

第9期末 (2023年11月20日)

基準価額	11,884円
純資産総額	70億円
騰落率	8.5%
分配金	0円

DCニッセイ 外国債券インデックス

追加型投信／海外／債券／インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2022年11月22日～2023年11月20日

第9期(決算日 2023年11月20日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「DCニッセイ外国債券インデックス」は、このたび第9期の決算を行いました。

当ファンドは、「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的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目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



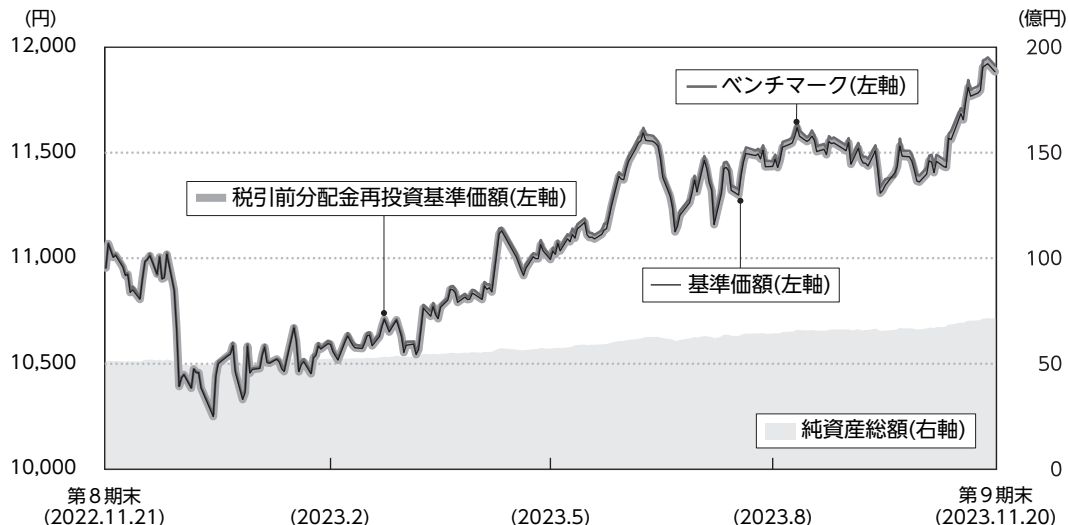
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年11月22日～2023年11月20日

基準価額等の推移



第9期首	10,954円	既払分配金	0円
第9期末	11,884円	騰落率 (分配金再投資ベース)	8.5%

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

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

(注3) ベンチマークはF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2023年2月から6月にかけて、堅調な米経済指標や植田日銀新総裁が金融緩和を継続するとの見方が強まったことから米ドル高円安基調となったこと
- ・10月下旬から当期末にかけて、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海外金利が低下（債券価格は上昇）したこと

<下落要因>

- ・期初から2023年1月中旬にかけて、日銀の金融政策決定会合でイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、YCC）の修正が実施され、日米金利差が縮小するとの見方から米ドル安円高となったこと

1万口当たりの費用明細

項目	第9期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	17円	0.153%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は11,067円です。
(投信会社)	(7)	(0.066)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(7)	(0.066)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(2)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
その他費用	5	0.045	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(保管費用)	(4)	(0.037)	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"> ・ 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	22	0.198	

(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、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。

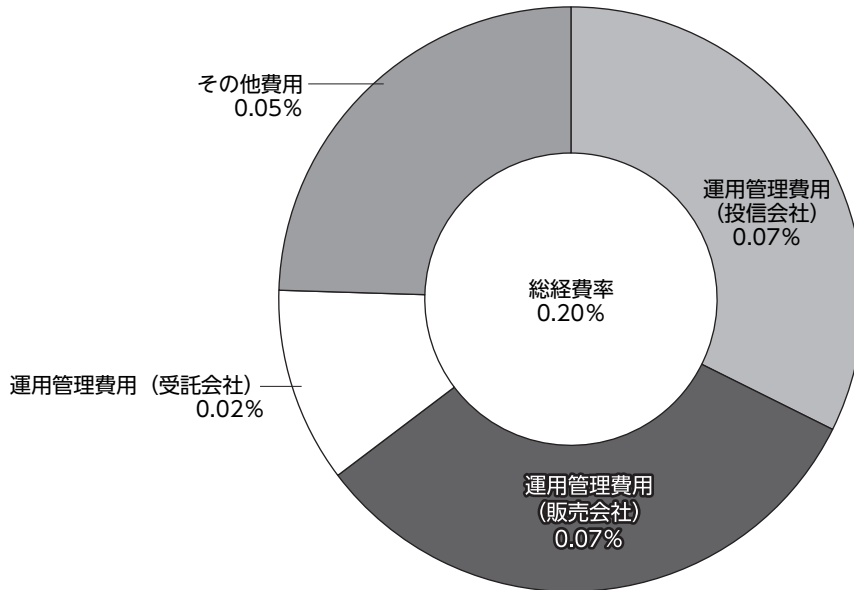
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.20%**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

■ 海外債券市況

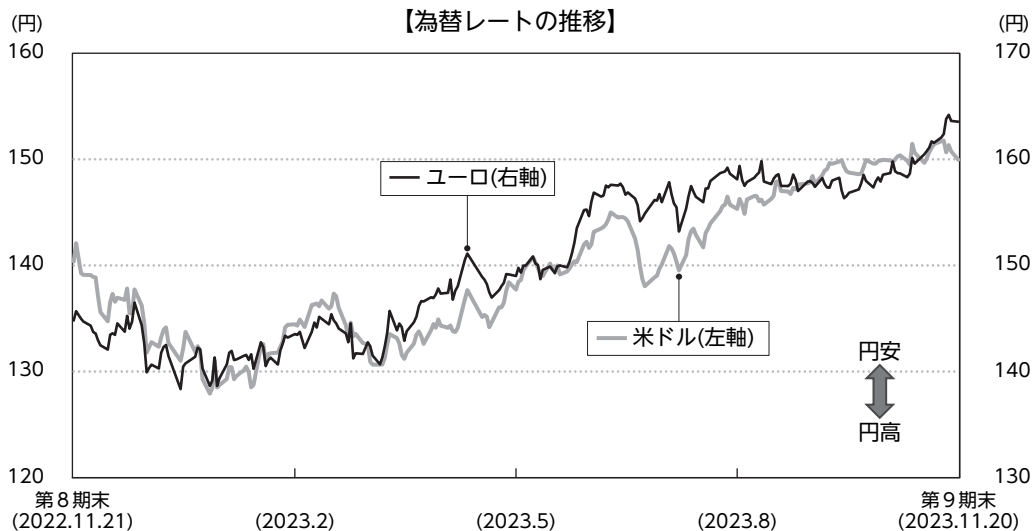


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、期初以降、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おおむね上昇基調となりました。2023年3月には米地方銀行の経営破綻をきっかけに投資家のリスク回避姿勢が強まったことから一時的に金利は低下しましたが、その後の堅調な米経済指標を背景に10月中旬にかけて上昇基調となりました。10月下旬以降は中東情勢の悪化により投資家のリスク回避姿勢が強まったことや物価上昇率の鈍化を受けて将来の利下げ観測が強まったことから金利はやや低下しましたが、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、期初から2023年5月にかけて欧州中央銀行（ECB）の金融政策動向の影響を受けて大きく上下する場面があったものの、おおむね横ばい圏での推移となりました。その後は各国の利上げや米金利の上昇を受けて上昇基調となり、9月には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。10月下旬以降は中東情勢の悪化により投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを受けて低下しましたが、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、期初から2023年1月中旬にかけて日銀によるYCCの修正などから米ドル安円高基調で推移しましたが、その後は堅調な米経済指標や植田日銀新総裁が金融緩和を継続するとの見方が強まったことから米ドル高円安基調に転じました。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、期初から2023年1月中旬にかけて日銀によるYCCの修正などからユーロ安円高基調で推移しましたが、その後はECBが継続的に物価上昇リスクを警戒していたことや米金利の上昇に連れて欧州金利が上昇したことなどからユーロ高円安基調に転じました。7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けてユーロ安円高に転じましたが、その後は日・欧中央銀行の金融政策の影響を受けて上下に振れつつも横ばい圏での推移となりました。11月には大手格付け機関によるイタリア国債の格下げが回避されたことなどをを受けてユーロに対する懸念が後退したことや日銀の金融緩和政策継続への見方が強まったことなどからユーロ高円安となり、結局、期を通じて見るとユーロ高円安で当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

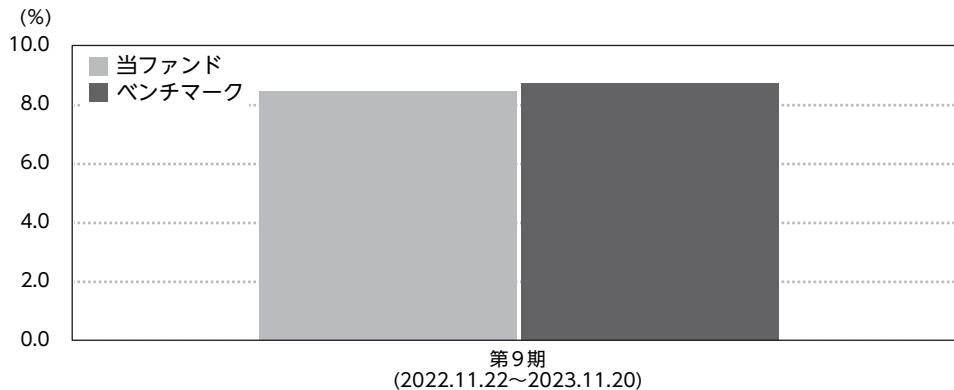
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

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。

*ベンチマークはF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+8.5%となり、ベンチマーク騰落率（+8.8%）におおむね連動しました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

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

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

項目	当期 2022年11月22日～2023年11月20日
当期分配金(税引前)	—
対基準価額比率	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,098円

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

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

今後の運用方針

■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に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。

■マザーファンド

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

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

組入ファンド

	第9期末 2023年11月20日
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	100.0%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

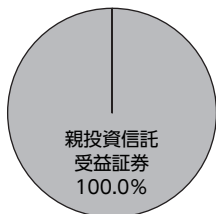
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

純資産等

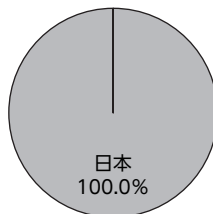
項目	第9期末 2023年11月20日
純資産総額	7,077,703,057円
受益権総口数	5,955,800,714口
1万口当たり基準価額	11,884円

(注) 当期間中における追加設定元本額は2,255,013,544円、同解約元本額は893,460,508円です。

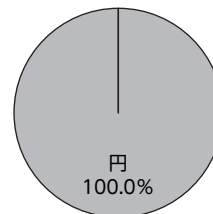
資産別配分



国別配分



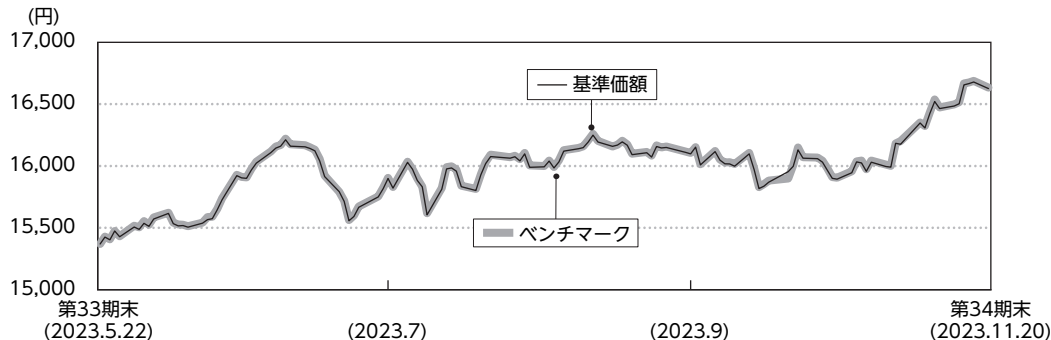
通貨別配分



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

ニッセイ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

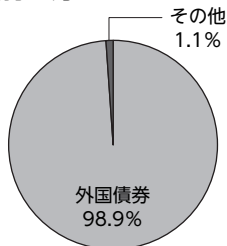
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.0% 2025/2/15	米ドル	1.7%
US TREASURY 2.25% 2025/11/15	米ドル	1.6
US TREASURY 2.125% 2025/5/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.25% 2024/11/15	米ドル	1.5
US TREASURY 1.625% 2026/2/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.875% 2028/8/15	米ドル	1.3
US TREASURY 1.625% 2026/5/15	米ドル	1.3
US TREASURY 1.5% 2026/8/15	米ドル	1.3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

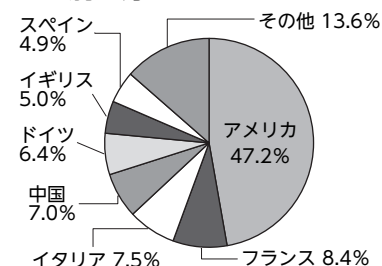
2023.5.23~2023.11.20

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

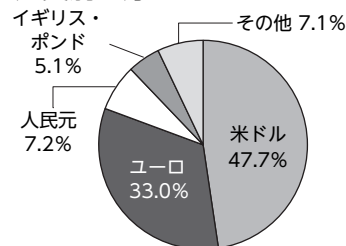
■ 資産別配分



■ 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。

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)	ベンチ マーク	期中 騰落率	債券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金				
	円	円	%	円		%	%	百万円
5期(2019年11月20日)	9,930	0	4.1	9,930	10,048	4.3	99.1	1,202
6期(2020年11月20日)	10,382	0	4.6	10,382	10,538	4.9	99.1	1,894
7期(2021年11月22日)	10,907	0	5.1	10,907	11,093	5.3	99.2	2,734
8期(2022年11月21日)	10,954	0	0.4	10,954	11,163	0.6	99.0	5,032
9期(2023年11月20日)	11,884	0	8.5	11,884	12,141	8.8	98.9	7,077

(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) 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4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」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		ベンチ マーク	騰落率		債券 組入比率
			%			%	
(期首)2022年11月21日	円 10,954		% -	11,163		% -	% 99.0
11月末	10,923	△0.3		11,136	△0.2		99.0
12月末	10,384	△5.2		10,588	△5.2		99.0
2023年1月末	10,506	△4.1		10,718	△4.0		99.2
2月末	10,631	△2.9		10,849	△2.8		99.1
3月末	10,763	△1.7		10,985	△1.6		98.7
4月末	10,840	△1.0		11,066	△0.9		98.9
5月末	11,113	1.5		11,354	1.7		99.1
6月末	11,558	5.5		11,807	5.8		98.9
7月末	11,307	3.2		11,549	3.5		99.2
8月末	11,618	6.1		11,868	6.3		98.9
9月末	11,437	4.4		11,690	4.7		99.2
10月末	11,430	4.3		11,679	4.6		99.0
(期末)2023年11月20日	11,884	8.5		12,141	8.8		98.9

(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11月22日～2023年11月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,613,015	2,506,669	645,116	1,001,790

(注) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2022年11月22日～2023年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2023年11月20日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	3,289,166	4,257,065	7,077,797

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ外国債券インデックスマザーファンド全体の口数は43,378,960千口です。

投資信託財産の構成

2023年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	7,077,797	99.7
コール・ローン等、その他	24,584	0.3
投資信託財産総額	7,102,382	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・シェケル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・リングギット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) 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(72,065,479千円)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。

DCニッセイ外国債券インデックス

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	7,102,382,155円
コール・ローン等	4,932,530
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	7,077,797,334
未収入金	19,652,291
(B)負債	24,679,098
未払解約金	19,558,676
未払信託報酬	4,875,092
その他未払費用	245,330
(C)純資産総額(A-B)	7,077,703,057
元本	5,955,800,714
次期繰越損益金	1,121,902,343
(D)受益権総口数	5,955,800,714口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,884円

(注) 期首元本額	4,594,247,678円
期中追加設定元本額	2,255,013,544円
期中一部解約元本額	893,460,508円

損益の状況

当期(2022年11月22日~2023年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 726円
受取利息	77
支払利息	△ 803
(B)有価証券売買損益	525,444,283
売買益	556,854,977
売買損	△ 31,410,694
(C)信託報酬等	△ 9,337,759
(D)当期損益金(A+B+C)	516,105,798
(E)前期繰越損益金	118,468,295
(分配準備積立金)	(118,468,817)
(繰越欠損金)	(△ 522)
(F)追加信託差損益金*	487,328,250
(配当等相当額)	(614,962,281)
(売買損益相当額)	(△ 127,634,031)
(G)合計(D+E+F)	1,121,902,343
次期繰越損益金(G)	1,121,902,343
追加信託差損益金	487,328,250
(配当等相当額)	(614,962,281)
(売買損益相当額)	(△ 127,634,031)
分配準備積立金	634,574,819
繰越欠損金	△ 726

- (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	516,106,002円
(c) 信託約款に定める収益調整金	614,962,281円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	118,468,817円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	1,249,537,100円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	2,098.02円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。	
主要運用対象	DCニッセイ外国債券インデックス	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド受益証券
	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
運用方法	DCニッセイ外国債券インデックス	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 <ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	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。 <ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。	

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 34 期

(計算期間：2023年5月23日～2023年11月20日)

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

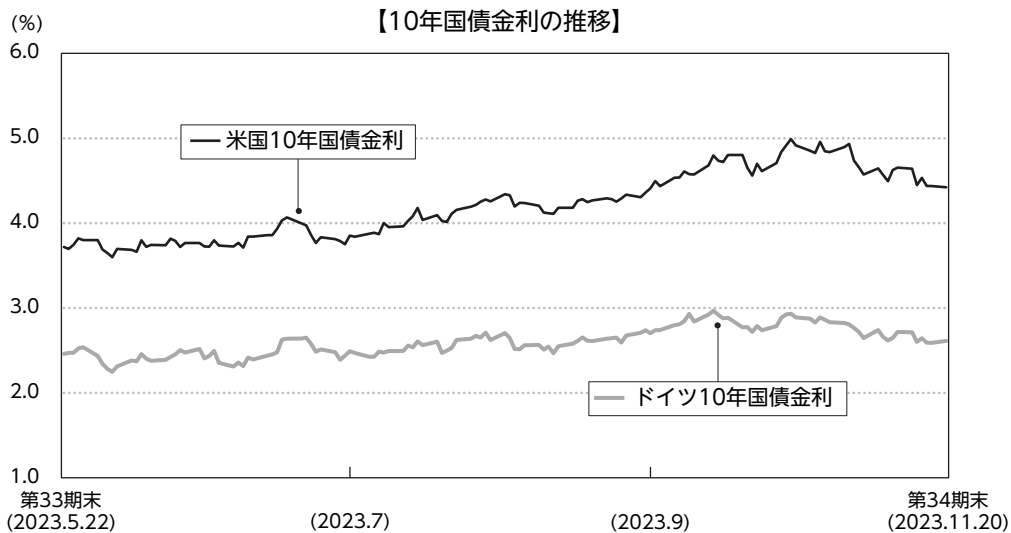
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年5月23日～2023年11月20日

投資環境

海外債券市況

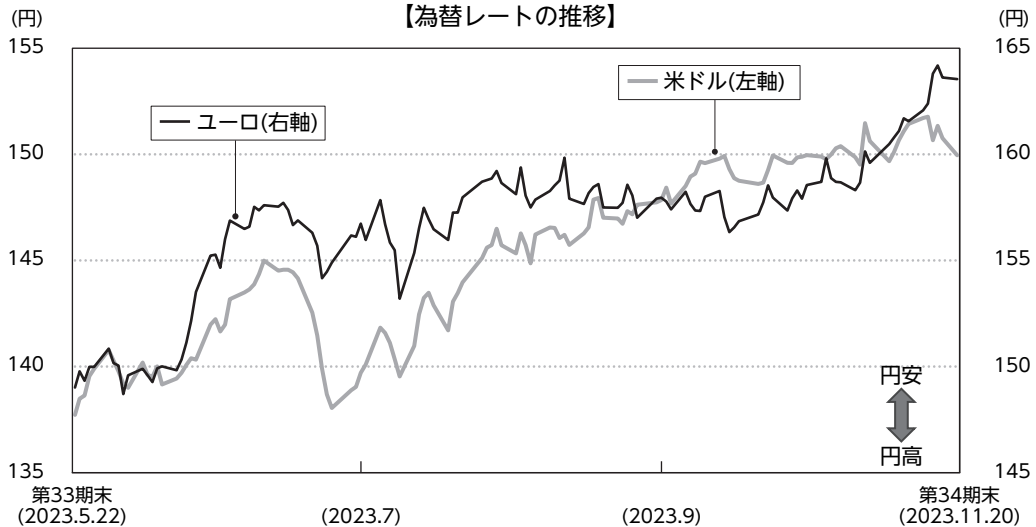


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

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

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

■為替市況

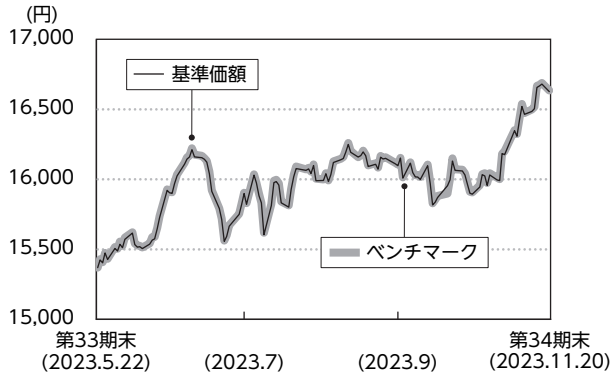


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
30期(2021年11月22日)	15,210	2.5	15,395	2.6	99.2	46,402
31期(2022年5月20日)	14,990	△1.4	15,179	△1.4	99.1	50,588
32期(2022年11月21日)	15,301	2.1	15,493	2.1	99.0	56,285
33期(2023年5月22日)	15,369	0.4	15,569	0.5	99.0	61,820
34期(2023年11月20日)	16,626	8.2	16,850	8.2	98.9	72,121

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023年11月20日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

売買および取引の状況

2023年5月23日～2023年11月20日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2023年5月23日～2023年11月20日

公社債

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

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2023年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	261,780	227,170	34,064,156	47.2	—	19.2	17.6	10.4
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	14,150	12,794	1,397,794	1.9	—	1.0	0.4	0.5
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア	12,140	10,689	1,042,944	1.4	—	1.0	0.3	0.1
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	2,890	2,782	310,487	0.4	—	0.3	0.1	0.1
	千ニューゼaland・ドル	千ニューゼaland・ドル						
ニューゼaland	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	千円
国債証券				千カナダ・ドル	千円
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	
国債証券				千オーストラリア・ドル	
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		-	-	-	-
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	
						千円	千円
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	千円	
オランダ						
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2027/01/15	350	320	52,487
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2027/07/15	370	344	56,339
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/01/15	290	320	52,437
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2028/07/15	430	393	64,299
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2029/01/15	270	234	38,414
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2029/07/15	270	235	38,480
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2030/01/15	170	167	27,371
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2030/07/15	310	258	42,316
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2031/07/15	330	267	43,711
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2032/07/15	300	246	40,351
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/01/15	350	340	55,633
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/07/15	250	241	39,497
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/01/15	390	430	70,394
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2038/01/15	230	149	24,510
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2040/01/15	350	237	38,829
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/01/15	410	448	73,345
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.2500	2044/01/15	100	103	16,844
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/01/15	450	429	70,276
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2052/01/15	390	172	28,257
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2054/01/15	190	152	24,858
小計			-	-	-	1,078,018
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/06/22	490	472	77,232
	BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/03/28	270	279	45,655
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/06/22	350	333	54,505
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2027/06/22	360	335	54,813
	BELGIUM KINGDOM	0.0000	2027/10/22	240	214	35,153
	BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	460	510	83,443
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2028/06/22	380	347	56,828
	BELGIUM KINGDOM	0.9000	2029/06/22	420	378	61,822
	BELGIUM KINGDOM	0.1000	2030/06/22	310	257	42,191
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/06/22	380	328	53,701
	BELGIUM KINGDOM	0.0000	2031/10/22	310	244	39,919
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/03/28	200	213	34,918
	BELGIUM KINGDOM	0.3500	2032/06/22	360	285	46,730
	BELGIUM KINGDOM	1.2500	2033/04/22	240	203	33,320
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2033/06/22	390	384	62,803

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2029/05/25	1,220	1,074	175,794
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2029/11/25	1,050	885	144,796
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/05/25	1,340	1,308	214,013
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2030/11/25	1,270	1,037	169,610
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/05/25	1,340	1,211	198,169
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2031/11/25	1,160	916	149,811
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2032/05/25	780	605	98,991
	FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	780	941	154,033
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2032/11/25	1,000	917	150,057
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2033/05/25	830	823	134,625
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2033/11/25	140	144	23,582
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2034/05/25	980	812	132,943
	FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/04/25	640	730	119,542
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/05/25	1,030	814	133,175
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2038/05/25	370	278	45,576
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	590	630	103,165
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2039/06/25	730	585	95,821
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2040/05/25	560	352	57,714
	FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/04/25	840	950	155,508
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2043/05/25	280	238	38,991
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2044/06/25	430	241	39,419
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/05/25	670	639	104,562
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2048/05/25	660	491	80,325
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2050/05/25	720	465	76,069
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2052/05/25	730	364	59,576
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2053/05/25	690	336	55,024
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2054/05/25	400	352	57,587
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/04/25	440	469	76,715
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/04/25	440	472	77,260
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/05/25	370	230	37,684
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2072/05/25	260	90	14,825
小計		-	-	-	-	6,035,786
ドイツ						
国債証券	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
ドイツ						
国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	420	495	81,043
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	470	589	96,451
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	420	444	72,686
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	660	626	102,415
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	690	653	106,927
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	810	590	96,604
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	220	107	17,540
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	870	421	68,995
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2052/08/15	600	275	45,023
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8000	2053/08/15	100	80	13,118
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8000	2053/08/15	530	424	69,379
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.2000	2024/12/12	190	187	30,690
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.5000	2025/03/13	390	386	63,179
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.8000	2025/06/12	400	397	65,051
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	3.1000	2025/09/18	370	370	60,554
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	3.1000	2025/12/12	50	50	8,200
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	300	339	55,485
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	380	425	69,556
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	300	328	53,796
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	480	573	93,717
小計		-	-	-	-	4,607,563
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	510	505	82,735
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2025/01/31	480	460	75,378
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/04/30	490	477	78,122
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2025/05/31	530	503	82,370
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/07/30	430	439	71,833
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	600	588	96,217
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2026/01/31	470	438	71,697
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	510	495	81,001
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.8000	2026/05/31	480	475	77,709
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	530	566	92,582
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	620	588	96,179
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2027/01/31	480	434	71,051
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	570	539	88,257
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2027/07/30	510	468	76,647
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	560	525	85,895

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

投資信託財産の構成

2023年11月20日現在

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

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

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

損益の状況

当期(2023年5月23日~2023年11月20日)

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

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ 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。