

## 第2期末（2023年11月20日）

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 12,635円 |
| 純資産総額 | 227億円   |
| 騰落率   | 22.1%   |
| 分配金   | 0円      |

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

# ニッセイ先進国株式インデックス (為替ヘッジなし) (ラップ専用)

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(為替ヘッジなし)(ラップ専用)」は、このたび第2期の決算を行いました。

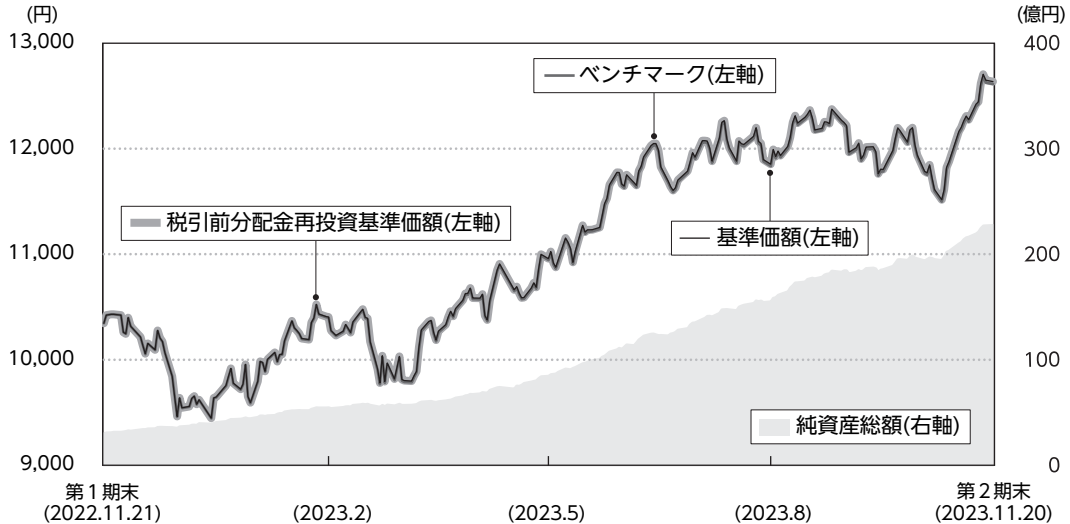
当ファンドは、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

# 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 | 10,345円 | 既払分配金          | 0円    |
| 第2期末 | 12,635円 | 騰落率（分配金再投資ベース） | 22.1% |

- (注1) 税引前分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 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、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>

- ・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       | 8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11,060円です。</p>                 |
| (投信会社)     | ( 4) | (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    | 0.003   |   |
| (株式)       | ( 0) | (0.002) | 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数   |
| (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    | 0.007   |   |
| (株式)       | ( 1) | (0.007) | 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    | 0.019   | 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)      | ( 0) | (0.000) | <ul style="list-style-type: none"> <li>信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用</li> <li>借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息</li> </ul> |
| 合計         | 11   | 0.100   |   |

(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。

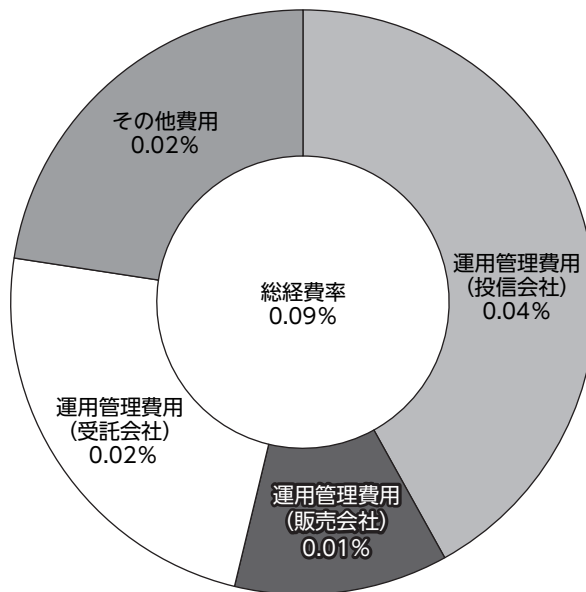
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.09%**です。



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

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

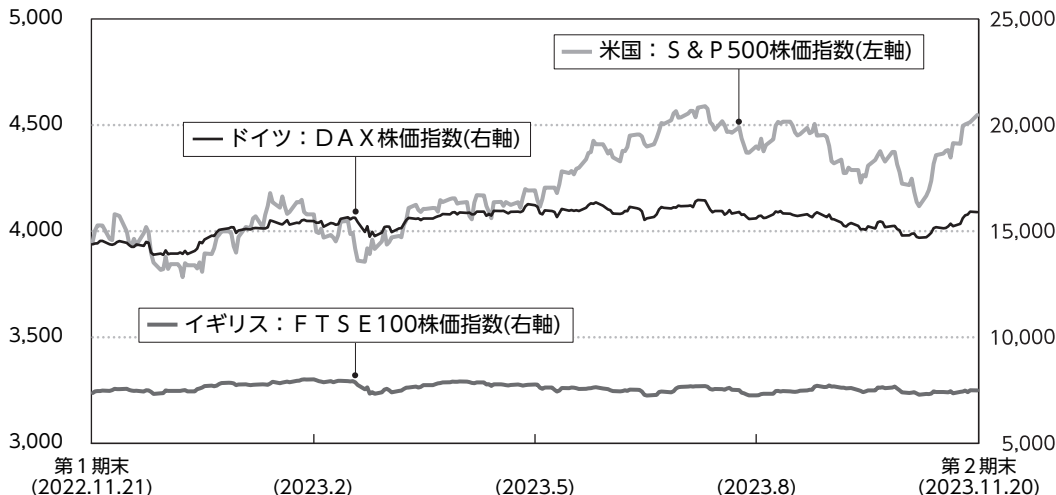
(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

## 投資環境

## ■ 海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】

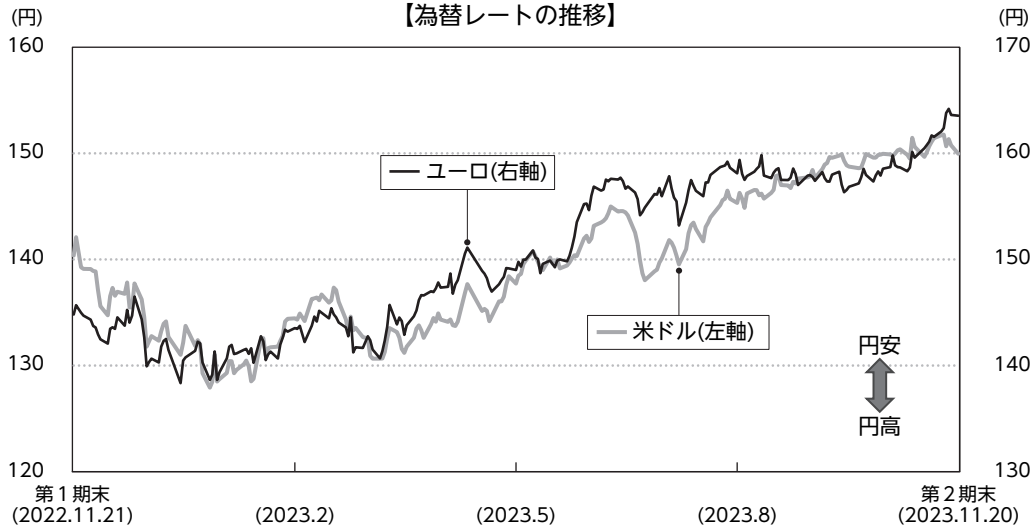


(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

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前向きな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受けて反発し、結局、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

■為替市況



（注）為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、期初から2023年1月中旬にかけて日銀によるイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、YCC）の修正などから米ドル安円高基調で推移しましたが、その後は堅調な米経済指標や植田日銀新総裁が金融緩和を継続するとの見方が強まったことから米ドル高円安基調に転じました。7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けて大きく円高に振れる場面があったものの、その後は米国が利上げ方向である一方で日本が金融緩和方向であったことから日米金利差が拡大し、大幅な米ドル高円安基調となりました。11月には米国の将来の利下げ観測が意識される一方で日本の金融政策正常化観測が高まったことでやや米ドル安円高となりましたが、結局、期を通じて見ると米ドル高円安で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、期初から2023年1月中旬にかけて日銀によるYCCの修正などからユーロ安円高基調で推移しましたが、その後は欧州中央銀行（ECB）が継続的に物価上昇リスクを警戒していたことや米金利の上昇に連れて欧州金利が上昇したことなどからユーロ高円安基調に転じました。7月には日銀の金融政策が修正されるとの見方を受けてユーロ安円高に転じましたが、その後は日・欧中央銀行の金融政策の影響を受けて上下に振れつつも横ばい圏での推移となりました。11月には大手格付け機関によるイタリア国債の格下げが回避されたことなどを受けてユーロに対する懸念が後退したことや日銀の金融緩和政策継続への見方が強まったことなどからユーロ高円安となり、結局、期を通じて見るとユーロ高円安で当期末を迎えました。

## ポートフォリオ

### ■当ファンド

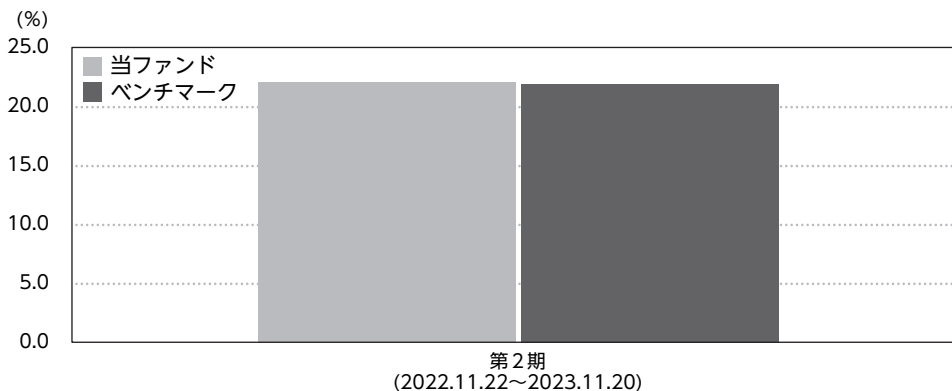
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

### ■マザーファンド

日本を除く主要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+22.1%となり、ベンチマーク騰落率（+21.9%）にほぼ連動しました。

（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<br>2022年11月22日～2023年11月20日 |
|------------|-------------------------------|
| 当期分配金(税引前) | —                             |
| 対基準価額比率    | —                             |
| 当期の収益      | —                             |
| 当期の収益以外    | —                             |
| 翌期繰越分配対象額  | 2,634円                        |

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

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

## 今後の運用方針

### ■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要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。

### ■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<br>2023年11月20日 |
|---------------------------|---------------------|
| ニッセイ外国株式インデックス<br>マザーファンド | 100.0%              |

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

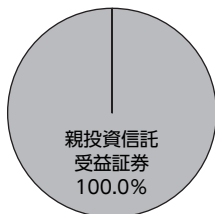
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

### ■純資産等

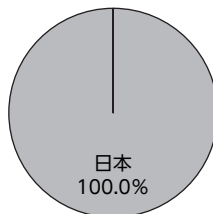
| 項目         | 第2期末<br>2023年11月20日 |
|------------|---------------------|
| 純資産総額      | 22,732,393,875円     |
| 受益権総口数     | 17,991,852,184口     |
| 1万口当たり基準価額 | 12,635円             |

(注) 当期間中における追加設定元本額は16,116,008,110円、同解約元本額は1,025,520,646円です。

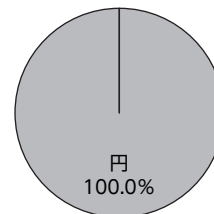
### ■資産別配分



### ■国別配分



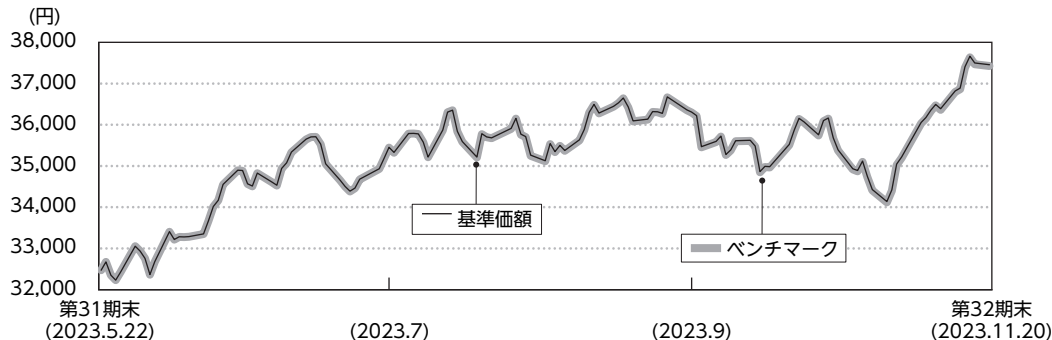
### ■通貨別配分



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

## ニッセイ外国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

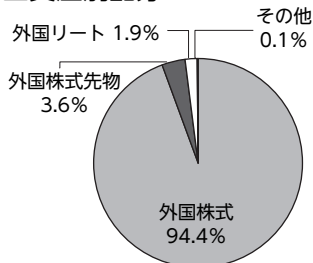
| 銘柄名                           | 通貨  | 比率   |
|-------------------------------|-----|------|
| APPLE INC                     | 米ドル | 5.4% |
| MICROSOFT CORP                | 米ドル | 4.7% |
| S&P 500 EMINI FUTURE 202312 買 | 米ドル | 2.7% |
| AMAZON.COM INC                | 米ドル | 2.4% |
| NVIDIA CORP                   | 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

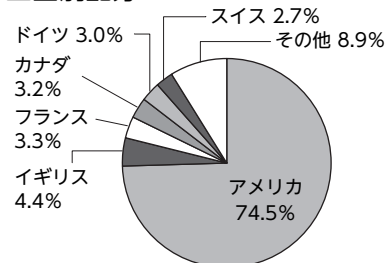
2023.5.23~2023.11.20

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

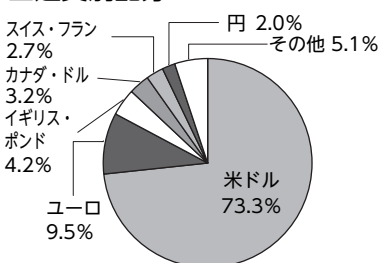
### ■ 資産別配分



### ■ 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<br>(分配落) | 税引前<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (ご参考)          | ベンチ<br>マーク | 期中<br>騰落率 | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純資産<br>総額 |
|-----------------|---------------|------------|-----------|----------------|------------|-----------|------------|------------|--------------------|-----------|
|                 |               |            |           | 基準価額+<br>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     | -         | -          | -          | -                  | 1         |
| 1期(2022年11月21日) | 10,345        | 0          | 3.5       | 10,345         | 10,332     | 3.3       | 94.1       | 2.9        | 2.1                | 3,001     |
| 2期(2023年11月20日) | 12,635        | 0          | 22.1      | 12,635         | 12,597     | 21.9      | 94.4       | 3.6        | 1.9                | 22,732    |

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

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

(注4) 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<br>マーク |       | 株式<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 |
|-----------------|--------|-------|------------|-------|------------|------------|--------------------|
|                 | 基準価額   | 騰落率   | ベンチ<br>マーク | 騰落率   |            |            |                    |
| (期首)2022年11月21日 | 円      | %     |            | %     | %          | %          | %                  |
| 11月末            | 10,345 | -     | 10,332     | -     | 94.1       | 2.9        | 2.1                |
| 12月末            | 10,245 | △ 1.0 | 10,232     | △ 1.0 | 95.7       | 2.0        | 2.2                |
| 2023年1月末        | 9,619  | △ 7.0 | 9,604      | △ 7.0 | 94.0       | 3.5        | 2.2                |
| 2月末             | 9,982  | △ 3.5 | 9,965      | △ 3.5 | 94.5       | 3.1        | 2.2                |
| 3月末             | 10,333 | △ 0.1 | 10,313     | △ 0.2 | 93.8       | 3.7        | 2.1                |
| 4月末             | 10,282 | △ 0.6 | 10,258     | △ 0.7 | 94.4       | 3.4        | 2.0                |
| 5月末             | 10,563 | 2.1   | 10,537     | 2.0   | 95.7       | 2.1        | 2.1                |
| 6月末             | 11,054 | 6.9   | 11,026     | 6.7   | 95.7       | 2.9        | 2.0                |
| 7月末             | 11,923 | 15.3  | 11,891     | 15.1  | 94.3       | 3.5        | 1.9                |
| 8月末             | 12,103 | 17.0  | 12,072     | 16.8  | 95.1       | 2.8        | 1.9                |
| 9月末             | 12,313 | 19.0  | 12,280     | 18.9  | 93.8       | 4.2        | 1.9                |
| 10月末            | 12,015 | 16.1  | 11,983     | 16.0  | 94.5       | 3.5        | 1.8                |
| (期末)2023年11月20日 | 11,611 | 12.2  | 11,578     | 12.1  | 95.0       | 3.0        | 1.8                |
|                 | 12,635 | 22.1  | 12,597     | 21.9  | 94.4       | 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 | 5,438,214 | 18,322,211 | 348,224 | 1,203,572 |

(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 | 979,463 | 6,069,453 | 22,732,529 |

(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 | 22,732,529 | 99.9  |
| コール・ローン等、その他          | 16,025     | 0.1   |
| 投資信託財産総額              | 22,748,554 | 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                    |
|----------------------------|------------------------|
| <b>(A) 資産</b>              | <b>22,748,554,871円</b> |
| コール・ローン等                   | 5,376,508              |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 22,732,529,408         |
| 未収入金                       | 10,648,955             |
| <b>(B) 負債</b>              | <b>16,160,996</b>      |
| 未払解約金                      | 10,515,168             |
| 未払信託報酬                     | 5,560,369              |
| その他未払費用                    | 85,459                 |
| <b>(C) 純資産総額(A-B)</b>      | <b>22,732,393,875</b>  |
| 元本                         | 17,991,852,184         |
| 次期繰越損益金                    | 4,740,541,691          |
| <b>(D) 受益権総口数</b>          | <b>17,991,852,184口</b> |
| 1万口当たり基準価額(C/D)            | <b>12,635円</b>         |

(注) 期首元本額 2,901,364,720円  
 期中追加設定元本額 16,116,008,110円  
 期中一部解約元本額 1,025,520,646円

損益の状況

当期 (2022年11月22日~2023年11月20日)

| 項目                      | 当期                   |
|-------------------------|----------------------|
| <b>(A) 配当等収益</b>        | <b>△ 487円</b>        |
| 受取利息                    | 48                   |
| 支払利息                    | △ 535                |
| <b>(B) 有価証券売買損益</b>     | <b>2,511,635,716</b> |
| 売買損益                    | 2,611,970,952        |
| 売買損                     | △ 100,335,236        |
| <b>(C) 信託報酬等</b>        | <b>△ 7,548,652</b>   |
| <b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b> | <b>2,504,086,577</b> |
| <b>(E) 前期繰越損益金</b>      | <b>78,450,416</b>    |
| (分配準備積立金)               | ( 78,450,422)        |
| (繰越欠損金)                 | (△ 6)                |
| <b>(F) 追加信託差損益金*</b>    | <b>2,158,004,698</b> |
| (配当等相当額)                | ( 461,278,057)       |
| (売買損益相当額)               | ( 1,696,726,641)     |
| <b>(G) 合計(D+E+F)</b>    | <b>4,740,541,691</b> |
| <b>次期繰越損益金(G)</b>       | <b>4,740,541,691</b> |
| 追加信託差損益金                | 2,158,004,698        |
| (配当等相当額)                | ( 461,278,057)       |
| (売買損益相当額)               | ( 1,696,726,641)     |
| 分配準備積立金                 | 2,582,537,480        |
| 繰越欠損金                   | △ 487                |

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。  
 (注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。  
 (注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。  
 (注4) (F)追加信託差損益金\*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

## 分配金の計算過程

| 項目                        | 当期             |
|---------------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益           | 0円             |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益       | 2,504,087,058円 |
| (c) 信託約款に定める収益調整金         | 2,158,004,698円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金       | 78,450,422円    |
| (e) 分配対象額 (a + b + c + d) | 4,740,542,178円 |
| (f) 分配対象額 (1万口当たり)        | 2,634.83円      |
| (g) 分配金                   | 0円             |
| (h) 分配金 (1万口当たり)          | 0円             |

# お知らせ

## ■ 当社による当ファンドの設定解約状況

| 前期末<br>残高<br>(元本) | 当期<br>設定元本 | 当期<br>解約元本 | 当期末残高 |     |    | 取引の理由           |
|-------------------|------------|------------|-------|-----|----|-----------------|
|                   |            |            | 元本    | 評価額 | 比率 |                 |
| 百万円               | 百万円        | 百万円        | 百万円   | 百万円 | %  |                 |
| 1                 | -          | 1          | -     | -   | -  | 当初設定時における取得分の処分 |

(注) 元本の単位未満は切り捨てています。

# 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 | 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、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。 |   |
| 主要運用対象  | ニッセイ先進国株式インデックス<br>(為替ヘッジなし) (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<br>インデックス<br>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<br>(為替ヘッジなし) (ラップ専用)   | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。<br>・株式への実質投資割合には、制限を設けません。<br>・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<br>インデックス<br>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。<br>・株式への投資割合には、制限を設けません。<br>・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



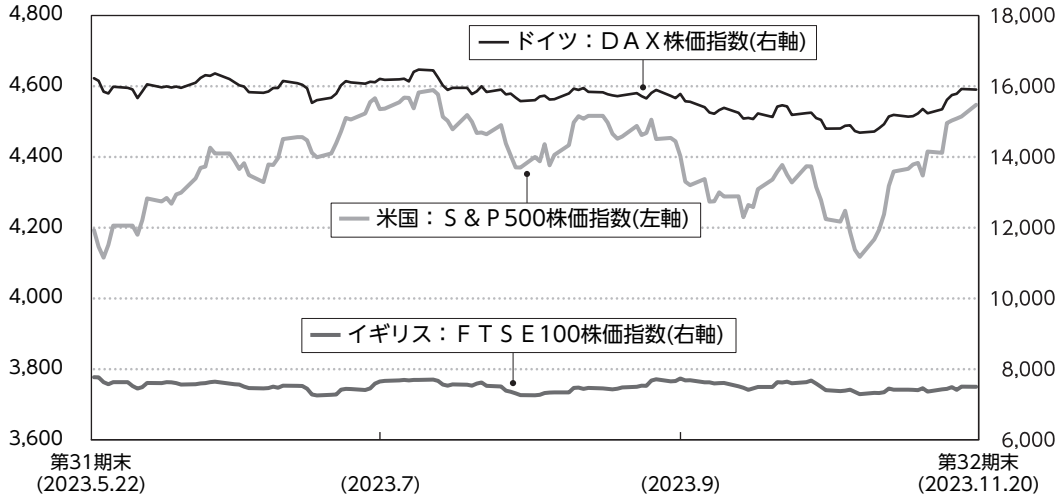
## 運用経過

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】

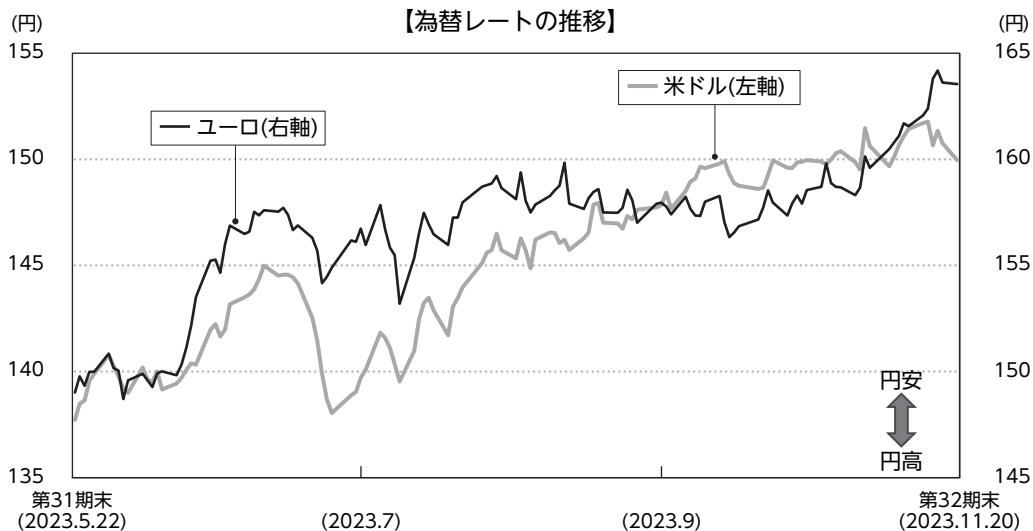


(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

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

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023年11月20日

| 項目              | 当期  |         | 項目の概要   |
|-----------------|-----|---------|---|
|                 | 金額  | 比率      |   |
| 売買委託手数料<br>(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<br>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<br>(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<br>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<br>(保管費用) | 3   | 0.008   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数<br>海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用             |
| (その他)           | (0) | (0.000) |   |
|                 |     |         | ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用<br>・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計              | 5   | 0.013   |   |

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## 売買および取引の状況

2023年5月23日～2023年11月20日

## (1) 株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

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



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

### (3) 先物取引の種類別取引状況

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 主要な売買銘柄

2023年5月23日～2023年11月20日

### 株式

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

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

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

## 組入有価証券明細表

2023年11月20日現在

## (1) 外国株式

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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



ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           | 期首(前期末) |       | 当期末    |           | 業種等                    |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
|                              | 株数      | 株数    | 評価額    |           |                        |
|                              |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| <b>(アメリカ)</b>                | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| REVVITY INC                  | 116     | 124   | 1,097  | 164,572   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | 295     | 648   | 1,083  | 162,442   | 自動車・自動車部品              |
| ROBERT HALF INC              | 100     | 107   | 866    | 129,890   | 商業・専門サービス              |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A    | -       | 424   | 343    | 51,503    | 金融サービス                 |
| ROBLOX CORP -CLASS A         | 330     | 418   | 1,584  | 237,661   | メディア・娯楽                |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 106     | 114   | 3,142  | 471,239   | 資本財                    |
| ROKU INC                     | 112     | 122   | 1,140  | 170,998   | メディア・娯楽                |
| ROLLINS INC                  | 204     | 245   | 966    | 144,893   | 商業・専門サービス              |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 98      | 105   | 5,558  | 833,554   | ソフトウェア・サービス            |
| ROSS STORES INC              | 320     | 338   | 4,361  | 653,981   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 212     | 228   | 2,413  | 361,839   | 消費者サービス                |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 326     | 379   | 1,008  | 151,178   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RPM INTERNATIONAL INC        | 119     | 128   | 1,305  | 195,804   | 素材                     |
| RTX CORPORATION              | 1,359   | 1,452 | 11,575 | 1,735,676 | 資本財                    |
| S&P GLOBAL INC               | 307     | 326   | 13,305 | 1,995,225 | 金融サービス                 |
| SALESFORCE INC               | 924     | 968   | 21,415 | 3,211,275 | ソフトウェア・サービス            |
| SCHLUMBERGER LTD             | 1,310   | 1,416 | 7,486  | 1,122,635 | エネルギー                  |
| SEA LTD-ADR                  | 334     | 362   | 1,363  | 204,432   | メディア・娯楽                |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 181     | 185   | 1,406  | 210,872   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SEAGEN INC                   | 128     | 139   | 2,963  | 444,384   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEALED AIR CORP              | 133     | 143   | 478    | 71,714    | 素材                     |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 105     | 112   | 650    | 97,582    | 金融サービス                 |
| SEMPRA                       | 290     | 625   | 4,519  | 677,720   | 公益事業                   |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 141     | 152   | 495    | 74,373    | 資本財                    |
| SERVICENOW INC               | 187     | 202   | 13,247 | 1,986,465 | ソフトウェア・サービス            |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 227     | 243   | 6,581  | 986,909   | 素材                     |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC       | 718     | 770   | 391    | 58,682    | メディア・娯楽                |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 148     | 158   | 1,490  | 223,476   | 半導体・半導体製造装置            |
| SMITH (A.O.) CORP            | 117     | 123   | 945    | 141,824   | 資本財                    |
| SNAP INC - A                 | 1,005   | 1,009 | 1,200  | 180,005   | メディア・娯楽                |
| SNAP-ON INC                  | 49      | 52    | 1,461  | 219,121   | 資本財                    |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A        | 207     | 259   | 4,194  | 628,893   | ソフトウェア・サービス            |
| 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                 |
| SYNOPSYS INC                   | 141     | 151   | 8,086  | 1,212,637 | ソフトウェア・サービス            |
| SYSCO CORP                     | 468     | 503   | 3,571  | 535,558   | 生活必需品流通・小売り            |
| T ROWE PRICE GROUP INC         | 206     | 223   | 2,182  | 327,321   | 金融サービス                 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE  | 155     | 168   | 2,598  | 389,627   | メディア・娯楽                |
| TARGA RESOURCES CORP           | 198     | 212   | 1,831  | 274,677   | エネルギー                  |
| TARGET CORP                    | 425     | 458   | 5,960  | 893,702   | 生活必需品流通・小売り            |
| TE CONNECTIVITY LTD            | 293     | 313   | 4,117  | 617,491   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC      | 43      | 46    | 1,827  | 274,032   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TELEFLEX INC                   | 43      | 46    | 992    | 148,882   | ヘルスケア機器・サービス           |
| TERADYNE INC                   | 143     | 154   | 1,419  | 212,795   | 半導体・半導体製造装置            |
| TESLA, INC.                    | 2,481   | 2,835 | 66,429 | 9,961,094 | 自動車・自動車部品              |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 1,026   | 1,112 | 1,007  | 151,019   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXAS INSTRUMENTS INC          | 839     | 902   | 13,950 | 2,091,937 | 半導体・半導体製造装置            |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP        | 5       | 6     | 1,011  | 151,603   | エネルギー                  |
| TEXTRON INC                    | 192     | 200   | 1,550  | 232,493   | 資本財                    |
| THE CIGNA GROUP                | 282     | 294   | 8,308  | 1,245,928 | ヘルスケア機器・サービス           |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC   | 362     | 383   | 17,882 | 2,681,487 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TJX COS INC                    | 1,073   | 1,142 | 10,147 | 1,521,614 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| T-MOBILE US INC                | 576     | 538   | 7,959  | 1,193,593 | 電気通信サービス               |
| TOAST INC-CLASS A              | 231     | 307   | 442    | 66,376    | 金融サービス                 |
| TORO CO                        | 96      | 103   | 882    | 132,302   | 資本財                    |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY         | 102     | 108   | 2,206  | 330,853   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A    | 411     | 442   | 2,938  | 440,688   | メディア・娯楽                |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A   | 102     | 108   | 1,011  | 151,724   | 金融サービス                 |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC         | 212     | 226   | 5,182  | 777,094   | 資本財                    |
| TRANSDIGM GROUP INC            | 47      | 54    | 5,227  | 783,893   | 資本財                    |
| TRANSUNION                     | 178     | 192   | 1,119  | 167,856   | 商業・専門サービス              |
| TRAVELERS COS INC/THE          | 216     | 229   | 3,943  | 591,396   | 保険                     |
| TRIMBLE INC                    | 228     | 246   | 1,067  | 160,094   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                           |                  | 期首(前期末)      |              | 当期末         |                     | 業種等                    |
|------------------------------|------------------|--------------|--------------|-------------|---------------------|------------------------|
|                              |                  | 株数           | 株数           | 評価額         |                     |                        |
|                              |                  |              |              | 外貨建金額       | 邦貨換算金額              |                        |
| <b>(シンガポール)</b>              |                  | 百株           | 百株           | シンガポールドル    | 千円                  |                        |
| UOL Group Limited            |                  | 428          | 459          | 282         | 31,494              | 不動産管理・開発               |
| VENTURE CORP LTD             |                  | 256          | -            | -           | -                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     |                  | 1,774        | 1,909        | 702         | 78,379              | 食品・飲料・タバコ              |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 55,366<br>16 | 76,498<br>16 | 22,747<br>- | 2,537,903<br><0.3%> |                        |
| <b>(ニュージーランド)</b>            |                  |              |              | 千ニュージーランドドル |                     |                        |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    |                  | 1,152        | 1,237        | 956         | 86,034              | 運輸                     |
| EBOS GROUP LTD               |                  | 149          | 152          | 588         | 52,899              | ヘルスケア機器・サービス           |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C |                  | 533          | 575          | 1,263       | 113,673             | ヘルスケア機器・サービス           |
| MERCURY NZ LTD               |                  | 638          | 685          | 414         | 37,299              | 公益事業                   |
| MERIDIAN ENERGY LTD          |                  | 1,187        | 1,276        | 638         | 57,413              | 公益事業                   |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        |                  | 1,764        | 1,877        | 943         | 84,861              | 電気通信サービス               |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 5,426<br>6   | 5,803<br>6   | 4,804<br>-  | 432,181<br><0.1%>   |                        |
| <b>(イギリス)</b>                |                  |              |              | 千イギリスポンド    |                     |                        |
| 3I GROUP PLC                 |                  | 897          | 965          | 2,095       | 391,146             | 金融サービス                 |
| ABRDN PLC                    |                  | 1,867        | 1,936        | 333         | 62,269              | 金融サービス                 |
| ADMIRAL GROUP PLC            |                  | 167          | 211          | 548         | 102,446             | 保険                     |
| ANGLO AMERICAN PLC           |                  | 1,174        | 1,263        | 2,822       | 526,907             | 素材                     |
| ANTOFAGASTA PLC              |                  | 364          | 391          | 539         | 100,771             | 素材                     |
| ASHTED GROUP PLC             |                  | 405          | 435          | 2,283       | 426,286             | 資本財                    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC |                  | 329          | 345          | 822         | 153,464             | 食品・飲料・タバコ              |
| ASTRAZENECA PLC              |                  | 1,432        | 1,540        | 15,804      | 2,950,619           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AUTO TRADER GROUP PLC-WI     |                  | 861          | 911          | 644         | 120,335             | メディア・娯楽                |
| AVIVA PLC                    |                  | 2,592        | 2,726        | 1,151       | 214,916             | 保険                     |
| BAE SYSTEMS PLC              |                  | 2,854        | 3,029        | 3,197       | 596,882             | 資本財                    |
| BARCLAYS PLC                 |                  | 14,648       | 15,453       | 2,206       | 411,974             | 銀行                     |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     |                  | 928          | 970          | 469         | 87,680              | 耐久消費財・アパレル             |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT |                  | 100          | 105          | 477         | 89,171              | 耐久消費財・アパレル             |
| BP PLC                       |                  | 16,779       | 17,242       | 8,236       | 1,537,687           | エネルギー                  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC |                  | 1,966        | 2,112        | 5,325       | 994,252             | 食品・飲料・タバコ              |
| BT GROUP PLC                 |                  | 6,454        | 6,470        | 769         | 143,627             | 電気通信サービス               |
| BUNZL PLC                    |                  | 312          | 335          | 988         | 184,634             | 資本財                    |
| BURBERRY GROUP PLC           |                  | 355          | 374          | 586         | 109,458             | 耐久消費財・アパレル             |
| CENTRICA PLC                 |                  | -            | 5,515        | 836         | 156,215             | 公益事業                   |
| COCA-COLA HBC AG-CDI         |                  | 186          | 219          | 464         | 86,739              | 食品・飲料・タバコ              |
| COMPASS GROUP PLC            |                  | 1,624        | 1,723        | 3,604       | 672,934             | 消費者サービス                |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

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

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                               |         | 期首(前期末) |       | 当期末    |             |        |
|----------------------------------|---------|---------|-------|--------|-------------|--------|
|                                  |         | □数      | □数    | 評価額    |             |        |
|                                  |         |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額      |        |
| <b>(カナダ)</b>                     |         |         | 千□    | 千□     | 千カナダ・ドル     | 千円     |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA     |         |         | 8     | 8      | 380         | 41,606 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR      |         |         | 14    | 15     | 267         | 29,258 |
| 小計                               | □数・金額   | 22      | 23    | 648    | 70,865      |        |
|                                  | 銘柄数<比率> | 2       | 2     | —      | <0.0%>      |        |
| <b>(オーストラリア)</b>                 |         |         |       |        | 千オーストラリア・ドル |        |
| GPT GROUP                        |         | 176     | 189   | 790    | 77,115      |        |
| GOODMAN GROUP                    |         | 156     | 168   | 3,896  | 380,163     |        |
| STOCKLAND                        |         | 220     | 236   | 943    | 92,088      |        |
| MIRVAC GROUP                     |         | 364     | 391   | 802    | 78,273      |        |
| VICINITY CENTRES                 |         | 356     | 383   | 710    | 69,313      |        |
| LENDLEASE GROUP                  |         | 63      | 68    | 469    | 45,776      |        |
| SCENTRE GROUP                    |         | 479     | 515   | 1,369  | 133,663     |        |
| DEXUS/AU                         |         | 99      | 106   | 764    | 74,544      |        |
| 小計                               | □数・金額   | 1,916   | 2,060 | 9,746  | 950,939     |        |
|                                  | 銘柄数<比率> | 8       | 8     | —      | <0.1%>      |        |
| <b>(香港)</b>                      |         |         |       |        | 千香港ドル       |        |
| LINK REIT                        |         | 199     | 251   | 10,013 | 192,552     |        |
| 小計                               | □数・金額   | 199     | 251   | 10,013 | 192,552     |        |
|                                  | 銘柄数<比率> | 1       | 1     | —      | <0.0%>      |        |
| <b>(シンガポール)</b>                  |         |         |       |        | 千シンガポール・ドル  |        |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT         |         | 311     | 370   | 1,036  | 115,648     |        |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL |         | 490     | 528   | 983    | 109,713     |        |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST        |         | 311     | 343   | 542    | 60,570      |        |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR |         | 217     | 235   | 325    | 36,305      |        |
| 小計                               | □数・金額   | 1,330   | 1,478 | 2,888  | 322,238     |        |
|                                  | 銘柄数<比率> | 4       | 4     | —      | <0.0%>      |        |
| <b>(イギリス)</b>                    |         |         |       |        | 千イギリス・ポンド   |        |
| BRITISH LAND CO PLC              |         | 81      | —     | —      | —           |        |
| LAND SECURITIES GROUP PLC        |         | 65      | 70    | 457    | 85,405      |        |
| SEGRO PLC                        |         | 111     | 115   | 952    | 177,792     |        |
| 小計                               | □数・金額   | 257     | 185   | 1,409  | 263,197     |        |
|                                  | 銘柄数<比率> | 3       | 2     | —      | <0.0%>      |        |
| <b>(ユーロ/ベルギー)</b>                |         |         |       |        | 千ユーロ        |        |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA           |         | 15      | 16    | 420    | 68,833      |        |
| 小計                               | □数・金額   | 15      | 16    | 420    | 68,833      |        |
|                                  | 銘柄数<比率> | 1       | 1     | —      | <0.0%>      |        |



## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄                        | 期首(前期末) |       | 当期末   |            |
|---------------------------|---------|-------|-------|------------|
|                           | □数      | □数    | 評価額   |            |
|                           |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額     |
| (ユーロ/フランス)                | 千口      | 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   | 42    | 1,814 | 296,824    |
|                           | 銘柄数<比率> | 4     | —     | <0.0%>     |
| ユーロ計                      | □数・金額   | 59    | 2,235 | 365,657    |
|                           | 銘柄数<比率> | 5     | —     | <0.0%>     |
| 合計                        | □数・金額   | 5,244 | —     | 15,356,225 |
|                           | 銘柄数<比率> | 56    | —     | <1.9%>     |

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

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

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2023年11月20日現在

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

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

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

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

|  |                  |
|--|------------------|
| (注1) 期首元本額                                 | 205,978,181,520円 |
| 期中追加設定元本額                                  | 26,115,488,072円  |
| 期中一部解約元本額                                  | 11,275,206,507円  |
| (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーフンド別内訳は、次の通りです。 |                  |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)                  | 794,706,462円     |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)                    | 3,806,956,625円   |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)                  | 3,508,595,111円   |
| ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)               | 2,154,739,003円   |
| ニッセイインデックスバラス(債券重視) S A(適格機関投資家限定)         | 949,369円         |
| ニッセイインデックスバラス(標準型) S A(適格機関投資家限定)          | 5,648,440円       |
| ニッセイインデックスバラス(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(高リスクなし)(ラップ専用)             | 6,069,453,038円   |
| FWニッセイ先進国株式インデックス                          | 56,059,397円      |
| DCニッセイターゲットデットファンド2065                     | 58,158,827円      |
| ニッセイ海外資産インデックス・バラスファンドⅡ2023-05(適格機関投資家限定)  | 100,296,022円     |
| DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト                      | 395,809円         |

### 損益の状況

当期(2023年5月23日~2023年11月20日)

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

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

## 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。