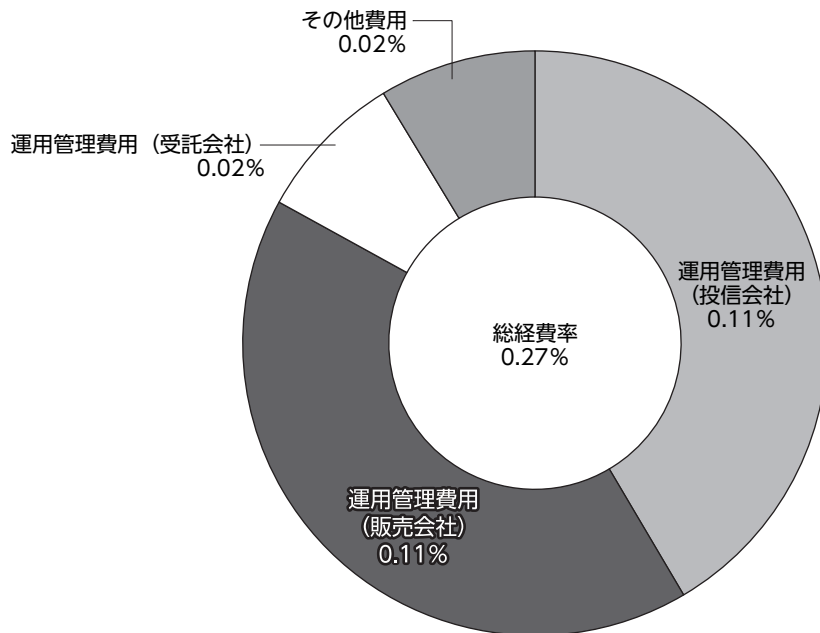
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.27%**です。



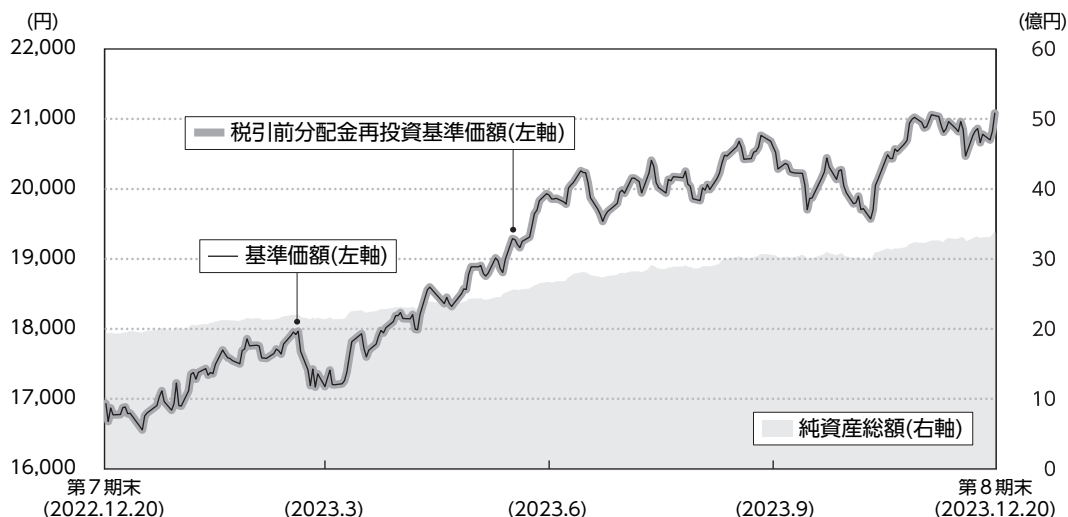
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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8期首	16,932円	既払分配金	0円
第8期末	21,081円	騰落率(分配金再投資ベース)	24.5%

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

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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;

- ・2023年1月から6月にかけて、世界的なインフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の改善期待などを背景に内外株式市場が上昇したことに加えて、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月から当期末にかけて、米国で利上げ打ち止め観測が高まり内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月中旬から10月にかけて、米欧の金融引き締め長期化観測などを受けて内外金利が上昇し、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	31.1%	26.4%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	45.5	33.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	8.1	0.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15.3	11.8

(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8期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	46円	0.242%	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19,110円です。
(信託会社)	(21)	(0.110)	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)	(21)	(0.110)	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)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(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	1	0.003	
(株式)	(1)	(0.003)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(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	0.022	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)	(3)	(0.013)	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)	(0.009)	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)	・ 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	51	0.269	

(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。

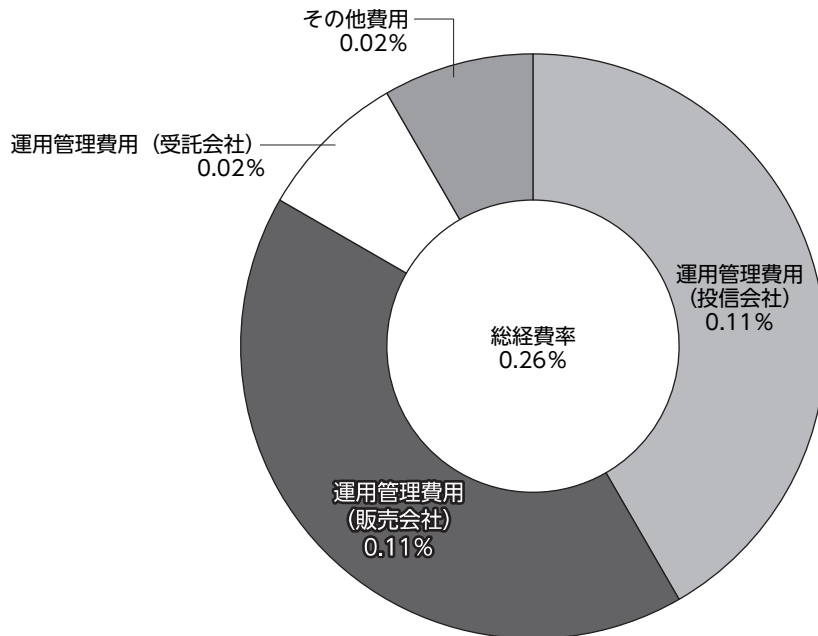
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.26%**です。



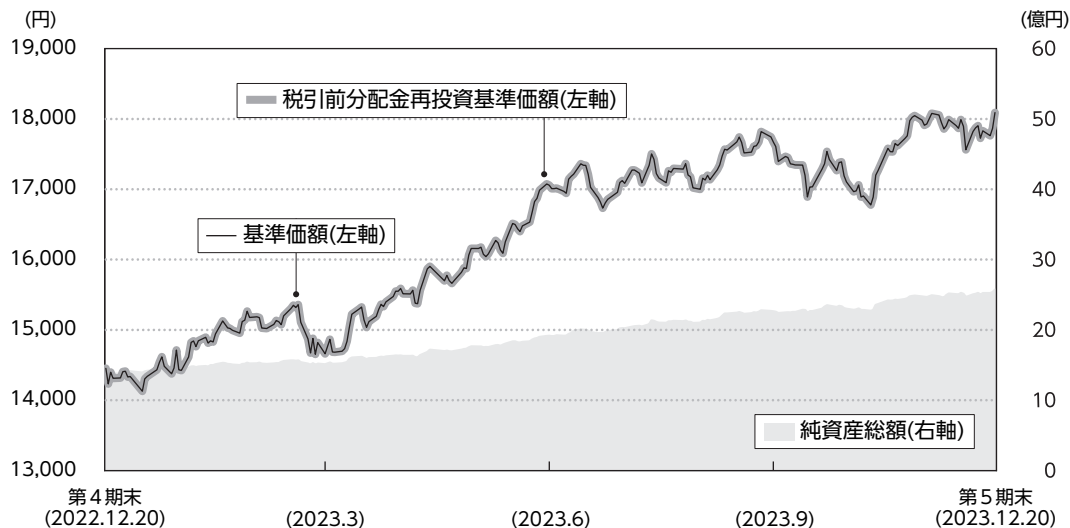
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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5期首	14,453円	既払分配金	0円
第5期末	18,090円	騰落率(分配金再投資ベース)	25.2%

(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、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;

- ・2023年1月から6月にかけて、世界的なインフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の改善期待などを背景に内外株式市場が上昇したことに加えて、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月から当期末にかけて、米国で利上げ打ち止め観測が高まり内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月中旬から10月にかけて、米欧の金融引き締め長期化観測などを受けて内外金利が上昇し、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	31.9%	26.4%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	46.7	33.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	5.9	0.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15.5	11.8

(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5期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	40円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は16,362円です。</p>
(投信会社)	(18)	(0.110)	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)	(0.110)	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)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(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	1	0.003	
(株式)	(1)	(0.003)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(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	0.023	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)	(2)	(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	44	0.269	

(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。

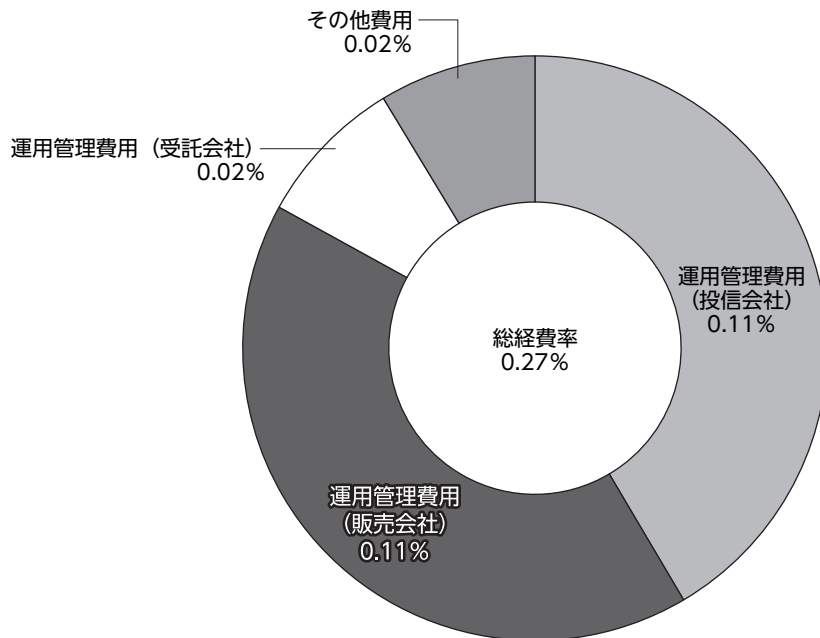
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.27%**です。



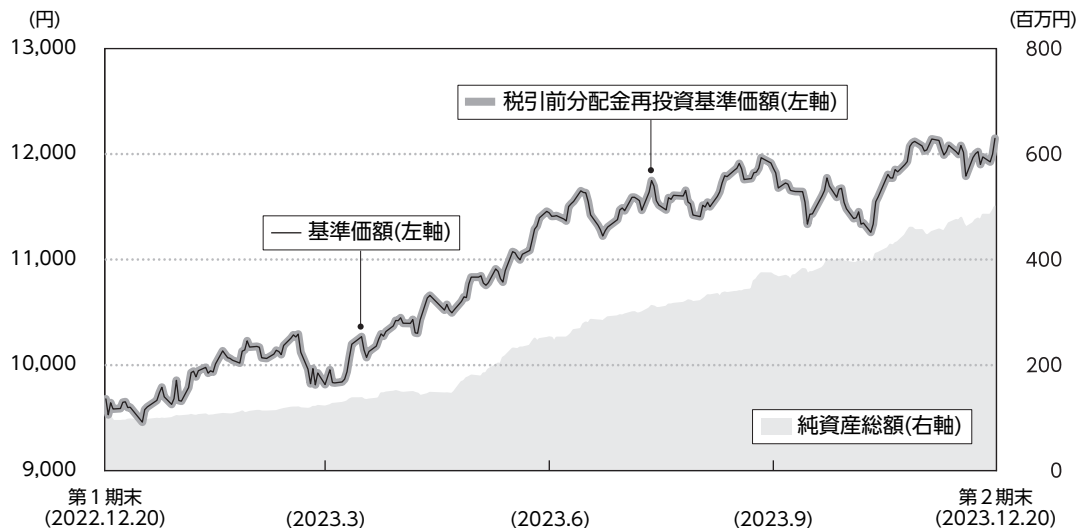
(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(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2期首	9,679円	既払分配金	0円
第2期末	12,148円	騰落率 (分配金再投資ベース)	25.5%

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

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

(注3) 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;

- ・2023年1月から6月にかけて、世界的なインフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の改善期待などを背景に内外株式市場が上昇したことに加えて、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したこと
- ・11月から当期末にかけて、米国で利上げ打ち止め観測が高まり内外金利が低下し、内外株式市場が上昇したこと

## &lt;下落要因&gt;

- ・2023年9月中旬から10月にかけて、米欧の金融引き締め長期化観測などを受けて内外金利が上昇し、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	32.3%	26.4%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	47.3	33.3
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	4.7	0.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	15.7	11.8

(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2期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	27円	0.242%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は10,974円です。</p>
(投信会社)	(12)	(0.110)	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)	(0.110)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	( 2)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.002	
(株式)	( 0)	(0.001)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(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)	( 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)	(0.011)	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)	(0.000)	<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	30	0.272	

(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。

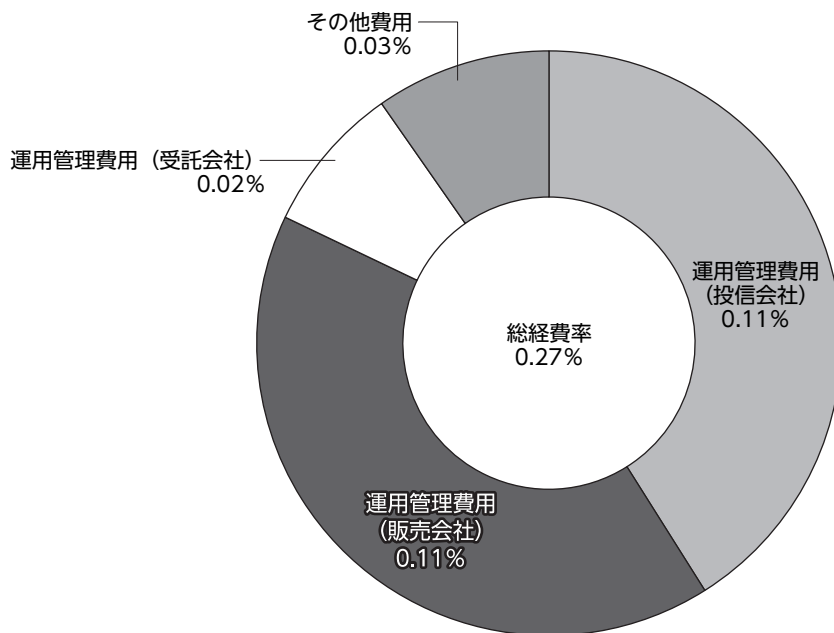
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.27%**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国内の好調な業績などから前期末と比較すると大きく上昇しました。

期初は円高米ドル安の一服や日銀が金融緩和策の現状維持を決定したことを受けて安心感が広がり、上昇しました。2023年3月に入ると欧米の金融システム不安を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことで下落しましたが、各国の金融当局による迅速な対応を受けて持ち直し、再び上昇基調となりました。その後も、債務上限問題や地方銀行の経営不安が懸念される米国株に比べ、相対的に良好な日本株の投資環境を好感した海外投資家の買いや円安米ドル高の進行に加え、国内企業による積極的な自社株買い方針等から上昇しました。

6月後半以降は米長期金利の上昇や中国の景気減速懸念、不動産企業の経営危機拡大が上値を抑える一方で、堅調な国内企業業績や円安米ドル高が下値を支え、一進一退の展開となりました。

8月後半以降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）議長の講演内容が市場の想定内であったことや米利上げ観測の後退、円安米ドル高の進行が追い風となり株価は大きく上昇しました。

9月中旬以降は日銀総裁のインタビュー報道を受け早期のマイナス金利脱却に対する思惑や米連邦公開市場委員会（FOMC）において政策金利の先行き見通しが上方修正されたことなどを背景に日米の長期金利の上昇が続いたことに加えて、米政府機関の一部閉鎖リスク等が嫌気されたことで下落する場面はありましたが、その後はFRBの追加利上げ観測の後退や日銀のYCCが微修正にとどまったことから株価は上昇しました。

### ■海外株式市況

海外株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、上昇基調で推移しましたが、その後は2023年2月に欧米の金融政策に対する楽観的な見方が後退し、利上げの長期化観測が高まったことや、3月上旬に米地銀の経営破綻に端を発した金融機関への信用不安が発生したことなどを背景に下落しました。3月下旬以降は主要グローバル企業の良好な業績動向に加え、米インフレ緩和の兆しを受けてFRBが景気の急失速を回避しつつ、インフレを抑制できるとの楽観的な見方が強まったことなどから堅調な推移となりました。期後半は米政府機関の閉鎖懸念や金融引き締め長期化、中東情勢の悪化などが嫌気されて軟調に推移しました。その後、当期末にかけては世界的に利上げ局面の終わりが近いとの期待感が高まったことなどから反発しました。

### ■国内債券市況

前期末を0.40%近辺でスタートした10年国債金利は、期初から日銀の金融政策修正に関する報道などが金利上昇圧力となり、YCCの上限となる0.5%近辺まで上昇したのち、2023年3月上旬まで横ばい推移しました。3月中旬には、米シリコンバレーバンク破綻を発端とした金融システム不安の強まりを受けて大幅に低下しましたが、4月以降、金融システム不安が後退したことや日銀の金融政策修正観測等から、金利上昇圧力が高まりました。その後、4月と6月の金融政策決定会合で金融政策が現状維持となったことにより、6月末までは0.4%台を中心に横ばい圏で推移しました。7月以降、内田日銀副総裁のインタビュー記事や日銀の物価上昇率の見直し引き上げ報道等から金融政策の修正観測が高まり、下旬の金融政策決定会合ではYCCの運用柔軟化

が決定され、国内金利は0.6%台に大きく上昇し、その後も米金利上昇や円安を反映して金利は上昇基調で推移しました。9月上旬には植田日銀総裁のインタビュー記事をきっかけに、金融政策の修正観測が高まったことで金利上昇が継続しました。その後、9月下旬の金融政策決定会合では現状維持となったものの、米金利上昇や円安進行、また10月末の金融政策決定会合ではYCCのさらなる柔軟化が決定されたことから長期金利は0.9%台まで大きく上昇しました。11月以降の米主要景気指標の悪化を受けた米金利低下や12月の金融政策決定会合で、金融政策修正が見送られ、その後も利上げを急がない姿勢が示されたことなどから早期の金融政策修正観測が後退し、11月前半から当期末にかけて金利は大きく低下する展開となりました。結局、10年国債金利は0.56%となり、期初から大きく上昇した水準で当期末を迎えました。

## ■海外債券市況

当期の米国10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

期初は低下基調で推移したものの、2023年3月上旬にかけては堅調な米雇用統計の発表などを受けて、金利は上昇基調で推移しました。4月上旬から10月中旬にかけては、FRBが利上げに積極的な姿勢を示したことなどから上昇基調で推移しました。その後、当期末にかけては軟調な米景気指標が相次ぎ、市場で早期利下げ観測が広がったことなどから金利は低下基調で推移しました。

当期のドイツ10年国債金利は期を通じて見ると低下しました。

2023年1月中旬から3月上旬にかけては、米金利の上昇や欧州中央銀行（ECB）高官の金融引き締めに関する積極的な発言などを受けて上昇しました。その後、米地銀の経営破綻を背景に金利は一時低下したものの、10月上旬にかけては米金利の上昇に追隨して上昇基調で推移しました。当期末にかけては軟調な米景気指標を受けて米金利が低下したことから、欧州金利も低下しました。

## ■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。

2023年3月下旬から6月末にかけては追加利上げ姿勢を示すFRB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などから、米ドルは上昇基調で推移しました。7月に内田日銀副総裁の発言を受けて金融緩和修正への期待感が高まったことなどから一時米ドルが対円で下落したものの、その後は再び米ドルは上昇基調となりました。当期末は軟調な米雇用統計などを背景に、米ドルは対円で下落しました。

ユーロ／円レートは期を通じて見ると上昇しました。

期初から2023年11月中旬にかけては根強いインフレ圧力を受けて金利が上昇したことや、イタリア国債の格下げ回避やギリシャ国債の格上げを受け、ユーロに対する懸念が後退したことなどから上昇基調で推移しました。当期末にかけてはECBの利下げに慎重な姿勢やドイツの景気不安などからユーロは対円で下落しました。

# 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	4.2%	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

(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>

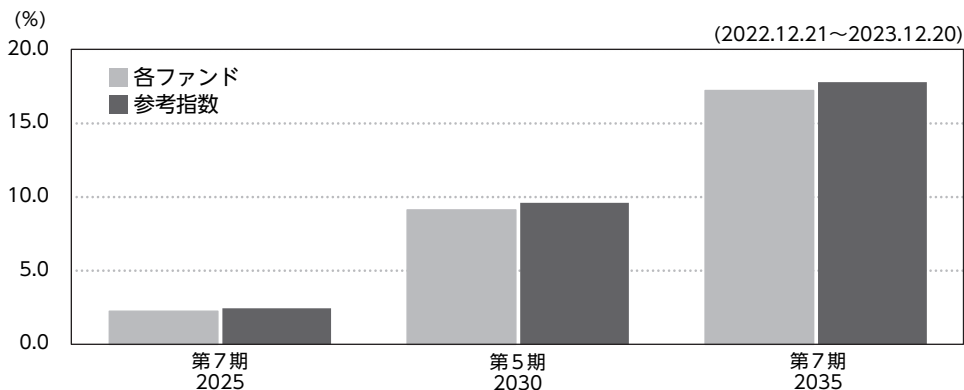
日本を除く各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含まず）しているリートを主要投資対象とし、ベンチマークであるS & Pグローバルリートインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

#### <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+2.2%となり、参考指数騰落率（+2.5%）を下回りました。

### 2030

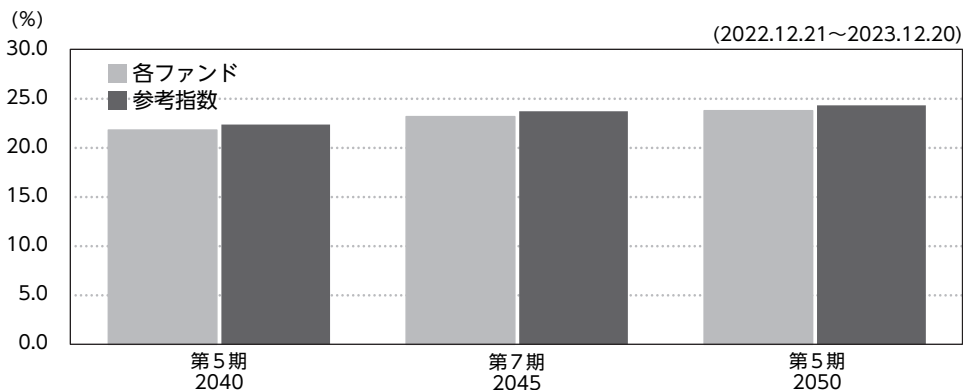
当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+9.1%となり、参考指数騰落率（+9.6%）を下回りました。

### 2035

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+17.2%となり、参考指数騰落率（+17.8%）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。

## ■2040

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+21.8%となり、参考指数騰落率(+22.4%)を下回りました。

## ■2045

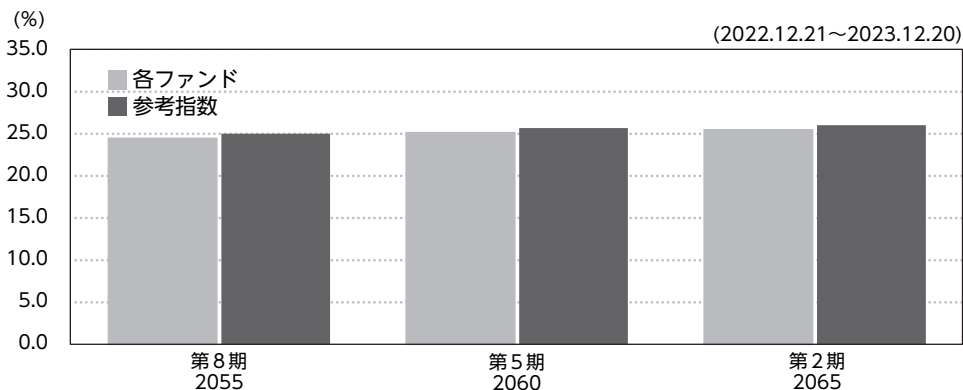
当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+23.2%となり、参考指数騰落率(+23.7%)を下回りました。

## ■2050

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+23.8%となり、参考指数騰落率(+24.3%)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。

## ■2055

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+24.5%となり、参考指数騰落率(+25.0%)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+25.2%となり、参考指数騰落率(+25.7%)を下回りました。

## ■2065

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+25.5%となり、参考指数騰落率(+26.0%)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	2022年12月21日～2023年12月20日		
	第7期	第5期	第7期
	2025	2030	2035
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	3,221円	5,656円

項目	2022年12月21日～2023年12月20日		
	第5期	第7期	第5期
	2040	2045	2050
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	6,932円	7,091円	7,581円

項目	2022年12月21日～2023年12月20日		
	第8期	第5期	第2期
	2055	2060	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	11,080円	8,090円	2,148円

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

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

# 今後の運用方針

## ■各ファンド

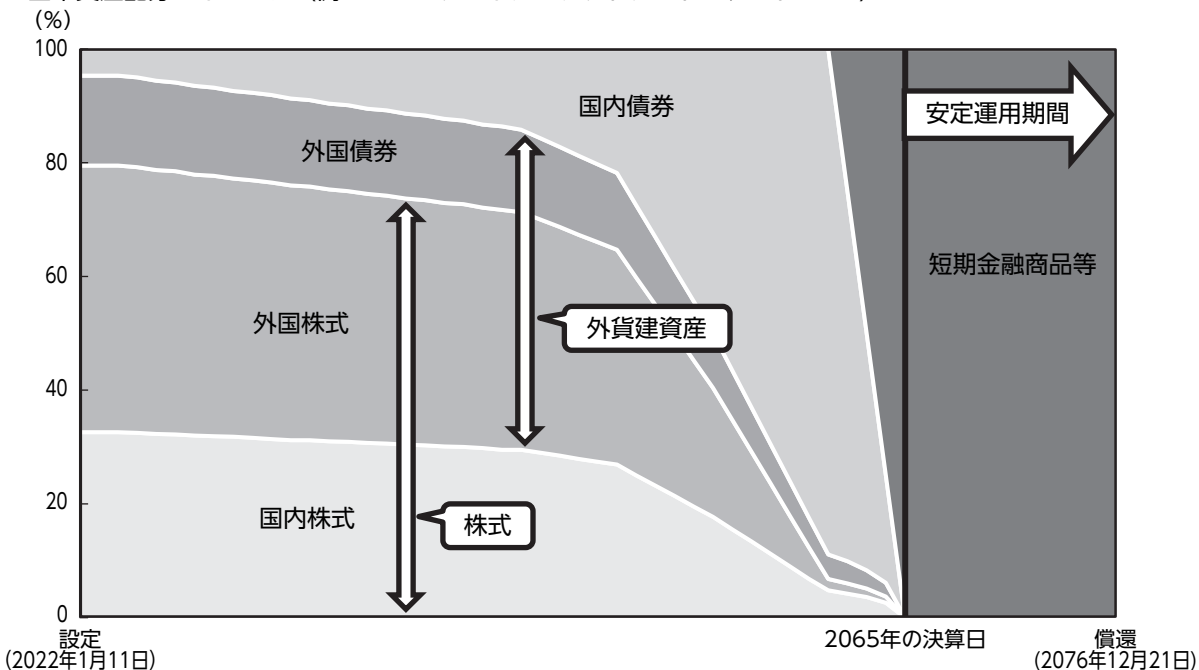
来期の基本資産配分に則り、複数のマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を含む各国の株式（リートを含みます）、公社債ならびに短期金融商品等に分散投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

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	3.6%	1.5%	41.7%	3.2%	50.0%
2030	11.2	12.4	69.5	6.9	0.0
2035	21.4	28.7	38.8	11.1	0.0
2040	27.9	39.4	18.8	13.9	0.0
2045	29.8	42.3	13.3	14.6	0.0
2050	30.6	43.6	10.8	15.0	0.0
2055	31.2	44.8	8.7	15.3	0.0
2060	32.0	45.9	6.5	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7期末 2023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	4.2%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	1.8
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	65.3
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	3.9
ニッセイマネーマーケット マザーファンド	24.8

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

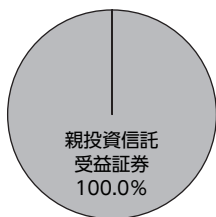
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

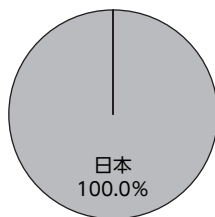
項目	第7期末 2023年12月20日
純資産総額	2,722,334,064円
受益権総口数	2,516,991,763口
1万口当たり基準価額	10,816円

(注) 当期間中における追加設定元本額は605,456,093円、同解約元本額は483,280,969円です。

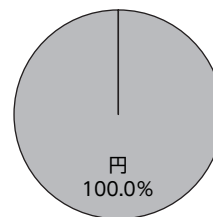
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年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2030の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第5期末 2023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	13.3%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	15.9
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	63.0
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	7.8

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

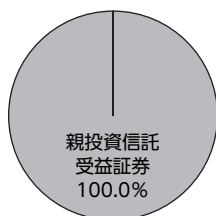
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

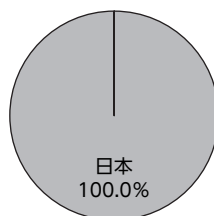
項目	第5期末 2023年12月20日
純資産総額	4,360,316,088円
受益権総口数	3,297,966,650口
1万口当たり基準価額	13,221円

(注) 当期間中における追加設定元本額は898,037,242円、同解約元本額は419,575,854円です。

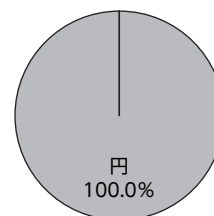
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年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7期末 2023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	23.0%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	32.1
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	33.1
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	11.9

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

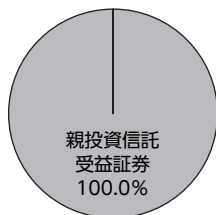
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

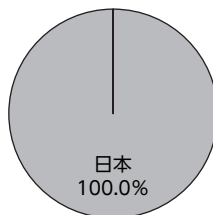
項目	第7期末 2023年12月20日
純資産総額	7,949,712,335円
受益権総口数	5,077,721,933口
1万口当たり基準価額	15,656円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,504,116,257円、同解約元本額は388,063,722円です。

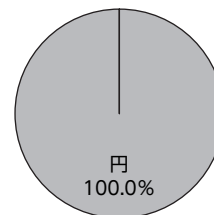
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年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2040の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第5期末 2023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	28.2%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	40.5
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	17.2
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	14.1

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

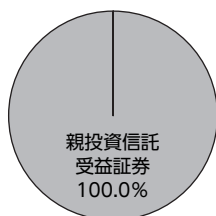
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

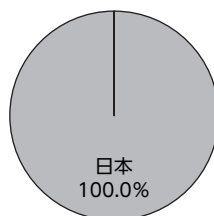
項目	第5期末 2023年12月20日
純資産総額	3,649,665,010円
受益権総口数	2,155,369,705口
1万口当たり基準価額	16,933円

(注) 当期間中における追加設定元本額は720,019,772円、同解約元本額は171,754,084円です。

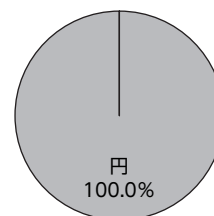
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年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2045の組入資産の内容

### ■組入ファンド

	第7期末 2023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	29.7%
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	12.6
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	14.7

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

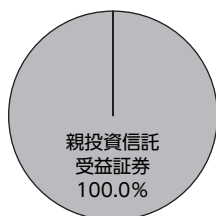
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

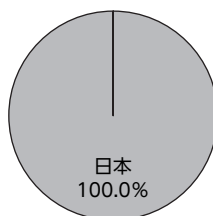
項目	第7期末 2023年12月20日
純資産総額	4,020,533,991円
受益権総口数	2,352,336,829口
1万口当たり基準価額	17,092円

(注) 当期間中における追加設定元本額は845,600,842円、同解約元本額は182,133,107円です。

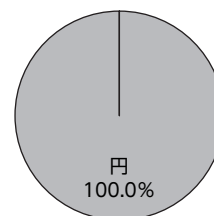
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年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5期末 2023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	30.4%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	44.2
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	10.5
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	14.9

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

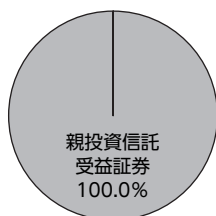
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

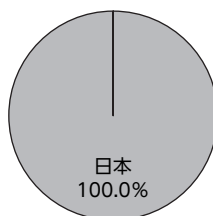
項目	第5期末 2023年12月20日
純資産総額	1,732,803,789円
受益権総口数	985,587,627口
1万口当たり基準価額	17,581円

(注) 当期間中における追加設定元本額は440,631,664円、同解約元本額は132,073,564円です。

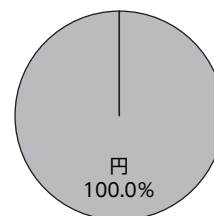
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023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8期末 2023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	31.1%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	45.5
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	8.1
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	15.3

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

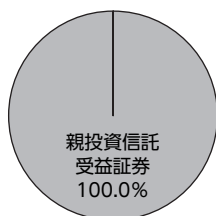
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

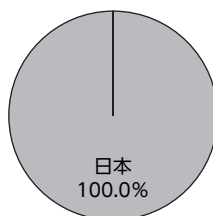
項目	第8期末 2023年12月20日
純資産総額	3,361,093,915円
受益権総口数	1,594,382,095口
1万口当たり基準価額	21,081円

(注) 当期間中における追加設定元本額は699,384,047円、同解約元本額は248,592,208円です。

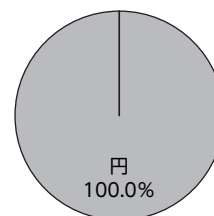
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年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5期末 2023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	31.9%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	46.7
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	5.9
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	15.5

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

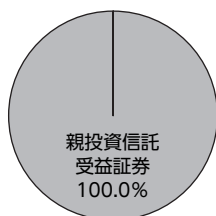
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

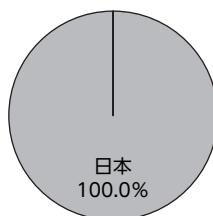
項目	第5期末 2023年12月20日
純資産総額	2,570,982,906円
受益権総口数	1,421,187,479口
1万口当たり基準価額	18,090円

(注) 当期間中における追加設定元本額は803,872,816円、同解約元本額は338,125,553円です。

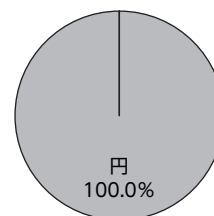
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年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2期末 2023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	32.3%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	47.3
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	4.7
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	15.7

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

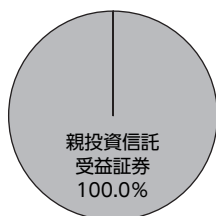
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

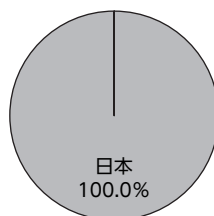
項目	第2期末 2023年12月20日
純資産総額	499,851,453円
受益権総口数	411,452,351口
1万口当たり基準価額	12,148円

(注) 当期間中における追加設定元本額は470,611,031円、同解約元本額は164,299,857円です。

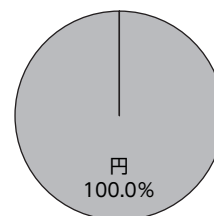
### ■資産別配分



### ■国別配分



### ■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年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

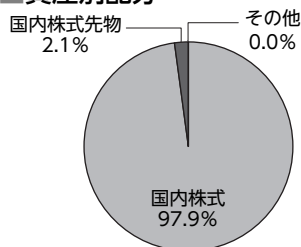
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.5%
ソニーグループ	円	2.7
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	2.1
TOPIX 先物 0503月 買	円	2.1
キーエンス	円	2.0
日本電信電話	円	1.7
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.5
武田薬品工業	円	1.3
第一三共	円	1.3
日立製作所	円	1.2
組入銘柄数		1,822

## ■ 1万口当たりの費用明細

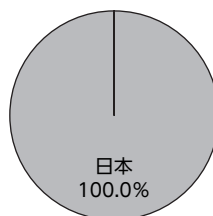
2022.2.22~2023.2.20

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

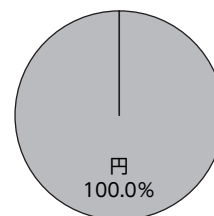
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



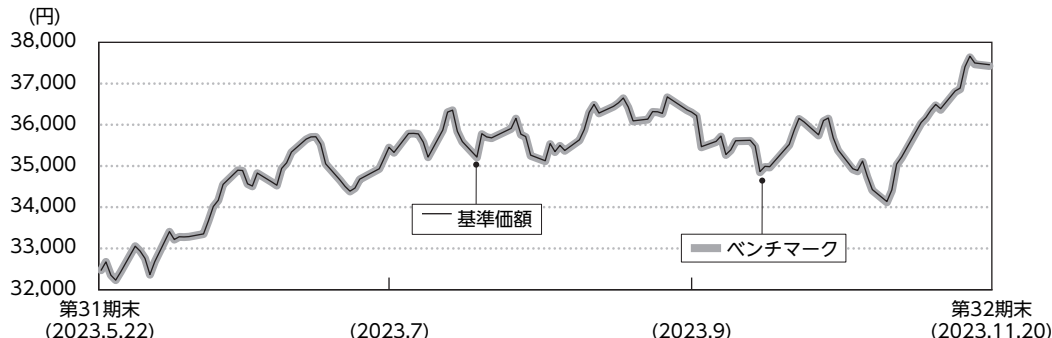
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

# ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

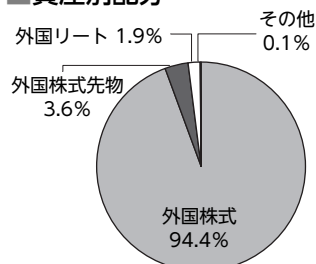
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	5.4%
MICROSOFT CORP	米ドル	4.7
S&P 500 EMINI FUTURE 202312 買	米ドル	2.7
AMAZON.COM INC	米ドル	2.4
NVIDIA CORP	米ドル	2.2
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.4
META PLATFORMS INC-A	米ドル	1.3
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.3
TESLA, INC.	米ドル	1.2
UNITEDHEALTH GROUP INC	米ドル	0.9
組入銘柄数		1278

## ■ 1万口当たりの費用明細

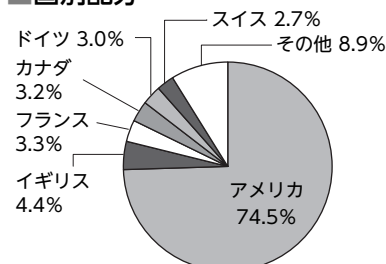
2023.5.23~2023.11.20

項目	金額
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)
(先物・オプション) (投資信託証券)	(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	5

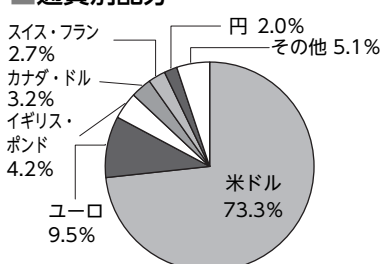
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



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

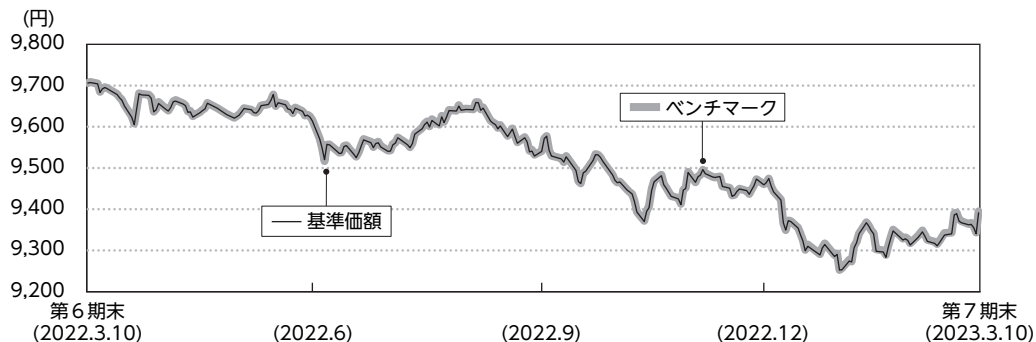
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2023年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

# ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

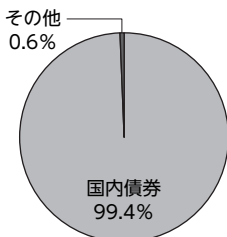
銘柄名	通貨	比率
第350回 利付国債 (10年)	円	0.9%
第364回 利付国債 (10年)	円	0.9
第368回 利付国債 (10年)	円	0.8
第365回 利付国債 (10年)	円	0.8
第349回 利付国債 (10年)	円	0.8
第338回 利付国債 (10年)	円	0.8
第360回 利付国債 (10年)	円	0.8
第361回 利付国債 (10年)	円	0.8
第218回 政保道路機構債券	円	0.8
第359回 利付国債 (10年)	円	0.8
組入銘柄数		368

## ■ 1万口当たりの費用明細

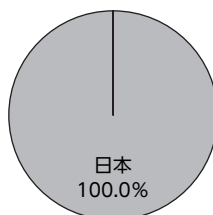
2022.3.11~2023.3.10

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

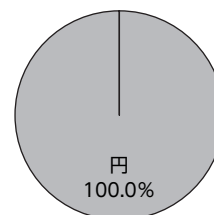
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



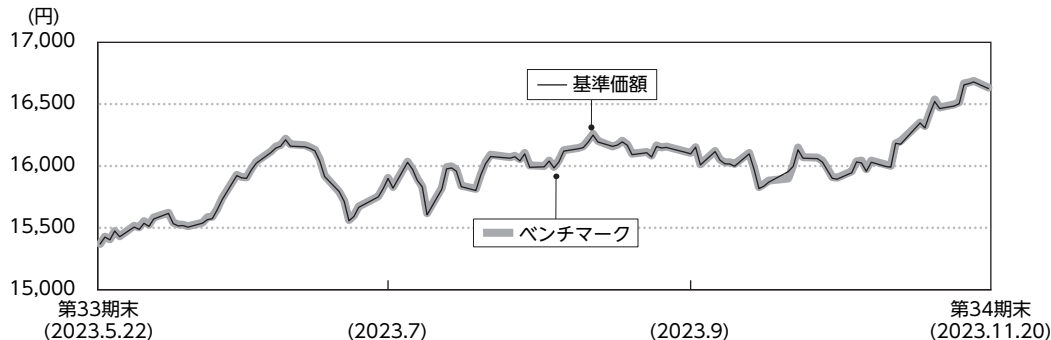
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

# ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

## ■ 上位銘柄

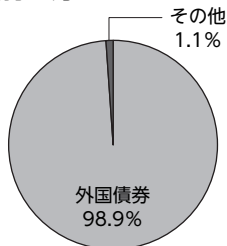
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.0% 2025/2/15	米ドル	1.7%
US TREASURY 2.25% 2025/11/15	米ドル	1.6
US TREASURY 2.125% 2025/5/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.25% 2024/11/15	米ドル	1.5
US TREASURY 1.625% 2026/2/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.875% 2028/8/15	米ドル	1.3
US TREASURY 1.625% 2026/5/15	米ドル	1.3
US TREASURY 1.5% 2026/8/15	米ドル	1.3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

## ■ 1万口当たりの費用明細

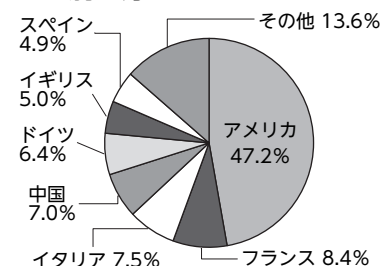
2023.5.23~2023.11.20

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

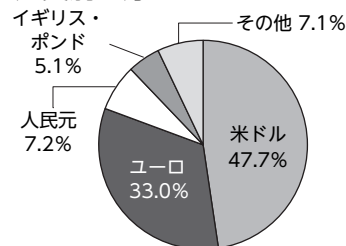
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



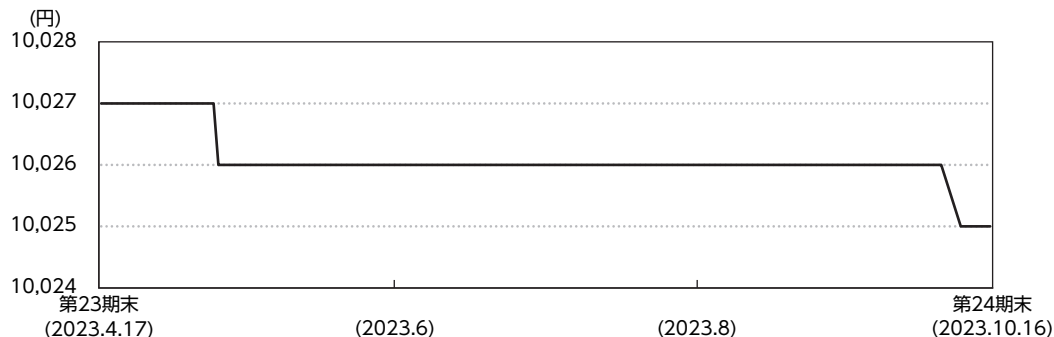
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

# ニッセイマネーマーケットマザーファンドの概要

## ■ 基準価額の推移



## ■ 上位銘柄

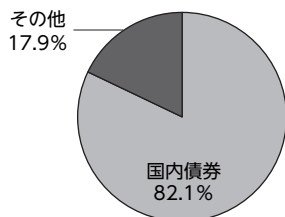
銘柄名	通貨	比率
第132回 共同発行市場公募地方債	円	21.6%
平成26年度第4回 京都府公募公債	円	13.9
第202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	円	13.9
平成25年度第11回 埼玉県公募公債	円	12.0
第727回 東京都公募公債	円	11.0
令和元年度第1回 長崎県公募公債	円	7.8
第1121回 国庫短期証券	円	1.9
組入銘柄数		7

## ■ 1万口当たりの費用明細

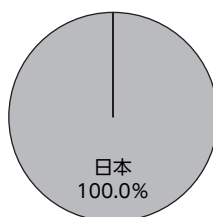
2023.4.18~2023.10.16

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

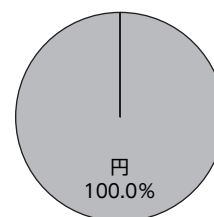
## ■ 資産別配分



## ■ 国別配分



## ■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2023年10月16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 (分配額)	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(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
7期(2023年12月20日)	10,816	0	2.2	10,816	11,007	2.5	5.8	0.2	87.6	—	2,722

(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(分配額)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)2022年12月20日	10,578	—	10,743	—	6.4	0.2	92.4	—
12月末	10,515	△0.6	10,685	△0.5	5.7	0.1	86.1	—
2023年1月末	10,525	△0.5	10,699	△0.4	6.1	0.2	86.1	—
2月末	10,615	0.3	10,791	0.4	5.9	0.1	85.9	—
3月末	10,725	1.4	10,902	1.5	5.7	0.2	85.7	—
4月末	10,762	1.7	10,940	1.8	5.9	0.2	90.7	—
5月末	10,790	2.0	10,970	2.1	5.9	0.2	84.9	—
6月末	10,873	2.8	11,056	2.9	6.0	0.2	84.2	—
7月末	10,762	1.7	10,944	1.9	5.9	0.1	86.3	—
8月末	10,729	1.4	10,910	1.6	5.9	0.2	88.5	—
9月末	10,667	0.8	10,851	1.0	5.7	0.2	88.8	—
10月末	10,534	△0.4	10,718	△0.2	5.8	0.2	85.4	—
11月末	10,732	1.5	10,919	1.6	5.9	0.1	85.0	—
(期末)2023年12月20日	10,816	2.2	11,007	2.5	5.8	0.2	87.6	—

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2022年12月21日～2023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	14,143	35,286	27,895	68,357
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	4,694	15,301	8,556	27,825
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	499,911	470,042	1,024,848	958,936
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	19,972	30,741	29,083	44,657
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	835,230	837,534	161,865	162,288

(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	45,930,418千円	123,411,360千円	2,297千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	182,556,803千円	657,945,943千円	-
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.25	0.18	-

(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12月21日～2023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ファンド2025

## 親投資信託残高

2023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	54,739	40,986	113,724
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	16,868	13,006	49,594
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,408,722	1,883,785	1,777,728
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	72,883	63,772	106,250
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	—	673,364	675,047

(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72,435,703千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが221,443,667千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが57,111,933千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが43,780,166千口、ニッセイマネーマーケットマザーファンドが723,755千口です。

## 投資信託財産の構成

2023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	113,724	4.2
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	49,594	1.8
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,777,728	65.1
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	106,250	3.9
ニッセイマネーマーケットマザーファンド	675,047	24.7
コール・ローン等、その他	7,086	0.3
投資信託財産総額	2,729,432	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144.03円、1カナダ・ドル107.94円、1オーストラリア・ドル97.26円、1香港ドル18.47円、1シンガポール・ドル108.40円、1ニュージーランド・ドル90.25円、1イギリス・ポンド183.28円、1イスラエル・シェケル39.434円、1スイス・フラン167.40円、1デンマーク・クローネ21.20円、1ノルウェー・クローネ14.01円、1スウェーデン・クローナ14.17円、1メキシコ・ペソ8.438円、1人民元20.203円、1マレーシア・リンギット30.902円、1南アフリカ・ランド7.85円、1ポーランド・ズロチ36.534円、1ユーロ158.07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（841,108,711千円）の投資信託財産総額（847,341,378千円）に対する比率は99.3%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（72,901,031千円）の投資信託財産総額（73,176,781千円）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（13,039,940千円）の投資信託財産総額（13,182,409千円）に対する比率は98.9%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2025

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>2,729,432,465円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,147,947
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	113,724,611
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	49,594,391
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	1,777,728,582
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	106,250,680
ニッセイマネーマーケット マザーファンド(評価額)	675,047,891
未 収 入 金	4,938,363
<b>(B)負債</b>	<b>7,098,401</b>
未 払 解 約 金	4,878,114
未 払 信 託 報 酬	2,098,898
そ の 他 未 払 費 用	121,389
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>2,722,334,064</b>
元 本	2,516,991,763
次 期 繰 越 損 益 金	205,342,301
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>2,516,991,763口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>10,816円</b>

(注) 期首元本額	2,394,816,639円
期中追加設定元本額	605,456,093円
期中一部解約元本額	483,280,969円

## 損益の状況

当期(2022年12月21日~2023年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>△ 274円</b>
受 取 利 息	27
支 払 利 息	△ 301
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>57,567,251</b>
売 買 益	66,023,931
売 買 損	△ 8,456,680
<b>(C)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 4,339,286</b>
<b>(D)当 期 損 益 金(A+B+C)</b>	<b>53,227,691</b>
<b>(E)前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>△ 42,277,254</b>
( 配 当 準 備 積 立 金 )	( 47,659,835)
( 繰 越 欠 損 金 )	(△ 89,937,089)
<b>(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *</b>	<b>194,391,864</b>
( 配 当 等 相 当 額 )	( 223,205,966)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 28,814,102)
<b>(G)合 計(D+E+F)</b>	<b>205,342,301</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(G)</b>	<b>205,342,301</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	194,391,864
( 配 当 等 相 当 額 )	( 223,205,966)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 28,814,102)
分 配 準 備 積 立 金	47,659,835
繰 越 欠 損 金	△ 36,709,398

- (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	223,205,966円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	47,659,835円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	270,865,801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
5期(2023年12月20日)	13,221	0	9.1	13,221	13,475	9.6	28.2	0.7	70.0	0.3	4,360

(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		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)2022年12月20日	12,115	-	12,294	-	32.6	1.0	65.3	0.4	
12月末	12,013	△0.8	12,200	△0.8	27.5	0.8	70.8	0.3	
2023年1月末	12,142	0.2	12,337	0.3	28.9	0.8	69.3	0.4	
2月末	12,320	1.7	12,518	1.8	28.1	0.8	70.0	0.3	
3月末	12,459	2.8	12,666	3.0	27.6	0.9	70.6	0.3	
4月末	12,582	3.9	12,793	4.1	28.6	0.7	69.8	0.3	
5月末	12,749	5.2	12,969	5.5	28.5	0.9	69.8	0.3	
6月末	13,092	8.1	13,319	8.3	28.6	1.0	69.6	0.3	
7月末	12,996	7.3	13,225	7.6	28.7	0.7	69.7	0.3	
8月末	13,007	7.4	13,239	7.7	28.3	1.0	69.7	0.3	
9月末	12,888	6.4	13,124	6.7	27.6	1.0	70.5	0.3	
10月末	12,634	4.3	12,871	4.7	28.0	0.8	70.3	0.3	
11月末	13,083	8.0	13,329	8.4	28.7	0.6	69.8	0.3	
(期末)2023年12月20日	13,221	9.1	13,475	9.6	28.2	0.7	70.0	0.3	

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2022年12月21日～2023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	71,788	185,193	103,845	252,749
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	64,579	216,949	104,045	327,935
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,259,132	1,181,733	434,160	406,882
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	68,244	106,663	65,489	99,975

(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	45,930,418千円	123,411,360千円	2,297千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	182,556,803千円	657,945,943千円	－
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.25	0.18	－

(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12月21日～2023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

2023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	240,808	208,751	579,223
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	221,778	182,312	695,176
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,085,538	2,910,510	2,746,648
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	200,892	203,647	339,297

(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72,435,703千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが221,443,667千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが57,111,933千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが43,780,166千口です。

## 投資信託財産の構成

2023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	579,223	13.3
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	695,176	15.9
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,746,648	62.9
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	339,297	7.8
コール・ローン等、その他	7,702	0.2
投資信託財産総額	4,368,048	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144.03円、1カナダ・ドル107.94円、1オーストラリア・ドル97.26円、1香港ドル18.47円、1シンガポール・ドル108.40円、1ニュージーランド・ドル90.25円、1イギリス・ポンド183.28円、1イスラエル・シェケル39.434円、1スイス・フラン167.40円、1デンマーク・クローネ21.20円、1ノルウェー・クローネ14.01円、1スウェーデン・クローナ14.17円、1メキシコ・ペソ8.438円、1人民元20.203円、1マレーシア・リンギット30.902円、1南アフリカ・ランド7.85円、1ポーランド・ズロチ36.534円、1ユーロ158.07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（841,108,711千円）の投資信託財産総額（847,341,378千円）に対する比率は99.3%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（72,901,031千円）の投資信託財産総額（73,176,781千円）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（13,039,940千円）の投資信託財産総額（13,182,409千円）に対する比率は98.9%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

(2023年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>4,368,048,449円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,896,021
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	579,223,683
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	695,176,026
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	2,746,648,839
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	339,297,201
未 収 入 金	2,806,679
<b>(B)負債</b>	<b>7,732,361</b>
未 払 解 約 金	2,659,303
未 払 信 託 報 酬	4,900,670
そ の 他 未 払 費 用	172,388
<b>(C)純 資 産 総 額 (A-B)</b>	<b>4,360,316,088</b>
元 本	3,297,966,650
次 期 繰 越 損 益 金	1,062,349,438
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>3,297,966,650口</b>
1万口当たり基準価額 (C/D)	13,221円

(注) 期首元本額	2,819,505,262円
期中追加設定元本額	898,037,242円
期中一部解約元本額	419,575,854円

## 損益の状況

当期 (2022年12月21日~2023年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>△ 722円</b>
受 取 利 息	74
支 払 利 息	△ 796
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>317,274,807</b>
売 買 益	345,841,443
売 買 損	△ 28,566,636
<b>(C)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 9,539,887</b>
<b>(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)</b>	<b>307,734,198</b>
<b>(E)前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>39,279,478</b>
( 配 分 準 備 積 立 金 ) (	126,847,472)
( 繰 越 欠 損 金 ) (△	87,567,994)
<b>(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *</b>	<b>715,335,762</b>
( 配 当 等 相 当 額 ) (	394,417,326)
( 売 買 損 益 相 当 額 ) (	320,918,436)
<b>(G)合 計 (D + E + F)</b>	<b>1,062,349,438</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(G)</b>	<b>1,062,349,438</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	715,335,762
( 配 当 等 相 当 額 ) (	394,417,326)
( 売 買 損 益 相 当 額 ) (	320,918,436)
分 配 準 備 積 立 金	347,014,398
繰 越 欠 損 金	△ 722

- (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	220,166,926円
(c) 信託約款に定める収益調整金	715,335,762円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	126,847,472円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	1,062,350,160円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	3,221.23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(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
7期(2023年12月20日)	15,656	0	17.2	15,656	16,143	17.8	53.0	1.4	44.5	0.6	7,949

(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
	円	%			%		%	%	%	%
(期首)2022年12月20日	13,354	-		13,704	-		56.4	1.8	40.6	0.7
12月末	13,239	△	0.9	13,593	△	0.8	52.3	1.5	45.0	0.7
2023年1月末	13,537	1.4		13,906	1.5		53.8	1.5	43.6	0.7
2月末	13,786	3.2		14,162	3.3		52.8	1.6	44.4	0.7
3月末	13,902	4.1		14,291	4.3		52.2	1.7	45.0	0.6
4月末	14,130	5.8		14,530	6.0		53.5	1.3	44.1	0.7
5月末	14,491	8.5		14,908	8.8		53.3	1.6	44.2	0.6
6月末	15,183	13.7		15,623	14.0		53.3	1.8	43.9	0.6
7月末	15,187	13.7		15,632	14.1		53.6	1.3	44.0	0.6
8月末	15,297	14.5		15,750	14.9		52.9	1.9	44.1	0.6
9月末	15,130	13.3		15,584	13.7		52.2	1.9	45.0	0.6
10月末	14,778	10.7		15,229	11.1		52.7	1.5	44.8	0.6
11月末	15,493	16.0		15,969	16.5		53.7	1.1	44.1	0.6
(期末)2023年12月20日	15,656	17.2		16,143	17.8		53.0	1.4	44.5	0.6

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。



## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2022年12月21日～2023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	226,630	583,398	175,309	431,570
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	230,255	771,805	186,805	603,384
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,511,510	1,419,167	312,019	292,264
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	211,572	329,593	103,833	158,601

(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	45,930,418千円	123,411,360千円	2,297千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	182,556,803千円	657,945,943千円	－
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.25	0.18	－

(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12月21日～2023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

2023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	607,219	658,540	1,827,252
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	625,220	668,670	2,549,709
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	1,586,926	2,786,417	2,629,541
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	458,411	566,150	943,262

(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72,435,703千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが221,443,667千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが57,111,933千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが43,780,166千口です。

## 投資信託財産の構成

2023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	1,827,252	22.9
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	2,549,709	32.0
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,629,541	33.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	943,262	11.8
コール・ローン等、その他	23,787	0.3
投資信託財産総額	7,973,553	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144.03円、1カナダ・ドル107.94円、1オーストラリア・ドル97.26円、1香港ドル18.47円、1シンガポール・ドル108.40円、1ニュージーランド・ドル90.25円、1イギリス・ポンド183.28円、1イスラエル・シェケル39.434円、1スイス・フラン167.40円、1デンマーク・クローネ21.20円、1ノルウェー・クローネ14.01円、1スウェーデン・クローナ14.17円、1メキシコ・ペソ8.438円、1人民元20.203円、1マレーシア・リンギット30.902円、1南アフリカ・ランド7.85円、1ポーランド・ズロチ36.534円、1ユーロ158.07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（841,108,711千円）の投資信託財産総額（847,341,378千円）に対する比率は99.3%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（72,901,031千円）の投資信託財産総額（73,176,781千円）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（13,039,940千円）の投資信託財産総額（13,182,409千円）に対する比率は98.9%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

(2023年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>7,973,553,768円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,727,040
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,827,252,039
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,549,709,321
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	2,629,541,824
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	943,262,919
未 収 入 金	15,060,625
<b>(B)負債</b>	<b>23,841,433</b>
未 払 解 約 金	14,793,811
未 払 信 託 報 酬	8,776,551
そ の 他 未 払 費 用	271,071
<b>(C)純 資 産 総 額 (A-B)</b>	<b>7,949,712,335</b>
元 本	5,077,721,933
次 期 繰 越 損 益 金	2,871,990,402
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>5,077,721,933口</b>
1万口当たり基準価額 (C/D)	<b>15,656円</b>

(注) 期首元本額	3,961,669,398円
期中追加設定元本額	1,504,116,257円
期中一部解約元本額	388,063,722円

## 損益の状況

当期 (2022年12月21日~2023年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>△ 1,336円</b>
受 取 利 息	102
支 払 利 息	△ 1,438
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>993,625,440</b>
売 買 益	1,045,616,877
売 買 損	△ 51,991,437
<b>(C)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 16,289,831</b>
<b>(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)</b>	<b>977,334,273</b>
<b>(E)前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>245,318,834</b>
( 配 分 準 備 積 立 金 ) (	335,195,167)
( 繰 越 欠 損 金 ) (△	89,876,333)
<b>(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *</b>	<b>1,649,337,295</b>
( 配 当 等 相 当 額 ) (	1,356,905,140)
( 売 買 損 益 相 当 額 ) (	292,432,155)
<b>(G)合 計 (D + E + F)</b>	<b>2,871,990,402</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 (G)</b>	<b>2,871,990,402</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	1,649,337,295
( 配 当 等 相 当 額 ) (	1,356,905,140)
( 売 買 損 益 相 当 額 ) (	292,432,155)
分 配 準 備 積 立 金	1,222,654,443
繰 越 欠 損 金 △	1,336

- (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	887,459,276円
(c) 信託約款に定める収益調整金	1,649,337,295円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	335,195,167円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	2,871,991,738円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	5,656.06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)	11,461	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
5期(2023年12月20日)	16,933	0	21.8	16,933	17,375	22.4	66.2	1.7	30.9	0.8	3,649

(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		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)2022年12月20日	13,899	-	14,198	-	66.3	2.1	30.4	0.9	
12月末	13,786	△ 0.8	14,087	△ 0.8	65.7	1.9	31.1	0.9	
2023年1月末	14,182	2.0	14,499	2.1	66.7	1.9	30.1	0.9	
2月末	14,470	4.1	14,794	4.2	65.8	2.0	30.9	0.9	
3月末	14,570	4.8	14,905	5.0	65.3	2.1	31.4	0.8	
4月末	14,860	6.9	15,206	7.1	66.6	1.6	30.5	0.8	
5月末	15,337	10.3	15,703	10.6	66.5	2.1	30.6	0.8	
6月末	16,241	16.9	16,631	17.1	66.1	2.2	30.5	0.8	
7月末	16,312	17.4	16,708	17.7	66.7	1.7	30.5	0.8	
8月末	16,485	18.6	16,892	19.0	65.8	2.4	30.7	0.8	
9月末	16,290	17.2	16,698	17.6	65.3	2.4	31.3	0.7	
10月末	15,881	14.3	16,285	14.7	65.8	1.9	31.2	0.7	
11月末	16,757	20.6	17,189	21.1	66.9	1.4	30.6	0.8	
(期末)2023年12月20日	16,933	21.8	17,375	22.4	66.2	1.7	30.9	0.8	

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

2022年12月21日～2023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	139,566	360,442	66,791	168,731
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	143,530	483,143	67,729	227,523
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	359,005	337,439	78,423	73,502
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	132,767	207,226	43,629	67,463

(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	45,930,418千円	123,411,360千円	2,297千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	182,556,803千円	657,945,943千円	－
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.25	0.18	－

(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12月21日～2023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

2023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	298,502	371,277	1,030,184
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	312,177	387,978	1,479,401
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	383,964	664,546	627,132
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	218,749	307,887	512,971

(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72,435,703千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが221,443,667千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが57,111,933千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが43,780,166千口です。

## 投資信託財産の構成

2023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	1,030,184	28.2
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,479,401	40.5
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	627,132	17.2
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	512,971	14.0
コール・ローン等、その他	4,778	0.1
投資信託財産総額	3,654,468	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144.03円、1カナダ・ドル107.94円、1オーストラリア・ドル97.26円、1香港ドル18.47円、1シンガポール・ドル108.40円、1ニュージーランド・ドル90.25円、1イギリス・ポンド183.28円、1イスラエル・シェケル39.434円、1スイス・フラン167.40円、1デンマーク・クローネ21.20円、1ノルウェー・クローネ14.01円、1スウェーデン・クローナ14.17円、1メキシコ・ペソ8.438円、1人民元20.203円、1マレーシア・リンギット30.902円、1南アフリカ・ランド7.85円、1ポーランド・ズロチ36.534円、1ユーロ158.07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（841,108,711千円）の投資信託財産総額（847,341,378千円）に対する比率は99.3%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（72,901,031千円）の投資信託財産総額（73,176,781千円）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（13,039,940千円）の投資信託財産総額（13,182,409千円）に対する比率は98.9%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

(2023年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>3,654,468,735円</b>
コール・ローン等	3,968,611
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,030,184,295
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,479,401,451
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	627,132,505
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	512,971,522
未収入金	810,351
<b>(B)負債</b>	<b>4,803,725</b>
未払解約金	687,178
未払信託報酬	3,973,659
その他未払費用	142,888
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>3,649,665,010</b>
元本	2,155,369,705
次期繰越損益金	1,494,295,305
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>2,155,369,705口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	16,933円

(注) 期首元本額	1,607,104,017円
期中追加設定元本額	720,019,772円
期中一部解約元本額	171,754,084円

## 損益の状況

当期(2022年12月21日~2023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	30
支払利息	△ 561
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>539,350,058</b>
売買益	564,924,084
売買損	△ 25,574,026
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 7,228,919</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>532,120,608</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>78,331,810</b>
(分配準備積立金)	(110,357,799)
(繰越欠損金)	(△ 32,025,989)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>883,842,887</b>
(配当等相当額)	(468,644,665)
(売買損益相当額)	(415,198,222)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>1,494,295,305</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>1,494,295,305</b>
追加信託差損益金	883,842,887
(配当等相当額)	(468,644,665)
(売買損益相当額)	(415,198,222)
分配準備積立金	610,452,949
繰越欠損金	△ 531

- (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	500,095,150円
(c) 信託約款に定める収益調整金	883,842,887円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	110,357,799円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	1,494,295,836円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	6,932.90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(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
7期(2023年12月20日)	17,092	0	23.2	17,092	17,630	23.7	70.1	1.8	27.0	0.9	4,020

(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		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
	基準価額	騰落率		騰落率	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	%	%
(期首)2022年12月20日	13,874	-	14,248	-	69.1	2.2	27.5	0.9	
12月末	13,762	△ 0.8	14,138	△ 0.8	69.6	2.0	27.0	0.9	
2023年1月1日	14,183	2.2	14,576	2.3	70.5	2.0	26.3	1.0	
2月末	14,479	4.4	14,882	4.5	69.6	2.1	26.9	0.9	
3月末	14,573	5.0	14,987	5.2	69.2	2.2	27.4	0.9	
4月末	14,878	7.2	15,305	7.4	70.4	1.7	26.6	0.9	
5月末	15,383	10.9	15,833	11.1	70.3	2.2	26.7	0.8	
6月末	16,340	17.8	16,821	18.1	69.9	2.3	26.6	0.8	
7月末	16,432	18.4	16,919	18.7	70.6	1.8	26.6	0.8	
8月末	16,622	19.8	17,122	20.2	69.5	2.5	26.8	0.8	
9月末	16,420	18.4	16,920	18.8	69.1	2.6	27.3	0.8	
10月末	16,000	15.3	16,492	15.8	69.6	2.0	27.3	0.8	
11月末	16,914	21.9	17,441	22.4	70.7	1.4	26.6	0.8	
(期末)2023年12月20日	17,092	23.2	17,630	23.7	70.1	1.8	27.0	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

2022年12月21日～2023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	173,169	443,919	68,045	174,012
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	183,449	611,146	71,711	243,570
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	282,966	265,904	62,615	58,562
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	162,838	253,588	47,022	73,084

(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	45,930,418千円	123,411,360千円	2,297千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	182,556,803千円	657,945,943千円	－
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.25	0.18	－

(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12月21日～2023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

2023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	325,367	430,491	1,194,486
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	342,211	453,949	1,730,953
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	315,885	536,236	506,046
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	237,750	353,565	589,075

(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72,435,703千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが221,443,667千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが57,111,933千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが43,780,166千口です。

## 投資信託財産の構成

2023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	1,194,486	29.6
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,730,953	42.9
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	506,046	12.6
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	589,075	14.6
コール・ローン等、その他	11,155	0.3
投資信託財産総額	4,031,717	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144.03円、1カナダ・ドル107.94円、1オーストラリア・ドル97.26円、1香港ドル18.47円、1シンガポール・ドル108.40円、1ニュージーランド・ドル90.25円、1イギリス・ポンド183.28円、1イスラエル・シェケル39.434円、1スイス・フラン167.40円、1デンマーク・クローネ21.20円、1ノルウェー・クローネ14.01円、1スウェーデン・クローナ14.17円、1メキシコ・ペソ8.438円、1人民元20.203円、1マレーシア・リンギット30.902円、1南アフリカ・ランド7.85円、1ポーランド・ズロチ36.534円、1ユーロ158.07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（841,108,711千円）の投資信託財産総額（847,341,378千円）に対する比率は99.3%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（72,901,031千円）の投資信託財産総額（73,176,781千円）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（13,039,940千円）の投資信託財産総額（13,182,409千円）に対する比率は98.9%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

(2023年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>4,031,717,053円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,359,130
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,194,486,083
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,730,953,564
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	506,046,342
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	589,075,276
未 収 入 金	6,796,658
<b>(B)負債</b>	<b>11,183,062</b>
未 払 解 約 金	6,661,187
未 払 信 託 報 酬	4,366,484
そ の 他 未 払 費 用	155,391
<b>(C)純 資 産 総 額 (A-B)</b>	<b>4,020,533,991</b>
元 本	2,352,336,829
次 期 繰 越 損 益 金	1,668,197,162
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>2,352,336,829口</b>
1万口当たり基準価額 (C/D)	<b>17,092円</b>

(注) 期首元本額	1,688,869,094円
期中追加設定元本額	845,600,842円
期中一部解約元本額	182,133,107円

## 損益の状況

当期 (2022年12月21日~2023年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>△ 567円</b>
受 取 利 息	37
支 払 利 息	△ 604
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>622,622,644</b>
売 買 益	651,681,717
売 買 損	△ 29,059,073
<b>(C)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 7,886,883</b>
<b>(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)</b>	<b>614,735,194</b>
<b>(E)前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>111,776,052</b>
( 配 当 準 備 積 立 金 ) (	142,448,000)
( 繰 越 欠 損 金 ) (△	30,671,948)
<b>(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *</b>	<b>941,685,916</b>
( 配 当 等 相 当 額 ) (	708,955,077)
( 売 買 損 益 相 当 額 ) (	232,730,839)
<b>(G)合 計 (D + E + F)</b>	<b>1,668,197,162</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(G)</b>	<b>1,668,197,162</b>
追 加 信 託 差 損 益 金	941,685,916
( 配 当 等 相 当 額 ) (	708,955,077)
( 売 買 損 益 相 当 額 ) (	232,730,839)
分 配 準 備 積 立 金	726,511,813
繰 越 欠 損 金 △	567

- (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	584,063,813円
(c) 信託約款に定める収益調整金	941,685,916円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	142,448,000円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	1,668,197,729円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	7,091.66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
5期(2023年12月20日)	17,581	0	23.8	17,581	18,027	24.3	71.8	1.9	25.2	0.9	1,732

(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
(期首)2022年12月20日	14,202	-	14,498	-	71.1	2.2	25.4	0.9
12月末	14,086	△ 0.8	14,385	△ 0.8	71.4	2.1	25.2	0.9
2023年1月末	14,529	2.3	14,843	2.4	72.1	2.1	24.5	1.0
2月末	14,836	4.5	15,159	4.6	71.3	2.2	25.2	0.9
3月末	14,929	5.1	15,262	5.3	70.9	2.3	25.6	0.9
4月末	15,248	7.4	15,592	7.5	72.1	1.8	24.9	0.9
5月末	15,779	11.1	16,144	11.4	72.0	2.2	24.9	0.9
6月末	16,784	18.2	17,176	18.5	71.5	2.4	24.8	0.9
7月末	16,887	18.9	17,285	19.2	72.3	1.8	24.8	0.8
8月末	17,091	20.3	17,500	20.7	71.2	2.6	25.0	0.8
9月末	16,881	18.9	17,291	19.3	70.8	2.6	25.5	0.8
10月末	16,444	15.8	16,849	16.2	71.3	2.1	25.5	0.8
11月末	17,399	22.5	17,834	23.0	72.5	1.5	24.9	0.9
(期末)2023年12月20日	17,581	23.8	18,027	24.3	71.8	1.9	25.2	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

2022年12月21日～2023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	92,897	238,866	40,208	102,890
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	98,108	329,584	42,233	143,380
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	120,631	113,251	32,466	30,433
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	84,853	132,519	28,982	45,214

(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	45,930,418千円	123,411,360千円	2,297千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	182,556,803千円	657,945,943千円	－
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.25	0.18	－

(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12月21日～2023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

2023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	137,166	189,855	526,791
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	144,812	200,686	765,238
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	104,413	192,579	181,736
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	99,611	155,482	259,048

(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72,435,703千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが221,443,667千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが57,111,933千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが43,780,166千口です。

## 投資信託財産の構成

2023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	526,791	30.3
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	765,238	44.1
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	181,736	10.5
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	259,048	14.9
コール・ローン等、その他	3,880	0.2
投資信託財産総額	1,736,696	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144.03円、1カナダ・ドル107.94円、1オーストラリア・ドル97.26円、1香港ドル18.47円、1シンガポール・ドル108.40円、1ニュージーランド・ドル90.25円、1イギリス・ポンド183.28円、1イスラエル・シェケル39.434円、1スイス・フラン167.40円、1デンマーク・クローネ21.20円、1ノルウェー・クローネ14.01円、1スウェーデン・クローナ14.17円、1メキシコ・ペソ8.438円、1人民元20.203円、1マレーシア・リンギット30.902円、1南アフリカ・ランド7.85円、1ポーランド・ズロチ36.534円、1ユーロ158.07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（841,108,711千円）の投資信託財産総額（847,341,378千円）に対する比率は99.3%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（72,901,031千円）の投資信託財産総額（73,176,781千円）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（13,039,940千円）の投資信託財産総額（13,182,409千円）に対する比率は98.9%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

(2023年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>1,736,696,361円</b>
コール・ローン等	1,838,656
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	526,791,936
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	765,238,085
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	181,736,924
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	259,048,655
未収入金	2,042,105
<b>(B)負債</b>	<b>3,892,572</b>
未払解約金	1,983,426
未払信託報酬	1,834,327
その他未払費用	74,819
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>1,732,803,789</b>
元本	985,587,627
次期繰越損益金	747,216,162
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>985,587,627口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	17,581円
(注) 期首元本額	677,029,527円
期中追加設定元本額	440,631,664円
期中一部解約元本額	132,073,564円

## 損益の状況

当期(2022年12月21日~2023年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 172円</b>
受取利息	11
支払利息	△ 183
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>257,110,142</b>
売益	277,951,402
売買損	△ 20,841,260
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 3,311,946</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>253,798,024</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>14,721,954</b>
(分配準備積立金)	(26,467,038)
(繰越欠損金)	(△ 11,745,084)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>478,696,184</b>
(配当等相当額)	(216,798,715)
(売買損益相当額)	(261,897,469)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>747,216,162</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>747,216,162</b>
追加信託差損益金	478,696,184
(配当等相当額)	(216,798,715)
(売買損益相当額)	(261,897,469)
分配準備積立金	268,520,150
繰越欠損金	△ 172

- (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	242,053,112円
(c) 信託約款に定める収益調整金	478,696,184円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	26,467,038円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	747,216,334円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	7,581.43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
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
8期(2023年12月20日)	21,081	0	24.5	21,081	21,885	25.0	73.7	1.9	23.2	0.9	3,361

(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		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
	基準価額	騰落率		騰落率	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	%	%
(期首)2022年12月20日	16,932	-	17,503	-	73.0	2.3	23.4	1.0	1.0
12月末	16,795	△ 0.8	17,367	△ 0.8	73.3	2.2	23.2	1.0	1.0
2023年1月末	17,338	2.4	17,935	2.5	74.0	2.1	22.6	1.0	1.0
2月末	17,710	4.6	18,322	4.7	73.2	2.2	23.2	1.0	1.0
3月末	17,816	5.2	18,441	5.4	72.8	2.4	23.6	0.9	0.9
4月末	18,206	7.5	18,850	7.7	74.0	1.8	22.9	0.9	0.9
5月末	18,858	11.4	19,536	11.6	73.9	2.3	23.0	0.9	0.9
6月末	20,091	18.7	20,817	18.9	73.4	2.5	22.9	0.9	0.9
7月末	20,226	19.5	20,961	19.8	74.2	1.9	22.9	0.9	0.9
8月末	20,481	21.0	21,233	21.3	73.1	2.7	23.1	0.9	0.9
9月末	20,226	19.5	20,977	19.8	72.8	2.7	23.5	0.8	0.8
10月末	19,698	16.3	20,435	16.7	73.2	2.1	23.5	0.8	0.8
11月末	20,861	23.2	21,650	23.7	74.4	1.5	22.9	0.9	0.9
(期末)2023年12月20日	21,081	24.5	21,885	25.0	73.7	1.9	23.2	0.9	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

2022年12月21日～2023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	181,419	466,830	87,516	222,695
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	193,311	649,425	92,282	310,784
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	179,228	168,455	54,749	51,285
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	168,191	262,607	63,324	98,544

(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	45,930,418千円	123,411,360千円	2,297千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	182,556,803千円	657,945,943千円	-
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.25	0.18	-

(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12月21日～2023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

2023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	282,717	376,620	1,045,007
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	299,775	400,803	1,528,304
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	163,671	288,149	271,926
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	204,765	309,631	515,877

(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72,435,703千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが221,443,667千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが57,111,933千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが43,780,166千口です。

## 投資信託財産の構成

2023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	1,045,007	31.0
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,528,304	45.4
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	271,926	8.1
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	515,877	15.3
コール・ローン等、その他	7,857	0.2
投資信託財産総額	3,368,974	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144.03円、1カナダ・ドル107.94円、1オーストラリア・ドル97.26円、1香港ドル18.47円、1シンガポール・ドル108.40円、1ニュージーランド・ドル90.25円、1イギリス・ポンド183.28円、1イスラエル・シェケル39.434円、1スイス・フラン167.40円、1デンマーク・クローネ21.20円、1ノルウェー・クローネ14.01円、1スウェーデン・クローナ14.17円、1メキシコ・ペソ8.438円、1人民元20.203円、1マレーシア・リンギット30.902円、1南アフリカ・ランド7.85円、1ポーランド・ズロチ36.534円、1ユーロ158.07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（841,108,711千円）の投資信託財産総額（847,341,378千円）に対する比率は99.3%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（72,901,031千円）の投資信託財産総額（73,176,781千円）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（13,039,940千円）の投資信託財産総額（13,182,409千円）に対する比率は98.9%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2055

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>3,368,974,442円</b>
コール・ローン等	3,613,345
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,045,007,802
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,528,304,935
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	271,926,840
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	515,877,140
未収入金	4,244,380
<b>(B)負債</b>	<b>7,880,527</b>
未払解約金	4,131,480
未払信託報酬	3,617,494
その他未払費用	131,553
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>3,361,093,915</b>
元本	1,594,382,095
次期繰越損益金	1,766,711,820
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>1,594,382,095口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>21,081円</b>

(注) 期首元本額	1,143,590,256円
期中追加設定元本額	699,384,047円
期中一部解約元本額	248,592,208円

## 損益の状況

当期(2022年12月21日~2023年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 449円</b>
受取利息	36
支払利息	△ 485
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>513,768,703</b>
売買益	558,567,656
売買損	△ 44,798,953
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 6,507,035</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>507,261,219</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>85,843,329</b>
(分配準備積立金)	(106,358,215)
(繰越欠損金)	(△ 20,514,886)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>1,173,607,272</b>
(配当等相当額)	(814,736,900)
(売買損益相当額)	(358,870,372)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>1,766,711,820</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>1,766,711,820</b>
追加信託差損益金	1,173,607,272
(配当等相当額)	(814,736,900)
(売買損益相当額)	(358,870,372)
分配準備積立金	593,104,997
繰越欠損金	△ 449

- (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	486,746,782円
(c) 信託約款に定める収益調整金	1,173,607,272円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	106,358,215円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	1,766,712,269円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	11,080.86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
5期(2023年12月20日)	18,090	0	25.2	18,090	18,565	25.7	75.6	2.0	21.2	0.9	2,570

(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		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)2022年12月20日	14,453	-	14,770	-	74.7	2.3	21.6	1.0	
12月末	14,336	△ 0.8	14,654	△ 0.8	75.3	2.2	21.1	1.0	
2023年1月末	14,812	2.5	15,147	2.6	75.9	2.2	20.7	1.0	
2月末	15,134	4.7	15,478	4.8	75.1	2.3	21.2	1.0	
3月末	15,221	5.3	15,575	5.4	74.7	2.4	21.6	0.9	
4月末	15,562	7.7	15,928	7.8	75.9	1.9	20.9	1.0	
5月末	16,134	11.6	16,523	11.9	75.8	2.3	21.0	0.9	
6月末	17,214	19.1	17,633	19.4	75.2	2.5	21.0	0.9	
7月末	17,341	20.0	17,765	20.3	76.1	1.9	20.9	0.9	
8月末	17,567	21.5	18,004	21.9	74.9	2.7	21.2	0.9	
9月末	17,346	20.0	17,784	20.4	74.7	2.8	21.5	0.8	
10月末	16,888	16.8	17,319	17.3	75.1	2.2	21.6	0.8	
11月末	17,902	23.9	18,366	24.3	76.3	1.6	21.0	0.9	
(期末)2023年12月20日	18,090	25.2	18,565	25.7	75.6	2.0	21.2	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

2022年12月21日～2023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	179,612	462,797	90,408	230,727
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	192,578	648,505	96,981	327,255
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	117,953	110,793	42,358	39,723
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	159,590	249,528	68,645	106,992

(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	45,930,418千円	123,411,360千円	2,297千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	182,556,803千円	657,945,943千円	－
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.25	0.18	－

(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12月21日～2023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

2023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	206,222	295,427	819,721
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	219,121	314,718	1,200,053
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	84,945	160,539	151,501
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	148,970	239,915	399,723

(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72,435,703千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが221,443,667千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが57,111,933千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが43,780,166千口です。

## 投資信託財産の構成

2023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	819,721	31.8
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	1,200,053	46.5
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	151,501	5.9
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	399,723	15.5
コール・ローン等、その他	7,193	0.3
投資信託財産総額	2,578,194	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144.03円、1カナダ・ドル107.94円、1オーストラリア・ドル97.26円、1香港ドル18.47円、1シンガポール・ドル108.40円、1ニュージーランド・ドル90.25円、1イギリス・ポンド183.28円、1イスラエル・シェケル39.434円、1スイス・フラン167.40円、1デンマーク・クローネ21.20円、1ノルウェー・クローネ14.01円、1スウェーデン・クローナ14.17円、1メキシコ・ペソ8.438円、1人民元20.203円、1マレーシア・リンギット30.902円、1南アフリカ・ランド7.85円、1ポーランド・ズロチ36.534円、1ユーロ158.07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（841,108,711千円）の投資信託財産総額（847,341,378千円）に対する比率は99.3%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（72,901,031千円）の投資信託財産総額（73,176,781千円）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（13,039,940千円）の投資信託財産総額（13,182,409千円）に対する比率は98.9%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

(2023年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>2,578,194,126円</b>
コール・ローン等	2,707,387
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	819,721,812
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	1,200,053,749
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	151,501,231
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	399,723,552
未収入金	4,486,395
<b>(B)負債</b>	<b>7,211,220</b>
未払解約金	4,399,873
未払信託報酬	2,708,713
その他未払費用	102,634
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>2,570,982,906</b>
元本	1,421,187,479
次期繰越損益金	1,149,795,427
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>1,421,187,479口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	18,090円

(注) 期首元本額	955,440,216円
期中追加設定元本額	803,872,816円
期中一部解約元本額	338,125,553円

## 損益の状況

当期(2022年12月21日~2023年12月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 273円</b>
受取利息	34
支払利息	△ 307
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>368,635,576</b>
売買益	418,384,205
売買損	△ 49,748,629
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 4,800,173</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>363,835,130</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>8,870,382</b>
(分配準備積立金)	( 23,349,978)
(繰越欠損金)	(△ 14,479,596)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>777,089,915</b>
(配当等相当額)	( 310,430,458)
(売買損益相当額)	( 466,659,457)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>1,149,795,427</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>1,149,795,427</b>
追加信託差損益金	777,089,915
(配当等相当額)	( 310,430,458)
(売買損益相当額)	( 466,659,457)
分配準備積立金	372,705,785
繰越欠損金	△ 273

- (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	349,355,807円
(c) 信託約款に定める収益調整金	777,089,915円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	23,349,978円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	1,149,795,700円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	8,090.39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
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
2期(2023年12月20日)	12,148	0	25.5	12,148	12,264	26.0	76.6	2.0	20.2	0.9	499

(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		参考指数		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
	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率				
(期首)2022年12月20日	円	%		%	%	%	%	%
12月末	9,679	-	9,730	-	75.5	2.4	20.8	1.0
2023年1月末	9,600	△ 0.8	9,654	△ 0.8	75.9	2.2	20.5	1.0
2月末	9,923	2.5	9,983	2.6	76.8	2.2	19.7	1.0
3月末	10,140	4.8	10,202	4.9	76.0	2.3	20.2	1.0
4月末	10,198	5.4	10,265	5.5	75.8	2.5	20.5	0.9
5月末	10,428	7.7	10,500	7.9	76.9	1.9	19.9	1.0
6月末	10,818	11.8	10,897	12.0	76.7	2.4	20.0	0.9
7月末	11,551	19.3	11,638	19.6	76.2	2.6	20.0	0.9
8月末	11,639	20.3	11,730	20.6	77.0	1.9	19.9	0.9
9月末	11,794	21.9	11,890	22.2	75.9	2.8	20.2	0.9
10月末	11,645	20.3	11,744	20.7	75.6	2.8	20.5	0.9
11月末	11,336	17.1	11,436	17.5	76.1	2.2	20.6	0.9
(期末)2023年12月20日	12,022	24.2	12,133	24.7	77.2	1.6	20.0	0.9
	12,148	25.5	12,264	26.0	76.6	2.0	20.2	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

2022年12月21日～2023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	68,141	178,288	25,322	65,949
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	73,687	252,420	28,053	95,981
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	29,533	27,749	9,929	9,317
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	55,886	88,335	19,677	31,086

(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	45,930,418千円	123,411,360千円	2,297千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	182,556,803千円	657,945,943千円	－
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.25	0.18	－

(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12月21日～2023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

2023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	15,338	58,157	161,370
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	16,336	61,971	236,303
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	5,253	24,857	23,458
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	11,040	47,249	78,722

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末における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72,435,703千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが221,443,667千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが57,111,933千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが43,780,166千口です。

## 投資信託財産の構成

2023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	161,370	32.2
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	236,303	47.1
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	23,458	4.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	78,722	15.7
コール・ローン等、その他	1,797	0.4
投資信託財産総額	501,652	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144.03円、1カナダ・ドル107.94円、1オーストラリア・ドル97.26円、1香港ドル18.47円、1シンガポール・ドル108.40円、1ニュージーランド・ドル90.25円、1イギリス・ポンド183.28円、1イスラエル・シェケル39.434円、1スイス・フラン167.40円、1デンマーク・クローネ21.20円、1ノルウェー・クローネ14.01円、1スウェーデン・クローナ14.17円、1メキシコ・ペソ8.438円、1人民元20.203円、1マレーシア・リンギット30.902円、1南アフリカ・ランド7.85円、1ポーランド・ズロチ36.534円、1ユーロ158.07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（841,108,711千円）の投資信託財産総額（847,341,378千円）に対する比率は99.3%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（72,901,031千円）の投資信託財産総額（73,176,781千円）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（13,039,940千円）の投資信託財産総額（13,182,409千円）に対する比率は98.9%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

(2023年12月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>501,652,297円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	441,915
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	161,370,245
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	236,303,625
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	23,458,351
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	78,722,638
未 収 入 金	1,355,523
<b>(B)負債</b>	<b>1,800,844</b>
未 払 解 約 金	1,338,813
未 払 信 託 報 酬	442,017
そ の 他 未 払 費 用	20,014
<b>(C)純 資 産 総 額 (A-B)</b>	<b>499,851,453</b>
元 本	411,452,351
次 期 繰 越 損 益 金	88,399,102
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>411,452,351口</b>
1万口当たり基準価額 (C/D)	<b>12,148円</b>

(注) 期首元本額	105,141,177円
期中追加設定元本額	470,611,031円
期中一部解約元本額	164,299,857円

## 損益の状況

当期 (2022年12月21日~2023年12月20日)

項目	当期
<b>(A)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>40,915,879円</b>
売 買 益	51,397,343
売 買 損	△ 10,481,464
<b>(B)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 634,829</b>
<b>(C)当 期 損 益 金 (A+B)</b>	<b>40,281,050</b>
<b>(D)前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>△ 1,816,723</b>
(繰 越 欠 損 金)	(△ 1,816,723)
<b>(E)追 加 信 託 差 損 益 金 *</b>	<b>49,934,775</b>
(売 買 損 益 相 当 額)	( 49,934,775)
<b>(F)合 計 (C+D+E)</b>	<b>88,399,102</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(F)</b>	<b>88,399,102</b>
追加信託差損益金	49,934,775
(売 買 損 益 相 当 額)	( 49,934,775)
分配準備積立金	38,464,327

- (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)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) **(E)追加信託差損益金\***とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、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	38,464,327円
(c) 信託約款に定める収益調整金	49,934,775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)	88,399,102円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	2,148.47円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

# お知らせ

## ■「2025」の自社の実質保有比率

2023年11月末現在、当ファンドの主要投資対象であるニッセイマネーマーケットマザーファンドの信託財産において、当社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に7.0%保有しています。当該実質保有分は、当社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

## ■当社による「2065」の設定解約状況

前期末 残高 (元本)	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	百万円	%	
1	-	1	-	-	-	当初設定時における取得分の処分

(注) 元本の単位未満は切り捨てています。

# 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	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	「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 デットファンド 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 23 期

(計算期間：2022年2月22日～2023年2月20日)

#### 運用方針

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

#### 主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

#### 運用方法

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



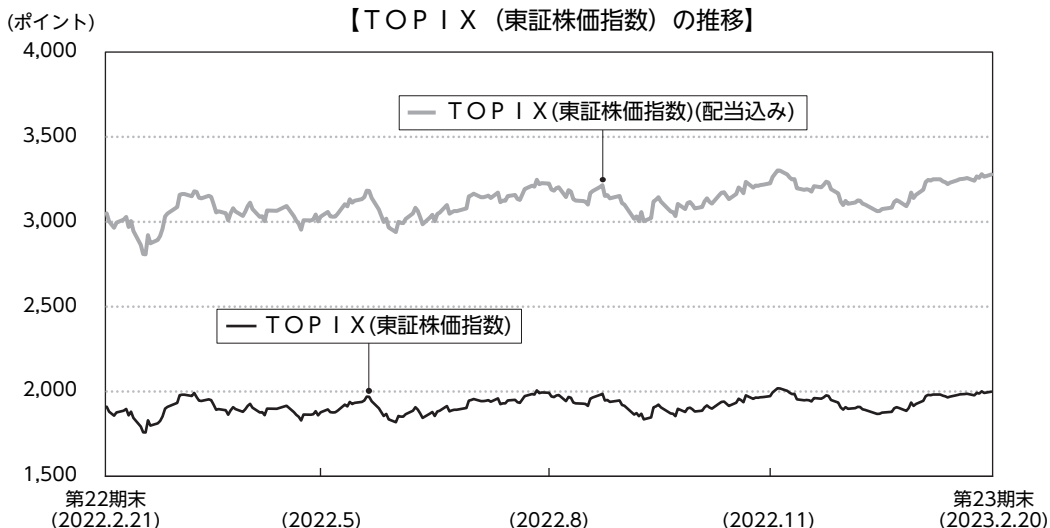
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

## 運用経過

2022年2月22日～2023年2月20日

## 国内株式市況

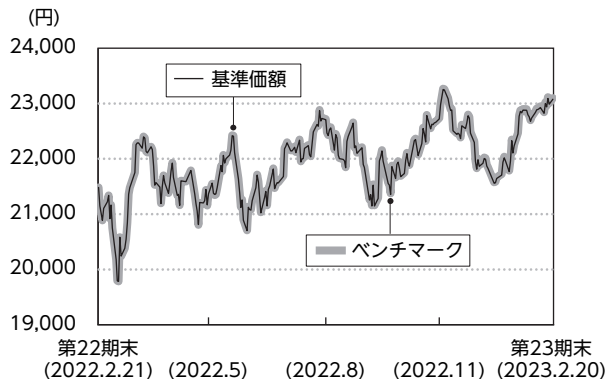


当期の国内株式市場は上昇しました。

期初より2022年3月上旬にかけては、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株価は下落しましたが、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、下落しました。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株価は上昇しましたが、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、12月になると欧米の金融引き締めに伴う景気後退への警戒感に加えて、下旬に日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことによる長期金利の上昇や円高進行を受けて下落しました。1月中旬には日銀が金融緩和策の現状維持を決定したことから市場に安心感が広がり、その後も円安に転じたことや米金融引き締めへの過度な警戒感がやわらいだことから上昇基調となり、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

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

## ポートフォリオ

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

\*ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+7.4%となり、ベンチマーク騰落率（+7.5%）にほぼ連動しました。

## 今後の運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する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	期中騰落率		ベンチマーク	期中騰落率		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円		%			%	%	%	百万円
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
23期(2023年2月20日)	23,077		7.4	23,334		7.5	97.9	2.1	187,428

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		ベンチマーク	騰落率		株式組入比率	株式先物比率
	円		%			%	%	%
(期首)2022年2月21日	21,482		—	21,702		—	96.1	3.7
2月末	21,222		△1.2	21,441		△1.2	96.0	4.0
3月末	22,132		3.0	22,362		3.0	96.4	3.6
4月末	21,601		0.6	21,826		0.6	97.2	2.8
5月末	21,765		1.3	21,997		1.4	97.5	2.6
6月末	21,317		△0.8	21,546		△0.7	98.0	2.0
7月末	22,110		2.9	22,348		3.0	98.3	1.7
8月末	22,377		4.2	22,618		4.2	97.9	1.9
9月末	21,147		△1.6	21,376		△1.5	96.2	3.7
10月末	22,219		3.4	22,465		3.5	97.5	2.5
11月末	22,873		6.5	23,128		6.6	97.2	2.8
12月末	21,829		1.6	22,072		1.7	98.2	1.8
2023年1月末	22,794		6.1	23,049		6.2	97.8	2.2
(期末)2023年2月20日	23,077		7.4	23,334		7.5	97.9	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2月22日～2023年2月20日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（21,942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2月22日～2023年2月20日

## (1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		41,228 ( 1,144)	94,389,662	15,136	33,664,915

(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	33,729	34,424	-	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2022年2月22日～2023年2月20日

## 株式

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	1,881	3,930,598	2,089	トヨタ自動車	564	1,158,068	2,051
ソニーグループ	244	2,752,545	11,262	ソニーグループ	63	710,223	11,167
日本電信電話	490	1,921,328	3,915	ソフトバンクグループ	104	649,181	6,200
キーエンス	34	1,655,773	48,414	キーエンス	9	511,535	53,845
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,959	1,455,421	742	三菱商事	122	506,757	4,153
任天堂	31	1,253,174	39,657	三菱UFJフィナンシャル・グループ	639	469,238	733
東京エレクトロン	23	1,228,527	51,402	日本電信電話	114	456,957	4,001
KDDI	269	1,192,922	4,429	日立製作所	64	437,551	6,741
日立製作所	180	1,184,515	6,551	ダイキン工業	16	370,817	22,204
武田薬品工業	306	1,141,626	3,721	KDDI	83	361,799	4,322

(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

2023年2月20日現在

(1) 国内株式  
上場株式

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
<b>水産・農林業(0.1%)</b>				
極洋	2	3	12,342	
ニッセイ	58	89	48,579	
マルハニチロ	9	13	32,491	
雪国まいたけ	4	7	7,753	
カネコ種苗	2	3	5,678	
サカタのタネ	7	11	45,708	
ホフト	4	7	14,859	
<b>鉱業(0.3%)</b>				
住石ホールディングス	11	13	5,323	
日鉄鉱業	1	3	12,708	
三井松島ホールディングス	2	4	15,160	
I N P E X	234	330	470,865	
石油資源開発	6	10	50,388	
K&Oエナジーグループ	2	4	8,792	

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
<b>建設業(1.9%)</b>				
ヒノキヤグループ	1	-	-	
ショーボンドホールディングス	8	12	64,172	
ミライト・ワン	18	31	46,624	
タマホーム	3	6	20,254	
ファーストコーポレーション	4	1	972	
スペースバリューホールディングス	6	-	-	
安藤・間	29	51	45,082	
東急建設	17	25	17,043	
コムシスホールディングス	18	30	75,077	
ピーアールホールディングス	8	14	5,061	
高松コンストラクショングループ	3	5	11,495	
東建コーポレーション	1	2	22,040	
ソネット	2	4	4,598	
ヤマウラ	3	4	5,154	

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
オリエンタル白石	19	32	10,143	
大成建設	39	62	272,125	
大林組	135	223	218,485	
清水建設	126	187	137,657	
飛鳥建設	3	6	7,348	
長谷工コーポレーション	40	64	99,265	
松井建設	5	8	5,585	
銭高組	0.800	1	4,438	
鹿島建設	98	138	222,569	
不動テトラ	2	4	6,978	
鉄建建設	2	4	8,046	
西松建設	8	10	37,683	
三井住友建設	30	50	21,218	
大豊建設	2	2	10,140	
佐田建設	6	10	5,540	
ナカノフドー建設	8	15	4,967	
奥村組	8	10	32,673	
東鉄工業	6	8	23,744	
浅沼組	1	5	16,275	
戸田建設	56	76	54,528	
熊谷組	6	10	29,710	
北野建設	1	-	-	
植木組	2	3	4,833	
矢作建設工業	6	8	6,961	
ピーエス三菱	4	7	5,071	
日本ハウスホールディングス	9	13	5,293	
新日本建設	5	8	7,664	
NIPPO	11	-	-	
東亜道路工業	0.700	1	7,728	
日本道路	1	1	8,788	
東亜建設工業	3	5	14,072	
日本国土開発	13	18	10,322	
若築建設	2	2	8,394	
東洋建設	15	20	18,341	
五洋建設	53	88	58,476	
世紀東急工業	6	8	6,560	
福田組	1	2	10,596	
住友林業	34	47	126,456	
日本基礎技術	5	8	4,341	
巴コーポレーション	6	10	4,356	
大和ハウス工業	124	174	543,704	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
ライト工業	8	11	23,490	
積水ハウス	146	195	498,154	
日特建設	4	6	5,586	
北陸電気工事	3	7	5,606	
ユアテック	7	13	10,460	
日本リーテック	2	5	4,872	
四電工	1	2	5,174	
中電工	6	9	20,651	
関電工	21	34	29,993	
きんでん	30	44	66,396	
東京エネシス	4	6	5,617	
トーエネック	1	2	7,150	
住友電設	3	5	14,124	
日本電設工業	7	10	15,460	
エクシオグループ	20	28	69,091	
新日本空調	3	3	6,667	
九電工	10	15	51,756	
三機工業	8	13	20,655	
日揮ホールディングス	41	61	108,644	
中外炉工業	1	3	5,349	
ヤマト	4	6	4,991	
太平電業	3	3	14,917	
高砂熱学工業	12	15	30,683	
三晃金属工業	1	1	3,840	
朝日工業社	0.700	2	5,470	
明星工業	8	10	8,442	
大気社	6	7	26,362	
ダイダン	3	4	9,233	
日比谷総合設備	4	5	10,848	
テスホールディングス	2	6	7,209	
インフロニア・ホールディングス	57	65	67,923	
東洋エンジニアリング	5	-	-	
レイズネクスト	6	9	12,132	
<b>食料品(3.4%)</b>				
ニッポン	12	16	26,972	
日清製粉グループ本社	48	58	90,538	
日東富士製粉	-	1	5,346	
昭和産業	4	5	13,695	
鳥越製粉	4	-	-	
中部飼料	4	8	9,013	
フィード・ワン	5	9	6,283	

## 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
日本甜菜製糖	2	3	5,896
DM三井製糖ホールディングス	3	6	12,685
塩水港精糖	14	23	4,593
ウェルネオシュガー	2	3	5,360
森永製菓	10	11	45,688
中村屋	1	1	4,880
江崎グリコ	11	17	62,471
名糖産業	1	3	5,055
井村屋グループ	2	3	7,520
不二家	2	4	10,719
山崎製パン	32	42	66,654
モロゾフ	1	2	6,820
亀田製菓	2	4	17,280
寿スピリッツ	4	6	57,821
カルビー	19	28	83,918
森永乳業	8	11	54,948
六甲バター	3	4	6,214
ヤクルト本社	32	44	414,876
明治ホールディングス	28	38	249,738
雪印メグミルク	10	15	27,375
プリマハム	5	8	18,152
日本ハム	16	24	92,365
林兼産業	5	7	3,206
丸大食品	4	6	9,336
S Foods	3	6	18,975
柿安本店	1	2	4,905
伊藤ハム米久ホールディングス	27	48	34,869
サッポロホールディングス	14	20	64,581
アサヒグループホールディングス	101	144	682,623
キリンホールディングス	158	283	567,839
宝ホールディングス	29	42	45,667
オエノンホールディングス	12	18	4,992
養命酒製造	1	2	4,938
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	30	49	69,672
サントリー食品インターナショナル	28	44	209,508
ガイドグループホールディングス	2	3	17,280
伊藤園	13	23	104,130
キーコーヒー	4	7	14,518
日清オイリオグループ	5	8	29,084
不二製油グループ本社	9	14	29,170
J-オイルミルズ	4	6	9,977

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キッコーマン	31	41	271,232
味の素	95	153	632,880
ブルドックソース	1	2	5,143
キューピー	22	33	75,757
ハウス食品グループ本社	16	19	51,628
カゴメ	16	29	88,779
アリアケジャパン	3	5	26,867
ピエトロ	1	-	-
エバラ食品工業	-	1	5,168
ニチレイ	19	28	78,064
東洋水産	20	31	176,569
イートアンドホールディングス	1	2	6,277
大冷	1	-	-
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4	7	7,861
日清食品ホールディングス	17	22	251,498
永谷園ホールディングス	1	3	6,494
一正蒲鉾	3	6	4,306
フジッコ	4	6	11,955
ロック・フィールド	4	7	12,158
日本たばこ産業	231	412	1,151,092
ケンコーマヨネーズ	2	4	5,542
わらべや日洋ホールディングス	2	4	8,671
なとり	2	3	7,975
ピッグルスコーポレーション	2	-	-
ファーマフーズ	4	9	14,676
ユーグレナ	22	40	38,703
紀文食品	3	5	4,901
ピッグルスホールディングス	-	4	5,096
ミヨシ油脂	2	3	3,144
理研ビタミン	4	5	10,983
<b>繊維製品(0.5%)</b>			
片倉工業	4	5	10,301
グンゼ	2	4	20,952
東洋紡	16	27	28,897
ユニチカ	11	-	-
富士紡ホールディングス	1	2	8,060
倉敷紡績	3	4	11,745
日本毛織	12	16	16,190
帝国繊維	4	7	11,469
帝人	39	61	88,823
東レ	305	427	342,812

## 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
日本フェルト	6	11	4,761
イチカワ	—	3	4,693
アツギ	5	10	3,937
セーレン	8	12	31,235
ソトー	3	5	4,622
東海染工	2	1	1,723
小松マテーレ	6	9	6,714
ワコールホールディングス	10	12	28,720
ホギメディカル	5	8	27,735
クラウドIAホールディングス	12	—	—
T S I ホールディングス	14	22	13,007
マツオカコーポレーション	2	4	6,518
ワールド	5	8	10,955
三陽商会	0.400	—	—
オンワードホールディングス	25	41	13,951
ゴールドウイン	7	11	129,390
デサント	8	11	43,175
ヤマトインターナショナル	10	17	4,375
<b>パルプ・紙(0.2%)</b>			
特種東海製紙	2	2	8,546
王子ホールディングス	176	265	142,946
日本製紙	20	33	33,432
三菱製紙	6	8	2,421
北越コーポレーション	27	40	31,675
大王製紙	20	28	30,371
阿波製紙	9	11	8,547
レンゴー	39	58	52,464
トーモク	2	3	5,675
ザ・パック	3	4	13,601
<b>化学(6.1%)</b>			
北の達人コーポレーション	15	26	8,984
クラレ	61	101	122,592
旭化成	279	398	380,113
レゾナック・ホールディングス	36	61	142,465
住友化学	309	473	225,716
住友精化	1	2	11,380
日産化学	22	30	178,467
ラサ工業	1	2	5,475
クレハ	3	5	45,650
多木化学	1	2	10,825
テイカ	3	4	5,043

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
石原産業	7	11	12,247
片倉コープアグリ	2	1	3,553
日本曹達	5	6	30,668
東ソー	60	85	152,167
トクヤマ	13	20	43,589
セントラル硝子	6	10	29,661
東亞合成	24	32	40,180
大阪ソーダ	3	3	16,017
関東電化工業	9	12	12,484
デンカ	15	23	68,300
信越化学工業	72	107	2,068,917
日本カーバイド工業	2	3	4,578
堺化学工業	3	4	8,824
第一稀元素化学工業	3	5	5,927
エア・ウォーター	39	60	97,524
日本酸素ホールディングス	40	61	146,269
日本化学工業	1	2	5,535
日本パーカライズィング	21	31	29,925
高圧ガス工業	6	9	6,156
四国化成ホールディングス	5	7	9,750
戸田工業	0.900	—	—
ステラ ケミファ	2	3	9,568
保土谷化学工業	1	1	5,616
日本触媒	7	9	55,484
大日精化工業	3	4	7,840
カネカ	10	14	50,297
三菱瓦斯化学	39	47	92,344
三井化学	38	53	174,200
J S R	39	59	185,058
東京応化工業	7	11	81,088
大阪有機化学工業	3	4	9,600
三菱ケミカルグループ	281	430	349,781
K H ネオケム	7	10	27,825
ダイセル	60	93	87,984
住友ベークライト	6	9	42,112
積水化学工業	88	130	236,335
日本ゼオン	38	38	49,215
アイカ工業	11	16	48,783
U B E	19	32	68,070
積水樹脂	6	9	17,976
タキロンシーアイ	9	13	6,908

## 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
旭有機材	2	4	11,907
ニチバン	2	4	7,224
リケンテクノス	10	13	7,576
大倉工業	2	3	5,670
積水化成成品工業	6	12	4,836
群栄化学工業	1	2	5,233
ダイキョーニシカワ	8	14	8,890
森六ホールディングス	2	3	5,849
恵和	1	4	6,330
日本化薬	33	48	58,099
カーリットホールディングス	2	6	4,561
日本精化	3	3	8,884
扶桑化学工業	3	5	21,505
トリケミカル研究所	4	8	19,660
A D E K A	19	22	47,241
日油	14	19	116,230
新日本理化	11	5	1,241
ハリマ化成グループ	3	5	5,138
花王	95	155	794,514
第一工業製薬	1	2	4,875
石原ケミカル	2	3	5,105
日華化学	3	5	4,653
三洋化成工業	2	3	16,692
有機合成薬品工業	11	15	4,597
大日本塗料	5	7	6,552
日本ペイントホールディングス	158	282	354,851
関西ペイント	43	58	107,748
中国塗料	9	11	12,391
日本特殊塗料	3	-	-
藤倉化成	6	11	5,164
太陽ホールディングス	6	9	22,901
D I C	17	24	60,482
サカタインクス	8	14	14,526
東洋インキSCホールディングス	8	12	23,687
T & K T O K A	-	5	7,250
富士フィルムホールディングス	75	122	786,969
資生堂	80	133	820,810
ライオン	52	76	113,061
高砂香料工業	3	4	10,762
マンダム	9	13	19,789
ミルボン	5	9	55,290

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ファンケル	17	27	71,451
コーセー	8	13	204,490
コタ	2	5	8,851
シーボン	1	2	4,640
ポーラ・オルビスホールディングス	18	32	57,552
ノエビアホールディングス	3	5	31,692
アジュバンホールディングス	2	5	5,050
新日本製薬	-	3	5,126
エステー	2	4	7,585
アグロ カネショウ	2	2	4,284
コニシ	7	10	19,013
長谷川香料	7	13	38,742
星光PMC	4	8	4,806
小林製薬	12	18	154,752
荒川化学工業	3	5	5,313
メック	3	5	11,760
日本高純度化学	1	2	4,908
タカラバイオ	11	17	30,478
J C U	4	7	22,068
新田ゼラチン	5	0.500	406
O A T アグリオ	-	2	4,037
デクセリアルズ	11	18	49,827
アース製薬	3	5	28,188
北興化学工業	4	6	5,267
大成ラミック	1	2	5,794
クミアイ化学工業	16	25	22,148
日本農薬	7	11	8,143
アキレス	2	4	5,224
有沢製作所	6	10	14,700
日東電工	26	46	389,296
レック	5	9	8,490
三光合成	7	-	-
きもと	13	5	1,100
藤森工業	3	5	15,375
前澤化成工業	2	4	5,658
未来工業	1	3	4,959
J S P	2	4	7,155
エフピコ	7	12	43,620
天馬	3	5	12,457
信越ポリマー	7	11	15,918
東リ	14	20	5,643

## 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
ニフコ	14	23	79,580
バルカー	3	5	17,172
ユニ・チャーム	83	133	673,352
<b>医薬品(5.4%)</b>			
協和キリン	50	77	227,199
武田薬品工業	338	565	2,409,873
アステラス製薬	373	612	1,154,420
住友ファーマ	26	47	41,143
塩野義製薬	54	81	503,272
わかもと製薬	5	5	1,215
日本新薬	11	15	95,281
中外製薬	134	199	713,643
科研製薬	6	10	39,676
エーザイ	51	77	606,914
ロート製薬	22	61	159,825
小野薬品工業	98	123	351,243
久光製薬	11	14	55,593
持田製薬	5	7	26,334
参天製薬	80	120	120,921
扶桑薬品工業	1	2	4,885
ツムラ	13	20	52,863
日医工	13	-	-
キッセイ薬品工業	7	9	24,938
生化学工業	7	12	9,967
栄研化学	7	10	16,286
日水製薬	2	-	-
鳥居薬品	2	3	11,067
JCRファーマ	12	21	33,631
東和薬品	6	9	18,698
富士製薬工業	2	4	5,068
ゼリア新薬工業	7	8	19,553
第一三共	338	556	2,379,722
キョーリン製薬ホールディングス	8	13	23,322
大幸薬品	6	12	5,397
ダイト	2	4	11,697
大塚ホールディングス	89	146	608,776
大正製薬ホールディングス	10	14	77,106
ペプチドリーム	22	31	58,125
あすか製薬ホールディングス	4	6	7,807
サワイグループホールディングス	9	14	55,334

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>石油・石炭製品(0.5%)</b>			
日本コークス工業	36	57	5,086
ニチレキ	5	7	10,395
ユシロ化学工業	2	6	5,133
富士石油	11	18	4,712
MORESCO	2	0.800	974
出光興産	47	70	218,017
ENEOSホールディングス	647	1,154	533,840
コスモエネルギーホールディングス	12	25	98,923
<b>ゴム製品(0.8%)</b>			
横浜ゴム	24	36	88,608
TOYO TIRE	22	36	58,683
ブリヂストン	124	204	1,065,288
住友ゴム工業	38	62	76,998
藤倉コンポジット	3	2	2,545
オカモト	2	3	14,076
フコク	1	4	4,825
ニッタ	4	6	19,038
住友理工	8	12	8,804
三ツ星ベルト	5	9	35,991
バンドー化学	6	10	10,251
<b>ガラス・土石製品(0.7%)</b>			
日東紡績	6	7	16,028
AGC	39	65	323,700
日本板硝子	20	32	22,689
日本山村硝子	3	-	-
日本電気硝子	17	26	64,962
オハラ	-	4	5,616
住友大阪セメント	8	9	34,470
太平洋セメント	24	40	100,122
日本ヒューム	4	7	4,980
日本コンクリート工業	10	21	5,080
三谷セキサン	2	2	11,866
アジアパイルホールディングス	6	10	6,350
東海カーボン	36	53	69,572
日本カーボン	2	3	15,392
東洋炭素	2	4	17,080
ノリタケカンパニーリミテド	2	3	14,304
TOTO	30	42	192,397
日本碍子	46	75	135,626



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
日本特殊陶業	32	48	132,969
MARUWA	1	2	41,664
品川リフラクトリーズ	1	1	7,740
黒崎播磨	0.700	1	8,567
ヨータイ	2	4	6,428
イソライト工業	2	-	-
ニッカトー	4	5	2,984
フジミンコーポレーテッド	3	5	32,436
クニミネ工業	2	0.900	792
ニチアス	10	16	41,682
ニチハ	6	8	21,184
<b>鉄鋼(0.9%)</b>			
日本製鉄	190	294	911,137
神戸製鋼所	79	132	117,658
中山製鋼所	7	13	14,431
合同製鐵	2	3	11,269
JFEホールディングス	115	175	306,422
東京製鐵	14	18	27,639
共英製鋼	4	7	11,625
大和工業	8	10	56,916
東京鐵鋼	2	3	6,099
大阪製鐵	-	4	5,565
淀川製鋼所	5	7	19,792
丸一鋼管	15	20	56,460
モリ工業	1	-	-
大同特殊鋼	7	8	44,073
日本高周波鋼業	9	15	5,213
日本冶金工業	3	4	21,528
山陽特殊製鋼	4	6	17,277
愛知製鋼	2	3	8,816
日立金属	45	-	-
大太平洋金属	2	4	9,338
新日本電工	27	42	15,708
栗本鐵工所	1	3	6,460
三菱製鋼	2	4	6,027
日亜鋼業	11	18	5,069
日本精線	0.700	1	5,098
エンビプロ・ホールディングス	1	0.300	216
シンニッタン	13	14	3,833
<b>非鉄金属(0.7%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	6	9	13,310
日本軽金属ホールディングス	10	17	25,629

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井金属鉱業	11	19	64,992
東邦亜鉛	2	3	8,127
三菱マテリアル	28	43	94,033
住友金属鉱山	54	76	396,468
DOWAホールディングス	11	14	66,822
古河機械金属	7	9	13,228
大阪チタニウムテクノロジーズ	4	9	29,730
東邦チタニウム	7	11	25,335
UACJ	6	9	23,324
CKサンエツ	0.900	1	6,744
古河電気工業	13	21	53,151
住友電気工業	159	226	378,809
フジクラ	47	70	68,103
昭和電線ホールディングス	3	7	14,082
東京特殊電線	1	-	-
タツタ電線	7	13	9,527
平河ヒューテック	2	4	5,903
リョービ	5	7	10,157
アーレスティ	5	7	4,282
アサヒホールディングス	17	26	52,455
<b>金属製品(0.6%)</b>			
稲葉製作所	2	3	5,342
宮地エンジニアリンググループ	1	1	6,624
トーカロ	11	18	22,425
アルファ	2	4	4,638
SUMCO	65	125	234,312
川田テクノロジーズ	0.900	1	5,280
RS Technologies	1	4	15,265
東洋製罐グループホールディングス	27	43	75,603
ホッカンホールディングス	2	3	4,707
コロナ	3	5	4,941
横河ブリッジホールディングス	7	8	17,652
三和ホールディングス	40	60	85,789
文化シャッター	13	18	21,640
三協立山	5	9	5,961
アルインコ	3	5	5,325
LIXIL	67	95	204,606
日本ファイルコン	5	9	4,449
ノーリツ	8	9	15,364
長府製作所	4	6	13,866
リンナイ	8	11	115,311
ダイニチ工業	3	7	4,874

## 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
日東精工	5	9	4,966	
三洋工業	1	2	5,373	
岡部	8	10	7,610	
ジーテクト	5	7	10,212	
東プレ	7	11	13,827	
高周波熱錬	7	10	7,179	
東京製綱	3	5	6,916	
サンコール	5	2	1,550	
モリテックスチール	8	7	2,383	
パイオラックス	6	9	17,553	
エイチワン	4	7	4,921	
日本発条	39	58	52,173	
中央発條	-	4	3,177	
三益半導体工業	3	5	14,826	
<b>機械(5.3%)</b>				
日本製鋼所	12	17	46,462	
三浦工業	18	26	89,846	
タクマ	14	19	27,403	
ツガミ	9	14	20,992	
オークマ	5	6	34,060	
芝浦機械	4	6	18,553	
アマダ	67	102	123,017	
アイダエンジニアリング	11	13	10,428	
TAKISAWA	2	4	4,468	
FUJI	19	28	57,540	
牧野フライス製作所	4	7	34,344	
オーエスジー	19	30	59,189	
ダイジェット工業	3	5	4,399	
旭ダイヤモンド工業	11	18	13,770	
DMG森精機	25	39	84,006	
ソディック	9	17	13,098	
ディスコ	6	10	412,000	
日東工器	2	3	5,456	
日進工具	3	5	5,772	
パンチ工業	-	10	4,693	
豊和工業	3	-	-	
東洋機械金属	5	7	4,060	
エンシュウ	5	5	3,981	
島精機製作所	6	10	18,880	
オプトラン	5	9	19,950	
NCホールディングス	0.500	2	4,237	

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
イワキ	2	4	5,508	
フリーュー	3	6	8,147	
ヤマシンフィルタ	8	15	6,196	
日阪製作所	5	6	5,759	
やまびこ	8	10	13,387	
野村マイクロ・サイエンス	1	2	9,625	
平田機工	2	3	20,057	
ペガサスミシン製造	5	7	4,771	
マルマエ	1	3	6,446	
タツモ	2	3	6,026	
ナプテスコ	24	40	142,410	
三井海洋開発	4	8	12,376	
レオン自動機	4	6	8,241	
S MC	12	20	1,399,046	
ホソカワミクロン	3	4	12,887	
ユニオンツール	1	2	9,058	
オイレス工業	6	9	14,625	
日精工エー・エス・ビー機械	1	3	13,020	
サトーホールディングス	5	9	21,011	
技研製作所	3	6	18,773	
日本エアータック	-	4	4,489	
カワタ	3	4	4,174	
日精樹脂工業	3	5	5,151	
オカダアイオン	1	-	-	
ワイエイシイホールディングス	2	-	-	
小松製作所	195	301	996,729	
住友重機械工業	24	38	112,242	
日立建機	17	25	79,744	
日工	5	9	5,956	
巴工業	1	2	6,795	
井関農機	4	6	7,092	
TOWA	3	6	12,084	
丸山製作所	1	-	-	
北川鉄工所	2	4	4,636	
ローツェ	2	3	34,918	
タカキタ	4	9	4,262	
クボタ	210	340	710,074	
荏原実業	2	3	9,064	
三菱化工機	1	2	5,330	
月島機械	7	8	9,709	
帝国電機製作所	3	4	12,191	

## 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
新東工業	9	13	9,802
澁谷工業	3	6	14,448
アイチコーポレーション	6	9	7,070
小森コーポレーション	10	14	12,977
鶴見製作所	3	4	9,716
荏原製作所	17	26	147,576
石井鐵工所	1	1	3,942
西島製作所	3	5	8,442
北越工業	4	6	9,002
ダイキン工業	54	76	1,793,280
オルガノ	1	8	29,744
トーヨーカネツ	1	2	6,331
栗田工業	23	36	217,080
椿本チエイン	5	9	28,164
大同工業	3	3	2,928
木村化工機	3	6	4,998
アネスト岩田	6	10	9,929
ダイフク	23	33	240,368
サムコ	1	2	7,318
加藤製作所	3	6	5,244
タダノ	22	33	34,001
フジテック	16	23	75,552
CKD	12	17	35,795
キトー	3	-	-
平和	12	21	52,943
理想科学工業	3	5	13,577
SANKYO	9	12	70,739
日本金銭機械	4	7	8,889
マースグループホールディングス	2	3	9,427
フクシマガリレイ	2	4	20,496
ダイコク電機	2	3	9,366
竹内製作所	6	11	34,702
アマノ	11	18	45,603
JUKI	6	10	6,340
ジャノメ	4	8	5,210
マックス	5	7	16,929
グローリー	11	16	44,605
新晃工業	4	6	10,094
大和冷機工業	6	9	12,206
セガサミーホールディングス	42	51	121,391
日本ピストンリング	2	-	-

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リケン	1	2	6,477
T P R	5	7	10,275
ツバキ・ナカシマ	9	15	17,283
ホシザキ	12	41	195,050
大豊工業	3	7	5,111
日本精工	81	118	88,177
NTN	92	126	42,858
ジェイテクト	41	57	58,229
不二越	3	4	18,142
日本トムソン	11	15	9,385
THK	24	37	106,402
ユースイン精機	4	7	5,321
前澤給装工業	3	5	5,038
イーグル工業	5	7	8,328
日本ピラー工業	4	6	20,040
キッツ	14	23	20,310
マキタ	52	80	278,400
三井E&Sホールディングス	15	29	12,468
日立造船	36	52	47,219
三菱重工業	67	112	567,675
IHI	26	40	147,378
スター精密	6	12	19,831
<b>電気機器(17.3%)</b>			
日清紡ホールディングス	26	52	51,876
イビデン	22	36	165,681
コニカミノルタ	94	143	86,507
ブラザー工業	52	85	172,744
ミネベアミツミ	74	111	266,433
日立製作所	207	322	2,276,445
東芝	75	123	536,920
三菱電機	430	664	1,030,107
富士電機	25	39	204,493
東洋電機製造	2	5	4,690
安川電機	46	76	392,430
シンフォニアテクノロジー	5	7	11,594
明電舎	7	9	18,757
オリジン	2	1	2,036
山洋電気	1	2	15,792
デンヨー	3	4	7,756
PHCホールディングス	4	8	12,629
ソシオネクスト	-	6	54,714

## 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
東芝テック	4	9	37,056
芝浦メカトロニクス	0.800	1	15,996
マブチモーター	10	16	60,000
日本電産	111	156	1,082,778
トレックス・セミコンダクター	2	3	7,560
東光高岳	2	3	7,901
ダブル・スコープ	12	21	27,720
ダイヘン	4	5	24,621
ヤーマン	7	12	18,150
JVCケンウッド	35	58	22,561
ミマキエンジニアリング	3	-	-
IPEX	2	4	4,981
日新電機	10	15	26,118
大崎電気工業	7	15	8,047
オムロン	35	58	426,377
日東工業	5	8	23,037
IDEC	5	9	31,112
不二電機工業	2	4	4,575
ジーエス・ユアコーポレーション	14	21	52,306
サクサホールディングス	2	3	5,787
メルコホールディングス	1	1	5,712
テクノメディカ	-	2	4,990
日本電気	54	91	434,980
富士通	38	64	1,122,391
沖電気工業	17	29	20,922
岩崎通信機	3	6	4,704
電気興業	2	2	5,631
サンケン電気	4	6	52,980
アイホン	2	3	7,620
ルネサスエレクトロニクス	233	419	717,896
セイコーエプソン	53	85	160,516
ワコム	33	50	33,644
アルバック	7	15	80,631
EIZO	3	4	17,390
ジャパンディスプレイ	147	247	10,374
日本信号	11	14	15,169
京三製作所	9	13	5,521
能美防災	5	8	14,407
ホーチキ	3	4	6,993
星和電機	-	10	4,742
エレコム	9	15	20,097

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パナソニック ホールディングス	459	759	896,943
シャープ	49	77	75,717
アンリツ	27	45	56,942
富士通ゼネラル	11	18	68,432
ソニーグループ	269	450	5,153,720
TDK	62	101	463,190
帝国通信工業	-	3	5,075
タムラ製作所	16	27	20,810
アルプスアルパイン	38	57	81,795
池上通信機	4	8	4,864
日本電波工業	3	7	10,949
メイコー	3	7	19,264
日本トリム	0.900	-	-
ローランド ディー. ジー.	2	3	11,214
フォスター電機	4	6	5,682
SMK	1	2	5,250
ヨコオ	3	5	10,210
ホシデン	10	15	24,701
ヒロセ電機	6	10	181,365
日本航空電子工業	9	13	29,937
TOA	4	7	5,853
マクセル	8	14	20,496
古野電気	5	8	7,929
ユニデンホールディングス	0.900	-	-
スミダコーポレーション	4	5	9,681
アイコム	1	2	6,427
リオン	1	2	5,003
横河電機	43	70	145,798
新電元工業	1	2	8,700
アズビル	25	44	160,645
東亜ディーケーケー	3	5	4,244
日本光電工業	17	29	99,225
共和電業	7	11	3,988
日本電子材料	2	4	6,363
堀場製作所	8	14	99,400
アドバンテスト	32	50	505,514
小野測器	6	11	4,621
エスベック	3	5	10,347
キーエンス	39	63	3,710,525
日置電機	2	3	26,169
シスメックス	36	54	455,779

## 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
日本マイクロニクス	7	10	13,639
メガチップス	4	5	14,747
OBARA GROUP	2	3	11,520
澤藤電機	1	3	3,765
原田工業	3	5	4,763
コーセル	5	8	9,222
イリソ電子工業	3	5	27,641
オプテックスグループ	7	11	24,183
千代田インテグレ	1	2	4,785
アイ・オー・データ機器	3	-	-
レーザーテック	18	31	708,227
スタンレー電気	30	45	128,380
岩崎電気	1	2	9,334
ウシオ電機	22	33	53,046
岡谷電機産業	9	0.100	29
日本セラミック	4	6	17,524
遠藤照明	2	6	5,134
古河電池	3	4	5,395
山一電機	3	5	10,040
図研	2	5	19,085
日本電子	9	16	64,240
カシオ計算機	31	47	64,084
ファナック	37	62	1,418,750
日本シイエムケイ	8	13	6,709
エンプラス	1	1	7,514
大真空	5	7	5,826
ローム	19	29	308,700
浜松ホトニクス	30	51	340,326
三井ハイテック	4	6	45,936
新光電気工業	12	22	85,500
京セラ	60	98	661,542
太陽誘電	20	31	129,735
村田製作所	126	193	1,429,519
双葉電子工業	7	12	6,630
北陸電気工業	0.100	3	5,358
ニチコン	13	13	17,082
日本ケミコン	4	6	13,324
KOA	6	9	17,817
市光工業	5	-	-
小糸製作所	23	76	175,184
ミツバ	8	11	6,033

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
SCREENホールディングス	7	10	112,597
キャノン電子	3	7	12,166
キャノン	213	349	1,034,398
リコー	119	159	170,240
象印マホービン	11	19	31,065
MUTOHホールディングス	1	2	4,017
東京エレクトロン	27	44	2,042,052
イノテック	2	4	5,590
<b>輸送用機器(7.5%)</b>			
トヨタ紡織	17	26	56,012
芦森工業	3	4	5,940
ユニプレス	6	11	8,675
豊田自動織機	34	46	360,218
モリタホールディングス	6	11	13,328
三櫻工業	6	9	6,586
デンソー	94	131	970,520
東海理化電機製作所	11	18	27,594
川崎重工業	31	48	145,200
名村造船所	-	16	6,275
日本車輛製造	1	2	4,880
三菱ロジスネクスト	5	10	8,547
近畿車輛	3	-	-
日産自動車	507	904	474,243
いすゞ自動車	135	185	303,913
トヨタ自動車	2,180	3,497	6,653,042
日野自動車	53	82	46,961
三菱自動車工業	159	248	132,148
エフテック	5	1	861
武蔵精密工業	9	15	28,314
日産車体	6	11	9,889
新明和工業	12	20	21,900
極東開発工業	8	11	16,273
トピー工業	3	5	9,682
ティラド	1	1	4,227
曙ブレーキ工業	23	38	5,718
タチエス	7	10	12,635
NOK	20	24	31,665
フタバ産業	10	17	7,011
KYB	4	6	22,173
大同メタル工業	8	12	6,299
プレス工業	21	28	12,978

## 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
ミクニ	9	13	4,732
太平洋工業	9	14	16,571
河西工業	10	-	-
アイシン	31	49	184,616
マツダ	135	210	246,519
今仙電機製作所	5	2	1,930
本田技研工業	338	517	1,791,242
スズキ	98	117	558,909
S U B A R U	123	201	442,897
ヤマハ発動機	56	100	337,837
エクセディ	6	10	18,720
豊田合成	13	18	40,306
愛三工業	6	10	9,124
盟和産業	-	4	4,598
ヨロズ	4	7	5,421
エフ・シー・シー	7	11	16,622
シマノ	17	26	571,590
テイ・エス テック	18	29	50,574
ジャムコ	3	3	6,279
<b>精密機器(2.5%)</b>			
テルモ	121	199	737,295
日機装	12	15	15,009
日本エム・ディ・エム	2	5	5,916
島津製作所	55	77	299,148
JMS	5	9	5,005
長野計器	3	4	5,552
ブイ・テクノロジー	1	3	7,808
東京計器	3	4	6,355
愛知時計電機	1	3	5,223
インターアクション	2	3	5,791
オーバル	12	6	3,182
東京精密	7	14	66,990
マニー	17	28	52,136
ニコン	65	99	128,106
トプコン	20	33	56,883
オリンパス	225	398	913,639
理研計器	3	4	19,820
タムロン	3	4	15,192
H O Y A	84	136	1,823,760
シード	-	2	1,466
ノーリツ鋼機	3	6	12,780

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
A&Dホロンホールディングス	3	9	11,690
朝日インテック	47	84	198,139
シチズン時計	50	70	58,450
リズム	2	1	1,838
メニコン	14	21	64,626
松風	1	2	6,052
セイコーグループ	6	9	28,967
ニプロ	32	53	57,666
<b>その他製品(2.3%)</b>			
K Y O R I T S U	-	25	3,263
スノーピーク	5	10	23,838
パラマウントベッドホールディングス	8	14	35,338
トランザクシオン	2	4	7,394
粧美堂	0.200	2	829
ニホンフラッシュ	3	6	5,616
前田工業	4	6	23,115
永大産業	10	18	4,095
アートネイチャー	4	6	4,943
パンダイナムコホールディングス	38	58	499,065
アイフィスジャパン	4	7	4,193
共立印刷	21	-	-
S H O E I	4	6	34,505
フランスベッドホールディングス	5	7	7,884
パイロットコーポレーション	7	10	44,200
萩原工業	2	4	5,224
フジシールインターナショナル	10	12	20,846
タカラトミー	18	29	38,249
広済堂ホールディングス	3	4	10,156
プロネクサス	3	5	5,236
大建工業	2	3	8,295
凸版印刷	65	83	200,086
大日本印刷	50	75	275,184
共同印刷	1	1	5,293
N I S S H A	8	12	22,276
TAKARA & COMPANY	2	4	9,570
アシックス	38	58	192,276
ツツミ	1	2	4,967
ローランド	3	4	18,306
小松ウオール工業	1	2	5,189
ヤマハ	25	40	198,695
河合楽器製作所	1	1	5,067

## 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
ビジョン	26	40	89,320
兼松サステック	—	0.400	898
キングジム	3	5	4,961
リンテック	9	12	28,108
イトーキ	7	13	9,759
任天堂	24	402	2,197,074
三菱鉛筆	7	9	13,320
タカラスタANDARD	8	12	17,269
コクヨ	20	30	56,764
ナカバヤシ	5	9	4,761
グローブライド	3	5	13,305
オカムラ	14	19	25,881
美津濃	4	6	19,089
<b>電気・ガス業(1.2%)</b>			
東京電力ホールディングス	322	574	275,568
中部電力	131	234	340,315
関西電力	163	245	325,325
中国電力	67	101	71,385
北陸電力	39	60	34,317
東北電力	100	155	106,343
四国電力	38	54	40,908
九州電力	88	146	110,687
北海道電力	37	61	29,827
沖縄電力	9	14	15,943
電源開発	36	48	103,392
エフオン	2	4	2,486
イーレックス	6	11	22,961
レノバ	8	16	38,041
東京瓦斯	82	134	360,862
大阪瓦斯	78	129	276,963
東邦瓦斯	19	25	63,001
北海道瓦斯	2	3	6,870
広島ガス	8	14	4,844
西部ガスホールディングス	4	6	10,638
静岡ガス	11	14	16,269
メタウォーター	4	8	13,160
<b>陸運業(2.9%)</b>			
SBSホールディングス	3	5	18,439
東武鉄道	42	70	210,350
相鉄ホールディングス	13	21	48,153
東急	108	178	291,296

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
京浜急行電鉄	55	72	91,838
小田急電鉄	64	96	158,163
京王電鉄	22	33	158,390
京成電鉄	30	41	159,057
富士急行	5	7	32,643
新京成電鉄	1	—	—
東日本旅客鉄道	75	108	745,740
西日本旅客鉄道	52	81	429,792
東海旅客鉄道	35	49	751,230
西武ホールディングス	56	77	108,724
鴻池運輸	6	10	16,055
西日本鉄道	11	17	40,936
ハマキョウレックス	3	5	15,750
サカイ引越センター	2	3	13,200
近鉄グループホールディングス	40	63	261,714
阪急阪神ホールディングス	51	84	325,632
南海電気鉄道	18	30	83,691
京阪ホールディングス	18	26	89,420
神戸電鉄	1	1	5,397
名古屋鉄道	33	70	146,013
山陽電気鉄道	3	4	10,502
アルプス物流	2	5	6,543
ヤマトホールディングス	57	81	189,743
山九	10	16	78,408
丸全昭和運輸	3	3	11,817
センコーグループホールディングス	20	33	32,891
トナミホールディングス	1	1	5,376
ニッコンホールディングス	13	20	50,388
日本石油輸送	0.500	1	2,804
福山通運	6	4	16,128
セイノーホールディングス	27	39	54,806
神奈川中央交通	1	1	5,886
日立物流	7	—	—
AZ-COM丸和ホールディングス	8	15	28,182
C&Fロジホールディングス	4	6	7,350
九州旅客鉄道	31	45	132,705
S Gホールディングス	77	122	255,590
NIPPON EXPRESSホールディングス	14	23	181,542
<b>海運業(0.6%)</b>			
日本郵船	34	170	566,262
商船三井	22	112	383,382

## 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
川崎汽船	12	54	176,150
N S ユナイテッド海運	2	3	14,577
明治海運	4	6	4,042
飯野海運	18	23	23,346
共栄タンカー	-	0,600	574
乾汽船	2	8	16,507
<b>空運業(0.5%)</b>			
日本航空	93	156	406,276
ANAホールディングス	103	173	486,649
パスコ	0.700	1	1,694
<b>倉庫・運輸関連業(0.1%)</b>			
トランコム	1	1	12,474
日新	3	4	9,744
三菱倉庫	13	13	42,675
三井倉庫ホールディングス	4	5	23,777
住友倉庫	14	17	36,872
澁澤倉庫	2	2	5,415
東陽倉庫	9	15	4,258
日本トランスシティ	9	12	7,257
中央倉庫	3	5	5,028
安田倉庫	3	5	4,914
東洋埠頭	2	-	-
上組	22	30	82,197
キューソー流通システム	-	4	4,006
近鉄エクスプレス	7	-	-
東海運	9	13	3,830
エーアイティ	2	4	6,312
内外トランスライン	1	2	4,979
日本コンセプト	1	3	4,579
<b>情報・通信業(8.7%)</b>			
N E C ネットエスアイ	14	21	34,697
クロスキャット	-	3	4,582
システナ	60	107	37,053
デジタルアーツ	2	4	21,720
日鉄ソリューションズ	6	10	36,624
キューブシステム	0.900	4	5,249
コア	1	3	5,025
手間いらず	0.600	1	5,461
ラクーンホールディングス	3	6	7,219
ソリトンシステムズ	-	4	4,862
ソフトクリエイトホールディングス	1	2	9,178

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
T I S	40	71	246,633
グリー	25	34	25,205
コーエーテックホールディングス	13	40	94,800
三菱総合研究所	1	3	16,058
A G S	3	6	4,499
ファインデックス	3	10	6,130
ブレインパッド	3	6	4,316
K L a b	7	12	4,964
ポルトゥウィンホールディングス	6	10	9,275
ネクソン	95	165	507,164
アイススタイル	12	20	9,078
エムアップホールディングス	4	7	8,556
エイチーム	3	6	5,286
エニグモ	4	8	4,965
テクノスジャパン	5	-	-
コロプラ	13	24	14,805
ブロードリーフ	20	37	16,374
クロス・マーケティンググループ	-	5	3,578
デジタルハーツホールディングス	1	4	6,140
システム情報	3	5	4,582
メディアドゥ	1	2	4,267
じげん	11	18	7,663
ブイキューブ	4	7	4,951
サイバーリンクス	2	3	3,293
フィックスターズ	4	7	10,022
CARTA HOLDINGS	1	3	4,501
オプティム	2	5	5,172
セレス	1	5	6,315
S H I F T	2	4	105,985
ティーガイア	3	6	11,055
テクマトリックス	7	11	17,678
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	11	19	45,396
GMOペイメントゲートウェイ	8	14	166,002
ザッパラス	5	-	-
インターネットイニシアティブ	11	35	95,301
さくらインターネット	5	9	5,674
ヴァインクス	3	-	-
GMOグローバルサイン・ホールディングス	0.900	1	7,533
S R A ホールディングス	2	3	9,982
朝日ネット	5	8	5,039
e B A S E	5	9	5,958



## 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
アバントグループ	4	8	10,959
アドソル日進	1	3	5,398
フリービット	2	4	5,561
コムチュア	4	8	18,681
サイバーコム	2	0.600	850
アステリア	3	6	5,071
アイル	2	3	6,883
マークラインズ	2	3	9,243
メディカル・データ・ビジョン	5	9	8,569
gumi	5	10	8,964
テラスカイ	1	2	5,474
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2	3	5,412
P R T I M E S	1	2	3,853
ラクス	14	30	52,427
ランドコンピュータ	3	5	5,500
ダブルスタンダード	1	2	5,239
オープンドア	2	4	7,231
アカツキ	1	3	6,480
Ubicomホールディングス	1	2	4,425
カナミックネットワーク	6	9	4,830
ノムラシステムコーポレーション	10	39	4,446
チェンジ	7	15	41,574
シンクロ・フード	8	0.200	101
オークネット	2	3	5,644
キャピタル・アセット・プランニング	4	7	4,582
マクロミル	8	14	14,891
ビーグリー	1	3	4,389
オロ	1	2	4,565
ユーザローカル	1	3	6,425
マネーフォワード	6	15	74,536
電算システムホールディングス	1	3	7,771
プロトコーポレーション	4	8	9,968
ハイマックス	2	-	-
野村総合研究所	81	131	386,712
サイバネットシステム	4	5	5,194
C Eホールディングス	6	9	5,123
インテージホールディングス	5	8	14,616
東邦システムサイエンス	2	-	-
ソースネクスト	18	32	7,605
インフォコム	4	8	19,360
シンプレクス・ホールディングス	4	10	25,252

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
HEROZ	2	5	5,890
ラクスル	4	18	24,372
メルカリ	-	28	73,012
I P S	-	2	5,512
F I G	8	12	3,660
イーソル	4	6	4,410
アルテリア・ネットワークス	5	6	7,728
ウイングアーク1 s t	2	6	12,005
サーバーワークス	0.900	2	4,876
トビラシステムズ	3	4	4,233
Sansan	15	23	36,328
ギフトィ	3	6	17,705
メドレー	-	6	27,744
ベース	0.700	2	10,384
JMDC	4	10	44,940
フォーカスシステムズ	3	4	4,732
クレスコ	3	4	8,540
フジ・メディア・ホールディングス	40	61	68,276
オービック	13	21	427,491
ジャストシステム	6	9	31,694
TDCソフト	3	5	8,148
Zホールディングス	614	909	348,147
トレンドマイクロ	22	36	239,850
IDホールディングス	3	5	5,315
日本オラクル	8	12	114,070
アルファシステムズ	1	2	8,470
フューチャー	8	15	28,349
CAC Holdings	2	3	6,286
S Bテクノロジーズ	1	2	5,324
トーセ	4	6	4,687
オービックビジネスコンサルタント	4	12	60,039
伊藤忠テクノソリューションズ	19	34	104,958
アイティフォー	5	8	7,266
東計電算	0.600	0.900	5,346
エックスネット	-	4	4,872
大塚商会	22	36	165,977
サイボウズ	5	8	23,100
電通国際情報サービス	6	7	38,142
A C C E S S	4	7	7,524
デジタルガレージ	7	11	51,358
イーエムシステムズ	7	10	9,211

## 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
ウェザーニューズ	1	2	15,594
C I J	3	5	5,991
ビジネスエンジニアリング	0.800	-	-
日本エンタープライズ	16	30	4,181
WOWOW	2	3	4,878
スカラ	4	6	4,785
ネットワンシステムズ	16	23	78,183
アルゴグラフィックス	3	5	22,567
マーベラス	6	10	7,488
エイベックス	7	10	17,581
B I P R O G Y	13	23	68,643
兼松エレクトロニクス	2	4	25,338
都築電気	2	3	5,009
T B Sホールディングス	25	32	53,268
日本テレビホールディングス	35	56	61,020
朝日放送グループホールディングス	4	7	5,016
テレビ朝日ホールディングス	10	15	21,731
スカパーJ S A Tホールディングス	35	56	27,612
テレビ東京ホールディングス	3	4	9,788
日本BS放送	2	4	4,368
ビジョン	7	8	13,431
USEN-NEXT HOLDINGS	4	5	14,905
コネクシオ	3	-	-
日本通信	35	58	14,136
日本電信電話	441	818	3,250,684
K D D I	308	493	1,993,650
ソフトバンク	639	1,026	1,572,498
光通信	5	7	151,725
エムティーアイ	4	9	4,794
GMOインターネットグループ	15	23	60,980
ファイバーゲート	2	-	-
アйдママーケティングコミュニケーション	10	16	4,706
K A D O K A W A	23	33	92,375
学研ホールディングス	6	10	9,147
ゼンリン	6	10	9,286
インプレスホールディングス	13	22	4,562
アイネット	2	3	4,992
松竹	2	3	40,885
東宝	24	40	189,200
東映	1	1	30,798
エヌ・ティ・ティ・データ	112	200	377,353

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ピー・シー・エー	2	3	4,832
ビジネスブレイン太田昭和	1	2	5,656
D T S	8	13	42,092
スクエア・エックス・ホールディングス	19	32	200,304
シーイーシー	4	9	13,554
カプコン	39	63	285,115
アイ・エス・ビー	2	4	5,168
ジャステック	2	4	5,199
S C S K	29	52	101,699
N S W	1	2	5,260
アイネス	3	4	5,989
T K C	7	11	41,917
富士ソフト	4	7	55,512
N S D	13	22	52,257
コナミグループ	15	27	170,898
福井コンピュータホールディングス	1	4	12,408
J B C Cホールディングス	2	4	8,892
ミロク情報サービス	3	5	10,492
ソフトバンクグループ	253	369	2,115,719
<b>卸売業(6.0%)</b>			
高千穂交易	-	2	5,776
オルパルスケアホールディングス	2	-	-
伊藤忠食品	1	1	7,455
エレマテック	3	6	10,404
J A L U X	1	-	-
あらた	3	5	20,982
トーマンデバイス	0.600	1	6,770
東京エレクトロン デバイス	1	2	19,825
円谷フィールズホールディングス	-	5	23,461
双日	46	71	184,184
アルフレッサ ホールディングス	47	67	110,931
横浜冷凍	11	18	18,245
ラサ商事	3	-	-
アルコニックス	5	8	11,979
神戸物産	32	52	188,081
ハイパー	5	4	1,980
あい ホールディングス	6	10	23,036
ディーブイエックス	2	4	4,841
ダイワボウホールディングス	20	27	56,760
マクニカホールディングス	10	16	58,410
ラクト・ジャパン	1	2	5,179

## 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
グリムス	1	2	6,946
バイタルケーエスケー・ホールディングス	7	9	8,486
八洲電機	3	5	6,042
メディアスホールディングス	3	7	5,464
レスターホールディングス	4	6	14,176
ジュテックホールディングス	2	4	5,332
OCHIホールディングス	2	3	5,206
TOKAIホールディングス	20	33	28,704
Cominix	4	6	5,005
三洋貿易	4	6	7,859
ビューティガレージ	-	1	4,207
ウイン・パートナーズ	3	4	5,179
シップハルスケアホールディングス	13	24	60,354
明治電機工業	2	4	5,358
コメダホールディングス	9	16	38,940
アセンテック	3	11	5,991
協栄産業	1	-	-
フルサト・マルカホールディングス	4	6	19,798
ヤマエグループホールディングス	2	3	6,281
小野建	4	6	9,337
南陽	1	2	5,055
佐鳥電機	-	4	6,858
伯東	2	3	18,876
コンドーテック	3	5	5,512
中山福	8	14	5,017
ナガイレーベン	5	8	16,753
三菱食品	4	6	20,398
松田産業	3	5	11,577
第一興商	8	13	55,250
メディパルホールディングス	45	69	122,325
S P K	2	3	5,316
萩原電気ホールディングス	1	2	6,931
アズワン	6	9	56,529
スズデン	1	2	6,391
シモジマ	2	5	5,319
ドウシシャ	4	7	12,559
小津産業	1	2	4,427
高速	2	3	6,727
丸文	3	6	7,938
ハピネット	3	5	10,590
橋本総業ホールディングス	1	4	5,254

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本ライフライン	12	19	18,005
I DOM	12	20	17,748
進和	2	4	9,567
ダイトロン	1	2	6,633
シークス	6	9	14,438
田中商事	4	8	4,938
オーハシテクニカ	2	3	5,253
白銅	1	2	6,211
伊藤忠商事	296	415	1,705,641
丸紅	418	532	935,522
長瀬産業	23	31	64,794
蝶理	2	3	9,032
豊田通商	42	59	329,220
三共生興	5	10	5,640
兼松	15	26	41,684
三井物産	329	493	1,926,644
日本紙パルプ商事	2	3	18,540
カメイ	5	7	9,907
OUGホールディングス	1	1	4,222
スターゼン	3	5	10,954
山善	17	18	19,000
椿本興業	0.900	1	4,908
住友商事	267	417	985,453
内田洋行	1	3	14,100
三菱商事	317	421	1,969,577
第一実業	1	2	12,480
キャノンマーケティングジャパン	10	15	48,204
西華産業	2	3	5,332
佐藤商事	3	4	6,424
菱洋エレクトロ	2	5	13,885
東京産業	3	6	4,947
ユアサ商事	4	6	22,173
神鋼商事	0.900	1	9,894
阪和興業	8	12	48,037
正栄食品工業	2	4	18,742
カナデン	3	5	5,956
菱電商事	3	5	10,076
岩谷産業	10	15	86,598
ナイス	1	2	3,967
極東貿易	1	4	5,784
アステナホールディングス	6	11	4,984

## 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
三愛オブリ	10	18	26,077
稲畑産業	9	13	35,496
G S Iクレオス	-	3	6,091
明和産業	3	9	6,318
クワザワホールディングス	-	10	4,939
ワキタ	9	12	14,470
東邦ホールディングス	13	16	36,136
サンゲツ	11	16	40,272
ミツウロコグループホールディングス	6	8	11,745
シナネンホールディングス	1	2	7,733
伊藤忠エネクス	9	16	18,403
サンリオ	13	19	77,928
サンワ テクノス	2	3	6,558
リョーサン	4	7	21,832
新光商事	6	9	11,720
トーホー	2	2	5,118
三信電気	2	2	6,885
東陽テクニカ	4	7	9,742
モスフードサービス	5	9	30,492
加賀電子	3	5	25,685
ソーダニッカ	4	-	-
立花エレテック	3	4	9,177
フォーバル	3	-	-
P A L T A C	5	10	51,516
三谷産業	9	15	5,008
西本Wismettacホールディングス	1	1	6,162
K P Pグループホールディングス	9	15	12,355
ヤマタネ	2	3	4,995
丸紅建材リース	1	2	4,847
日鉄物産	3	4	42,596
泉州電業	1	3	12,427
トラスコ中山	8	14	31,048
オートバックスセブン	14	23	33,883
モリト	4	6	6,402
加藤産業	6	8	29,807
イエローハット	7	11	21,158
J Kホールディングス	3	5	5,628
日伝	3	4	7,612
北沢産業	12	23	6,354
杉本商事	2	3	5,748
因幡電機産業	11	17	49,070

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東テク	1	2	9,141
ミスミグループ本社	53	101	316,795
タキヒヨー	1	-	-
蔵王産業	1	2	5,187
スズケン	16	21	73,185
ジェコス	3	5	5,010
<b>小売業(4.6%)</b>			
ローソン	9	16	90,514
サンエー	3	5	21,216
カワチ薬品	3	5	12,311
エービーシー・マート	6	9	66,444
ハードオフコーポレーション	4	2	3,640
アスクル	6	16	28,247
ゲオホールディングス	5	7	12,545
アダストリア	4	8	18,411
くら寿司	4	7	25,122
キャンドウ	2	2	5,551
I Kホールディングス	7	-	-
パルグループホールディングス	3	6	18,222
エディオン	19	26	35,217
サーラコーポレーション	8	14	10,110
ハローズ	1	3	10,431
フジオフードグループ本社	3	5	7,593
あみやき亭	1	1	5,069
大黒天物産	1	2	11,832
ハニーズホールディングス	3	6	8,718
ファーマライズホールディングス	-	7	4,277
アルペン	3	5	10,920
ハブ	4	-	-
クオールホールディングス	5	9	11,067
ジンスホールディングス	2	4	14,080
ビックカメラ	25	44	52,908
D C Mホールディングス	26	41	49,032
MonotaRO	53	95	182,214
東京一番フーズ	5	8	4,034
アークランドサービスホールディングス	3	5	12,028
J. フロント リテイリング	50	83	107,599
ドトール・日レスホールディングス	7	11	22,360
マツキヨココカラ&カンパニー	26	40	270,758
ブロンコビリー	2	3	8,679
Z O Z O	29	44	136,837

## ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トレジャー・ファクトリー	3	2	4,828
物語コーポレーション	2	3	26,381
三越伊勢丹ホールディングス	74	113	160,007
Hamee	0.300	7	5,964
ウエルシアホールディングス	22	35	105,875
クリエイトSDホールディングス	6	11	37,518
丸善CHIホールディングス	8	12	4,445
ミサワ	4	2	1,414
ティーライフ	2	3	4,355
シュッピン	3	5	4,530
オイシックス・ラ・大地	6	9	22,859
ネクステージ	8	15	48,895
ジョイフル本田	12	21	38,322
鳥貴族ホールディングス	-	2	5,122
ホットランド	3	5	7,170
すかいらーくホールディングス	54	92	147,267
SFPホールディングス	2	3	6,541
綿半ホールディングス	3	5	7,363
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	12	22	24,684
ゴルフダイジェスト・オンライン	2	3	3,224
B E E N O S	2	3	9,511
あさひ	3	5	7,632
日本調剤	2	4	5,395
コスモス薬品	4	7	95,988
セブン&アイ・ホールディングス	165	232	1,424,314
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	22	50	48,672
ツルハホールディングス	9	16	156,585
サンマルクホールディングス	3	5	9,655
フェリシモ	2	4	4,400
トリドールホールディングス	10	16	45,023
T O K Y O B A S E	4	17	8,043
ウエルプラスホールディングス	3	-	-
J Mホールディングス	2	5	10,670
アレンザホールディングス	3	5	5,075
パロックジャパンリミテッド	3	5	4,950
クスリのアオキホールディングス	4	6	48,280
FOOD & LIFE COMPANIES	24	38	135,450
メディカルシステムネットワーク	5	11	4,720
はるやまホールディングス	-	11	4,906
ノジマ	6	22	28,798
カッパ・クリエイト	5	10	15,147

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ライトオン	3	6	3,682
良品計画	48	86	122,007
アドヴァングループ	4	6	5,792
アルビス	1	2	5,284
コナカ	9	14	5,069
ハウス オブ ローゼ	-	2	4,782
G-7ホールディングス	4	8	12,062
イオン北海道	7	10	8,910
コジマ	7	13	7,267
ヒマラヤ	3	4	4,630
コーナン商事	6	9	30,576
エコス	1	2	4,820
ワタミ	5	8	7,290
パ・パフィック・インターナショナルホールディングス	84	151	390,442
西松屋チェーン	9	14	23,318
ゼンショーホールディングス	20	36	140,589
幸楽苑ホールディングス	2	-	-
サイゼリヤ	6	11	34,216
V Tホールディングス	16	25	12,876
魚力	-	2	4,958
フジ・コーポレーション	2	3	4,753
ユナイテッドアローズ	4	7	12,535
ハイデイ日高	6	10	20,570
YU-WA CREATION HOLDINGS	14	-	-
コロワイド	17	31	58,125
ピーシーデポコーポレーション	9	17	5,304
壱番屋	3	5	24,857
スギホールディングス	8	13	77,928
薬王堂ホールディングス	2	3	9,203
スクロール	6	10	7,850
ヨンドシーホールディングス	3	5	10,411
木曽路	5	10	22,348
S R Sホールディングス	5	11	10,145
千趣会	7	12	4,910
リテールパートナーズ	5	10	13,070
ケーヨー	7	10	9,766
上新電機	4	6	11,946
日本瓦斯	20	36	67,831
ロイヤルホールディングス	7	13	33,536
東天紅	3	5	4,033
いなげや	5	6	8,703

## 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
チヨダ	4	6	5,068
ライフコーポレーション	4	5	16,496
リンガーハット	5	8	19,583
MrMaxHD	5	9	6,429
AOKIホールディングス	8	12	9,812
オークワ	6	10	9,946
コメリ	6	10	27,560
青山商事	8	14	13,694
しまむら	4	7	102,147
高島屋	30	50	96,723
松屋	8	11	12,973
エイチ・ツー・オー リテイリング	20	32	44,575
近鉄百貨店	1	2	5,398
丸井グループ	33	49	102,680
アクシアル リテイリング	3	4	16,307
イオン	163	228	596,923
イズミ	7	10	30,549
平和堂	7	11	24,600
フジ	5	10	18,818
ヤオコー	4	7	51,984
ゼビオホールディングス	5	9	8,908
ケーズホールディングス	39	53	63,355
日産東京販売ホールディングス	13	4	1,675
Genky DrugStores	1	3	14,008
ナルミヤ・インターナショナル	3	5	5,224
ブックオフグループホールディングス	2	4	5,096
ギフトホールディングス	-	1	5,999
アインホールディングス	6	9	52,080
元気寿司	1	2	6,394
ヤマダホールディングス	155	276	132,347
アークランズ	6	9	14,404
ニトリホールディングス	16	27	439,120
グルメ杵屋	3	5	5,560
愛眼	17	27	4,537
ケーユーホールディングス	-	3	5,674
吉野家ホールディングス	14	26	62,594
松屋フーズホールディングス	2	3	12,800
サガミホールディングス	6	10	13,748
関西フードマーケット	3	6	8,277
王将フードサービス	2	4	26,708
プレナス	4	-	-

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ミニストップ	3	4	6,918
アークス	8	12	27,503
パローホールディングス	9	12	24,897
ベルク	1	3	18,802
大 庄	-	4	4,255
ファーストリテイリング	5	10	834,967
サンドラッグ	15	25	94,976
サックスパー ホールディングス	5	6	4,953
ヤマザワ	1	3	4,957
やまや	1	1	4,964
ベルーナ	9	16	11,097
<b>銀行業(6.8%)</b>			
いよぎんホールディングス	-	74	60,500
しずおかフィナンシャルグループ	-	141	157,145
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	-	52	51,004
島根銀行	5	9	5,157
じもとホールディングス	4	8	3,645
めぶきフィナンシャルグループ	220	311	114,832
東京きらぼしフィナンシャルグループ	5	8	24,080
九州フィナンシャルグループ	86	110	56,414
ゆうちょ銀行	100	178	215,748
富山第一銀行	10	15	10,202
コンコルディア・フィナンシャルグループ	242	345	197,740
西日本フィナンシャルホールディングス	27	39	44,821
三十三フィナンシャルグループ	3	5	9,615
第四北越フィナンシャルグループ	6	9	31,605
ひろぎんホールディングス	62	81	56,687
おきなわフィナンシャルグループ	3	6	14,070
十六フィナンシャルグループ	5	8	26,158
北國フィナンシャルホールディングス	3	5	22,949
プロクレアホールディングス	-	7	18,010
あいちフィナンシャルグループ	-	8	20,627
SBI新生銀行	27	18	45,066
あおぞら銀行	23	39	104,449
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,662	3,982	3,975,729
りそなホールディングス	486	800	603,572
三井住友トラスト・ホールディングス	80	114	565,554
三井住友フィナンシャルグループ	293	458	2,750,400
千葉銀行	141	174	173,052
群馬銀行	81	121	61,701
武蔵野銀行	6	8	20,225

## 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	
千葉興業銀行	11	14	7,541	
筑波銀行	—	27	6,572	
七十七銀行	13	20	48,501	
青森銀行	3	—	—	
秋田銀行	2	4	8,148	
山形銀行	4	7	8,939	
岩手銀行	2	4	10,479	
東邦銀行	35	49	12,300	
みちのく銀行	3	—	—	
ふくおかフィナンシャルグループ	35	50	155,059	
静岡銀行	103	—	—	
スルガ銀行	37	55	23,391	
八十二銀行	95	128	77,734	
山梨中央銀行	4	6	8,659	
大垣共立銀行	8	12	23,976	
福井銀行	3	5	9,486	
清水銀行	1	3	4,792	
富山銀行	1	1	1,985	
滋賀銀行	8	10	30,243	
南都銀行	6	9	25,126	
百五銀行	40	59	24,603	
京都銀行	15	19	127,957	
紀陽銀行	14	22	36,310	
ほくほくフィナンシャルグループ	26	39	42,134	
山陰合同銀行	25	39	33,129	
中国銀行	33	—	—	
鳥取銀行	1	—	—	
伊予銀行	56	—	—	
百十四銀行	4	5	11,382	
四国銀行	6	10	9,520	
阿波銀行	6	9	20,794	
大分銀行	2	3	8,588	
宮崎銀行	2	4	11,410	
佐賀銀行	2	3	6,830	
琉球銀行	9	14	15,825	
セブン銀行	126	224	60,444	
みずほフィナンシャルグループ	543	907	1,945,729	
山口フィナンシャルグループ	49	69	63,894	
長野銀行	2	3	5,486	
名古屋銀行	3	4	15,204	
北洋銀行	64	95	28,405	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
愛知銀行	1	—	—	
中京銀行	1	—	—	
大光銀行	2	3	4,521	
愛媛銀行	5	8	8,151	
京葉銀行	18	29	18,944	
栃木銀行	20	28	9,499	
北日本銀行	1	2	4,928	
東和銀行	7	11	6,992	
トモニホールディングス	32	50	19,773	
フィデアホールディングス	3	6	9,600	
池田泉州ホールディングス	48	80	20,476	
<b>証券、商品先物取引業(0.8%)</b>				
F P G	14	25	31,033	
ジャパンインベストメントアドバイザー	3	5	5,380	
マーキュリアホールディングス	—	4	3,675	
S B Iホールディングス	52	90	268,768	
ジャフコ グループ	16	20	44,328	
大和証券グループ本社	318	448	288,834	
野村ホールディングス	648	1,155	653,612	
岡三証券グループ	33	55	24,629	
丸三証券	12	20	9,196	
東洋証券	15	20	6,780	
東海証券フィナンシャル・ホールディングス	48	68	26,568	
光世証券	6	5	1,907	
水戸証券	11	23	6,969	
いちよし証券	7	11	7,551	
松井証券	20	37	29,785	
マネックスグループ	34	70	37,082	
極東証券	5	8	5,321	
岩井コスモホールディングス	4	7	9,819	
アイザワ証券グループ	7	9	6,461	
スパークス・グループ	19	7	12,012	
<b>保険業(2.5%)</b>				
かんぽ生命保険	42	76	183,718	
SOMPOホールディングス	69	107	624,229	
アニコム ホールディングス	13	21	12,077	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	95	127	568,713	
第一生命ホールディングス	209	319	946,405	
東京海上ホールディングス	139	631	1,810,481	
T & Dホールディングス	110	168	364,369	
アドバンスクリエイト	2	3	4,154	

## 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
<b>その他金融業(1.2%)</b>			
全国保証	10	16	87,285
ジェイリース	1	2	4,998
イントラスト	3	4	3,897
アルヒ	6	7	8,616
プレミアグループ	2	10	16,493
ネットプロテクションズホールディングス	—	20	11,964
クレディセゾン	27	39	72,412
芙蓉総合リース	4	5	52,722
みずほリース	6	9	33,340
東京センチュリー	8	11	54,634
日本証券金融	16	25	25,928
アイフル	71	103	38,339
リコーリース	3	6	23,730
イオンフィナンシャルサービス	23	36	47,952
アコム	83	111	36,591
ジャックス	4	6	28,743
オリエンコーポレーション	114	16	19,122
オリックス	257	419	1,017,916
三菱HCキャピタル	156	244	169,997
九州リースサービス	5	3	3,104
日本取引所グループ	107	176	346,497
イー・ギャランティ	6	10	22,977
アサックス	4	8	4,952
NECキャピタルソリューション	1	3	7,998
<b>不動産業(1.9%)</b>			
大東建託	13	23	289,340
いちご	47	72	20,793
日本駐車場開発	46	74	19,123
スター・マイカ・ホールディングス	2	—	—
SREホールディングス	1	3	10,757
ADワークスグループ	19	20	3,292
ヒューリック	101	146	158,442
三栄建築設計	1	3	4,926
野村不動産ホールディングス	22	39	114,503
三重交通グループホールディングス	8	13	6,686
サムティ	6	10	20,460
ディア・ライフ	5	9	5,942
コーセーアールイー	4	6	4,532
地主	2	4	9,124
プレサンスコーポレーション	5	8	13,751

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ハウスコム	—	4	4,460
JPMC	2	4	4,690
サンセイランディック	0.200	5	4,580
エストラスト	4	8	5,040
フージャースホールディングス	5	9	8,021
オープンハウスグループ	13	23	111,320
東急不動産ホールディングス	125	188	120,515
飯田グループホールディングス	35	54	120,725
イーブランド	1	—	—
ムゲンエステート	6	9	4,878
ファーストブラザーズ	3	—	—
And Doホールディングス	3	6	5,511
シーアールイー	—	4	4,578
ケイアイスター不動産	1	3	12,725
グッドコムアセット	2	5	4,979
ジェイ・エス・ビー	0.700	1	5,692
ロードスターキャピタル	—	3	4,683
パーク24	22	48	99,169
三井不動産	193	272	677,547
三菱地所	279	378	619,983
平和不動産	7	10	36,669
東京建物	41	59	95,261
ダイビル	10	—	—
京阪神ビルディング	6	7	9,630
住友不動産	89	113	351,540
テーオーシー	7	11	7,107
東京楽天地	0.700	1	5,352
レオパレス21	44	70	22,977
スターツコーポレーション	5	9	23,314
フジ住宅	4	8	5,948
空港施設	5	9	4,765
ゴールドクレスト	3	6	9,948
エスリード	1	2	6,081
日神グループホールディングス	6	11	4,961
日本エスコン	7	14	11,674
MIRARTHホールディングス	17	31	11,443
AVANTIA	3	5	4,628
イオンモール	21	32	58,825
ファースト住建	2	4	4,656
カチタス	10	16	45,528
トーセイ	5	10	14,996



## 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
穴吹興産	1	2	5,014	
サンフロンティア不動産	5	10	12,820	
FJネクストホールディングス	4	6	6,501	
グランディハウス	6	8	4,988	
日本空港ビルデング	16	22	144,300	
<b>サービス業(5.2%)</b>				
日本工営	2	4	15,228	
L I F U L L	12	22	4,345	
M I X I	9	14	39,201	
ジェイエイシーリクルートメント	3	5	13,446	
日本M&Aセンターホールディングス	67	112	134,647	
メンバーズ	1	2	3,632	
UTグループ	5	9	23,241	
アイティメディア	1	3	4,512	
E・Jホールディングス	-	4	5,678	
オープンアップグループ	10	23	44,860	
コシダカホールディングス	11	19	18,012	
アルトナー	3	1	1,409	
パソナグループ	4	7	15,199	
CDS	1	2	4,690	
リングアンドモチベーション	9	18	11,280	
エス・エム・エス	14	24	82,917	
サニーサイドアップグループ	4	7	4,102	
パーソルホールディングス	41	73	204,726	
クックパッド	12	26	5,772	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4	3	2,165	
学情	2	3	4,844	
スタジオアリス	1	3	6,930	
シミックホールディングス	2	3	6,336	
N J S	1	2	5,060	
総合警備保障	16	24	85,293	
カカココム	30	48	94,132	
アイロムグループ	1	2	4,783	
セントケア・ホールディング	3	5	4,553	
ルネサンス	2	5	5,084	
ディップ	7	11	42,090	
デジタルホールディングス	2	5	5,946	
新日本科学	5	6	18,429	
ベネフィット・ワン	15	30	63,145	
エムスリー	72	129	427,667	
ツカダ・グローバルホールディング	10	-	-	

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
アウトソーシング	23	39	49,101	
ウェルネット	6	7	5,089	
ワールドホールディングス	1	2	7,803	
ディー・エヌ・エー	15	27	50,136	
博報堂DYホールディングス	57	83	125,584	
ぐるなび	6	12	4,662	
ジャパンバスターシキュシステム	-	5	4,655	
ファンコミュニケーションズ	10	12	5,248	
ライク	-	2	4,562	
ビジネス・ブレークスルー	7	11	4,446	
エスプール	11	18	12,972	
WDBホールディングス	1	3	6,642	
アドウェイズ	6	9	6,435	
バリューコマース	3	4	8,383	
インフォマート	45	68	22,304	
J P ホールディングス	12	18	6,448	
CLホールディングス	2	6	4,972	
プレステージ・インターナショナル	15	27	18,562	
アミューズ	2	3	6,177	
ドリームインキュベータ	1	2	6,177	
クイック	2	5	9,170	
TAC	13	22	4,651	
電通グループ	42	64	280,348	
ぴあ	1	2	6,853	
イオンファンタジー	1	2	7,966	
シーティーエス	4	7	5,666	
ネクシィーズグループ	4	-	-	
H. U. グループホールディングス	10	19	51,590	
アルプス技研	3	5	13,668	
日本空調サービス	4	7	5,047	
オリエンタルランド	48	69	1,488,217	
ダスキン	9	14	45,552	
明光ネットワークジャパン	5	8	5,340	
ファルコホールディングス	2	3	5,892	
秀英予備校	7	11	4,706	
ラウンドワン	11	54	26,256	
リゾートトラスト	18	25	55,315	
ビー・エム・エル	5	8	25,636	
りらいあコミュニケーションズ	6	10	15,681	
リソー教育	18	29	10,549	
早稲田アカデミー	2	4	5,190	

## 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
ユー・エス・エス	46	67	150,213
東京個別指導学院	4	9	4,885
サイバーエージェント	101	156	187,920
楽天グループ	211	302	209,303
クリーク・アンド・リバー社	2	3	8,618
モーニングスター	7	10	5,232
テー・オー・ダブリュー	9	16	5,018
山田コンサルティンググループ	2	4	6,451
セントラルスポーツ	1	2	6,165
フルキャストホールディングス	3	6	15,500
エン・ジャパン	6	11	28,426
テクノプロ・ホールディングス	24	43	152,333
インターワークス	7	12	4,798
アイ・アールジャパンホールディングス	1	3	6,762
Keeper 技研	2	4	16,755
三機サービス	2	4	4,377
Gunosy	2	-	-
イー・ガーディアン	1	2	5,952
リブセンス	17	1	475
ジャパンマテリアル	12	20	47,260
ベクトル	5	10	14,008
ウチヤマホールディングス	9	15	4,277
チャーム・ケア・コーポレーション	3	5	6,099
キャリアリンク	2	2	6,072
I B J	3	5	4,494
アサンテ	1	3	5,260
バリューHR	1	5	9,063
M&Aキャピタルパートナーズ	3	6	27,210
ライドオンエクスプレスホールディングス	1	4	5,156
アビスト	1	-	-
シグマクシス・ホールディングス	2	9	10,909
ウィルグループ	3	5	6,064
メドピア	3	5	6,981
リクルートホールディングス	317	484	1,846,222
エラン	5	8	9,282
日本郵政	537	858	1,046,331
ベルシステム24ホールディングス	5	8	13,006
鎌倉新書	4	7	8,073
SMN	4	8	3,801
エアトリ	2	4	10,714
アトラエ	2	5	5,074
ストライク	1	3	13,056
ソラスト	10	18	12,222
インソース	4	16	21,205
ペイカレント・コンサルティング	2	51	289,562

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
Orchestra Holdings	0.800	2	5,250
アイモパイル	-	4	5,212
MS-Japan	3	-	-
ジャパンエペーターサービスホールディングス	13	23	46,716
GAMEWITH	6	10	3,510
ウェルビー	2	6	4,349
ミダックホールディングス	1	4	11,116
日総工産	3	-	-
キュービネットホールディングス	1	3	5,227
RPAホールディングス	8	18	6,290
マネジメントソリューションズ	2	3	13,284
プロレド・パートナーズ	2	10	5,613
and factory	7	11	4,247
カープスホールディングス	11	20	15,718
フォーラムエンジニアリング	3	5	5,150
ダイレクトマーケティングミックス	4	7	12,097
ポピンズ	1	3	5,952
LITALICO	3	5	13,203
リログループ	22	36	78,915
東祥	3	4	5,469
TREホールディングス	5	13	20,451
人・夢・技術グループ	1	2	4,428
エイチ・アイ・エス	9	17	35,756
ラックランド	1	2	5,796
共立メンテナンス	7	11	59,024
イチネンホールディングス	4	6	8,776
建設技術研究所	2	3	11,832
スペース	3	5	4,717
燦ホールディングス	-	2	6,032
東京テアトル	2	4	4,520
タナベコンサルティンググループ	4	7	6,153
ナガワ	1	1	13,680
東京都競馬	3	5	20,487
カナモト	7	12	26,712
西尾レントオール	3	6	18,971
トランス・コスモス	5	8	27,418
乃村工藝社	17	28	25,682
藤田観光	1	2	9,613
KNT-CTホールディングス	2	3	6,680
日本管財	4	6	17,601
トーカイ	3	5	11,043
セコム	40	66	525,262
セントラル警備保障	2	3	8,715
丹青社	8	12	9,042
メイテック	5	26	63,449

## 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
応用地質	4	6	12,187
船井総研ホールディングス	8	13	38,391
進学会ホールディングス	10	14	4,380
学究社	1	2	5,429
ベネッセホールディングス	13	24	48,214
イオンディライト	5	7	21,744
ナック	3	5	5,090
ダイセキ	7	13	53,935
ステップ	1	2	4,795
合計	株数・金額	47,173	74,409 183,450,884
	銘柄数<比率>	1,840	1,821 <97.9%>

(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
国内		百万円	百万円
	TOPIX		3,958

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2023年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	183,450,884	97.7
コール・ローン等、その他	4,369,209	2.3
投資信託財産総額	187,820,093	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

(2023年2月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>187,717,378,816円</b>
コール・ローン等	3,767,811,236
株式(評価額)	183,450,884,230
未収入金	123,396,100
未収配当金	317,622,250
差入委託証拠金	57,665,000
<b>(B)負債</b>	<b>289,343,871</b>
未払解約金	289,341,033
その他未払費用	2,838
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>187,428,034,945</b>
元本	81,219,744,591
次期繰越損益金	106,208,290,354
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>81,219,744,591口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>23,077円</b>

(注1) 期首元本額 54,493,461,224円  
 期中追加設定元本額 52,350,966,244円  
 期中一部解約元本額 25,624,682,877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	5,571,030,272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)	3,265,507,266円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,457,877円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,199,185,777円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,566,845,432円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,825,429,331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)	3,392,674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)	13,543,439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)	11,849,890円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,876,859,994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	23,490,370,695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)	2,985,872,092円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	290,153,997円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	242,293,972円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	335,702,180円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	571,176,835円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	47,127,163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)	124,141,170円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	9,162,792円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	12,847,195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)	5,307,703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)	8,885,025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)	28,981,300円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	212,241,013円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	141,337,546円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	299,353,517円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	205,759,439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)	25,795,069,108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)	22,046,930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)	72,423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)	154,390円
FWニッセイ国内株インデックス	38,721,220円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	15,864,934円

### 損益の状況

当期(2022年2月22日~2023年2月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>4,092,787,401円</b>
受取配当金	4,093,722,738
受取利息	85,045
その他収益	1,284,641
支払利息	△ 2,305,023
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>10,228,495,064</b>
売却益	17,364,693,127
売却損	△ 7,136,198,063
<b>(C)先物取引等損益</b>	<b>273,947,350</b>
取引益	755,852,300
取引損	△ 481,904,950
<b>(D)信託報酬等</b>	<b>△ 127,768</b>
<b>(E)当期損益金(A+B+C+D)</b>	<b>14,595,102,047</b>
<b>(F)前期繰越損益金</b>	<b>62,567,536,066</b>
<b>(G)追加信託差損益金</b>	<b>60,038,867,965</b>
<b>(H)解約差損益金</b>	<b>△ 30,993,215,724</b>
<b>(I)合計(E+F+G+H)</b>	<b>106,208,290,354</b>
<b>次期繰越損益金(I)</b>	<b>106,208,290,354</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 32 期

(計算期間：2023年5月23日～2023年11月20日)

#### 運用方針

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

#### 主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

#### 運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

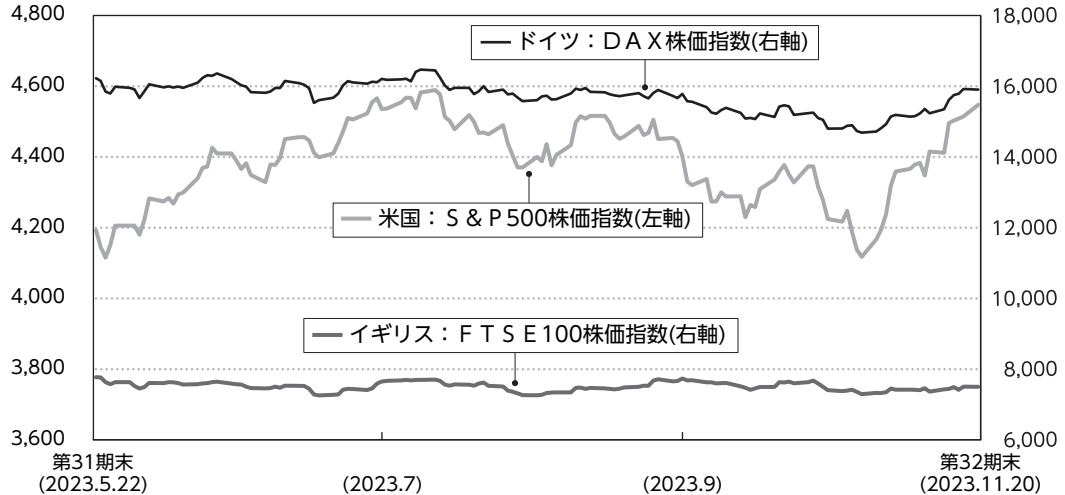
## 運用経過

2023年5月23日～2023年11月20日

## 投資環境

## ■ 海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】

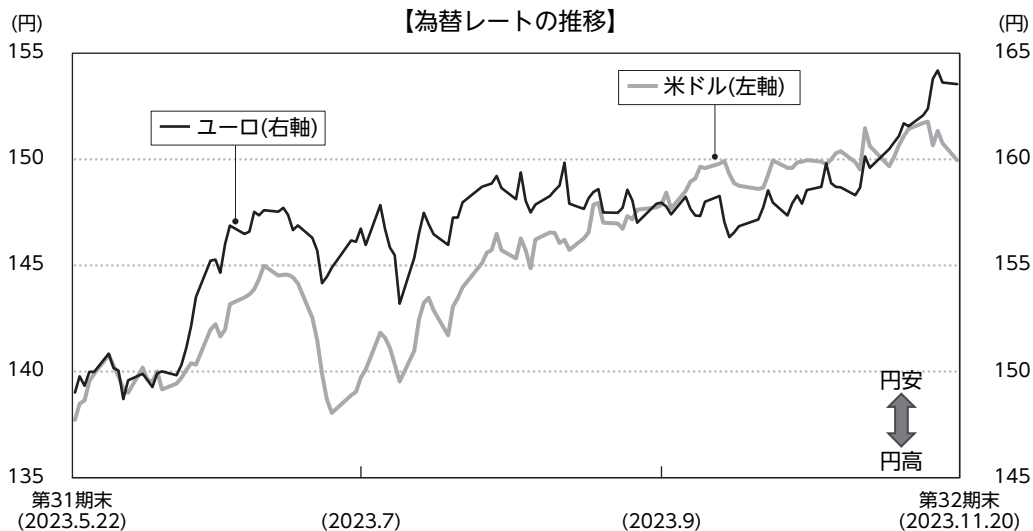


(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

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

期初から7月にかけては、米国における債務上限法案の上下院での可決や米消費者物価指数（CPI）がおおむね市場の予想通りとなったこと、堅調な経済指標を背景とした景気の軟着陸（ソフトランディング）への期待感が強まったことなどから株価はおおむね上昇しました。8月以降は米国債の格下げや堅調な経済指標を受けて米金利が上昇したことへの懸念等から株価は下落し、その後も米連邦準備制度理事会（FRB）による金融引き締めに向き姿勢を受けて米金利が上昇したことや米国の政府閉鎖問題、中東情勢の緊迫化を背景に下落しました。11月に入ると米連邦公開市場委員会（FOMC）で追加利上げ観測が後退したことなどを受けて株価は反発しました。結局、前期末と比較すると米国は上昇、ドイツとイギリスは下落して当期末を迎えました。

## ■為替市況



(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

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

#### <下落要因>

- ・ 9月にFRBによる金融引き締めに前向きな姿勢を受けて米金利が上昇する中、幅広いセクターで株価が下落したこと

## ポートフォリオ

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

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+15.3%となり、ベンチマーク騰落率(+15.2%)にほぼ連動しました。

## 今後の運用方針

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

## お知らせ

### ■ 約款変更

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

(2023年8月19日)



## 最近5期の運用実績

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

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
		%		%			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2023年5月22日	32,472	－	31,568	－	95.1	2.9	2.0
5月末	32,757	0.9	31,845	0.9	95.7	2.9	2.0
6月末	35,334	8.8	34,344	8.8	94.3	3.5	1.9
7月末	35,870	10.5	34,865	10.4	95.1	2.8	1.9
8月末	36,493	12.4	35,466	12.3	93.8	4.2	1.9
9月末	35,612	9.7	34,608	9.6	94.5	3.5	1.8
10月末	34,419	6.0	33,440	5.9	95.0	3.0	1.8
(期末)2023年11月20日	37,454	15.3	36,382	15.2	94.4	3.6	1.9

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023年11月20日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（35,267円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

## 売買および取引の状況

2023年5月23日～2023年11月20日

## (1) 株式

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル
	30,057 ( 1,299)	282,332 (△ 135)	5,304	28,957
カナダ		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
	3,162 ( 224)	18,932 (△ 96)	135	678
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
	5,194 (△ 456)	11,696	131	54
香港		千香港ドル		千香港ドル
	5,551	17,481	486	1,242
シンガポール		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
	21,395	2,625 (△ 23)	263	344
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
	384	334	6	28
イギリス		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
	24,825	17,312 (△ 261)	4,652	953
イスラエル		千イスラエル・シケル		千イスラエル・シケル
	411	1,651	2,120	2,816
スイス		千スイス・フラン		千スイス・フラン
	1,174 ( 398)	9,750 (△ 8)	3,614	1,849
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
	348 ( 1,587)	20,170	6	390
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
	421	7,476	29	960
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
	2,914 ( 161)	46,530	2,433	23,525

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
<b>(アメリカ)</b>		千□	千□	千米ドル
NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I	—	—	1	15
	( 1)			
<b>(カナダ)</b>		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.402	19	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.895	16	—	—
<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	13	53	—	—
GOODMAN GROUP	12	263	—	—
STOCKLAND	16	67	—	—
MIRVAC GROUP	27	61	—	—
VICINITY CENTRES	27	49	—	—
LENDLEASE GROUP	4	37	—	—
SCENTRE GROUP	35	94	—	—
DEXUS/AU	7	58	—	—
<b>(香港)</b>		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	52	2,345	—	—
<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	58	162	—	—
		(△ 3)		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	38	72	—	—
		(△ 1)		
KEPPEL REIT	—	—	28	23
	( 28)	( 23)		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	32	53	—	—
		(△ 6)		
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	17	27	—	—
		(△0.822)		
<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	2	7	83	270
LAND SECURITIES GROUP PLC	4	29	—	—
SEGRO PLC	5	44	1	13
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>		千ユーロ		千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW SCA	1	35	—	—
<b>(ユーロ/フランス)</b>				
KLEPIERRE	1	34	—	—
		(△ 17)		

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

### (3) 先物取引の種類別取引状況

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

(注1) 外貨建取引の金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）における国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2023年5月23日～2023年11月20日

### 株式

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

(注1) 金額は受渡代金で、外国株式は各月末（決算日の属する月については決算日）における国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

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

## 組入有価証券明細表

2023年11月20日現在

## (1) 外国株式

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



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
CARRIER GLOBAL CORP	773	829	4,415	662,120	資本財
CATALENT INC	158	179	714	107,176	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	481	512	12,962	1,943,764	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	98	104	1,852	277,855	金融サービス
CBRE GROUP INC	292	308	2,413	361,964	不動産管理・開発
CDW CORP/DE	125	133	2,884	432,556	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	100	102	1,334	200,090	素材
CENCORA, INC.	142	170	3,330	499,364	ヘルスケア機器・サービス
CENTENE CORP	523	545	3,961	594,085	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	581	626	1,741	261,067	公益事業
CERIDIAN HCM HOLDING INC	127	146	1,014	152,089	商業・専門サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	181	193	1,499	224,857	素材
CHARLES RIVER LABORATORIES	47	50	962	144,255	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHARLES SCHWAB CORP	1,342	1,494	8,486	1,272,552	金融サービス
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	100	97	3,965	594,595	メディア・娯楽
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	92	92	1,322	198,333	ソフトウェア・サービス
CHENIERE ENERGY INC	206	241	4,187	627,877	エネルギー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	105	112	921	138,195	エネルギー
CHEVRON CORP	1,698	1,803	26,051	3,906,419	エネルギー
CHEWY INC - CLASS A	87	115	237	35,606	一般消費財・サービス流通・小売り
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	25	27	5,928	889,024	消費者サービス
CHUBB LTD	383	411	9,163	1,374,059	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	225	242	2,243	336,422	家庭用品・パーソナル用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	138	156	1,576	236,366	保険
CINTAS CORP	84	90	4,984	747,483	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	3,797	4,050	19,342	2,900,442	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CITIGROUP INC	1,790	1,934	8,776	1,316,026	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	455	480	1,334	200,173	銀行
CLARIVATE PLC	281	337	243	36,476	商業・専門サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	476	512	870	130,505	素材
COLOROX CO	114	122	1,710	256,516	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	236	273	1,986	297,915	ソフトウェア・サービス
CME GROUP INC	332	357	7,631	1,144,307	金融サービス
CMS ENERGY CORP	268	289	1,662	249,296	公益事業
COCA-COLA CO	3,798	4,083	23,384	3,506,526	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	190	204	1,230	184,558	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	159	171	634	95,085	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	474	504	3,506	525,773	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	115	167	1,655	248,304	金融サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	733	783	5,923	888,173	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	3,987	4,134	17,536	2,629,663	メディア・娯楽
CONAGRA BRANDS INC	443	474	1,337	200,559	食品・飲料・タバコ
CONFLUENT INC-CLASS A	-	162	309	46,367	ソフトウェア・サービス
CONOCOPHILLIPS	1,151	1,202	13,781	2,066,468	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	327	344	3,144	471,589	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	153	163	3,863	579,279	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION ENERGY	302	322	3,922	588,150	公益事業
COOPER COS INC/THE	45	49	1,657	248,610	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	396	853	4,288	643,058	商業・専門サービス
CORNING INC	743	803	2,287	342,978	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	660	706	3,343	501,384	素材
COSTAR GROUP INC	375	406	3,359	503,769	不動産管理・開発
COSTCO WHOLESALE CORP	409	440	25,421	3,811,901	生活必需品流通・小売り
COTERRA ENERGY INC	728	752	2,013	301,980	エネルギー
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	188	222	4,613	691,770	ソフトウェア・サービス
CROWN HOLDINGS INC	110	119	997	149,559	素材
CSX CORP	1,943	2,035	6,436	965,186	運輸
CUMMINS INC	130	140	3,173	475,894	資本財
CVS HEALTH CORP	1,214	1,274	8,769	1,314,995	ヘルスケア機器・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	37	41	785	117,724	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	639	696	14,477	2,170,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DARDEN RESTAURANTS INC	113	120	1,873	280,898	消費者サービス
DARLING INTERNATIONAL INC	148	158	690	103,581	食品・飲料・タバコ
DATADOG INC - CLASS A	229	250	2,741	411,147	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	49	53	518	77,805	ヘルスケア機器・サービス
DECKERS OUTDOOR CORP	-	25	1,612	241,732	耐久消費財・アパレル
DEERE & CO	265	276	10,634	1,594,689	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	239	254	1,872	280,775	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	147	159	575	86,255	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	198	211	626	94,013	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	573	637	2,893	433,875	エネルギー
DEXCOM INC	357	385	4,044	606,456	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	154	170	2,667	399,946	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	-	62	734	110,202	一般消費財・サービス流通・小売り

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ESSENTIAL UTILITIES INC	230	249	888	133,279	公益事業
ESTEE LAUDER COS INC	213	230	2,855	428,171	家庭用品・パーソナル用品
ETSY INC	116	122	889	133,425	一般消費財・サービス流通・小売り
EVEREST GROUP LTD	36	42	1,687	252,973	保険
EVERGY INC	212	228	1,149	172,412	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	321	346	2,029	304,302	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	164	179	1,188	178,254	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	918	988	3,848	577,064	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	139	141	1,932	289,738	消費者サービス
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	146	151	1,805	270,755	運輸
EXXON MOBIL CORP	3,807	4,017	42,171	6,323,657	エネルギー
F5 INC	55	60	979	146,869	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	35	37	1,733	259,979	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	23	24	2,587	388,064	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	529	567	3,450	517,399	資本財
FEDEX CORP	228	237	6,073	910,711	運輸
FERGUSON PLC	192	203	3,383	507,336	資本財
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	238	257	1,158	173,704	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	548	589	3,220	482,971	金融サービス
FIFTH THIRD BANCORP	634	676	1,865	279,683	銀行
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	9	10	1,568	235,145	銀行
FIRST HORIZON NATIONAL CORP	496	528	652	97,790	銀行
FIRST SOLAR INC	88	100	1,563	234,451	半導体・半導体製造装置
FIRSTENERGY CORP	502	540	2,010	301,548	公益事業
FISERV INC	557	613	7,613	1,141,614	金融サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	64	69	1,622	243,356	金融サービス
FMC CORP	116	124	667	100,085	素材
FORD MOTOR CO	3,651	3,906	4,011	601,547	自動車・自動車部品
FORTINET INC	613	663	3,399	509,818	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	310	351	2,392	358,723	資本財
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS, INC	118	125	846	126,910	資本財
FOX CORP - CLASS A	275	263	800	120,080	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	138	144	410	61,524	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	276	298	724	108,589	金融サービス
FREPORT-MCMORAN INC	1,321	1,424	5,127	768,849	素材
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	55	54	326	48,959	金融サービス
GARMIN LTD	141	152	1,819	272,839	耐久消費財・アパレル

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
GARTNER INC	73	78	3,279	491,822	ソフトウェア・サービス
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	336	406	2,968	445,122	ヘルスケア機器・サービス
GEN DIGITAL INC	541	572	1,183	177,501	ソフトウェア・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	58	61	705	105,839	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	215	231	5,672	850,613	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,010	1,082	12,978	1,946,120	資本財
GENERAL MILLS INC	548	581	3,768	565,030	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	1,313	1,381	3,872	580,628	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	130	139	1,919	287,867	一般消費財・サービス流通・小売り
GILEAD SCIENCES INC	1,159	1,239	9,354	1,402,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	249	260	2,917	437,504	金融サービス
GLOBAL-E ONLINE LTD	-	89	274	41,096	一般消費財・サービス流通・小売り
GLOBE LIFE INC	85	90	1,064	159,651	保険
GODADDY INC - CLASS A	143	145	1,339	200,866	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	313	330	11,206	1,680,363	金融サービス
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	1,204	1,863	616	92,468	運輸
GRACO INC	155	167	1,349	202,354	資本財
HALLIBURTON CO	839	896	3,405	510,711	エネルギー
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	293	308	2,357	353,542	保険
HASBRO INC	121	131	591	88,690	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	196	205	5,053	757,809	ヘルスケア機器・サービス
HEICO CORP	40	43	734	110,180	資本財
HEICO CORP-CLASS A	68	74	1,007	151,096	資本財
HENRY SCHEIN INC	125	130	894	134,182	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	135	146	2,870	430,390	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	256	274	3,966	594,791	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,189	1,283	2,043	306,473	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HF SINCLAIR CORP	138	152	819	122,896	エネルギー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	250	262	4,425	663,556	消費者サービス
HOLOGIC INC	227	244	1,757	263,538	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	942	999	30,705	4,604,242	一般消費財・サービス流通・小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	621	661	12,653	1,897,365	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,031	1,103	362	54,414	不動産管理・開発
HORIZON PHARMA PLC	199	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	278	299	972	145,901	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	344	389	2,005	300,775	資本財
HP INC	929	881	2,496	374,323	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千米ドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC	379	404	6,896	1,034,185	商業・専門サービス
WATERS CORP	54	58	1,536	230,469	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WATSCO INC	-	33	1,295	194,203	資本財
WEBSTER FINANCIAL CORP	160	173	749	112,332	銀行
WEC ENERGY GROUP INC	291	313	2,562	384,229	公益事業
WELLS FARGO & CO	3,522	3,645	15,660	2,348,261	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	68	73	2,528	379,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTERN DIGITAL CORP	293	318	1,483	222,380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTLAKE CHEMICAL CORP	35	37	493	74,050	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	235	254	966	144,877	素材
WEYERHAEUSER CO	680	727	2,321	348,119	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
WHIRLPOOL CORP	50	54	613	91,946	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	1,126	1,210	4,288	643,116	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	100	105	2,559	383,864	保険
WIX.COM LTD	52	53	518	77,778	ソフトウェア・サービス
WOLFSPEED INC	114	123	454	68,180	半導体・半導体製造装置
WORKDAY INC-CLASS A	185	204	4,742	711,074	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	195	207	1,454	218,118	保険
WW GRAINGER INC	42	44	3,599	539,740	資本財
WYNN RESORTS LTD	99	101	883	132,515	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	505	546	3,312	496,711	公益事業
XYLEM INC	166	237	2,406	360,869	資本財
YUM! BRANDS INC	260	278	3,554	533,026	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	47	51	1,114	167,187	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC - C W/I	144	152	596	89,417	不動産管理・開発
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	193	207	2,316	347,356	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	430	459	8,029	1,203,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	204	237	1,520	227,928	ソフトウェア・サービス
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	242	260	349	52,336	メディア・娯楽
ZSCALER INC	80	87	1,631	244,594	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	313,393 601	339,445 605	3,882,866 -	582,235,857 <70.4%>
<b>(カナダ)</b>			千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD	421	489	3,250	355,142	素材
AIR CANADA	166	176	316	34,574	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	630	657	537	58,740	公益事業



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	750	777	6,085	664,824	生活必需品流通・小売り
ALTAGAS LTD	263	282	777	84,918	公益事業
ARC RESOURCES LTD	587	608	1,302	142,254	エネルギー
BANK OF MONTREAL	627	710	7,963	870,029	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	1,104	1,188	7,257	792,894	銀行
BARRICK GOLD CORP	1,629	1,746	3,764	411,253	素材
BCE INC	79	87	473	51,719	電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	328	349	1,611	176,071	金融サービス
BROOKFIELD CORPORATION-A	1,312	1,401	6,511	711,386	金融サービス
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	121	136	484	52,976	公益事業
BRP INC/CA- SUB VOTING	33	36	374	40,869	耐久消費財・アパレル
CAE INC	295	317	915	100,068	資本財
CAMECO CORP	400	430	2,636	287,983	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	840	904	4,903	535,724	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	531	560	8,868	968,830	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,025	1,101	10,058	1,098,852	エネルギー
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LIMITED	861	926	9,116	995,969	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	51	52	778	85,042	一般消費財・サービス流通・小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	123	135	424	46,342	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B	139	149	871	95,258	素材
CENOVUS ENERGY INC	1,332	1,425	3,536	386,311	エネルギー
CGI INC	196	211	2,933	320,469	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC	18	20	6,320	690,564	ソフトウェア・サービス
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	79	85	948	103,591	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC	253	282	2,788	304,691	一般消費財・サービス流通・小売り
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	366	389	815	89,045	金融サービス
EMERA INC	251	274	1,349	147,420	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	151	147	570	62,306	生活必需品流通・小売り
ENBRIDGE INC	1,877	2,018	9,327	1,019,031	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	21	21	2,546	278,253	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	545	585	897	98,010	素材
FIRSTSERVICE CORP	37	40	846	92,430	不動産管理・開発
FORTIS INC	449	485	2,742	299,641	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	177	191	3,158	345,086	素材
GEORGE WESTON LTD	66	62	1,033	112,874	生活必需品流通・小売り
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	170	232	960	104,934	商業・専門サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	167	178	875	95,614	耐久消費財・アパレル

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
GREAT-WEST LIFECO INC	264	282	1,204	131,601	保険
HYDRO ONE LTD	309	332	1,274	139,285	公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	98	102	898	98,184	保険
IGM FINANCIAL INC	80	86	292	31,927	金融サービス
IMPERIAL OIL LTD	196	204	1,614	176,390	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	162	175	3,661	400,000	保険
IVANHOE MINES LTD-CL A	564	607	669	73,112	素材
KEYERA CORP	207	230	740	80,914	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	1,163	1,219	889	97,223	素材
LOBLAW COS LTD	151	159	1,947	212,730	生活必需品流通・小売り
LUNDIN MINING CORP	609	655	588	64,285	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	252	271	2,086	227,906	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,749	1,835	4,824	527,108	保険
METRO INC	220	232	1,631	178,256	生活必需品流通・小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	313	337	3,083	336,857	銀行
NORTHLAND POWER INC	228	254	572	62,546	公益事業
NUTRIEN LTD	481	493	3,829	418,361	素材
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	60	63	170	18,589	金融サービス
ONEX CORPORATION	66	68	607	66,334	金融サービス
OPEN TEXT CORP	251	270	1,436	156,935	ソフトウェア・サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	195	362	712	77,817	素材
PARKLAND CORP	132	141	614	67,175	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	513	551	2,451	267,816	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	516	580	2,124	232,142	保険
QUEBECOR INC -CL B	145	155	480	52,481	電気通信サービス
RB GLOBAL INC	103	181	1,531	167,311	商業・専門サービス
RESTAURANT BRANDS INTERN	270	294	2,876	314,231	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	332	357	2,097	229,108	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,280	1,379	16,622	1,815,988	銀行
SAPUTO INC	233	254	686	75,048	食品・飲料・タバコ
SHOPIFY INC - CLASS A	1,100	1,192	11,193	1,222,882	ソフトウェア・サービス
STANTEC INC	-	111	1,074	117,382	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	545	586	4,074	445,140	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,253	1,312	6,080	664,298	エネルギー
TC ENERGY CORP	937	1,013	5,104	557,631	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	420	453	2,239	244,643	素材
TFI INTERNATIONAL INC	72	76	1,195	130,556	運輸

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(カナダ)</b>		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
THOMSON REUTERS CORP		156	158	2,988	326,454	商業・専門サービス
TMX GROUP LTD		52	280	812	88,760	金融サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD		77	82	940	102,742	資本財
TORONTO-DOMINION BANK		1,678	1,829	15,511	1,694,670	銀行
TOURMALINE OIL CORP		297	320	2,128	232,591	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD		53	56	596	65,186	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		418	450	2,826	308,777	素材
WSP GLOBAL INC		115	124	2,369	258,882	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	36,824	40,075	242,290	26,470,279	
<b>(オーストラリア)</b>				千オーストラリア・ドル		
AMPOL LTD		219	236	793	77,427	エネルギー
ANZ GROUP HOLDINGS LTD		2,764	2,986	7,189	701,445	銀行
APA GROUP		1,090	1,253	1,045	101,967	公益事業
ARISTOCRAT LEISURE LTD		548	584	2,352	229,571	消費者サービス
ASX LTD		179	192	1,101	107,475	金融サービス
AURIZON HOLDINGS LTD		1,699	1,827	665	64,911	運輸
BHP GROUP LIMITED		4,683	5,035	23,468	2,289,849	素材
BLUESCOPE STEEL LTD		427	451	923	90,091	素材
BRAMBLES LTD		1,282	1,379	1,816	177,219	商業・専門サービス
COCHLEAR LTD		60	65	1,694	165,368	ヘルスケア機器・サービス
COLES GROUP LTD		1,237	1,330	2,051	200,137	生活必需品流通・小売り
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		1,566	1,666	17,072	1,665,746	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED		502	570	1,348	131,536	商業・専門サービス
CSL LIMITED		445	479	12,400	1,209,952	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA		1,323	1,425	701	68,436	生活必需品流通・小売り
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,565	1,683	4,246	414,318	素材
IDP EDUCATION LTD		193	249	593	57,867	消費者サービス
IGO LTD		629	677	602	58,792	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		2,275	2,422	1,419	138,518	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		411	437	2,103	205,267	素材
LOTTERY CORP LTD/THE		2,056	2,208	1,007	98,267	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD		339	364	6,108	596,053	金融サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		2,546	2,736	971	94,793	保険
MINERAL RESOURCES LTD		157	173	1,103	107,693	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		2,914	3,121	8,654	844,455	銀行
NEWCREST MINING LIMITED		824	-	-	-	素材

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	オーストラリアドル	千円	
NEWMONT CORP-CDI	-	354	2,001	195,313	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,068	1,139	1,340	130,771	素材
ORICA LTD	418	452	712	69,535	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,592	1,710	1,471	143,546	公益事業
PILBARA MINERALS LTD	2,354	2,680	954	93,102	素材
QANTAS AIRWAYS LTD	851	836	438	42,765	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,371	1,481	2,225	217,143	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	169	182	942	91,962	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	48	52	831	81,097	メディア・娯楽
REECE LTD	209	224	437	42,685	資本財
RIO TINTO LTD	343	368	4,630	451,783	素材
SANTOS LTD	2,917	3,227	2,255	220,113	エネルギー
SEEK LTD	311	353	819	79,999	メディア・娯楽
SONIC HEALTHCARE LTD	422	444	1,310	127,906	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	4,236	4,512	1,430	139,581	素材
SUNCORP GROUP LTD	1,168	1,257	1,679	163,906	保険
TELSTRA GROUP LTD	3,816	4,112	1,579	154,083	電気通信サービス
TRANSURBAN GROUP	2,843	3,063	3,980	388,334	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	666	718	762	74,366	食品・飲料・タバコ
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	200	233	780	76,165	金融サービス
WESFARMERS LIMITED	1,048	1,127	5,977	583,250	一般消費財・サービス流通・小売り
WESTPAC BANKING CORP	3,236	3,488	7,360	718,182	銀行
WISETECH GLOBAL LTD	136	164	1,108	108,141	ソフトウェア・サービス
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1,755	1,887	5,925	578,190	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,124	1,211	4,277	417,383	生活必需品流通・小売り
XERO LTD	124	142	1,446	141,116	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	64,384 51	68,991 51	158,118 -	15,427,596 <1.9%>
<b>(香港)</b>			千香港ドル		
AIA GROUP LTD	10,926	11,480	83,694	1,609,448	保険
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,420	3,680	7,839	150,748	銀行
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,590	1,713	2,607	50,136	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,834	1,959	7,522	144,665	不動産管理・開発
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,484	2,664	10,709	205,946	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	585	630	2,406	46,278	公益事業
CLP HOLDINGS LTD	1,521	1,631	9,715	186,822	公益事業
ESR GROUP LIMITED	1,842	2,178	2,195	42,218	不動産管理・開発

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
RELX PLC	1,770	1,881	5,615	1,048,318	商業・専門サービス	
RENTOKIL INITIAL PLC	2,328	2,503	1,161	216,763	商業・専門サービス	
RIO TINTO PLC	1,039	1,118	6,093	1,137,682	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	7,735	8,362	2,040	380,934	資本財	
SAGE GROUP PLC	942	1,016	1,000	186,848	ソフトウェア・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	1,623	1,643	437	81,693	生活必需品流通・小売り	
SCHRODERS PLC	817	799	325	60,793	金融サービス	
SEVERN TRENT PLC	232	250	675	126,147	公益事業	
SHELL PLC-NEW	6,524	6,663	17,381	3,244,933	エネルギー	
SMITH & NEPHEW PLC	804	867	888	165,871	ヘルスケア機器・サービス	
SMITHS GROUP PLC	327	347	573	107,097	資本財	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	68	73	655	122,455	資本財	
SSE PLC	997	1,082	1,943	362,848	公益事業	
ST JAMES'S PLACE PLC	503	546	375	70,118	金融サービス	
STANDARD CHARTERED PLC	2,273	2,355	1,554	290,215	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	3,270	3,517	442	82,550	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	6,842	7,122	1,965	366,989	生活必需品流通・小売り	
UNILEVER PLC	2,343	2,499	9,539	1,780,844	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	629	676	733	136,953	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC	24,274	23,169	1,737	324,414	電気通信サービス	
WHITBREAD PLC	186	196	655	122,450	消費者サービス	
WISE PLC - A	-	611	436	81,534	金融サービス	
WPP PLC	990	1,068	761	142,168	メディア・娯楽	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	254,927 77	275,100 82	180,171 -	33,636,305 <4.1%>	
<b>(イスラエル)</b>			千イスラエル・シケル			
AZRIELI GROUP	39	42	829	33,453	不動産管理・開発	
BANK HAPOALIM BM	1,173	1,261	3,788	152,783	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,426	1,525	4,099	165,321	銀行	
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	1,965	-	-	-	電気通信サービス	
ELBIT SYSTEMS LTD	24	26	1,961	79,118	資本財	
FIRST INTL BANK ISRAEL	51	-	-	-	銀行	
ICL GROUP LTD	655	769	1,481	59,766	素材	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	1,141	1,227	2,229	89,931	銀行	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	142	153	1,994	80,428	銀行	
NICE LTD	58	62	4,535	182,903	ソフトウェア・サービス	



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(イスラエル)</b>		百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
TOWER SEMICONDUCTOR LTD		101	-	-	-	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額	6,780	5,070	20,920	843,706	
	銘柄数<比率>	11	8	-	<0.1%>	
<b>(スイス)</b>				千スイス・フラン		
ABB LTD		1,452	1,589	5,368	908,495	資本財
ADECCO GROUP AG-REG		147	158	656	111,058	商業・専門サービス
ALCON INC		461	496	3,101	524,900	ヘルスケア機器・サービス
BACHEM HOLDING AG-REG B		30	33	240	40,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BALOISE HOLDING AG		42	45	596	100,939	保険
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		27	29	303	51,337	銀行
BARRY CALLEBAUT AG-REG		3	3	527	89,208	食品・飲料・タバコ
BKW AG		19	20	325	55,031	公益事業
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.96	0.95	1,030	174,423	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.10	0.10	1,084	183,434	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		482	518	5,841	988,549	耐久消費財・アパレル
CLARIANT AG		199	214	286	48,486	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG		3,329	-	-	-	金融サービス
DUFREY AG-REG		-	95	303	51,277	一般消費財・サービス流通・小売り
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		6	7	434	73,546	素材
GEBERIT AG-REG		33	33	1,584	268,049	資本財
GIVAUDAN-REG		8	9	2,960	501,059	素材
HELVETIA HOLDING AG-REG		-	36	454	76,885	保険
HOLCIM LTD		512	517	3,196	540,945	素材
JULIUS BAER GROUP LTD		197	204	1,139	192,897	金融サービス
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		50	54	1,330	225,157	運輸
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		159	163	1,234	208,885	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG		68	74	2,628	444,721	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA		2,542	2,653	26,270	4,445,437	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG		1,999	2,037	17,131	2,899,007	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDING AG		20	22	2,540	429,862	金融サービス
ROCHE HOLDING AG		649	698	16,588	2,807,149	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG-BR		24	31	808	136,786	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SANDOZ GROUP AG		-	407	1,040	176,077	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		22	23	440	74,489	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		37	40	775	131,198	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE		147	149	1,099	186,077	商業・専門サービス
SIG GROUP AG		282	304	637	107,838	素材

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ/スペイン)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	5,570	5,926	4,909	802,889	銀行
BANCO SANTANDER SA	15,514	16,076	5,985	978,850	銀行
CAIXABANK	4,095	4,100	1,660	271,527	銀行
CELLNEX TELECOM SAU	524	564	1,836	300,322	電気通信サービス
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	60	65	176	28,943	公益事業
ENAGAS SA	230	247	400	65,463	公益事業
ENDESA SA	292	314	616	100,783	公益事業
FERROVIAL S.A.	450	-	-	-	資本財
FERROVIAL SE	-	505	1,528	249,989	資本財
GRIFOLS SA	275	296	375	61,340	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA	5,677	6,048	6,695	1,094,922	公益事業
INDITEX SA	1,008	1,083	3,865	632,130	一般消費財・サービス流通・小売り
NATURGY ENERGY GROUP SA	134	124	336	55,003	公益事業
REDEIA CORPORACION SA	376	405	613	100,276	公益事業
REPSOL SA	1,269	1,266	1,747	285,774	エネルギー
TELEFONICA SA	4,857	5,212	1,956	319,941	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	41,047 19	43,002 19	37,740 -	6,172,011 <0.7%>
<b>(ユーロ/イタリア)</b>					
AMPLIFON SPA	115	123	340	55,704	ヘルスケア機器・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	1,025	1,006	1,957	320,158	保険
DIASORIN ITALIA SPA	23	22	197	32,355	ヘルスケア機器・サービス
ENEL SPA	7,515	8,080	5,175	846,426	公益事業
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	2,308	2,346	3,522	576,149	エネルギー
FINECOBANK SPA	563	607	746	122,130	銀行
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	324	347	371	60,745	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO	14,919	15,442	4,144	677,830	銀行
MEDIOBANCA SPA	549	547	644	105,358	銀行
MONCLER SPA	189	204	1,032	168,839	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA	545	587	406	66,543	金融サービス
POSTE ITALIANE SPA	482	518	527	86,261	保険
PRYSMIAN SPA	235	260	932	152,520	資本財
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	96	103	469	76,768	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAM SPA	1,860	2,002	900	147,302	公益事業
STELLANTIS NV	2,078	2,198	4,060	664,039	自動車・自動車部品
TELECOM ITALIA SPA	9,330	10,078	261	42,689	電気通信サービス
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	1,298	1,395	1,049	171,560	公益事業

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
<b>(ユーロ/イタリア)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNICREDIT SPA		1,775	1,831	4,585	749,840	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	45,238 19	47,705 19	31,327 -	5,123,226 <0.6%>	
<b>(ユーロ/フィンランド)</b>						
ELISA OYJ		134	145	610	99,865	電気通信サービス
FORTUM OYJ		414	445	565	92,420	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		252	271	465	76,083	生活必需品流通・小売り
KONE OYJ		314	337	1,395	228,267	資本財
METSO CORPORATION		613	658	596	97,522	資本財
NESTE OYJ		390	420	1,449	237,097	エネルギー
NOKIA OYJ		4,998	5,313	1,737	284,172	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ORION OYJ-CLASS B		98	107	402	65,866	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		443	456	1,774	290,135	保険
STORA ENSO OYJ		508	577	703	115,057	素材
UPM-KYMMENE OYJ		493	530	1,749	286,139	素材
WARTSILA OYJ		436	469	557	91,247	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,098 12	9,735 12	12,008 -	1,963,877 <0.2%>	
<b>(ユーロ/オーストリア)</b>						
ERSTE GROUP BANK AG		317	341	1,225	200,386	銀行
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A		62	67	577	94,524	公益事業
OMV AG		136	146	597	97,762	エネルギー
VOESTALPINE AG		106	115	301	49,304	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	623 4	670 4	2,702 -	441,978 <0.1%>	
<b>(ユーロ/その他)</b>						
AEGON LTD		1,654	1,674	831	135,919	保険
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		189	203	730	119,528	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,844 2	1,878 2	1,561 -	255,448 <0.0%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	169,971 222	178,770 222	462,124 -	75,575,875 <9.1%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,040,017 1,213	1,128,688 1,219	- -	780,690,036 <94.4%>	

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		
		□数	□数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(カナダ)</b>			千口	千口	千カナダ・ドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA			8	8	380	41,606
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR			14	15	267	29,258
小計	□数・金額	22	23	648	70,865	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>	
<b>(オーストラリア)</b>					千オーストラリア・ドル	
GPT GROUP		176	189	790	77,115	
GOODMAN GROUP		156	168	3,896	380,163	
STOCKLAND		220	236	943	92,088	
MIRVAC GROUP		364	391	802	78,273	
VICINITY CENTRES		356	383	710	69,313	
LENDLEASE GROUP		63	68	469	45,776	
SCENTRE GROUP		479	515	1,369	133,663	
DEXUS/AU		99	106	764	74,544	
小計	□数・金額	1,916	2,060	9,746	950,939	
	銘柄数<比率>	8	8	—	<0.1%>	
<b>(香港)</b>					千香港ドル	
LINK REIT		199	251	10,013	192,552	
小計	□数・金額	199	251	10,013	192,552	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
<b>(シンガポール)</b>					千シンガポール・ドル	
CAPITALAND ASCENDAS REIT		311	370	1,036	115,648	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		490	528	983	109,713	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		311	343	542	60,570	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR		217	235	325	36,305	
小計	□数・金額	1,330	1,478	2,888	322,238	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>	
<b>(イギリス)</b>					千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		81	—	—	—	
LAND SECURITIES GROUP PLC		65	70	457	85,405	
SEGRO PLC		111	115	952	177,792	
小計	□数・金額	257	185	1,409	263,197	
	銘柄数<比率>	3	2	—	<0.0%>	
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>					千ユーロ	
WAREHOUSES DE PAUW SCA		15	16	420	68,833	
小計	□数・金額	15	16	420	68,833	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	□数	□数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	千□	千□	千ユーロ	千円	
KLEPIERRE	19	21	492	80,601	
GECINA SA	4	4	454	74,317	
COVIVIO	4	5	226	36,969	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10	11	641	104,934	
小計	□数・金額	39	42	1,814	296,824
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
ユーロ計	□数・金額	54	59	2,235	365,657
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.0%>
合計	□数・金額	4,914	5,244	—	15,356,225
	銘柄数<比率>	58	56	—	<1.9%>

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

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

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

(注1) 外貨建ての評価額は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2023年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	780,690,036	94.2
投資信託証券	15,356,225	1.9
コール・ローン等、その他	32,982,118	4.0
投資信託財産総額	829,028,380	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル149.95円、1カナダ・ドル109.25円、1オーストラリア・ドル97.57円、1香港ドル19.23円、1シンガポール・ドル111.57円、1ニュージーランド・ドル89.96円、1イギリス・ポンド186.69円、1イスラエル・シケル40.328円、1スイス・フラン169.22円、1デンマーク・クローネ21.93円、1ノルウェー・クローネ13.87円、1スウェーデン・クローナ14.25円、1ユーロ163.54円です。

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

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

(注1) 期首元本額	205,978,181,520円
期中追加設定元本額	26,115,488,072円
期中一部解約元本額	11,275,206,507円
(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーフンド別内訳は、次の通りです。	
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	794,706,462円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,806,956,625円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,508,595,111円
ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)	2,154,739,003円
ニッセイインデックスバラス(債券重視) S A(適格機関投資家限定)	949,369円
ニッセイインデックスバラス(標準型) S A(適格機関投資家限定)	5,648,440円
ニッセイインデックスバラス(成長型) S A(適格機関投資家限定)	5,790,300円
ニッセイ外国株式インデックスA II(適格機関投資家限定)	326,433,259円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	158,220,790,915円
DCニッセイ外国株式インデックス	39,070,481,438円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	2,629,645,151円
DCニッセイターゲットデットファンド2055	395,039,390円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	177,542,196円
DCニッセイターゲットデットファンド2045	454,908,719円
DCニッセイターゲットデットファンド2035	677,865,953円
DCニッセイターゲットデットファンド2025	13,655,388円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	94,377,931円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	7,675,694円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式・リート)	10,219,362円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式・リート・債券)	3,714,441円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	21,299,634円
DCニッセイターゲットデットファンド2060	312,220,561円
DCニッセイターゲットデットファンド2050	199,356,481円
DCニッセイターゲットデットファンド2040	390,015,492円
DCニッセイターゲットデットファンド2030	184,195,638円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定)	161,299,099円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット)	253,851,314円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適格機関投資家限定)	162,468,312円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01(適格機関投資家限定)	159,155,707円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05(適格機関投資家限定)	158,496,026円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08(適格機関投資家限定)	141,595,628円
ニッセイ先進国株式インデックス(高成長ヘッジあり)(ラップ専用)	30,410,953円
ニッセイ先進国株式インデックス(高成長ヘッジなし)(ラップ専用)	6,069,453,038円
FWニッセイ先進国株式インデックス	56,059,397円
DCニッセイターゲットデットファンド2065	58,158,827円
ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンドⅡ2023-05(適格機関投資家限定)	100,296,022円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	395,809円

### 損益の状況

当期(2023年5月23日~2023年11月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>6,521,239,758円</b>
受 取 配 当 金	6,238,208,851
受 取 利 息	61,970,427
受 取 他 収 益	224,459,610
支 払 利 息	△ 3,399,130
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>98,381,228,951</b>
売 買 損 益	129,007,619,592
売 買 損 益	△ 30,626,390,641
<b>(C)先 物 取 引 等 損 益</b>	<b>1,018,859,721</b>
取 引 損 益	1,903,646,971
取 引 損 益	△ 884,787,250
<b>(D)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 63,394,060</b>
<b>(E)当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>105,857,934,370</b>
<b>(F)前期繰越損益金</b>	<b>462,865,060,071</b>
<b>(G)追加信託差損益金</b>	<b>65,902,196,199</b>
<b>(H)解約差損益金</b>	<b>△ 28,385,789,827</b>
<b>(I)合 計(E + F + G + H)</b>	<b>606,239,400,813</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(I)</b>	<b>606,239,400,813</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) (E)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。
- (注3) (H)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

# ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

## 運用報告書

### 第 7 期

(計算期間：2022年3月11日～2023年3月10日)

#### 運用方針

- ① 国内の公社債に投資し、NOMURA – 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

2022年3月11日～2023年3月10日

## 国内債券市況



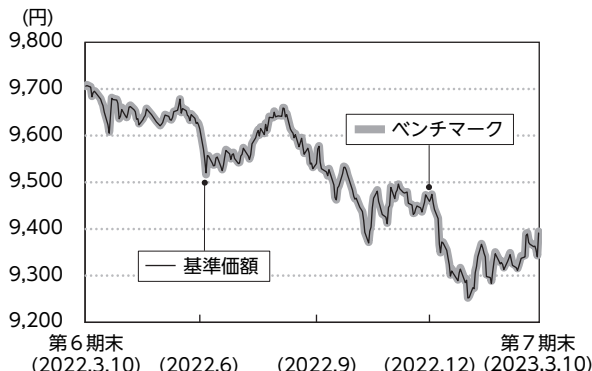
(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

10年国債金利は期を通じて見ると上昇しました。

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

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

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■ 基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

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

#### <下落要因>

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

## ポートフォリオ

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

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

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

## ベンチマークとの差異

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

## 今後の運用方針

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
3期(2019年3月11日)	9,828	1.5	9,825	1.4	99.2	91,526
4期(2020年3月10日)	9,979	1.5	9,970	1.5	99.3	82,399
5期(2021年3月10日)	9,774	△2.1	9,767	△2.0	99.2	80,558
6期(2022年3月10日)	9,706	△0.7	9,699	△0.7	99.2	78,005
7期(2023年3月10日)	9,391	△3.2	9,388	△3.2	99.4	66,191

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	債券 組入比率
		%		%	
(期首)2022年3月10日	円 9,706	% -	9,699	% -	% 99.2
3月末	9,680	△0.3	9,674	△0.3	99.3
4月末	9,657	△0.5	9,651	△0.5	99.2
5月末	9,643	△0.6	9,636	△0.6	99.1
6月末	9,553	△1.6	9,549	△1.6	99.2
7月末	9,615	△0.9	9,611	△0.9	99.2
8月末	9,594	△1.2	9,589	△1.1	99.1
9月末	9,492	△2.2	9,486	△2.2	99.2
10月末	9,481	△2.3	9,477	△2.3	99.2
11月末	9,434	△2.8	9,428	△2.8	99.1
12月末	9,310	△4.1	9,308	△4.0	99.2
2023年1月末	9,283	△4.4	9,282	△4.3	99.2
2月末	9,386	△3.3	9,383	△3.3	99.1
(期末)2023年3月10日	9,391	△3.2	9,388	△3.2	99.4

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2022年3月11日～2023年3月10日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	0円	0.000%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <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（9,511円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

## 売買および取引の状況

2022年3月11日～2023年3月10日

## 公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

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

## 主要な売買銘柄

2022年3月11日～2023年3月10日

## 公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

## 組入有価証券明細表

2023年3月10日現在

## 国内(邦貨建)公社債

区分	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	50,701,000	51,151,638	77.3	-	55.2	16.5	5.6
	(18,982,000)	(17,952,162)	(27.1)		(19.2)	(4.2)	(3.7)
地方債証券	3,568,000	3,660,443	5.5	-	4.4	0.5	0.7
	(3,568,000)	(3,660,443)	(5.5)		(4.4)	(0.5)	(0.7)
特殊債券 (除く金融債券)	4,944,100	5,065,603	7.7	-	5.5	1.4	0.8
	(4,944,100)	(5,065,603)	(7.7)		(5.5)	(1.4)	(0.8)
金融債券	600,000	599,343	0.9	-	-	0.8	0.2
	(600,000)	(599,343)	(0.9)			(0.8)	(0.2)
社債券	5,300,000	5,306,786	8.0	-	1.4	4.1	2.6
	(5,300,000)	(5,306,786)	(8.0)		(1.4)	(4.1)	(2.6)
合計	65,113,100	65,783,815	99.4	-	66.5	23.1	9.8
	(33,394,100)	(32,584,339)	(49.2)		(30.5)	(10.8)	(7.9)

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

(注2) ( )内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(国内公社債の内訳)

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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



## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

### 投資信託財産の構成

2023年3月10日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。



## ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年3月10日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>66,219,439,587円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	235,628,795
公 社 債 (評価額)	65,783,815,052
未 収 利 息	193,844,712
前 払 費 用	6,151,028
<b>(B)負債</b>	<b>27,573,877</b>
未 払 解 約 金	27,572,838
そ の 他 未 払 費 用	1,039
<b>(C)純 資 産 総 額 (A - B)</b>	<b>66,191,865,710</b>
元 本	70,484,284,906
次 期 繰 越 損 益 金	△ 4,292,419,196
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>70,484,284,906口</b>
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	<b>9,391円</b>

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

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

ニッセイ国内債券パッシブDB (適格機関投資家限定)

51,084,508,245円
DCニッセイ日本債券インデックス 4,376,565,929円
DCニッセイターゲットデットファンド2055 184,254,353円
DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型) 7,128,880,475円
DCニッセイターゲットデットファンド2045 349,794,886円
DCニッセイターゲットデットファンド2035 2,006,258,528円
DCニッセイターゲットデットファンド2025 1,778,441,326円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス
バランスファンド (6資産均等型) 305,813,488円
ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート/債券) 32,647,069円
ニッセイ・インデックスパッケージ (国内・株式/リート/債券) 102,108,625円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス
バランスファンド (8資産均等型) 70,746,283円
DCニッセイターゲットデットファンド2060 95,997,486円
DCニッセイターゲットデットファンド2050 121,545,116円
DCニッセイターゲットデットファンド2040 444,032,744円
DCニッセイターゲットデットファンド2030 2,365,333,858円
FWニッセイ国内債インデックス 31,516,014円
DCニッセイターゲットデットファンド2065 5,840,481円

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

### 損益の状況

当期 (2022年3月11日~2023年3月10日)

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

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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



# ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 34 期

(計算期間：2023年5月23日～2023年11月20日)

運用方針	主に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
	主に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	日本を除く主要国の国債
運用方法	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 <ul style="list-style-type: none"><li>・ 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。</li><li>・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li></ul>



ニッセイアセットマネジメント株式会社

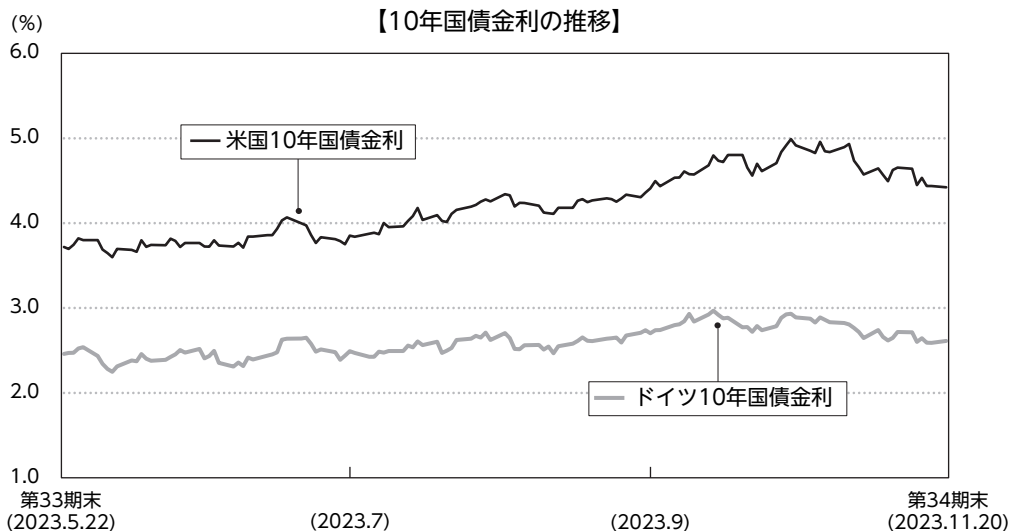
東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2023年5月23日～2023年11月20日

## 投資環境

### 海外債券市況

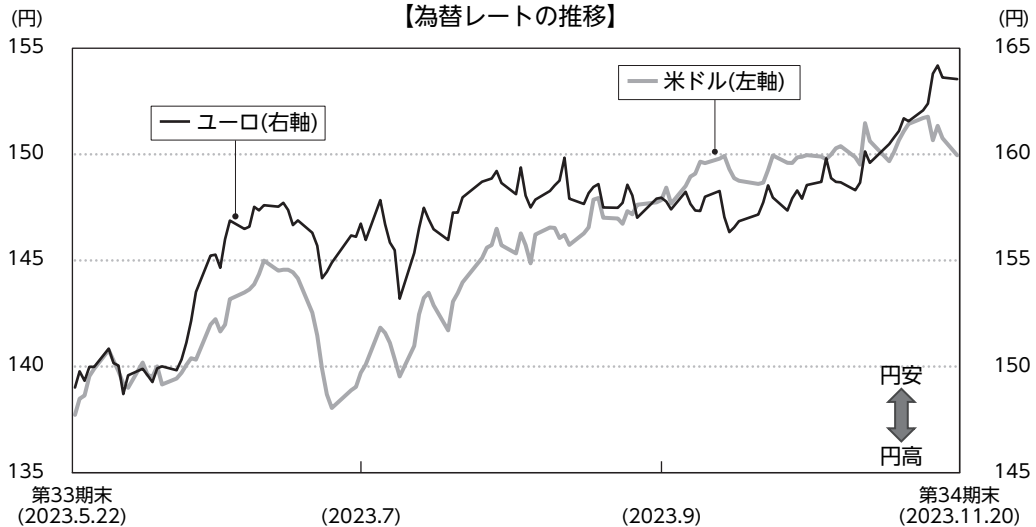


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

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

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

## ■為替市況

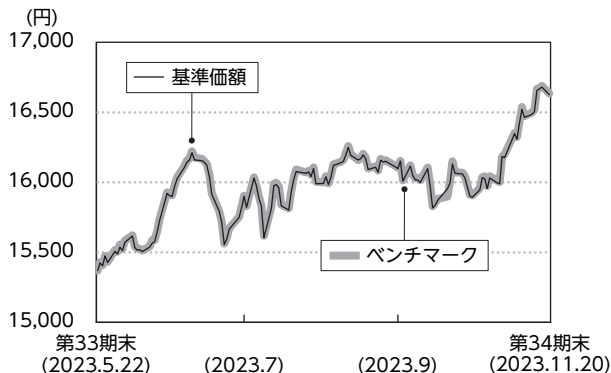


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

### ■基準価額の主な変動要因

#### <上昇要因>

- ・ 期初から6月にかけて、米金融政策が利上げ方向であった一方で、国内においては金融緩和を維持したことから日米金利差が拡大し大幅な米ドル高円安基調となったこと

#### <下落要因>

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

## ポートフォリオ

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

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+8.2%となり、ベンチマーク騰落率 (+8.2%) に連動しました。

## 今後の運用方針

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	債券組入比率	純資産総額
30期(2021年11月22日)	15,210	2.5	15,395	2.6	99.2	46,402
31期(2022年5月20日)	14,990	△1.4	15,179	△1.4	99.1	50,588
32期(2022年11月21日)	15,301	2.1	15,493	2.1	99.0	56,285
33期(2023年5月22日)	15,369	0.4	15,569	0.5	99.0	61,820
34期(2023年11月20日)	16,626	8.2	16,850	8.2	98.9	72,121

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

## 当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	債券組入比率
(期首)2023年5月22日	15,369	—	15,569	—	99.0
5月末	15,536	1.1	15,757	1.2	99.1
6月末	16,160	5.1	16,386	5.2	98.9
7月末	15,811	2.9	16,028	3.0	99.2
8月末	16,249	5.7	16,470	5.8	98.9
9月末	15,998	4.1	16,224	4.2	99.2
10月末	15,990	4.0	16,209	4.1	99.0
(期末)2023年11月20日	16,626	8.2	16,850	8.2	98.9

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	3円	0.018%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.018)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <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	0.018	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（15,977円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

## 売買および取引の状況

2023年5月23日～2023年11月20日

## 公社債

		買付額	売付額
アメリカ	国債証券	千米ドル	千米ドル
		45,934	31,181
カナダ	国債証券	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル
		2,352	1,575
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
		809	149
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
		363	227
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
		318	142
イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド
		3,209	677
イスラエル	国債証券	千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル
		765	-
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
		1,154	494
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
		1,358	153
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
		769	109
メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ
		12,620	9,652
中国	国債証券	千人民元	千人民元
		95,906	11,808
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
		1,343	898
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
		1,656	1,027
ユーロ	国債証券	千ユーロ	千ユーロ
		179	99
		728	566
		957	892
		4,686	1,961
		4,705	2,969
		2,717	1,872
		4,114	2,597
		330	133
681	608		

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2023年5月23日～2023年11月20日

公社債

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

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2023年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	261,780	227,170	34,064,156	47.2	—	19.2	17.6	10.4
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	14,150	12,794	1,397,794	1.9	—	1.0	0.4	0.5
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア	12,140	10,689	1,042,944	1.4	—	1.0	0.3	0.1
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	2,890	2,782	310,487	0.4	—	0.3	0.1	0.1
	千ニューージーランド・ドル	千ニューージーランド・ドル						
ニューージーランド	2,140	1,849	166,401	0.2	—	0.1	0.1	0.0
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	23,780	19,415	3,624,647	5.0	—	3.6	0.9	0.6
	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル						
イスラエル	6,010	5,511	222,259	0.3	—	0.1	0.1	0.1



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

区分	当期末								
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 11,260	千デンマーク・クローネ 10,387	千円 227,799	% 0.3	% -	% 0.2	% 0.0	% 0.1	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 9,770	千ノルウェー・クローネ 9,006	124,924	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 10,890	千スウェーデン・クローナ 10,268	146,325	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 82,270	千メキシコ・ペソ 75,107	653,762	0.9	-	0.5	0.3	0.1	
中国	千人民元 241,970	千人民元 243,949	5,063,949	7.0	-	3.1	2.8	1.2	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 11,450	千マレーシア・リンギット 11,601	371,431	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 10,660	千ポーランド・ズロチ 9,821	366,007	0.5	-	0.2	0.3	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
	アイルランド	2,930	2,530	413,911	0.6	-	0.4	0.1	0.1
	オランダ	7,360	6,591	1,078,018	1.5	-	0.9	0.5	0.1
	ベルギー	8,590	7,693	1,258,182	1.7	-	1.2	0.5	0.1
	フランス	40,920	36,907	6,035,786	8.4	-	5.0	2.4	0.9
	ドイツ	30,720	28,173	4,607,563	6.4	-	3.4	2.1	0.9
	スペイン	23,770	21,775	3,561,212	4.9	-	2.8	1.5	0.7
	イタリア	35,540	32,922	5,384,213	7.5	-	4.1	2.3	1.1
	フィンランド	2,670	2,269	371,179	0.5	-	0.3	0.2	0.1
	オーストリア	5,890	5,150	842,327	1.2	-	0.7	0.4	0.1
合計	-	-	71,335,288	98.9	-	48.6	33.1	17.2	

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

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

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

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千円	千円	
オーストラリア			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.5000	2026/09/21	550	497	48,558
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	490	500	48,812
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	400	380	37,104
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	350	323	31,556
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	320	300	29,276
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	440	420	41,017
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2029/11/21	410	378	36,913
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5000	2030/05/21	510	459	44,811
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2030/12/21	440	351	34,318
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/06/21	540	441	43,052
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2031/11/21	690	533	52,070
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.2500	2032/05/21	640	497	48,554
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2032/11/21	600	481	46,941
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	530	532	51,912
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2033/11/21	500	441	43,064
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2034/05/21	420	394	38,509
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.5000	2034/12/21	360	328	32,098
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	300	252	24,638
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/04/21	270	247	24,123
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	230	193	18,891
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2041/05/21	320	244	23,810
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	310	231	22,561
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2051/06/21	430	230	22,447
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2054/06/21	150	149	14,540
小計			-	-	-	1,042,944
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/06/01	220	216	24,135
	SINGAPORE GOVERNMENT	0.5000	2025/11/01	170	161	17,964
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/06/01	160	155	17,387
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.2500	2026/11/01	130	123	13,742
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	210	212	23,741
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2027/09/01	70	69	7,794
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2028/05/01	140	138	15,408
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2028/08/01	60	59	6,672
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	160	159	17,785
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	200	198	22,175
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.6250	2031/07/01	120	109	12,170
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2032/08/01	120	116	13,040

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千シンガポール・ドル	千円
シンガポール		%		千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	200	206	23,089
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	180	166	18,556
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2039/07/01	120	111	12,402
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	120	116	13,001
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	160	153	17,155
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2050/03/01	140	112	12,495
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2051/10/01	100	80	9,004
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2072/08/01	110	114	12,763
小計		-	-	-	-	310,487
ニュージーランド				千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	
国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2025/04/15	240	232	20,903
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	0.5000	2026/05/15	290	261	23,480
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5000	2027/04/15	80	79	7,145
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	0.2500	2028/05/15	140	115	10,346
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.0000	2029/04/20	250	229	20,657
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5000	2030/05/15	110	108	9,746
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.5000	2031/05/15	140	111	9,993
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.0000	2032/05/15	180	144	13,019
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.5000	2033/04/14	270	242	21,786
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.2500	2034/05/15	90	85	7,657
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2037/04/15	130	100	9,080
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.7500	2041/05/15	100	61	5,504
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.7500	2051/05/15	120	78	7,078
	小計		-	-	-	-
イギリス				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	
国債証券	UK TREASURY	0.2500	2025/01/31	680	645	120,507
	UK TREASURY	5.0000	2025/03/07	390	391	73,144
	UK TREASURY	0.6250	2025/06/07	340	320	59,892
	UK TREASURY	2.0000	2025/09/07	310	296	55,431
	UK TREASURY	3.5000	2025/10/22	650	637	119,061
	UK TREASURY	0.1250	2026/01/30	340	311	58,132
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	360	335	62,716
	UK TREASURY	0.3750	2026/10/22	590	528	98,730
	UK TREASURY	4.1250	2027/01/29	710	707	132,172
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	330	298	55,795
	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	330	332	62,027
	UK TREASURY	0.1250	2028/01/31	340	289	54,014
	UK TREASURY	4.5000	2028/06/07	290	294	55,018



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						千円	邦貨換算金額
イギリス		%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
国債証券	UK TREASURY	4.0000	2060/01/22	300	276	51,676	
	UK TREASURY	0.5000	2061/10/22	470	141	26,424	
	UK TREASURY	4.0000	2063/10/22	230	211	39,490	
	UK TREASURY	2.5000	2065/07/22	350	225	42,118	
	UK TREASURY	3.5000	2068/07/22	350	291	54,459	
	UK TREASURY	1.6250	2071/10/22	310	146	27,304	
	UK TREASURY	1.1250	2073/10/22	220	81	15,279	
	小計		-	-	-	-	3,624,647
イスラエル				千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル		
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	0.4000	2024/10/31	300	290	11,719	
	ISRAEL FIXED BOND	0.5000	2025/04/30	520	497	20,044	
	ISRAEL FIXED BOND	1.7500	2025/08/31	630	609	24,576	
	ISRAEL FIXED BOND	0.5000	2026/02/27	420	390	15,755	
	ISRAEL FIXED BOND	6.2500	2026/10/30	330	352	14,212	
	ISRAEL FIXED BOND	2.0000	2027/03/31	560	534	21,574	
	ISRAEL FIXED BOND	2.2500	2028/09/28	520	482	19,454	
	ISRAEL FIXED BOND	3.7500	2029/02/28	180	181	7,327	
	ISRAEL FIXED BOND	1.0000	2030/03/31	530	442	17,831	
	ISRAEL FIXED BOND	1.3000	2032/04/30	360	288	11,615	
	ISRAEL FIXED BOND	1.5000	2037/05/31	480	333	13,460	
	ISRAEL FIXED BOND	5.5000	2042/01/31	430	489	19,733	
	ISRAEL FIXED BOND	3.7500	2047/03/31	560	486	19,604	
	ISRAEL FIXED BOND	2.8000	2052/11/29	190	132	5,350	
小計		-	-	-	-	222,259	
デンマーク				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	0.0000	2024/11/15	1,400	1,355	29,717	
	KINGDOM OF DENMARK	1.7500	2025/11/15	1,370	1,338	29,348	
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2027/11/15	1,450	1,333	29,244	
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2029/11/15	1,250	1,102	24,172	
	KINGDOM OF DENMARK	0.0000	2031/11/15	1,550	1,251	27,439	
	KINGDOM OF DENMARK	2.2500	2033/11/15	640	608	13,340	
	KINGDOM OF DENMARK	4.5000	2039/11/15	2,330	2,778	60,925	
	KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2052/11/15	1,270	620	13,610	
小計		-	-	-	-	227,799	
ノルウェー				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2025/03/13	1,350	1,310	18,175	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/02/19	1,070	1,015	14,089	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2027/02/17	1,060	994	13,797	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						邦貨換算金額	
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	千円	
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/04/26	850	792	10,986	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2029/09/06	940	848	11,770	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.3750	2030/08/19	1,240	1,074	14,901	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.2500	2031/09/17	880	739	10,252	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.1250	2032/05/18	920	819	11,360	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0000	2033/08/15	1,020	965	13,394	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.5000	2042/10/06	440	446	6,197	
小計		-	-	-	-	124,924	
スウェーデン				千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ		
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	2.5000	2025/05/12	1,780	1,758	25,055	
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0000	2026/11/12	1,850	1,752	24,967	
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2028/05/12	1,610	1,480	21,091	
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2029/11/12	1,530	1,373	19,575	
	SWEDISH GOVERNMENT	0.1250	2031/05/12	1,220	1,016	14,482	
	SWEDISH GOVERNMENT	2.2500	2032/06/01	1,110	1,077	15,348	
	SWEDISH GOVERNMENT	1.7500	2033/11/11	830	765	10,910	
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	960	1,045	14,894	
小計		-	-	-	-	146,325	
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/05	4,840	4,801	41,794	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0000	2025/03/06	3,200	3,006	26,170	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	9,850	9,047	78,754	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.0000	2026/09/03	2,000	1,872	16,303	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5000	2027/03/04	8,020	7,122	61,997	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	7,620	7,158	62,313	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/03/01	1,050	1,016	8,846	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	6,240	6,023	52,433	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	9,310	8,503	74,020	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2033/05/26	4,950	4,363	37,979	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	2,120	1,883	16,392	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2035/05/24	600	542	4,720	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	1,650	1,721	14,983	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	4,810	4,418	38,463	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	6,670	5,632	49,023	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	5,840	5,007	43,589	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2053/07/31	3,500	2,984	25,974	
小計		-	-	-	-	653,762	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千人民元	千円
中国		%		千人民元	千人民元	千円
国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.8100	2050/09/14	1,200	1,372	28,486
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.7200	2051/04/12	1,260	1,419	29,469
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.5300	2051/10/18	3,650	4,006	83,162
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.3200	2052/04/15	5,400	5,704	118,408
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.1200	2052/10/25	5,800	5,887	122,208
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.1900	2053/04/15	7,900	8,262	171,521
小計		-	-	-	-	5,063,949
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8820	2025/03/14	340	342	10,960
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/09/15	680	685	21,947
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/04/15	360	366	11,742
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9060	2026/07/15	250	252	8,083
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9000	2026/11/30	370	373	11,943
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/03/15	610	615	19,705
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8990	2027/11/16	530	535	17,133
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/06/15	550	550	17,615
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.5040	2029/04/30	160	165	5,283
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8850	2029/08/15	440	440	14,109
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/04/15	490	507	16,250
	MALAYSIA GOVERNMENT	2.6320	2031/04/15	340	312	9,995
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	380	387	12,399
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.5820	2032/07/15	390	379	12,138
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	410	408	13,065
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.6420	2033/11/07	340	361	11,583
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8280	2034/07/05	460	451	14,470
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/05/31	320	326	10,447
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	590	630	20,198
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.8930	2038/06/08	500	545	17,480
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7570	2040/05/22	540	507	16,259
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.6960	2042/10/15	420	445	14,255
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	190	206	6,603
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	240	252	8,078
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9210	2048/07/06	360	389	12,460
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.0650	2050/06/15	610	579	18,555
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4570	2053/03/31	240	244	7,825
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.5020	2027/05/31	340	338	10,840
小計		-	-	-	-	371,431

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/06/22	210	205	33,592
	BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	440	509	83,244
	BELGIUM KINGDOM	1.4500	2037/06/22	150	118	19,304
	BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/06/22	190	155	25,471
	BELGIUM KINGDOM	2.7500	2039/04/22	120	109	17,844
	BELGIUM KINGDOM	0.4000	2040/06/22	200	121	19,857
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/03/28	370	402	65,744
	BELGIUM KINGDOM	3.4500	2043/06/22	90	87	14,298
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/06/22	220	223	36,494
	BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/06/22	240	162	26,573
	BELGIUM KINGDOM	1.7000	2050/06/22	250	166	27,238
	BELGIUM KINGDOM	1.4000	2053/06/22	240	142	23,237
	BELGIUM KINGDOM	3.3000	2054/06/22	210	192	31,539
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2057/06/22	160	117	19,136
	BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/06/22	200	139	22,819
	BELGIUM KINGDOM	0.6500	2071/06/22	140	53	8,744
小計		-	-	-	-	1,258,182
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	800	786	128,581
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2025/02/25	700	671	109,881
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2025/03/25	1,070	1,025	167,654
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/05/25	1,020	980	160,341
	FRANCE (GOVT OF)	6.0000	2025/10/25	630	664	108,637
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	830	797	130,418
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2026/02/25	1,010	944	154,543
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/04/25	980	991	162,227
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/05/25	1,110	1,044	170,840
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2026/09/24	930	918	150,207
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	880	813	133,039
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2027/02/25	900	820	134,117
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2027/05/25	900	844	138,066
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	1,230	1,224	200,299
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/02/25	1,010	925	151,289
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/05/25	1,380	1,258	205,779
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/11/25	1,310	1,182	193,417
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2029/02/25	610	605	99,034
	FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/04/25	880	993	162,434



ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ					
国債証券					
BUNDESobligation	0.0000	2026/10/09	530	490	80,240
BUNDESobligation	0.0000	2027/04/16	490	448	73,393
BUNDESobligation	1.3000	2027/10/15	190	181	29,677
BUNDESobligation	1.3000	2027/10/15	650	620	101,478
BUNDESobligation	2.2000	2028/04/13	550	542	88,675
BUNDESobligation	2.4000	2028/10/19	500	497	81,300
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/02/15	680	657	107,560
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	640	618	101,097
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	750	712	116,481
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	720	669	109,434
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	650	602	98,554
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2027/08/15	720	668	109,259
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2027/11/15	490	443	72,536
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2028/02/15	640	588	96,305
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2028/08/15	630	567	92,882
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2028/11/15	600	531	86,882
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2029/02/15	620	553	90,526
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2029/08/15	650	565	92,491
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.1000	2029/11/15	570	557	91,194
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/01/04	260	315	51,549
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/02/15	610	524	85,774
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	210	178	29,213
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	720	611	100,028
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.4000	2030/11/15	180	178	29,214
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/02/15	620	519	84,984
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/08/15	200	165	27,074
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2031/08/15	710	587	96,097
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2032/02/15	670	546	89,407
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7000	2032/08/15	620	580	94,942
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.3000	2033/02/15	140	137	22,449
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.3000	2033/02/15	850	833	136,235
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.6000	2033/08/15	480	480	78,605
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/07/04	540	645	105,497
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2035/05/15	500	369	60,360
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2036/05/15	570	407	66,656
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	610	693	113,353
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2038/05/15	450	354	58,006

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>ドイツ</b>						
<b>国債証券</b>	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	420	495	81,043
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	470	589	96,451
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	420	444	72,686
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	660	626	102,415
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	690	653	106,927
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	810	590	96,604
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	220	107	17,540
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	870	421	68,995
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2052/08/15	600	275	45,023
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8000	2053/08/15	100	80	13,118
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8000	2053/08/15	530	424	69,379
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.2000	2024/12/12	190	187	30,690
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.5000	2025/03/13	390	386	63,179
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.8000	2025/06/12	400	397	65,051
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	3.1000	2025/09/18	370	370	60,554
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	3.1000	2025/12/12	50	50	8,200
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	300	339	55,485
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	380	425	69,556
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	300	328	53,796
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	480	573	93,717
	小計	-	-	-	-	4,607,563
<b>スペイン</b>						
<b>国債証券</b>	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	510	505	82,735
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2025/01/31	480	460	75,378
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/04/30	490	477	78,122
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2025/05/31	530	503	82,370
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/07/30	430	439	71,833
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	600	588	96,217
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2026/01/31	470	438	71,697
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	510	495	81,001
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.8000	2026/05/31	480	475	77,709
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	530	566	92,582
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	620	588	96,179
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2027/01/31	480	434	71,051
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	570	539	88,257
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2027/07/30	510	468	76,647
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	560	525	85,895

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン					
国債証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2028/01/31	600	526	86,146
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/04/30	620	575	94,126
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/07/30	540	499	81,658
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	450	490	80,192
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/01/31	590	668	109,392
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2029/04/30	470	429	70,280
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.5000	2029/05/31	80	81	13,262
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2029/07/30	590	516	84,472
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6000	2029/10/31	540	464	75,930
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2030/04/30	550	463	75,763
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/07/30	530	488	79,884
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2500	2030/10/31	540	472	77,261
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.1000	2031/04/30	540	426	69,755
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2031/10/31	490	392	64,259
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7000	2032/04/30	520	417	68,280
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/07/30	540	633	103,593
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.5500	2032/10/31	500	464	76,032
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.1500	2033/04/30	540	523	85,609
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.3500	2033/07/30	440	397	65,025
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.5500	2033/10/31	480	478	78,258
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.8500	2035/07/30	490	404	66,173
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/01/31	500	520	85,104
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8500	2037/07/30	320	218	35,706
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.9000	2039/07/30	190	187	30,725
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/07/30	450	498	81,455
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2000	2040/10/31	440	289	47,289
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/07/30	470	510	83,539
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0000	2042/07/30	230	139	22,775
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2043/07/30	210	191	31,325
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	350	402	65,787
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	440	361	59,166
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7000	2048/10/31	400	311	50,972
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0000	2050/10/31	500	248	40,707
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9000	2052/10/31	370	228	37,414
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/07/30	320	268	43,965
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2071/10/31	170	74	12,236
小計	-	-	-	-	3,561,212

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア					
国債証券					
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.1000	2029/02/01	100	101	16,623
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.4500	2029/02/15	360	304	49,813
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2029/06/15	350	333	54,465
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0000	2029/08/01	510	490	80,215
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/01	680	732	119,854
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2029/12/15	410	410	67,080
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/03/01	600	589	96,390
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2030/04/01	500	430	70,328
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7000	2030/06/15	310	306	50,091
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2030/08/01	420	347	56,850
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2030/11/15	120	120	19,677
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2030/12/01	520	447	73,154
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9000	2031/04/01	540	435	71,213
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/05/01	700	792	129,648
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6000	2031/08/01	470	365	59,750
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2031/10/30	220	219	35,947
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2031/12/01	460	363	59,493
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/03/01	550	458	74,952
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2032/06/01	460	357	58,463
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2032/12/01	400	351	57,470
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/02/01	540	605	98,958
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.4000	2033/05/01	470	477	78,152
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2033/09/01	440	378	61,949
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.3500	2033/11/01	440	443	72,540
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2000	2034/03/01	160	158	25,951
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/08/01	590	623	101,928
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.3500	2035/03/01	350	317	51,923
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2035/04/30	250	241	39,539
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2036/03/01	290	208	34,108
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/09/01	380	298	48,865
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/02/01	690	657	107,509
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2037/03/01	380	247	40,452
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2038/03/01	230	198	32,391
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.9500	2038/09/01	330	273	44,661
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/08/01	560	582	95,259
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1000	2040/03/01	320	264	43,204
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/09/01	510	529	86,618

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8000	2041/03/01	340	226	37,035
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.4500	2043/09/01	200	192	31,507
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/09/01	410	411	67,283
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2045/04/30	300	174	28,507
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/09/01	390	313	51,210
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/03/01	420	305	49,946
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2048/03/01	400	329	53,940
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2049/09/01	340	296	48,515
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2050/09/01	320	213	34,948
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7000	2051/09/01	330	183	30,075
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2052/09/01	200	121	19,856
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2053/10/01	180	171	28,075
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/03/01	210	138	22,650
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2072/03/01	110	60	9,815
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/01	220	242	39,702
小計		-	-	-	-	5,384,213
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/07/04	100	101	16,554
	FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/09/15	140	134	22,012
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/04/15	140	132	21,638
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2026/09/15	90	82	13,567
	FINNISH GOVERNMENT	1.3750	2027/04/15	100	95	15,555
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2027/09/15	150	137	22,463
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/07/04	120	119	19,533
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2028/09/15	150	133	21,902
	FINNISH GOVERNMENT	2.8750	2029/04/15	70	69	11,427
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2029/09/15	150	130	21,423
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2030/09/15	130	106	17,415
	FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/04/15	110	93	15,358
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2031/09/15	140	112	18,326
	FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2032/09/15	130	114	18,707
	FINNISH GOVERNMENT	3.0000	2033/09/15	110	108	17,794
	FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2034/04/15	100	82	13,449
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2036/04/15	110	74	12,253
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2038/04/15	90	83	13,689
	FINNISH GOVERNMENT	0.2500	2040/09/15	90	54	8,925
	FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/07/04	120	108	17,700

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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



## 投資信託財産の構成

2023年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	71,335,288	98.5
コール・ローン等、その他	1,073,573	1.5
投資信託財産総額	72,408,861	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル149.95円、1カナダ・ドル109.25円、1オーストラリア・ドル97.57円、1シンガポール・ドル111.57円、1ニュージーランド・ドル89.96円、1イギリス・ポンド186.69円、1イスラエル・シケル40.328円、1デンマーク・クローネ21.93円、1ノルウェー・クローネ13.87円、1スウェーデン・クローナ14.25円、1メキシコ・ペソ8,704円、1人民元20,758円、1マレーシア・リンギット32,015円、1ポーランド・ズロチ37,264円、1ユーロ163.54円です。

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

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

(注1)	期首元本額	40,223,772,028円
	期中追加設定元本額	6,712,335,044円
	期中一部解約元本額	3,557,146,909円
(注2)	当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパーファンド別内訳は、次の通りです。	
	DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	3,461,059,032円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	6,218,098,531円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,547,097,324円
	ニッセイ外国債券インデックスS A(適格機関投資家限定)	912,607,004円
	ニッセイインデックスバランス(債券重視型)	
	S A(適格機関投資家限定)	2,067,561円
	ニッセイインデックスバランス(標準型)	
	S A(適格機関投資家限定)	6,149,747円
	ニッセイインデックスバランス(成長型)	
	S A(適格機関投資家限定)	4,503,470円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ外国債券インデックスファンド	15,831,877,263円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	5,727,201,586円
	DCニッセイ外国債券インデックス	4,257,065,641円
	DCニッセイターゲットデートファンド2055	293,816,747円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,933,271,698円
	DCニッセイターゲットデートファンド2045	341,078,933円
	DCニッセイターゲットデートファンド2035	552,481,112円
	DCニッセイターゲットデートファンド2025	64,415,551円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	205,521,429円
	ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	20,223,791円
	＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	46,373,044円
	DCニッセイターゲットデートファンド2060	229,109,652円
	DCニッセイターゲットデートファンド2050	148,732,633円
	DCニッセイターゲットデートファンド2040	297,949,699円
	DCニッセイターゲットデートファンド2030	198,032,837円
	FWニッセイ外国債券インデックス	37,526,371円
	DCニッセイターゲットデートファンド2065	42,699,507円

### 損益の状況

当期(2023年5月23日~2023年11月20日)

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

# ニッセイマネーマーケット マザーファンド

## 運用報告書

### 第 24 期

(計算期間：2023年4月18日～2023年10月16日)

#### 運用方針

- ① 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。
- ② 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### 主要運用 対象

円建ての短期公社債および短期金融商品

#### 運用方法

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。



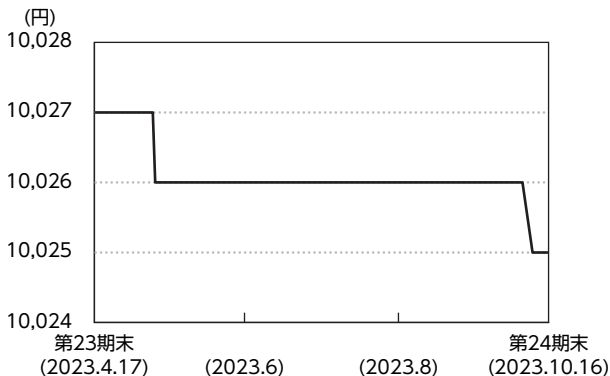
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

## 運用経過

2023年4月18日～2023年10月16日

### 基準価額等の推移



#### ■ 基準価額の主な変動要因

<下落要因>

- ・前期末以降、無担保コールレート翌日物のマイナス金利等が影響したこと

(注) 当マザーファンドはベンチマークを設けていません。

### ポートフォリオ

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。

### ベンチマークとの差異

当マザーファンドは、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て運用を行うことから、コンセプトに適った指数が存在しないため、ベンチマークなどを設けていません。

## 今後の運用方針

当マザーファンドは、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。

今後も引き続き、安定した収益確保のため、短期証券を中心に投資していく方針です。

## お知らせ

#### ■ 約款変更

デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、関連条項に所要の変更を行いました。

(2023年7月26日)

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		
	円	%	%	百万円
20期(2021年10月15日)	10,030	0.0	69.5	50
21期(2022年4月15日)	10,029	△0.0	69.5	50
22期(2022年10月17日)	10,029	0.0	79.4	50
23期(2023年4月17日)	10,027	△0.0	89.9	706
24期(2023年10月16日)	10,025	△0.0	82.1	720

## 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	債券 組入比率
	円	%	%
(期首)2023年4月17日	10,027	—	89.9
4月末	10,027	0.0	89.3
5月末	10,026	△0.0	66.3
6月末	10,026	△0.0	63.0
7月末	10,026	△0.0	72.3
8月末	10,026	△0.0	81.1
9月末	10,026	△0.0	81.2
(期末)2023年10月16日	10,025	△0.0	82.1

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2023年4月18日～2023年10月16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)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	0	0.000	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（10,026円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

## 売買および取引の状況

2023年4月18日～2023年10月16日

## 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	地方債証券	322,340	— (165,000)
	特殊債券	—	— (200,000)

(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

2023年4月18日～2023年10月16日

## 公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
平成26年度第4回 京都府公募公債	100,628	—	—
平成25年度第11回 埼玉県公募公債	86,450		
第727回 東京都公募公債	79,257		
令和元年度第1回 長崎県公募公債	56,004		

(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。

# ニッセイマネーマーケットマザーファンド

## 組入有価証券明細表

2023年10月16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	14,000 ( 14,000)	14,001 ( 14,001)	1.9 ( 1.9)	—	—	—	—	1.9 ( 1.9)
地方債証券	476,000 (476,000)	477,237 (477,237)	66.3 (66.3)	—	—	—	—	66.3 (66.3)
特殊債券 (除く金融債券)	100,000 (100,000)	100,030 (100,030)	13.9 (13.9)	—	—	—	—	13.9 (13.9)
合計	590,000 (590,000)	591,269 (591,269)	82.1 (82.1)	—	—	—	—	82.1 (82.1)

(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。

### (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1121回 国庫短期証券	—	2023/11/20	14,000	14,001
	小計	—	—	—	14,001
地方債証券	第727回 東京都公募公債	0.7200	2023/12/20	79,000	79,100
	平成26年度第4回 京都府公募公債	0.6640	2024/ 6 /20	100,000	100,454
	平成25年度第11回 埼玉県公募公債	0.6550	2024/ 3 /26	86,000	86,244
	第132回 共同発行市場公募地方債	0.6600	2024/ 3 /25	155,000	155,435
	令和元年度第1回 長崎県公募公債	0.0100	2024/ 6 /26	56,000	56,003
	小計	—	—	—	477,237
特殊債券 (除く金融債券)	第202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.6990	2023/10/31	100,000	100,030
	小計	—	—	—	100,030
	合計	—	—	—	591,269

## 投資信託財産の構成

2023年10月16日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	591,269	82.0
コール・ローン等、その他	130,227	18.0
投資信託財産総額	721,496	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

# ニッセイマネーマーケットマザーファンド

## 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年10月16日現在)

項目	当期末
(A)資産	721,496,958円
コ ー ル ・ ロ ー ン 債 (評価額)	129,585,003
公 社 債 (評価額)	591,269,516
未 収 利 息	590,905
前 払 費 用	51,534
(B)負債	1,163,467
未 払 解 約 金	1,163,365
そ の 他 未 払 費 用	102
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	720,333,491
元 本	718,501,875
次 期 繰 越 損 益 金	1,831,616
(D)受 益 権 総 口 数	718,501,875口
1万口当たり基準価額 (C / D)	10,025円

(注1) 期首元本額 704,956,153円  
 期中追加設定元本額 104,036,090円  
 期中一部解約元本額 90,490,368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。

ニッセイグローバル好配当株式プラス (毎月決算型)	10,000円
ニッセイマネーマーケットファンド (適格機関投資家限定)	49,952,497円
ニッセイ豪州ハイ・インカム株式ファンド (毎月決算型)	9,994円
ニッセイアメリカ高配当株ファンド (毎月決算型)	9,984円
ニッセイアメリカ高配当株ファンド (年2回決算型)	9,984円
ニッセイ世界高配当株ファンド (毎月決算型)	9,984円
ニッセイ世界高配当株ファンド (年2回決算型)	9,984円
ニッセイ世界ハイリッド証券戦略ファンド (毎月決算型・通貨プレミアムコース)	9,977円
ニッセイ世界ハイリッド証券戦略ファンド (毎月決算型・為替ヘッジありコース)	9,977円
ニッセイ世界ハイリッド証券戦略ファンド (毎月決算型・為替ヘッジなしコース)	9,977円
J P X 日経400アクティブ・オープン米ドル投資型	9,976円
J P X 日経400アクティブ・プレミアム・オープン (毎月決算型)	9,976円
ニッセイ・オーストラリア・リート・オープン (毎月決算型)	9,974円
ニッセイ・オーストラリア・リート・オープン (年2回決算型)	9,974円
ニッセイ/MF S 外国株低ボラティリティ運用ファンド	9,967円
ニッセイ A I 関連株式ファンド (為替ヘッジあり)	9,967円
ニッセイ A I 関連株式ファンド (為替ヘッジなし)	9,967円
ニッセイ豪州ハイ・インカム株式ファンド (資産成長型)	9,968円
D C ニッセイターゲットデットファンド 2 0 2 5	668,110,536円
ニッセイ/コムジスト新興国成長株ファンド (資産成長型)	9,969円
ニッセイ/コムジスト新興国成長株ファンド (年2回決算型)	9,969円
ニッセイ A I 関連株式ファンド (年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,969円
ニッセイ A I 関連株式ファンド (年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,969円
ニッセイ/T CW 債券戦略ファンド (3ヵ月決算型・為替ヘッジあり)	9,969円
ニッセイ/T CW 債券戦略ファンド (3ヵ月決算型・為替ヘッジなし)	9,969円
ニッセイ/T CW 債券戦略ファンド (資産成長型・為替ヘッジあり)	9,969円
ニッセイ/T CW 債券戦略ファンド (資産成長型・為替ヘッジなし)	9,969円
ニッセイ/シュロダー・グローバルCBファンド (年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,970円
ニッセイ/シュロダー・グローバルCBファンド (年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,970円
ニッセイ/シュロダー・グローバルCBファンド (資産成長型・為替ヘッジあり)	9,970円
ニッセイ/シュロダー・グローバルCBファンド (資産成長型・為替ヘッジなし)	9,970円
グローバル・ディスラプター成長株ファンド (予想配分金提示型)	9,972円
グローバル・ディスラプター成長株ファンド (資産成長型)	9,972円
ニッセイ新興国テクノロジー関連株式ファンド (予想配分金提示型)	9,972円
ニッセイ新興国テクノロジー関連株式ファンド (資産成長型)	9,972円
既定追加型・横上償還多額付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド (為替ヘッジあり)	9,973円
既定追加型・横上償還多額付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド (為替ヘッジなし)	9,973円
ニッセイ/シュロダー・好利回りCBファンド 2023-02 (為替ヘッジあり・既定追加型)	9,974円
既定追加型・横上償還多額付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド 2023-07 (為替ヘッジあり)	9,975円
既定追加型・横上償還多額付ニッセイ世界リカバリー株式厳選ファンド 2023-07 (為替ヘッジなし)	9,975円
ニッセイ・マルチアセット・インカム戦略ファンド (資産成長型)	9,975円
ニッセイ・マルチアセット・インカム戦略ファンド (毎月決算型)	9,975円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (毎月決算型・為替ヘッジあり)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (毎月決算型・為替ヘッジなし)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (年2回決算型・為替ヘッジあり)	9,968円
ニッセイ米国不動産投資法人債ファンド (年2回決算型・為替ヘッジなし)	9,968円

## 損益の状況

当期 (2023年4月18日~2023年10月16日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	1,734,560円
受 取 利 息	1,788,938
支 払 利 息	△ 54,378
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,815,052
売 買 損 益	△ 1,815,052
(C)信 託 報 酬 等	△ 1,705
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 82,197
(E)前 期 繰 越 損 益 金	1,877,347
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	271,311
(G)解 約 差 損 益 金	△ 234,845
(H)合 計 (D + E + F + G)	1,831,616
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	1,831,616

(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 M S C I 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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

#### ・ 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。