

第6期末 (2023年2月21日)

基準価額	10,587円
純資産総額	110億円
騰落率	△1.5%
分配金	0円

DCニッセイ ワールドセレクトファンド (安定型)

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2月22日～2023年2月21日

第6期(決算日 2023年2月21日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)」は、このたび第6期の決算を行いました。

当ファンドは、「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



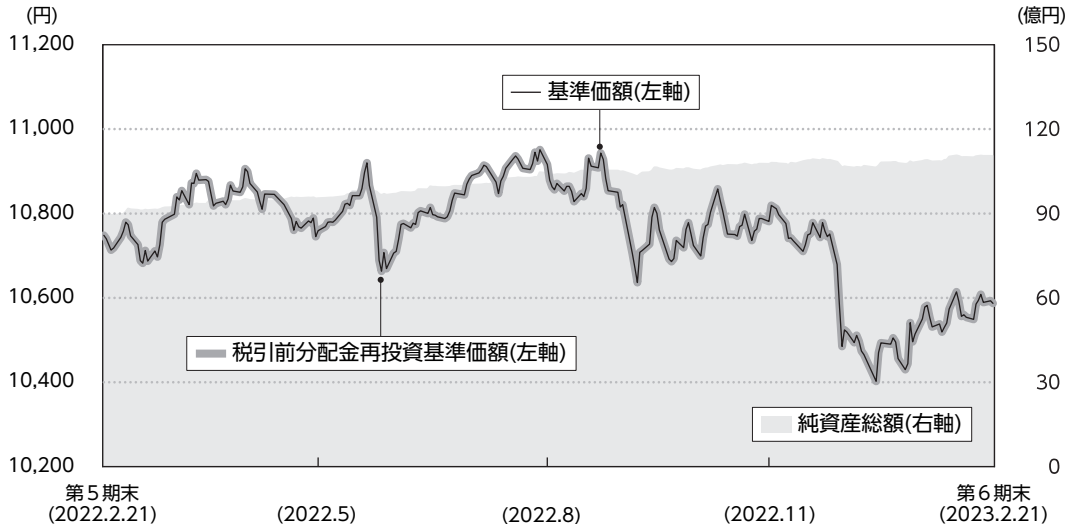
ニッセイアセットマネジメント株式会社

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21日

基準価額等の推移



第6期首	10,748円	既払分配金	0円
第6期末	10,587円	騰落率(分配金再投資ベース)	△1.5%

(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

<上昇要因>

- ・2022年7月から8月中旬にかけて、米金融政策・景気の軟着陸(ソフトランディング)への期待感や、10月以降の米利上げペース鈍化への期待感を受けて株価が上昇したこと
- ・2023年1月から当期末にかけて内外の金融引き締め加速への警戒感が和らいだことなどから株価がおおむね上昇したこと
- ・期を通じて世界的に金融緩和縮小が進み、内外金利差の拡大などから主要通貨に対して円安が進行したこと

<下落要因>

- ・2022年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(FRB)議長による金融引き締めに向けた発言や欧州中央銀行(ECB)の利上げを受けて内外の金利が上昇(債券価格は下落)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許容変動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国内金利が上昇したこと

組入マザーファンド	投資比率	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	5.0%	5.1%	7.3%
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	60.0	59.5	△3.9
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	5.0	5.1	11.3
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25.0	25.1	0.1
短期金融資産	5.0	5.1	-

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

項目	第6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	17円	0.154%	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10,756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
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	2	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)	(0.011)	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)	(0.007)	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	19	0.172	

(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。

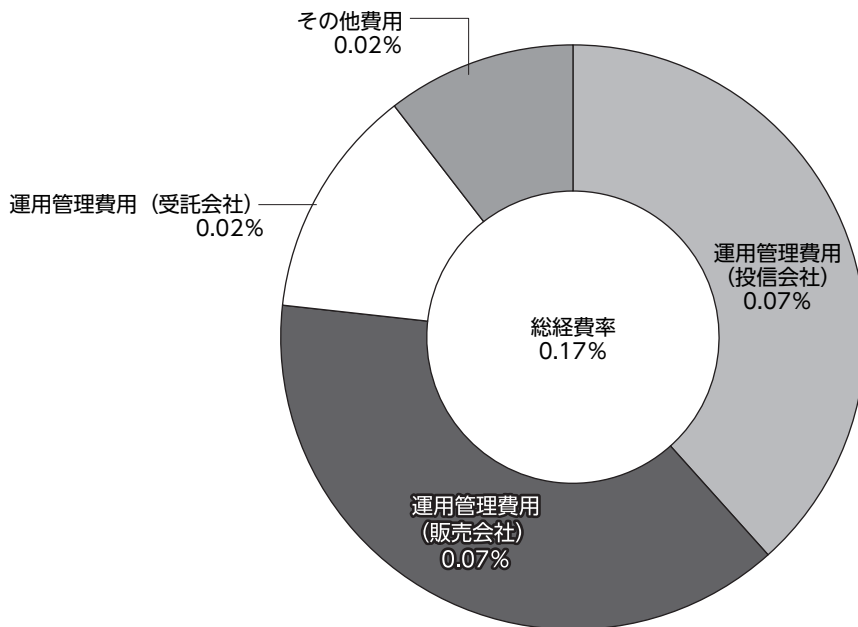
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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。

投資環境

■国内株式市場

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。2023年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。

■国内債券市場

当期の10年国債金利は上昇しました。

期初はロシア・ウクライナ情勢の緊迫化を背景に金利は低下しましたが、2022年3月中旬以降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前に前向きな発言や、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米金利が上昇し、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。2023年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、当期末にかけて再度上昇し、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

■海外株式市況

当期の海外株式市場は米国では下落しましたが、ドイツやイギリスでは上昇しました。

期初以降、米金融政策の引き締め懸念やロシアによるウクライナ侵攻を背景に株価は下落しました。2022年3月中旬から6月にかけては、堅調な経済指標やコモディティ価格上昇の一服を受けて一時上昇する場面もありましたが、中国のロックダウン（都市封鎖）や主要な中央銀行が相次いで利上げを実施したことが懸念され株価は下落しました。7月から8月中旬にかけては、米金融政策・景気のソフトランディングへの期待感から株価は上昇しましたが、8月下旬から9月にかけては、パウエルFRB議長によるジャクソンホール会議での金融引き締めに積極的なスタンスが警戒されたことや米CPIが市場予想を上回ったことから米金融引き締めの長期化が懸念され下落しました。その後はイギリスにおける政治的混乱が沈静化したことや、米CPIの上昇ペースが市場予想より減速し米利上げペース鈍化への期待感が高まったことを受けて株価は上昇しました。

2023年1月から当期末にかけては、インフレ鈍化期待や中国における行動制限の緩和を受けて一時上昇したものの、米金融政策の引き締め懸念が再燃し米国株式市場は下落し、前期末と比較すると下落して当期末を迎えました。一方、中国の経済再開による影響を受けやすいとの期待感から欧州株式市場については底堅く推移し、前期末と比較すると上昇して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、2022年3月から6月中旬にかけて物価高を背景にFRB高官から早期の大幅利上げを示唆する発言が相次いだことなどから大幅に上昇しました。その後は利上げによる景気減速懸念を受けて金利は一時低下する場面がありましたが、8月から10月にかけては堅調な米経済指標や物価の上昇を受けて再び上昇しました。当期末にかけては景気減速懸念等を受けた利上げペースの鈍化観測により金利はやや低下しましたが、結局、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、2022年3月から6月中旬にかけて欧州域内の物価上昇が加速する中、ECB高官が早期利上げを示唆したことなどから大幅に上昇しました。6月下旬から7月にかけては、ロシアからの天然ガス供給の不透明感による景気減速懸念等を受けて金利は一時低下しましたが、10月にかけては物価上昇を背景に欧州の各中央銀行が利上げを行ったことや、イギリスの大幅減税政策の発表を受けた財政懸念によりイギリス国債金利が急騰したことなどから、再び上昇基調となりました。その後は物価の落ち着きや米国の利上げペースの鈍化観測を背景に横ばいでの推移となりましたが、結局、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

■為替市況

当期の米ドル/円レートは上昇しました。

期初以降、米国が物価上昇を背景に利上げを継続していた一方で、日本は金融緩和を維持したことから日米金利差が拡大し、2022年3月から10月中旬にかけて大幅な米ドル高円安基調となりました。その後は米経済指標の悪化を背景に米利上げペースの鈍化観測が高まったことや、12月に日銀が金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅を拡大したことが事実上の利上げと受け止められ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/円レートは上昇しました。

期初はウクライナ情勢の緊迫から投資家のリスク回避姿勢が強まりユーロ安円高となりましたが、2022年6月中旬にかけては欧州域内の物価上昇を背景としたECBの早期利上げ観測を受けてユーロ高円安となりました。7月にはロシアからの天然ガス供給の不透明感による景気減速懸念等を受けて一時ユーロ安円高に転じましたが、その後はECBによる積極的な利上げ観測が高まり再びユーロ高円安となりました。11月から12月にかけては欧米の金利低下や日銀による長期金利の許容変動幅拡大を受けた日欧金利差縮小観測からユーロ安円高となりましたが、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

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行いました。

■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TOPIX（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NOMURA-BPI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>

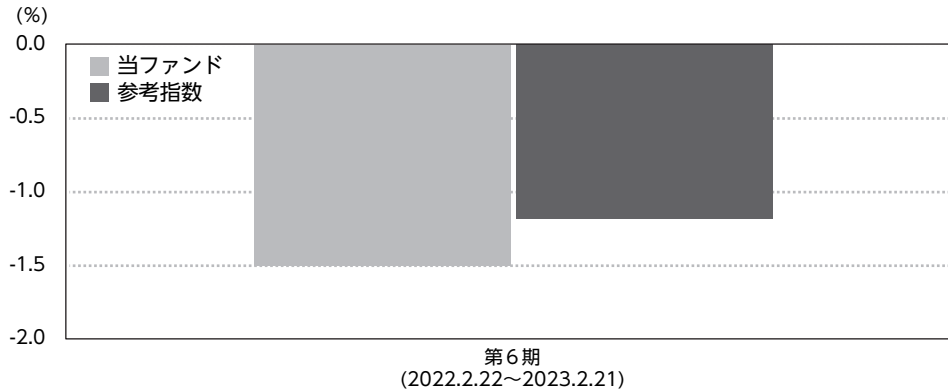
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<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。

参考指数との差異



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

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は-1.5%となり、参考指数騰落率（-1.2%）を下回りました。信託報酬等を控除した関係などから参考指数騰落率を下回る結果となりました。

(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、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2月22日~2023年2月21日
当期分配金(税引前)	-
対基準価額比率	-
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	586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

「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。相場動向やその見通しによって資産配分比率を変更するファンドではありません。従って、今後も投資比率（基準ポートフォリオ）に基づいて各マザーファンド受益証券の組み入れを行い、同投資比率を継続的に維持していく予定です。

■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。

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6期末 2023年2月21日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	5.1%
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド	59.5
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	5.1
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	25.1

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

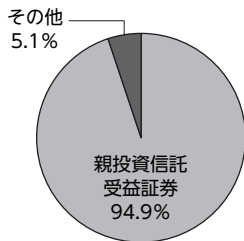
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

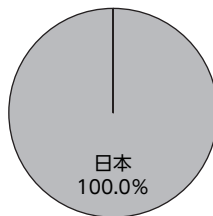
項目	第6期末 2023年2月21日
純資産総額	11,023,772,224円
受益権総口数	10,412,827,818口
1万口当たり基準価額	10,587円

(注) 当期間中における追加設定元本額は3,034,896,795円、同解約元本額は961,282,740円です。

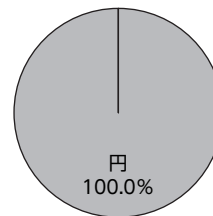
■資産別配分



■国別配分



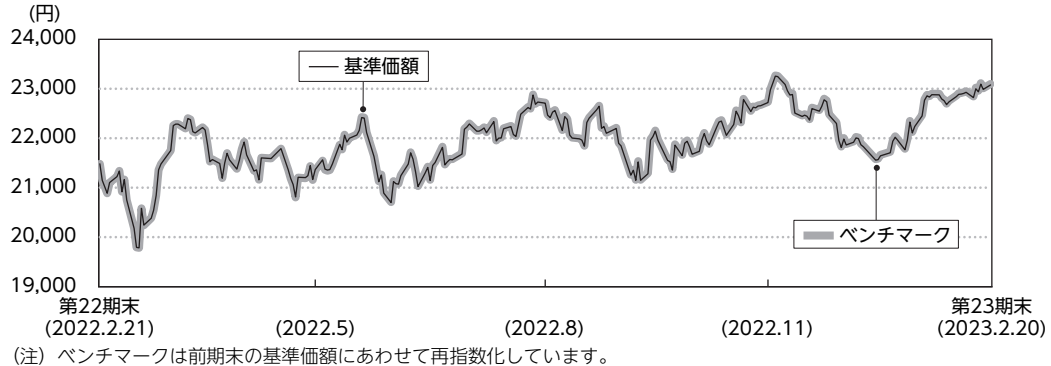
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年2月21日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ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



■ 上位銘柄

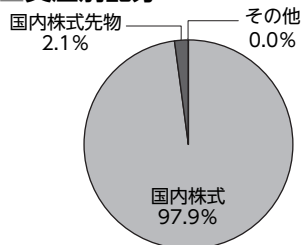
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.5%
ソニーグループ	円	2.7
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	2.1
TOPIX 先物 0503月 買	円	2.1
キーエンス	円	2.0
日本電信電話	円	1.7
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.5
武田薬品工業	円	1.3
第一三共	円	1.3
日立製作所	円	1.2
組入銘柄数		1,822

■ 1万口当たりの費用明細

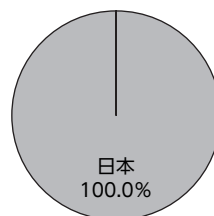
2022.2.22~2023.2.20

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

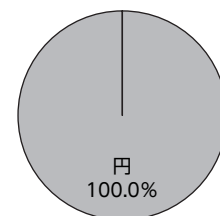
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



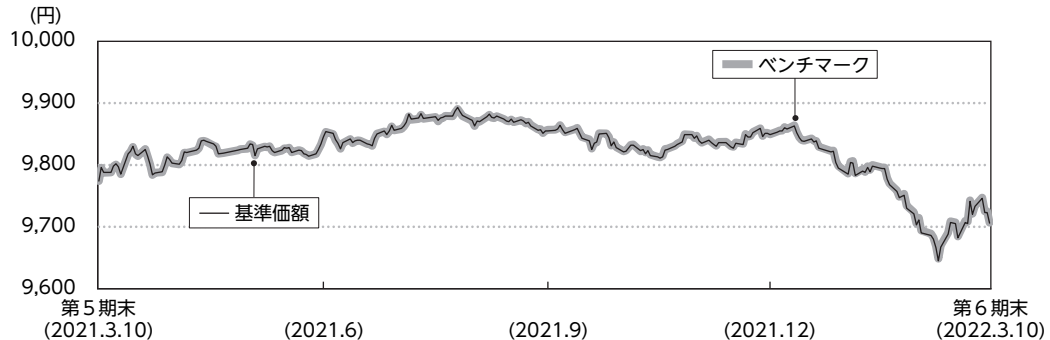
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

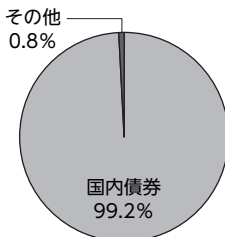
銘柄名	通貨	比率
第350回 利付国債 (10年)	円	1.0%
第 3 回 利付国債 (40年)	円	0.8
第363回 利付国債 (10年)	円	0.8
第361回 利付国債 (10年)	円	0.8
第430回 利付国債 (2年)	円	0.8
第431回 利付国債 (2年)	円	0.8
第364回 利付国債 (10年)	円	0.8
第429回 利付国債 (2年)	円	0.8
第428回 利付国債 (2年)	円	0.8
第340回 利付国債 (10年)	円	0.7
組入銘柄数		355

■ 1万口当たりの費用明細

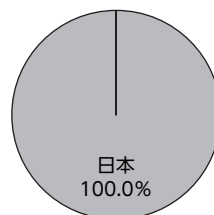
2021.3.11~2022.3.10

項目	金額
その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

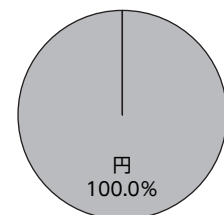
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



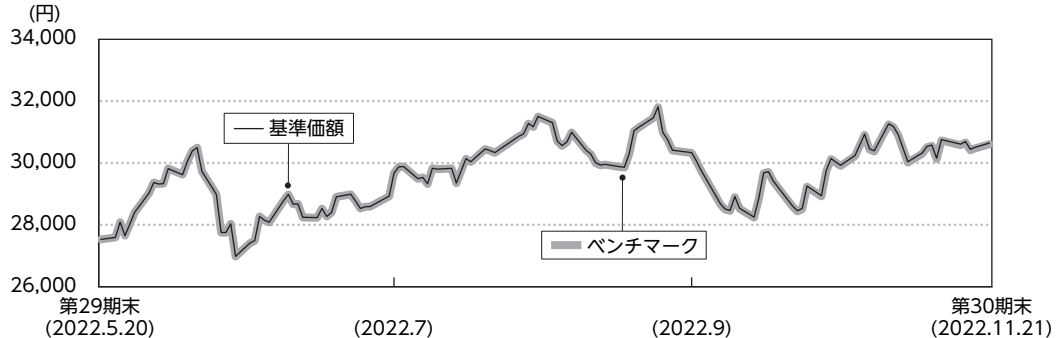
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

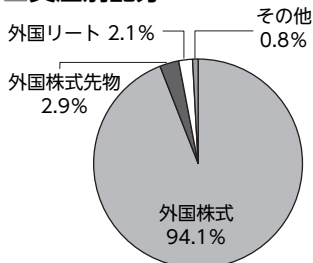
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	4.9%
MICROSOFT CORP	米ドル	3.4%
S&P 500 EMINI FUTURE 202212 買	米ドル	2.2%
AMAZON.COM INC	米ドル	1.7%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.2%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.1%
UNITEDHEALTH GROUP INC	米ドル	1.0%
TESLA, INC.	米ドル	1.0%
EXXON MOBIL CORP	米ドル	0.9%
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	0.9%
組入銘柄数		1,271

■ 1万口当たりの費用明細

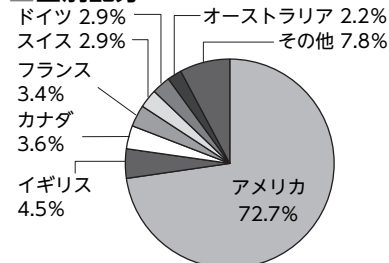
2022.5.21~2022.11.21

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

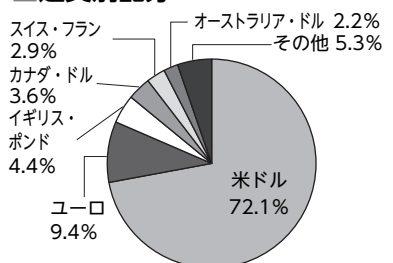
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



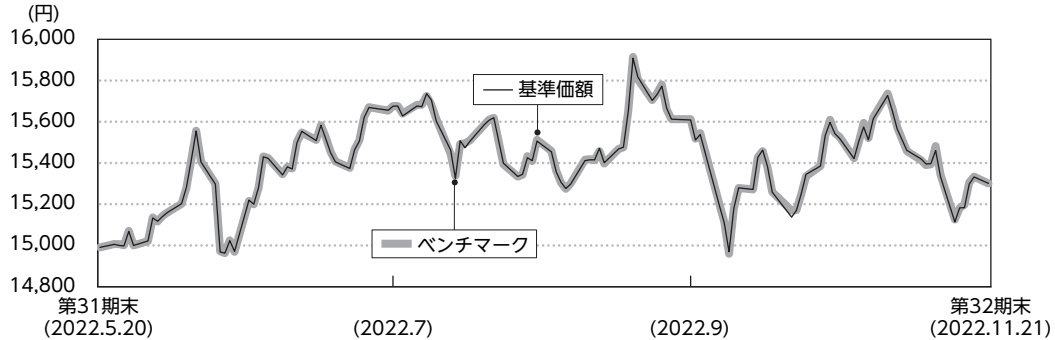
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

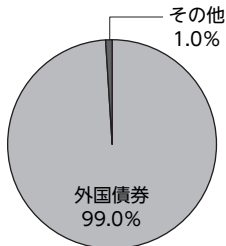
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.5% 2024/5/15	米ドル	2.0%
US TREASURY 2.25% 2024/11/15	米ドル	1.5
US TREASURY 2.0% 2025/2/15	米ドル	1.3
US TREASURY 2.375% 2024/8/15	米ドル	1.2
US TREASURY 2.75% 2024/2/15	米ドル	1.1
US TREASURY 2.125% 2025/5/15	米ドル	1.1
US TREASURY 0.25% 2024/3/15	米ドル	1.0
US TREASURY 2.625% 2029/2/15	米ドル	1.0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

■ 1万口当たりの費用明細

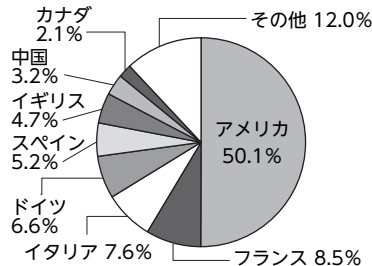
2022.5.21~2022.11.21

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

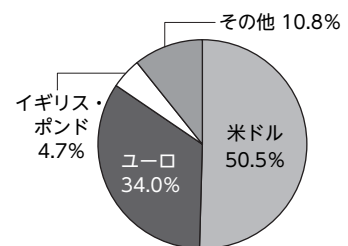
■ 資産別配分



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

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	参考指数	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2019年2月21日)	10,190	0	1.2	10,190	10,222	1.4	9.8	0.2	84.0	0.1	459
3期(2020年2月21日)	10,590	0	3.9	10,590	10,640	4.1	9.6	0.3	84.3	0.1	3,187
4期(2021年2月22日)	10,669	0	0.7	10,669	10,738	0.9	9.9	0.2	83.9	0.1	5,944
5期(2022年2月21日)	10,748	0	0.7	10,748	10,842	1.0	9.4	0.4	84.2	0.1	8,963
6期(2023年2月21日)	10,587	0	△1.5	10,587	10,714	△1.2	9.7	0.3	83.8	0.1	11,023

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) 参考指数は設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	参考指数	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
(期首)2022年2月21日	10,748	-	10,842	-	9.4	0.4	84.2	0.1
2月末	10,743	△0.0	10,837	△0.0	9.4	0.4	84.3	0.1
3月末	10,895	1.4	10,989	1.4	10.3	0.4	83.5	0.1
4月末	10,846	0.9	10,944	0.9	9.3	0.2	84.6	0.1
5月末	10,822	0.7	10,922	0.7	9.6	0.3	84.2	0.1
6月末	10,802	0.5	10,906	0.6	9.3	0.3	84.6	0.1
7月末	10,902	1.4	11,012	1.6	9.9	0.2	84.0	0.1
8月末	10,864	1.1	10,973	1.2	9.6	0.3	84.2	0.1
9月末	10,712	△0.3	10,822	△0.2	9.2	0.3	84.5	0.1
10月末	10,858	1.0	10,976	1.2	9.9	0.3	84.0	0.1
11月末	10,742	△0.1	10,859	0.2	9.9	0.2	83.9	0.1
12月末	10,465	△2.6	10,585	△2.4	9.4	0.3	84.3	0.1
2023年1月末	10,519	△2.1	10,645	△1.8	10.0	0.3	83.7	0.1
(期末)2023年2月21日	10,587	△1.5	10,714	△1.2	9.7	0.3	83.8	0.1

(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2月22日～2023年2月21日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	98,883	214,789	64,774	143,047
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	2,300,745	2,196,706	815,718	776,904
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	79,956	232,887	56,674	170,378
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	646,244	979,546	280,226	426,086

(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
(a) 期中の株式売買金額	128,054,577千円	112,134,926千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	163,688,125千円	534,868,916千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.78	0.20

(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2月22日～2023年2月21日

当期における利害関係人との取引はありません。

DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)

親投資信託残高

2023年2月21日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	208,072	242,181	558,228
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	5,565,351	7,050,377	6,564,606
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	159,332	182,613	562,907
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,507,249	1,873,266	2,772,247

(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81,220,752千口、ニッセイ国内債券パッシブマザーファンドが70,724,755千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが200,521,891千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが39,232,944千口です。

投資信託財産の構成

2023年2月21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	558,228	5.1
ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド	6,564,606	59.4
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	562,907	5.1
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	2,772,247	25.1
コール・ローン等、その他	586,284	5.3
投資信託財産総額	11,044,273	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2月21日における邦貨換算レートは、1米ドル134.32円、1カナダ・ドル99.80円、1オーストラリア・ドル92.82円、1香港ドル17.14円、1シンガポール・ドル100.56円、1ニュージーランド・ドル84.00円、1イギリス・ポンド161.64円、1イスラエル・シケル37.54円、1スイス・フラン145.46円、1デンマーク・クローネ19.27円、1ノルウェー・クローネ13.13円、1スウェーデン・クローナ12.99円、1メキシコ・ペソ7.311円、1人民元19.572円、1マレーシア・リングギット30.295円、1ポーランド・ズロチ30.248円、1ユーロ143.45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 (605,255,739千円) の投資信託財産総額 (619,172,011千円) に対する比率は97.8%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 (57,985,800千円) の投資信託財産総額 (58,209,406千円) に対する比率は99.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型)

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	11,044,273,769円
コール・ローン等	574,804,987
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	558,228,080
ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド(評価額)	6,564,606,697
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	562,907,331
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	2,772,247,266
未収入金	11,479,408
(B)負債	20,501,545
未払解約金	11,889,465
未払信託報酬	8,256,641
その他未払費用	355,439
(C)純資産総額(A-B)	11,023,772,224
元本	10,412,827,818
次期繰越損益金	610,944,406
(D)受益権総口数	10,412,827,818口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,587円

(注) 期首元本額	8,339,213,763円
期中追加設定元本額	3,034,896,795円
期中一部解約元本額	961,282,740円

損益の状況

当期 (2022年2月22日～2023年2月21日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 241,058円
受取利息	20,412
支払利息	△ 261,470
(B)有価証券売買損益	△ 158,055,863
売買益	114,579,781
売買損	△ 272,635,644
(C)信託報酬等	△ 16,345,153
(D)当期損益金(A+B+C)	△ 174,642,074
(E)前期繰越損益金	105,538,269
(分配準備積立金)	(111,909,178)
(繰越欠損金)	(△ 6,370,909)
(F)追加信託差損益金*	680,048,211
(配当等相当額)	(385,794,282)
(売買損益相当額)	(294,253,929)
(G)合計(D+E+F)	610,944,406
次期繰越損益金(G)	610,944,406
追加信託差損益金	680,048,211
(配当等相当額)	(385,794,282)
(売買損益相当額)	(294,253,929)
分配準備積立金	111,909,178
繰越欠損金	△ 181,012,983

- (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	499,276,286円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	111,909,178円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	611,185,464円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	586.95円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■運用体制の変更について

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

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

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	下記マザーファンド受益証券を主要投資対象としてバランス運用を行い、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きをとらえることを目標に運用を行います。	
主要運用対象	DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」 受益証券
	国内株式マザーファンド	国内の金融商品取引所上場株式等
	国内債券マザーファンド	国内の公社債
	外国株式マザーファンド	日本を除く主要先進国の株式
	外国債券マザーファンド	日本を除く主要国の国債
運用方法	DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	各マザーファンドへは、原則として下記の比率で投資し、それぞれ±5%未満に変動幅を抑制します。また株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の25%以下とし、外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の45%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…………… 5% ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド……………60% ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド…………… 5% ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド……………25% 短期金融資産…………… 5%
	国内株式マザーファンド	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。
	国内債券マザーファンド	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。
	外国株式マザーファンド	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。
	外国債券マザーファンド	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。
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。



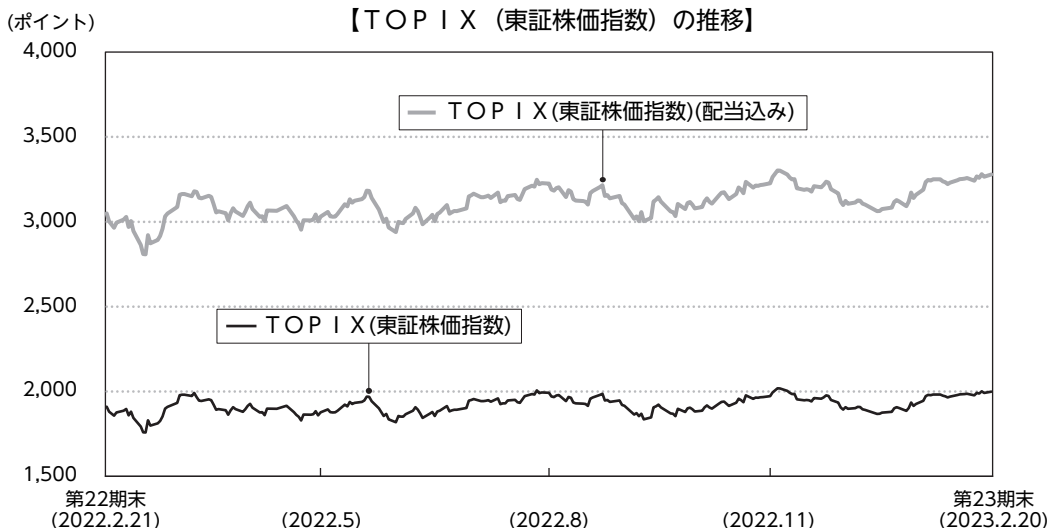
ニッセイアセットマネジメント株式会社

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

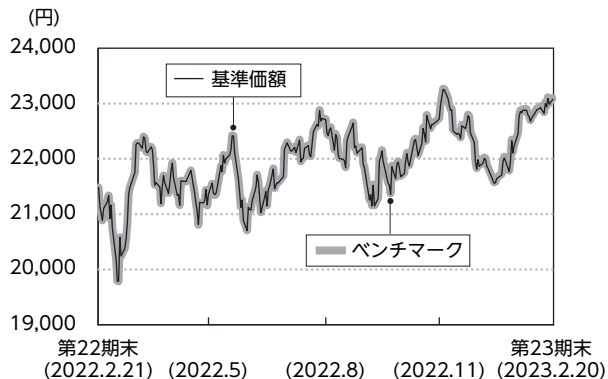


当期の国内株式市場は上昇しました。

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
水産・農林業(0.1%)				
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	
鉱業(0.3%)				
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
建設業(1.9%)				
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
食料品(3.4%)			
ニッパン	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
繊維製品(0.5%)			
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
パルプ・紙(0.2%)			
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
化学(6.1%)			
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
日本パーカライジニング	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
医薬品(5.4%)			
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
石油・石炭製品(0.5%)			
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
ゴム製品(0.8%)			
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
ガラス・土石製品(0.7%)			
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
鉄鋼(0.9%)			
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
非鉄金属(0.7%)			
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
金属製品(0.6%)			
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	
機械(5.3%)				
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	67	112	567,675
IHI	26	40	147,378
スター精密	6	12	19,831
電気機器(17.3%)			
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
マプチモーター	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
輸送用機器(7.5%)			
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
精密機器(2.5%)			
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
その他製品(2.3%)			
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
電気・ガス業(1.2%)			
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
陸運業(2.9%)			
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
海運業(0.6%)			
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
空運業(0.5%)			
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
倉庫・運輸関連業(0.1%)			
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
エーアイティー	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
情報・通信業(8.7%)			
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
ポルトゥワインホールディングス	6	10	9,275
ネクソン	95	165	507,164
アイスタイル	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
オーブند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
シンクロー・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
卸売業(6.0%)			
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
小売業(4.6%)			
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
杏番屋	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
銀行業(6.8%)			
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	
証券、商品先物取引業(0.8%)				
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	
保険業(2.5%)				
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
その他金融業(1.2%)			
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
不動産業(1.9%)			
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	
サービス業(5.2%)				
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	-	-
ジャパンエレベ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
(A)資産	187,717,378,816円
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)負債	289,343,871
未払解約金	289,341,033
その他未払費用	2,838
(C)純資産総額(A-B)	187,428,034,945
元本	81,219,744,591
次期繰越損益金	106,208,290,354
(D)受益権総口数	81,219,744,591口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,077円

(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ペーパ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
(A)配当等収益	4,092,787,401円
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)有価証券売買損益	10,228,495,064
売買益	17,364,693,127
売買損	△ 7,136,198,063
(C)先物取引等損益	273,947,350
取引益	755,852,300
取引損	△ 481,904,950
(D)信託報酬等	△ 127,768
(E)当期損益金(A+B+C+D)	14,595,102,047
(F)前期繰越損益金	62,567,536,066
(G)追加信託差損益金	60,038,867,965
(H)解約差損益金	△ 30,993,215,724
(I)合計(E+F+G+H)	106,208,290,354
次期繰越損益金(I)	106,208,290,354

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

ニッセイ国内債券パッシブ マザーファンド

運用報告書

第 6 期

(計算期間：2021年3月11日～2022年3月10日)

運用方針

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

主要運用 対象

国内の公社債

運用方法

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2021年3月11日～2022年3月10日

国内債券市況

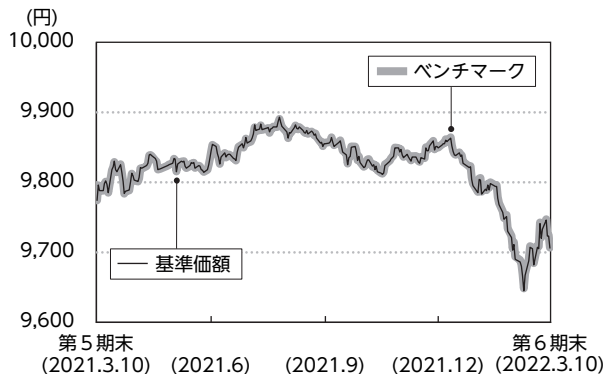


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は上昇しました。

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

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

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	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
2期(2018年3月12日)	9,687	1.1	9,688	1.1	99.1	126,324
3期(2019年3月11日)	9,828	1.5	9,825	1.4	99.2	91,526
4期(2020年3月10日)	9,979	1.5	9,970	1.5	99.3	82,399
5期(2021年3月10日)	9,774	△2.1	9,767	△2.0	99.2	80,558
6期(2022年3月10日)	9,706	△0.7	9,699	△0.7	99.2	78,005

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2021年3月11日～2022年3月10日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用 (その他)	0円 (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	0.000	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（9,822円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2021年3月11日～2022年3月10日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

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

主要な売買銘柄

2021年3月11日～2022年3月10日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2022年3月10日現在

国内(邦貨建)公社債

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

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

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

(国内公社債の内訳)

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

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

投資信託財産の構成

2022年3月10日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内債券パッシブマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年3月10日現在)

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

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

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

ニッセイ国内債券パッシブDB (適格機関投資家限定)

65,329,145,586円
DCニッセイ日本債券インデックス 3,451,719,435円
DCニッセイターゲットデットファンド2055 107,909,695円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) 5,636,145,522円
DCニッセイターゲットデットファンド2045 216,124,782円
DCニッセイターゲットデットファンド2035 1,147,396,165円
DCニッセイターゲットデットファンド2025 2,062,605,972円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス
バランスファンド(6資産均等型) 218,681,287円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券) 24,004,631円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券) 69,765,956円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス
バランスファンド(8資産均等型) 58,442,636円
DCニッセイターゲットデットファンド2060 51,955,149円
DCニッセイターゲットデットファンド2050 71,837,078円
DCニッセイターゲットデットファンド2040 266,777,033円
DCニッセイターゲットデットファンド2030 1,658,861,597円
FWニッセイ国内債インデックス 1,064,570円
DCニッセイターゲットデットファンド2065 47,967円

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

損益の状況

当期(2021年3月11日~2022年3月10日)

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

(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。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 30 期

(計算期間：2022年5月21日～2022年11月21日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

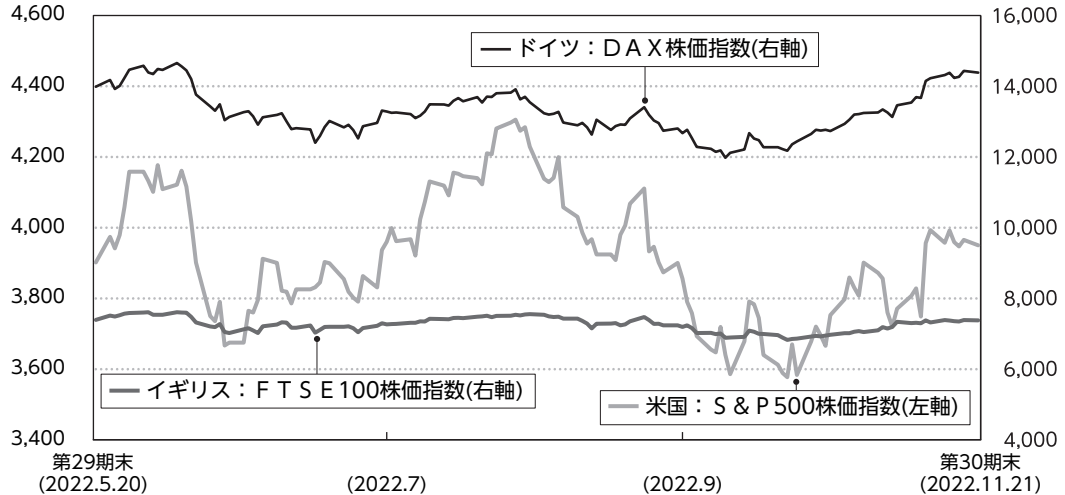
運用経過

2022年5月21日～2022年11月21日

投資環境

■ 海外株式市況

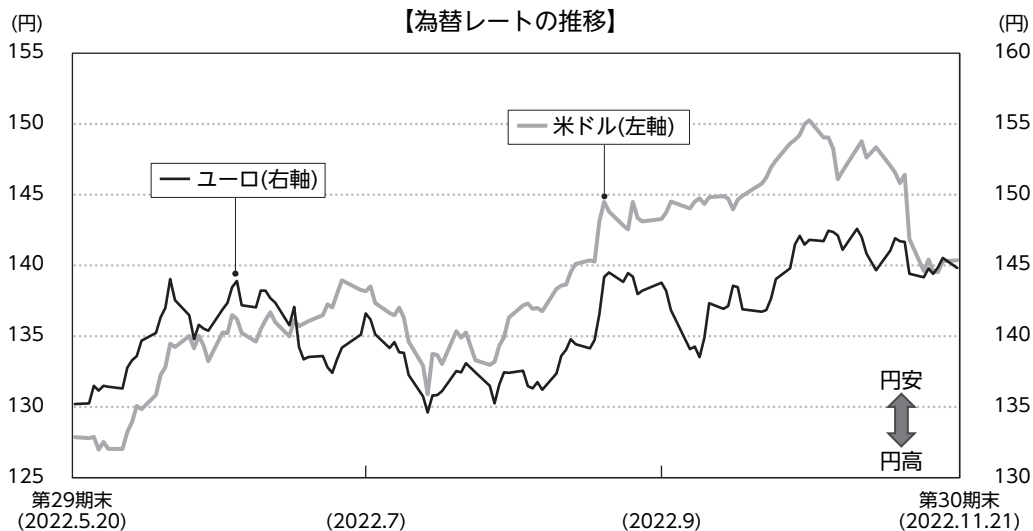
【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

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

■為替市況

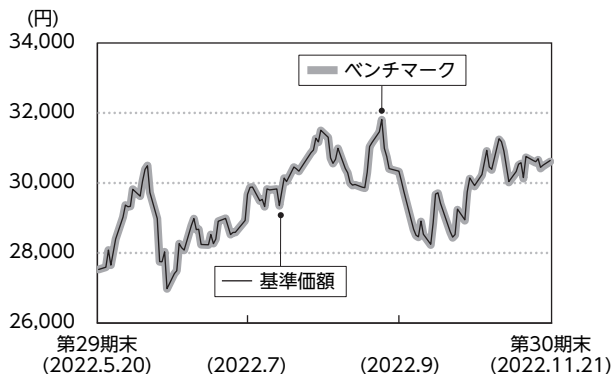


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

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

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2022年5月21日～2022年11月21日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式)	0円	0.001%	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	0.011	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.001)	
			・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	4	0.014	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（29,639円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2022年5月21日～2022年11月21日

(1) 株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

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

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
	81,587	79,760	-	-

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2022年5月21日～2022年11月21日

株式

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

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

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

組入有価証券明細表

2022年11月21日現在

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
10X GENOMICS INC-CLASS A	63	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	467	489	6,208	871,436	資本財
ABBOTT LABORATORIES	1,432	1,505	15,641	2,195,451	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	1,432	1,520	23,559	3,306,759	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	36	38	1,467	206,000	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC	511	544	15,602	2,190,007	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	630	672	4,985	699,705	メディア・娯楽
ADOBE INC	385	406	13,435	1,885,769	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	50	52	769	108,028	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	1,323	1,393	10,249	1,438,689	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	108	116	689	96,840	資本財
AES CORP	541	575	1,591	223,406	公益事業
AFFIRM HOLDINGS INC	135	165	224	31,443	ソフトウェア・サービス
AFLAC INC	507	524	3,723	522,620	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	244	256	3,755	527,138	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	179	190	5,660	794,493	素材
AIRBNB INC-CLASS A	238	322	3,151	442,278	消費者サービス
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	131	137	1,251	175,720	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	94	100	2,785	390,985	素材
ALCOA CORP	-	157	745	104,699	素材
ALIGN TECHNOLOGY INC	60	63	1,238	173,767	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	11	-	-	-	保険
ALLEGION PLC	74	76	863	121,196	資本財
ALLIANT ENERGY CORP	203	215	1,192	167,357	公益事業
ALLSTATE CORP	231	235	3,127	438,936	保険
ALLY FINANCIAL INC	293	274	714	100,348	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	97	103	2,258	316,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	243	5,171	50,382	7,071,635	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	231	4,851	47,446	6,659,603	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	1,489	1,558	6,886	966,619	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	369	7,873	74,125	10,404,262	小売
AMC ENTERTAINMENT HLDGS	-	431	59	8,357	メディア・娯楽
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	417	431	327	45,964	メディア・娯楽
AMCOR PLC	1,257	1,308	1,546	217,035	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	565,772,218	93.2
投資信託証券	12,919,106	2.1
コール・ローン等、その他	28,190,825	4.6
投資信託財産総額	606,882,149	100.0

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月21日現在)

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

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

損益の状況

当期(2022年5月21日~2022年11月21日)

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

- (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。

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 32 期

(計算期間：2022年5月21日～2022年11月21日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く主要国の国債

運用方法

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

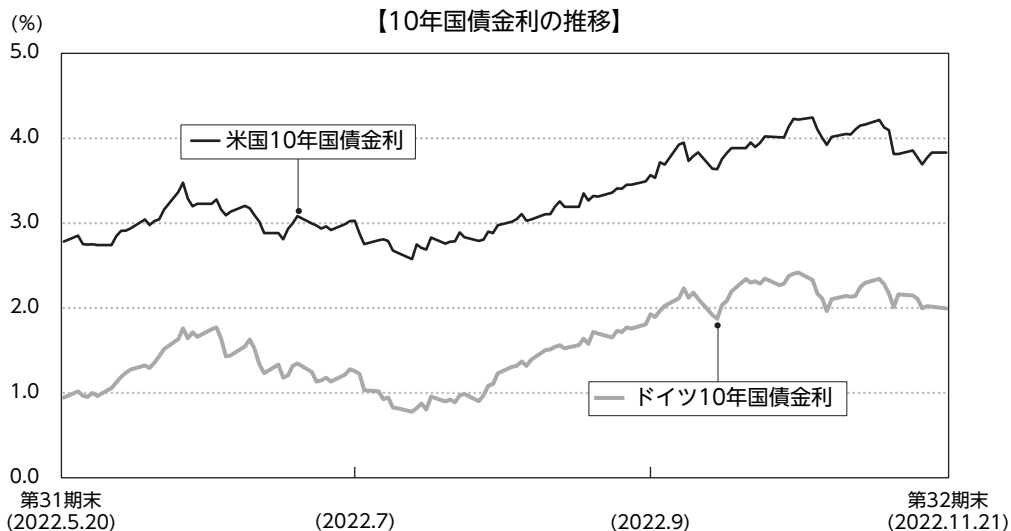
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年5月21日～2022年11月21日

投資環境

■ 海外債券市況

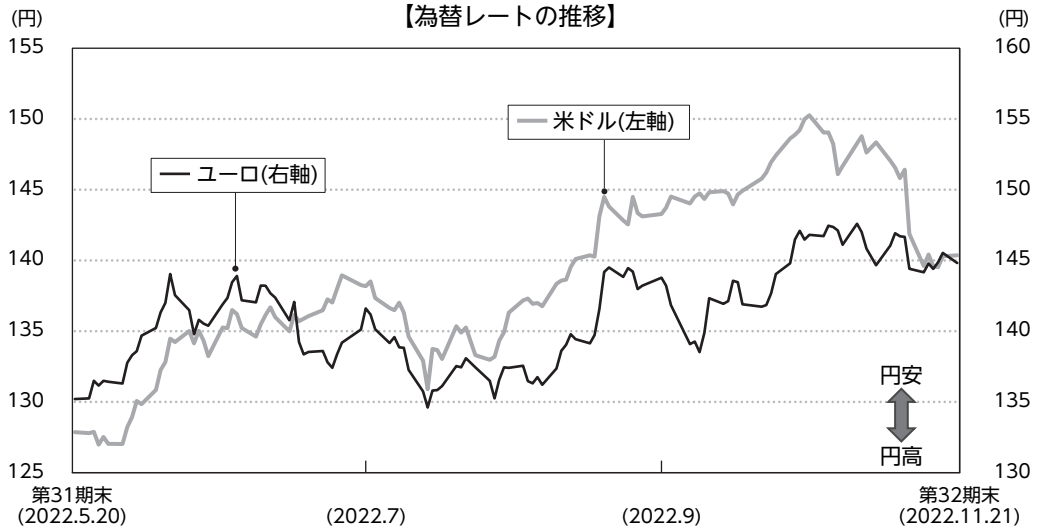


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

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

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

■為替市況

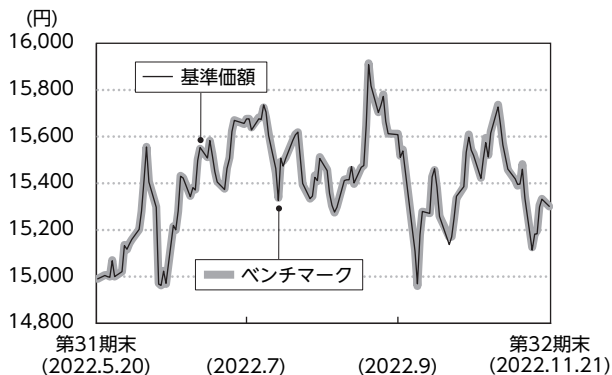


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

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

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2022年5月21日～2022年11月21日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	3円	0.021%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.021)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 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	0.021	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

売買および取引の状況

2022年5月21日～2022年11月21日

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2022年5月21日～2022年11月21日

公社債

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

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2022年11月21日現在

外国（外貨建）公社債

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						邦貨換算金額	
スウェーデン		%		千クェーデン・クローナ	千クェーデン・クローナ	千円	
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2029/11/12	1,390	1,271	16,758	
	SWEDISH GOVERNMENT	0.1250	2031/05/12	1,070	914	12,059	
	SWEDISH GOVERNMENT	2.2500	2032/06/01	1,040	1,066	14,058	
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	890	1,089	14,359	
小計		-	-	-	-	143,144	
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2023/12/07	4,760	4,638	33,455	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2024/09/05	6,580	6,375	45,989	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/05	5,040	5,045	36,394	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0000	2025/03/06	2,100	1,892	13,651	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	8,870	7,958	57,403	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5000	2027/03/04	2,920	2,535	18,288	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	6,820	6,384	46,054	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	5,940	5,725	41,299	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	8,610	7,860	56,697	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	1,720	1,532	11,053	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	1,450	1,530	11,039	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	4,710	4,387	31,644	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	5,070	4,342	31,323	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	5,240	4,588	33,100	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2053/07/31	1,000	870	6,281	
小計		-	-	-	-	473,675	
中国				千人民元	千人民元		
国債証券	CHINAGOVERNMENTBOND	2.2800	2024/03/17	7,000	7,003	137,590	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.1800	2024/06/25	2,200	2,192	43,072	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.4700	2024/09/02	5,600	5,607	110,170	
	CHINAGOVERNMENTBOND	1.9900	2024/09/15	4,000	3,976	78,121	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.2400	2025/05/25	5,500	5,474	107,565	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.1800	2025/08/25	7,000	6,951	136,581	
	CHINAGOVERNMENTBOND	3.0300	2026/03/11	1,200	1,217	23,919	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.6900	2026/08/12	4,400	4,407	86,593	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.3700	2027/01/20	3,200	3,161	62,117	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.4800	2027/04/15	6,700	6,644	130,551	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.5000	2027/07/25	4,800	4,766	93,655	
	CHINAGOVERNMENTBOND	3.0100	2028/05/13	720	728	14,313	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.9100	2028/10/14	5,400	5,456	107,199	
	CHINAGOVERNMENTBOND	2.8000	2029/03/24	3,600	3,600	70,734	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

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

投資信託財産の構成

2022年11月21日現在

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

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1カナダ・ドル104.82円、1オーストラリア・ドル93.41円、1シンガポール・ドル102.07円、1ニュージーランド・ドル86.21円、1イギリス・ポンド166.59円、1イスラエル・シケル40.408円、1デンマーク・クローネ19.47円、1ノルウェー・クローネ13.74円、1スウェーデン・クローナ13.18円、1メキシコ・ペソ7.213円、1人民元19.647円、1マレーシア・リンギット30.617円、1ポーランド・ズロチ30.809円、1ユーロ144.81円です。

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月21日現在)

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

(注1) 期首元本額	33,749,154,108円
期中追加設定元本額	6,095,504,207円
期中一部解約元本額	3,058,388,426円
(注2) 当マザーファンドの当期末元本額における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)	3,204,719,220円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,416,454,023円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,062,600,685円
ニッセイ外国債券インデックスSA(適格機関投資家限定)	864,520,535円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)	
SA(適格機関投資家限定)	2,743,596円
ニッセイインデックスバランス(標準型)	
SA(適格機関投資家限定)	6,743,242円
ニッセイインデックスバランス(成長型)	
SA(適格機関投資家限定)	5,156,272円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	14,361,888,951円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	4,034,335,050円
DCニッセイ外国債券インデックス	3,289,166,819円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	194,490,072円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	1,733,127,766円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	222,180,351円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	437,042,241円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	70,272,806円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	170,801,283円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	18,635,379円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	41,316,219円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	140,408,215円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	93,510,516円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	206,076,638円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	191,924,583円
FWニッセイ外国債券インデックス	10,493,180円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	7,662,247円

損益の状況

当期(2022年5月21日~2022年11月21日)

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

- (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。

・ 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。"

・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

・ 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。