

第2期末(2023年11月20日)

基準価額	9,076円
純資産総額	113百万円
騰落率	7.7%
分配金	0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)

追加型投信/海外/株式/インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2022年11月22日~2023年11月20日

第2期(決算日 2023年11月20日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「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)」は、このたび第2期の決算を行いました。

当ファンドは、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に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、円ヘッジベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00~17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



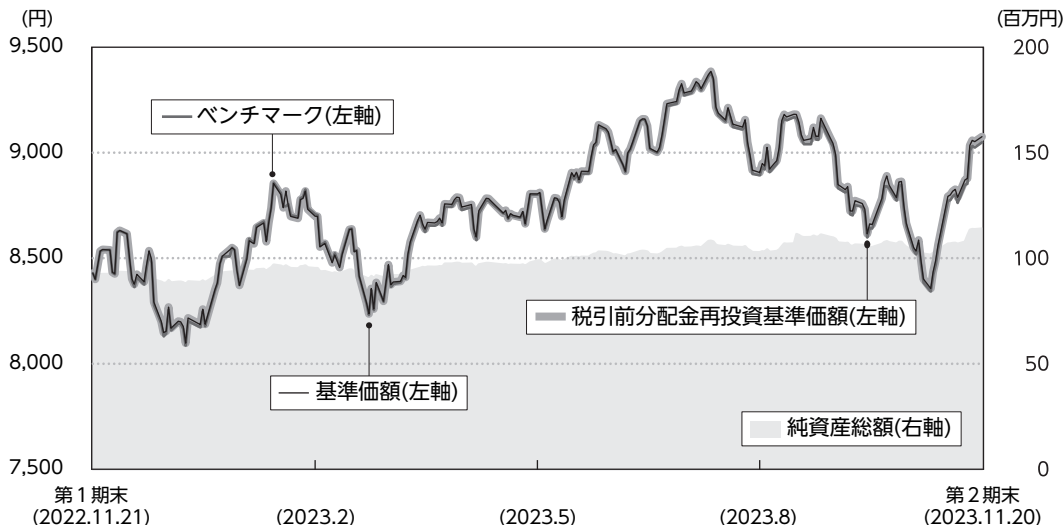
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年11月22日～2023年11月20日

基準価額等の推移



第2期首	8,429円	既払分配金	0円
第2期末	9,076円	騰落率(分配金再投資ベース)	7.7%

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

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

(注3) ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジベース)で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・2023年6月に米連邦公開市場委員会(FOMC)において市場の予想通り利上げが見送られたことに加えて、堅調な経済指標や米消費者物価指数(CPI)の減速を受けて米景気の軟着陸(ソフトランディング)への期待感が強まったことなどから株価が上昇したこと
- ・11月にFOMCで追加利上げ観測が後退したことなどを受けて株価が上昇したこと

<下落要因>

- ・2022年12月にFOMCにおいて2023年の政策金利見通しが想定よりも上振れしたことが嫌気され株価が下落したこと
- ・2023年9月に米連邦準備制度理事会(FRB)による金融引き締めに向き姿勢を受けて米金利が上昇する中、幅広いセクターで株価が下落したこと

1万口当たりの費用明細

項目	第2期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	6円	0.071%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は8,756円です。</p>
(投信会社)	(3)	(0.038)	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)	(1)	(0.011)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(2)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.001)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.006	
(株式)	(1)	(0.006)	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	0.025	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.018)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.001)	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)	(1)	(0.006)	<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	9	0.104	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含まず。

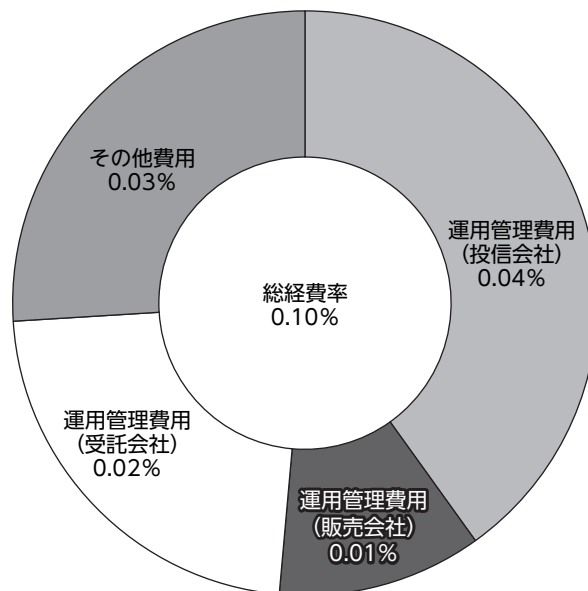
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

（参考情報）

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.10%**です。



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

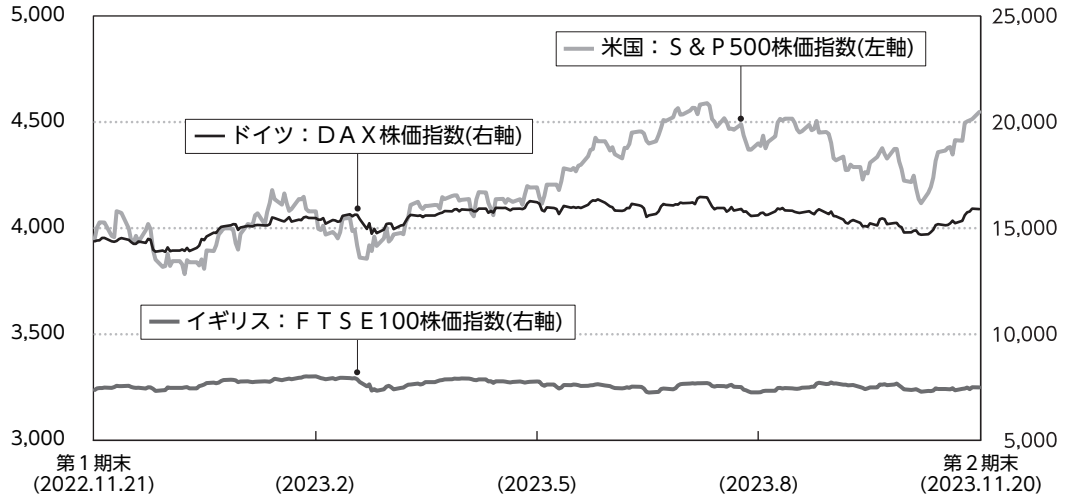
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

海外株式市況

【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欧米の金融システム不安や地政学リスクの高まりから下落する場面もありましたが、世界の主要な中央銀行による利上げの最終局面入りが意識されたことなどを背景に上昇しました。

2022年12月にFOMCにおいて2023年の政策金利見通しが想定よりも上振れしたことが嫌気され下落しましたが、その後は欧米各国における物価上昇率鈍化を背景に金融引き締め長期化への警戒感が和らぎ2023年2月にかけて株価はおおむね上昇しました。3月から5月にかけては、米国において複数の銀行が経営破綻したことや大手金融機関クレディ・スイス・グループの経営不安が高まったことなどが嫌気されて株価は下落する場面もありましたが、欧米各国の当局による資金繰り支援や救済措置などの迅速な対応により市場心理が改善したこと、市場予想を上回る決算を発表した大型ハイテク株が堅調に推移したことなどから上昇しました。6月から7月にかけては、米国における債務上限法案の上下院での可決や堅調な経済指標を背景とした景気のソフトランディングへの期待感が強まったことなどから株価は上昇しました。その後は米国債の格下げや9月にFRBによる金融引き締めに向き姿勢を受けて米金利が上昇したこと、米国の政府閉鎖問題、中東情勢の緊迫化を背景に株価は下落したものの、11月に入るとFOMCで追加利上げ観測が後退したことなどを反発し、結局、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

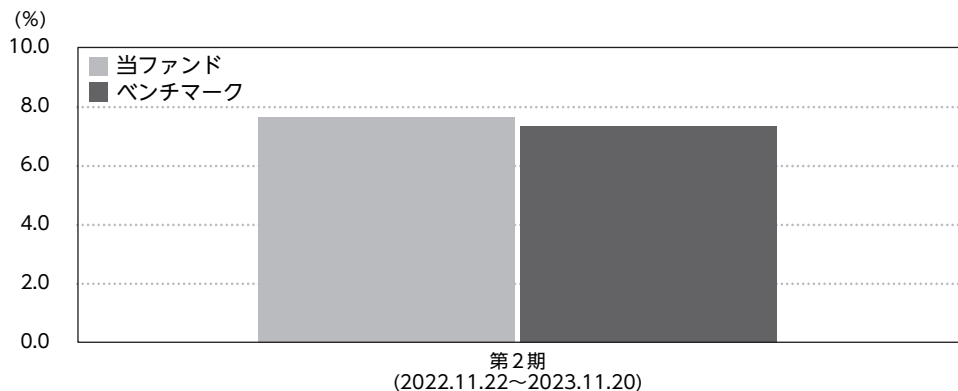
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました。なお、実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図りました。

■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した。

*ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）です。ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+7.7%となり、ベンチマーク騰落率（+7.4%）におおむね連動しました。

（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。

なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

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

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

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

今後の運用方針

■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要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。なお、実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。

■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。

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2期末 2023年11月20日
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	99.9%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

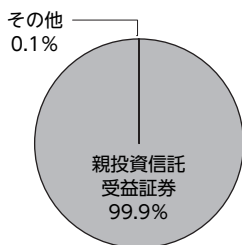
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

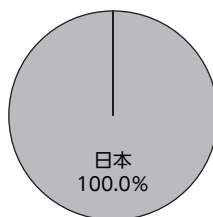
項目	第2期末 2023年11月20日
純資産総額	113,964,171円
受益権総口数	125,571,085口
1万口当たり基準価額	9,076円

(注) 当期間中における追加設定元本額は17,428,761円、同解約元本額は140,316円です。

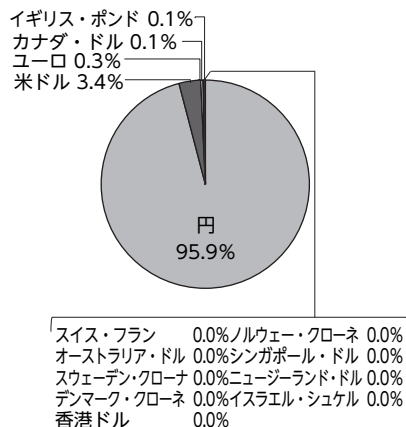
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分

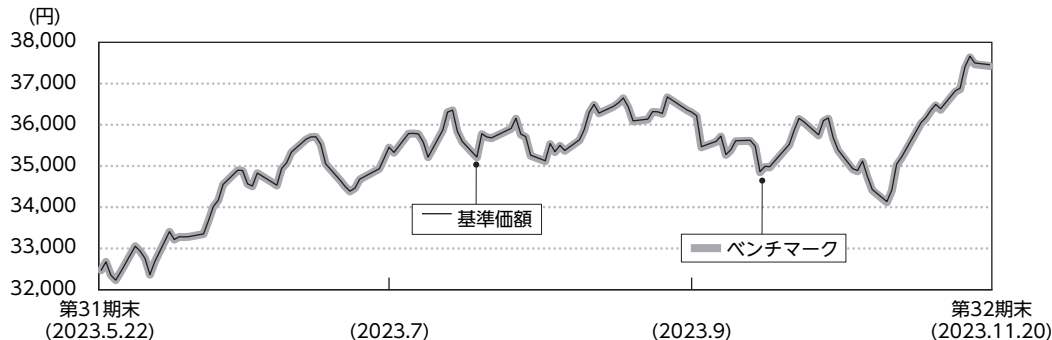


(注1) 資産別・国別・通貨別配分は、2023年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注2) 通貨別配分については、実質組入比率を記載しています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

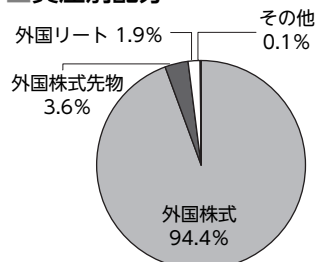
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	5.4%
MICROSOFT CORP	米ドル	4.7%
S&P 500 EMINI FUTURE 202312 買	米ドル	2.7%
AMAZON.COM INC	米ドル	2.4%
NVIDIA CORP	米ドル	2.2%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.4%
META PLATFORMS INC-A	米ドル	1.3%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.3%
TESLA, INC.	米ドル	1.2%
UNITEDHEALTH GROUP INC	米ドル	0.9%
組入銘柄数		1278

■ 1万口当たりの費用明細

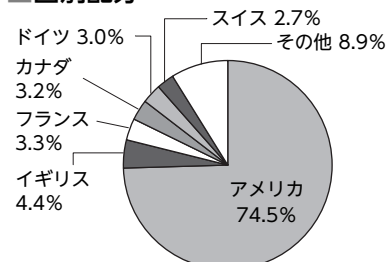
2023.5.23~2023.11.20

項目	金額
売買委託手数料 (株式)	0円
(先物・オプション)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	1
(投資信託証券)	(1)
その他費用 (保管費用)	3
(その他)	(0)
合計	5

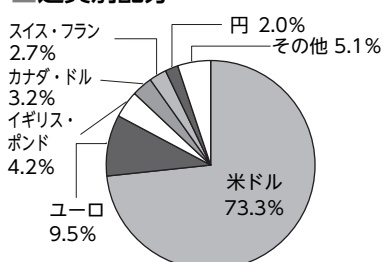
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

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

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

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	ベンチ マーク	期中 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	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金						
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	百万円
2021年11月19日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	100
1期(2022年11月21日)	8,429	0	△15.7	8,429	8,380	△16.2	89.9	2.8	2.1	91
2期(2023年11月20日)	9,076	0	7.7	9,076	8,997	7.4	94.3	3.6	1.9	113

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

(注3) 「基準価額+累計分配金」は、当該決算期の基準価額（分配落）に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

(注4) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注5) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注6) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注7) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

(注8) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチ マーク		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	騰落率	騰落率					
	円	%		%	%	%	%
(期首) 2022年11月21日	8,429	-	8,380	-	89.9	2.8	2.1
11月末	8,426	△ 0.0	8,375	△ 0.1	90.5	1.9	2.1
12月末	8,216	△ 2.5	8,153	△ 2.7	91.5	3.4	2.1
2023年 1 月末	8,578	1.8	8,536	1.9	95.1	3.1	2.2
2 月末	8,515	1.0	8,474	1.1	98.2	3.9	2.2
3 月末	8,578	1.8	8,521	1.7	93.4	3.3	2.0
4 月末	8,725	3.5	8,660	3.3	97.0	2.2	2.1
5 月末	8,763	4.0	8,726	4.1	97.7	2.9	2.0
6 月末	9,049	7.4	8,993	7.3	98.9	3.7	2.0
7 月末	9,370	11.2	9,308	11.1	93.5	2.8	1.9
8 月末	9,181	8.9	9,111	8.7	96.3	4.3	1.9
9 月末	8,772	4.1	8,701	3.8	97.0	3.6	1.9
10 月末	8,436	0.1	8,373	△ 0.1	95.3	3.0	1.8
(期末) 2023年11月20日	9,076	7.7	8,997	7.4	94.3	3.6	1.9

(注) 期末基準価額は分配金（税引前）込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2022年11月22日～2023年11月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	8,348	27,126	6,390	21,521

(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	110,423,097千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	639,236,458千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) 外国株式の(a)は各月末（決算日の属する月については決算日）、(b)は各月末の国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

利害関係人との取引状況等

2022年11月22日～2023年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2023年11月20日現在

種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	28,452	30,410	113,901

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ外国株式インデックスマザーファンド全体の口数は220,818,463千口です。

投資信託財産の構成

2023年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	113,901	99.5
コール・ローン等、その他	626	0.5
投資信託財産総額	114,527	100.0

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

項目	当期末
(A) 資産	222,714,315円
コール・ローン等	36,463
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	113,901,183
未収入金	108,776,669
(B) 負債	108,750,144
未払金	108,712,337
未払信託報酬	37,275
その他未払費用	532
(C) 純資産総額(A-B)	113,964,171
元本	125,571,085
次期繰越損益金	△ 11,606,914
(D) 受益権総口数	125,571,085口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,076円

(注1) 期首元本額 108,282,640円
期中追加設定元本額 17,428,761円
期中一部解約元本額 140,316円

(注2) 元本の欠損
純資産総額は元本額を下回っており、その差額は11,606,914円です。

損益の状況

当期(2022年11月22日~2023年11月20日)

項目	当期
(A) 有価証券売買損益	7,276,208円
売 買 益	34,178,498
売 買 損	△26,902,290
(B) 信託報酬等	△ 77,387
(C) 当期損益金(A+B)	7,198,821
(D) 前期繰越損益金	△15,750,381
(繰越欠損金)	(△15,750,381)
(E) 追加信託差損益金*	△ 3,055,354
(売買損益相当額)	(△ 3,055,354)
(F) 合計(C+D+E)	△11,606,914
次期繰越損益金(F)	△11,606,914
追加信託差損益金	△ 3,055,354
(売買損益相当額)	(△ 3,055,354)
繰越欠損金	△ 8,551,560

(注1) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (B)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (D)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注4) (E)追加信託差損益金*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	0円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	0円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	0円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	0.00円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■ 自社による当ファンドの設定解約状況

当期における自社による当ファンドの設定解約はありません。なお当期末現在、自社による当ファンドの保有残高は90百万円（元本100百万円、ファンド全体の79.6%）です。当社は当該保有分を解約することがあります。

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	<p>①ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に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、円ヘッジベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。</p> <p>②実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い為替変動リスクの低減を図ります。</p>	
主要運用対象	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）	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券
	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
運用方法	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）	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。	

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 32 期

(計算期間：2023年5月23日～2023年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

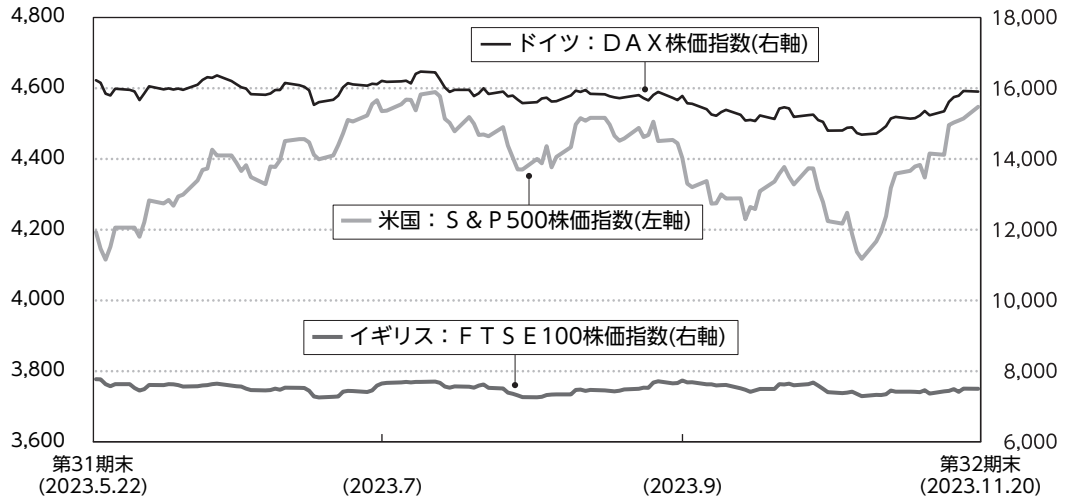
運用経過

2023年5月23日～2023年11月20日

投資環境

■海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】

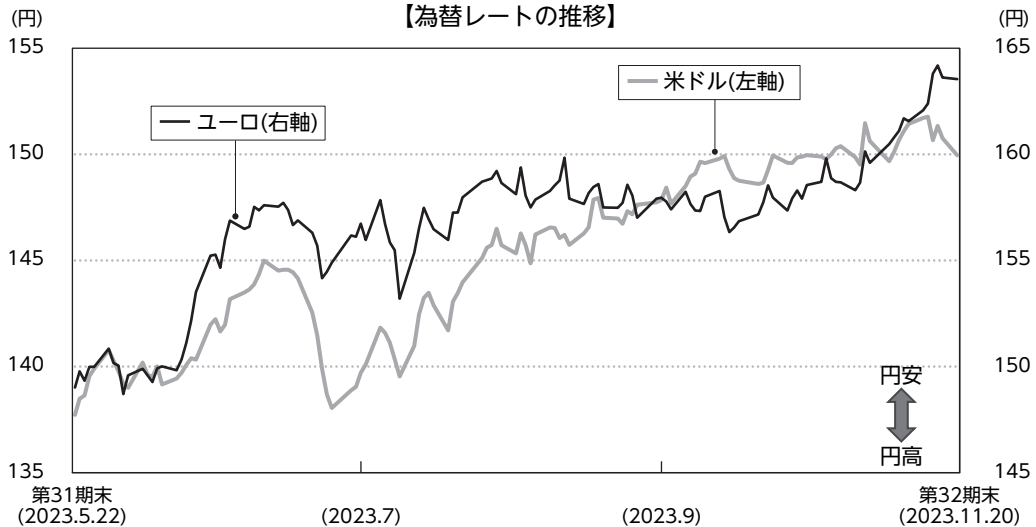


(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

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

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

■為替市況



(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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

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

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

お知らせ

■約款変更

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

(2023年8月19日)

最近5期の運用実績

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

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式)	0円	0.001%	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.003	
(株式)	(1)	(0.003)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 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	3	0.008	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(保管費用)	(3)	(0.008)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	5	0.013	・ 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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

売買および取引の状況

2023年5月23日～2023年11月20日

(1) 株式

	買付		売付		
	株数	金額	株数	金額	
外国	アメリカ	百株 30,057 (1,299)	千米ドル 282,332 (△ 135)	百株 5,304	千米ドル 28,957
	カナダ	3,162 (224)	千カナダ・ドル 18,932 (△ 96)	135	千カナダ・ドル 678
	オーストラリア	5,194 (△ 456)	千オーストラリア・ドル 11,696	131	千オーストラリア・ドル 54
	香港	5,551	千香港ドル 17,481	486	千香港ドル 1,242
	シンガポール	21,395	千シンガポール・ドル 2,625 (△ 23)	263	千シンガポール・ドル 344
	ニュージーランド	384	千ニュージーランド・ドル 334	6	千ニュージーランド・ドル 28
	イギリス	24,825	千イギリス・ポンド 17,312 (△ 261)	4,652	千イギリス・ポンド 953
	イスラエル	411	千イスラエル・シェケル 1,651	2,120	千イスラエル・シェケル 2,816
	スイス	1,174 (398)	千スイス・フラン 9,750 (△ 8)	3,614	千スイス・フラン 1,849
	デンマーク	348 (1,587)	千デンマーク・クローネ 20,170	6	千デンマーク・クローネ 390
ノルウェー	421	千ノルウェー・クローネ 7,476	29	千ノルウェー・クローネ 960	
スウェーデン	2,914 (161)	千スウェーデン・クローナ 46,530	2,433	千スウェーデン・クローナ 23,525	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ) NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I	千□ — (1)	千米ドル —	千□ 1	千米ドル 15
(カナダ) CAN APARTMENT PROP REAL ESTA RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.402 0.895	千カナダ・ドル 19 16	— —	千カナダ・ドル — —
(オーストラリア) GPT GROUP GOODMAN GROUP STOCKLAND MIRVAC GROUP VICINITY CENTRES LENDLEASE GROUP SCENTRE GROUP DEXUS/AU	13 12 16 27 27 4 35 7	千オーストラリア・ドル 53 263 67 61 49 37 94 58	— — — — — — — —	千オーストラリア・ドル — — — — — — — —
(香港) LINK REIT	52	千香港ドル 2,345	—	千香港ドル —
(シンガポール) CAPITALAND ASCENDAS REIT CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST KEPPEL REIT MAPLETREE LOGISTICS TRUST MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	58 38 — 32 17	千シンガポール・ドル 162 (△ 3) 72 (△ 1) — (23) 53 (△ 6) 27 (△0.822)	— — 28 — —	千シンガポール・ドル — — 23 — —
(イギリス) BRITISH LAND CO PLC LAND SECURITIES GROUP PLC SEGRO PLC	2 4 5	千イギリス・ポンド 7 29 44	83 — 1	千イギリス・ポンド 270 — 13
(ユーロ/ベルギー) WAREHOUSES DE PAUW SCA	1	千ユーロ 35	—	千ユーロ —
(ユーロ/フランス) KLEPIERRE	1	34 (△ 17)	—	—

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	0.322	31	—	—
	COVIVIO	0.711	31	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1	50	—	—

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2023年5月23日～2023年11月20日

株式

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

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

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

組入有価証券明細表

2023年11月20日現在

(1) 外国株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
THOMSON REUTERS CORP	156	158	2,988	326,454	商業・専門サービス
TMX GROUP LTD	52	280	812	88,760	金融サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	77	82	940	102,742	資本財
TORONTO-DOMINION BANK	1,678	1,829	15,511	1,694,670	銀行
TOURMALINE OIL CORP	297	320	2,128	232,591	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD	53	56	596	65,186	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	418	450	2,826	308,777	素材
WSP GLOBAL INC	115	124	2,369	258,882	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	36,824 84	40,075 85	242,290 -	26,470,279 <3.2%>
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル		
AMPOL LTD	219	236	793	77,427	エネルギー
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	2,764	2,986	7,189	701,445	銀行
APA GROUP	1,090	1,253	1,045	101,967	公益事業
ARISTOCRAT LEISURE LTD	548	584	2,352	229,571	消費者サービス
ASX LTD	179	192	1,101	107,475	金融サービス
AURIZON HOLDINGS LTD	1,699	1,827	665	64,911	運輸
BHP GROUP LIMITED	4,683	5,035	23,468	2,289,849	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	427	451	923	90,091	素材
BRAMBLES LTD	1,282	1,379	1,816	177,219	商業・専門サービス
COCHLEAR LTD	60	65	1,694	165,368	ヘルスケア機器・サービス
COLES GROUP LTD	1,237	1,330	2,051	200,137	生活必需品流通・小売り
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,566	1,666	17,072	1,665,746	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED	502	570	1,348	131,536	商業・専門サービス
CSL LIMITED	445	479	12,400	1,209,952	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	1,323	1,425	701	68,436	生活必需品流通・小売り
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,565	1,683	4,246	414,318	素材
IDP EDUCATION LTD	193	249	593	57,867	消費者サービス
IGO LTD	629	677	602	58,792	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	2,275	2,422	1,419	138,518	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	411	437	2,103	205,267	素材
LOTTERY CORP LTD/THE	2,056	2,208	1,007	98,267	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	339	364	6,108	596,053	金融サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,546	2,736	971	94,793	保険
MINERAL RESOURCES LTD	157	173	1,103	107,693	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,914	3,121	8,654	844,455	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	824	-	-	-	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
SIKA AG-BEARER	135	145	3,424	579,510	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	48	51	1,198	202,860	ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG	103	110	1,330	225,144	ヘルスケア機器・サービス	
SWATCH GROUP AG	26	28	674	114,216	耐久消費財・アパレル	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	28	29	1,692	286,480	保険	
SWISS PRIME SITE-REG	70	76	647	109,560	不動産管理・開発	
SWISS RE AG	278	299	2,996	507,000	保険	
SWISSCOM AG	24	26	1,333	225,582	電気通信サービス	
TEMENOS GROUP AG-REG	58	63	439	74,370	ソフトウェア・サービス	
THE SWATCH GROUP AG-REG	50	53	237	40,271	耐久消費財・アパレル	
UBS GROUP AG	3,094	3,267	7,561	1,279,628	金融サービス	
VAT GROUP AG	24	26	1,016	171,955	資本財	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	139	149	6,534	1,105,761	保険	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,045 43	15,004 45	131,049 -	22,176,253 <2.7%>	
(デンマーク)			千デンマーク・クローネ			
A P MOLLER - MAERSK A/S	4	4	4,928	108,074	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S	2	3	3,103	68,067	運輸	
CARLSBERG AS-B	89	97	8,297	181,966	食品・飲料・タバコ	
CHR HANSEN HOLDING A/S	97	104	5,737	125,821	素材	
COLOPLAST-B	109	118	8,803	193,053	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S	637	685	12,152	266,498	銀行	
DEMANT A/S	85	100	2,754	60,415	ヘルスケア機器・サービス	
DSV A/S	173	184	20,067	440,070	運輸	
GENMAB A/S	60	65	14,552	319,133	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVO-NORDISK A/S	1,530	3,243	225,195	4,938,537	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	189	203	7,323	160,603	素材	
ORSTED A/S	174	188	5,882	128,996	公益事業	
PANDORA A/S	83	83	7,736	169,652	耐久消費財・アパレル	
ROCKWOOL A/S-B SHS	8	9	1,511	33,146	資本財	
TRYGVESTA AS	333	348	4,987	109,365	保険	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	933	1,003	17,834	391,114	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,515 16	6,444 16	350,867 -	7,694,519 <0.9%>	
(ノルウェー)			千ノルウェー・クローネ			
ADEVINTA ASA-B	269	289	3,156	43,777	メディア・娯楽	
AKER BP ASA	291	313	9,659	133,975	エネルギー	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	□数	□数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	
KLEPIERRE	19	21	492	80,601	
GECINA SA	4	4	454	74,317	
COVIVIO	4	5	226	36,969	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10	11	641	104,934	
小計	□数・金額	39	42	1,814	296,824
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
ユーロ計	□数・金額	54	59	2,235	365,657
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.0%>
合計	□数・金額	4,914	5,244	—	15,356,225
	銘柄数<比率>	58	56	—	<1.9%>

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2023年11月20日現在

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

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

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

損益の状況

当期(2023年5月23日~2023年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	6,521,239,758円
受 取 配 当 金	6,238,208,851
受 取 利 息	61,970,427
受 取 他 収 益	224,459,610
支 払 利 息	△ 3,399,130
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	98,381,228,951
売 買 損 益	129,007,619,592
売 買 損 益	△ 30,626,390,641
(C)先 物 取 引 等 損 益	1,018,859,721
取 引 損 益	1,903,646,971
取 引 損 益	△ 884,787,250
(D)信 託 報 酬 等	△ 63,394,060
(E)当期損益金(A + B + C + D)	105,857,934,370
(F)前期繰越損益金	462,865,060,071
(G)追加信託差損益金	65,902,196,199
(H)解約差損益金	△ 28,385,789,827
(I)合 計(E + F + G + H)	606,239,400,813
次 期 繰 越 損 益 金(I)	606,239,400,813

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円ヘッジベース）

MSCI 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。

- ・MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

MSCI 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。