

第6期末（2023年11月20日）

基準価額	15,642円
純資産総額	187百万円
騰落率	11.6%
分配金	0円

ニッセイ・ インデックスパッケージ (内外・株式／リート)

【愛称】 ファンドパック5

追加型投信／内外／資産複合／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6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・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）」は、このたび第6期の決算を行いました。

当ファンドは、投資対象の異なる5つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式およびリート（不動産投資信託）市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

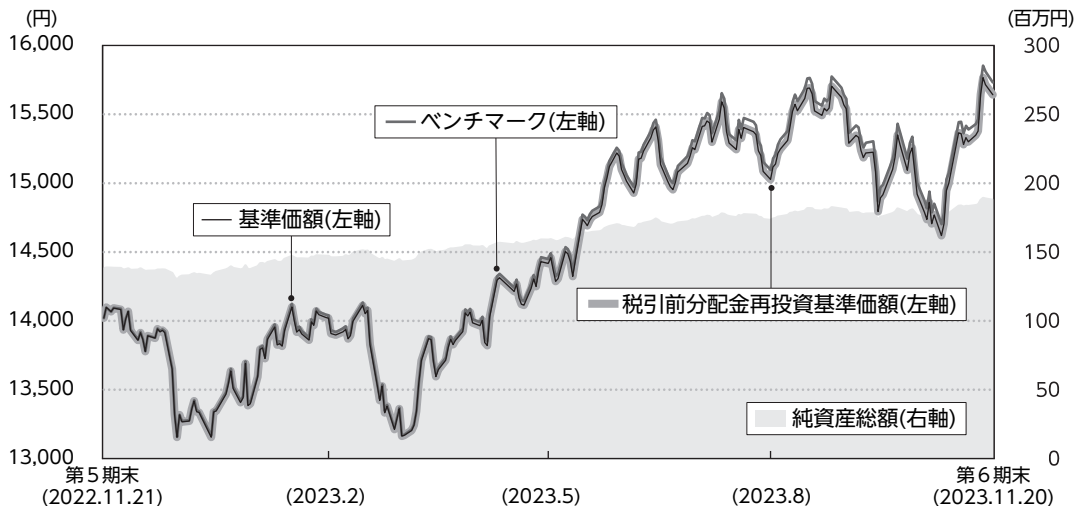
NISSAY
ASSET MANAGEMENT

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年11月22日～2023年11月20日

基準価額等の推移



第6期首	14,020円	既払分配金	0円
第6期末	15,642円	騰落率(分配金再投資ベース)	11.6%

- (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、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)、東証REIT指数(配当込み)、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)を5分の1ずつ組み合わせて合成したもので、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

当期の基準価額は国内外の株式市場上昇と為替市場における米ドル高円安を受け、上昇しました。

2022年12月に米連邦公開市場委員会（FOMC）において強い金融引き締め姿勢が示され、国内外の株価が下落し、金利は上昇（債券価額は下落）しました。また、日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したため円高が進行し、基準価額は下落しました。

その後、3月下旬から7月にかけてインフレへの過度な警戒感の後退や企業業績の回復期待などを背景に国内外の株価が上昇したことに加え、日銀の金融緩和継続姿勢を受けて円安が進行したことなどから基準価額は上昇し、前期末を上回る水準で当期末を迎えました。

組入マザーファンド	基本投資割合	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	5分の1	19.6%	23.3%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	5分の1	20.4	22.2
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	5分の1	20.3	13.7
ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド	5分の1	19.2	△ 2.6
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	5分の1	20.5	4.5

（注）組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1万口当たりの費用明細

項目	第6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	51円	0.355%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は14,492円です。</p>
(投信会社)	(24)	(0.165)	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)	(24)	(0.165)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(4)	(0.026)	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	2	0.014	
(株式)	(1)	(0.004)	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)	(1)	(0.004)	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)	(1)	(0.006)	
有価証券取引税	1	0.009	
(株式)	(1)	(0.006)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.003)	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	13	0.088	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)	(9)	(0.063)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(2)	(0.011)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(2)	(0.015)	<ul style="list-style-type: none"> 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	68	0.467	

(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。

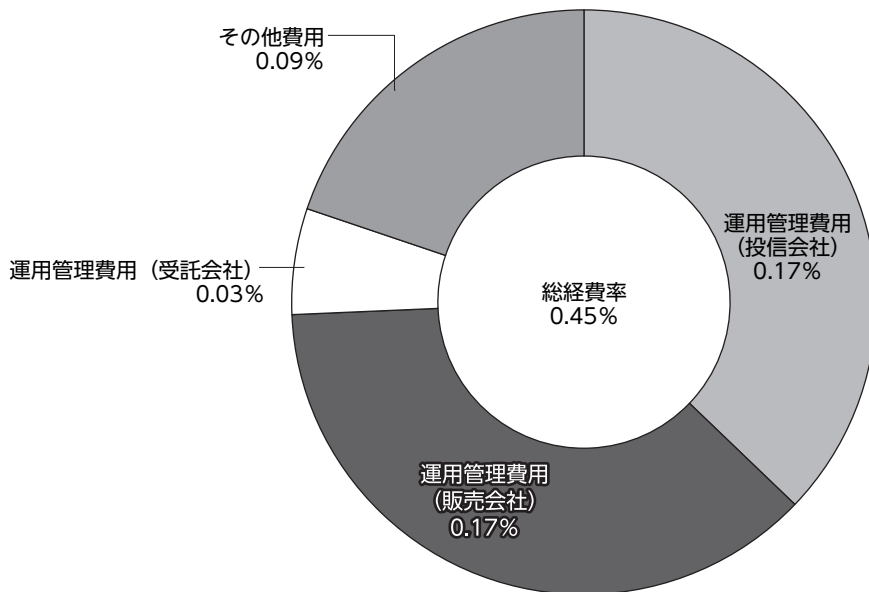
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.45%**です。



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

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

投資環境

■国内株式市況

国内株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、米連邦準備制度理事会（F R B）が金融引き締めを継続する姿勢を示したことによる景気減速懸念や日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことによる長期金利の上昇、さらに円高が進行したことなどから株価は下落しました。年明け以降は欧米における金融引き締めの長期化懸念が後退したことや日銀による金融緩和の現状維持により市場に安心感が広がったことから株価は上昇に転じたものの、2023年3月中旬に米中堅地銀の経営破綻や欧州大手投資銀行の信用不安等に伴う欧米金融システムに対する懸念を受けて下落しました。

3月下旬以降は米著名投資家による日本株への追加投資の報道や外国人投資家の買い越し、東京証券取引所が株価純資産倍率（P B R）の低い企業に資本効率や株価を意識した経営を求めたことによる日本企業の資本コスト意識の高まりなど日本独自のポジティブ要因に加えて、米経済の軟着陸（ソフトランディング）への期待感や人工知能（A I）ブームによる世界同時株高の追い風を受けて株価は上昇基調で推移しました。7月に入ると米長期金利の上昇や日銀によるイールドカーブ・コントロール（長短金利操作、Y C C）の運用柔軟化等、金融政策への思惑が交錯し株価は上下する展開となりましたが、その後、9月中旬にかけては米追加利上げ観測の後退を受け上昇しました。9月下旬から10月末にかけては米金利の上昇を受けて株価は下落しましたが、11月に入ると日銀の金融緩和姿勢の継続が示唆されたことや米金利の低下を受けて上昇し、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

■先進国株式市況

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F O M C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F R Bによる金融引き締め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F O M Cで追加利上げ観測が後退したことなどを反発し、結局、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

■新興国株式市況

新興国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2023年1月にかけては、米国の金融引き締め長期化や世界経済の減速が懸念された一方、中国における「ゼロコロナ」政策の緩和姿勢や大手不動産開発会社への支援等が好感され株価は上昇しました。2月から5月にかけては、米国の金融引き締めへの警戒感や欧米金融市場における信用不安、地政学リスクの高まりなどを受けて投資家心理が悪化し株価は軟調に推移しました。6月から10月にかけては、米国の金融引き締めに対する懸念の一時緩和や中国における金融市場・景気への支援策が好感された一方、中国景気や不動産市場の不透明感は根強く株価は一進一退の展開となりました。11月に入ると米国の金融引き締めへの懸念の後退と中国における景気支援策への期待感から株価は上昇して当期末を迎えました。

■ Jリート市況

Jリート市場は期初以降、日本銀行がYCCの運用を見直し、長期金利の変動幅を変更したことから国内長期金利の上昇が意識され、大きく下落しました。その後3月中旬には、海外金融機関の破綻や経営危機が報じられたことを受け、Jリート市場は一時急落したものの、クレジット市場の悪化懸念が弱まると上昇に転じました。その後は狭いレンジでもみ合う展開が続きましたが、オフィス型リーートの決算内容からオフィス需要の底堅さが確認されると、8月下旬から9月上旬にかけてJリート市場は反発しました。一方、期末にかけては、国内長期金利が0.7%を超過し、再び金利上昇リスクが意識されたことから軟調となり、前期末と比較すると下落して当期末を迎えました。

■ 先進国リート市況

当期の先進国リート市場は、期初以降、各国における金利上昇懸念の高まりや中国におけるコロナウイルス感染再拡大の報道等が嫌気され下落して始まりしました。その後、FRB高官から利上げ幅の縮小を支持する発言が相次いだことで反発したものの、2023年3月には米シリコンバレーバンクの経営破綻等を受けて欧米の金融システム不安が高まり融資基準の厳格化等、不動産市況への悪影響が懸念されたことからリート市場は下落しました。その後、7月にかけては米オフィスリート大手のSLグリーン・リアルティによる物件売却のニュースが好感されたことや、米国やイギリスで発表された消費者物価指数（CPI）が市場予想を下回ったことなどから金融引き締め長期化への過度な警戒感が後退し、リート市場は上昇基調で推移しました。10月にかけては米経済の底堅さを示す経済指標の発表が続いたため、FRBによる金融引き締めの長期化観測が強まり、高金利のもとで不動産市況の回復にも遅れが出るとの懸念からリート市場は再び軟調な推移となりましたが、11月に入り発表された経済指標がインフレ鈍化を示し、長期金利が大きく低下したことなどが好感され当期末にかけて反発しました。

ポートフォリオ

■当ファンド

投資対象の異なる5つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式およびリート市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークであるT O P I X（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド>

新興国の株式等（D R（預託証券）を含みます）に投資することにより、ベンチマークであるM S C I エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド>

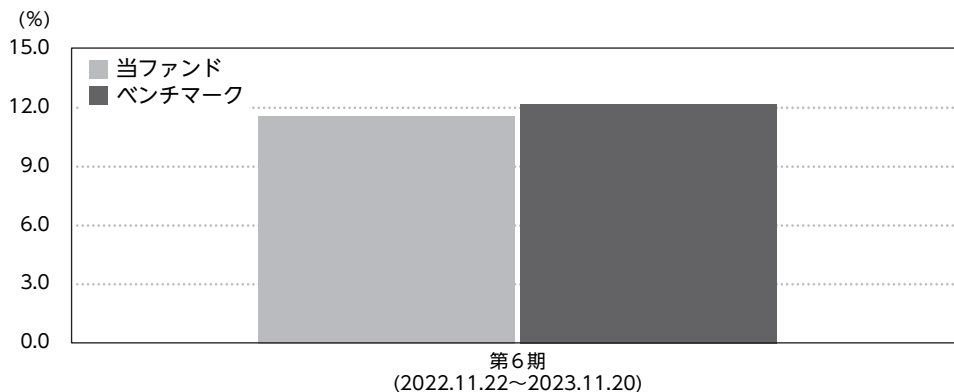
国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークである東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド>

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリートに投資することにより、ベンチマークであるS & P先進国R E I Tインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

*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11.6%となり、ベンチマーク騰落率(12.2%)を下回りました。

当ファンドは投資対象の異なる5つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式およびリート市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行っています。相場変動による基本投資割合からの変動についてはリバランスを行い基本投資割合に戻しますが、当期の市場変動の中でリバランスに伴って一時的に発生したキャッシュ(未収入金)部分や当ファンドにおいて信託報酬等の費用を控除した影響などがマイナスに働きました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

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

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

【分配原資の内訳(1万口当たり)】

項目	当期 2022年11月22日~2023年11月20日
当期分配金(税引前)	—
対基準価額比率	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	5,641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

投資対象の異なる5つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式およびリート市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド>

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイJ-REITインデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所に上場しているJリートに投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド>

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリートに投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■組入ファンド

	第6期末 2023年11月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	19.6%
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	20.4
ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド	20.3
ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド	19.2
ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド	20.5

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

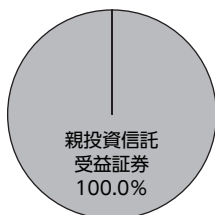
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

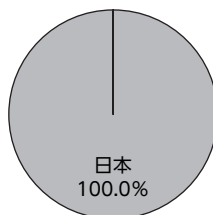
項目	第6期末 2023年11月20日
純資産総額	187,726,333円
受益権総口数	120,017,861口
1万口当たり基準価額	15,642円

(注) 当期間中における追加設定元本額は33,090,854円、同解約元本額は11,331,166円です。

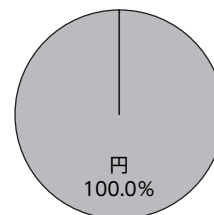
■資産別配分



■国別配分



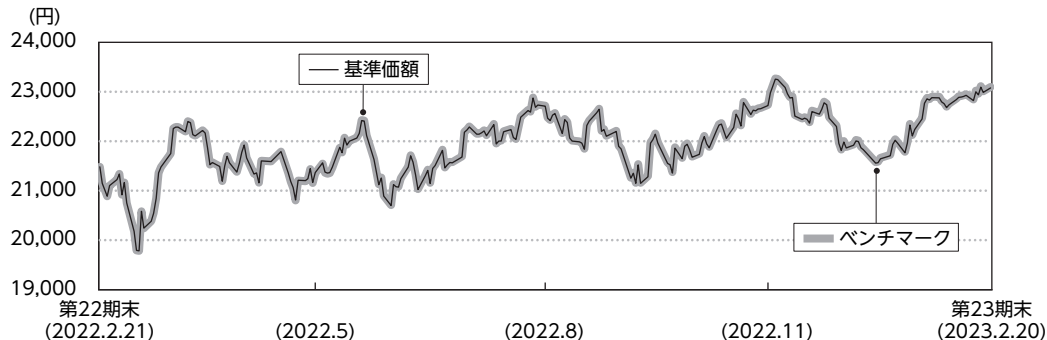
■通貨別配分



(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。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

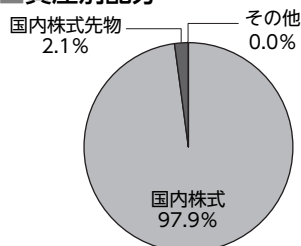
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.5%
ソニーグループ	円	2.7
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	2.1
TOPIX 先物 0503月 買	円	2.1
キーエンス	円	2.0
日本電信電話	円	1.7
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.5
武田薬品工業	円	1.3
第一三共	円	1.3
日立製作所	円	1.2
組入銘柄数		1,822

■ 1万口当たりの費用明細

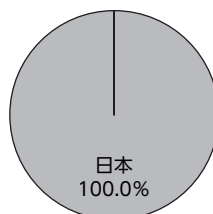
2022.2.22~2023.2.20

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

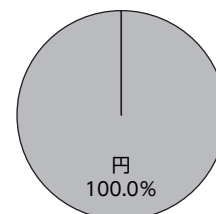
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



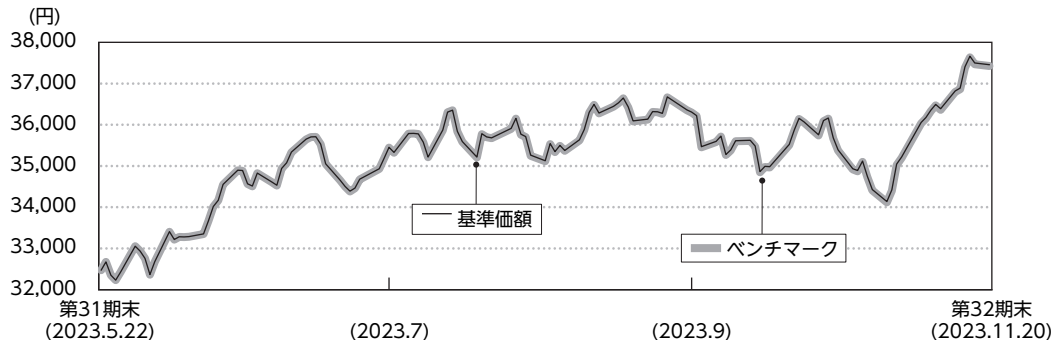
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

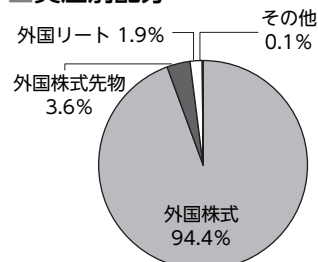
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	5.4%
MICROSOFT CORP	米ドル	4.7%
S&P 500 EMINI FUTURE 202312 買	米ドル	2.7%
AMAZON.COM INC	米ドル	2.4%
NVIDIA CORP	米ドル	2.2%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.4%
META PLATFORMS INC-A	米ドル	1.3%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.3%
TESLA, INC.	米ドル	1.2%
UNITEDHEALTH GROUP INC	米ドル	0.9%
組入銘柄数		1278

■ 1万口当たりの費用明細

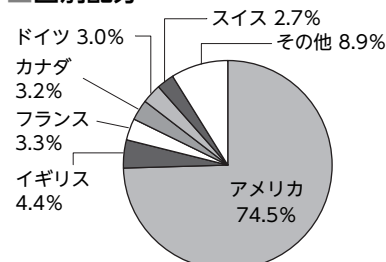
2023.5.23~2023.11.20

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

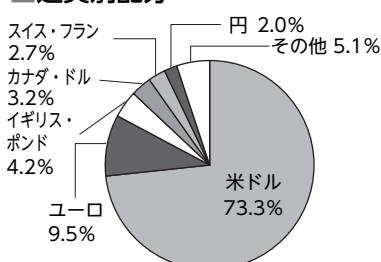
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

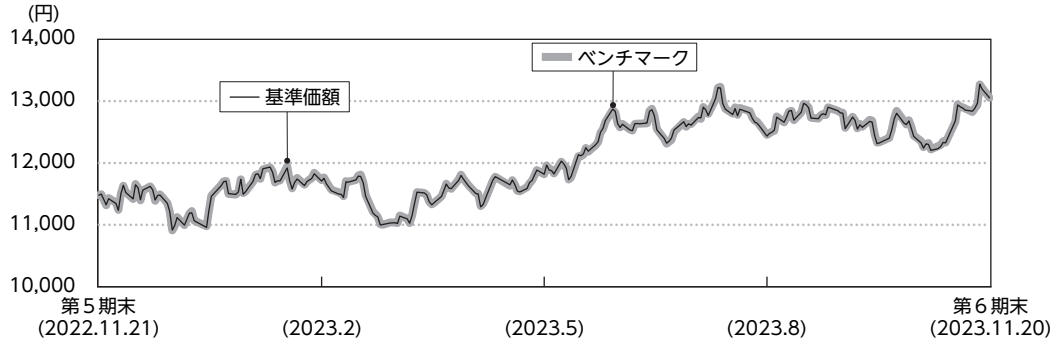
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2023年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

ニッセイ新興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



■ 上位銘柄

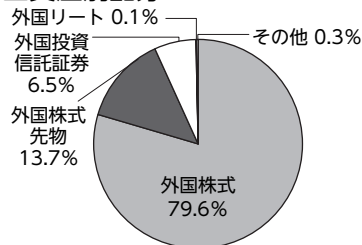
銘柄名	通貨	比率
MINI MSCI EM INDEX FUTURE 202312 買	米ドル	13.7%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾ドル	5.8
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	米ドル	3.7
TENCENT HOLDINGS LTD	香港ドル	3.5
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国ウォン	3.4
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	香港ドル	2.0
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	米ドル	1.2
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	インド・ルピー	1.1
MEITUAN-B	香港ドル	0.9
PDD HOLDINGS INC(ADR)	米ドル	0.9
組入銘柄数		1,055

■ 1万口当たりの費用明細

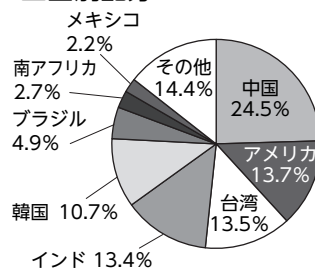
2022.11.22~2023.11.20

項目	金額
売買委託手数料 (株式)	4円 (2)
(先物・オプション)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	3 (3)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	29 (21)
(その他)	(8)
合計	36

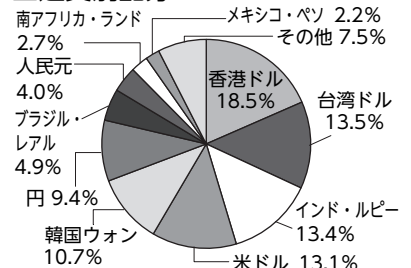
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

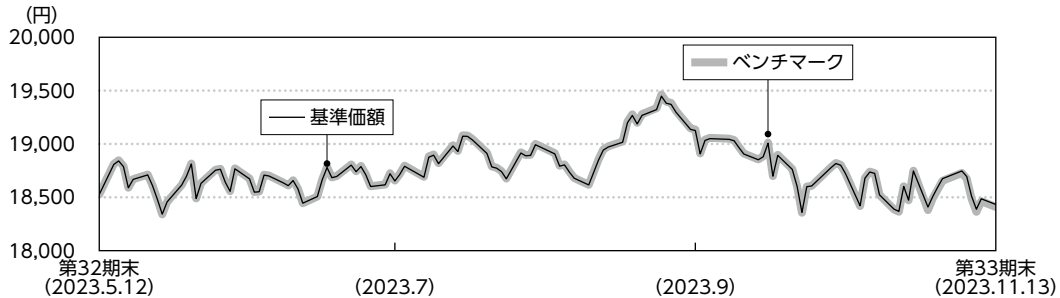
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2023年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

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

ニッセイJ-REIT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

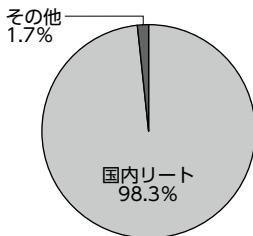
銘柄名	通貨	比率
日本ビルファンド投資法人	円	6.7%
ジャパンリアルエステイト投資法人	円	5.5
野村不動産マスターファンド投資法人	円	5.2
日本プロロジスリート投資法人	円	4.5
日本都市ファンド投資法人	円	4.5
GLP投資法人	円	4.4
KDX不動産投資法人	円	4.4
大和ハウスリート投資法人	円	3.9
オリックス不動産投資法人	円	3.2
ユナイテッド・アーバン投資法人	円	3.2
組入銘柄数		58

■ 1万口当たりの費用明細

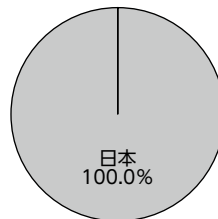
2023.5.13~2023.11.13

項目	金額
売買委託手数料 (投資信託証券)	0円 (0)
その他費用 (その他)	0 (0)
合計	0

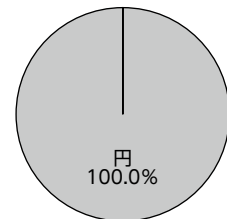
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



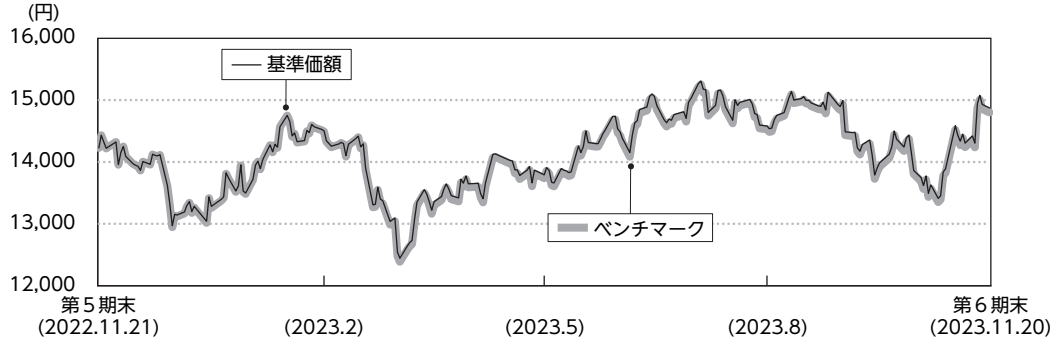
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2023年11月13日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



■ 上位銘柄

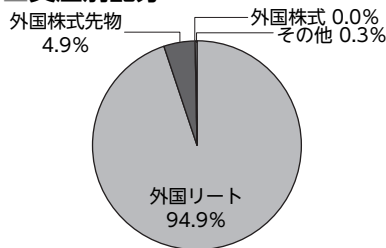
銘柄名	通貨	比率
PROLOGIS INC	米ドル	7.9%
EQUINIX INC	米ドル	5.6
DOW JONES U.S. REAL ESTATE INDEX FUTURES 202312 買	米ドル	4.3
WELLTOWER INC	米ドル	3.5
DIGITAL REALTY TRUST INC	米ドル	3.2
PUBLIC STORAGE	米ドル	3.2
SIMON PROPERTY GROUP INC	米ドル	3.1
REALTY INCOME CORP	米ドル	2.9
VICI PROPERTIES INC	米ドル	2.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	米ドル	2.1
組入銘柄数		300

■ 1万口当たりの費用明細

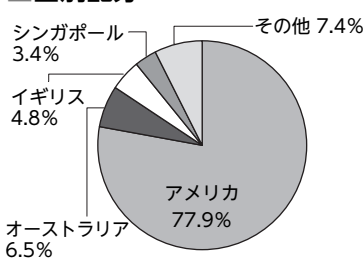
2022.11.22~2023.11.20

項目	金額
売買委託手数料 (先物・オプション)	5円 (1)
(投資信託証券)	(4)
有価証券取引税 (投資信託証券)	2 (2)
その他費用 (保管費用)	19 (18)
(その他)	(1)
合計	27

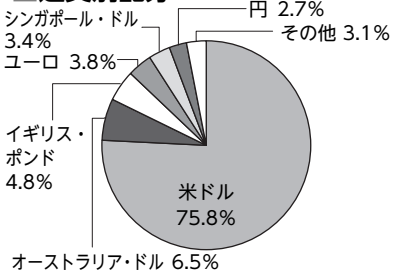
■ 資産別配分



■ 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。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2019年11月20日)	11,229	0	12.6	11,229	11,386	13.3	56.2	2.8	-	40.0	32
3期(2020年11月20日)	10,927	0	△ 2.7	10,927	11,276	△ 1.0	57.3	2.0	-	40.0	57
4期(2021年11月22日)	14,174	0	29.7	14,174	14,744	30.8	55.7	2.9	0.0	40.9	107
5期(2022年11月21日)	14,020	0	△ 1.1	14,020	14,702	△ 0.3	54.9	3.4	-	41.0	137
6期(2023年11月20日)	15,642	0	11.6	15,642	16,497	12.2	54.6	4.9	-	40.1	187

(注1) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注3) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

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

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチ マーク		株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%	円	%				
(期首) 2022年11月21日	14,020	-	14,702	-	54.9	3.4	-	41.0
11月末	14,014	△ 0.0	14,702	△ 0.0	55.1	3.5	-	40.9
12月末	13,335	△ 4.9	13,993	△ 4.8	55.1	2.7	-	41.5
2023年 1月末	13,825	△ 1.4	14,520	△ 1.2	55.7	3.2	-	40.5
2月末	13,938	△ 0.6	14,640	△ 0.4	54.6	3.7	-	40.9
3月末	13,710	△ 2.2	14,392	△ 2.1	56.2	2.7	-	40.2
4月末	14,028	0.1	14,737	0.2	55.0	2.9	-	41.2
5月末	14,431	2.9	15,177	3.2	55.1	3.9	-	40.7
6月末	15,231	8.6	16,023	9.0	55.5	3.3	-	40.4
7月末	15,465	10.3	16,280	10.7	54.7	4.5	-	40.6
8月末	15,572	11.1	16,404	11.6	54.9	3.6	-	41.0
9月末	15,219	8.6	16,039	9.1	55.4	4.2	-	40.0
10月末	14,705	4.9	15,507	5.5	54.9	4.0	-	40.6
(期末) 2023年11月20日	15,642	11.6	16,497	12.2	54.6	4.9	-	40.1

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2022年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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	4,274	10,535	3,380	8,467
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	3,258	10,450	2,027	6,602
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	10,073	12,151	5,207	6,275
ニッセイJ-R-E-I-Tインデックスマザーファンド	8,104	14,995	2,991	5,566
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	10,960	15,439	4,248	6,056

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期			
	ニッセイ 国内株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ 外国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ 新興国株式 インデックス マザーファンド	ニッセイ 先進国リート インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	45,825,391千円	110,423,097千円	2,644,017千円	0千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	181,025,881千円	639,236,458千円	5,707,749千円	1,006千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.25	0.17	0.46	0.00

(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。

ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート)

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	口数	評価額
	千口		千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	12,231	13,124	13,124	36,774
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	8,988	10,219	10,219	38,275
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	24,304	29,170	29,170	38,070
ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド	14,165	19,278	19,278	36,086
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	19,188	25,900	25,900	38,524

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが71,774,824千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが220,818,463千口、ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンドが7,117,768千口、ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンドが16,718,367千口、ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドが6,248,675千口です。

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	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	36,774	19.5
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	38,275	20.3
ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	38,070	20.2
ニッセイJ-R E I Tインデックスマザーファンド	36,086	19.2
ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	38,524	20.5
コール・ローン等、その他	524	0.3
投資信託財産総額	188,256	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台湾ドル4.712円、1イギリス・ポンド186.69円、1イスラエル・シェケル40.328円、1スイス・フラン169.22円、1トルコ・リラ5.234円、1デンマーク・クローネ21.93円、1ノルウェー・クローネ13.87円、1スウェーデン・クローナ14.25円、1メキシコ・ペソ8.704円、1フィリピン・ペソ2.692円、100チリ・ペソ16.87円、100コロンビア・ペソ3.662円、1インド・ルピー1.81円、100インドネシア・ルピア0.97円、1ブラジル・レアル30.529円、1チェコ・コルナ6.667円、100韓国ウォン11.56円、1人民元20.758円、1マレーシア・リンギット32.015円、1南アフリカ・ランド8.17円、1タイ・バーツ4.27円、1ポーランド・ズロチ37.264円、100ハンガリー・フォリント43.119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。
ニッセイ新興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 (8,413,245千円) の投資信託財産総額 (9,348,956千円) に対する比率は90.0%です。
ニッセイ先進国リート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 (9,045,847千円) の投資信託財産総額 (9,381,771千円) に対する比率は96.4%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	188,256,805円
コール・ローン等	300,697
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド (評価額)	36,774,183
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド (評価額)	38,275,598
ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド (評価額)	38,070,828
ニッセイJ-REITインデックス マザーファンド (評価額)	36,086,714
ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド (評価額)	38,524,704
未収入金	224,081
(B)負債	530,472
未払解約金	211,055
未払信託報酬	309,944
その他未払費用	9,473
(C)純資産総額 (A-B)	187,726,333
元本	120,017,861
次期繰越損益金	67,708,472
(D)受益権総口数	120,017,861口
1万口当たり基準価額 (C/D)	15,642円

(注) 期首元本額	98,258,173円
期中追加設定元本額	33,090,854円
期中一部解約元本額	11,331,166円

損益の状況

当期 (2022年11月22日~2023年11月20日)

項目	当期
(A)有価証券売買損益	18,877,959円
売	20,120,989
買	△ 1,243,030
(B)信託報酬等	△ 584,321
(C)当期損益金 (A+B)	18,293,638
(D)前期繰越損益金	16,343,444
(分配準備積立金)	(16,744,397)
(繰越欠損金)	(△ 400,953)
(E)追加信託差損益金*	33,071,390
(配当等相当額)	(27,005,591)
(売買損益相当額)	(6,065,799)
(F)合計 (C+D+E)	67,708,472
次期繰越損益金 (F)	67,708,472
追加信託差損益金	33,071,390
(配当等相当額)	(27,005,591)
(売買損益相当額)	(6,065,799)
分配準備積立金	34,637,082

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

分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	17,892,685円
(c) 信託約款に定める収益調整金	33,071,390円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	16,744,397円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	67,708,472円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	5,641.53円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■約款変更

ベンチマークが「配当を含む指数」であることを明確化しました。

（2023年8月19日）

■関連会社の実質保有比率

2023年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるニッセイ先進国リートインデックスマザーファンドの信託財産において、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に28.1%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	下記マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式およびリート（不動産投資信託）市場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・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイJ－REITインデックスマザーファンド」「ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド」受益証券
	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	国内の金融商品取引所上場株式等
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	日本を除く主要先進国の株式
	ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド	新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）
	ニッセイJ－REITインデックスマザーファンド	国内の金融商品取引所に上場しているJリート
	ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド	各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリート
運用方法	ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）	各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、それぞれ信託財産の純資産総額の5分の1ずつとします。
	ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ニッセイ・インデックスパッケージ（内外・株式／リート）

運用方法	ニッセイ新興国株式 インデックスマザーファンド	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 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J-REIT インデックスマザーファンド	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・ 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ先進国リート インデックスマザーファンド	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・ 株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針		<p>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。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。</p>

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 23 期

(計算期間：2022年2月22日～2023年2月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



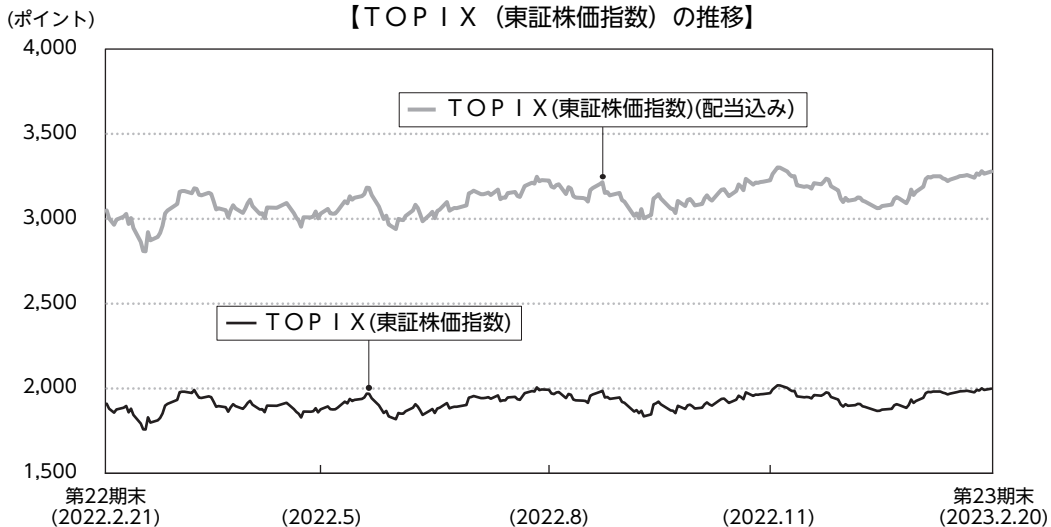
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年2月22日～2023年2月20日

国内株式市況



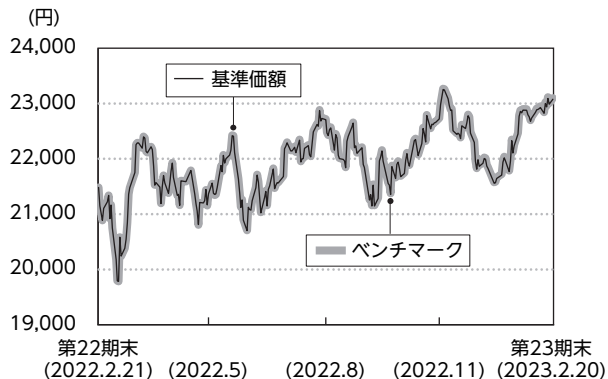
（注）各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初より2022年3月上旬にかけては、米金融政策が引き締め姿勢へ転換したことに加えて、ロシアのウクライナ侵攻を背景とした資源高によるインフレリスクの高まりを受けて株価は下落しましたが、3月末にかけては原油価格の上昇が一服したことやロシアとウクライナの停戦交渉進展への期待感などから上昇しました。4月以降はインフレ加速に伴う米長期金利の上昇や金融引き締め政策に加えて、中国における新型コロナウイルスの感染拡大の影響が警戒され、下落しました。5月中旬以降は国内企業の本決算発表の内容がおおむね想定内であったことや、米長期金利の上昇に一服感が出たことから株価は上昇しましたが、6月中旬以降は米消費者物価指数（CPI）の高い伸びなどを受けてインフレ加速への警戒感が高まり下落しました。

7月以降は米国による対中制裁関税の一部解除検討に関する報道などを受けて米国株が反発に転じたことなどが好感されて上昇しましたが、8月中旬以降は米長期金利の上昇懸念が再び重荷となったことから下落しました。10月から11月にかけては米長期金利の上昇懸念がやや緩和し株価は上昇基調となりましたが、12月になると欧米の金融引き締めに伴う景気後退への警戒感に加えて、下旬に日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことによる長期金利の上昇や円高進行を受けて下落しました。1月中旬には日銀が金融緩和策の現状維持を決定したことから市場に安心感が広がり、その後も円安に転じたことや米金融引き締めへの過度な警戒感がやわらいだことから上昇基調となり、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

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

ポートフォリオ

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

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する成果を目標として運用を行います。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率		ベンチマーク	期中騰落率		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		円	%		%	%			
19期(2019年2月20日)	16,916	△	6.4	17,088	△	6.4	98.4	1.5	58,316
20期(2020年2月20日)	18,004		6.4	18,182		6.4	98.3	1.6	68,225
21期(2021年2月22日)	21,336		18.5	21,558		18.6	99.3	0.7	170,293
22期(2022年2月21日)	21,482		0.7	21,702		0.7	96.1	3.7	117,060
23期(2023年2月20日)	23,077		7.4	23,334		7.5	97.9	2.1	187,428

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		ベンチマーク	騰落率		株式組入比率	株式先物比率
		円	%		%	%		
(期首)2022年2月21日	21,482		—	21,702		—	96.1	3.7
2月末	21,222		△1.2	21,441		△1.2	96.0	4.0
3月末	22,132		3.0	22,362		3.0	96.4	3.6
4月末	21,601		0.6	21,826		0.6	97.2	2.8
5月末	21,765		1.3	21,997		1.4	97.5	2.6
6月末	21,317		△0.8	21,546		△0.7	98.0	2.0
7月末	22,110		2.9	22,348		3.0	98.3	1.7
8月末	22,377		4.2	22,618		4.2	97.9	1.9
9月末	21,147		△1.6	21,376		△1.5	96.2	3.7
10月末	22,219		3.4	22,465		3.5	97.5	2.5
11月末	22,873		6.5	23,128		6.6	97.2	2.8
12月末	21,829		1.6	22,072		1.7	98.2	1.8
2023年1月末	22,794		6.1	23,049		6.2	97.8	2.2
(期末)2023年2月20日	23,077		7.4	23,334		7.5	97.9	2.1

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2022年2月22日～2023年2月20日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（21,942円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2022年2月22日～2023年2月20日

(1) 株式

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建		
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額	
国内	百万円	百万円	百万円	百万円	
国内	株式先物取引	33,729	34,424	-	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2022年2月22日～2023年2月20日

株式

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

組入有価証券明細表

2023年2月20日現在

(1) 国内株式
上場株式

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

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
建設業(1.9%)				
ヒノキヤグループ	1	-	-	
ショーボンドホールディングス	8	12	64,172	
ミライト・ワン	18	31	46,624	
タマホーム	3	6	20,254	
ファーストコーポレーション	4	1	972	
スペースバリューホールディングス	6	-	-	
安藤・間	29	51	45,082	
東急建設	17	25	17,043	
コムシスホールディングス	18	30	75,077	
ピーアールホールディングス	8	14	5,061	
高松コンストラクショングループ	3	5	11,495	
東建コーポレーション	1	2	22,040	
ソネット	2	4	4,598	
ヤマウラ	3	4	5,154	

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本甜菜製糖	2	3	5,896
DM三井製糖ホールディングス	3	6	12,685
塩水港精糖	14	23	4,593
ウェルネオシュガー	2	3	5,360
森永製菓	10	11	45,688
中村屋	1	1	4,880
江崎グリコ	11	17	62,471
名糖産業	1	3	5,055
井村屋グループ	2	3	7,520
不二家	2	4	10,719
山崎製パン	32	42	66,654
モロゾフ	1	2	6,820
亀田製菓	2	4	17,280
寿スピリッツ	4	6	57,821
カルビー	19	28	83,918
森永乳業	8	11	54,948
六甲バター	3	4	6,214
ヤクルト本社	32	44	414,876
明治ホールディングス	28	38	249,738
雪印メグミルク	10	15	27,375
プリマハム	5	8	18,152
日本ハム	16	24	92,365
林兼産業	5	7	3,206
丸大食品	4	6	9,336
S Foods	3	6	18,975
柿安本店	1	2	4,905
伊藤ハム米久ホールディングス	27	48	34,869
サッポロホールディングス	14	20	64,581
アサヒグループホールディングス	101	144	682,623
キリンホールディングス	158	283	567,839
宝ホールディングス	29	42	45,667
オエノンホールディングス	12	18	4,992
養命酒製造	1	2	4,938
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	30	49	69,672
サントリー食品インターナショナル	28	44	209,508
ガイドグループホールディングス	2	3	17,280
伊藤園	13	23	104,130
キーコーヒー	4	7	14,518
日清オイリオグループ	5	8	29,084
不二製油グループ本社	9	14	29,170
J-オイルミルズ	4	6	9,977

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本フェルト	6	11	4,761
イチカワ	—	3	4,693
アツギ	5	10	3,937
セーレン	8	12	31,235
ソトー	3	5	4,622
東海染工	2	1	1,723
小松マテーレ	6	9	6,714
ワコールホールディングス	10	12	28,720
ホギメディカル	5	8	27,735
クラウドIAホールディングス	12	—	—
T S I ホールディングス	14	22	13,007
マツオカコーポレーション	2	4	6,518
ワールド	5	8	10,955
三陽商会	0.400	—	—
オンワードホールディングス	25	41	13,951
ゴールドウイン	7	11	129,390
デサント	8	11	43,175
ヤマトインターナショナル	10	17	4,375
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	2	2	8,546
王子ホールディングス	176	265	142,946
日本製紙	20	33	33,432
三菱製紙	6	8	2,421
北越コーポレーション	27	40	31,675
大王製紙	20	28	30,371
阿波製紙	9	11	8,547
レンゴー	39	58	52,464
トーモク	2	3	5,675
ザ・パック	3	4	13,601
化学(6.1%)			
北の達人コーポレーション	15	26	8,984
クラレ	61	101	122,592
旭化成	279	398	380,113
レゾナック・ホールディングス	36	61	142,465
住友化学	309	473	225,716
住友精化	1	2	11,380
日産化学	22	30	178,467
ラサ工業	1	2	5,475
クレハ	3	5	45,650
多木化学	1	2	10,825
テイカ	3	4	5,043

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
旭有機材	2	4	11,907
ニチバン	2	4	7,224
リケンテクノス	10	13	7,576
大倉工業	2	3	5,670
積水化成成品工業	6	12	4,836
群栄化学工業	1	2	5,233
ダイキョーニシカワ	8	14	8,890
森六ホールディングス	2	3	5,849
恵和	1	4	6,330
日本化薬	33	48	58,099
カーリットホールディングス	2	6	4,561
日本精化	3	3	8,884
扶桑化学工業	3	5	21,505
トリケミカル研究所	4	8	19,660
A D E K A	19	22	47,241
日油	14	19	116,230
新日本理化	11	5	1,241
ハリマ化成グループ	3	5	5,138
花王	95	155	794,514
第一工業製薬	1	2	4,875
石原ケミカル	2	3	5,105
日華化学	3	5	4,653
三洋化成工業	2	3	16,692
有機合成薬品工業	11	15	4,597
大日本塗料	5	7	6,552
日本ペイントホールディングス	158	282	354,851
関西ペイント	43	58	107,748
中国塗料	9	11	12,391
日本特殊塗料	3	-	-
藤倉化成	6	11	5,164
太陽ホールディングス	6	9	22,901
D I C	17	24	60,482
サカタインクス	8	14	14,526
東洋インキSCホールディングス	8	12	23,687
T & K T O K A	-	5	7,250
富士フィルムホールディングス	75	122	786,969
資生堂	80	133	820,810
ライオン	52	76	113,061
高砂香料工業	3	4	10,762
マンダム	9	13	19,789
ミルボン	5	9	55,290

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ニフコ	14	23	79,580
バルカー	3	5	17,172
ユニ・チャーム	83	133	673,352
医薬品(5.4%)			
協和キリン	50	77	227,199
武田薬品工業	338	565	2,409,873
アステラス製薬	373	612	1,154,420
住友ファーマ	26	47	41,143
塩野義製薬	54	81	503,272
わかもと製薬	5	5	1,215
日本新薬	11	15	95,281
中外製薬	134	199	713,643
科研製薬	6	10	39,676
エーザイ	51	77	606,914
ロート製薬	22	61	159,825
小野薬品工業	98	123	351,243
久光製薬	11	14	55,593
持田製薬	5	7	26,334
参天製薬	80	120	120,921
扶桑薬品工業	1	2	4,885
ツムラ	13	20	52,863
日医工	13	-	-
キッセイ薬品工業	7	9	24,938
生化学工業	7	12	9,967
栄研化学	7	10	16,286
日水製薬	2	-	-
鳥居薬品	2	3	11,067
JCRファーマ	12	21	33,631
東和薬品	6	9	18,698
富士製薬工業	2	4	5,068
ゼリア新薬工業	7	8	19,553
第一三共	338	556	2,379,722
キョーリン製薬ホールディングス	8	13	23,322
大幸薬品	6	12	5,397
ダイト	2	4	11,697
大塚ホールディングス	89	146	608,776
大正製薬ホールディングス	10	14	77,106
ペプチドリーム	22	31	58,125
あすか製薬ホールディングス	4	6	7,807
サワイグループホールディングス	9	14	55,334

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
日本特殊陶業	32	48	132,969	
MARUWA	1	2	41,664	
品川リフラクトリーズ	1	1	7,740	
黒崎播磨	0.700	1	8,567	
ヨータイ	2	4	6,428	
イソライト工業	2	-	-	
ニッカトー	4	5	2,984	
フジミンコーポレートッド	3	5	32,436	
クニミネ工業	2	0.900	792	
ニチアス	10	16	41,682	
ニチハ	6	8	21,184	
鉄鋼(0.9%)				
日本製鉄	190	294	911,137	
神戸製鋼所	79	132	117,658	
中山製鋼所	7	13	14,431	
合同製鐵	2	3	11,269	
JFEホールディングス	115	175	306,422	
東京製鐵	14	18	27,639	
共英製鋼	4	7	11,625	
大和工業	8	10	56,916	
東京鐵鋼	2	3	6,099	
大阪製鐵	-	4	5,565	
淀川製鋼所	5	7	19,792	
丸一鋼管	15	20	56,460	
モリ工業	1	-	-	
大同特殊鋼	7	8	44,073	
日本高周波鋼業	9	15	5,213	
日本冶金工業	3	4	21,528	
山陽特殊製鋼	4	6	17,277	
愛知製鋼	2	3	8,816	
日立金属	45	-	-	
大太平洋金属	2	4	9,338	
新日本電工	27	42	15,708	
栗本鐵工所	1	3	6,460	
三菱製鋼	2	4	6,027	
日亜鋼業	11	18	5,069	
日本精線	0.700	1	5,098	
エンビプロ・ホールディングス	1	0.300	216	
シンニッタン	13	14	3,833	
非鉄金属(0.7%)				
大紀アルミニウム工業所	6	9	13,310	
日本軽金属ホールディングス	10	17	25,629	

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日東精工	5	9	4,966
三洋工業	1	2	5,373
岡部	8	10	7,610
ジーテクト	5	7	10,212
東プレ	7	11	13,827
高周波熱錬	7	10	7,179
東京製綱	3	5	6,916
サンコール	5	2	1,550
モリテックスチール	8	7	2,383
パイオラックス	6	9	17,553
エイチワン	4	7	4,921
日本発条	39	58	52,173
中央発條	-	4	3,177
三益半導体工業	3	5	14,826
機械(5.3%)			
日本製鋼所	12	17	46,462
三浦工業	18	26	89,846
タクマ	14	19	27,403
ツガミ	9	14	20,992
オークマ	5	6	34,060
芝浦機械	4	6	18,553
アマダ	67	102	123,017
アイダエンジニアリング	11	13	10,428
TAKISAWA	2	4	4,468
FUJI	19	28	57,540
牧野フライス製作所	4	7	34,344
オーエスジー	19	30	59,189
ダイジェット工業	3	5	4,399
旭ダイヤモンド工業	11	18	13,770
DMG森精機	25	39	84,006
ソディック	9	17	13,098
ディスコ	6	10	412,000
日東工器	2	3	5,456
日進工具	3	5	5,772
パンチ工業	-	10	4,693
豊和工業	3	-	-
東洋機械金属	5	7	4,060
エンシュウ	5	5	3,981
島精機製作所	6	10	18,880
オプトラン	5	9	19,950
NCホールディングス	0.500	2	4,237

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イワキ	2	4	5,508
フリーュー	3	6	8,147
ヤマシンフィルタ	8	15	6,196
日阪製作所	5	6	5,759
やまびこ	8	10	13,387
野村マイクロ・サイエンス	1	2	9,625
平田機工	2	3	20,057
ペガサスミシン製造	5	7	4,771
マルマエ	1	3	6,446
タツモ	2	3	6,026
ナプテスコ	24	40	142,410
三井海洋開発	4	8	12,376
レオン自動機	4	6	8,241
S MC	12	20	1,399,046
ホソカワミクロン	3	4	12,887
ユニオンツール	1	2	9,058
オイレス工業	6	9	14,625
日精工エー・エス・ビー機械	1	3	13,020
サトーホールディングス	5	9	21,011
技研製作所	3	6	18,773
日本エアータック	-	4	4,489
カワタ	3	4	4,174
日精樹脂工業	3	5	5,151
オカダアイオン	1	-	-
ワイエイシイホールディングス	2	-	-
小松製作所	195	301	996,729
住友重機械工業	24	38	112,242
日立建機	17	25	79,744
日工	5	9	5,956
巴工業	1	2	6,795
井関農機	4	6	7,092
TOWA	3	6	12,084
丸山製作所	1	-	-
北川鉄工所	2	4	4,636
ローツェ	2	3	34,918
タカキタ	4	9	4,262
クボタ	210	340	710,074
荏原実業	2	3	9,064
三菱化工機	1	2	5,330
月島機械	7	8	9,709
帝国電機製作所	3	4	12,191

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
新東工業	9	13	9,802
澁谷工業	3	6	14,448
アイチコーポレーション	6	9	7,070
小森コーポレーション	10	14	12,977
鶴見製作所	3	4	9,716
荏原製作所	17	26	147,576
石井鐵工所	1	1	3,942
西島製作所	3	5	8,442
北越工業	4	6	9,002
ダイキン工業	54	76	1,793,280
オルガノ	1	8	29,744
トーヨーカネツ	1	2	6,331
栗田工業	23	36	217,080
椿本チエイン	5	9	28,164
大同工業	3	3	2,928
木村化工機	3	6	4,998
アネスト岩田	6	10	9,929
ダイフク	23	33	240,368
サムコ	1	2	7,318
加藤製作所	3	6	5,244
タダノ	22	33	34,001
フジテック	16	23	75,552
CKD	12	17	35,795
キトー	3	-	-
平和	12	21	52,943
理想科学工業	3	5	13,577
SANKYO	9	12	70,739
日本金銭機械	4	7	8,889
マースグループホールディングス	2	3	9,427
フクシマガリレイ	2	4	20,496
ダイコク電機	2	3	9,366
竹内製作所	6	11	34,702
アマノ	11	18	45,603
JUKI	6	10	6,340
ジャノメ	4	8	5,210
マックス	5	7	16,929
グローリー	11	16	44,605
新晃工業	4	6	10,094
大和冷機工業	6	9	12,206
セガサミーホールディングス	42	51	121,391
日本ピストンリング	2	-	-

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東芝テック	4	9	37,056
芝浦メカトロニクス	0.800	1	15,996
マプチモーター	10	16	60,000
日本電産	111	156	1,082,778
トレックス・セミコンダクター	2	3	7,560
東光高岳	2	3	7,901
ダブル・スコープ	12	21	27,720
ダイヘン	4	5	24,621
ヤーマン	7	12	18,150
JVCケンウッド	35	58	22,561
ミマキエンジニアリング	3	-	-
IPEX	2	4	4,981
日新電機	10	15	26,118
大崎電気工業	7	15	8,047
オムロン	35	58	426,377
日東工業	5	8	23,037
IDEC	5	9	31,112
不二電機工業	2	4	4,575
ジーエス・ユアコーポレーション	14	21	52,306
サクサホールディングス	2	3	5,787
メルコホールディングス	1	1	5,712
テクノメディカ	-	2	4,990
日本電気	54	91	434,980
富士通	38	64	1,122,391
沖電気工業	17	29	20,922
岩崎通信機	3	6	4,704
電気興業	2	2	5,631
サンケン電気	4	6	52,980
アイホン	2	3	7,620
ルネサスエレクトロニクス	233	419	717,896
セイコーエプソン	53	85	160,516
ワコム	33	50	33,644
アルバック	7	15	80,631
EIZO	3	4	17,390
ジャパンディスプレイ	147	247	10,374
日本信号	11	14	15,169
京三製作所	9	13	5,521
能美防災	5	8	14,407
ホーチキ	3	4	6,993
星和電機	-	10	4,742
エレコム	9	15	20,097

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本マイクロニクス	7	10	13,639
メガチップス	4	5	14,747
OBARA GROUP	2	3	11,520
澤藤電機	1	3	3,765
原田工業	3	5	4,763
コーセル	5	8	9,222
イリソ電子工業	3	5	27,641
オプテックスグループ	7	11	24,183
千代田インテグレ	1	2	4,785
アイ・オー・データ機器	3	-	-
レーザーテック	18	31	708,227
スタンレー電気	30	45	128,380
岩崎電気	1	2	9,334
ウシオ電機	22	33	53,046
岡谷電機産業	9	0.100	29
日本セラミック	4	6	17,524
遠藤照明	2	6	5,134
古河電池	3	4	5,395
山一電機	3	5	10,040
図研	2	5	19,085
日本電子	9	16	64,240
カシオ計算機	31	47	64,084
ファナック	37	62	1,418,750
日本シイエムケイ	8	13	6,709
エンプラス	1	1	7,514
大真空	5	7	5,826
ローム	19	29	308,700
浜松ホトニクス	30	51	340,326
三井ハイテック	4	6	45,936
新光電気工業	12	22	85,500
京セラ	60	98	661,542
太陽誘電	20	31	129,735
村田製作所	126	193	1,429,519
双葉電子工業	7	12	6,630
北陸電気工業	0.100	3	5,358
ニチコン	13	13	17,082
日本ケミコン	4	6	13,324
KOA	6	9	17,817
市光工業	5	-	-
小糸製作所	23	76	175,184
ミツバ	8	11	6,033

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ミクニ	9	13	4,732
太平洋工業	9	14	16,571
河西工業	10	-	-
アイシン	31	49	184,616
マツダ	135	210	246,519
今仙電機製作所	5	2	1,930
本田技研工業	338	517	1,791,242
スズキ	98	117	558,909
S U B A R U	123	201	442,897
ヤマハ発動機	56	100	337,837
エクセディ	6	10	18,720
豊田合成	13	18	40,306
愛三工業	6	10	9,124
盟和産業	-	4	4,598
ヨロズ	4	7	5,421
エフ・シー・シー	7	11	16,622
シマノ	17	26	571,590
テイ・エス テック	18	29	50,574
ジャムコ	3	3	6,279
精密機器(2.5%)			
テルモ	121	199	737,295
日機装	12	15	15,009
日本エム・ディ・エム	2	5	5,916
島津製作所	55	77	299,148
JMS	5	9	5,005
長野計器	3	4	5,552
ブイ・テクノロジー	1	3	7,808
東京計器	3	4	6,355
愛知時計電機	1	3	5,223
インターアクション	2	3	5,791
オーバル	12	6	3,182
東京精密	7	14	66,990
マニー	17	28	52,136
ニコン	65	99	128,106
トプコン	20	33	56,883
オリンパス	225	398	913,639
理研計器	3	4	19,820
タムロン	3	4	15,192
H O Y A	84	136	1,823,760
シード	-	2	1,466
ノーリツ鋼機	3	6	12,780

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ビジョン	26	40	89,320
兼松サステック	—	0.400	898
キングジム	3	5	4,961
リンテック	9	12	28,108
イトーキ	7	13	9,759
任天堂	24	402	2,197,074
三菱鉛筆	7	9	13,320
タカラスタANDARD	8	12	17,269
コクヨ	20	30	56,764
ナカバヤシ	5	9	4,761
グローブライド	3	5	13,305
オカムラ	14	19	25,881
美津濃	4	6	19,089
電気・ガス業(1.2%)			
東京電力ホールディングス	322	574	275,568
中部電力	131	234	340,315
関西電力	163	245	325,325
中国電力	67	101	71,385
北陸電力	39	60	34,317
東北電力	100	155	106,343
四国電力	38	54	40,908
九州電力	88	146	110,687
北海道電力	37	61	29,827
沖縄電力	9	14	15,943
電源開発	36	48	103,392
エフオン	2	4	2,486
イーレックス	6	11	22,961
レノバ	8	16	38,041
東京瓦斯	82	134	360,862
大阪瓦斯	78	129	276,963
東邦瓦斯	19	25	63,001
北海道瓦斯	2	3	6,870
広島ガス	8	14	4,844
西部ガスホールディングス	4	6	10,638
静岡ガス	11	14	16,269
メタウォーター	4	8	13,160
陸運業(2.9%)			
SBSホールディングス	3	5	18,439
東武鉄道	42	70	210,350
相鉄ホールディングス	13	21	48,153
東急	108	178	291,296

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
川崎汽船	12	54	176,150
N S ユナイテッド海運	2	3	14,577
明治海運	4	6	4,042
飯野海運	18	23	23,346
共栄タンカー	-	0,600	574
乾汽船	2	8	16,507
空運業(0.5%)			
日本航空	93	156	406,276
ANAホールディングス	103	173	486,649
パスコ	0.700	1	1,694
倉庫・運輸関連業(0.1%)			
トランコム	1	1	12,474
日新	3	4	9,744
三菱倉庫	13	13	42,675
三井倉庫ホールディングス	4	5	23,777
住友倉庫	14	17	36,872
澁澤倉庫	2	2	5,415
東陽倉庫	9	15	4,258
日本トランスシティ	9	12	7,257
中央倉庫	3	5	5,028
安田倉庫	3	5	4,914
東洋埠頭	2	-	-
上組	22	30	82,197
キューソー流通システム	-	4	4,006
近鉄エクスプレス	7	-	-
東海運	9	13	3,830
エーアイティ	2	4	6,312
内外トランスライン	1	2	4,979
日本コンセプト	1	3	4,579
情報・通信業(8.7%)			
N E C ネットエスアイ	14	21	34,697
クロスキャット	-	3	4,582
システナ	60	107	37,053
デジタルアーツ	2	4	21,720
日鉄ソリューションズ	6	10	36,624
キューブシステム	0.900	4	5,249
コア	1	3	5,025
手間いらず	0.600	1	5,461
ラクーンホールディングス	3	6	7,219
ソリトンシステムズ	-	4	4,862
ソフトクリエイトホールディングス	1	2	9,178

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アバントグループ	4	8	10,959
アドソル日進	1	3	5,398
フリービット	2	4	5,561
コムチュア	4	8	18,681
サイバーコム	2	0,600	850
アステリア	3	6	5,071
アイル	2	3	6,883
マークラインズ	2	3	9,243
メディカル・データ・ビジョン	5	9	8,569
gumi	5	10	8,964
テラスカイ	1	2	5,474
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2	3	5,412
P R T I M E S	1	2	3,853
ラクス	14	30	52,427
ランドコンピュータ	3	5	5,500
ダブルスタンダード	1	2	5,239
オープンドア	2	4	7,231
アカツキ	1	3	6,480
Ubicomホールディングス	1	2	4,425
カナミックネットワーク	6	9	4,830
ノムラシステムコーポレーション	10	39	4,446
チェンジ	7	15	41,574
シンクロー・フード	8	0,200	101
オークネット	2	3	5,644
キャピタル・アセット・プランニング	4	7	4,582
マクロミル	8	14	14,891
ビーグリー	1	3	4,389
オロ	1	2	4,565
ユーザローカル	1	3	6,425
マネーフォワード	6	15	74,536
電算システムホールディングス	1	3	7,771
プロトコーポレーション	4	8	9,968
ハイマックス	2	-	-
野村総合研究所	81	131	386,712
サイバネットシステム	4	5	5,194
C Eホールディングス	6	9	5,123
インテージホールディングス	5	8	14,616
東邦システムサイエンス	2	-	-
ソースネクスト	18	32	7,605
インフォコム	4	8	19,360
シンプレクス・ホールディングス	4	10	25,252

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
HEROZ	2	5	5,890
ラクスル	4	18	24,372
メルカリ	-	28	73,012
I P S	-	2	5,512
F I G	8	12	3,660
イーソル	4	6	4,410
アルテリア・ネットワークス	5	6	7,728
ウイングアーク1 s t	2	6	12,005
サーバーワークス	0,900	2	4,876
トビラシステムズ	3	4	4,233
Sansan	15	23	36,328
ギフトィ	3	6	17,705
メドレー	-	6	27,744
ベース	0,700	2	10,384
JMDC	4	10	44,940
フォーカスシステムズ	3	4	4,732
クレスコ	3	4	8,540
フジ・メディア・ホールディングス	40	61	68,276
オービック	13	21	427,491
ジャストシステム	6	9	31,694
TDCソフト	3	5	8,148
Zホールディングス	614	909	348,147
トレンドマイクロ	22	36	239,850
IDホールディングス	3	5	5,315
日本オラクル	8	12	114,070
アルファシステムズ	1	2	8,470
フューチャー	8	15	28,349
CAC Holdings	2	3	6,286
S Bテクノロジーズ	1	2	5,324
トーセ	4	6	4,687
オービックビジネスコンサルタント	4	12	60,039
伊藤忠テクノソリューションズ	19	34	104,958
アイティフォー	5	8	7,266
東計電算	0,600	0,900	5,346
エックスネット	-	4	4,872
大塚商会	22	36	165,977
サイボウズ	5	8	23,100
電通国際情報サービス	6	7	38,142
A C C E S S	4	7	7,524
デジタルガレージ	7	11	51,358
イーエムシステムズ	7	10	9,211

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ウェザーニューズ	1	2	15,594
C I J	3	5	5,991
ビジネスエンジニアリング	0.800	-	-
日本エンタープライズ	16	30	4,181
WOWOW	2	3	4,878
スカラ	4	6	4,785
ネットワンシステムズ	16	23	78,183
アルゴグラフィックス	3	5	22,567
マーベラス	6	10	7,488
エイベックス	7	10	17,581
B I P R O G Y	13	23	68,643
兼松エレクトロニクス	2	4	25,338
都築電気	2	3	5,009
T B Sホールディングス	25	32	53,268
日本テレビホールディングス	35	56	61,020
朝日放送グループホールディングス	4	7	5,016
テレビ朝日ホールディングス	10	15	21,731
スカパーJ S A Tホールディングス	35	56	27,612
テレビ東京ホールディングス	3	4	9,788
日本BS放送	2	4	4,368
ビジョン	7	8	13,431
USEN-NEXT HOLDINGS	4	5	14,905
コネクシオ	3	-	-
日本通信	35	58	14,136
日本電信電話	441	818	3,250,684
K D D I	308	493	1,993,650
ソフトバンク	639	1,026	1,572,498
光通信	5	7	151,725
エムティーアイ	4	9	4,794
GMOインターネットグループ	15	23	60,980
ファイバーゲート	2	-	-
アйдママーケティングコミュニケーション	10	16	4,706
K A D O K A W A	23	33	92,375
学研ホールディングス	6	10	9,147
ゼンリン	6	10	9,286
インプレスホールディングス	13	22	4,562
アイネット	2	3	4,992
松竹	2	3	40,885
東宝	24	40	189,200
東映	1	1	30,798
エヌ・ティ・ティ・データ	112	200	377,353

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
グリムス	1	2	6,946
バイタルケーエスケア・ホールディングス	7	9	8,486
八洲電機	3	5	6,042
メディアスホールディングス	3	7	5,464
レスターホールディングス	4	6	14,176
ジュテックホールディングス	2	4	5,332
OCHIホールディングス	2	3	5,206
TOKAIホールディングス	20	33	28,704
Cominix	4	6	5,005
三洋貿易	4	6	7,859
ビューティガレージ	-	1	4,207
ウイン・パートナーズ	3	4	5,179
シップハルスケアホールディングス	13	24	60,354
明治電機工業	2	4	5,358
コメダホールディングス	9	16	38,940
アセンテック	3	11	5,991
協栄産業	1	-	-
フルサト・マルカホールディングス	4	6	19,798
ヤマエグループホールディングス	2	3	6,281
小野建	4	6	9,337
南陽	1	2	5,055
佐鳥電機	-	4	6,858
伯東	2	3	18,876
コンドーテック	3	5	5,512
中山福	8	14	5,017
ナガイレーベン	5	8	16,753
三菱食品	4	6	20,398
松田産業	3	5	11,577
第一興商	8	13	55,250
メディパルホールディングス	45	69	122,325
S P K	2	3	5,316
萩原電気ホールディングス	1	2	6,931
アズワン	6	9	56,529
スズデン	1	2	6,391
シモジマ	2	5	5,319
ドウシシャ	4	7	12,559
小津産業	1	2	4,427
高速	2	3	6,727
丸文	3	6	7,938
ハピネット	3	5	10,590
橋本総業ホールディングス	1	4	5,254

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三愛オブリ	10	18	26,077
稲畑産業	9	13	35,496
G S Iクレオス	-	3	6,091
明和産業	3	9	6,318
クワザワホールディングス	-	10	4,939
ワキタ	9	12	14,470
東邦ホールディングス	13	16	36,136
サンゲツ	11	16	40,272
ミツウロコグループホールディングス	6	8	11,745
シナネンホールディングス	1	2	7,733
伊藤忠エネクス	9	16	18,403
サンリオ	13	19	77,928
サンワ テクノス	2	3	6,558
リョーサン	4	7	21,832
新光商事	6	9	11,720
トーホー	2	2	5,118
三信電気	2	2	6,885
東陽テクニカ	4	7	9,742
モスフードサービス	5	9	30,492
加賀電子	3	5	25,685
ソーダニッカ	4	-	-
立花エレテック	3	4	9,177
フォーバル	3	-	-
P A L T A C	5	10	51,516
三谷産業	9	15	5,008
西本Wismettacホールディングス	1	1	6,162
K P Pグループホールディングス	9	15	12,355
ヤマタネ	2	3	4,995
丸紅建材リース	1	2	4,847
日鉄物産	3	4	42,596
泉州電業	1	3	12,427
トラスコ中山	8	14	31,048
オートバックスセブン	14	23	33,883
モリト	4	6	6,402
加藤産業	6	8	29,807
イエローハット	7	11	21,158
J Kホールディングス	3	5	5,628
日伝	3	4	7,612
北沢産業	12	23	6,354
杉本商事	2	3	5,748
因幡電機産業	11	17	49,070

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

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

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
チヨダ	4	6	5,068
ライフコーポレーション	4	5	16,496
リンガーハット	5	8	19,583
MrMaxHD	5	9	6,429
AOKIホールディングス	8	12	9,812
オークワ	6	10	9,946
コメリ	6	10	27,560
青山商事	8	14	13,694
しまむら	4	7	102,147
高島屋	30	50	96,723
松屋	8	11	12,973
エイチ・ツー・オー リテイリング	20	32	44,575
近鉄百貨店	1	2	5,398
丸井グループ	33	49	102,680
アクシアル リテイリング	3	4	16,307
イオン	163	228	596,923
イズミ	7	10	30,549
平和堂	7	11	24,600
フジ	5	10	18,818
ヤオコー	4	7	51,984
ゼビオホールディングス	5	9	8,908
ケーズホールディングス	39	53	63,355
日産東京販売ホールディングス	13	4	1,675
Genky DrugStores	1	3	14,008
ナルミヤ・インターナショナル	3	5	5,224
ブックオフグループホールディングス	2	4	5,096
ギフトホールディングス	-	1	5,999
アインホールディングス	6	9	52,080
元気寿司	1	2	6,394
ヤマダホールディングス	155	276	132,347
アーケランズ	6	9	14,404
ニトリホールディングス	16	27	439,120
グルメ杵屋	3	5	5,560
愛眼	17	27	4,537
ケーユーホールディングス	-	3	5,674
吉野家ホールディングス	14	26	62,594
松屋フーズホールディングス	2	3	12,800
サガミホールディングス	6	10	13,748
関西フードマーケット	3	6	8,277
王将フードサービス	2	4	26,708
プレナス	4	-	-

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
千葉興業銀行	11	14	7,541	
筑波銀行	—	27	6,572	
七十七銀行	13	20	48,501	
青森銀行	3	—	—	
秋田銀行	2	4	8,148	
山形銀行	4	7	8,939	
岩手銀行	2	4	10,479	
東邦銀行	35	49	12,300	
みちのく銀行	3	—	—	
ふくおかフィナンシャルグループ	35	50	155,059	
静岡銀行	103	—	—	
スルガ銀行	37	55	23,391	
八十二銀行	95	128	77,734	
山梨中央銀行	4	6	8,659	
大垣共立銀行	8	12	23,976	
福井銀行	3	5	9,486	
清水銀行	1	3	4,792	
富山銀行	1	1	1,985	
滋賀銀行	8	10	30,243	
南都銀行	6	9	25,126	
百五銀行	40	59	24,603	
京都銀行	15	19	127,957	
紀陽銀行	14	22	36,310	
ほくほくフィナンシャルグループ	26	39	42,134	
山陰合同銀行	25	39	33,129	
中国銀行	33	—	—	
鳥取銀行	1	—	—	
伊予銀行	56	—	—	
百十四銀行	4	5	11,382	
四国銀行	6	10	9,520	
阿波銀行	6	9	20,794	
大分銀行	2	3	8,588	
宮崎銀行	2	4	11,410	
佐賀銀行	2	3	6,830	
琉球銀行	9	14	15,825	
セブン銀行	126	224	60,444	
みずほフィナンシャルグループ	543	907	1,945,729	
山口フィナンシャルグループ	49	69	63,894	
長野銀行	2	3	5,486	
名古屋銀行	3	4	15,204	
北洋銀行	64	95	28,405	

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
その他金融業(1.2%)			
全国保証	10	16	87,285
ジェイリース	1	2	4,998
イントラスト	3	4	3,897
アルヒ	6	7	8,616
プレミアグループ	2	10	16,493
ネットプロテクションズホールディングス	—	20	11,964
クレディセゾン	27	39	72,412
芙蓉総合リース	4	5	52,722
みずほリース	6	9	33,340
東京センチュリー	8	11	54,634
日本証券金融	16	25	25,928
アイフル	71	103	38,339
リコーリース	3	6	23,730
イオンフィナンシャルサービス	23	36	47,952
アコム	83	111	36,591
ジャックス	4	6	28,743
オリエンコーポレーション	114	16	19,122
オリックス	257	419	1,017,916
三菱HCキャピタル	156	244	169,997
九州リースサービス	5	3	3,104
日本取引所グループ	107	176	346,497
イー・ギャランティ	6	10	22,977
アサックス	4	8	4,952
NECキャピタルソリューション	1	3	7,998
不動産業(1.9%)			
大東建託	13	23	289,340
いちご	47	72	20,793
日本駐車場開発	46	74	19,123
スター・マイカ・ホールディングス	2	—	—
SREホールディングス	1	3	10,757
ADワークスグループ	19	20	3,292
ヒューリック	101	146	158,442
三栄建築設計	1	3	4,926
野村不動産ホールディングス	22	39	114,503
三重交通グループホールディングス	8	13	6,686
サムティ	6	10	20,460
ディア・ライフ	5	9	5,942
コーセーアールイー	4	6	4,532
地主	2	4	9,124
プレサンスコーポレーション	5	8	13,751

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
穴吹興産	1	2	5,014
サンフロンティア不動産	5	10	12,820
FJネクストホールディングス	4	6	6,501
グランディハウス	6	8	4,988
日本空港ビルデング	16	22	144,300
サービス業(5.2%)			
日本工営	2	4	15,228
L I F U L L	12	22	4,345
M I X I	9	14	39,201
ジェイエイシーリクルートメント	3	5	13,446
日本M&Aセンターホールディングス	67	112	134,647
メンバーズ	1	2	3,632
UTグループ	5	9	23,241
アイティメディア	1	3	4,512
E・Jホールディングス	—	4	5,678
オープンアップグループ	10	23	44,860
コシダカホールディングス	11	19	18,012
アルトナー	3	1	1,409
パソナグループ	4	7	15,199
CDS	1	2	4,690
リングアンドモチベーション	9	18	11,280
エス・エム・エス	14	24	82,917
サニーサイドアップグループ	4	7	4,102
パーソルホールディングス	41	73	204,726
クックパッド	12	26	5,772
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4	3	2,165
学情	2	3	4,844
スタジオアリス	1	3	6,930
シミックホールディングス	2	3	6,336
N J S	1	2	5,060
総合警備保障	16	24	85,293
カカココム	30	48	94,132
アイロムグループ	1	2	4,783
セントケア・ホールディング	3	5	4,553
ルネサンス	2	5	5,084
ディップ	7	11	42,090
デジタルホールディングス	2	5	5,946
新日本科学	5	6	18,429
ベネフィット・ワン	15	30	63,145
エムスリー	72	129	427,667
ツカダ・グローバルホールディング	10	—	—

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アウトソーシング	23	39	49,101
ウェルネット	6	7	5,089
ワールドホールディングス	1	2	7,803
ディー・エヌ・エー	15	27	50,136
博報堂DYホールディングス	57	83	125,584
ぐるなび	6	12	4,662
ジャパンバスターシキュシステム	—	5	4,655
ファンコミュニケーションズ	10	12	5,248
ライク	—	2	4,562
ビジネス・ブレークスルー	7	11	4,446
エスプール	11	18	12,972
WDBホールディングス	1	3	6,642
アドウェイズ	6	9	6,435
バリューコマース	3	4	8,383
インフォマート	45	68	22,304
J P ホールディングス	12	18	6,448
CLホールディングス	2	6	4,972
プレステージ・インターナショナル	15	27	18,562
アミューズ	2	3	6,177
ドリームインキュベータ	1	2	6,177
クイック	2	5	9,170
TAC	13	22	4,651
電通グループ	42	64	280,348
ぴあ	1	2	6,853
イオンファンタジー	1	2	7,966
シーティーエス	4	7	5,666
ネクシィーズグループ	4	—	—
H. U. グループホールディングス	10	19	51,590
アルプス技研	3	5	13,668
日本空調サービス	4	7	5,047
オリエンタルランド	48	69	1,488,217
ダスキン	9	14	45,552
明光ネットワークジャパン	5	8	5,340
ファルコホールディングス	2	3	5,892
秀英予備校	7	11	4,706
ラウンドワン	11	54	26,256
リゾートトラスト	18	25	55,315
ビー・エム・エル	5	8	25,636
りらいあコミュニケーションズ	6	10	15,681
リソー教育	18	29	10,549
早稲田アカデミー	2	4	5,190

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユー・エス・エス	46	67	150,213
東京個別指導学院	4	9	4,885
サイバーエージェント	101	156	187,920
楽天グループ	211	302	209,303
クリーク・アンド・リバー社	2	3	8,618
モーニングスター	7	10	5,232
テー・オー・ダブリュー	9	16	5,018
山田コンサルティンググループ	2	4	6,451
セントラルスポーツ	1	2	6,165
フルキャストホールディングス	3	6	15,500
エン・ジャパン	6	11	28,426
テクノプロ・ホールディングス	24	43	152,333
インタワーワークス	7	12	4,798
アイ・アールジャパンホールディングス	1	3	6,762
Keeper 技研	2	4	16,755
三機サービス	2	4	4,377
Gunosy	2	-	-
イー・ガーディアン	1	2	5,952
リブセンス	17	1	475
ジャパンマテリアル	12	20	47,260
ベクトル	5	10	14,008
ウチヤマホールディングス	9	15	4,277
チャーム・ケア・コーポレーション	3	5	6,099
キャリアリンク	2	2	6,072
I B J	3	5	4,494
アサンテ	1	3	5,260
バリュウHR	1	5	9,063
M&Aキャピタルパートナーズ	3	6	27,210
ライドオンエクスプレスホールディングス	1	4	5,156
アビスト	1	-	-
シグマクシス・ホールディングス	2	9	10,909
ウィルグループ	3	5	6,064
メドピア	3	5	6,981
リクルートホールディングス	317	484	1,846,222
エラン	5	8	9,282
日本郵政	537	858	1,046,331
ベルシステム24ホールディングス	5	8	13,006
鎌倉新書	4	7	8,073
SMN	4	8	3,801
エアトリ	2	4	10,714
アトラエ	2	5	5,074
ストライク	1	3	13,056
ソラスト	10	18	12,222
インソース	4	16	21,205
ペイカレント・コンサルティング	2	51	289,562

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
応用地質	4	6	12,187
船井総研ホールディングス	8	13	38,391
進学会ホールディングス	10	14	4,380
学究社	1	2	5,429
ベネッセホールディングス	13	24	48,214
イオンディライト	5	7	21,744
ナック	3	5	5,090
ダイセキ	7	13	53,935
ステップ	1	2	4,795
合計	株数・金額	47,173	74,409 183,450,884
	銘柄数<比率>	1,840	1,821 <97.9%>

(注1) 銘柄欄の()内は、当期末における国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
国内		百万円	百万円
	TOPIX		3,958

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2023年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	183,450,884	97.7
コール・ローン等、その他	4,369,209	2.3
投資信託財産総額	187,820,093	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月20日現在)

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

(注1) 期首元本額	54,493,461,224円
期中追加設定元本額	52,350,966,244円
期中一部解約元本額	25,624,682,877円
(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。	
ニッセイTOPIXオープン	5,571,030,272円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	3,265,507,266円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	3,457,877円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,199,185,777円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	7,566,845,432円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	5,825,429,331円
ニッセイインデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	3,392,674円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	13,543,439円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	11,849,890円
DCニッセイ国内株式インデックス	1,876,859,994円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	23,490,370,695円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	2,985,872,092円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	290,153,997円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	242,293,972円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	335,702,180円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	571,176,835円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	47,127,163円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(6資産均等型)	124,141,170円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	9,162,792円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	12,847,195円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	5,307,703円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	8,885,025円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	28,981,300円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	212,241,013円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	141,337,546円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	299,353,517円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	205,759,439円
ニッセイ国内株式市場連動SAファンド(適格機関投資家限定)	25,795,069,108円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型)(スケッチ)	22,046,930円
ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(安定型)	72,423円
ニッセイ国内3資産高値参照型バランスファンド(積極型)	154,390円
FWニッセイ国内株インデックス	38,721,220円
DCニッセイターゲットデートファンド2065	15,864,934円

損益の状況

当期(2022年2月22日~2023年2月20日)

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

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

ニッセイ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

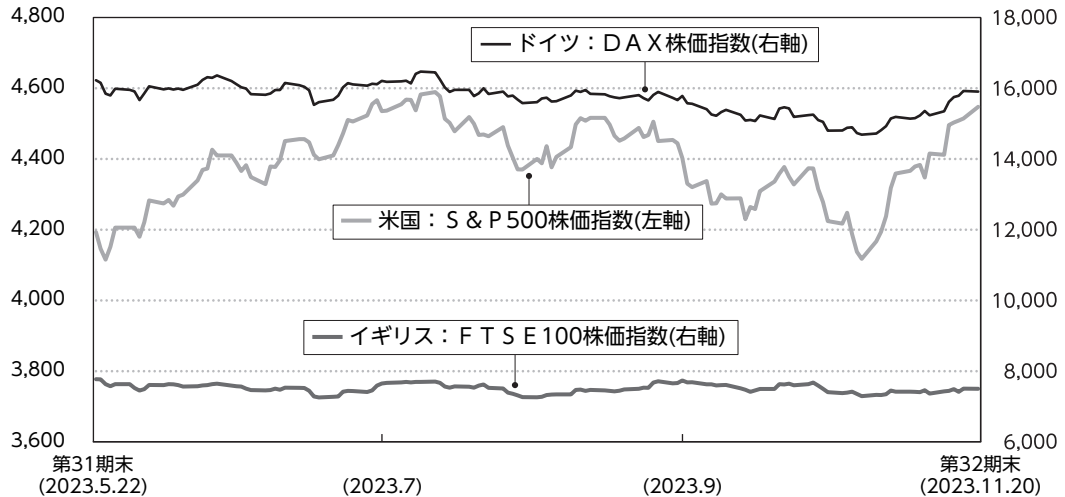
運用経過

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】

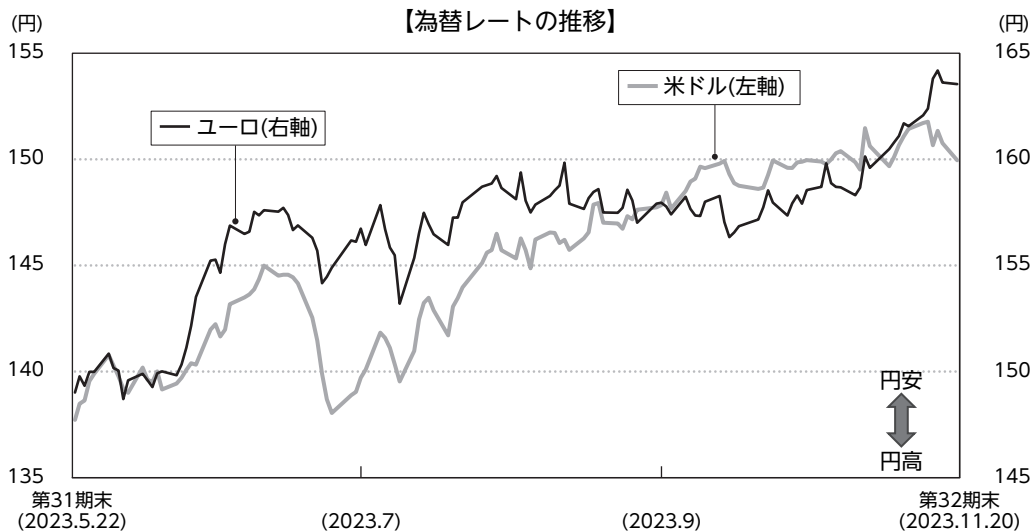


(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

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と政策継続への見方が強まったことなどからユーロ高円安となり、結局、期を通じて見るとユーロ高円安で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

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

<下落要因>

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

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

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

お知らせ

■ 約款変更

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

(2023年8月19日)

最近5期の運用実績

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

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2023年5月23日～2023年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式)	0円	0.001%	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.003	
(株式)	(1)	(0.003)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	3	0.008	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.008)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	5	0.013	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

売買および取引の状況

2023年5月23日～2023年11月20日

(1) 株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2023年5月23日～2023年11月20日

株式

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

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

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

組入有価証券明細表

2023年11月20日現在

(1) 外国株式

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(スウェーデン)		百株	百株	千円		
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		137	147	3,249	46,307	資本財
INVESTOR AB		1,680	1,718	36,313	517,464	金融サービス
INVESTOR AB-A SHS		464	-	-	-	金融サービス
KINNEVIK AB - B		223	-	-	-	金融サービス
LIFCO AB-B SHS		215	231	5,235	74,603	資本財
LUNDBERGS AB-B SHS		70	74	3,595	51,238	金融サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		1,400	1,506	9,854	140,421	資本財
NORDEA BANK ABP		3,057	3,200	38,531	549,066	銀行
SAAB AB-B		-	79	4,413	62,885	資本財
SAGAX AB-B		176	196	4,568	65,105	不動産管理・開発
SANDVIK AB		984	1,058	21,421	305,257	資本財
SECURITAS AB		453	487	4,381	62,433	商業・専門サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		1,492	1,574	19,874	283,216	銀行
SKANSKA AB-B SHS		314	337	5,622	80,124	資本財
SKF AB		353	338	6,425	91,559	資本財
SVENSKA CELLULOOSA AB		559	601	9,725	138,589	素材
SVENSKA HANDELSBANKEN		1,347	1,447	14,259	203,201	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES		836	842	15,530	221,305	銀行
TELE2 AB		538	554	4,511	64,290	電気通信サービス
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON		2,696	2,909	15,192	216,489	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB		2,527	2,474	5,977	85,182	電気通信サービス
VOLVO AB		1,388	1,494	34,777	495,575	資本財
VOLVO AB-A SHS		190	203	4,862	69,293	資本財
VOLVO CAR AB-B		550	592	2,148	30,616	自動車・自動車部品
小計		株数・金額				
		34,536	35,179	513,368	7,315,494	
		銘柄数<比率>				
		46	43	-	<0.9%>	
(ユーロ/アイルランド)				千ユーロ		
AIB GROUP PLC		985	1,427	598	97,890	銀行
BANK OF IRELAND GROUP PLC		988	1,048	901	147,377	銀行
CRH PLC		690	-	-	-	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.		154	175	2,545	416,239	消費者サービス
KERRY GROUP PLC-A		147	158	1,153	188,706	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC		142	153	1,061	173,517	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		228	258	820	134,155	素材
小計		株数・金額				
		3,336	3,222	7,080	1,157,886	
		銘柄数<比率>				
		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	
(ユーロ/オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ABN AMRO BANK NV	372	399	507	83,006	銀行
ADYEN NV	20	21	2,239	366,189	金融サービス
AIRBUS SE	546	589	7,792	1,274,319	資本財
AKZO NOBEL NV	167	169	1,165	190,667	素材
ASM INTERNATIONAL NV	43	46	2,171	355,060	半導体・半導体製造装置
ASML HOLDING NV	372	400	25,190	4,119,695	半導体・半導体製造装置
ASR NEDERLAND NV	-	158	583	95,401	保険
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	-	76	916	149,957	半導体・半導体製造装置
CNH INDUSTRIAL NV	945	1,016	952	155,745	資本財
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	482	518	533	87,187	食品・飲料・タバコ
DSM-FIRMENICH AG	158	184	1,699	277,936	素材
EURONEXT NV	79	85	625	102,239	金融サービス
EXOR NV	99	107	924	151,218	金融サービス
FERRARI NV	116	125	4,128	675,132	自動車・自動車部品
HEINEKEN HOLDING NV	106	128	913	149,368	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN NV	239	286	2,381	389,430	食品・飲料・タバコ
IMCD NV	52	56	760	124,444	資本財
ING GROEP NV-CVA	3,443	3,595	4,585	749,974	銀行
JDE PEET'S BV	92	124	318	52,125	食品・飲料・タバコ
JUST EAT TAKEAWAY	169	-	-	-	消費者サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	965	964	2,567	419,889	生活必需品流通・小売り
KONINKLIJKE PHILIPS NV	858	922	1,789	292,647	ヘルスケア機器・サービス
NN GROUP NV	257	249	799	130,702	保険
OCI NV	97	104	222	36,396	素材
PROSUS	740	1,519	4,594	751,406	一般消費財・サービス流通・小売り
QIAGEN NV	210	226	816	133,540	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD NV	110	109	585	95,797	商業・専門サービス
ROYAL KPN NV	3,123	3,297	1,044	170,770	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	631	679	2,846	465,557	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	670	814	1,951	319,182	メディア・娯楽
WOLTERS KLUWER NV	237	255	3,133	512,380	商業・専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,413 29	17,234 30	78,741 -	12,877,372 <1.6%>
(ユーロ/ベルギー)					
AGEAS	148	158	610	99,819	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	802	863	4,854	793,841	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE	51	55	2,515	411,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ/ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
D'IETTEREN GROUP		23	21	332	54,449	一般消費財・サービス流通・小売り
ELIA GROUP SA/NV		30	29	298	48,837	公益事業
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		92	94	687	112,443	金融サービス
KBC GROEP NV		231	248	1,324	216,548	銀行
LOTUS BAKERIES		-	0.41	308	50,489	食品・飲料・タバコ
SOFINA		14	15	308	50,387	金融サービス
SOLVAY SA		68	73	759	124,177	素材
UCB SA		116	125	860	140,710	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE		193	208	485	79,376	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,773 11	1,894 12	13,345 -	2,182,500 <0.3%>	
(ユーロ/ルクセンブルグ)						
ARCELORMITTAL		485	507	1,112	181,869	素材
TENARIS SA		435	468	733	119,940	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	921 2	975 2	1,845 -	301,810 <0.0%>	
(ユーロ/フランス)						
ACCOR		157	183	576	94,268	消費者サービス
ADP		27	29	341	55,866	運輸
AIR LIQUIDE		483	520	8,861	1,449,269	素材
ALSTOM RGPT		295	284	352	57,583	資本財
AMUNDI SA		56	60	338	55,438	金融サービス
ARKEMA		55	59	555	90,843	素材
AXA SA		1,738	1,823	5,176	846,562	保険
BIOMERIEUX		38	41	394	64,510	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS		1,026	1,042	5,914	967,266	銀行
BOLLORE SE		818	732	389	63,746	メディア・娯楽
BOUYGUES		208	189	661	108,106	資本財
BUREAU VERITAS SA		271	293	648	105,996	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA		151	163	2,915	476,788	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA		547	592	1,008	164,915	生活必需品流通・小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN		452	459	2,682	438,659	資本財
CREDIT AGRICOLE SA		1,125	1,201	1,413	231,219	銀行
DANONE		593	639	3,681	602,067	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA		23	20	384	62,802	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA		616	665	2,799	457,895	ソフトウェア・サービス
EDENRED		230	248	1,240	202,878	金融サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

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

(注4) 業種は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	
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	
BOSTON PROPERTIES INC	13	14	815	122,319	
CROWN CASTLE INC	40	43	4,481	672,039	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14	16	1,695	254,272	
PROLOGIS INC	85	91	10,103	1,514,977	
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	43	49	875	131,231	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	12	14	2,384	357,577	
CAMDEN PROPERTY TRUST	9	10	927	139,023	
EQUITY RESIDENTIAL	33	35	1,982	297,268	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	6	1,345	201,752	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	49	54	895	134,254	
WELLTOWER INC	43	49	4,321	648,006	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	66	70	1,219	182,844	
KIMCO REALTY CORP	57	61	1,158	173,724	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10	11	1,407	211,072	
PUBLIC STORAGE	14	15	4,052	607,724	
REGENCY CENTERS CORP	14	16	1,018	152,690	
SIMON PROPERTY GROUP INC	30	32	3,953	592,882	
SUN COMMUNITIES INC	11	12	1,518	227,649	
UDR INC	30	31	1,019	152,941	
VENTAS INC	36	39	1,770	265,454	
WP CAREY INC	19	21	1,202	180,305	
REALTY INCOME CORP	58	66	3,542	531,258	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16	17	1,221	183,128	
EXTRA SPACE STORAGE INC	12	21	2,693	403,903	
DIGITAL REALTY TRUST INC	26	28	3,895	584,183	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	55	—	—	—	
IRON MOUNTAIN INC	26	28	1,802	270,330	
AMERICAN TOWER REIT INC	43	46	9,161	1,373,736	
EQUINIX INC	8	9	7,200	1,079,681	
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPOR	35	37	540	81,112	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	29	32	1,166	174,845	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	23	26	1,184	177,584	
SBA COMMUNICATIONS CORP	9	10	2,517	377,432	
INVITATION HOMES INC	56	60	2,038	305,646	
VICI PROPERTIES INC	89	99	2,853	427,918	
小計	□数・金額	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	
(カナダ)			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%>
(オーストラリア)					千オーストラリア・ドル	
GPT GROUP			176	189	790	77,115
GOODMAN GROUP			156	168	3,896	380,163
STOCKLAND			220	236	943	92,088
MIRVAC GROUP			364	391	802	78,273
VICINITY CENTRES			356	383	710	69,313
LENDLEASE GROUP			63	68	469	45,776
SCENTRE GROUP			479	515	1,369	133,663
DEXUS/AU			99	106	764	74,544
小計	□数・金額		1,916	2,060	9,746	950,939
	銘柄数<比率>		8	8	—	<0.1%>
(香港)					千香港ドル	
LINK REIT			199	251	10,013	192,552
小計	□数・金額		199	251	10,013	192,552
	銘柄数<比率>		1	1	—	<0.0%>
(シンガポール)					千シンガポール・ドル	
CAPITALAND ASCENDAS REIT			311	370	1,036	115,648
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL			490	528	983	109,713
MAPLETREE LOGISTICS TRUST			311	343	542	60,570
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR			217	235	325	36,305
小計	□数・金額		1,330	1,478	2,888	322,238
	銘柄数<比率>		4	4	—	<0.0%>
(イギリス)					千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC			81	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC			65	70	457	85,405
SEGRO PLC			111	115	952	177,792
小計	□数・金額		257	185	1,409	263,197
	銘柄数<比率>		3	2	—	<0.0%>
(ユーロ/ベルギー)					千ユーロ	
WAREHOUSES DE PAUW SCA			15	16	420	68,833
小計	□数・金額		15	16	420	68,833
	銘柄数<比率>		1	1	—	<0.0%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
外 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
(A)資産	843,905,268,660円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	19,901,926,195
株 式(評価額)	780,690,036,233
投 資 信 託 証 券(評価額)	15,356,225,963
未 収 入 金	16,020,545,503
未 収 配 当 金	950,156,766
差 入 委 託 証 拠 金	10,986,378,000
(B)負債	16,847,404,762
未 払 金	15,040,401,421
未 払 解 約 金	1,806,984,938
そ の 他 未 払 費 用	18,403
(C)純 資 産 総 額(A - B)	827,057,863,898
元 本	220,818,463,085
次 期 繰 越 損 益 金	606,239,400,813
(D)受 益 権 総 口 数	220,818,463,085口
1万口当たり基準価額(C / D)	37,454円

(注1) 期首元本額	205,978,181,520円
期中追加設定元本額	26,115,488,072円
期中一部解約元本額	11,275,206,507円
(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーフンド別内訳は、次の通りです。	
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	794,706,462円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,806,956,625円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,508,595,111円
ニッセイ外国株式インデックスS A(適格機関投資家限定)	2,154,739,003円
ニッセイインデックスバラス(債券重視) S A(適格機関投資家限定)	949,369円
ニッセイインデックスバラス(標準型) S A(適格機関投資家限定)	5,648,440円
ニッセイインデックスバラス(成長型) S A(適格機関投資家限定)	5,790,300円
ニッセイ外国株式インデックスA II(適格機関投資家限定)	326,433,259円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国株式インデックスファンド	158,220,790,915円
DCニッセイ外国株式インデックス	39,070,481,438円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバラスファンド(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(高成長ヘッジあり)(ラップ専用)	30,410,953円
ニッセイ先進国株式インデックス(高成長ヘッジなし)(ラップ専用)	6,069,453,038円
FWニッセイ先進国株インデックス	56,059,397円
DCニッセイターゲットデットファンド2065	58,158,827円
ニッセイ海外資産インデックス・バラスファンドⅡ2023-05(適格機関投資家限定)	100,296,022円
DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト	395,809円

損益の状況

当期(2023年5月23日~2023年11月20日)

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

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

ニッセイ新興国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第6期

(計算期間：2022年11月22日～2023年11月20日)

運用方針

主に新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、MSCIエマージング・マーケット・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

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

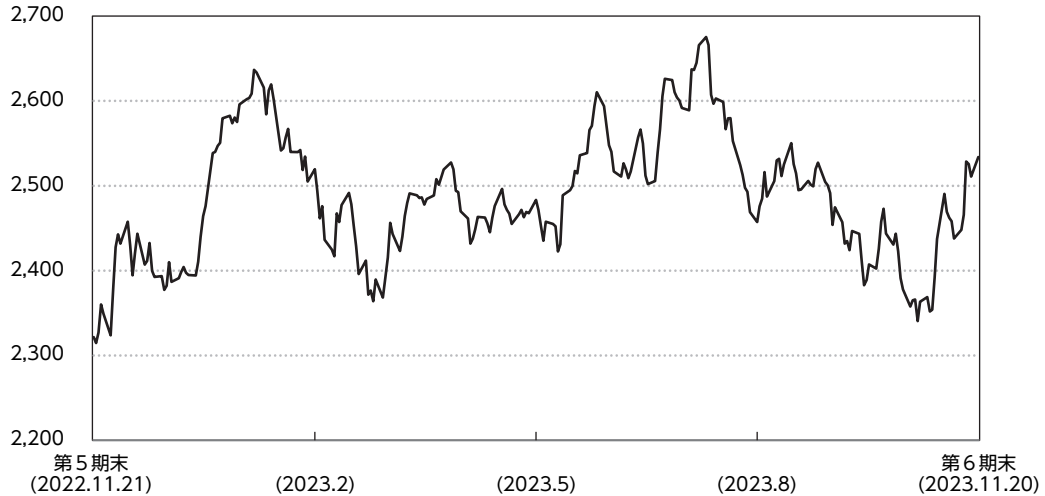
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2022年11月22日～2023年11月20日

海外株式市況

【MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】

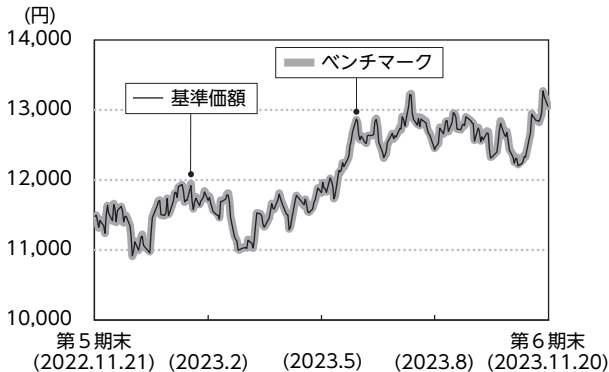


(注) 指数はブルームバーグのデータを使用しています。

新興国株式市場は期を通じて見ると上昇しました。

期初から2023年1月にかけては、米国の金融引き締め長期化や世界経済の減速が懸念された一方、中国における「ゼロコロナ」政策の緩和姿勢や大手不動産開発会社への支援等が好感され株価は上昇しました。2月から5月にかけては、米国の金融引き締めへの警戒感や欧米金融市場における信用不安、地政学リスクの高まりなどを受けて投資家心理が悪化し株価は軟調に推移しました。6月から10月にかけては、米国の金融引き締めに対する懸念の一服や中国における金融市場・景気への支援策が好感された一方、中国景気や不動産市場の不透明感は根強く株価は一進一退の展開となりました。11月に入ると米国の金融引き締めへの懸念の後退と中国における景気支援策への期待感から株価は上昇して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>

- ・ 2023年1月に中国における経済活動再開の動きや米金融政策転換への期待感の高まりを背景に株価が上昇したこと
- ・ 6月から7月にかけて、中国における景気支援策への期待感や米国の金融引き締めに対する過度な懸念の後退を受けて株価が上昇したこと

<下落要因>

- ・ 2023年9月から10月にかけて、中国における景気の見通しや不動産市場の不透明感、地政学リスクへの懸念等を背景に株価が下落したこと

ポートフォリオ

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）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+13.7%となり、ベンチマーク騰落率（+13.7%）に連動しました。

今後の運用方針

新興国の株式等（DR（預託証券）を含みます）に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率					
	円	%		%	%	%	%	%	百万円
2期(2019年11月20日)	9,354	5.1	10,252	5.8	85.7	8.5	-	4.1	2,160
3期(2020年11月20日)	10,400	11.2	11,393	11.1	92.3	3.5	-	4.0	2,353
4期(2021年11月22日)	12,243	17.7	13,481	18.3	86.1	8.1	0.0	5.6	4,467
5期(2022年11月21日)	11,479	△ 6.2	12,677	△ 6.0	81.4	11.1	-	7.2	5,428
6期(2023年11月20日)	13,051	13.7	14,414	13.7	79.6	13.7	-	6.6	9,289

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
		%		%				
(期首) 2022年11月21日	11,479	-	12,677	-	81.4	11.1	-	7.2
11月末	11,502	0.2	12,708	0.2	80.8	12.7	-	6.9
12月末	11,065	△ 3.6	12,220	△ 3.6	84.3	8.4	-	7.1
2023年 1月末	11,845	3.2	13,099	3.3	82.9	10.5	-	6.5
2月末	11,493	0.1	12,709	0.2	80.3	13.0	-	6.4
3月末	11,527	0.4	12,731	0.4	85.3	7.4	-	7.0
4月末	11,427	△ 0.5	12,613	△ 0.5	82.5	10.0	-	7.3
5月末	11,915	3.8	13,171	3.9	80.3	13.5	-	7.0
6月末	12,632	10.0	13,953	10.1	83.1	9.8	-	7.0
7月末	13,042	13.6	14,395	13.5	79.0	14.2	-	6.5
8月末	12,847	11.9	14,182	11.9	83.8	9.0	-	7.2
9月末	12,575	9.5	13,901	9.7	84.0	8.7	-	7.1
10月末	12,264	6.8	13,570	7.0	81.3	11.9	-	6.6
(期末) 2023年11月20日	13,051	13.7	14,414	13.7	79.6	13.7	-	6.6

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2022年11月22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	4円	0.030%	
(株式)	(2)	(0.017)	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)	(1)	(0.012)	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)	(0.001)	
有価証券取引税	3	0.025	
(株式)	(3)	(0.025)	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	29	0.240	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)	(21)	(0.174)	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)	(8)	(0.065)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	36	0.295	

(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（12,060円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2022年11月22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 367 (7)	千米ドル 521	百株 175	千米ドル 298
	香港	22,920 (106)	千香港ドル 35,314 (△ 26)	3,020	千香港ドル 1,139
	台湾	9,090 (175)	千台湾ドル 81,852 (△ 319)	40	千台湾ドル 776
	トルコ	874 (205)	千トルコ・リラ 4,284	107	千トルコ・リラ 556
	メキシコ	2,155 (179)	千メキシコ・ペソ 8,406	1,329	千メキシコ・ペソ 1,809
	フィリピン	700 (17)	千フィリピン・ペソ 4,593	1,031	千フィリピン・ペソ 812
	チリ	2,455 (1)	千チリ・ペソ 91,042	77	千チリ・ペソ 13,943
	コロンビア	28	千コロンビア・ペソ 76,723	180	千コロンビア・ペソ 41,390
	インド	4,373 (445)	千インド・ルピー 233,491	112	千インド・ルピー 8,258
	インドネシア	79,116 (1,938)	千インドネシア・ルピア 5,291,617	777	千インドネシア・ルピア 164,096

ニッセイ新興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	ブラジル	百株 1,984 (14)	千ブラジル・リアル 4,432	百株 156	千ブラジル・リアル 214
	チェコ	3	千チェコ・コルナ 358	—	千チェコ・コルナ —
	韓国	376 (△ 0.56)	千韓国ウォン 2,969,206	24	千韓国ウォン 84,777
	中国	5,589 (89)	千人民元 7,476	931	千人民元 1,055
	マレーシア	1,744	千マレーシア・リングgit 1,177	399	千マレーシア・リングgit 35
	南アフリカ	817	千南アフリカ・ランド (△ 35)	88	千南アフリカ・ランド 1,058
	タイ	3,512 (△ 202)	千タイ・バーツ 13,907	295	千タイ・バーツ 871
	ポーランド	174	千ポーランド・ズロチ 777	27	千ポーランド・ズロチ 119
	ハンガリー	22	千ハンガリー・フォリント 12,382	—	千ハンガリー・フォリント —
	ユーロ ギリシャ	423	千ユーロ 135 (△ 0.819)	30	千ユーロ 45

(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。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。

ニッセイ新興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	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	20	308	0.700	10
ISHARES MSCI QATAR CP ETF	10	189	—	—
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	19	753	—	—
ISHARES MSCI KUWAIT ETF	6	211	—	—
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	1	1
	(1)	(1)		
(メキシコ)		千メキシコ・ペソ		千メキシコ・ペソ
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	2	63	—	—

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
	4,825	4,235	—	—

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2022年11月22日～2023年11月20日

株式

銘柄	買付			売付			
	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	60	144,172	2,402	TRIP.COM GROUP LTD	3	16,954	4,577
TENCENT HOLDINGS LTD	18	111,167	5,944	AMERICA MOVIL SAB DE CV	107	14,798	138
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	11	80,817	7,134	LI AUTO INC - ADR	3	9,192	2,918
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	47	73,336	1,550	BEIGENE LTD-ADR	0.239	6,074	25,415
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	7	31,857	4,291	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	0.100	3,797	37,977
MEITUAN-B	12	30,530	2,482	XPENG INC - ADR	2	3,459	1,433
PDD HOLDINGS INC(ADR)	1	23,595	12,490	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	25	2,973	118
ECOPRO CO LTD	0.159	22,208	139,677	TERNA ENERGY SA	1	2,666	2,621
TRIP.COM GROUP LTD	4	21,614	4,803	ZAI LAB LTD-ADR	0.559	2,632	4,709
ICICI BANK LTD	12	20,506	1,611	HDFC BANK LTD	0.919	2,607	2,837

(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	
AUTOHOME INC-ADR	5	5	14	2,147	メディア・娯楽
BEIGENE LTD-ADR	2	—	—	—	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	5	5	4	701	素材
CREDICORP LTD	4	4	63	9,483	銀行
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4	4	10	1,618	半導体・半導体製造装置
H WORLD GROUP LIMITED(ADR)	10	14	53	8,093	消費者サービス
HUTCHMED CHINA LIMITED ADR	6	—	—	—	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	—	99	13	2,023	エネルギー
IQIYI INC-ADR	9	32	16	2,437	メディア・娯楽
JOYY INC	3	3	13	2,082	メディア・娯楽
KANZHUN LTD	11	19	31	4,718	メディア・娯楽
KE HOLDINGS INC	38	52	81	12,149	不動産管理・開発
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2	5	36	5,488	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LI AUTO INC - ADR	31	—	—	—	自動車・自動車部品
LUFAX HOLDING LTD	—	59	5	804	金融サービス
LUKOIL PJSC-SPON ADR	18	18	0.000	0.026	エネルギー
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	14	—	—	—	生活必需品流通・小売り
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	—	7	18	2,797	一般消費財・サービス流通・小売り
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK CO	29	29	0.000	0.043	電気通信サービス
NIO INC - ADR	77	113	83	12,568	自動車・自動車部品
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	4	4	0.000	0.005	エネルギー
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	7	7	0.000	0.010	素材
OZON HOLDINGS PLC - ADR	3	3	0.000	0.004	一般消費財・サービス流通・小売り
PDD HOLDINGS INC(ADR)	28	47	545	81,861	一般消費財・サービス流通・小売り
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	5	5	0.000	0.007	素材
PJSC GAZPROM ADR	279	279	0.003	0.418	エネルギー
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	27	27	0.000	0.040	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	4	4	0.000	0.005	素材
QIFU TECHNOLOGY INC(ADR)	5	5	8	1,264	金融サービス
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	32	—	—	—	食品・飲料・タバコ
ROSNEFT OJSC-GDR	54	54	0.001	0.080	エネルギー
SBERBANK OF RUSSIA	498	498	0.005	0.746	銀行
SEVERSTAL PAO - GDR REG S	13	13	0.000	0.019	素材
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	—	43	9	1,408	ソフトウェア・サービス

ニッセイ新興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		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	22	—	—	—	不動産管理・開発	
SOUTHERN COPPER CORP	4	7	53	8,059	素材	
SURGUTNEFTEGAS PJSC ADR	51	51	0.001	0.076	エネルギー	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	28	28	26	4,022	消費者サービス	
TATNEFT-SPONSORED ADR	12	12	0.000	0.017	エネルギー	
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	5	5	0.000	0.007	銀行	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	34	59	49	7,496	メディア・娯楽	
TRIP.COM GROUP LTD	31	—	—	—	消費者サービス	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	23	26	40	6,108	一般消費財・サービス流通・小売り	
VK COMPANY LTD-GDR	3	3	0.000	0.004	メディア・娯楽	
VTB BANK JSC-GDR-REG S/WI	66	66	0.001	0.098	銀行	
WEIBO CORP-SPON ADR	3	3	3	585	メディア・娯楽	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	4	4	0.000	0.005	生活必需品流通・小売り	
XPENG INC - ADR	24	—	—	—	自動車・自動車部品	
YANDEX NV-A	13	13	0.000	0.019	メディア・娯楽	
YUM CHINA HOLDINGS INC	22	34	157	23,575	消費者サービス	
ZAI LAB LTD-ADR	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	24	33	75	11,317	運輸	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,618 48	1,818 43	1,419 —	212,816 <2.3%>	
(香港)			千香港ドル			
3SBIO INC	40	155	109	2,113	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	35	35	71	1,373	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,580	2,170	616	11,851	銀行	
AIR CHINA LIMITED-H	100	100	53	1,026	運輸	
AKESO INC	—	40	187	3,599	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	848	1,312	9,610	184,807	一般消費財・サービス流通・小売り	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	300	520	238	4,589	生活必需品流通・小売り	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	400	—	—	—	メディア・娯楽	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO-H	15	—	—	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	240	240	95	1,841	素材	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	60	115	218	4,192	素材	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	7	7	90	1,733	食品・飲料・タバコ	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	70	108	881	16,957	耐久消費財・アパレル	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	40	40	14	275	資本財	

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
BAIDU INC-CLASS A	125	186	1,925	37,019	メディア・娯楽
BANK OF CHINA LTD - H	4,210	6,180	1,748	33,632	銀行
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	380	770	352	6,781	銀行
BEIGENE LTD	—	58	667	12,826	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	40	40	11	226	運輸
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	15	45	119	2,306	公益事業
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	160	160	26	501	公益事業
BILIBILI INC-CLASS Z	11	19	205	3,954	メディア・娯楽
BOC AVIATION LTD	5	19	100	1,925	資本財
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	160	160	49	947	耐久消費財・アパレル
BYD CO LTD	45	80	1,953	37,567	自動車・自動車部品
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	30	65	250	4,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	—	60	105	2,021	不動産管理・開発
CANSINO BIOLOGICS INC-H	4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CGN POWER CO LTD-H	650	650	121	2,337	公益事業
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	280	280	22	425	金融サービス
CHINA CITIC BANK	490	770	270	5,197	銀行
CHINA COAL ENERGY CO - H	—	200	122	2,357	エネルギー
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	80	80	26	518	資本財
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	85	85	52	1,005	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5,310	7,690	3,483	66,989	銀行
CHINA COSCO HOLDINGS-H	146	301	234	4,510	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	120	120	26	507	銀行
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	150	150	40	773	商業・専門サービス
CHINA FEIHE LTD	170	320	152	2,922	食品・飲料・タバコ
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	115	115	51	984	金融サービス
CHINA GAS HOLDINGS LTD	150	268	191	3,684	公益事業
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	140	140	95	1,833	素材
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	116	132	182	3,502	金融サービス
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	560	560	48	936	不動産管理・開発
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	50	—	—	—	資本財
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	440	620	677	13,019	保険
CHINA LITERATURE LTD	36	36	103	1,993	メディア・娯楽
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	170	320	207	3,993	公益事業
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	80	80	109	2,098	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	20	20	10	193	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA MENGNIU DAIRY CO	170	280	686	13,191	食品・飲料・タバコ

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA MERCHANTS BANK - H	230	335	989	19,036	銀行
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	100	100	100	1,934	運輸
CHINA MINSHENG BANKING-H	229	559	144	2,784	銀行
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	200	420	155	2,988	素材
CHINA OILFIELD SERVICES-H	120	120	102	1,966	エネルギー
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	230	355	519	9,994	不動産管理・開発
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	50	50	33	643	不動産管理・開発
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	148	222	382	7,351	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,340	1,840	756	14,542	エネルギー
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	528	748	512	9,863	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA POWER INTERNATIONAL	330	330	98	1,897	公益事業
CHINA RAILWAY GROUP LTD - H	280	280	99	1,906	資本財
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	100	140	543	10,445	食品・飲料・タバコ
CHINA RESOURCES CEMENT	180	180	33	640	素材
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	40	82	202	3,894	公益事業
CHINA RESOURCES LAND LTD	180	260	754	14,499	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	44	44	128	2,470	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	-	180	88	1,703	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	100	160	252	4,855	公益事業
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	-	520	96	1,849	メディア・娯楽
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	185	260	646	12,424	エネルギー
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	-	140	111	2,142	エネルギー
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	240	240	92	1,781	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	120	120	107	2,067	資本財
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	140	-	-	-	エネルギー
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	66	66	47	917	保険
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	-	6	53	1,030	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA TOWER CORP LTD-H	2,160	4,020	313	6,029	電気通信サービス
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	60	60	21	409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA VANKE CO LTD-H	138	138	108	2,093	不動産管理・開発
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	120	120	74	1,430	ソフトウェア・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	-	132	152	2,939	一般消費財・サービス流通・小売り
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	249	-	-	-	エクイティ不動産投資信託(REIT)
CITIC LTD	320	500	351	6,759	資本財
CITIC SECURITIES CO LTD-H	145	165	275	5,305	金融サービス
CMOC GROUP LIMITED-H	240	240	104	2,002	素材
COSCO PACIFIC LTD	60	60	30	581	運輸

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	480	—	—	—	不動産管理・開発
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	110	210	149	2,883	不動産管理・開発
CRRG CORP LTD H	340	340	109	2,111	資本財
DALI FOODS GROUP CO LTD	215	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	180	180	66	1,277	自動車・自動車部品
DONGYUE GROUP	80	80	43	839	素材
EAST BUY HOLDING LIMITED	—	30	85	1,652	消費者サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	43	58	327	6,290	公益事業
FAR EAST HORIZON LTD	70	70	41	795	金融サービス
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	30	30	43	844	半導体・半導体製造装置
FOSUN INTERNATIONAL	170	170	77	1,487	資本財
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	32	32	116	2,239	自動車・自動車部品
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	22	22	61	1,180	素材
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	—	1,700	200	3,857	半導体・半導体製造装置
GDS HOLDINGS LTD-CL A	57	57	62	1,194	ソフトウェア・サービス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	350	570	544	10,467	自動車・自動車部品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	60	100	236	4,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GF SECURITIES CO LTD-H	48	48	49	943	金融サービス
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	150	150	173	3,340	自動車・自動車部品
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	—	115	92	1,778	不動産管理・開発
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	60	—	—	—	不動産管理・開発
GUANGDONG INVESTMENT LTD	160	300	165	3,172	公益事業
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	196	196	71	1,371	自動車・自動車部品
H Aidilao INTERNATIONAL HOLDI	50	160	257	4,959	消費者サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	114	180	406	7,822	耐久消費財・アパレル
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	50	50	97	1,871	資本財
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	100	100	46	884	金融サービス
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	12	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	80	80	117	2,258	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGAN INTL GROUP CO LTD	45	45	124	2,397	家庭用品・パーソナル用品
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	53	—	—	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	30	30	54	1,049	半導体・半導体製造装置
HUANENG POWER INTL INC-H	140	140	55	1,060	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	54	54	58	1,127	金融サービス
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	20	20	97	1,874	ヘルスケア機器・サービス
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,120	5,150	1,931	37,137	銀行
INNOVENT BIOLOGICS INC	55	90	401	7,727	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	69	105	399	7,678	生活必需品流通・小売り
JD LOGISTICS INC	—	221	217	4,173	運輸
JD.COM INC - CL A	122	191	2,019	38,828	一般消費財・サービス流通・小売り
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20	20	13	259	運輸
JIANGXI COPPER CO LTD-H	90	90	97	1,876	素材
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	40	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	30	90	74	1,433	消費者サービス
KINGBOARD HOLDINGS LIMITED	40	40	76	1,473	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	25	25	18	352	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	140	230	265	5,104	ソフトウェア・サービス
KINGSOFT CORP LTD	52	80	244	4,692	メディア・娯楽
KUAISHOU TECHNOLOGY	97	197	1,154	22,199	メディア・娯楽
KUNLUN ENERGY CO LTD	200	360	257	4,942	公益事業
LEGEND GROUP LTD	400	580	559	10,751	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LI AUTO INC-CLASS A	—	91	1,429	27,491	自動車・自動車部品
LI NING CO LTD	135	205	473	9,106	耐久消費財・アパレル
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	90	155	198	3,809	不動産管理・開発
MEITUAN-B	247	407	4,373	84,103	消費者サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	53	53	70	1,359	ヘルスケア機器・サービス
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	20	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MINITH GROUP LTD	40	40	72	1,389	自動車・自動車部品
NETEASE INC	118	156	2,798	53,817	メディア・娯楽
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	60	60	98	1,889	保険
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	98	111	594	11,430	消費者サービス
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	30	30	12	233	素材
NONGFU SPRING CO LTD-H	102	150	675	12,994	食品・飲料・タバコ
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	10	10	94	1,817	運輸
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	230	230	58	1,132	保険
PETROCHINA CO LTD-H	1,220	1,380	705	13,560	エネルギー
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	9	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	410	470	430	8,269	保険
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	16	16	29	568	生活必需品流通・小売り
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	365	550	2,095	40,296	保険
POP MART INTERNATIONAL GROUP	38	38	85	1,651	一般消費財・サービス流通・小売り
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	400	670	237	4,560	銀行
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	—	110	99	1,922	資本財
SEAZEN GROUP LTD	80	—	—	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	57	57	84	1,627	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	164	164	130	2,500	ヘルスケア機器・サービス
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	30	30	54	1,053	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	27	27	31	604	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN INTL HOLDINGS	15	15	8	159	運輸
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	44	68	554	10,657	耐久消費財・アパレル
SINO BIOPHARMACEUTICAL	570	940	360	6,923	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOPHARM GROUP CO-H	88	100	187	3,596	ヘルスケア機器・サービス
SINOTRUK HONG KONG LTD	20	60	101	1,956	資本財
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	100	210	136	2,616	食品・飲料・タバコ
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	230	—	—	—	不動産管理・開発
SUNNY OPTICAL TECH	42	60	439	8,451	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TENCENT HOLDINGS LTD	348	535	16,863	324,279	メディア・娯楽
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	120	120	119	2,302	食品・飲料・タバコ
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	80	80	116	2,246	消費者サービス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	40	180	118	2,274	一般消費財・サービス流通・小売り
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	30	100	125	2,415	消費者サービス
TRIP.COM GROUP LTD	—	45	1,233	23,710	消費者サービス
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	40	40	218	4,199	食品・飲料・タバコ
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	30	30	16	313	食品・飲料・タバコ
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	280	280	125	2,412	食品・飲料・タバコ
WEICHAI POWER CO LTD-H	120	120	169	3,258	資本財
WHARF HOLDINGS LTD	70	—	—	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)
WUXI APPTec CO LTD-H	25	28	264	5,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	205	325	1,535	29,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XIAOMI CORP-CLASS B	884	1,294	2,062	39,664	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	24	—	—	—	資本財
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	260	440	219	4,213	半導体・半導体製造装置
XPENG INC - CLASS A SHARES	—	74	482	9,270	自動車・自動車部品
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	90	90	46	893	耐久消費財・アパレル
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	40	100	148	2,857	自動車・自動車部品
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	100	150	205	3,951	エネルギー
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	20	20	25	499	食品・飲料・タバコ
YUEXIU PROPERTY CO LTD	32	172	129	2,497	不動産管理・開発
ZAI LAB LTD	—	78	168	3,232	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	—	125	118	2,273	素材
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	20	20	10	198	運輸

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H		31	77	158	3,042	保険
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS		35	65	125	2,407	一般消費財・サービス流通・小売り
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H		39	39	98	1,886	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H		300	480	565	10,873	素材
ZTE CORP-H		62	62	115	2,212	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額	43,708	63,715	89,174	1,714,820	
	銘柄数<比率>	185	186	-	<18.5%>	
(台湾)				千台湾ドル		
ACCTON TECHNOLOGY CORP		30	40	2,128	10,027	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC		130	210	717	3,379	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADVANTECH CO LTD		20	34	1,185	5,588	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP		10	10	1,100	5,183	資本財
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD		170	240	3,012	14,193	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP		70	160	663	3,125	素材
ASUSTEK COMPUTER INC		40	60	2,355	11,097	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUO CORPORATION		328	518	859	4,052	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD		40	40	766	3,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO		460	830	3,801	17,913	保険
CHAILEASE HOLDING CO LTD		78	130	2,319	10,929	金融サービス
CHANG HWA COMMERCIAL BANK		199	204	361	1,705	銀行
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD		130	130	605	2,851	自動車・自動車部品
CHINA AIRLINES LTD		-	200	436	2,054	運輸
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL		830	1,270	1,518	7,156	保険
CHINA STEEL CORP		700	990	2,494	11,756	素材
CHUNGHWA TELECOM CO LTD		210	280	3,276	15,437	電気通信サービス
COMPAL ELECTRONICS		130	360	1,092	5,148	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD		1,080	1,510	4,054	19,105	銀行
DELTA ELECTRONICS INC		110	150	4,575	21,558	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E INK HOLDINGS INC		50	60	1,086	5,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO		773	1,191	2,996	14,119	銀行
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD		10	10	578	2,723	耐久消費財・アパレル
EMEMORY TECHNOLOGY INC		-	10	2,475	11,662	半導体・半導体製造装置
EVA AIRWAYS CORP		-	180	578	2,727	運輸
EVERGREEN MARINE		56	56	650	3,067	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP		100	210	645	3,042	資本財
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD		80	80	633	2,985	電気通信サービス
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD		33	37	684	3,223	耐久消費財・アパレル

ニッセイ新興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	
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	560	865	2,383	11,232	銀行
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	180	270	1,733	8,168	素材
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	70	120	1,004	4,733	エネルギー
FORMOSA PLASTICS CORP	230	330	2,666	12,564	素材
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	427	606	3,831	18,053	保険
GIANT MANUFACTURING	10	20	347	1,635	耐久消費財・アパレル
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	-	40	922	4,344	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GLOBAL UNICHIP CORP	-	10	1,735	8,175	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	10	20	1,064	5,013	半導体・半導体製造装置
HON HAI PRECISION INDUSTRY	702	1,002	10,270	48,397	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	20	20	1,393	6,565	一般消費財・サービス流通・小売り
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	453	703	1,518	7,156	銀行
INNOLUX CORPORATION	425	755	967	4,557	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVENTEC CO LTD	80	230	980	4,622	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LARGAN PRECISION CO LTD	10	10	2,120	9,990	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	110	160	1,752	8,255	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC	90	120	10,848	51,119	半導体・半導体製造装置
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	594	941	3,692	17,400	銀行
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	40	50	830	3,911	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOMO.COM INC	-	11	558	2,633	一般消費財・サービス流通・小売り
NAN YA PLASTICS CORP	250	410	2,796	13,176	素材
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	10	20	474	2,233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	80	80	539	2,540	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10	10	334	1,573	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	30	50	2,475	11,662	半導体・半導体製造装置
PARADE TECHNOLOGIES LTD	10	10	1,050	4,947	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	100	160	1,292	6,092	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PHARMAESSENTIA CORP	-	20	724	3,411	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
POU CHEN	70	70	215	1,015	耐久消費財・アパレル
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	150	320	929	4,380	半導体・半導体製造装置
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20	50	1,337	6,302	生活必需品流通・小売り
QUANTA COMPUTER INC	150	210	4,378	20,632	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	30	40	1,712	8,067	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	97	88	324	1,530	不動産管理・開発
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	562	562	509	2,398	保険
SILERGY CORP	20	30	1,255	5,916	半導体・半導体製造装置
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	600	694	1,308	6,167	銀行

ニッセイ新興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
(台湾)		百株	百株	千台湾ドル	千円	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP		80	80	536	2,529	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING		508	911	1,640	7,729	銀行
TAIWAN BUSINESS BANK		–	471	626	2,952	銀行
TAIWAN CEMENT		340	500	1,662	7,836	素材
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL		602	895	2,367	11,157	銀行
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP		60	60	181	856	運輸
TAIWAN MOBILE CO LTD		80	140	1,367	6,445	電気通信サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING		1,370	1,970	114,260	538,427	半導体・半導体製造装置
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA		220	350	1,603	7,553	銀行
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP		80	110	1,749	8,241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO		250	350	2,485	11,710	食品・飲料・タバコ
UNITED MICROELECTRONICS CORP		680	930	4,626	21,802	半導体・半導体製造装置
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI		40	80	590	2,782	半導体・半導体製造装置
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY		–	10	1,495	7,044	資本財
WALSIN LIHWA CORP		150	240	912	4,297	資本財
WAN HAI LINES LIMITED		37	37	179	844	運輸
WIN SEMICONDUCTORS CORP		20	–	–	–	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP		170	170	470	2,215	半導体・半導体製造装置
WISTRON CORP		–	220	2,178	10,263	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WIWYNN CORP		10	10	1,830	8,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD		57	117	837	3,945	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YAGEO CORPORATION		23	23	1,305	6,152	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YANG MING MARINE TRANSPORT		90	90	376	1,772	運輸
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO		595	685	1,738	8,191	金融サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		40	40	418	1,969	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,581 81	26,807 90	265,364 –	1,250,476 <13.5%>	
(イギリス)				千イギリス・ポンド		
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC		19	19	0.000	0.035	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	19 1	19 1	0.000 –	0.035 <0.0%>	
(トルコ)				千トルコ・リラ		
AKBANK T.A.S.		258	293	881	4,614	銀行
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		21	116	492	2,577	資本財
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		25	25	786	4,117	生活必需品流通・小売り
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		81	81	311	1,629	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		1	5	503	2,635	自動車・自動車部品

ニッセイ新興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		
(トルコ)		百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
HACI OMER SABANCI HOLDING	–	68	400	2,097	銀行	
HEKTAS TICARET T.A.S	–	91	188	987	素材	
KOC HOLDING AS	87	58	832	4,356	資本財	
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	–	4	303	1,587	運輸	
SASA POLYESTER SANAYI	–	82	363	1,904	素材	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	–	10	268	1,405	自動車・自動車部品	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	10	85	1,318	6,898	エネルギー	
TURK HAVA YOLLARI AO	–	37	952	4,987	運輸	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	–	105	513	2,688	資本財	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	118	118	670	3,508	電気通信サービス	
TURKIYE IS BANKASI-C	325	325	669	3,502	銀行	
YAPI VE KREDI BANKASI	–	392	662	3,469	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	930 9	1,903 17	10,119 –	52,966 <0.6%>	
(メキシコ)				千メキシコ・ペソ		
ALFA S.A.B.-A	179	179	208	1,818	資本財	
AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,563	–	–	–	電気通信サービス	
AMERICA MOVIL SAB DE CV	–	1,586	2,415	21,025	電気通信サービス	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	18	40	712	6,199	食品・飲料・タバコ	
BANCO DEL BAJIO SA	–	59	345	3,004	銀行	
CEMEX SAB-CPO	782	1,254	1,512	13,163	素材	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	28	32	476	4,147	食品・飲料・タバコ	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	111	150	3,272	28,484	食品・飲料・タバコ	
GRUMA S.A.B.-B	12	12	389	3,388	食品・飲料・タバコ	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	10	15	627	5,463	運輸	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	19	28	684	5,959	運輸	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	89	101	843	7,346	食品・飲料・タバコ	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	9	53	727	6,328	資本財	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	152	212	3,413	29,709	銀行	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	146	166	689	6,005	銀行	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	169	243	1,905	16,589	素材	
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	140	140	111	972	メディア・娯楽	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3	11	270	2,353	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	100	100	340	2,967	家庭用品・パーソナル用品	
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	120	120	240	2,096	電気通信サービス	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	33	125	417	3,630	素材	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	4	17	297	2,592	運輸	

ニッセイ新興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	
(メキシコ)		百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
SITIOS LATINOAMERICA SAB DE		78	-	-	-	電気通信サービス
WALMART DE MEXICO-SER V		300	427	2,910	25,337	生活必需品流通・小売り
小計	株数・金額	4,067	5,072	22,814	198,585	
	銘柄数<比率>	22	22	-	<2.1%>	
(フィリピン)				千フィリピン・ペソ		
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		63	63	297	802	資本財
ACEN CORPORATION		469	-	-	-	公益事業
AYALA CORPORATION		17	17	1,161	3,127	資本財
AYALA LAND INC		488	553	1,642	4,422	不動産管理・開発
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN		125	152	1,604	4,319	銀行
BDO UNIBANK INC		111	214	2,793	7,523	銀行
GLOBE TELECOM INC		0.65	-	-	-	電気通信サービス
GT CAPITAL HOLDINGS INC		1	-	-	-	資本財
INTL CONTAINER TERM SVCS INC		56	92	1,947	5,244	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC		185	185	712	1,919	資本財
JOLLIBEE FOODS CORP		13	13	317	854	消費者サービス
MANILA ELECTRIC COMPANY		13	13	517	1,394	公益事業
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		281	-	-	-	金融サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST		151	151	788	2,122	銀行
MONDE NISSIN CORP		292	-	-	-	食品・飲料・タバコ
PLDT INC		5	5	725	1,953	電気通信サービス
SM INVESTMENTS CORP		15	17	1,534	4,132	資本財
SM PRIME HOLDINGS INC		603	1,057	3,329	8,966	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP		28	72	813	2,191	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	2,925	2,610	18,186	48,974	
	銘柄数<比率>	19	14	-	<0.5%>	
(チリ)				千チリ・ペソ		
BANCO DE CHILE		3,064	3,474	32,869	5,545	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION		1	6	15,719	2,651	銀行
BANCO SANTANDER CHILE		5,533	6,273	26,379	4,450	銀行
CENCOSUD SA		43	92	14,555	2,455	生活必需品流通・小売り
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		2	2	1,405	237	食品・飲料・タバコ
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES		928	928	4,790	808	運輸
EMPRESAS CMPC SA		37	101	17,889	3,017	素材
EMPRESAS COPEC SA		30	30	19,736	3,329	エネルギー
ENEL CHILE SA		904	904	5,003	844	公益事業
ENERSIS SA		994	2,052	20,116	3,393	公益事業

ニッセイ新興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	
(チリ)		百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
FALABELLA SA		24	75	15,203	2,564	一般消費財・サービス流通・小売り
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		7	10	47,004	7,929	資本財
小計	株数・金額	11,573	13,953	220,672	37,227	
	銘柄数<比率>	12	12	-	<0.4%>	
(コロンビア)				千コロンビア・ペソ		
BANCOLOMBIA SA		25	25	76,013	2,783	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		16	45	126,121	4,618	銀行
ECOPETROL SA		180	-	-	-	エネルギー
INTERCONEXION ELECTRICA SA		14	14	23,187	849	公益事業
小計	株数・金額	237	85	225,321	8,251	
	銘柄数<比率>	4	3	-	<0.1%>	
(インド)				千インド・ルピー		
ABB INDIA LTD		-	5	2,215	4,009	資本財
ACC LTD		2	-	-	-	素材
ADANI ENTERPRISES LTD		15	15	3,450	6,244	資本財
ADANI GREEN ENERGY LTD		18	27	2,592	4,693	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON		33	38	3,082	5,578	運輸
ADANI POWER LTD		51	51	1,988	3,598	公益事業
ADANI TOTAL GAS LTD		16	-	-	-	公益事業
ADANI TRANSMISSION LTD		16	-	-	-	公益事業
AMBUJA CEMENTS LTD		25	50	2,140	3,874	素材
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE		4	8	4,520	8,181	ヘルスケア機器・サービス
ASHOK LEYLAND LTD		-	114	1,996	3,614	資本財
ASIAN PAINTS LTD		22	30	9,665	17,493	素材
ASTRAL LTD		-	10	1,955	3,539	資本財
AU SMALL FINANCE BANK LTD		11	11	841	1,522	銀行
AUROBINDO PHARMA LTD		8	20	2,112	3,823	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVENUE SUPERMARTS LTD		8	13	5,049	9,139	生活必需品流通・小売り
AXIS BANK LTD		131	186	18,537	33,553	銀行
BAJAJ AUTO LTD		2	5	3,339	6,044	自動車・自動車部品
BAJAJ FINANCE LTD		15	22	16,420	29,721	金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD		21	32	5,214	9,438	金融サービス
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN		-	2	1,579	2,859	金融サービス
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD		3	3	875	1,583	自動車・自動車部品
BANDHAN BANK LTD		35	35	771	1,396	銀行
BANK OF BARODA		-	94	1,868	3,382	銀行
BERGER PAINTS INDIA LTD		19	23	1,390	2,517	素材

ニッセイ新興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	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
BHARAT ELECTRONICS LTD	212	240	3,517	6,366	資本財
BHARAT FORGE LTD	17	17	1,906	3,450	自動車・自動車部品
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	50	50	1,971	3,567	エネルギー
BHARTI AIRTEL LTD	120	181	17,236	31,197	電気通信サービス
BIOCON LTD	15	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5	8	4,142	7,498	食品・飲料・タバコ
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LIMITED	—	47	1,839	3,330	資本財
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	21	36	4,145	7,502	金融サービス
CIPLA LIMITED	25	43	5,486	9,929	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COAL INDIA LTD	120	136	4,708	8,523	エネルギー
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	7	7	1,602	2,900	家庭用品・パーソナル用品
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	16	16	1,271	2,301	運輸
CUMMINS INDIA LTD	—	10	1,954	3,536	資本財
DABUR INDIA LTD	37	42	2,322	4,203	家庭用品・パーソナル用品
DIVI'S LABORATORIES LTD	7	8	2,898	5,246	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DLF LTD	40	45	2,876	5,206	不動産管理・開発
DR. REDDY'S LABORATORIES	6	8	4,595	8,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EICHER MOTORS LTD	6	11	4,271	7,730	自動車・自動車部品
GAIL INDIA LTD	148	148	1,872	3,389	公益事業
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	26	29	2,976	5,388	家庭用品・パーソナル用品
GODREJ PROPERTIES LTD	6	6	1,128	2,043	不動産管理・開発
GRASIM INDUSTRIES LTD	14	16	3,294	5,963	素材
HAVELLS INDIA LTD	14	16	2,159	3,908	資本財
HCL TECHNOLOGIES LTD	61	77	10,194	18,451	ソフトウェア・サービス
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	7	2,287	4,140	金融サービス
HDFC BANK LTD	—	225	33,900	61,360	銀行
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	51	82	5,408	9,789	保険
HERO MOTOCORP LTD	7	8	2,757	4,991	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	88	100	4,997	9,046	素材
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	—	14	3,142	5,687	資本財
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	19	19	598	1,082	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	44	68	17,238	31,202	家庭用品・パーソナル用品
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	96	—	—	—	金融サービス
ICICI BANK LTD	288	415	38,348	69,409	銀行
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	14	16	2,387	4,321	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	23	23	1,313	2,377	保険
IDFC BANK LTD	—	262	2,234	4,043	銀行

ニッセイ新興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	
(インド)	百株	百株	千ドル・ルピー	千円	
INDIAN HOTELS CO LTD	—	77	3,178	5,753	消費者サービス
INDIAN OIL CORPORATION LTD	89	256	2,635	4,770	エネルギー
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	13	13	941	1,704	商業・専門サービス
INDRAPRASTHA GAS LTD	10	10	422	765	公益事業
INDUS TOWERS LTD	41	—	—	—	電気通信サービス
INFO EDGE INDIA LTD	3	5	2,849	5,157	メディア・娯楽
INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	187	267	38,396	69,498	ソフトウェア・サービス
INTERGLOBE AVIATION LTD	5	10	2,846	5,151	運輸
ITC LTD	159	235	10,351	18,736	食品・飲料・タバコ
JINDAL STEEL & POWER LTD	27	27	1,807	3,271	素材
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	—	215	4,753	8,603	金融サービス
JSW STEEL LTD	46	52	4,052	7,334	素材
JUBILANT FOODWORKS LTD	20	20	1,090	1,973	消費者サービス
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	32	88	15,528	28,106	銀行
LARSEN & TOUBRO LTD	40	53	16,664	30,162	資本財
LTIMINDTREE LIMITED	3	6	3,449	6,242	ソフトウェア・サービス
LUPIN LTD	9	9	1,085	1,963	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	50	76	12,148	21,989	自動車・自動車部品
MARICO LTD	28	46	2,445	4,426	食品・飲料・タバコ
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	6	11	11,670	21,123	自動車・自動車部品
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	—	65	3,970	7,186	ヘルスケア機器・サービス
MINDTREE LTD	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MPHASIS LTD	4	4	967	1,750	ソフトウェア・サービス
MRF LTD	0.07	0.07	780	1,412	自動車・自動車部品
MUTHOOT FINANCE LTD	4	4	600	1,086	金融サービス
NESTLE INDIA LTD	1	2	6,629	11,999	食品・飲料・タバコ
NTPC LTD	244	382	9,628	17,428	公益事業
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	145	279	5,488	9,934	エネルギー
PAGE INDUSTRIES LTD	0.33	0.55	2,062	3,732	耐久消費財・アパレル
PETRONET LNG LTD	18	66	1,312	2,375	エネルギー
PI INDUSTRIES LTD	3	7	2,671	4,836	素材
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8	15	3,820	6,915	素材
POWER FINANCE CORPORATION	—	95	3,027	5,479	金融サービス
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	166	394	8,259	14,950	公益事業
REC LTD	—	90	3,077	5,570	金融サービス
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	169	244	57,494	104,064	エネルギー
SAMWARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	90	244	2,205	3,992	自動車・自動車部品

ニッセイ新興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		
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	10	27	2,045	3,702	金融サービス	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	23	36	5,228	9,464	保険	
SHREE CEMENT LTD	0.75	0.75	1,964	3,556	素材	
SHRIRAM FINANCE LIMITED	12	22	4,500	8,145	金融サービス	
SIEMENS LTD	–	6	2,221	4,020	資本財	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	–	39	2,289	4,144	自動車・自動車部品	
SRF LTD	7	13	3,150	5,701	素材	
STATE BANK OF INDIA	105	148	8,333	15,082	銀行	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	51	71	8,599	15,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SUPREME INDUSTRIES LTD	–	5	2,106	3,812	素材	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	51	73	25,795	46,689	ソフトウェア・サービス	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	33	38	3,553	6,431	食品・飲料・タバコ	
TATA ELXSI LTD	2	2	1,744	3,157	ソフトウェア・サービス	
TATA MOTORS LTD	95	139	9,521	17,234	自動車・自動車部品	
TATA POWER CO LTD	–	138	3,637	6,584	公益事業	
TATA STEEL LTD	446	598	7,489	13,556	素材	
TECH MAHINDRA LTD	32	47	5,666	10,255	ソフトウェア・サービス	
TITAN CO LTD	19	26	8,841	16,002	耐久消費財・アパレル	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	5	5	1,070	1,937	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRENT LTD	11	12	3,346	6,057	一般消費財・サービス流通・小売り	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	–	8	2,842	5,144	自動車・自動車部品	
TVS MOTOR CO LTD	–	20	3,524	6,380	自動車・自動車部品	
ULTRATECH CEMENT LTD	5	9	8,175	14,797	素材	
UNITED SPIRITS LTD	18	18	1,903	3,445	食品・飲料・タバコ	
UPL LTD	25	46	2,616	4,736	素材	
VARUN BEVERAGES LTD	–	40	4,246	7,686	食品・飲料・タバコ	
VEDANTA LTD	47	47	1,129	2,043	素材	
WIPRO LTD	67	106	4,199	7,601	ソフトウェア・サービス	
YES BANK LTD	–	925	1,924	3,483	銀行	
ZOMATO LTD	78	260	3,183	5,762	消費者サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,875 105	9,581 122	687,767 – <13.4%>	1,244,859	
(インドネシア)			千インドネシア・ルピア			
ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	842	842	213,868	2,074	エネルギー	
ADARO MINERALS INDONESIA TBK	529	–	–	–	素材	
ANEKA TAMBANG TBK	532	532	86,982	843	素材	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,220	1,734	988,380	9,587	資本財	

ニッセイ新興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		
(インドネシア)		百株	百株	千円	千円	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	3,297	4,642	4,212,615	40,862	銀行	
BANK JAGO TBK PT	224	—	—	—	銀行	
BANK MANDIRI TBK	1,081	3,107	1,833,130	17,781	銀行	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	487	1,104	549,792	5,332	銀行	
BANK RAKYAT INDONESIA	3,757	5,757	3,008,032	29,177	銀行	
BARITO PACIFIC TBK PT	885	2,725	317,576	3,080	素材	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	455	455	250,250	2,427	食品・飲料・タバコ	
GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	—	69,688	585,379	5,678	一般消費財・サービス流通・小売り	
GUDANG GARAM TBK PT	11	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	60	60	51,000	494	素材	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	96	96	100,560	975	食品・飲料・タバコ	
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	104	104	66,820	648	食品・飲料・タバコ	
INTERNATIONAL NICKEL INDONES	181	181	83,079	805	素材	
KALBE FARMA TBK PT	569	1,761	285,282	2,767	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	628	1,136	268,096	2,600	素材	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,626	1,626	159,348	1,545	電気通信サービス	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	94	94	62,275	604	素材	
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	998	998	288,422	2,797	生活必需品流通・小売り	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	2,690	4,000	1,420,000	13,774	電気通信サービス	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	491	491	170,377	1,652	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED TRACTORS TBK PT	106	106	242,475	2,352	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	20,963 24	101,239 22	15,243,739 —	147,864 <1.6%>	
(ブラジル)			千ブラジル・リアル			
AMBEV SA	268	365	496	15,154	食品・飲料・タバコ	
AMERICANAS SA	38	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
ATACADAO SA	19	19	20	618	生活必需品流通・小売り	
BANCO BRADESCO S.A.	63	172	236	7,216	銀行	
BANCO BRADESCO SA-PREF	329	413	638	19,492	銀行	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	69	92	307	9,397	金融サービス	
BANCO DO BRASIL SA	57	65	329	10,052	銀行	
BANCO SANTANDER BRASIL SA/BRAZIL	30	30	92	2,830	銀行	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	39	44	139	4,268	保険	
BM&FBOVESPA SA	349	477	607	18,537	金融サービス	
BRF SA	43	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
CCR SA	68	68	89	2,721	運輸	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	69	101	408	12,460	公益事業	

ニッセイ新興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	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	7	26	114	3,509	公益事業
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	84	84	113	3,459	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	22	25	161	4,935	公益事業
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	-	51	75	2,313	素材
COSAN SA	56	104	186	5,696	エネルギー
CPFL ENERGIA SA	-	30	109	3,341	公益事業
ENERGISA SA-UNITS	6	23	118	3,629	公益事業
ENEVA SA	-	83	106	3,253	公益事業
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6	6	29	887	公益事業
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	53	86	294	8,992	公益事業
GERDAU SA-PREF	62	100	245	7,497	素材
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	276	435	199	6,083	ヘルスケア機器・サービス
HYPERA S.A	26	29	98	3,005	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	282	406	1,237	37,788	銀行
ITAUSA SA	282	413	406	12,411	銀行
JBS SA	42	71	153	4,690	食品・飲料・タバコ
KLABIN SA - UNIT	40	40	92	2,824	素材
LOCALIZA RENT A CAR	41	73	449	13,726	運輸
LOJAS RENNER S.A.	59	59	85	2,611	一般消費財・サービス流通・小売り
MAGAZINE LUIZA SA	152	152	33	1,030	一般消費財・サービス流通・小売り
NATURA &CO HOLDING SA	42	73	111	3,400	家庭用品・パーソナル用品
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	211	320	1,264	38,608	エネルギー
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	271	366	1,343	41,018	エネルギー
PRIO S.A.	38	67	311	9,507	エネルギー
RAIA DROGASIL SA	59	109	299	9,131	生活必需品流通・小売り
REDE D'OR SAO LUIZ SA	25	53	133	4,079	ヘルスケア機器・サービス
RUMO SA	72	82	190	5,820	運輸
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	-	117	153	4,682	生活必需品流通・小売り
SUZANO S.A.	37	56	297	9,086	素材
TELEFONICA BRASIL S.A.	27	31	156	4,766	電気通信サービス
TIM SA	35	35	58	1,771	電気通信サービス
TOTVS SA	25	44	143	4,369	ソフトウェア・サービス
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	22	52	128	3,908	エネルギー
VALE SA	228	275	2,045	62,450	素材
VIBRA ENERGIA SA	69	78	167	5,114	一般消費財・サービス流通・小売り
WEG SA	85	124	413	12,611	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,188 45	6,030 47	14,896 -	454,768 <4.9%>

ニッセイ新興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	
(チェコ)		百株	百株	千チェコ・コルナ	千円	
CEZ AS		10	13	1,379	9,201	公益事業
KOMERCNI BANKA AS		6	6	444	2,960	銀行
MONETA MONEY BANK AS		11	11	102	682	銀行
小計	株数・金額	27	31	1,926	12,844	
	銘柄数<比率>	3	3	-	<0.1%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
ALTEOGEN INC		0.98	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMOREPACIFIC CORP		1	3	47,902	5,537	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC GROUP		3	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品
BGF RETAIL CO LTD/NEW		0.15	0.15	2,002	231	生活必需品流通・小売り
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD		4	9	68,987	7,974	ヘルスケア機器・サービス
CELLTRION INC		5	9	154,591	17,870	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION PHARM INC		-	1	14,402	1,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEIL WORLDWIDE INC		1	-	-	-	メディア・娯楽
CJ CHEILJEDANG CORP		0.61	0.61	19,459	2,249	食品・飲料・タバコ
CJ CORP		0.53	-	-	-	資本財
CJ ENM CO LTD		0.28	-	-	-	メディア・娯楽
CJ LOGISTICS		0.16	-	-	-	運輸
COSMOAM&T CO LTD		-	2	32,595	3,767	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COWAY CO LTD		3	3	16,192	1,871	耐久消費財・アパレル
DAUM COMMUNICATIONS CORP		17	24	117,895	13,628	メディア・娯楽
DB INSURANCE CO LTD		1	3	29,620	3,424	保険
DOOSAN BOBCAT INC		2	2	11,124	1,286	資本財
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES		-	33	48,422	5,597	資本財
ECOPRO BM CO LTD		2	4	99,246	11,472	資本財
ECOPRO CO LTD		-	1	107,961	12,480	素材
E-MART CO LTD		0.63	-	-	-	生活必需品流通・小売り
F&F CO LTD / NEW		0.90	0.90	7,956	919	耐久消費財・アパレル
GREEN CROSS CORP		0.38	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GS ENGINEERING & CONSTRUCT		1	-	-	-	資本財
GS HOLDINGS CORP		4	4	17,297	1,999	資本財
HANA FINANCIAL GROUP		16	24	100,131	11,575	銀行
HANKOOK TIRE AND TECHNOLOGY CO LTD		5	5	23,815	2,753	自動車・自動車部品
HANMI PHARM CO LTD		0.58	0.59	17,788	2,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD		-	3	23,047	2,664	半導体・半導体製造装置
HANON SYSTEMS		9	9	6,902	797	自動車・自動車部品
HANWHA AEROSPACE CO LTD		-	3	40,029	4,627	資本財

ニッセイ新興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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
HANWHA SOLUTIONS CORP	6	9	30,734	3,552	素材
HD HYUNDAI	3	3	21,407	2,474	エネルギー
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1	1	14,259	1,648	資本財
HD KOREA SHIPBUILDING AND OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2	3	33,093	3,825	資本財
HLB INC	5	6	19,896	2,300	ヘルスケア機器・サービス
HLB INC-RIGHTS	0.52	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
HMM CO LTD	12	22	34,162	3,949	運輸
HOTEL SHILLA CO LTD	0.99	2	17,371	2,008	一般消費財・サービス流通・小売り
HYBE CO LTD	0.99	1	29,877	3,453	メディア・娯楽
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	4	4	17,395	2,010	資本財
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1	1	22,990	2,657	運輸
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	—	2	15,984	1,847	資本財
HYUNDAI MOBIS	3	4	113,373	13,105	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	7	10	198,230	22,915	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2	2	25,764	2,978	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	1	1	18,258	2,110	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	5	5	18,559	2,145	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	22	22	25,754	2,977	銀行
JYP ENTERTAINMENT CORP	—	2	19,595	2,265	メディア・娯楽
KAKAO GAMES CORP	1	1	3,862	446	メディア・娯楽
KAKAOBANK CORP	7	16	39,579	4,575	銀行
KAKAOPAY CORP	—	2	10,366	1,198	金融サービス
KANGWON LAND INC	3	3	5,498	635	消費者サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	21	29	162,817	18,821	銀行
KIA CORPORATION	15	20	178,834	20,673	自動車・自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5	5	23,690	2,738	資本財
KOREA ELECTRIC POWER CORP	13	21	37,658	4,353	公益事業
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1	4	27,849	3,219	金融サービス
KOREA ZINC CO LTD	0.53	0.53	25,890	2,992	素材
KOREAN AIR LINES CO LTD	11	11	27,014	3,122	運輸
KRAFTON INC	1	2	46,344	5,357	メディア・娯楽
KT CORP	—	7	24,655	2,850	電気通信サービス
KT&G CORP	4	7	71,562	8,272	食品・飲料・タバコ
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1	1	13,241	1,530	素材
L&F CO LTD	1	1	29,175	3,372	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD	2	4	194,568	22,492	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	0.56	0.56	16,744	1,935	素材

ニッセイ新興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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
LG CORP	5	8	73,102	8,450	資本財
LG DISPLAY CO LTD	13	13	18,087	2,090	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG ELECTRONICS INC	6	9	96,926	11,204	耐久消費財・アパレル
LG ENERGY SOLUTION	1	3	165,456	19,126	資本財
LG H AND H CO LTD	0.64	1	33,750	3,901	家庭用品・パーソナル用品
LG H AND H CO LTD-PFD	0.04	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品
LG INNOTEK CO LTD	0.83	0.83	20,667	2,389	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13	13	13,936	1,611	金融サービス
LG UPLUS CORP	8	8	8,508	983	電気通信サービス
LOTTE CHEMICAL CORP	1	1	17,503	2,023	素材
LOTTE ENERGY MATERIALS CORPORATION	1	1	5,210	602	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LOTTE SHOPPING CO	0.22	-	-	-	一般消費財・サービス流通・小売り
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	-	8	47,403	5,479	金融サービス
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	2	-	-	-	保険
MERITZ SECURITIES CO LTD	10	-	-	-	金融サービス
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	13	13	9,669	1,117	金融サービス
NAVER CORP	7	10	219,574	25,382	メディア・娯楽
NCSOFT CORPORATION	0.86	1	33,428	3,864	メディア・娯楽
NETMARBLE CORPORATION	0.58	0.58	2,781	321	メディア・娯楽
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	0.92	2	28,220	3,262	食品・飲料・タバコ
PEARL ABYSS CORP	1	1	6,582	760	メディア・娯楽
POSCO FUTURE M CO LTD	1	2	77,220	8,926	資本財
POSCO HOLDINGS INC	4	5	272,538	31,505	素材
POSCO INTERNATIONAL CORPORATION	-	4	24,835	2,871	資本財
S-1 CORPORATION	0.32	-	-	-	商業・専門サービス
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1	1	104,835	12,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG C&T CORP	4	7	82,647	9,554	資本財
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	3	5	69,978	8,089	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	266	379	2,750,940	318,008	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	46	67	387,895	44,840	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8	12	30,426	3,517	資本財
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	1	2	49,245	5,692	保険
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	32	51	37,754	4,364	資本財
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO., LTD	4	4	34,204	3,954	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	3	4	198,912	22,994	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG SDS CO LTD	1	3	53,874	6,227	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4	4	17,537	2,027	金融サービス

ニッセイ新興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	
(韓国)		百株	百株	千韓国ウォン	千円	
	SD BIOSENSOR INC	2	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
	SEEGENE INC	1	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	26	35	129,454	14,964	銀行
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1	1	13,026	1,505	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	SK BIOSCIENCE CO LTD	1	1	7,716	892	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	0.36	-	-	-	素材
	SK HYNIX INC	30	43	570,780	65,982	半導体・半導体製造装置
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1	1	12,217	1,412	素材
	SK INC	2	3	54,768	6,331	資本財
	SK INNOVATION CO LTD	3	4	66,961	7,740	エネルギー
	SK SQUARE CO LTD	5	5	26,341	3,045	資本財
	SKC CO LTD	1	1	12,693	1,467	素材
	S-OIL CORPORATION	3	3	20,340	2,351	エネルギー
	STX PAN OCEAN CO LTD	18	18	7,611	879	運輸
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	38	43	54,055	6,248	銀行
	YUHAN CORP	1	4	27,596	3,190	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	875	1,227	8,620,643	996,546	
	銘柄数<比率>	109	103	-	<10.7%>	
(中国)				千人民元		
	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	45	45	42	889	ソフトウェア・サービス
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	5	5	88	1,838	半導体・半導体製造装置
	AECC AVIATION POWER CO-A	10	31	115	2,391	資本財
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	338	718	260	5,410	銀行
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	35	46	80	1,677	ヘルスケア機器・サービス
	AIR CHINA LTD-A	-	101	82	1,704	運輸
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	-	148	86	1,788	素材
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	10	10	23	486	素材
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3	3	77	1,608	食品・飲料・タバコ
	ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	1	1	20	422	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS	92	92	31	658	金融サービス
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	86	86	38	797	銀行
	BANK OF CHINA LTD-A	321	321	126	2,632	銀行
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	222	222	128	2,668	銀行
	BANK OF JIANGSU CO LTD-A	78	78	52	1,081	銀行
	BANK OF NANJING CO LTD -A	-	88	67	1,397	銀行
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	17	43	106	2,220	銀行
	BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45	45	27	560	銀行

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	57	57	35	731	素材
BBMG CORPORATION-A	141	-	-	-	素材
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	2	2	71	1,481	ソフトウェア・サービス
BEIJING TONGRENTANG CO-A	-	20	100	2,082	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING UNITED INFORMATION-A	-	13	49	1,025	資本財
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	4	5	27	564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	197	242	118	2,461	運輸
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	110	454	180	3,750	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BYD CO LTD -A	7	13	307	6,389	自動車・自動車部品
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	75	75	61	1,279	金融サービス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	1	1	15	328	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	123	123	71	1,480	金融サービス
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	96	96	61	1,271	銀行
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	32	32	82	1,707	資本財
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	68	68	28	594	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	97	370	108	2,242	銀行
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	69	69	92	1,923	金融サービス
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	-	24	105	2,189	金融サービス
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	10	10	31	655	保険
CHINA MERCHANTS BANK-A	69	108	327	6,799	銀行
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	27	105	150	3,121	金融サービス
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	19	19	20	425	不動産管理・開発
CHINA MINSHENG BANKING-A	212	212	80	1,672	銀行
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	106	106	74	1,553	公益事業
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	16	16	33	701	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	15	40	96	2,006	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	84	259	140	2,924	エネルギー
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	88	88	51	1,061	資本財
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	171	108	50	1,053	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	-	14	77	1,605	半導体・半導体製造装置
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20	48	147	3,068	エネルギー
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	47	47	28	598	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	108	229	116	2,419	資本財
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	128	128	60	1,254	公益事業
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	8	8	74	1,554	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA VANKE CO LTD -A	22	81	94	1,953	不動産管理・開発
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	90	134	303	6,291	公益事業

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	5	5	34	724	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	246	246	61	1,276	銀行
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	58	58	96	2,004	自動車・自動車部品
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	4	6	38	801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITIC SECURITIES CO-A	28	67	150	3,132	金融サービス
CMOC GROUP LTD-A	113	113	59	1,231	素材
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	-	13	69	1,448	素材
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	9	22	412	8,553	資本財
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	50	50	49	1,019	運輸
CSC FINANCIAL CO LTD-A	26	26	68	1,421	金融サービス
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	-	42	63	1,320	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	50	60	91	1,909	金融サービス
EVE ENERGY CO LTD-A	9	9	40	850	資本財
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	59	59	39	813	メディア・娯楽
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	10	25	97	2,019	食品・飲料・タバコ
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	83	116	116	2,419	金融サービス
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	26	63	103	2,138	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	-	28	104	2,162	自動車・自動車部品
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-A	7	28	123	2,560	素材
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	132	132	51	1,065	公益事業
GEM CO LTD-A	-	133	79	1,639	素材
GF SECURITIES CO LTD-A	37	37	54	1,137	金融サービス
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC-A	1	1	20	427	半導体・半導体製造装置
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2	2	13	289	資本財
GOERTEK INC -A	10	10	19	399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GOLDWIND SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD-A	39	39	35	732	資本財
GONGNIU GROUP CO LTD-A	-	7	68	1,419	資本財
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	18	18	42	874	資本財
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	7	35	97	2,029	自動車・自動車部品
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	32	32	104	2,158	耐久消費財・アパレル
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	10	10	44	929	食品・飲料・タバコ
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	54	54	40	836	エネルギー
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	-	87	86	1,793	自動車・自動車部品
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13	13	38	796	ヘルスケア機器・サービス
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	10	10	27	565	素材
GUANGZHOU YUJIXIU CAPITAL HOLDINGS GROUP CO LTD-A	98	98	64	1,348	金融サービス
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	112	112	110	2,287	金融サービス

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	33	33	50	1,046	金融サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A	20	55	122	2,536	耐久消費財・アパレル
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	29	126	126	2,618	金融サービス
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	8	11	30	634	半導体・半導体製造装置
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	8	8	20	421	食品・飲料・タバコ
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	28	79	110	2,304	素材
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	28	28	37	778	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	57	57	39	828	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	-	7	105	2,188	金融サービス
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	4	4	21	453	素材
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	13	13	53	1,115	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG POWER INTL INC-A	77	77	59	1,232	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	21	85	134	2,794	金融サービス
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	41	41	33	694	金融サービス
HUAXIA BANK CO LTD-A	62	62	34	715	銀行
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	14	14	24	512	自動車・自動車部品
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	5	5	69	1,434	自動車・自動車部品
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	11	11	38	798	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	12	12	59	1,225	ソフトウェア・サービス
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	1	1	32	677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IND & COMM BK OF CHINA-A	280	544	260	5,397	銀行
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	89	140	205	4,274	銀行
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	324	324	51	1,076	素材
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	21	21	8	174	素材
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	28	28	75	1,566	食品・飲料・タバコ
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	9	13	31	652	半導体・半導体製造装置
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	29	29	30	627	素材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	10	10	58	1,217	資本財
JIANGSU HENGRUI PHARMACEUTICALS CO LTD-A	33	33	159	3,311	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	-	13	70	1,465	食品・飲料・タバコ
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	4	9	104	2,174	食品・飲料・タバコ
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	22	22	31	649	資本財
JIANGXI COPPER CO LTD-A	20	20	35	742	素材
JINKO SOLAR CO LTD-A	-	60	60	1,265	半導体・半導体製造装置
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	-	66	96	1,996	資本財
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	4	6	1,052	21,838	食品・飲料・タバコ
LB GROUP CO LTD-A	29	29	51	1,064	素材

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	24	24	32	675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A	139	139	94	1,956	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	30	64	152	3,173	半導体・半導体製造装置
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	30	30	98	2,045	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	4	9	187	3,891	食品・飲料・タバコ
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	13	13	36	754	メディア・娯楽
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	4	4	65	1,353	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	205	205	66	1,370	資本財
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	-	9	58	1,211	半導体・半導体製造装置
MUYUAN FOODS CO LTD-A	21	21	80	1,679	食品・飲料・タバコ
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	25	31	69	1,433	資本財
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	2	2	49	1,025	半導体・半導体製造装置
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	9	9	29	602	保険
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	18	18	17	369	食品・飲料・タバコ
NINESTAR CORP-A	17	17	48	1,001	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	-	54	76	1,582	素材
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	7	7	51	1,059	自動車・自動車部品
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	44	44	63	1,311	素材
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	45	45	40	839	金融サービス
PETROCHINA CO LTD-A	69	297	209	4,340	エネルギー
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	4	6	23	479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PICC HOLDING CO-A	149	149	77	1,617	保険
PING AN BANK CO LTD-A	97	97	98	2,043	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	37	49	209	4,339	保険
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	27	27	29	607	不動産管理・開発
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	122	122	54	1,139	銀行
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	100	100	51	1,062	資本財
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	27	27	45	936	素材
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	30	30	33	690	素材
S F HOLDING CO LTD-A	22	22	90	1,870	運輸
SAIC MOTOR CORP LTD-A	21	80	115	2,404	自動車・自動車部品
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	-	51	74	1,548	半導体・半導体製造装置
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	30	30	42	884	資本財
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	-	46	72	1,512	素材
SDIC CAPITAL CO LTD-A	-	137	97	2,021	金融サービス
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	57	-	-	-	公益事業
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	23	23	28	581	不動産管理・開発

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	47	47	86	1,802	エネルギー
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	4	4	10	217	素材
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	19	19	56	1,177	素材
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	-	302	89	1,855	素材
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	13	15	67	1,399	ソフトウェア・サービス
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	63	63	28	593	資本財
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	7	36	101	2,107	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	86	86	41	871	運輸
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	51	51	55	1,152	不動産管理・開発
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	-	55	99	2,056	ヘルスケア機器・サービス
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	67	189	129	2,691	銀行
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	8	11	28	593	素材
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A	-	148	85	1,766	銀行
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	56	56	32	671	金融サービス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	4	4	113	2,351	食品・飲料・タバコ
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	-	79	84	1,749	素材
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	1	1	10	221	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	110	110	50	1,054	金融サービス
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	1	1	12	252	素材
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	15	15	92	1,911	資本財
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	4	4	14	298	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	5	5	142	2,963	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	3	3	41	861	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	-	18	41	862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	19	-	-	-	金融サービス
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	5	5	43	907	資本財
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	1	1	19	404	資本財
TBEA CO LTD-A	22	28	40	836	資本財
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	40	44	18	380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY TECHNOLOGY CO LTD-A	15	18	34	723	半導体・半導体製造装置
TIANMA MICROELECTRONICS-A	72	72	76	1,594	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANQI LITHIUM CORP-A	-	13	70	1,460	素材
TONGWEI CO LTD-A	15	39	106	2,210	半導体・半導体製造装置
TRINA SOLAR CO LTD-A	10	10	33	690	半導体・半導体製造装置
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	6	6	47	977	食品・飲料・タバコ
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4	4	32	674	半導体・半導体製造装置
UNISPLENDOR CORP LTD-A	9	9	21	437	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ新興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	
(中国)	百株	百株	千人民元	千円	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	15	15	123	2,562	素材
WEICHAI POWER CO LTD-A	34	34	49	1,029	資本財
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	18	18	32	682	食品・飲料・タバコ
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	97	97	65	1,367	金融サービス
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	4	4	43	899	半導体・半導体製造装置
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2	2	10	207	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	51	51	23	491	一般消費財・サービス流通・小売り
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	40	52	41	865	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	15	23	356	7,400	食品・飲料・タバコ
WUXI APTEC CO LTD-A	6	18	159	3,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	26	26	14	307	資本財
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	-	47	82	1,714	素材
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	-	52	102	2,128	エネルギー
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	13	13	44	931	食品・飲料・タバコ
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	16	16	29	612	ソフトウェア・サービス
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	25	25	33	702	運輸
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7	7	35	730	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A	3	3	19	410	素材
ZHANGZHOU PIEN TZE HUANG PHA-A	3	3	74	1,548	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	11	11	25	531	資本財
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30	30	62	1,294	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	6	6	23	489	素材
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	8	8	35	747	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	10	10	16	346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	20	20	20	428	金融サービス
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	-	124	90	1,884	金融サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	71	71	84	1,764	素材
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	94	94	61	1,266	資本財
ZTE CORP-A	7	7	19	400	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,244 201	13,991 229	17,861 -	370,771 <4.0%>
(マレーシア)			千マレーシア・リンギット		
AMBANK HOLDINGS BHD	97	97	38	1,220	銀行
AXIATA GROUP BERHAD	205	205	49	1,588	電気通信サービス
CELCOMDIGI BERHAD	225	225	95	3,068	電気通信サービス
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	403	593	343	11,011	銀行
DIALOG GROUP BHD	149	149	31	1,020	エネルギー

ニッセイ新興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		
(マレーシア)		百株	百株	マレーシア・リンギット	千円	
GAMUDA BHD	–	188	87	2,804	資本財	
GENTING BHD	67	67	29	928	消費者サービス	
GENTING MALAYSIA BHD	113	113	28	918	消費者サービス	
HAP SENG CONSOLIDATED	11	–	–	–	資本財	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	47	–	–	–	ヘルスケア機器・サービス	
HONG LEONG BANK BERHAD	45	45	85	2,751	銀行	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	19	19	31	1,015	銀行	
IHH HEALTHCARE BHD	63	172	102	3,276	ヘルスケア機器・サービス	
INARI AMERTRON BHD	166	166	49	1,578	半導体・半導体製造装置	
IOI CORPORATION BHD	197	197	78	2,522	食品・飲料・タバコ	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	34	34	74	2,394	食品・飲料・タバコ	
MALAYAN BANKING BHD	287	465	424	13,577	銀行	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	49	49	36	1,165	運輸	
MAXIS BHD	196	196	79	2,560	電気通信サービス	
MISC BHD	50	50	36	1,182	運輸	
MR DIY GROUP M BHD	163	163	25	829	一般消費財・サービス流通・小売り	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2	6	73	2,356	食品・飲料・タバコ	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	133	285	205	6,587	素材	
PETRONAS DAGANGAN BHD	7	33	75	2,402	エネルギー	
PETRONAS GAS BHD	22	54	92	2,963	公益事業	
PPB GROUP BERHAD	18	56	84	2,691	食品・飲料・タバコ	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	230	261	127	4,077	素材	
PUBLIC BANK BHD	874	1,226	518	16,603	銀行	
QL RESOURCES BHD	30	30	16	537	食品・飲料・タバコ	
RHB BANK BHD	49	170	95	3,064	銀行	
SIME DARBY BERHAD	48	48	11	374	資本財	
SIME DARBY PLANTATION BHD	77	190	83	2,664	食品・飲料・タバコ	
TELEKOM MALAYSIA BHD	22	125	65	2,093	電気通信サービス	
TENAGA NASIONAL BHD	129	236	235	7,525	公益事業	
TOP GLOVE CORP BHD	341	–	–	–	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,568 34	5,913 32	3,415 –	109,361 <1.2%>	
(南アフリカ)				千南アフリカ・ランド		
ABSA GROUP LTD	47	68	1,211	9,901	銀行	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	6	6	109	892	素材	
ANGLO PLATINUM LTD	2	7	513	4,193	素材	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28	–	–	–	素材	

ニッセイ新興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	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	–	31	999	8,163	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	22	22	386	3,158	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BID CORP LTD	19	26	1,094	8,944	生活必需品流通・小売り
BIDVEST GROUP LTD	17	19	550	4,497	資本財
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	5	8	1,621	13,244	銀行
CLICKS GROUP LTD	12	20	598	4,887	生活必需品流通・小売り
DISCOVERY HOLDINGS LIMITED	24	50	697	5,694	保険
EXXARO RESOURCES LTD	15	15	285	2,330	エネルギー
FIRSTRAND LTD	299	392	2,549	20,829	金融サービス
GOLD FIELDS LTD	46	73	1,755	14,345	素材
HARMONY GOLD MINING CO LTD	38	38	389	3,179	素材
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	45	66	543	4,442	素材
KUMBA IRON ORE LTD	4	4	244	1,994	素材
MR PRICE GROUP LTD	13	–	–	–	一般消費財・サービス流通・小売り
MTN GROUP LTD	99	133	1,246	10,183	電気通信サービス
MULTICHOICE GROUP LTD	13	–	–	–	メディア・娯楽
NASPERS LTD-N SHS	12	15	5,248	42,881	一般消費財・サービス流通・小売り
NEDBANK GROUP LTD	25	38	802	6,559	銀行
NEPI ROCKCASTLE S.A.	12	33	368	3,012	不動産管理・開発
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	19	36	429	3,508	素材
OLD MUTUAL LTD	287	287	354	2,895	保険
OUTSURANCE GROUP LTD	–	66	289	2,368	保険
PEPKOR HOLDINGS LTD	–	145	271	2,221	一般消費財・サービス流通・小売り
REINET INVESTMENTS SCA	7	7	333	2,724	金融サービス
REMGRO LTD	27	31	447	3,654	金融サービス
SANLAM LIMITED	97	142	991	8,098	保険
SASOL LTD	30	42	965	7,891	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD	25	39	980	8,006	生活必需品流通・小売り
SIBANYE STILLWATER LTD	156	249	592	4,836	素材
SPAR GROUP LIMITED/THE	5	–	–	–	生活必需品流通・小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	78	121	2,345	19,160	銀行
VODACOM GROUP LTD	42	66	679	5,547	電気通信サービス
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	60	68	461	3,771	一般消費財・サービス流通・小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,650 34	2,378 33	30,357 –	248,024 <2.7%>
(タイ)			千タイ・パーツ		
ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG		66	112	2,441	10,425 電気通信サービス

ニッセイ新興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	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR	255	380	2,622	11,195	運輸
ASSET WORLD CORP PCL-FOREIGN	881	881	320	1,369	消費者サービス
B GRIMM POWER PCL-FOREIGN	31	31	81	347	公益事業
BANGKOK COMMERCIAL-FOREIGN	90	—	—	—	金融サービス
BANGKOK DUSIT MED SERVICE-F	597	934	2,475	10,568	ヘルスケア機器・サービス
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-FOREIGN	236	713	581	2,481	運輸
BANPU PUBLIC CO LTD-FOR REG	—	856	693	2,960	エネルギー
BERLI JUCKER PUB CO-FORGN	60	60	166	710	生活必需品流通・小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL	574	574	421	1,801	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL-FOREIGN	39	44	963	4,114	ヘルスケア機器・サービス
CARABAO GROUP PCL-F	26	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CENTRAL PATTANA PUB CO-FOREI	126	143	950	4,060	不動産管理・開発
CENTRAL RETAIL CORP-FOREIGN	67	157	620	2,648	一般消費財・サービス流通・小売り
CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	268	268	503	2,151	食品・飲料・タバコ
CP ALL PCL-FOREIGN	343	505	2,865	12,237	生活必需品流通・小売り
CP AXTRA PUBLIC COMPANY LIMITED (F)	—	199	587	2,506	生活必需品流通・小売り
DELTA ELECTRONICS THAI-FORGN	—	255	2,071	8,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ELECTRICITY GEN PUB CO-FOR R	10	10	127	544	公益事業
ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN	89	192	912	3,894	公益事業
GLOBAL POWER SYNERGY PCL-F	24	88	415	1,775	公益事業
GULF ENERGY DEVELOPM-FOREIGN	173	196	911	3,891	公益事業
HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR	184	444	541	2,312	一般消費財・サービス流通・小売り
INDORAMA VENTURES-FOREIGN	122	122	311	1,328	素材
INTOUCH HOLDINGS PCL-F	63	63	452	1,930	電気通信サービス
JMT NETWORK SERVICES-FOREIGN	57	—	—	—	金融サービス
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	49	49	651	2,782	銀行
KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	323	323	594	2,537	銀行
KRUNGTHAI CARD PCL-FOREIGN	54	155	709	3,027	金融サービス
LAND & HOUSES PUB CO-FOR REG	285	285	218	930	不動産管理・開発
MINOR INTERNATIONAL PCL-FOR	185	185	508	2,172	消費者サービス
MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIG	21	21	91	392	金融サービス
OSOTSPA PCL-FOREIGN	32	32	77	332	食品・飲料・タバコ
PTT EXPLORATION & PROD-FOR	79	90	1,426	6,091	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	143	143	543	2,320	素材
PTT OIL & RETAIL BUS-FOREIGN	142	329	654	2,795	一般消費財・サービス流通・小売り
PTT PCL/FOREIGN	526	753	2,579	11,012	エネルギー
RATCH GROUP PCL-FOREIGN	23	165	536	2,289	公益事業

ニッセイ新興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	
(タイ)		百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
	SCB X PCL-FOREIGN	68	68	673	2,874	銀行
	SCG PACKAGING PCL-FOREIGN	73	73	273	1,168	素材
	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	42	70	2,037	8,697	素材
	SRISAWADCORP PCL - FOREIGN	24	—	—	—	金融サービス
	THAI OIL PCL-FRGN	93	93	465	1,985	エネルギー
	THAI UNION GROUP PCL-F	98	—	—	—	食品・飲料・タバコ
	TRUE CORP PCL/NEW-FOREIGN	—	607	370	1,583	電気通信サービス
	TRUE CORP PCL-FOREIGN	1,013	—	—	—	電気通信サービス
小計	株数・金額	7,654	10,668	34,449	147,100	
	銘柄数<比率>	42	40	—	<1.6%>	
(ポーランド)				千ポーランド・ズロチ		
	ALLEGRO.EU SA	16	34	101	3,774	一般消費財・サービス流通・小売り
	BANK PEKAO SA	11	13	185	6,897	銀行
	BUDIMEX	—	0.97	52	1,966	資本財
	CD PROJEKT SA	4	4	48	1,800	メディア・娯楽
	CYFROWY POLSAT SA	10	10	12	470	メディア・娯楽
	DINO POLSKA SA	2	3	146	5,446	生活必需品流通・小売り
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	8	15	183	6,836	素材
	LPP SA	0.04	0.09	137	5,114	耐久消費財・アパレル
	MBANK SA	—	1	63	2,374	銀行
	ORANGE POLSKA SA	13	—	—	—	電気通信サービス
	ORLEN SA	40	46	288	10,751	エネルギー
	PEPCO GROUP NV	—	15	29	1,088	一般消費財・サービス流通・小売り
	PGE SA	17	88	62	2,346	公益事業
	PKO BANK POLSKI SA	50	71	340	12,686	銀行
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	34	49	231	8,623	保険
	SANTANDER BANK POLSKA S.A.	1	3	176	6,575	銀行
小計	株数・金額	211	358	2,059	76,754	
	銘柄数<比率>	13	15	—	<0.8%>	
(ハンガリー)				千ハンガリー・フォリント		
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	26	42	11,976	5,164	エネルギー
	OTP BANK RT	11	18	25,192	10,862	銀行
	RICHTER GEDEON NYRT	8	8	7,638	3,293	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	46	69	44,807	19,320	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.2%>	

ニッセイ新興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/ギリシャ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	–	126	19	3,128	銀行
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	–	173	29	4,750	銀行
FF GROUP	1	1	0.619	101	耐久消費財・アパレル
HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	15	17	22	3,681	電気通信サービス
JUMBO SA	9	11	30	4,910	一般消費財・サービス流通・小売り
MOTOR OIL (HELLAS) SA	–	5	12	2,062	エネルギー
MYTILINEOS S.A.	13	7	24	4,015	資本財
NATIONAL BANK OF GREECE	–	46	28	4,604	銀行
OPAP SA	18	20	30	4,973	消費者サービス
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	–	55	17	2,828	銀行
PUBLIC POWER CORP	27	14	14	2,389	公益事業
小計	株数・金額	85	479	228	37,446
	銘柄数<比率>	6	11	–	<0.4%>
合計	株数・金額	137,055	267,956	–	7,389,780
	銘柄数<比率>	1,000	1,048	–	<79.6%>

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

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

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

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

ニッセイ新興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	
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千米ドル	千円
ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF		31	51	767	115,062
ISHARES MSCI QATAR CP ETF		19	29	521	78,163
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF		38	57	2,268	340,208
ISHARES MSCI KUWAIT ETF		8	14	443	66,483
小計	口数・金額	97	152	4,000	599,918
	銘柄数<比率>	4	4	—	<6.5%>
(メキシコ)				千メキシコ・ペソ	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		18	21	613	5,339
小計	口数・金額	18	21	613	5,339
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>
(南アフリカ)				千南アフリカ・ランド	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		19	19	200	1,640
小計	口数・金額	19	19	200	1,640
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>
合計	口数・金額	136	193	—	606,898
	銘柄数<比率>	6	6	—	<6.5%>

(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) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、口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
外国		百万円	百万円
	MINI MSCI EM INDEX FUTURES	1,268	—

(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	7,389,780	79.0
投資信託証券	606,898	6.5
コール・ローン等、その他	1,352,276	14.5
投資信託財産総額	9,348,956	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香港ドル19.23円、1台湾ドル4.712円、1イギリス・ポンド186.69円、1トルコ・リラ5.234円、1メキシコ・ペソ8.704円、1フィリピン・ペソ2.692円、100チリ・ペソ16.87円、100コロンビア・ペソ3.662円、1インド・ルピー1.81円、100インドネシア・ルピア0.97円、1ブラジル・レアル30.529円、1チェコ・コルナ6.667円、100韓国ウォン11.56円、1人民元20.758円、1マレーシア・リングgit32.015円、1南アフリカ・ランド8.17円、1タイ・バーツ4.27円、1ポーランド・ズロチ37.264円、100ハンガリー・フォリント43.119円、1ユーロ163.54円です。

(注2) 外貨建純資産 (8,413,245千円) の投資信託財産総額 (9,348,956千円) に対する比率は90.0%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ新興国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	10,223,961,401円
コーポレート債等 株式(評価額)	1,012,938,757 7,389,780,711
投資信託証券(評価額)	606,898,904
未収入金	910,597,799
未収配当金	8,747,913
差入委託証拠金	294,997,317
(B)負債	934,857,729
未払金	886,347,454
未払解約金	48,509,343
その他未払費用	932
(C)純資産総額(A - B)	9,289,103,672
元本	7,117,768,792
次期繰越損益金	2,171,334,880
(D)受益権総口数	7,117,768,792口
1万口当たり基準価額(C / D)	13,051円

(注1) 期首元本額 4,729,645,782円
 期中追加設定元本額 3,508,693,484円
 期中一部解約元本額 1,120,570,474円

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

<購入・換金手数料なし>ニッセイ新興国株式インデックスファンド 2,915,896,360円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式) 21,977,301円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート) 29,170,813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) 10,602,726円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (8資産均等型) 60,797,503円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド (GDP型バスケット) 613,202,841円
 ニッセイ新興国株式インデックス (ラップ専用) 1,803,005,099円
 FWニッセイ新興国株インデックス 10,439,849円
 DCニッセイ全世界株式インデックスコレクト 141,867円
 DCニッセイ新興国株式インデックス 1,652,534,433円

損益の状況

当期 (2022年11月22日~2023年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	187,395,746円
受取配当金	175,723,318
受取利息	2,893,239
その他収益金	8,993,546
支払利息	△ 214,357
(B)有価証券売買損益	776,451,878
売買益	1,402,492,963
売買損	△ 626,041,085
(C)先物取引等損益	5,285,260
取引益	73,976,707
取引損	△ 68,691,447
(D)信託報酬等	△ 16,654,430
(E)当期損益金(A + B + C + D)	952,478,454
(F)前期繰越損益金	699,291,835
(G)追加信託差損益金	761,284,175
(H)解約差損益金	△ 241,719,584
(I)合計(E + F + G + H)	2,171,334,880
次期繰越損益金(I)	2,171,334,880

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

ニッセイJ-REIT インデックスマザーファンド

運用報告書

第 33 期

(計算期間：2023年5月13日～2023年11月13日)

運用方針	<p>①国内の金融商品取引所に上場しているJリート（不動産投資信託）を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標とします。</p> <p>②Jリートへの投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄（採用予定を含みます）に投資を行うものとします。なお、東証REIT指数の採用銘柄の追加・変更があった場合は、適宜追加・見直しを行います。</p>	運用方法	<p>以下の様な投資制限のもと運用を行います。</p> <ul style="list-style-type: none">・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。・同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超える投資信託証券がある場合には、当該投資信託証券を東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。・外貨建資産への投資は行いません。
主要運用対象	国内の金融商品取引所に上場しているJリート		



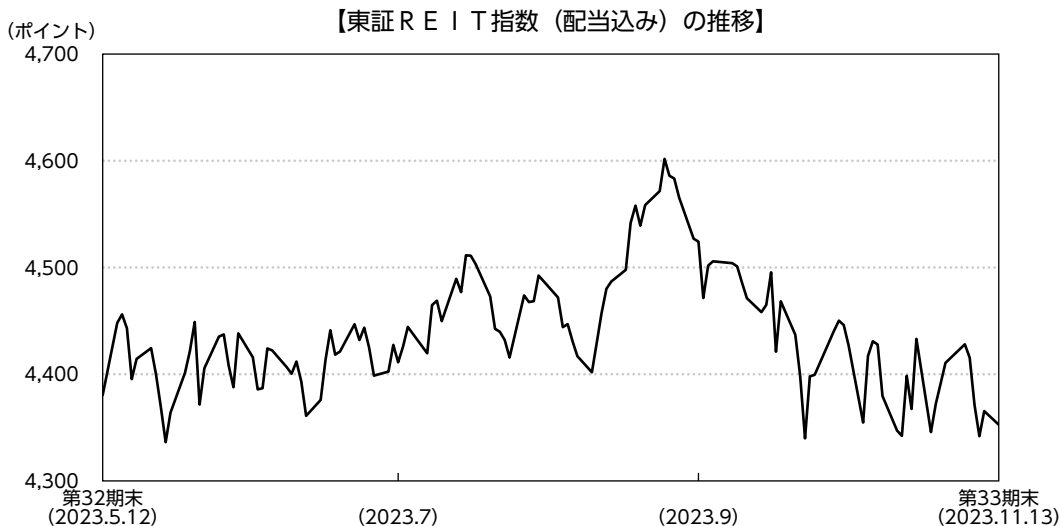
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2023年5月13日～2023年11月13日

Jリート市況

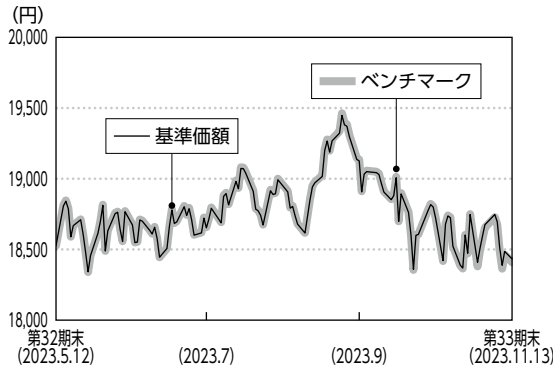


(注) 指数はブルームバーグのデータを使用しています。

Jリート市場は期を通じて見ると下落しました。

期初から6月にかけて、主に国内金融機関の買いが下値を支える一方で、日銀の金融政策の不透明感などを受けて上値が抑えられる展開となり、狭いレンジで安定的に推移しました。7月上旬から下旬にかけて、7月末に開催された日銀の金融政策決定会合において、長期金利の変動幅が据え置かれるとの見通しが高まり、金利上昇に対する過度な警戒感が後退したことを背景に上昇しました。8月上旬以降は株式市場の動向や金利見通しにつれて上下しながらやや下落したものの、下旬以降は金利上昇に対する過度な懸念が後退したことやオフィス型リートの決算からオフィス需要の底堅さが確認されたことで上昇しました。その後は、ファンダメンタルズ（リートの営業収益や利益といった業績や資産、負債などの財務状況を表す指標）の改善傾向が確認されたものの、日米の金利上昇がJリート市場の下押し材料となり、前期末と比較すると下落して当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

国内の金融商品取引所に上場している J リートを主要投資対象とし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は下落しました。詳しくは前掲の「J リート市場」をご参照ください。

ポートフォリオ

国内の金融商品取引所に上場している J リートを主要投資対象とし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ポートフォリオの構築・運用は、東証 REIT 指数採用全銘柄を投資対象とし、市場での時価総額比率をベースに完全法を用いて行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は -0.5% となり、ベンチマーク騰落率(-0.6%)にほぼ連動しました。

今後の運用方針

東証 REIT 指数採用全銘柄について完全法にて投資を行い、ベンチマークの動きに連動する成果を目標に運用を行います。

最近５期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチマーク	期中	投資信託証券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
29期 (2021年11月12日)	19,395	1.9	18,966	1.9	98.4	32,023
30期 (2022年 5月12日)	18,642	△3.9	18,222	△3.9	98.1	31,255
31期 (2022年11月14日)	19,056	2.2	18,630	2.2	98.8	32,174
32期 (2023年 5月12日)	18,527	△2.8	18,108	△2.8	98.4	31,880
33期 (2023年11月13日)	18,433	△0.5	17,993	△0.6	98.3	30,812

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	投資信託証券 組入比率
		%		%	
(期首) 2023年 5月12日	18,527	－	18,108	－	98.4
5月末	18,812	1.5	18,391	1.6	98.6
6月末	18,695	0.9	18,276	0.9	98.5
7月末	18,911	2.1	18,490	2.1	98.4
8月末	19,188	3.6	18,764	3.6	98.1
9月末	18,893	2.0	18,471	2.0	98.2
10月末	18,508	△0.1	18,073	△0.2	98.5
(期末) 2023年11月13日	18,433	△0.5	17,993	△0.6	98.3

(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13日～2023年11月13日

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

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（18,770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13日～2023年11月13日

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	0.020	2,331	0.033	3,884
サンケイリアルエステート投資法人	0.032	2,877	0.051	4,557
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	0.055	7,066	0.081	10,657
東海道リート投資法人	0.015	1,826	0.077	9,322
日本アコモデーションファンド投資法人	0.035	22,239	0.056	36,839
森ヒルズリート投資法人	0.117	16,960	0.189	27,922
産業ファンド投資法人	0.153	22,260	0.247	37,826
アドバンス・レジデンス投資法人	0.186	62,381	0.302	105,944
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	0.076	16,586	0.108	23,246
	(△ 2)			
アクティビア・プロパティーズ投資法人	0.050	20,378	0.092	37,513
ＧＬＰ投資法人	0.768	110,399	0.524	75,429
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.085	27,893	0.074	25,665
日本プロロジスリート投資法人	0.333	98,071	0.271	78,989
星野リゾート・リート投資法人	0.048	30,612	0.030	19,012
Oneリート投資法人	0.016	3,995	0.027	6,637
イオンリート投資法人	0.351	52,775	0.190	29,043
ヒューリックリート投資法人	0.093	14,791	0.150	23,392
日本リート投資法人	0.033	11,312	0.053	17,895
積水ハウス・リート投資法人	0.300	24,613	0.485	39,179
トーセイ・リート投資法人	0.021	2,850	0.067	9,054
ケネディクス商業リート投資法人	0.044	11,920	0.064	17,247
	(△ 1)			
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.024	3,674	0.040	6,432
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.064	7,419	0.043	5,031
野村不動産マスターファンド投資法人	0.323	53,833	0.522	85,426
いちごホテルリート投資法人	0.017	1,835	0.028	2,902
ラサールロジポート投資法人	0.284	43,485	0.200	31,642
スターアジア不動産投資法人	0.988	54,146	0.204	11,924
マリモ地方創生リート投資法人	0.020	2,562	0.026	3,399
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	0.100	48,325	0.063	31,875
大江戸温泉リート投資法人	0.014	911	0.049	3,188
投資法人みらい	0.312	14,437	0.198	9,039

国内

ニッセイＪ－ＲＥＩＴ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
	千口	千円	千口	千円
三菱地所物流リート投資法人	0.040	16,015	0.056	23,207
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	0.048	8,336	0.068	12,467
ザイマックス・リート投資法人	0.016	1,816	0.026	2,939
タカラレーベン不動産投資法人	0.056	5,378	0.077	7,296
アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.052	6,845	0.072	9,676
日本ビルファンド投資法人	0.115	66,601	0.187	107,047
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.108	60,629	0.166	90,997
日本都市ファンド投資法人	0.470	45,665	1	147,389
オリックス不動産投資法人	0.199	35,341	0.322	57,946
日本プライムリアルティ投資法人	0.069	24,447	0.111	39,157
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	0.236	30,712	0.140	18,501
東急リアル・エステート投資法人	0.067	12,381	0.108	20,116
グローバル・ワン不動産投資法人	0.083	9,388	0.120	13,314
ユナイテッド・アーバン投資法人	0.225	34,725	0.362	54,308
森トラストリート投資法人	0.383	27,832	0.303	21,667
インヴィンシブル投資法人	1	101,216	0.694	40,284
フロンティア不動産投資法人	0.036	16,892	0.059	28,522
平和不動産リート投資法人	0.256	38,041	0.111	16,311
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.062	18,609	0.202	62,372
福岡リート投資法人	0.052	8,414	0.084	13,669
KDX不動産投資法人	0.057	18,570	0.128	34,182
	(6)			
いちごオフィスリート投資法人	0.082	7,241	0.132	11,689
大和証券オフィス投資法人	0.023	14,425	0.035	21,699
阪急阪神リート投資法人	0.120	17,228	0.074	10,643
スターツプロシード投資法人	0.018	3,967	0.029	6,665
大和ハウスリート投資法人	0.152	42,329	0.245	68,605
ジャパン・ホテル・リート投資法人	0.684	52,674	0.522	38,009
大和証券リビング投資法人	0.395	43,888	0.224	25,562
ジャパンエクセレント投資法人	0.084	10,615	0.283	36,652

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()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3) 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。

組入有価証券明細表

2023年11月13日現在

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	0.611	0.598	70,145
サンケイリアルエステート投資法人	0.962	0.943	84,681
S O S I L A 物流リート投資法人	1	1	174,985
東海道リート投資法人	0.500	0.438	54,662
日本アコモデーションファンド投資法人	1	1	618,744
森ヒルズリート投資法人	3	3	479,902
産業ファンド投資法人	4	4	604,219
アドバンス・レジデンス投資法人	3	2	936,831
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2	—	—
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1	1	616,056
G L P 投資法人	9	9	1,357,667
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1	1	457,252
日本プロロジスリート投資法人	5	5	1,392,975
星野リゾート・リート投資法人	0.525	0.543	326,886
Oneリート投資法人	0.524	0.513	132,251
イオンリート投資法人	3	3	512,117
ヒューリックリート投資法人	2	2	415,427
日本リート投資法人	0.976	0.956	326,952
積水ハウス・リート投資法人	9	8	686,061
トーセイ・リート投資法人	0.666	0.620	84,072
ケネディクス商業リート投資法人	1	—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人	0.741	0.725	103,892
サムティ・レジデンシャル投資法人	0.781	0.802	86,535
野村不動産マスターファンド投資法人	9	9	1,598,520
いちごホテルリート投資法人	0.498	0.487	50,307
ラサールロジポート投資法人	3	3	565,278
スターアジア不動産投資法人	3	4	257,984
マリモ地方創生リート投資法人	0.459	0.453	57,168
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1	1	572,220
大江戸温泉リート投資法人	0.485	0.450	29,340
投資法人みらい	3	3	167,829
三菱地所物流リート投資法人	1	1	383,032
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1	1	202,593
ザイマックス・リート投資法人	0.487	0.477	55,522
タカラレーベン不動産投資法人	1	1	135,454
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1	1	160,480

ニッセイ J-REIT インデックス マザー ファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
日本ビルファンド投資法人	3	3	2,079,792
ジャパンリアルエステイト投資法人	3	3	1,680,232
日本都市ファンド投資法人	15	14	1,379,273
オリックス不動産投資法人	5	5	994,781
日本プライムリアルティ投資法人	2	2	696,152
NTT都市開発リート投資法人	2	2	380,630
東急リアル・エステート投資法人	2	1	350,799
グローバル・ワン不動産投資法人	2	2	244,027
ユナイテッド・アーバン投資法人	6	6	985,983
森トラストリート投資法人	5	5	415,117
インヴィンシブル投資法人	13	14	819,145
フロンティア不動産投資法人	1	1	492,492
平和不動産リート投資法人	2	2	307,939
日本ロジスティクスファンド投資法人	2	1	536,282
福岡リート投資法人	1	1	245,346
KDX不動産投資法人	1	8	1,354,720
いちごオフィスリート投資法人	2	2	200,595
大和証券オフィス投資法人	0.622	0.610	397,720
阪急阪神リート投資法人	1	1	197,402
スタートアップシード投資法人	0.521	0.510	103,020
大和ハウスリート投資法人	4	4	1,208,094
ジャパン・ホテル・リート投資法人	9	9	663,822
大和証券リビング投資法人	4	4	467,097
ジャパンエクセレント投資法人	2	2	333,432
合計	口数・金額 銘柄数<比率>	182 60	185 58 30,291,949 <98.3%>

(注1) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、口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。

投資信託財産の構成

2023年11月13日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託証券	30,291,949	98.1
コール・ローン等、その他	586,282	1.9
投資信託財産総額	30,878,231	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ J-R E I T 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13日現在)

項目	当期末
(A) 資産	30,878,231,422円
コール・ローン等	286,676,474
投資信託証券(評価額)	30,291,949,200
未収配当金	299,605,748
(B) 負債	65,562,319
未払解約金	65,561,750
その他未払費用	569
(C) 純資産総額(A-B)	30,812,669,103
元本	16,716,012,931
次期繰越損益金	14,096,656,172
(D) 受益権総口数	16,716,012,931口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,433円

(注1) 期首元本額 17,208,055,347円
 期中追加設定元本額 2,361,824,590円
 期中一部解約元本額 2,853,867,006円

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

ニッセイ J-R E I T インデックス ファンド (適格機関投資家限定)
 56,841,873円
 DCニッセイ J-R E I T インデックス ファンド 1,080,525,327円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ Jリート インデックス ファンド
 8,890,804,254円
 ニッセイ J-R E I T インデックス ファンド2013-02 (適格機関投資家限定)
 1,637,278,520円
 DCニッセイ J-R E I T インデックス ファンド A
 2,982,848,934円
 DCニッセイ J-R E I T インデックス ファンド B
 1,803,563,289円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス バランス ファンド (6資産均等型)
 177,025,489円
 ニッセイ・インデックス パッケージ (内外・株式/リート)
 19,243,470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)
 6,990,409円
 ニッセイ・インデックス パッケージ (国内・株式/リート/債券)
 14,716,384円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス バランス ファンド (8資産均等型)
 40,515,311円
 ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランス ファンド (安定型)
 108,494円
 ニッセイ 国内3資産 高値参照型 バランス ファンド (積極型)
 236,567円
 FWニッセイ 国内リート インデックス
 5,314,610円

損益の状況

当期 (2023年5月13日~2023年11月13日)

項目	当期
(A) 配当等収益	645,010,267円
受取配当金	645,115,691
受取利息	4,455
その他収益金	1
支払利息	△ 109,880
(B) 有価証券売買損益	△ 780,994,702
売買益	651,774,293
売買損	△ 1,432,768,995
(C) 信託報酬等	△ 3,421
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 135,987,856
(E) 前期繰越損益金	14,672,716,502
(F) 追加信託差損益金	2,060,496,409
(G) 解約差損益金	△ 2,500,568,883
(H) 合計(D+E+F+G)	14,096,656,172
次期繰越損益金(H)	14,096,656,172

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

ニッセイ先進国リートインデックス マザーファンド

運用報告書

第 6 期

(計算期間：2022年11月22日～2023年11月20日)

運用方針

主に各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国のリート（不動産投資信託）に投資することにより、S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

主要運用 対象

各国の金融商品取引所に上場（これに準ずる市場で取引されているものを含みます）している日本を除く先進国のリート

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・ 投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ・ 株式、新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

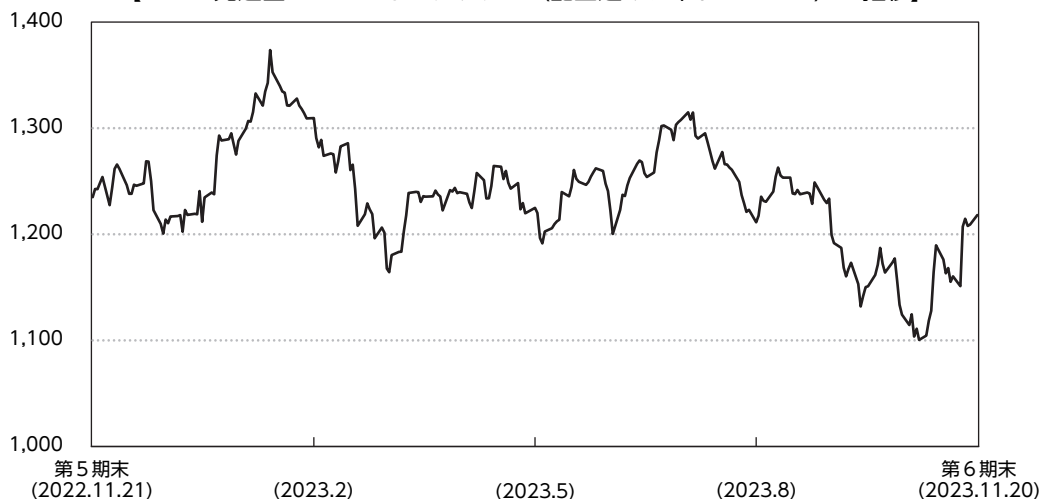
運用経過

2022年11月22日～2023年11月20日

投資環境

■先進国リート市況

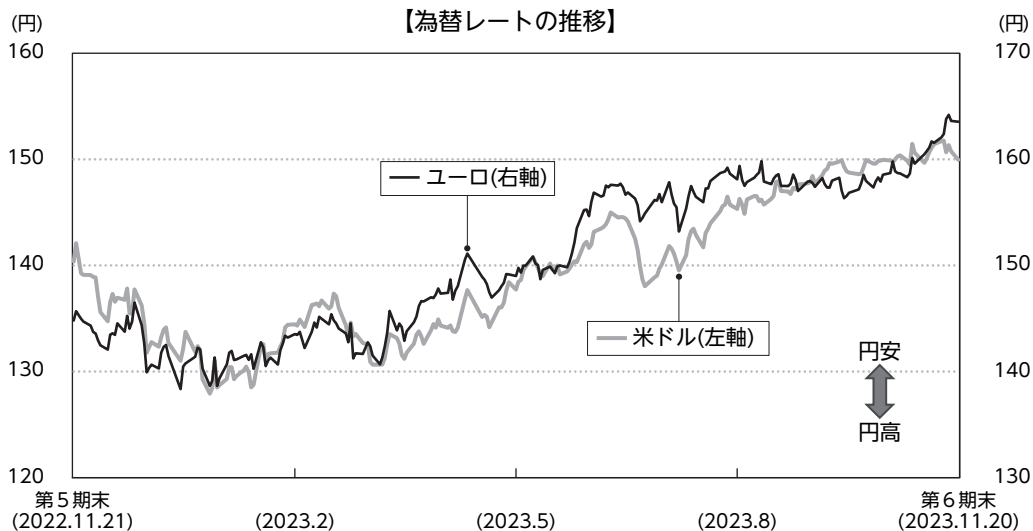
【S & P先進国REITインデックス（配当込み、米ドルベース）の推移】



(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の先進国リート市場は、期初以降、各国における金利上昇懸念の高まりや中国におけるコロナウイルス感染再拡大の報道等が嫌気され下落して始まりました。その後、FRB高官から利上げ幅の縮小を支持する発言が相次いだことで反発したものの、2023年3月には米シリコンバレーバンクの経営破綻等を受けて欧米の金融システム不安が高まり融資基準の厳格化等、不動産市況への悪影響が懸念されたことからリート市場は下落しました。その後、7月にかけては米オフィスリート大手のSLグリーン・リアルティによる物件売却のニュースが好感されたことや、米国やイギリスで発表されたCPIが市場予想を下回ったことなどから金融引き締め長期化への過度な警戒感が後退し、リート市場は上昇基調で推移しました。10月にかけては米経済の底堅さを示す経済指標の発表が続いたため、FRBによる金融引き締めの長期化観測が強まり、高金利のもとで不動産市況の回復にも遅れが出るとの懸念からリート市場は再び軟調な推移となりましたが、11月に入り発表された経済指標がインフレ鈍化を示し、長期金利が大きく低下したことなどが好感され当期末にかけて反発しました。

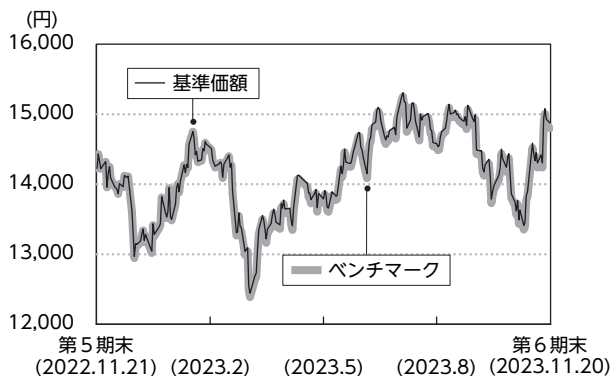
■為替市況



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。

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>

- ・2023年1月から2月にかけて、米連邦準備制度理事会（F R B）高官から利上げ幅の縮小を支持する発言が相次いだことが好感されリート市場が上昇したこと
- ・4月から7月にかけて、為替が円安基調で推移する中、米オフィスリート大手による物件売却のニュースが好感されたことや、米国やイギリスで発表された消費者物価指数（C P I）が市場予想を下回ったことなどから金融引き締め長期化への過度な警戒感が後退しリート市場が上昇したこと
- ・11月に入り発表された米経済指標がインフレ鈍化を示し、長期金利が大きく低下したことなどが好感されリート市場が上昇したこと

<下落要因>

- ・期初から2022年12月にかけて、各国における金利上昇懸念の高まりや中国におけるコロナウイルス感染再拡大の報道等が嫌気されリート市場が下落したこと
- ・2023年3月に米シリコンバレーバンクの経営破綻等を受けて欧米の金融システム不安が高まり融資基準の厳格化等、不動産市況への悪影響が懸念されリート市場が下落したこと
- ・9月から10月にかけて、米経済の底堅さを示す経済指標の発表が続いたため、F R Bによる金融引き締めの長期化観測が強まったことが嫌気されリート市場が下落したこと

ポートフォリオ

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリートに投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+4.5%となり、ベンチマーク騰落率（+4.0%）を上回りました。これはキャッシュフローに伴うタイミング効果等によるものです。

今後の運用方針

各国の金融商品取引所に上場している日本を除く先進国のリートに投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託証券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
2期(2019年11月20日)	11,556	12.2	11,458	11.8	—	—	97.7	2,470
3期(2020年11月20日)	9,969	△13.7	9,745	△14.9	—	—	98.4	2,497
4期(2021年11月22日)	14,373	44.2	14,056	44.2	—	—	98.9	4,519
5期(2022年11月21日)	14,227	△ 1.0	13,816	△ 1.7	—	—	99.3	5,896
6期(2023年11月20日)	14,874	4.5	14,372	4.0	0.0	4.9	94.9	9,294

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託証券 組入比率
		%		%			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2022年11月21日	14,227	—	13,816	—	—	—	99.3
11月末	14,157	△0.5	13,746	△0.5	—	—	98.8
12月末	13,282	△6.6	12,877	△6.8	—	—	98.7
2023年 1 月末	14,164	△0.4	13,746	△0.5	—	—	98.9
2 月末	14,317	0.6	13,892	0.6	—	—	98.4
3 月末	13,352	△6.2	12,909	△6.6	—	—	97.9
4 月末	13,659	△4.0	13,208	△4.4	0.0	—	98.0
5 月末	13,855	△2.6	13,402	△3.0	0.0	—	98.4
6 月末	14,847	4.4	14,362	4.0	0.0	—	97.9
7 月末	14,918	4.9	14,439	4.5	0.0	3.3	97.2
8 月末	15,140	6.4	14,655	6.1	0.0	2.4	97.5
9 月末	14,281	0.4	13,810	△0.0	0.0	5.1	95.0
10月末	13,453	△5.4	13,006	△5.9	0.0	2.9	96.9
(期末)2023年11月20日	14,874	4.5	14,372	4.0	0.0	4.9	94.9

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2022年11月22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 (先物・オプション)	5円 (1)	0.037% (0.006)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(4)	(0.031)	
有価証券取引税	2	0.015	
(投資信託証券)	(2)	(0.015)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	19	0.137	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)	(18)	(0.129)	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)	(1)	(0.009)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	27	0.190	

(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（14,169円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2022年11月22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	千米ドル	百株	千米ドル
		—	—	—	0.003
		(4)	(9)		

(注1) 金額は受渡代金です。

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

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

ニッセイ先進国リート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	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	2	151	0.436	23
ACADIA REALTY TRUST	0.539	7	—	—
AGREE REALTY CORP	2	132	—	—
ALEXANDER'S INC	0.103	19	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	356	0.334	41
PROLOGIS INC	16	1,952	2	279
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2	16	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	438	0.256	43
BRANDYWINE REALTY TRUST	4	20	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	201	0.264	29
NNN REIT INC	3	133	0.428	19
COPT DEFENSE PROPERTIES	1	45	—	—
COUSINS PROPERTIES INC	2	57	—	—
SITE CENTERS CORP	2	35	—	—
EASTGROUP PROPERTIES	0.791	132	—	—
EPR PROPERTIES	1	48	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	6	388	0.766	48
外国 ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	251	0.222	49
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	125	0.198	20
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	2	120	0.322	16
GETTY REALTY CORP	0.949	28	—	—
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.150	1	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9	204	0.621	15
WELLTOWER INC	9	782	0.286	19
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1	39	—	—
SERVICE PROPERTIES TRUST	1	8	—	—
HOST HOTELS AND RESORTS INC	12	209	2	34
EQUITY COMMONWEALTH	2	66	—	—
CENTERSPACE	0.314	19	—	—
SAFEHOLD INC	0.471	10	—	0.033
	(△ 1)	(△ 9)		
KILROY REALTY CORP	1	54	—	—
KIMCO REALTY CORP	10	210	1	30
LXP INDUSTRIAL TRUST	6	62	—	—
LTC PROPERTIES INC	0.763	25	—	—
MACERICH CO/THE	3	34	—	—
VERIS RESIDENTIAL INC	1	25	—	—

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	303	0.147	21
NATL HEALTH INVESTORS INC	0.714	38	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	4	144	0.711	22
PUBLIC STORAGE	2	781	0.400	115
RPT REALTY	0.580	6	—	—
REGENCY CENTERS CORP	2	169	0.236	14
	(0.367)			
SAUL CENTERS INC	0.387	14	—	—
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	4	12	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	5	646	0.985	111
SL GREEN REALTY CORP	0.816	25	—	—
LIFE STORAGE INC	0.954	118	0.205	26
	(△ 3)			
SUN COMMUNITIES INC	2	284	0.333	45
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	1	38	—	—
UDR INC	5	217	1	40
UMH PROPERTIES INC	1	18	—	—
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.325	15	—	—
VENTAS INC	6	316	1	51
VORNADO REALTY TRUST	2	42	—	—
WP CAREY INC	3	261	0.279	17
ELME COMMUNITIES	1	24	—	—
REALTY INCOME CORP	14	837	0.433	26
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3	245	0.462	31
KITE REALTY GROUP TRUST	3	80	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	394	0.332	48
	(3)			
CUBESMART	3	169	0.604	26
DIGITAL REALTY TRUST INC	5	633	0.672	69
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	3	25	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	10	93	1	18
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3	35	—	—
URSTADT BIDDLE - CL A	0.029	0.659	—	0.031
	(△ 1)			
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	2	2	—	—
DOUGLAS EMMETT INC	3	36	—	—
IRON MOUNTAIN INC	5	287	0.657	35
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	3	21	—	—

外国

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2	16	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	0.888	12	—	—
TERRENO REALTY CORP	2	122	—	—
RLJ LODGING TRUST	2	25	—	—
AMERICAN ASSETS TRUST INC	0.279	5	—	—
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	2	29	—	—
CHATHAM LODGING TRUST	0.053	0.498	—	—
STAG INDUSTRIAL INC	3	110	—	—
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	0.509	2	—	—
EQUINIX INC	1	1,204	0.162	118
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	6	124	1	21
SABRA HEALTH CARE REIT INC	3	47	—	—
WHITESTONE REIT	0.118	1	—	—
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1	103	0.166	14
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	5	182	—	—
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1	20	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	5	72	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	4	230	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2	92	0.448	18
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	0.630	5	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	4	223	0.477	23
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	1	4	—	—
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5	110	1	24
CARETRUST REIT INC	1	35	—	—
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	3	56	—	—
STORE CAPITAL CORP	0.716	22	9	319
PARAMOUNT GROUP INC	0.710	3	—	—
URBAN EDGE PROPERTIES	0.860	13	—	—
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2	29	—	—
XENIA HOTELS & RESORTS INC	1	18	—	—
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1	35	—	—
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.354	15	—	—
APPLE HOSPITALITY REIT INC	3	51	—	—
CITY OFFICE REIT INC	0.789	4	—	—
GLOBAL NET LEASE INC	0.901	8	—	—
	(3)			
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1	40	—	—
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.613	21	—	—

外国

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
FARMLAND PARTNERS INC	0.983	11	—	—
MANULIFE US REAL ESTATE INV	17	3	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	2	29	—	—
INVITATION HOMES INC	10	333	1	50
JBG SMITH PROPERTIES	1	27	—	—
ALEXANDER & BALDWIN INC	1	26	—	—
GLADSTONE LAND CORP	0.675	11	—	—
GLOBAL MEDICAL REIT INC	0.214	1	—	—
VICI PROPERTIES INC	18	589	1	62
AMERICOLD REALTY TRUST	4	141	0.908	29
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER SAFEHOLD INC	0.490	36	—	—
	—	—	—	—
	(△0.586)			
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	2	15	—	—
	(△ 5)			
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	1	46	—	—
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	0.151	3	—	—
PRIME US REIT	22	4	—	—
		(△0.284)		
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	24	7	—	—
		(△0.549)		
APARTMENT INCOME REIT CO	2	90	0.411	14
NETSTREIT CORP	1	25	—	—
CTO REALTY GROWTH INC	0.836	14	—	—
BROADSTONE NET LEASE INC-A	4	64	—	—
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	0.750	3	—	—
INDUS REALTY TRUST INC	—	—	0.103	6
POSTAL REALTY TRUST INC- A	0.882	12	—	—
ORION OFFICE REIT INC	1	7	—	—
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2	73	—	—
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	0.592	13	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP	1	25	—	—
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	25	14	—	—
		(△0.272)		
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	—	0.147	1
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	1	17	—	0.003
	(0.016)	(0.147)		
PEAKSTONE REALTY TRUST	1	34	—	—

外国

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
UNITI GROUP INC	12	63	—	—
NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I	—	—	—	—
	(0.688)			
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.137	9	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1	29	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1	66	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	0.611	5	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2	46	—	—
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1	23	—	—
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1	18	—	—
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4	34	—	—
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	2	25	—	—
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.465	35	—	—
CHOICE PROPERTIES REIT	3	48	—	—
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1	20	—	—
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1	24	—	—
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2	31	—	—
SLATE GROCERY REIT	0.057	0.567	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	0.254	4	—	—
SLATE OFFICE REIT	—	—	2	3
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	—	—	2	63
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	0.044	0.566	—	—
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	0.626	8	—	—
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	—	—	0.800	8
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	7	22	—	—
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	—	—	2	5
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	—	—	2	8
PRIMARIS REIT	0.125	1	—	—
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
GPT GROUP	31	133	7	31
GOODMAN GROUP	29	596	4	90
STOCKLAND	39	161	8	31
BWP TRUST	11	39	—	—
MIRVAC GROUP	70	156	11	25
CHARTER HALL RETAIL REIT	10	36	—	—
VICINITY CENTRES	69	131	10	18
CHARTER HALL GROUP	6	77	—	—

外国

ニッセイ先進国リート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
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
CROMWELL PROPERTY GROUP	60	25	—	—
REGION RE LTD	20	43	—	—
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	0.369	0.768	—	—
INGENIA COMMUNITIES GROUP	6	25	—	—
DEXUS INDUSTRIA REIT	0.685	1	—	—
NATIONAL STORAGE REIT	24	57	—	—
SCENTRE GROUP	91	249	9	28
ARENA REIT	7	29	—	—
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	1	2	—	—
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	5	17	—	—
WAYPOINT REIT LTD	11	28	—	—
CHARTER HALL LONG WALE REIT	12	42	—	—
RURAL FUNDS GROUP	0.486	0.927	—	—
CENTURIA OFFICE REIT	0.599	0.668	—	—
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	3	10	—	—
CENTURIA CAPITAL GROUP	3	5	—	—
HOMECO DAILY NEEDS REIT	36	45	—	—
外国 DEXUS/AU	19	152	2	18
HMC CAPITAL LTD	4	24	—	—
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	33	24	33	24
HEALTHCO REIT	9	13	—	—
ABACUS STORAGE KING	—	—	—	—
	(14)			
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
CHAMPION REIT	39	107	—	—
LINK REIT	56	2,682	2	120
PROSPERITY REIT	98	184	—	—
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	75	123	—	—
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	45	145	—	—
FORTUNE REIT	42	242	—	—
LINK REIT-RIGHTS	—	—	15	50
	(15)			
(シンガポール)		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
CAPITALAND ASCENDAS REIT	67	186	—	—
		(△ 2)		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	92	180	14	27
		(△0.764)		

ニッセイ先進国リート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
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
KEPPEL REIT	37	32 (△0.345)	—	—
SUNTEC REIT	36	47 (△0.714)	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	57	95 (△ 5)	—	—
STARHILL GLOBAL REIT	40	19	—	—
CAPITALAND ASCOTT TRUST	49	52 (△ 1)	—	—
FRASERS CENTREPOINT TRUST	16	35	—	—
ESR-LOGOS REIT	110	34 (△ 1)	—	—
CDL HOSPITALITY TRUSTS	4	4 (△0.257)	—	—
CAPITALAND CHINA TRUST	6	5 (△ 2)	—	—
AIMS APAC REIT	15	19 (△0.729)	—	—
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	48	12 (△0.448)	78	17
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	11	42 (△0.582)	—	—
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	34	78 (△0.316)	—	—
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	43	69 (△0.801)	—	—
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	33	21 (△0.108)	—	—
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	88	28 (△0.194)	140	29
PARAGON REIT	43	39	—	—
KEPPEL DC REIT	30	61 (△ 1)	—	—
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	48	59 (△ 1)	—	—
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	38	29 (△0.053)	—	—
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	7	4	—	—

外国

ニッセイ先進国リート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
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
EC WORLD REIT	17	5	—	—
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	—	—	32	17
		(△ 1)		
(ニュージーランド)		千ニュージーランド・ドル		千ニュージーランド・ドル
KIWI PROPERTY GROUP LTD	40	36	—	—
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	34	45	—	—
GOODMAN PROPERTY TRUST	26	54	—	—
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	—	—	14	29
ARGOSY PROPERTY LTD	4	5	—	—
STRIDE PROPERTY GROUP	13	18	29	37
(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	14	51	—	—
HAMMERSON PLC	47	12	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	13	83	2	16
SEGRO PLC	21	165	2	17
WORKSPACE GROUP PLC	0.615	3	—	—
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	27	27	—	—
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	3	17	—	—
SHAFTESBURY PLC	—	—	—	—
	(△ 8)			
BIG YELLOW GROUP PLC	2	28	—	—
DERWENT LONDON PLC	1	25	—	—
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	30	35	—	—
	(28)			
INVISTA FOUNDATION PROPERTY	23	10	—	—
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	15	27	—	—
TRITAX BIG BOX REIT PLC	30	41	—	—
SAFESTORE HOLDINGS PLC	3	27	—	—
ASSURA PLC	53	25	—	—
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	14	13	—	—
REGIONAL REIT LTD	7	3	—	—
NEWRIVER REIT PLC	7	6	—	—
UNITE GROUP PLC	7	66	1	16
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	11	9	26	20
LXI REIT PLC	27	25	—	—
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	1	0.966	—	—
PICTON PROPERTY INCOME LTD	13	10	—	—
AEW UK REIT PLC	8	8	—	—

外国

ニッセイ先進国リート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
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	2	1	—	—
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	33	28	—	—
CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC	17	15	—	—
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	10	5	—	—
PRS REIT PLC/THE	2	1	—	—
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	21	14	21	14
URBAN LOGISTICS REIT PLC	2	2	—	—
WAREHOUSE REIT PLC	0.572	0.401	—	—
CLS HOLDINGS PLC	8	12	—	—
HELICAL PLC	5	15	—	—
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	34	26	—	—
LIFE SCIENCE REIT PLC	22	15	—	—
(イスラエル)		千イスラエル・シケル		千イスラエル・シケル
REIT 1 LTD	3	58	—	—
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	5	41	—	—
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	8	14	—	—
(ユーロ/アイルランド)		千ユーロ		千ユーロ
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	15	16	—	—
(ユーロ/オランダ)				
WERELDHAVE NV	0.190	2	—	—
NSI NV	0.811	17	—	—
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	0.250	5	—	—
(ユーロ/ベルギー)				
COFINIMMO	0.754	54	—	—
RETAIL ESTATES	0.288	18	—	—
INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES	0.026	0.525	—	—
WAREHOUSES DE PAUW SCA	3	90	—	—
AEDIFICA	1	69	—	—
XIOR STUDENT HOUSING NV	1	31	—	—
MONTEA NV	0.520	35	—	—
CARE PROPERTY INVEST	1	25	—	—
CARE PROPERTY INVEST NV-RTS	—	—	1	1
	(1)			
AEDIFICA SA-RIGHTS	—	—	1	0.648
	(1)			
(ユーロ/フランス)				
KLEPIERRE	3	73	—	—
		(△ 6)		

ニッセイ先進国リート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
GECINA SA	0.973	95	0.319	31
COVIVIO	0.892	38	–	–
MERCIALYS	1	14	–	–
ICADE	0.584	22	–	–
ALTAREA	0.013	1 (△ 2) (△0.031)	–	–
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1	94	0.424	20
CARMILA	0.972	13 (△ 2)	–	–
(ユーロ/ドイツ)				
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	–	– (0.656)	0.508	2
HAMBORNER REIT AG	4	28	–	–
(ユーロ/スペイン)				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	2	11 (△0.548)	–	–
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	5	46	–	–
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	4	26 (△0.598)	–	–

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()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3) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円 2,106	百万円 1,654	百万円 –	百万円 –

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2022年11月22日～2023年11月20日

株式

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
—	—	—	—	STAR HOLDINGS	—	0.437	—

(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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
STARHOLDINGS	—	4	5	898	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
合計	株数・金額	—	4	—	898
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.0%>

(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。

(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。

ニッセイ先進国リート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	
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円
BOSTON PROPERTIES INC	4	6	377	56,633
ACADIA REALTY TRUST	3	4	60	9,120
AGREE REALTY CORP	2	4	265	39,786
ALEXANDER'S INC	0.045	0.148	28	4,287
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4	7	782	117,299
PROLOGIS INC	30	44	4,903	735,347
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	4	6	44	6,675
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4	6	1,157	173,503
BRANDYWINE REALTY TRUST	5	9	39	5,928
CAMDEN PROPERTY TRUST	3	5	446	66,879
NNN REIT INC	6	8	347	52,111
COPT DEFENSE PROPERTIES	3	5	125	18,816
COUSINS PROPERTIES INC	4	7	145	21,795
SITE CENTERS CORP	6	8	118	17,758
EASTGROUP PROPERTIES	1	2	377	56,616
EPR PROPERTIES	2	3	168	25,231
EQUITY RESIDENTIAL	11	16	921	138,224
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	3	647	97,110
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	3	336	50,385
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	4	6	287	43,091
GETTY REALTY CORP	1	2	65	9,892
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1	1	21	3,152
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	18	27	445	66,743
WELLTOWER INC	15	25	2,189	328,358
HERSHA HOSPITALITY TRUST	0.962	0.962	9	1,430
HIGHWOODS PROPERTIES INC	3	5	99	14,956
SERVICE PROPERTIES TRUST	6	7	52	7,889
HOST HOTELS AND RESORTS INC	23	34	590	88,496
EQUITY COMMONWEALTH	2	5	99	14,960
CENTERSPACE	0.486	0.800	42	6,372
SAFEHOLD INC	3	1	33	5,084
KILROY REALTY CORP	3	5	156	23,495
KIMCO REALTY CORP	20	30	565	84,766
LXP INDUSTRIAL TRUST	8	14	119	17,854
LTC PROPERTIES INC	1	1	64	9,671
MACERICH CO/THE	7	10	117	17,551
VERIS RESIDENTIAL INC	2	3	49	7,363
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	5	694	104,089
NATL HEALTH INVESTORS INC	1	2	112	16,852
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7	11	374	56,185

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千□	千□	千米ドル	千円
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.420	0.420	8	1,238
PUBLIC STORAGE	5	7	1,956	293,448
RPT REALTY	3	4	49	7,422
REGENCY CENTERS CORP	5	8	498	74,783
SAUL CENTERS INC	0.390	0.777	27	4,189
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	5	10	22	3,376
SIMON PROPERTY GROUP INC	10	15	1,910	286,515
SL GREEN REALTY CORP	2	2	102	15,297
LIFE STORAGE INC	2	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC	4	5	731	109,620
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	3	5	129	19,420
UDR INC	10	14	480	72,024
UMH PROPERTIES INC	1	3	45	6,784
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.291	0.616	24	3,703
VENTAS INC	13	19	853	127,958
VORNADO REALTY TRUST	5	7	172	25,909
WP CAREY INC	6	10	583	87,520
ELME COMMUNITIES	2	4	53	8,012
REALTY INCOME CORP	20	34	1,806	270,956
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5	8	624	93,712
KITE REALTY GROUP TRUST	7	10	223	33,511
EXTRA SPACE STORAGE INC	4	10	1,300	195,076
CUBESMART	7	10	420	63,122
DIGITAL REALTY TRUST INC	9	14	1,965	294,744
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	6	9	82	12,374
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20	28	132	19,906
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6	9	97	14,589
URSTADT BIDDLE - CL A	1	—	—	—
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1	3	8	1,339
DOUGLAS EMMETT INC	5	8	101	15,212
IRON MOUNTAIN INC	9	14	873	130,947
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	3	6	40	6,128
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	4	6	36	5,519
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	4	5	67	10,066
TERRENO REALTY CORP	2	4	226	33,980
RLJ LODGING TRUST	5	8	83	12,528
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1	2	40	6,084
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4	6	75	11,318
CHATHAM LODGING TRUST	1	1	16	2,519
STAG INDUSTRIAL INC	5	8	319	47,954
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4	4	28	4,263

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千□	千□	千米ドル	千円
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1	1	9	1,486
EQUINIX INC	3	4	3,497	524,450
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPOR	12	18	260	39,022
SABRA HEALTH CARE REIT INC	7	11	160	24,061
WHITESTONE REIT	1	1	21	3,155
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1	2	283	42,484
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9	15	547	82,066
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1	3	38	5,755
PHYSICIANS REALTY TRUST	6	11	130	19,583
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	5	10	469	70,475
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	4	6	276	41,485
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	4	5	48	7,330
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	8	12	575	86,347
BRAEMAR HOTELS AND RESORTS INC	1	2	5	838
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	10	14	312	46,896
CARETRUST REIT INC	3	4	109	16,432
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	7	11	144	21,702
STORE CAPITAL CORP	9	-	-	-
PARAMOUNT GROUP INC	5	6	29	4,432
URBAN EDGE PROPERTIES	4	5	86	12,951
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	2	4	50	7,630
XENIA HOTELS & RESORTS INC	3	5	63	9,562
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3	4	134	20,216
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.720	1	32	4,894
APPLE HOSPITALITY REIT INC	7	10	172	25,861
CITY OFFICE REIT INC	1	1	8	1,253
GLOBAL NET LEASE INC	4	9	80	12,067
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2	4	94	14,137
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.490	1	29	4,406
FARMLAND PARTNERS INC	1	2	28	4,264
MANULIFE US REAL ESTATE INV	59	76	7	1,095
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	7	9	140	21,142
INVITATION HOMES INC	19	27	934	140,055
JBG SMITH PROPERTIES	3	4	66	9,977
ALEXANDER & BALDWIN INC	2	3	58	8,771
CLIPPER REALTY INC	0.093	0.093	0.451	67
GLADSTONE LAND CORP	0.938	1	23	3,485
GLOBAL MEDICAL REIT INC	2	2	23	3,539
VICI PROPERTIES INC	32	48	1,397	209,555
AMERICOLD REALTY TRUST	8	12	338	50,743
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2	2	6	968

ニッセイ先進国リート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
(アメリカ)	千□	千□	千米ドル	千円
BRT APARTMENTS CORP	0.345	0.345	5	897
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.857	1	106	15,898
SAFEHOLD INC	0.586	—	—	—
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	3	—	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	5	7	165	24,886
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1	1	28	4,238
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20	20	0.020	3
PRIME US REIT	11	33	5	806
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	15	39	11	1,658
APARTMENT INCOME REIT CO	5	7	223	33,448
NETSTREIT CORP	1	3	48	7,213
CTO REALTY GROWTH INC	0.453	1	21	3,212
BROADSTONE NET LEASE INC-A	5	9	141	21,214
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	0.337	0.337	5	809
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	0.629	1	3	485
INDUS REALTY TRUST INC	0.103	—	—	—
POSTAL REALTY TRUST INC- A	0.399	1	18	2,700
ORION OFFICE REIT INC	1	2	12	1,926
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	3	5	199	29,847
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	0.610	1	27	4,093
INVENTRUST PROPERTIES CORP	2	3	78	11,713
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	14	39	22	3,359
BLUEROCK HOMES TRUST INC	0.147	—	—	—
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	—	1	12	1,840
PEAKSTONE REALTY TRUST	—	1	31	4,674
UNITI GROUP INC	—	12	66	9,972
NET LEASE OFFICE PROPERT-W/I	—	0.688	10	1,632
小計	□数・金額	839	1,278	45,655
	銘柄数<比率>	145	142	—
				<73.7%>
(カナダ)			千カナダ・ドル	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.900	1	68	7,507
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM	2	3	79	8,644
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2	4	181	19,774
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTM	1	1	9	993
H&R REAL ESTATE INVESTMNT-UTS	4	5	49	5,391
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4	7	124	13,591
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2	3	56	6,136
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2	2	13	1,459
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	1	3	41	4,492
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2	6	28	3,074
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1	3	44	4,829

ニッセイ先進国リートインデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1	1	108	11,889
CHOICE PROPERTIES REIT	3	6	90	9,908
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	0.200	1	19	2,156
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1	2	37	4,141
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4	6	78	8,610
SLATE GROCERY REIT	1	1	18	1,996
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2	2	38	4,242
SLATE OFFICE REIT	2	—	—	—
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	2	—	—	—
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	0.900	0.900	1	130
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1	1	19	2,107
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4	4	65	7,135
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	0.800	—	—	—
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	—	7	20	2,200
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	2	—	—	—
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	2	—	—	—
NEXUS INDUSTRIAL REIT	0.800	0.800	5	650
PRIMARIS REIT	1	2	27	2,968
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	2	2	11	1,306
小計	□数・金額	61	82	1,238
	銘柄数<比率>	29	25	—
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル	
GPT GROUP	67	91	381	37,238
GOODMAN GROUP	57	82	1,902	185,605
STOCKLAND	83	115	458	44,777
BWP TRUST	13	24	86	8,432
MIRVAC GROUP	131	190	390	38,077
CHARTER HALL RETAIL REIT	17	28	92	9,019
ABACUS GROUP	14	14	15	1,476
VICINITY CENTRES	131	190	351	34,319
CHARTER HALL GROUP	16	23	247	24,168
CROMWELL PROPERTY GROUP	40	100	43	4,210
REGION RE LTD	39	59	128	12,491
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	10	11	26	2,549
INGENIA COMMUNITIES GROUP	11	17	76	7,425
GDI PROPERTY GROUP	14	14	8	780
DEXUS INDUSTRIA REIT	10	11	29	2,871
NATIONAL STORAGE REIT	36	61	134	13,092
SCENTRE GROUP	175	256	681	66,535
ARENA REIT	9	17	58	5,664
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	11	12	32	3,207

ニッセイ先進国リート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
(オーストラリア)		千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L		5	10	28	2,770
WAYPOINT REIT LTD		24	35	85	8,298
CHARTER HALL LONG WALE REIT		23	35	121	11,818
RURAL FUNDS GROUP		14	14	27	2,709
CENTURIA OFFICE REIT		17	18	23	2,271
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		21	24	76	7,480
CENTURIA CAPITAL GROUP		28	31	44	4,366
HOMECO DAILY NEEDS REIT		56	92	105	10,330
DEXUS/AU		35	52	378	36,965
HMC CAPITAL LTD		7	12	62	6,084
HEALTHCO REIT		12	22	31	3,031
ABACUS STORAGE KING		—	14	16	1,567
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,137	1,687	6,145	599,635
(香港)				千香港ドル	
CHAMPION REIT		50	89	223	4,295
LINK REIT		68	122	4,885	93,950
PROSPERITY REIT		—	98	131	2,525
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR		38	113	132	2,542
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		15	60	127	2,446
FORTUNE REIT		30	72	345	6,645
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	201	554	5,845	112,405
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
CAPITALAND ASCENDAS REIT		106	174	487	54,356
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		169	247	460	51,367
KEPPEL REIT		63	100	85	9,511
SUNTEC REIT		70	107	119	13,383
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		106	163	258	28,821
STARHILL GLOBAL REIT		42	82	40	4,526
CAPITALAND ASCOTT TRUST		63	112	102	11,437
FRASERS CENTREPOINT TRUST		37	53	116	13,047
ESR-LOGOS REIT		213	323	96	10,815
CDL HOSPITALITY TRUSTS		37	42	43	4,800
CAPITALAND CHINA TRUST		50	56	46	5,155
AIMS APAC REIT		22	37	48	5,398
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		29	—	—	—
PARKWAY LIFE REAL ESTATE		7	18	66	7,427
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		61	96	218	24,363
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR		64	107	148	16,582
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		26	60	38	4,298

ニッセイ先進国リート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
(シンガポール)		千□	千□	千シンガポール・ドル	千円
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		52	—	—	—
PARAGON REIT		16	60	50	5,651
KEPPEL DC REIT		36	67	125	13,978
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T		95	144	155	17,388
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		5	43	30	3,396
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		59	67	38	4,330
EC WORLD REIT		—	17	4	556
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST		32	—	—	—
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,470	2,184	2,783	310,596
		24	22	—	<3.3%>
(ニュージーランド)				千ニュージーランド・ドル	
KIWI PROPERTY GROUP LTD		33	74	61	5,538
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		27	61	71	6,451
GOODMAN PROPERTY TRUST		23	50	104	9,431
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		14	—	—	—
ARGOSY PROPERTY LTD		34	39	44	3,976
STRIDE PROPERTY GROUP		15	—	—	—
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	149	225	282	25,398
		6	4	—	<0.3%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		29	44	163	30,477
HAMMERSON PLC		134	182	49	9,226
LAND SECURITIES GROUP PLC		25	36	237	44,275
SEGRO PLC		41	60	498	93,101
WORKSPACE GROUP PLC		4	5	31	5,973
INTU PROPERTIES PLC		19	19	0.020	3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		39	66	65	12,262
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		7	11	48	9,075
SHAFTESBURY PLC		8	—	—	—
BIG YELLOW GROUP PLC		5	8	89	16,688
DERWENT LONDON PLC		3	4	110	20,600
SHAFTESBURY CAPITAL PLC		27	86	106	19,919
INVISTA FOUNDATION PROPERTY		6	30	13	2,427
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		32	48	88	16,517
TRITAX BIG BOX REIT PLC		60	90	138	25,850
SAFESTORE HOLDINGS PLC		7	10	82	15,419
ASSURA PLC		88	142	64	12,064
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		16	31	29	5,451
REGIONAL REIT LTD		15	23	7	1,337
NEWRIVER REIT PLC		6	14	12	2,325

ニッセイ先進国リート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
(イギリス)		千□	千□	千イギリス・ポンド	千円
UNITE GROUP PLC		13	19	189	35,336
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		14	—	—	—
LXI REIT PLC		60	87	85	15,990
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		10	10	8	1,627
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		28	30	17	3,252
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		11	11	7	1,417
PICTON PROPERTY INCOME LTD		13	26	17	3,347
AEW UK REIT PLC		3	11	11	2,133
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU		25	28	19	3,592
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		32	66	54	10,262
CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT P		5	23	21	3,974
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIM		9	20	9	1,855
HOME REIT PLC		24	24	0.002	0.457
PRS REIT PLC/THE		21	24	20	3,841
URBAN LOGISTICS REIT PLC		15	18	21	3,979
WAREHOUSE REIT PLC		17	17	14	2,729
CLS HOLDINGS PLC		—	8	8	1,575
HELICAL PLC		—	5	12	2,379
TARGET HEALTHCARE REIT PLC		—	34	29	5,498
LIFE SCIENCE REIT PLC		—	22	14	2,737
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	892	1,408	2,402	448,531
(イスラエル)				千イスラエル・シケル	
REIT 1 LTD		5	9	139	5,626
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		5	10	83	3,356
MENIVIM- THE NEW REIT LTD		23	32	48	1,969
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	34	51	271	10,952
		3	3	—	<0.1%>
(ユーロ/アイルランド)				千ユーロ	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		6	21	21	3,471
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	6	21	21	3,471
		1	1	—	<0.0%>
(ユーロ/オランダ)					
WERELDHAVE NV		1	1	25	4,155
VASTNED RETAIL NV		0.513	0.513	9	1,610
NSI NV		0.299	1	19	3,158
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		1	1	40	6,559
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	3	5	94	15,483
		4	4	—	<0.2%>

ニッセイ先進国リート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/ベルギー)		千□	千□	千ユーロ	千円
COFINIMMO		0.914	1	108	17,703
RETAIL ESTATES		0.211	0.499	31	5,230
INTERVEST OFFICES AND WAREHOUSES		0.773	0.799	16	2,678
WAREHOUSES DE PAUW SCA		4	7	197	32,245
AEDIFICA		1	2	136	22,281
XIOR STUDENT HOUSING NV		0.383	1	47	7,784
MONTEA NV		0.231	0.751	53	8,732
CARE PROPERTY INVEST		—	1	22	3,722
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	7	17	613	100,378
		7	8	—	<1.1%>
(ユーロ/フランス)					
KLEPIERRE		6	9	221	36,250
GECINA SA		1	2	244	40,012
COVIVIO		1	2	105	17,182
MERCIALYS		2	4	39	6,539
ICADE		0.966	1	50	8,289
ALTAREA		0.195	0.208	14	2,394
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3	5	281	46,077
CARMILA		1	2	41	6,753
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	19	28	999	163,499
		8	8	—	<1.8%>
(ユーロ/ドイツ)					
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		0.508	—	—	—
HAMBORNER REIT AG		—	4	28	4,673
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	0.508	4	28	4,673
		1	1	—	<0.1%>
(ユーロ/スペイン)					
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		1	3	19	3,268
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		10	16	147	24,125
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		8	13	78	12,806
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	20	33	245	40,199
		3	3	—	<0.4%>
(ユーロ/イタリア)					
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		1	1	2	400
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1	1	2	400
		1	1	—	<0.0%>
ユーロ計	□数・金額 銘柄数<比率>	59	111	2,006	328,108
		25	26	—	<3.5%>
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	4,847	7,584	—	8,817,010
		303	297	—	<94.9%>

(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。

(注2) 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3) □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
外国		百万円	百万円
	DOW JONES U.S. REAL ESTATE INDEX	397	—
	THE STOXX 600 REAL ESTATE INDEX	53	—

(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	898	0.0
投資信託証券	8,817,010	94.0
コール・ローン等、その他	563,862	6.0
投資信託財産総額	9,381,771	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・シェケル40.328円、1ユーロ163.54円です。

(注2) 外貨建純資産 (9,045,847千円) の投資信託財産総額 (9,381,771千円) に対する比率は96.4%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	9,728,737,025円
コール・ローン等	357,301,076
株式(評価額)	898,341
投資信託証券(評価額)	8,817,010,783
未収入金	379,118,898
未収配当金	12,866,575
差入委託証拠金	161,541,352
(B)負債	434,459,848
未払金	352,836,280
未払解約金	81,623,291
その他未払費用	277
(C)純資産総額(A-B)	9,294,277,177
元本	6,248,675,491
次期繰越損益金	3,045,601,686
(D)受益権総口数	6,248,675,491口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,874円

(注1) 期首元本額 4,144,508,902円
期中追加設定元本額 2,938,566,020円
期中一部解約元本額 834,399,431円

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

ニッセイ先進国リートインデックスファンド
(適格機関投資家限定) 1,674,789,330円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランス
ファンド(6資産均等型) 239,219,115円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)
25,900,702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)
9,414,551円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランス
ファンド(8資産均等型) 53,976,772円
ニッセイ海外リートインデックス(為替ヘッジあり)
(ラップ専用) 53,464,777円
ニッセイ海外リートインデックス(為替ヘッジなし)
(ラップ専用) 2,047,968,511円
FWニッセイ先進国リートインデックス 10,622,530円
DCニッセイ先進国リートインデックス 2,133,319,203円

損益の状況

当期(2022年11月22日~2023年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	292,302,853円
受取配当金	289,084,682
受取利息	1,262,567
受取の他収益	2,015,027
受取の他利益	59,423
(B)有価証券売買損益	132,255,436
売却益	967,466,655
買入損	835,211,219
(C)先物取引等損益	△ 16,186,065
取引引損	34,744,055
取引引益	△ 50,930,120
(D)信託報酬等	△ 9,690,975
(E)当期損益金(A+B+C+D)	398,681,249
(F)前期繰越損益金	1,752,061,386
(G)追加信託差損益金	1,249,986,926
(H)解約差損益金	△ 355,127,875
(I)合計(E+F+G+H)	3,045,601,686
次期繰越損益金(I)	3,045,601,686

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の
評価換えによる損益を含みます。

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

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

・ T O P I X（東証株価指数）（配当込み）

T O P I X（東証株価指数）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

・ M S C I エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

・ 東証 R E I T 指数（配当込み）

東証 R E I T 指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。J P X は、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。J P X は、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P X により提供、保証または販売されるものではありません。J P X は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。J P X は、ニッセイアセットマネジメント株式会社または当ファンドの購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、J P X は当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

- ・ S & P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）
S & P先進国REITインデックス（除く日本）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスがニッセイアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、同インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。