

第7期末 (2021年11月22日)

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 14,515円 |
| 純資産総額 | 169億円 |
| 騰落率 | 16.1% |
| 分配金 | 0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)

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:2020年11月21日～2021年11月22日

第7期(決算日 2021年11月22日)

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

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「<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)」は、このたび第7期の決算を行いました。

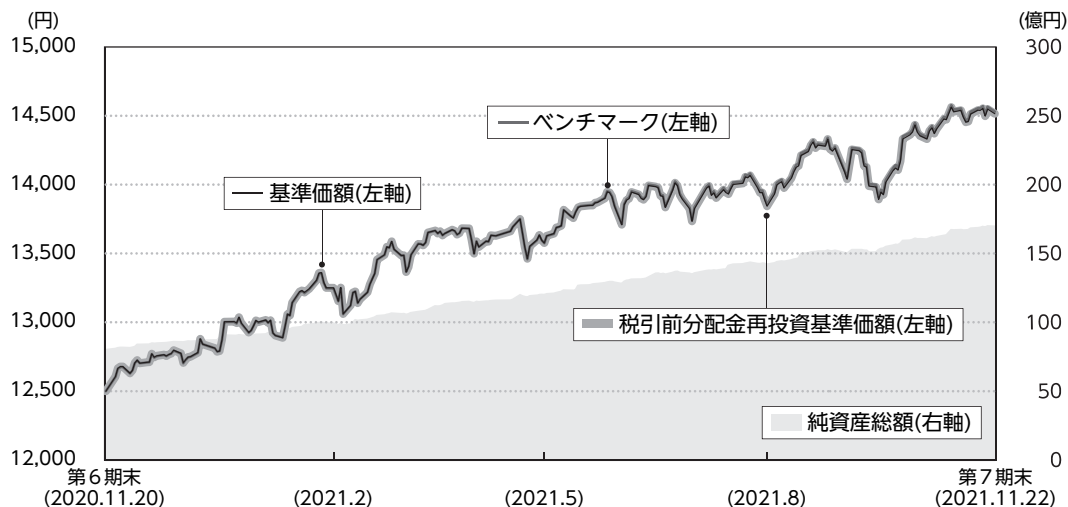
当ファンドは、投資対象の異なる4つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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。

運用経過

2020年11月21日～2021年11月22日

基準価額等の推移



| | | | |
|------|---------|-----------------|-------|
| 第7期首 | 12,499円 | 既払分配金 | 0円 |
| 第7期末 | 14,515円 | 騰落率 (分配金再投資ベース) | 16.1% |

- (注1) 税引前分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) ベンチマークは、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）を25%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

当期の基準価額は期を通じてみると金利が上昇（債券価格は下落）したことや、９月後半に米国における早期利上げ観測等を背景とした株式市場の下落が下落要因となりましたが、国内株式市場や主要な海外株式市場が上昇したことなどが上昇要因となり、前期末と比較すると上昇して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 | 25.0% | 25.0% | 20.8% |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 25.0 | 25.0 | △ 0.2 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 25.0 | 25.0 | 42.4 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 25.0 | 24.9 | 5.2 |

(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7期 | | 項目の概要 |
|------------|------|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 21円 | 0.155% | $\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ <p>期中の平均基準価額は13,651円です。</p> |
| (投信会社) | (9) | (0.066) | ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価 |
| (販売会社) | (9) | (0.066) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 |
| (受託会社) | (3) | (0.022) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価 |
| 売買委託手数料 | 0 | 0.001 | $\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ <p>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</p> |
| (株式) | (0) | (0.000) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (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 | 0 | 0.002 | $\text{有価証券取引税} = \text{期中の有価証券取引税} / \text{期中の平均受益権口数}$ <p>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</p> |
| (株式) | (0) | (0.002) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| その他費用 | 3 | 0.021 | $\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$ |
| (保管費用) | (2) | (0.013) | 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (監査費用) | (0) | (0.001) | 公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用 |
| (その他) | (1) | (0.007) | <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 | 24 | 0.178 | |

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

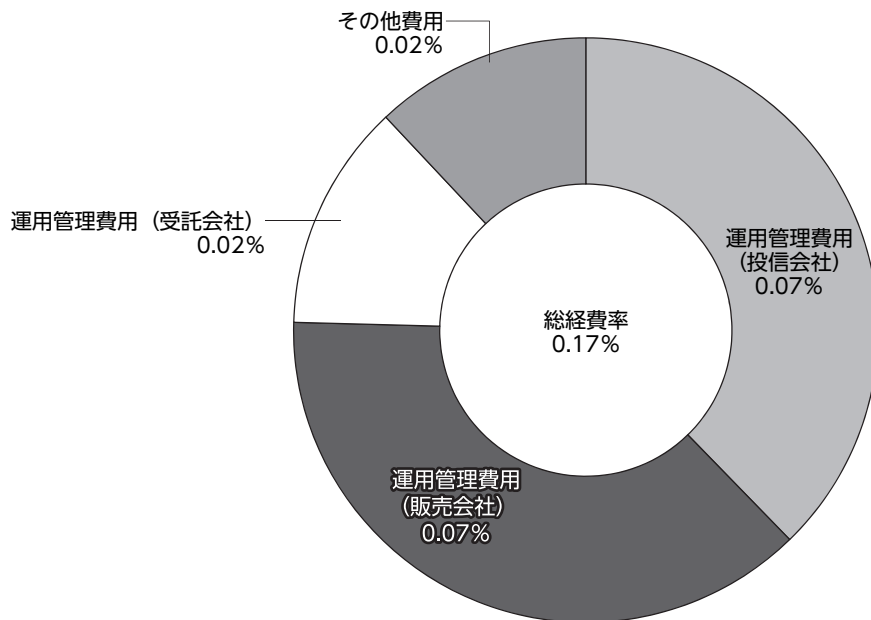
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

（参考情報）

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.17%**です。



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

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

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

投資環境

国内株式市況

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初以降、米大統領選で民主党のバイデン候補が当選を確実にしたことによる先行き不透明感の後退に加え、米追加経済対策や新型コロナウイルスのワクチン普及による景気回復期待を背景として世界的に株高基調となり、国内株式市場も上昇しましたが2月半ば以降は米長期金利の急上昇懸念などから下落しました。その後、米景気回復期待などから株価は反発する場面もありましたが、4月以降は同ウイルス感染拡大に伴う企業業績悪化懸念などからおおむね軟調に推移し、5月中旬には米国におけるインフレ懸念の台頭と長期金利の上昇を背景として急落する場面もありました。

5月下旬以降は金利上昇が一服したことやワクチン接種の進展による経済活動正常化への期待感の高まりを背景として上昇し、その後はおおむね横ばいとなりましたが8月中旬には感染力が強い新型コロナウイルスの変異株（デルタ型）の世界的な感染拡大による景気減速懸念が強まり下落しました。

9月に入ると新型コロナウイルスの感染者数減少に伴う経済活動再開への期待感から急上昇し、その後、インフレ圧力の高まりによる米連邦準備制度理事会（FRB）の早期利上げ観測に加えて、中国における不動産業界の債務問題などから下落しましたが、10月には円安の進行や良好な米経済指標を好感し上昇に転じました。その後も衆議院選挙の結果による政局不安後退や米国の早期利上げ観測後退などから株価はおおむね堅調に推移し、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

国内債券市況

当期の10年国債金利は上昇しました。

期初は新型コロナウイルスの感染再拡大を背景に経済活動が制限されたことなどから金利は低下しましたが、1月中旬以降は日銀が3月の政策点検で長期金利の変動幅の再拡大を検討しているとの報道を受けて上昇し、その後も米長期金利の上昇や巨額の財政出動による米景気回復期待に支えられ大きく上昇する展開となりました。3月上旬には首都圏における緊急事態宣言の再延長などから金利は大きく低下しましたが、日銀が3月末に長期国債買い入れオペ（公開市場操作）の減額方針を公表したことを受けて上昇しました。

4月下旬には同ウイルスの感染再拡大などを背景に金利は低下し、その後も株式市場低迷等の影響から低下基調となりました。8月になると長期金利の水準がゼロ近傍まで低下したことで下げ渋る展開となり、FRB副議長がテーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）に言及したこと、米金利の上昇とともに国内金利も上昇しました。9月以降も米金利の上昇が継続したことに加え、自民党総裁選において積極財政に伴う国債増発懸念が高まったことなどから金利は上昇傾向となりました。衆議院選挙後には国債増発への過度な懸念が後退したことなどから低下しましたが、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

■海外株式市況

当期の海外株式市場は、期初以降、米追加経済対策や新型コロナウイルスに対する懸念の後退、堅調な企業業績を背景に上昇基調で推移しました。2月から3月の米債券市場における金利上昇、9月のデルタ型による感染拡大やサプライチェーン（供給網）問題による業績懸念等から株価は下落する場面もありましたが、その後は堅調な企業業績を背景に反発し、結局、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

■海外債券市況

当期の米国10年国債金利は、1月から3月にかけて米追加経済対策や新型コロナウイルスワクチン接種の進展による経済活動正常化への期待感、国債増発やインフレ加速懸念から大きく上昇しました。その後、5月から7月にかけてはFRBが早期のテーパリングに慎重な姿勢を示したことで金利は低下基調となりました。9月から10月にかけては原油価格の高騰を背景にインフレ懸念が高まり金融政策正常化が意識され再び金利は上昇し、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初から5月にかけて欧州域内におけるワクチン接種の進展やインフレ加速懸念から上昇基調となりました。8月にかけては欧州中央銀行（ECB）が金融緩和を継続する姿勢を示したことで低下基調となりましたが、9月以降はECBが金融政策正常化に向かうとの見方から再度金利は上昇し、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

■為替市況

当期の米ドル／円レートは上昇しました。期初以降、米ドルは対円でおおむね横ばいで推移した後、3月にかけては米追加経済対策や新型コロナウイルスワクチン接種の進展による経済活動正常化への期待感から大きく上昇しました。その後、9月中旬まではおおむね横ばい圏で推移しましたが、9月下旬から10月にかけてFRBの金融政策正常化観測の高まりを背景とした金利上昇を受けて米ドル高円安となりました。その後は金利上昇が止まったことで米ドルの上昇は止まりましたが、高値圏で横ばい推移となりました。

当期のユーロ／円レートは上昇しました。期初から5月にかけてワクチン接種の進展や良好な経済指標などをを受けてユーロは対円で上昇基調となりました。その後はECBがコロナ危機に対応する資産購入の特別枠（PEPP）の購入ペース維持等の金融緩和姿勢を示したことからユーロ安に転じました。10月には欧州域内の景気回復やインフレ加速を背景にユーロ高に転じる場面もありましたが、感染力が強いデルタ型への懸念から当期末にかけては急速にユーロ安が進行しました。

ポートフォリオ

■当ファンド

投資対象の異なる4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市場および債券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。

<ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

国内の公社債に投資することにより、ベンチマークであるN O M U R A - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

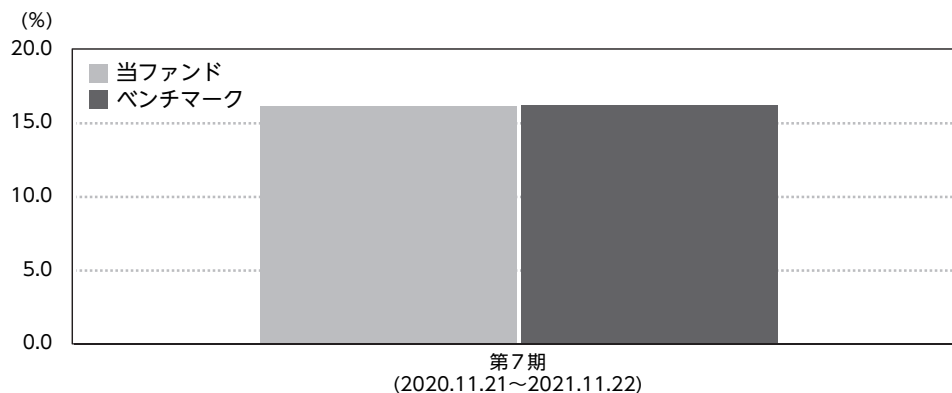
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークであるM S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く主要国の国債に投資することにより、ベンチマークであるF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

* 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+16.1%となり、ベンチマーク騰落率（+16.3%）にほぼ連動しました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金

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

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

【分配原資の内訳（1万口当たり）】

| 項目 | 当期 2020年11月21日~2021年11月22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 | 4,514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4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市場および債券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す。

<ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

国内の公社債に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

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

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■組入ファンド

| | 第7期末 2021年11月22日 |
|---------------------------|---------------------|
| ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド | 25.0% |
| ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド | 25.0 |
| ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド | 25.0 |
| ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド | 24.9 |

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

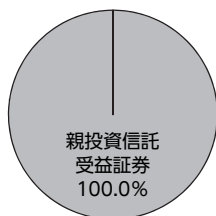
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

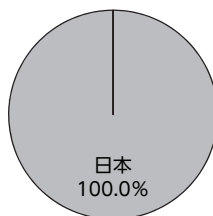
| 項目 | 第7期末 2021年11月22日 |
|------------|---------------------|
| 純資産総額 | 16,944,062,410円 |
| 受益権総口数 | 11,673,573,356口 |
| 1万口当たり基準価額 | 14,515円 |

(注) 当期間中における追加設定元本額は6,799,934,192円、同解約元本額は1,512,982,271円です。

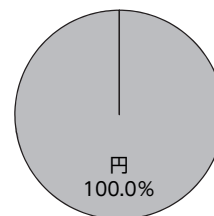
■資産別配分



■国別配分



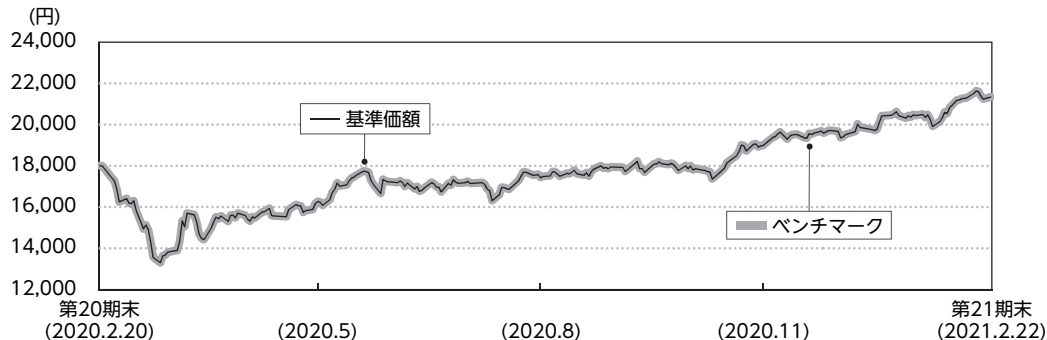
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2021年11月22日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



■ 上位銘柄

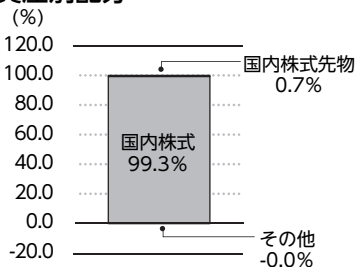
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------------------|----|-------|
| ソフトバンクグループ | 円 | 3.1% |
| トヨタ自動車 | 円 | 3.1 |
| ソニー | 円 | 2.8 |
| キーエンス | 円 | 2.1 |
| 任天堂 | 円 | 1.5 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 円 | 1.4 |
| リクルートホールディングス | 円 | 1.4 |
| 日本電産 | 円 | 1.3 |
| 信越化学工業 | 円 | 1.3 |
| 日本電信電話 | 円 | 1.2 |
| 組入銘柄数 | | 1,853 |

■ 1万口当たりの費用明細

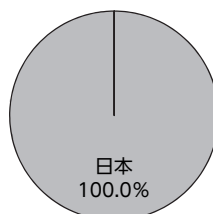
2020.2.21～2021.2.22

| 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 |

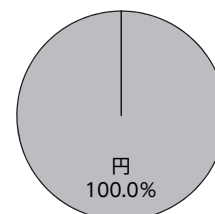
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



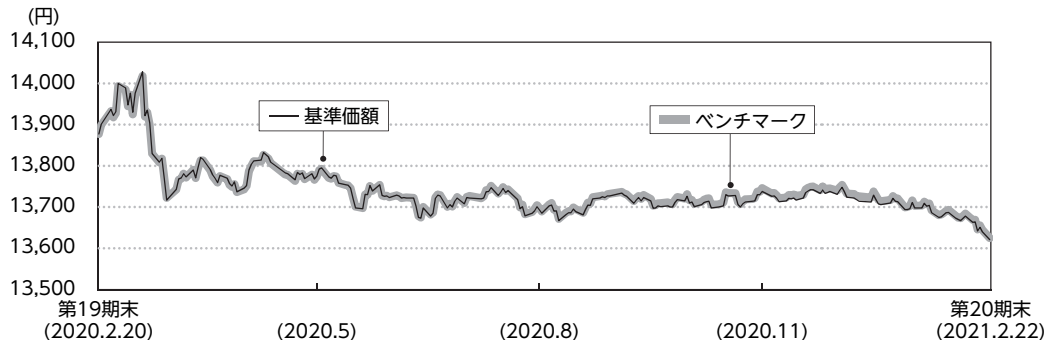
（注1）基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

（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（2021年2月22日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

ニッセイ国内債券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

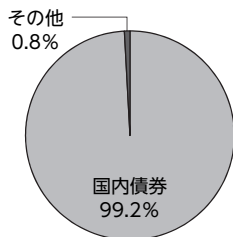
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-----------------|----|------|
| 第325回 利付国債（10年） | 円 | 7.5% |
| 第346回 利付国債（10年） | 円 | 7.5 |
| 第354回 利付国債（10年） | 円 | 7.5 |
| 第 4 回 利付国債（40年） | 円 | 7.4 |
| 第143回 利付国債（5年） | 円 | 7.3 |
| 第160回 利付国債（20年） | 円 | 6.1 |
| 第338回 利付国債（10年） | 円 | 5.9 |
| 第143回 利付国債（20年） | 円 | 5.7 |
| 第330回 利付国債（10年） | 円 | 4.4 |
| 第125回 利付国債（20年） | 円 | 3.5 |
| 組入銘柄数 | | 35 |

■ 1万口当たりの費用明細

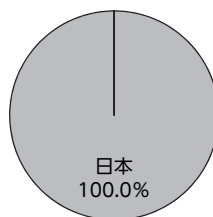
2020.2.21～2021.2.22

| 項目 | 金額 |
|----------------|-----------|
| その他費用 (その他) | 0円 (0) |
| 合計 | 0 |

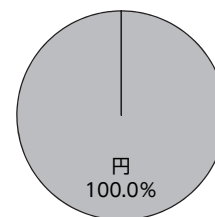
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



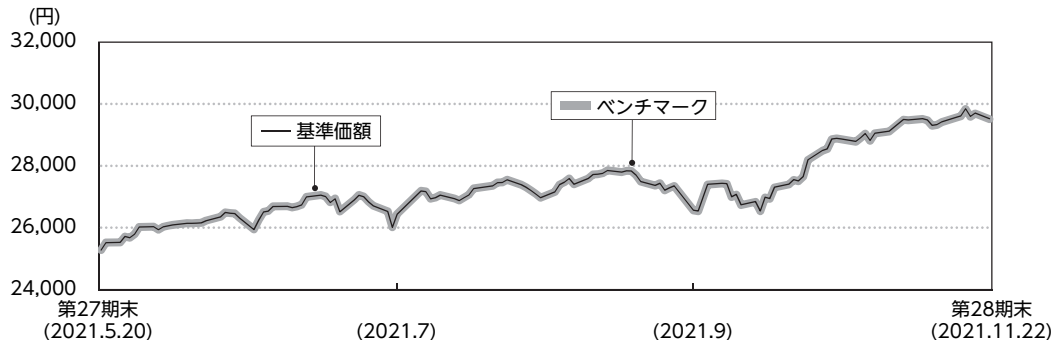
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2021年2月22日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

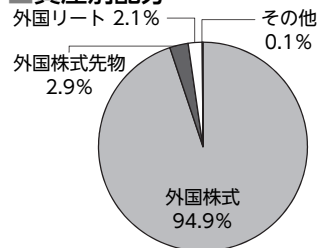
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|----------------------|-----|-------|
| APPLE INC | 米ドル | 4.5% |
| MICROSOFT CORP | 米ドル | 4.1% |
| AMAZON.COM INC | 米ドル | 2.8% |
| TESLA, INC. | 米ドル | 1.6% |
| ALPHABET INC-CL A | 米ドル | 1.5% |
| ALPHABET INC-CL C | 米ドル | 1.5% |
| META PLATFORMS INC-A | 米ドル | 1.4% |
| NVIDIA CORP | 米ドル | 1.4% |
| JPMORGAN CHASE & CO | 米ドル | 0.8% |
| HOME DEPOT INC | 米ドル | 0.7% |
| 組入銘柄数 | | 1,277 |

■ 1万口当たりの費用明細

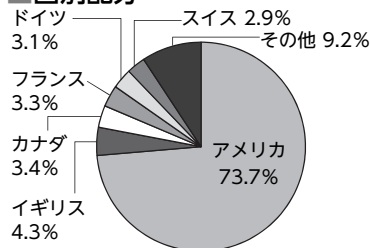
2021.5.21~2021.11.22

| 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 | 8 |
| (保管費用) | (3) |
| (その他) | (5) |
| 合計 | 9 |

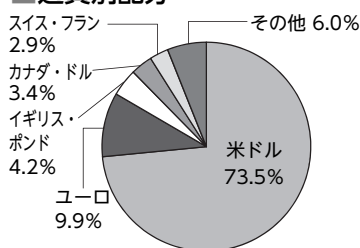
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



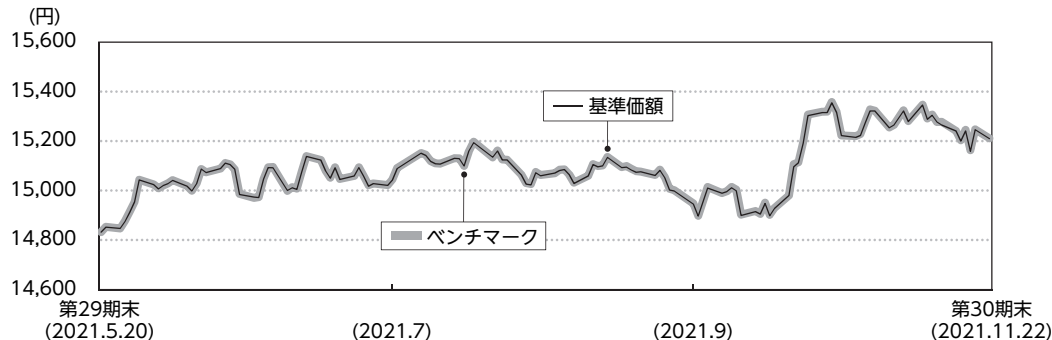
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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（2021年11月22日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

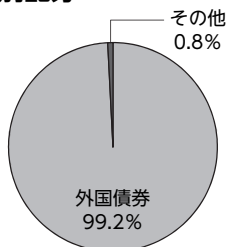
| 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|------------------------------|-----|------|
| US TREASURY 2.5% 2024/5/15 | 米ドル | 1.2% |
| US TREASURY 2.75% 2024/2/15 | 米ドル | 1.0% |
| US TREASURY 2.5% 2023/8/15 | 米ドル | 0.9% |
| US TREASURY 1.75% 2023/5/15 | 米ドル | 0.9% |
| US TREASURY 0.125% 2023/9/15 | 米ドル | 0.9% |
| US TREASURY 2.375% 2024/8/15 | 米ドル | 0.9% |
| US TREASURY 2.0% 2025/8/15 | 米ドル | 0.9% |
| US TREASURY 2.25% 2025/11/15 | 米ドル | 0.8% |
| US TREASURY 2.0% 2023/2/15 | 米ドル | 0.8% |
| US TREASURY 2.125% 2024/3/31 | 米ドル | 0.8% |
| 組入銘柄数 | | 695 |

■ 1万口当たりの費用明細

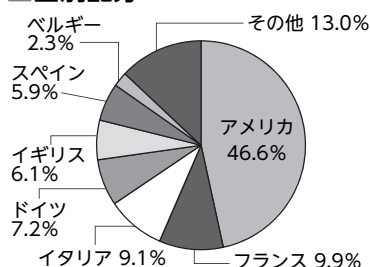
2021.5.21~2021.11.22

| 項目 | 金額 |
|--------------------------|------------------|
| その他費用 (保管費用) (その他) | 3円 (2) (0) |
| 合計 | 3 |

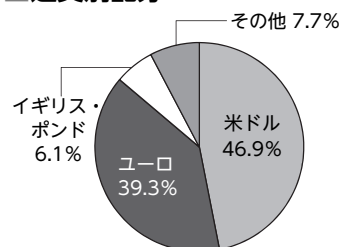
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2021年11月22日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 税引前 分配金 | 期中 騰落率 | (ご参考) | ベンチ マーク | 期中 騰落率 | 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 |
| 3期(2017年11月20日) | 11,255 | 0 | 13.4 | 11,255 | 11,410 | 13.8 | 47.8 | 1.2 | 49.5 | 0.6 | 1,788 |
| 4期(2018年11月20日) | 11,081 | 0 | △ 1.5 | 11,081 | 11,272 | △ 1.2 | 47.5 | 1.4 | 50.0 | 0.6 | 2,780 |
| 5期(2019年11月20日) | 11,825 | 0 | 6.7 | 11,825 | 12,050 | 6.9 | 48.2 | 1.3 | 49.3 | 0.7 | 4,559 |
| 6期(2020年11月20日) | 12,499 | 0 | 5.7 | 12,499 | 12,731 | 5.6 | 49.0 | 1.6 | 48.4 | 0.6 | 7,982 |
| 7期(2021年11月22日) | 14,515 | 0 | 16.1 | 14,515 | 14,800 | 16.3 | 48.0 | 1.6 | 49.6 | 0.5 | 16,944 |

(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 | 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)2020年11月20日 | 12,499 | - | 12,731 | - | 49.0 | 1.6 | 48.4 | 0.6 |
| 11月末 | 12,630 | 1.0 | 12,862 | 1.0 | 49.6 | 1.4 | 48.0 | 0.6 |
| 12月末 | 12,841 | 2.7 | 13,079 | 2.7 | 48.2 | 1.6 | 49.2 | 0.5 |
| 2021年1月1日 | 12,904 | 3.2 | 13,144 | 3.2 | 48.9 | 1.0 | 49.1 | 0.5 |
| 2月末 | 13,061 | 4.5 | 13,301 | 4.5 | 48.2 | 1.3 | 49.5 | 0.5 |
| 3月末 | 13,559 | 8.5 | 13,811 | 8.5 | 48.8 | 1.8 | 48.4 | 0.5 |
| 4月末 | 13,628 | 9.0 | 13,879 | 9.0 | 47.8 | 1.5 | 49.7 | 0.5 |
| 5月末 | 13,770 | 10.2 | 14,026 | 10.2 | 48.3 | 1.4 | 49.5 | 0.5 |
| 6月末 | 13,891 | 11.1 | 14,157 | 11.2 | 48.0 | 1.6 | 49.4 | 0.5 |
| 7月末 | 13,903 | 11.2 | 14,173 | 11.3 | 47.9 | 1.2 | 49.9 | 0.5 |
| 8月末 | 14,092 | 12.7 | 14,370 | 12.9 | 48.5 | 1.5 | 49.1 | 0.5 |
| 9月末 | 14,128 | 13.0 | 14,405 | 13.2 | 47.8 | 1.6 | 49.6 | 0.5 |
| 10月末 | 14,404 | 15.2 | 14,686 | 15.4 | 48.8 | 1.7 | 48.6 | 0.6 |
| (期末)2021年11月22日 | 14,515 | 16.1 | 14,800 | 16.3 | 48.0 | 1.6 | 49.6 | 0.5 |

(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

2020年11月21日～2021年11月22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 | 1,180,572 | 2,530,414 | 404,424 | 865,248 |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 2,128,449 | 2,917,253 | 457,240 | 626,596 |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 952,129 | 2,416,696 | 500,972 | 1,280,403 |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 1,804,497 | 2,690,446 | 377,839 | 561,959 |

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 当期 | |
|-------------------|---------------------------|---------------------------|
| | ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド | ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 106,659,945千円 | 90,016,841千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 150,462,148千円 | 375,888,387千円 |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.70 | 0.23 |

(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

2020年11月21日～2021年11月22日

当期における利害関係人との取引はありません。

| 親投資信託残高 | | 2021年11月22日現在 | | |
|-----------------------|-----------|---------------|-----------|--|
| 種類 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
| | 口数 | 口数 | 評価額 | |
| | 千口 | 千口 | 千円 | |
| ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド | 1,074,533 | 1,850,681 | 4,243,426 | |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 1,418,643 | 3,089,851 | 4,235,568 | |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 986,387 | 1,437,543 | 4,244,348 | |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 1,348,446 | 2,775,104 | 4,220,934 | |

(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52,189,089千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが40,629,319千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが174,007,653千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが30,507,939千口です。

| 投資信託財産の構成 | | 2021年11月22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 | 4,243,426 | 25.0 | |
| ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド | 4,235,568 | 25.0 | |
| ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド | 4,244,348 | 25.0 | |
| ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド | 4,220,934 | 24.9 | |
| コール・ローン等、その他 | 28,722 | 0.2 | |
| 投資信託財産総額 | 16,973,000 | 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22日における邦貨換算レートは、1米ドル114.10円、1カナダ・ドル90.18円、1オーストラリア・ドル82.49円、1香港ドル14.65円、1シンガポール・ドル83.73円、1ニュージーランド・ドル79.71円、1イギリス・ポンド153.36円、1イスラエル・シェケル36.874円、1スイス・フラン122.82円、1デンマーク・クローネ17.30円、1ノルウェー・クローネ12.77円、1スウェーデン・クローナ12.73円、1メキシコ・ペソ5.473円、1人民元17.842円、1マレーシア・リングギット27.243円、1ポーランド・ズロチ27.436円、1ユーロ128.67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(509,970,711千円)の投資信託財産総額(514,417,469千円)に対する比率は99.1%です。
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(46,312,944千円)の投資信託財産総額(46,579,409千円)に対する比率は99.4%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

(2021年11月22日現在)

| 項目 | 当期末 |
|--------------------------------|------------------------|
| (A)資産 | 16,973,000,765円 |
| コーポレート債券等 | 10,973,360 |
| ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額) | 4,243,426,916 |
| ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額) | 4,235,568,931 |
| ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額) | 4,244,348,550 |
| ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額) | 4,220,934,259 |
| 未収入金 | 17,748,749 |
| (B)負債 | 28,938,355 |
| 未払解約金 | 17,533,403 |
| 未払信託報酬 | 11,324,143 |
| その他未払費用 | 80,809 |
| (C)純資産総額(A-B) | 16,944,062,410 |
| 元本 | 11,673,573,356 |
| 次期繰越損益金 | 5,270,489,054 |
| (D)受益権総口数 | 11,673,573,356口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,515円 |

| | |
|-----------|----------------|
| (注) 期首元本額 | 6,386,621,435円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,799,934,192円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,512,982,271円 |

損益の状況

当期(2020年11月21日～2021年11月22日)

| 項目 | 当期 |
|------------------------|----------------------|
| (A)配当等収益 | △ 3,028円 |
| 受取利息 | 128 |
| 支払利息 | △ 3,156 |
| (B)有価証券売買損益 | 1,616,202,877 |
| 売買益 | 1,732,723,550 |
| 売買損 | △ 116,520,673 |
| (C)信託報酬等 | △ 19,014,041 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | 1,597,185,808 |
| (E)前期繰越損益金 | 572,531,694 |
| (分配準備積立金) | (572,531,694) |
| (F)追加信託差損益金* | 3,100,771,552 |
| (配当等相当額) | (2,517,044,230) |
| (売買損益相当額) | (583,727,322) |
| (G)合計(D+E+F) | 5,270,489,054 |
| 次期繰越損益金(G) | 5,270,489,054 |
| 追加信託差損益金 | 3,100,771,552 |
| (配当等相当額) | (2,526,845,127) |
| (売買損益相当額) | (573,926,425) |
| 分配準備積立金 | 2,169,717,502 |

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

分配金の計算過程

| 項目 | 当期 |
|---------------------|----------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 192,087,671円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 1,405,098,137円 |
| (c) 信託約款に定める収益調整金 | 3,100,771,552円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金 | 572,531,694円 |
| (e) 分配対象額(a+b+c+d) | 5,270,489,054円 |
| (f) 分配対象額(1万口当たり) | 4,514.89円 |
| (g) 分配金 | 0円 |
| (h) 分配金(1万口当たり) | 0円 |

お知らせ

■関連会社の実質保有比率

2021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外国株式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6.4%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 | 無制限 | |
| 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市場および債券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 | <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) | 「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券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」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券 |
| | ニッセイ国内株式 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 |
| | ニッセイ国内債券 インデックスマザーファンド | 国内の公社債 |
| | 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 |
| | ニッセイ外国債券 インデックスマザーファンド | 日本を除く主要国の国債 |
| 運用方法 | <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) | 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25%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。 |
| | ニッセイ国内債券 インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに 限ります。 |
| | 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。 |
| | ニッセイ外国債券 インデックスマザーファンド | 以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得 に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とし ます。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |
| 分 配 方 針 | 毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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。 | |

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 21 期

(計算期間：2020年2月21日～2021年2月22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。



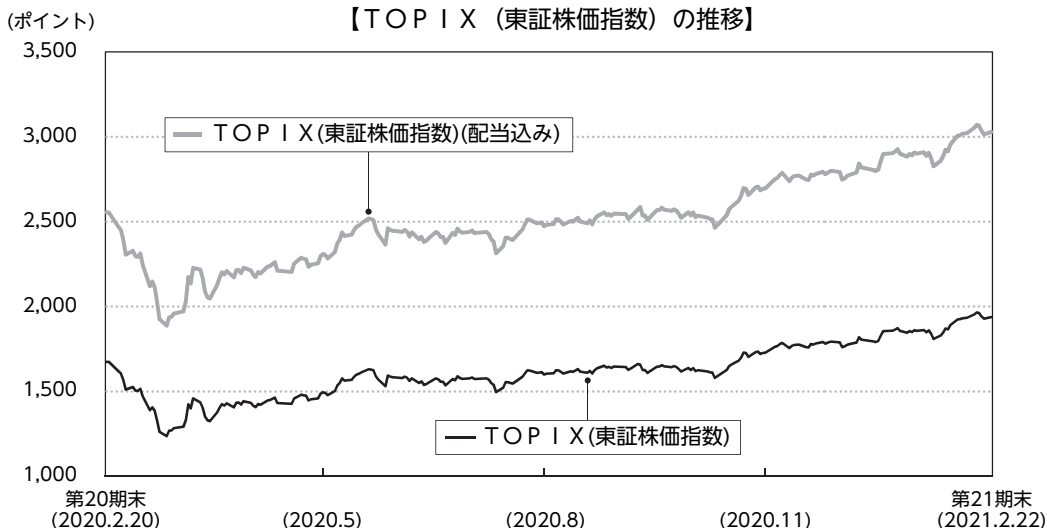
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2020年2月21日～2021年2月22日

国内株式市況



(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の国内株式市場は上昇しました。

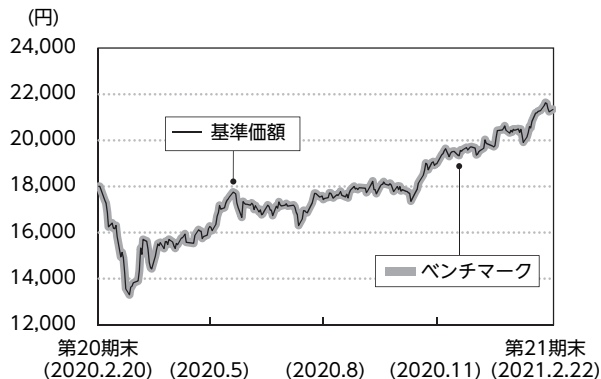
期初以降、中国で発生した新型コロナウイルスの感染拡大懸念から市場心理が大幅に悪化し、2020年3月中旬にかけて株価は大幅に下落しました。

その後、各国における緊急経済対策の発表や中央銀行の金融支援策の決定等を背景に株価は反発し、新型コロナウイルスの感染拡大に落ち着きが見られたことによる経済活動再開への期待感の高まりなどから6月上旬まで上昇基調となりました。

6月中旬には新型コロナウイルスの感染拡大第2波に対する警戒感や「香港国家安全維持法案」を巡る米中対立の懸念から株価は下落しました。7月には新型コロナウイルスの治療薬開発への期待感などを背景に上昇する場面もありましたが、感染拡大に歯止めがかからなかったことや米中対立の激化、加えて円高進行や企業業績の悪化が懸念され、株価は下落する展開となりました。8月に入ると米株高に加えて国内企業の第1四半期決算の内容や通期予想の下方修正が想定内であったこと、ワクチン開発への期待感などを背景に株価は反発し、その後はおおむね横ばいで推移しました。

11月以降は米大統領選において民主党のバイデン候補が当選を確実にしたことで先行き不透明感が後退したことや、ワクチン実用化への期待感から世界的な株高の流れが強まり、国内株式市場も上昇基調となりました。1月以降は国内における緊急事態宣言の再発令などを背景に株価は下落する場面もありましたが、米ジョージア州の上院決選投票の結果を受けて、バイデン次期政権下における追加経済対策への期待感が高まったことなどから株価は上昇基調となり、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

当期も東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

銘柄選択については、一部信用不安銘柄を投資ユニバースから除外した後、層化抽出法にて行いました（市場での組入比率が大きな銘柄については、ベンチマークとの連動性を高めるために、信用不安銘柄であっても組み入れを行いました）。

また資金の流出入などに対応するため、TOPIX（東証株価指数）先物も一部利用しました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+18.5%となり、ベンチマーク騰落率（+18.6%）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 | % | | % | % | | | |
| 17期(2017年2月20日) | 15,544 | | 21.6 | 15,699 | | 21.7 | 97.7 | 2.3 | 40,998 |
| 18期(2018年2月20日) | 18,076 | | 16.3 | 18,261 | | 16.3 | 98.2 | 1.9 | 50,868 |
| 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 |

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | | ベンチマーク | 騰落率 | | 株式組入比率 | 株式先物比率 |
|----------------|--------|-----|------|--------|-----|------|--------|--------|
| | | 円 | % | | % | % | | |
| (期首)2020年2月20日 | 18,004 | | — | 18,182 | | — | 98.3 | 1.6 |
| 2月末 | 16,251 | △ | 9.7 | 16,410 | △ | 9.7 | 97.9 | 1.8 |
| 3月末 | 15,273 | △ | 15.2 | 15,427 | △ | 15.2 | 96.7 | 3.7 |
| 4月末 | 15,931 | △ | 11.5 | 16,098 | △ | 11.5 | 95.9 | 4.2 |
| 5月末 | 17,014 | △ | 5.5 | 17,195 | △ | 5.4 | 95.4 | 5.6 |
| 6月末 | 16,986 | △ | 5.7 | 17,163 | △ | 5.6 | 98.3 | 1.7 |
| 7月末 | 16,304 | △ | 9.4 | 16,472 | △ | 9.4 | 97.2 | 2.7 |
| 8月末 | 17,635 | △ | 2.0 | 17,818 | △ | 2.0 | 96.7 | 3.2 |
| 9月末 | 17,860 | △ | 0.8 | 18,050 | △ | 0.7 | 96.1 | 3.9 |
| 10月末 | 17,352 | △ | 3.6 | 17,538 | △ | 3.5 | 96.0 | 4.0 |
| 11月末 | 19,290 | | 7.1 | 19,492 | | 7.2 | 96.7 | 3.3 |
| 12月末 | 19,863 | | 10.3 | 20,070 | | 10.4 | 96.7 | 3.4 |
| 2021年1月末 | 19,909 | | 10.6 | 20,117 | | 10.6 | 98.3 | 1.7 |
| (期末)2021年2月22日 | 21,336 | | 18.5 | 21,558 | | 18.6 | 99.3 | 0.7 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2020年2月21日～2021年2月22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) | 0.002% (0.000) (0.002) | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 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 | 0.002 | |

(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（17,705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

2020年2月21日～2021年2月22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 |
| | | 43,919 | 71,806,619 | 3,992 | 6,940,146 |
| | | (△ 6,715) | | | |

(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 | 33,249 | 34,694 | - | - |

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2020年2月21日～2021年2月22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 |
| トヨタ自動車 | 374 | 2,423,034 | 6,470 | NTTドコモ | 443 | 1,705,218 | 3,843 |
| ソニー | 223 | 1,442,267 | 6,444 | トヨタ自動車 | 45 | 338,103 | 7,382 |
| キーエンス | 37 | 1,398,831 | 37,806 | 日本電信電話 | 81 | 215,540 | 2,651 |
| ソフトバンクグループ | 275 | 1,142,633 | 4,145 | エムスリー | 23 | 210,146 | 9,097 |
| 日本電信電話 | 440 | 1,092,980 | 2,482 | 日立ハイテック | 20 | 161,636 | 7,962 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 2,375 | 1,017,404 | 428 | ソニーフィナンシャルホールディングス | 49 | 128,675 | 2,594 |
| 武田薬品工業 | 294 | 990,131 | 3,362 | 日立化成 | 27 | 125,435 | 4,611 |
| KDDI | 303 | 946,036 | 3,116 | ファミリーマート | 48 | 109,945 | 2,281 |
| 信越化学工業 | 67 | 796,653 | 11,750 | 三菱商事 | 45 | 108,153 | 2,382 |
| 任天堂 | 20 | 775,927 | 37,666 | バンダイナムコホールディングス | 11 | 103,653 | 9,092 |

(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

2021年2月22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 | 1 | 2 | 2 | 8,845 |
| 日本水産 | 38 | 80 | 80 | 40,360 |
| マルハニチロ | 5 | 13 | 13 | 33,728 |
| 雪国まいたけ | - | 5 | 5 | 9,547 |
| カネコ種苗 | 1 | 2 | 2 | 4,152 |
| サカタのタネ | 4 | 10 | 10 | 40,352 |
| ホクト | 2 | 7 | 7 | 15,658 |
| 鉱業(0.2%) | | | | |
| 住石ホールディングス | 12 | 2 | 2 | 297 |
| 日鉄鉱業 | 0.900 | 2 | 2 | 11,980 |
| 三井松島ホールディングス | 0.900 | 5 | 5 | 4,939 |
| 国際石油開発帝石 | 154 | 318 | 318 | 247,078 |
| 石油資源開発 | 5 | 11 | 11 | 25,300 |
| K&Oエナジーグループ | 1 | 4 | 4 | 6,148 |

| 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(2.3%) | | | | |
| ヒノキヤグループ | 1 | 2 | 2 | 4,601 |
| ショーボンドホールディングス | 6 | 12 | 12 | 58,652 |
| ミライト・ホールディングス | 11 | 30 | 30 | 51,360 |
| タマホーム | 2 | 5 | 5 | 9,869 |
| ファーストコーポレーション | 3 | 5 | 5 | 4,118 |
| ベステラ | 1 | - | - | - |
| スペースパリュールホールディングス | 4 | 10 | 10 | 8,628 |
| ダイセキ環境ソリューション | 1 | 3 | 3 | 2,707 |
| 安藤・間 | 23 | 55 | 55 | 43,401 |
| 東急建設 | 11 | 25 | 25 | 13,817 |
| コムシスホールディングス | 13 | 30 | 30 | 99,775 |
| ピーアールホールディングス | 4 | 10 | 10 | 6,976 |
| 高松コンストラクショングループ | 2 | 5 | 5 | 11,485 |
| 東建コーポレーション | 1 | 2 | 2 | 23,139 |

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 |
| ソネット | － | 5 | 4,243 |
| ヤマウラ | 1 | 4 | 4,288 |
| 大成建設 | 29 | 62 | 235,738 |
| 大林組 | 89 | 199 | 187,106 |
| 清水建設 | 90 | 187 | 153,024 |
| 飛鳥建設 | 2 | 5 | 6,378 |
| 長谷工コーポレーション | 34 | 65 | 88,687 |
| 松井建設 | 3 | 7 | 5,656 |
| 銭高組 | 0.400 | 1 | 4,575 |
| 鹿島建設 | 70 | 146 | 208,176 |
| 不動テトラ | 2 | 4 | 8,844 |
| 大末建設 | 1 | 5 | 4,630 |
| 鉄建建設 | 1 | 4 | 7,864 |
| 西松建設 | 6 | 14 | 37,122 |
| 三井住友建設 | 21 | 48 | 22,218 |
| 大豊建設 | 2 | 4 | 16,192 |
| 前田建設工業 | 22 | 50 | 49,999 |
| 佐田建設 | 4 | 9 | 4,099 |
| ナカノフドー建設 | 3 | 10 | 3,932 |
| 奥村組 | 4 | 11 | 29,502 |
| 東鉄工業 | 3 | 8 | 22,772 |
| 浅沼組 | 1 | 2 | 10,872 |
| 戸田建設 | 37 | 83 | 61,669 |
| 熊谷組 | 4 | 9 | 26,040 |
| 北野建設 | 0.700 | 1 | 4,212 |
| 植木組 | 0.700 | 1 | 4,365 |
| 矢作建設工業 | 3 | 8 | 7,453 |
| ピーエス三菱 | 2 | 6 | 4,658 |
| 日本ハウスホールディングス | 6 | 13 | 4,569 |
| 大東建託 | 10 | 21 | 269,230 |
| 新日本建設 | 3 | 8 | 7,191 |
| NIPPPO | 7 | 16 | 46,728 |
| 東亜道路工業 | 0.600 | 1 | 4,968 |
| 前田道路 | 9 | 12 | 24,837 |
| 日本道路 | 0.900 | 1 | 15,219 |
| 東亜建設工業 | 2 | 5 | 11,501 |
| 日本国土開発 | 6 | 19 | 10,825 |
| 若築建設 | 1 | 3 | 4,597 |
| 東洋建設 | 10 | 22 | 12,387 |
| 五洋建設 | 35 | 84 | 67,495 |
| 世紀東急工業 | 4 | 9 | 8,544 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 福田組 | 1 | 2 | 11,546 |
| 住友林業 | 22 | 47 | 98,653 |
| 日本基礎技術 | 4 | 8 | 4,332 |
| 巴コーポレーション | 4 | 10 | 4,168 |
| 大和ハウス工業 | 88 | 184 | 590,720 |
| ライト工業 | 5 | 11 | 18,775 |
| 積水ハウス | 97 | 216 | 451,160 |
| 日特建設 | 2 | 5 | 4,239 |
| 北陸電気工事 | － | 3 | 4,172 |
| ユアテック | 5 | 11 | 9,302 |
| 日本リーテック | － | 4 | 10,474 |
| 四電工 | 0.700 | 1 | 4,206 |
| 中電工 | 3 | 9 | 20,341 |
| 関電工 | 12 | 32 | 28,730 |
| きんでん | 21 | 43 | 76,723 |
| 東京エネシス | 3 | 6 | 6,058 |
| トーエネック | 0.900 | 2 | 7,470 |
| 住友電設 | 2 | 5 | 13,630 |
| 日本電設工業 | 4 | 11 | 21,252 |
| 協和エクシオ | 13 | 30 | 82,476 |
| 新日本空調 | 2 | 5 | 12,031 |
| 九電工 | 6 | 14 | 47,460 |
| 三機工業 | 6 | 14 | 18,403 |
| 日揮ホールディングス | 27 | 66 | 90,378 |
| 中外炉工業 | 1 | 2 | 4,360 |
| ヤマト | 2 | 6 | 4,281 |
| 太平電業 | 2 | 4 | 11,717 |
| 高砂熱学工業 | 7 | 18 | 28,887 |
| 三晃金属工業 | 0.700 | 1 | 4,642 |
| 朝日工業社 | 0.600 | 1 | 4,515 |
| 明星工業 | 5 | 12 | 10,397 |
| 大気社 | 4 | 9 | 28,585 |
| ダイダン | 2 | 4 | 12,359 |
| 日比谷総合設備 | 2 | 6 | 12,019 |
| OSJBホールディングス | 14 | 29 | 7,944 |
| 東洋エンジニアリング | 3 | － | － |
| レイズネクスト | 4 | 10 | 12,593 |
| 食料品(3.3%) | | | |
| ニッポン | 8 | 18 | 30,088 |
| 日清製粉グループ本社 | 32 | 72 | 124,862 |
| 昭和産業 | 2 | 5 | 17,523 |

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 | 千株 | 千円 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| 鳥越製粉 | 2 | 5 | 4,896 | |
| 中部飼料 | 3 | 7 | 11,255 | |
| フィード・ワン | 19 | 8 | 7,860 | |
| 東洋精糖 | 1 | - | - | |
| 日本甜菜製糖 | 1 | 3 | 5,560 | |
| 三井製糖 | 2 | 5 | 9,690 | |
| 塩水港精糖 | 7 | 18 | 4,309 | |
| 日新製糖 | 1 | 3 | 5,610 | |
| 森永製菓 | 6 | 15 | 59,700 | |
| 中村屋 | 0.700 | 1 | 5,955 | |
| 江崎グリコ | 8 | 17 | 78,848 | |
| 名糖産業 | 1 | 3 | 4,545 | |
| 井村屋グループ | 1 | 3 | 9,057 | |
| 不二家 | 1 | 4 | 9,339 | |
| 山崎製パン | 21 | 48 | 90,576 | |
| モロゾフ | 0.500 | 1 | 5,650 | |
| 亀田製菓 | 1 | 3 | 17,316 | |
| 寿スピリッツ | 2 | 6 | 42,284 | |
| カルビー | 13 | 29 | 84,767 | |
| 森永乳業 | 5 | 11 | 56,994 | |
| 六甲バター | 1 | 4 | 7,299 | |
| ヤクルト本社 | 19 | 44 | 243,320 | |
| 明治ホールディングス | 18 | 42 | 294,831 | |
| 雪印メグミルク | 6 | 15 | 33,710 | |
| プリマハム | 4 | 9 | 30,060 | |
| 日本ハム | 10 | 24 | 114,292 | |
| 林兼産業 | - | 7 | 4,444 | |
| 丸大食品 | 3 | 6 | 10,697 | |
| S F o o d s | 2 | 5 | 19,750 | |
| 柿安本店 | 1 | 2 | 5,992 | |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 18 | 41 | 30,694 | |
| サッポロホールディングス | 9 | 21 | 48,919 | |
| アサヒグループホールディングス | 59 | 139 | 635,810 | |
| キリンホールディングス | 120 | 271 | 573,799 | |
| 宝ホールディングス | 21 | 47 | 71,052 | |
| オエノンホールディングス | 7 | 18 | 7,280 | |
| 養命酒製造 | 0.900 | 2 | 4,232 | |
| コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス | 20 | 49 | 89,768 | |
| サントリー食品インターナショナル | 19 | 42 | 161,356 | |
| グアールグループホールディングス | 1 | 3 | 19,476 | |
| 伊藤園 | 8 | 19 | 122,414 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-------|---------|----|
| | 株数 | 株数 | 千株 | 千円 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| キーコーヒー | 2 | 6 | 13,589 | |
| 日清オイリオグループ | 3 | 8 | 26,199 | |
| 不二製油グループ本社 | 7 | 15 | 49,764 | |
| かどや製油 | 0.500 | 1 | 4,504 | |
| J-オイルミルズ | 1 | 3 | 11,415 | |
| キッコーマン | 20 | 46 | 340,400 | |
| 味の素 | 63 | 152 | 345,113 | |
| キューピー | 15 | 35 | 85,226 | |
| ハウス食品グループ本社 | 10 | 23 | 88,908 | |
| カゴメ | 10 | 26 | 87,174 | |
| アリアケジャパン | 2 | 5 | 39,440 | |
| ピエトロ | 1 | 2 | 4,272 | |
| エバラ食品工業 | 0.800 | 0.900 | 2,382 | |
| ニチレイ | 13 | 30 | 85,613 | |
| 東洋水産 | 14 | 32 | 151,833 | |
| イートアンドホールディングス | 1 | 2 | 4,462 | |
| 大冷 | 0.900 | 2 | 4,120 | |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 1 | 4 | 4,689 | |
| 日清食品ホールディングス | 12 | 25 | 209,334 | |
| 永谷園ホールディングス | 1 | 3 | 7,309 | |
| 一正蒲鉾 | 1 | 3 | 4,280 | |
| フジッコ | 3 | 6 | 13,820 | |
| ロック・フィールド | 3 | 6 | 10,729 | |
| 日本たばこ産業 | 164 | 343 | 664,413 | |
| ケンコーマヨネーズ | 1 | 3 | 7,893 | |
| わらべや日洋ホールディングス | 1 | 4 | 7,207 | |
| なとり | 1 | 3 | 7,268 | |
| ピックルスコオペレーション | - | 1 | 5,370 | |
| 北の達人コーオペレーション | 10 | 22 | 14,182 | |
| ユーグレナ | 12 | 27 | 27,423 | |
| ミヨシ油脂 | 1 | 3 | 4,320 | |
| 理研ビタミン | 1 | 6 | 8,178 | |
| 繊維製品(0.5%) | | | | |
| 片倉工業 | 4 | 8 | 11,684 | |
| グンゼ | 2 | 4 | 17,434 | |
| 東洋紡 | 11 | 24 | 33,147 | |
| ユニチカ | 8 | 18 | 8,161 | |
| 富士紡ホールディングス | 1 | 3 | 12,870 | |
| 倉敷紡績 | 2 | 5 | 11,136 | |
| シキボウ | 1 | - | - | |
| 日本毛織 | 9 | 20 | 19,639 | |

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 |
| 帝国繊維 | 3 | 7 | 15,925 |
| 帝人 | 22 | 58 | 110,132 |
| 東レ | 201 | 452 | 319,544 |
| サカイオーベックス | 1 | 1 | 5,416 |
| 住江織物 | 0.800 | - | - |
| 日本フェルト | 3 | 9 | 4,351 |
| イチカワ | 1 | 3 | 4,249 |
| アツギ | 2 | 8 | 4,695 |
| セーレン | 6 | 15 | 29,398 |
| ソトー | 1 | 5 | 4,316 |
| 東海染工 | 1 | 3 | 4,173 |
| 小松マテール | 4 | 10 | 10,444 |
| ワコールホールディングス | 7 | 15 | 34,678 |
| ホギメディカル | 3 | 8 | 26,754 |
| クラウドIAホールディングス | 3 | 16 | 4,704 |
| T S Iホールディングス | 9 | 19 | 5,282 |
| マツオカコーポレーション | 0.900 | 2 | 4,023 |
| ワールド | 3 | 8 | 11,324 |
| 三陽商会 | 1 | 0.400 | 291 |
| オンワードホールディングス | 16 | 37 | 10,350 |
| ゴールドウイン | 5 | 10 | 76,014 |
| デサント | 5 | 10 | 18,949 |
| ヤマトインターナショナル | 4 | 12 | 4,166 |
| パルプ・紙(0.3%) | | | |
| 特種東海製紙 | 1 | 3 | 17,993 |
| 王子ホールディングス | 116 | 281 | 199,299 |
| 日本製紙 | 12 | 27 | 38,805 |
| 三菱製紙 | 4 | 11 | 4,295 |
| 北越コーポレーション | 18 | 44 | 22,975 |
| 中越パルプ工業 | 1 | 3 | 4,327 |
| 大王製紙 | 12 | 30 | 66,942 |
| 阿波製紙 | 1 | 0.200 | 90 |
| レンゴー | 26 | 64 | 56,607 |
| トーモク | 1 | 3 | 7,102 |
| ザ・パックス | 2 | 4 | 12,863 |
| 化学(7.4%) | | | |
| クラレ | 43 | 98 | 117,566 |
| 旭化成 | 184 | 413 | 474,835 |
| 昭和電工 | 19 | 47 | 122,860 |
| 住友化学 | 204 | 491 | 256,563 |
| 住友精化 | 1 | 3 | 12,060 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日産化学 | 15 | 34 | 214,656 |
| ラサ工業 | - | 2 | 4,496 |
| クレハ | 2 | 5 | 38,826 |
| 多木化学 | 0.800 | 2 | 15,336 |
| テイカ | 2 | 4 | 6,624 |
| 石原産業 | 5 | 11 | 9,195 |
| 片倉コープアグリ | 1 | 3 | 4,382 |
| 日本曹達 | 4 | 8 | 29,449 |
| 東ソー | 43 | 96 | 191,938 |
| トクヤマ | 8 | 18 | 49,617 |
| セントラル硝子 | 5 | 11 | 27,381 |
| 東亞合成 | 17 | 38 | 47,358 |
| 大阪ソーダ | 2 | 6 | 16,650 |
| 関東電化工業 | 6 | 14 | 13,127 |
| デンカ | 10 | 22 | 93,936 |
| 信越化学工業 | 47 | 115 | 2,164,470 |
| 日本カーバイド工業 | 1 | 3 | 4,415 |
| 堺化学工業 | 1 | 4 | 8,694 |
| 第一稀元素化学工業 | 3 | 6 | 6,589 |
| エア・ウォーター | 25 | 63 | 111,029 |
| 日本酸素ホールディングス | 26 | 51 | 103,262 |
| 日本化学工業 | 0.900 | 1 | 5,958 |
| 日本パーカラライジング | 14 | 31 | 34,681 |
| 高压ガス工業 | 4 | 9 | 7,316 |
| 四国化成工業 | 4 | 8 | 10,466 |
| ステラケミファ | 1 | 3 | 11,135 |
| 保土谷化学工業 | 1 | 1 | 8,874 |
| 日本触媒 | 4 | 11 | 65,427 |
| 大日精化工業 | 2 | 5 | 12,500 |
| カネカ | 7 | 16 | 68,827 |
| 三菱瓦斯化学 | 26 | 62 | 162,312 |
| 三井化学 | 25 | 53 | 174,636 |
| J S R | 25 | 62 | 212,553 |
| 東京応化工業 | 4 | 10 | 72,867 |
| 大阪有機化学工業 | 2 | 5 | 22,272 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 186 | 417 | 305,328 |
| K Hネオケム | 4 | 10 | 25,832 |
| ダイセル | 38 | 83 | 65,022 |
| 住友ベークライト | 4 | 9 | 43,463 |
| 積水化学工業 | 59 | 132 | 266,772 |
| 日本ゼオン | 25 | 56 | 93,120 |

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 |
| アイカ工業 | 8 | 17 | 66,816 |
| 宇部興産 | 14 | 31 | 67,441 |
| 積水樹脂 | 5 | 10 | 21,279 |
| タキロンシーアイ | 6 | 13 | 9,328 |
| 旭有機材 | 1 | 3 | 5,155 |
| 日立化成 | 12 | - | - |
| ニチバン | 1 | 3 | 6,012 |
| リケンテクノス | 7 | 15 | 7,524 |
| 大倉工業 | 1 | 2 | 5,800 |
| 積水化成成品工業 | 3 | 8 | 4,712 |
| 群栄化学工業 | 0.700 | 1 | 4,253 |
| タイガースポリマー | 3 | 10 | 4,856 |
| ダイキョーニシカワ | 5 | 13 | 10,546 |
| 竹本容器 | 2 | - | - |
| 森六ホールディングス | 1 | 3 | 6,959 |
| 日本化薬 | 17 | 38 | 40,916 |
| カーリットホールディングス | 3 | 6 | 4,513 |
| 日本精化 | 2 | 4 | 6,376 |
| 扶桑化学工業 | 2 | 4 | 19,453 |
| トリケミカル研究所 | 0.600 | 5 | 23,800 |
| ADEKA | 12 | 28 | 53,468 |
| 日油 | 10 | 23 | 137,475 |
| 新日本理化 | 8 | 15 | 4,240 |
| ハリマ化成グループ | 2 | 4 | 4,360 |
| 花王 | 68 | 152 | 1,109,402 |
| 第一工業製薬 | 1 | 2 | 7,917 |
| 日華化学 | 2 | 4 | 4,262 |
| ニイタカ | 0.800 | 1 | 4,056 |
| 三洋化成工業 | 1 | 3 | 19,351 |
| 有機合成薬品工業 | 6 | 13 | 3,907 |
| 大日本塗料 | 3 | 7 | 6,560 |
| 日本ペイントホールディングス | 23 | 51 | 448,565 |
| 関西ペイント | 31 | 70 | 204,481 |
| 中国塗料 | 7 | 15 | 14,040 |
| 日本特殊塗料 | 2 | 4 | 5,423 |
| 藤倉化成 | 3 | 8 | 4,410 |
| 太陽ホールディングス | 2 | 4 | 27,094 |
| DIC | 11 | 26 | 75,504 |
| サカタインクス | 6 | 13 | 15,000 |
| 東洋インキSCホールディングス | 5 | 13 | 26,492 |
| T&K TOKA | 2 | 5 | 4,140 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 富士フィルムホールディングス | 54 | 112 | 709,296 |
| 資生堂 | 56 | 126 | 1,032,605 |
| ライオン | 36 | 82 | 180,307 |
| 高砂香料工業 | 1 | 4 | 10,436 |
| マンダム | 6 | 13 | 25,058 |
| ミルボン | 3 | 8 | 54,400 |
| ファンケル | 11 | 23 | 94,656 |
| コーセー | 5 | 12 | 217,200 |
| コタ | 1 | 3 | 6,763 |
| シーボン | 0.700 | 2 | 4,189 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 12 | 27 | 67,347 |
| ノエビアホールディングス | 2 | 5 | 26,271 |
| アジュバンコスメジャパン | 1 | 4 | 4,396 |
| エステー | 1 | 4 | 8,089 |
| アグロカネショウ | 1 | 2 | 4,382 |
| コニシ | 4 | 10 | 17,619 |
| 長谷川香料 | 3 | 11 | 21,461 |
| 星光PMC | 2 | 5 | 4,174 |
| 小林製薬 | 8 | 17 | 196,721 |
| 荒川化学工業 | 2 | 5 | 6,863 |
| メック | 2 | 4 | 9,121 |
| 日本高純度化学 | 0.800 | 1 | 4,838 |
| タカラバイオ | 7 | 16 | 51,519 |
| JCU | 3 | 7 | 24,552 |
| 新田ゼラチン | 2 | 6 | 4,216 |
| OATアグリオ | - | 3 | 4,428 |
| デクセリアルズ | 7 | 17 | 27,376 |
| アース製薬 | 2 | 4 | 29,136 |
| 北興化学工業 | 2 | 5 | 6,171 |
| 大成ラミック | 0.900 | 2 | 5,870 |
| クミアイ化学工業 | 11 | 26 | 23,284 |
| 日本農薬 | 5 | 11 | 6,042 |
| アキレス | 2 | 4 | 6,542 |
| 有沢製作所 | 4 | 8 | 8,739 |
| 日東電工 | 19 | 40 | 384,744 |
| レック | 3 | 7 | 10,305 |
| 三光合成 | 5 | 5 | 2,575 |
| 藤森工業 | 2 | 5 | 26,391 |
| 前澤化成工業 | 1 | 4 | 4,259 |
| 未来工業 | 1 | 2 | 4,166 |
| ウェーブロックホールディングス | - | 4 | 3,596 |

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 |
| J S P | 1 | 3 | 6,715 |
| エフピコ | 3 | 11 | 49,725 |
| 天馬 | 1 | 4 | 10,320 |
| 信越ポリマー | 5 | 9 | 10,064 |
| 東リ | 7 | 17 | 4,214 |
| ニフコ | 10 | 23 | 88,803 |
| バルカー | 2 | 5 | 11,039 |
| ユニ・チャーム | 54 | 135 | 627,868 |
| 医薬品(5.6%) | | | |
| 協和キリン | 28 | 64 | 197,748 |
| 武田薬品工業 | 236 | 530 | 1,955,584 |
| アステラス製薬 | 249 | 552 | 983,253 |
| 大日本住友製薬 | 21 | 47 | 80,457 |
| 塩野義製薬 | 36 | 80 | 466,042 |
| わかもと製薬 | 7 | 13 | 3,381 |
| あすか製薬 | 3 | 7 | 10,300 |
| 日本新薬 | 7 | 18 | 141,361 |
| ビオフェルミン製薬 | 0.800 | - | - |
| 中外製薬 | 29 | 199 | 1,046,850 |
| 科研製薬 | 4 | 10 | 45,289 |
| エーザイ | 34 | 70 | 536,800 |
| ロート製薬 | 14 | 30 | 90,196 |
| 小野薬品工業 | 65 | 146 | 447,252 |
| 久光製薬 | 7 | 18 | 130,795 |
| 持田製薬 | 3 | 8 | 36,476 |
| 参天製薬 | 52 | 110 | 174,334 |
| 扶桑薬品工業 | 1 | 2 | 5,573 |
| ツムラ | 8 | 21 | 73,165 |
| 日医工 | 8 | 18 | 20,018 |
| キッセイ薬品工業 | 5 | 11 | 25,278 |
| 生化学工業 | 5 | 11 | 11,883 |
| 栄研化学 | 5 | 11 | 23,990 |
| 日水製薬 | 1 | 4 | 4,187 |
| 鳥居薬品 | 1 | 4 | 12,020 |
| J C R ファーマ | 2 | 18 | 58,860 |
| 東和薬品 | 3 | 9 | 20,516 |
| 富士製薬工業 | 1 | 4 | 5,504 |
| 沢井製薬 | 5 | 14 | 68,530 |
| ゼリア新薬工業 | 5 | 11 | 23,478 |
| 第一三共 | 81 | 547 | 1,784,745 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 6 | 14 | 27,227 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 大幸薬品 | 1 | 7 | 10,311 |
| ダイト | 1 | 4 | 14,719 |
| 大塚ホールディングス | 54 | 132 | 592,142 |
| 大正製薬ホールディングス | 6 | 15 | 105,184 |
| ペプチドリーム | 14 | 32 | 175,608 |
| 石油・石炭製品(0.4%) | | | |
| 日本コークス工業 | 24 | 53 | 5,605 |
| ニチレキ | 3 | 7 | 11,535 |
| ユシロ化学工業 | 1 | 3 | 4,123 |
| ビーピー・カストロール | 1 | - | - |
| 富士石油 | 3 | 18 | 3,945 |
| MORESCO | 1 | 3 | 4,255 |
| 出光興産 | 32 | 70 | 194,133 |
| ENEOSホールディングス | 427 | 959 | 443,921 |
| コスモエネルギーホールディングス | 8 | 20 | 50,197 |
| ゴム製品(0.6%) | | | |
| 横浜ゴム | 16 | 36 | 72,360 |
| TOYO TIRE | 16 | 33 | 64,041 |
| ブリヂストン | 87 | 169 | 711,730 |
| 住友ゴム工業 | 25 | 57 | 68,416 |
| オカモト | 1 | 3 | 16,048 |
| フコク | 2 | 5 | 4,194 |
| ニッタ | 3 | 6 | 15,813 |
| 住友理工 | 5 | 12 | 7,948 |
| 三ツ星ベルト | 3 | 7 | 13,290 |
| バンドー化学 | 5 | 11 | 8,254 |
| ガラス・土石製品(0.8%) | | | |
| 日東紡績 | 4 | 9 | 41,705 |
| AGC | 28 | 58 | 228,442 |
| 日本板硝子 | 13 | 32 | 17,829 |
| 日本山村硝子 | 1 | 4 | 4,406 |
| 日本電気硝子 | 11 | 23 | 59,047 |
| オハラ | 1 | 2 | 5,130 |
| 住友大阪セメント | 5 | 11 | 40,940 |
| 太平洋セメント | 17 | 37 | 103,599 |
| 日本ヒューム | 2 | 5 | 4,460 |
| 日本コンクリート工業 | 6 | 13 | 5,288 |
| 三谷セキサン | 1 | 3 | 14,460 |
| アジアパイルホールディングス | 4 | 9 | 5,194 |
| 東海カーボン | 29 | 62 | 94,384 |
| 日本カーボン | 1 | 3 | 14,332 |

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-----------------|---------|-----|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | 千円 |
| 東洋炭素 | 1 | 3 | 7,351 | |
| ノリタケカンパニーリミテド | 1 | 3 | 12,652 | |
| TOTO | 20 | 45 | 311,675 | |
| 日本碍子 | 34 | 70 | 131,858 | |
| 日本特殊陶業 | 22 | 48 | 90,598 | |
| MARUWA | 1 | 2 | 23,254 | |
| 品川リフラクトリーズ | 0.700 | 1 | 4,419 | |
| 黒崎播磨 | 0.600 | 1 | 5,307 | |
| ヨータイ | 2 | 4 | 5,086 | |
| イソライト工業 | 3 | 7 | 4,672 | |
| ニッカトー | 2 | 5 | 3,728 | |
| フジミンコーポレーテッド | 2 | 5 | 21,547 | |
| クニミネ工業 | 1 | 3 | 3,996 | |
| ニチアス | 7 | 16 | 40,024 | |
| ニチハ | 4 | 8 | 27,100 | |
| 鉄鋼(0.7%) | | | | |
| 日本製鉄 | 125 | 300 | 466,846 | |
| 神戸製鋼所 | 51 | 115 | 73,394 | |
| 中山製鋼所 | 3 | 11 | 4,651 | |
| 合同製鐵 | 1 | 3 | 7,072 | |
| ジェイエフイーホールディングス | 75 | 182 | 203,011 | |
| 東京製鐵 | 13 | 24 | 17,761 | |
| 共英製鋼 | 3 | 7 | 10,167 | |
| 大和工業 | 6 | 13 | 36,340 | |
| 東京鐵鋼 | 1 | 2 | 4,816 | |
| 大阪製鐵 | 1 | 3 | 4,144 | |
| 淀川製鋼所 | 3 | 8 | 19,575 | |
| 丸一鋼管 | 9 | 20 | 51,291 | |
| モリ工業 | 0.800 | 1 | 4,432 | |
| 大同特殊鋼 | 4 | 10 | 48,358 | |
| 日本高周波鋼業 | 4 | 12 | 4,368 | |
| 日本冶金工業 | 2 | 4 | 10,383 | |
| 山陽特殊製鋼 | 1 | 7 | 13,292 | |
| 愛知製鋼 | 1 | 3 | 11,462 | |
| 日立金属 | 30 | 59 | 102,286 | |
| 日本金属 | 2 | - | - | |
| 大太平洋金属 | 1 | 4 | 10,750 | |
| 新日本電工 | 18 | 40 | 12,128 | |
| 栗本鐵工所 | 1 | 2 | 5,118 | |
| 三菱製鋼 | 2 | 2 | 1,528 | |
| 日亜鋼業 | 5 | 14 | 4,145 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | 千円 |
| 日本精線 | 0.300 | 1 | 4,020 | |
| シンニッタン | 4 | 20 | 4,511 | |
| 非鉄金属(0.8%) | | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 4 | 9 | 7,619 | |
| 日本軽金属ホールディングス | 71 | 17 | 37,272 | |
| 三井金属鉱業 | 7 | 17 | 66,045 | |
| 東邦亜鉛 | 1 | 3 | 8,452 | |
| 三菱マテリアル | 18 | 41 | 108,076 | |
| 住友金属鉱山 | 35 | 80 | 449,586 | |
| DOWAホールディングス | 7 | 15 | 66,382 | |
| 古河機械金属 | 5 | 10 | 14,060 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 2 | 6 | 5,398 | |
| 東邦チタニウム | 5 | 11 | 11,085 | |
| UACJ | 4 | 9 | 24,067 | |
| CKサンエツ | 0.600 | 1 | 5,141 | |
| 古河電気工業 | 8 | 19 | 56,271 | |
| 住友電気工業 | 105 | 220 | 340,890 | |
| フジクラ | 33 | 76 | 39,952 | |
| 昭和電線ホールディングス | 3 | 6 | 10,693 | |
| 東京特殊電線 | 0.100 | 1 | 4,413 | |
| タツタ電線 | 5 | 11 | 7,226 | |
| カナレ電気 | 1 | - | - | |
| 平河ヒューテック | 1 | 3 | 4,161 | |
| リョービ | 3 | 7 | 10,186 | |
| アーレスティ | 3 | 10 | 4,293 | |
| アサヒホールディングス | 4 | 11 | 50,917 | |
| 金属製品(0.6%) | | | | |
| 稲葉製作所 | 1 | 3 | 4,994 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 0.900 | 2 | 4,664 | |
| トーカロ | 7 | 16 | 22,868 | |
| アルファ | 1 | 4 | 4,603 | |
| SUMCO | 33 | 80 | 203,364 | |
| 川田テクノロジーズ | 0.600 | 1 | 6,084 | |
| RSTechnologies | 0.800 | 2 | 12,660 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 17 | 40 | 54,576 | |
| ホッカンホールディングス | 1 | 3 | 4,576 | |
| コロナ | 1 | 4 | 4,184 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 5 | 10 | 20,649 | |
| 三和ホールディングス | 27 | 59 | 78,111 | |
| 文化シャッター | 8 | 18 | 18,600 | |
| 三協立山 | 3 | 8 | 6,706 | |

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 |
| アルインコ | 2 | 4 | 4,285 |
| LIXIL | 41 | 86 | 262,570 |
| 日本フィルコン | 3 | 8 | 4,150 |
| ノーリツ | 5 | 13 | 21,942 |
| 長府製作所 | 2 | 6 | 13,491 |
| リンナイ | 5 | 12 | 140,958 |
| ダイニチ工業 | 2 | 4 | 3,919 |
| 日東精工 | 3 | 9 | 6,003 |
| 三洋工業 | 0.900 | 2 | 4,074 |
| 岡部 | 5 | 12 | 10,099 |
| ジーテクト | 3 | 7 | 11,294 |
| 東プレ | 5 | 11 | 18,714 |
| 高周波熱錬 | 5 | 12 | 6,534 |
| 東京製綱 | 2 | 4 | 6,502 |
| サンコール | 1 | 6 | 3,311 |
| モリテックスチール | 5 | 9 | 4,074 |
| パイオラックス | 4 | 9 | 14,824 |
| エイチワン | 2 | 6 | 4,786 |
| 日本発条 | 30 | 62 | 50,993 |
| 立川ブラインド工業 | 1 | 3 | 4,067 |
| 三益半導体工業 | 2 | 4 | 12,980 |
| 機械(5.6%) | | | |
| 日本製鋼所 | 8 | 19 | 55,141 |
| 三浦工業 | 12 | 27 | 167,622 |
| タクマ | 9 | 21 | 43,292 |
| ツガミ | 5 | 13 | 21,418 |
| オークマ | 3 | 7 | 43,581 |
| 芝浦機械 | 3 | 6 | 19,214 |
| アマダ | 35 | 92 | 119,103 |
| アイダエンジニアリング | 7 | 16 | 15,790 |
| 滝澤鉄工所 | 1 | 4 | 4,341 |
| F U J I | 12 | 25 | 67,208 |
| 牧野フライス製作所 | 3 | 7 | 29,785 |
| オーエスジー | 13 | 31 | 61,360 |
| ダイジェット工業 | 1 | 3 | 4,284 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 7 | 16 | 8,415 |
| DMG森精機 | 17 | 39 | 63,800 |
| ソディック | 6 | 13 | 13,576 |
| ディスコ | 3 | 8 | 305,300 |
| 日東工器 | 1 | 3 | 5,574 |
| 日進工具 | 0.800 | 2 | 6,865 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| パンチ工業 | 4 | - | - |
| 豊和工業 | 2 | 4 | 4,118 |
| 〇 K K | 2 | - | - |
| 東洋機械金属 | 3 | 9 | 4,167 |
| エンシュウ | 1 | 4 | 4,224 |
| 島精機製作所 | 4 | 9 | 21,196 |
| オプトラン | 3 | 7 | 21,922 |
| NCホールディングス | 2 | 7 | 4,693 |
| イワキ | 1 | 5 | 4,263 |
| フリュー | 2 | 6 | 6,944 |
| ヤマシンフィルタ | 6 | 12 | 11,303 |
| 日阪製作所 | 3 | 7 | 6,559 |
| やまびこ | 5 | 12 | 14,359 |
| 平田機工 | 1 | 3 | 21,840 |
| ペガサスミシン製造 | 3 | 12 | 5,520 |
| マルマエ | - | 1 | 1,956 |
| タツモ | - | 2 | 4,438 |
| ナプテスコ | 16 | 37 | 180,306 |
| 三井海洋開発 | 3 | 6 | 11,738 |
| レオン自動機 | 2 | 6 | 7,037 |
| S M C | 8 | 18 | 1,231,582 |
| ヤマハモーターロボティクスホールディングス | 2 | - | - |
| ホソカワミクロン | 1 | 2 | 14,410 |
| ユニオンツール | 1 | 2 | 8,004 |
| オイレス工業 | 3 | 8 | 14,933 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 0.900 | 1 | 10,134 |
| サトーホールディングス | 4 | 8 | 20,725 |
| 技研製作所 | 2 | 5 | 29,064 |
| 日本エアータック | 1 | - | - |
| カワタ | 1 | 4 | 3,891 |
| 日精樹脂工業 | 2 | 4 | 4,420 |
| オカダアイオン | 1 | 3 | 4,284 |
| 小松製作所 | 128 | 288 | 939,466 |
| 住友重機械工業 | 16 | 36 | 105,886 |
| 日立建機 | 11 | 29 | 99,085 |
| 日工 | 3 | 9 | 6,906 |
| 巴工業 | 1 | 2 | 5,135 |
| 井関農機 | 2 | 6 | 9,862 |
| T O W A | 2 | 5 | 12,856 |
| 丸山製作所 | 1 | 2 | 4,284 |
| 北川鉄工所 | 1 | 3 | 4,581 |

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 |
| ローツェ | 1 | 2 | 22,708 |
| タカキタ | 3 | 6 | 4,110 |
| クボタ | 150 | 334 | 827,705 |
| 荏原実業 | 0.900 | 1 | 7,440 |
| 三菱化工機 | 1 | 2 | 5,932 |
| 月島機械 | 5 | 11 | 15,128 |
| 帝国電機製作所 | 2 | 4 | 5,324 |
| 新東工業 | 6 | 15 | 11,460 |
| 澁谷工業 | 2 | 5 | 19,768 |
| アイチコーポレーション | 4 | 11 | 9,867 |
| 小森コーポレーション | 7 | 16 | 11,680 |
| 鶴見製作所 | 2 | 4 | 8,462 |
| 荏原製作所 | 11 | 26 | 108,504 |
| 石井鐵工所 | - | 1 | 4,407 |
| 西島製作所 | 2 | 6 | 5,350 |
| 北越工業 | 2 | 6 | 7,378 |
| ダイキン工業 | 36 | 81 | 1,794,520 |
| オルガノ | 1 | 2 | 12,999 |
| トーヨーカネツ | 1 | 2 | 6,664 |
| 栗田工業 | 15 | 34 | 152,835 |
| 椿本チエイン | 4 | 9 | 26,763 |
| 大同工業 | - | 5 | 4,495 |
| 木村化工機 | 3 | - | - |
| アネスト岩田 | 4 | 10 | 11,630 |
| ダイフク | 14 | 35 | 396,981 |
| サムコ | 0.900 | 1 | 5,912 |
| 加藤製作所 | 1 | 4 | 4,408 |
| 油研工業 | 1 | - | - |
| タダノ | 13 | 30 | 31,200 |
| フジテック | 10 | 21 | 55,538 |
| C K D | 7 | 14 | 36,630 |
| キトー | 2 | 5 | 7,948 |
| 平和 | 7 | 17 | 28,497 |
| 理想科学工業 | 2 | 4 | 6,688 |
| SANKYO | 6 | 15 | 44,900 |
| 日本金銭機械 | 3 | 8 | 4,424 |
| マースグループホールディングス | 1 | 4 | 6,380 |
| フクシマガリレイ | 1 | 4 | 18,458 |
| ダイコク電機 | 1 | 4 | 4,436 |
| 竹内製作所 | 4 | 10 | 29,735 |
| アマノ | 7 | 16 | 40,380 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| J U K I | 4 | 8 | 7,387 |
| サンデンホールディングス | 3 | - | - |
| 蛇の目ミシン工業 | 4 | 5 | 4,715 |
| マックス | 4 | 8 | 14,203 |
| グローリー | 7 | 16 | 37,556 |
| 新晃工業 | 2 | 5 | 11,652 |
| 大和冷機工業 | 4 | 10 | 11,067 |
| セガサミーホールディングス | 28 | 58 | 106,256 |
| 日本ピストンリング | 1 | 4 | 4,576 |
| リケン | 1 | 3 | 6,747 |
| T P R | 3 | 8 | 13,097 |
| ツバキ・ナカシマ | 5 | 12 | 15,542 |
| ホシザキ | 8 | 20 | 193,965 |
| 大豊工業 | 2 | - | - |
| 日本精工 | 53 | 130 | 132,732 |
| N T N | 65 | 147 | 46,462 |
| ジェイテクト | 27 | 61 | 70,020 |
| 不二越 | 2 | 5 | 27,641 |
| 日本トムソン | 8 | 17 | 9,957 |
| T H K | 16 | 39 | 144,508 |
| ユーシン精機 | 2 | 4 | 4,158 |
| 前澤給装工業 | 1 | 2 | 5,135 |
| イーグル工業 | 3 | 7 | 9,108 |
| 日本ピラー工業 | 2 | 6 | 11,027 |
| キッツ | 11 | 19 | 11,465 |
| マキタ | 37 | 83 | 390,154 |
| 日立造船 | 22 | 50 | 35,703 |
| 三菱重工業 | 47 | 100 | 306,111 |
| I H I | 20 | 42 | 81,467 |
| スター精密 | 4 | 9 | 15,856 |
| 電気機器(18.0%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | 18 | 39 | 31,356 |
| イビデン | 17 | 30 | 147,974 |
| コニカミノルタ | 62 | 129 | 71,115 |
| ブラザー工業 | 34 | 77 | 175,983 |
| ミネベアミツミ | 52 | 109 | 293,433 |
| 日立製作所 | 136 | 306 | 1,512,271 |
| 三菱電機 | 284 | 637 | 1,020,956 |
| 富士電機 | 17 | 38 | 179,136 |
| 東洋電機製造 | 1 | 3 | 4,235 |
| 安川電機 | 30 | 68 | 388,962 |

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 |
| シンフォニアテクノロジー | 3 | 8 | 11,113 |
| 明電舎 | 5 | 10 | 25,617 |
| オリジン | 1 | 3 | 4,393 |
| 山洋電気 | 1 | 3 | 18,724 |
| デンヨー | 2 | 5 | 11,431 |
| 東芝テック | 3 | 6 | 26,248 |
| 芝浦メカトロニクス | 0.500 | 1 | 5,577 |
| マブチモーター | 7 | 17 | 85,976 |
| 日本電産 | 34 | 153 | 2,247,310 |
| トレックス・セミコンダクター | 1 | 3 | 5,470 |
| 東光高岳 | 1 | 3 | 4,992 |
| ダブル・スコープ | 4 | 12 | 9,979 |
| ダイヘン | 3 | 7 | 32,760 |
| ヤーマン | 4 | 10 | 20,124 |
| JVCケンウッド | 23 | 55 | 10,653 |
| ミマキエンジニアリング | 3 | 8 | 4,950 |
| I P E X | 1 | 3 | 6,072 |
| 日新電機 | 6 | 14 | 18,923 |
| 大崎電気工業 | 5 | 12 | 7,734 |
| オムロン | 25 | 53 | 500,202 |
| 日東工業 | 4 | 9 | 19,683 |
| I D E C | 4 | 8 | 15,988 |
| 不二電機工業 | 1 | 3 | 4,067 |
| ジーエス・ユアサコーポレーション | 9 | 22 | 77,173 |
| サクサホールディングス | 1 | 3 | 4,485 |
| メルコホールディングス | 1 | 2 | 8,602 |
| 日本電気 | 34 | 81 | 509,490 |
| 富士通 | 27 | 57 | 912,947 |
| 沖電気工業 | 11 | 25 | 27,195 |
| 電気興業 | 1 | 3 | 9,123 |
| サンケン電気 | 3 | 7 | 41,850 |
| アイホン | 1 | 3 | 6,310 |
| ルネサスエレクトロニクス | 135 | 274 | 344,121 |
| セイコーエプソン | 35 | 79 | 139,848 |
| ワコム | 19 | 46 | 36,695 |
| アルバック | 5 | 11 | 59,787 |
| E I Z O | 2 | 5 | 20,682 |
| ジャパンディスプレイ | 82 | 217 | 10,449 |
| 日本信号 | 7 | 14 | 14,259 |
| 京三製作所 | 6 | 13 | 5,836 |
| 能美防災 | 3 | 8 | 18,950 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ホーチキ | 2 | 4 | 5,952 |
| エレコム | 3 | 7 | 36,354 |
| パナソニック | 324 | 679 | 979,931 |
| シャープ | 32 | 73 | 157,932 |
| アンリツ | 18 | 38 | 91,154 |
| 富士通ゼネラル | 7 | 19 | 58,227 |
| ソニー | 179 | 399 | 4,783,614 |
| T D K | 13 | 30 | 500,808 |
| 帝国通信工業 | 1 | 3 | 4,229 |
| タムラ製作所 | 9 | 22 | 12,732 |
| アルプスアルパイン | 25 | 52 | 74,867 |
| 池上通信機 | 1 | 4 | 4,081 |
| 日本電波工業 | 3 | 6 | 4,302 |
| 鈴木 | 2 | - | - |
| 日本トリム | 0.400 | 1 | 6,146 |
| ローランドディー・ジー | 1 | 3 | 7,254 |
| フォスター電機 | 3 | 6 | 8,756 |
| S M K | 0.700 | 1 | 4,824 |
| ヨコオ | 1 | 4 | 14,085 |
| ホシデン | 7 | 17 | 18,913 |
| ヒロセ電機 | 4 | 9 | 164,444 |
| 日本航空電子工業 | 6 | 14 | 24,761 |
| T O A | 3 | 7 | 6,772 |
| マクセルホールディングス | 6 | 12 | 18,338 |
| 古野電気 | 3 | 8 | 9,380 |
| ユニデンホールディングス | 0.900 | 2 | 4,712 |
| スミダコーポレーション | 2 | 5 | 5,545 |
| アイコム | 1 | 2 | 7,228 |
| リオン | 1 | 2 | 7,924 |
| 船井電機 | 2 | - | - |
| 横河電機 | 26 | 63 | 136,723 |
| 新電元工業 | 1 | 2 | 7,900 |
| アズビル | 17 | 43 | 215,931 |
| 東亜ディーケーケー | 1 | 4 | 4,076 |
| 日本光電工業 | 11 | 26 | 79,426 |
| 共和電業 | 4 | 10 | 4,196 |
| 日本電子材料 | 1 | 2 | 4,376 |
| 堀場製作所 | 5 | 12 | 84,924 |
| アドバンテスト | 21 | 47 | 458,358 |
| 小野測器 | 3 | 7 | 4,251 |
| エスペック | 2 | 5 | 10,791 |

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 |
| キーエンス | 25 | 62 | 3,552,550 |
| 日置電機 | 1 | 3 | 11,811 |
| シスメックス | 20 | 49 | 584,472 |
| 日本マイクロニクス | 4 | 11 | 20,956 |
| メガチップス | 2 | 6 | 22,048 |
| OBARAGROUP | 1 | 3 | 14,689 |
| 澤藤電機 | 0.900 | 1 | 2,319 |
| 原田工業 | 1 | 4 | 4,478 |
| コーセル | 3 | 7 | 9,079 |
| イリソ電子工業 | 2 | 5 | 27,216 |
| オプテックスグループ | 4 | 10 | 18,501 |
| 千代田インテグレ | 1 | 2 | 4,860 |
| アイ・オー・データ機器 | 1 | - | - |
| レーザーテック | 12 | 28 | 408,240 |
| スタンレー電気 | 20 | 44 | 153,768 |
| 岩崎電気 | 1 | 3 | 4,563 |
| ウシオ電機 | 16 | 32 | 45,027 |
| 岡谷電機産業 | 4 | 11 | 4,350 |
| ハリオステクノホールディング | 4 | - | - |
| エノモト | 1 | 2 | 4,856 |
| 日本セラミック | 2 | 6 | 17,810 |
| 遠藤照明 | 2 | 7 | 5,046 |
| 古河電池 | 2 | 4 | 7,146 |
| 双信電機 | - | 9 | 4,067 |
| 山一電機 | 2 | 4 | 6,216 |
| 図研 | 1 | 4 | 12,095 |
| 日本電子 | 5 | 11 | 50,054 |
| カシオ計算機 | 25 | 51 | 105,421 |
| ファナック | 27 | 55 | 1,542,001 |
| 日本シイエムケイ | 6 | 13 | 5,986 |
| エンプラス | 1 | 2 | 13,470 |
| 大真空 | - | 2 | 5,628 |
| ローム | 12 | 26 | 303,955 |
| 浜松ホトニクス | 20 | 45 | 311,674 |
| 三井ハイテック | 3 | 6 | 28,117 |
| 新光電気工業 | 9 | 21 | 64,949 |
| 京セラ | 40 | 97 | 674,956 |
| 太陽誘電 | 12 | 28 | 165,272 |
| 村田製作所 | 83 | 187 | 1,850,898 |
| 双葉電子工業 | 4 | 10 | 10,551 |
| 北陸電気工業 | 1 | 4 | 4,216 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ニチコン | 9 | 20 | 23,054 |
| 日本ケミコン | 2 | 6 | 11,820 |
| KOA | 4 | 8 | 13,376 |
| 市光工業 | 4 | 9 | 7,248 |
| 小糸製作所 | 17 | 38 | 296,050 |
| ミツバ | 5 | 11 | 7,300 |
| SCREENホールディングス | 4 | 11 | 104,007 |
| キャノン電子 | 3 | 5 | 9,813 |
| キャノン | 153 | 316 | 740,836 |
| リコー | 72 | 162 | 153,765 |
| 象印マホービン | 8 | 17 | 31,372 |
| MUTOHホールディングス | 1 | 2 | 4,293 |
| 東京エレクトロン | 18 | 37 | 1,726,990 |
| 輸送用機器(6.9%) | | | |
| トヨタ紡織 | 8 | 18 | 32,233 |
| 芦森工業 | 1 | 4 | 4,536 |
| ユニプレス | 5 | 10 | 10,004 |
| 豊田自動織機 | 23 | 51 | 491,232 |
| モリタホールディングス | 5 | 10 | 18,492 |
| 三櫻工業 | 3 | 8 | 8,272 |
| デンソー | 62 | 140 | 936,748 |
| 東海理化電機製作所 | 7 | 16 | 30,340 |
| 三井E&Sホールディングス | 10 | 24 | 10,892 |
| 川崎重工業 | 22 | 49 | 114,427 |
| 名村造船所 | 9 | - | - |
| 日本車輛製造 | 1 | 2 | 5,729 |
| 三菱ロジスネクスト | 3 | 8 | 9,693 |
| 近畿車輛 | 1 | 3 | 4,263 |
| 日産自動車 | 335 | 751 | 441,456 |
| いすゞ自動車 | 82 | 184 | 207,602 |
| トヨタ自動車 | 317 | 645 | 5,205,148 |
| 日野自動車 | 35 | 79 | 80,953 |
| 三菱自動車工業 | 105 | 236 | 69,148 |
| エフテック | 0.900 | 6 | 4,535 |
| 武蔵精密工業 | 6 | 14 | 26,937 |
| 日産車体 | 5 | 9 | 7,514 |
| 新明和工業 | 7 | 18 | 17,298 |
| 極東開発工業 | 5 | 11 | 17,655 |
| 日信工業 | 5 | - | - |
| トピー工業 | 2 | 5 | 7,529 |
| ティラド | 1 | 3 | 5,731 |

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 |
| 曙ブレーキ工業 | 15 | 35 | 5,740 |
| タチエス | 4 | 9 | 10,789 |
| NOK | 15 | 30 | 45,368 |
| フタバ産業 | 7 | 16 | 8,640 |
| K Y B | 3 | 7 | 21,371 |
| 大同メタル工業 | 5 | 13 | 7,365 |
| プレス工業 | 14 | 31 | 10,491 |
| ミクニ | 5 | 15 | 4,419 |
| 太平洋工業 | 5 | 13 | 16,146 |
| ケーヒン | 6 | - | - |
| 河西工業 | 3 | 9 | 3,803 |
| アイシン精機 | 23 | 46 | 169,988 |
| マツダ | 83 | 200 | 171,885 |
| 今仙電機製作所 | 2 | 5 | 4,389 |
| 本田技研工業 | 223 | 501 | 1,494,407 |
| スズキ | 56 | 126 | 621,635 |
| S U B A R U | 88 | 182 | 371,794 |
| 安永 | 1 | - | - |
| ヤマハ発動機 | 37 | 90 | 217,141 |
| ショーワ | 6 | - | - |
| T B K | 4 | 9 | 4,073 |
| エクセディ | 3 | 8 | 14,311 |
| 豊田合成 | 9 | 20 | 58,833 |
| 愛三工業 | 4 | 10 | 5,780 |
| 日本プラスト | 2 | - | - |
| ヨロズ | 2 | 5 | 7,199 |
| エフ・シー・シー | 4 | 10 | 18,127 |
| シマノ | 10 | 23 | 607,179 |
| テイ・エステック | 6 | 14 | 45,140 |
| ジャムコ | 1 | 6 | 5,505 |
| 精密機器(2.6%) | | | |
| テルモ | 80 | 195 | 835,921 |
| クリエートメディック | 1 | - | - |
| 日機装 | 8 | 20 | 22,145 |
| 日本エム・ディ・エム | 1 | 3 | 7,422 |
| 島津製作所 | 34 | 82 | 357,930 |
| J M S | 2 | 5 | 5,308 |
| 長野計器 | 2 | 4 | 4,627 |
| ブイ・テクノロジー | 1 | 3 | 17,820 |
| 東京計器 | 1 | 4 | 4,078 |
| 愛知時計電機 | - | 1 | 4,395 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| インターアクション | 1 | 3 | 8,611 |
| オーバル | 7 | 4 | 1,342 |
| 東京精密 | 5 | 10 | 54,891 |
| マニー | 11 | 25 | 68,453 |
| ニコン | 46 | 97 | 89,418 |
| トプコン | 14 | 32 | 40,767 |
| オリンパス | 157 | 352 | 790,224 |
| 理研計器 | 2 | 5 | 15,629 |
| タムロン | 2 | 5 | 10,041 |
| H O Y A | 56 | 126 | 1,652,090 |
| シード | 1 | - | - |
| ノーリツ鋼機 | 1 | 5 | 13,594 |
| エー・アンド・デイ | 2 | 5 | 6,604 |
| 朝日インテック | 24 | 67 | 220,088 |
| シチズン時計 | 33 | 80 | 31,389 |
| リズム | 2 | 6 | 4,740 |
| 大研医器 | 1 | 7 | 4,182 |
| メニコン | 3 | 9 | 66,738 |
| 松風 | 1 | 2 | 5,243 |
| セイコーホールディングス | 4 | 9 | 15,120 |
| ニプロ | 19 | 47 | 65,930 |
| その他製品(2.5%) | | | |
| スノーピーク | 1 | 3 | 12,046 |
| パラマウントベッドホールディングス | 3 | 6 | 27,694 |
| トランザクション | 1 | - | - |
| 粧美堂 | 4 | 10 | 4,242 |
| ニホンフラッシュ | 1 | 5 | 6,743 |
| 前田工織 | 3 | 7 | 20,762 |
| 永大産業 | 5 | 14 | 4,409 |
| アートネイチャー | 3 | 6 | 4,355 |
| バンダイナムコホールディングス | 29 | 52 | 460,808 |
| 共立印刷 | 11 | 34 | 4,284 |
| S H O E I | 1 | 5 | 23,856 |
| フランスベッドホールディングス | 4 | 8 | 7,888 |
| パイロットコーポレーション | 4 | 11 | 37,346 |
| 萩原工業 | 1 | 3 | 5,236 |
| トッパン・フォームズ | 6 | 11 | 11,856 |
| フジシールインターナショナル | 6 | 13 | 28,151 |
| タカラトミー | 12 | 28 | 28,571 |
| 廣済堂 | 2 | 4 | 4,492 |
| アーク | 19 | - | - |

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 |
| プロネクサス | 2 | 5 | 6,644 |
| ホクシン | 11 | 37 | 4,366 |
| 大建工業 | 1 | 4 | 8,651 |
| 凸版印刷 | 40 | 96 | 162,888 |
| 大日本印刷 | 37 | 77 | 149,611 |
| 共同印刷 | 0.900 | 2 | 6,200 |
| N I S S H A | 5 | 13 | 18,877 |
| 光村印刷 | 1 | - | - |
| TAKARA&COMPANY | 1 | 3 | 5,409 |
| アシックス | 23 | 56 | 100,222 |
| ツツミ | 0.900 | 2 | 4,816 |
| ローランド | - | 3 | 12,950 |
| 小松ウオール工業 | 0.900 | 2 | 4,641 |
| ヤマハ | 16 | 37 | 218,683 |
| 河合楽器製作所 | 0.900 | 1 | 6,570 |
| ビジョン | 17 | 40 | 167,281 |
| オリバー | 0.700 | 1 | 4,116 |
| キングジム | 2 | 5 | 4,701 |
| リンテック | 6 | 13 | 32,844 |
| イトーキ | 6 | 12 | 4,622 |
| 任天堂 | 17 | 36 | 2,483,095 |
| 三菱鉛筆 | 4 | 10 | 14,700 |
| タカラスタンダード | 5 | 13 | 20,737 |
| コクヨ | 13 | 30 | 43,543 |
| ナカバヤシ | - | 6 | 4,216 |
| グローブライド | 1 | 3 | 12,586 |
| オカムラ | 9 | 24 | 26,288 |
| 美津濃 | 2 | 6 | 14,036 |
| 電気・ガス業(1.3%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 226 | 540 | 193,570 |
| 中部電力 | 86 | 195 | 257,887 |
| 関西電力 | 107 | 241 | 259,008 |
| 中国電力 | 39 | 91 | 119,837 |
| 北陸電力 | 26 | 58 | 39,294 |
| 東北電力 | 71 | 149 | 141,088 |
| 四国電力 | 25 | 53 | 40,333 |
| 九州電力 | 58 | 140 | 130,944 |
| 北海道電力 | 26 | 59 | 27,760 |
| 沖縄電力 | 5 | 12 | 18,066 |
| 電源開発 | 22 | 50 | 89,282 |
| エフオン | 1 | 3 | 3,668 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| イーレックス | 4 | 9 | 16,309 |
| レノバ | 4 | 10 | 36,112 |
| 東京瓦斯 | 54 | 122 | 283,573 |
| 大阪瓦斯 | 55 | 115 | 226,842 |
| 東邦瓦斯 | 14 | 31 | 203,158 |
| 北海道瓦斯 | 1 | 3 | 5,463 |
| 広島ガス | 5 | 13 | 5,029 |
| 西部瓦斯 | 3 | 7 | 21,139 |
| 静岡ガス | 8 | 18 | 17,321 |
| メタウォーター | 1 | 7 | 15,696 |
| 陸運業(3.5%) | | | |
| SBSホールディングス | 2 | 4 | 11,942 |
| 東武鉄道 | 30 | 66 | 201,856 |
| 相鉄ホールディングス | 9 | 21 | 54,158 |
| 東急 | 71 | 160 | 233,642 |
| 京浜急行電鉄 | 36 | 81 | 147,993 |
| 小田急電鉄 | 42 | 102 | 329,272 |
| 京王電鉄 | 14 | 35 | 298,328 |
| 京成電鉄 | 19 | 47 | 181,162 |
| 富士急行 | 3 | 8 | 50,373 |
| 新京成電鉄 | 0.700 | 1 | 4,265 |
| 東日本旅客鉄道 | 50 | 112 | 855,525 |
| 西日本旅客鉄道 | 25 | 56 | 358,521 |
| 東海旅客鉄道 | 23 | 53 | 932,800 |
| 西武ホールディングス | 38 | 76 | 99,686 |
| 鴻池運輸 | 4 | 10 | 11,009 |
| 西日本鉄道 | 7 | 17 | 53,365 |
| ハマキョウレックス | 2 | 4 | 16,390 |
| サカイ引越センター | 1 | 2 | 14,210 |
| 近鉄グループホールディングス | 26 | 60 | 275,424 |
| 阪急阪神ホールディングス | 35 | 80 | 291,812 |
| 南海電気鉄道 | 12 | 28 | 74,674 |
| 京阪ホールディングス | 12 | 26 | 132,079 |
| 神戸電鉄 | 0.600 | 1 | 5,152 |
| 名古屋鉄道 | 22 | 49 | 137,044 |
| 山陽電気鉄道 | 1 | 4 | 8,578 |
| 日本通運 | 9 | 20 | 166,991 |
| ヤマトホールディングス | 47 | 84 | 241,448 |
| 山九 | 7 | 15 | 69,285 |
| 丸全昭和運輸 | 2 | 4 | 15,337 |
| センコーグループホールディングス | 14 | 33 | 34,632 |

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 |
| トナミホールディングス | 0.600 | 1 | 7,616 |
| ニッコンホールディングス | 9 | 20 | 43,726 |
| 日本石油輸送 | 0.500 | 1 | 3,991 |
| 福山通運 | 3 | 7 | 33,379 |
| セイノーホールディングス | 20 | 45 | 69,336 |
| エスライン | 1 | - | - |
| 神奈川中央交通 | 0.700 | 1 | 5,737 |
| 日立物流 | 4 | 13 | 44,621 |
| 丸和運輸機関 | 2 | 12 | 27,647 |
| C&Fロジホールディングス | 2 | 6 | 10,955 |
| 九州旅客鉄道 | 24 | 46 | 119,225 |
| S Gホールディングス | 28 | 114 | 302,935 |
| 海運業(0.2%) | | | |
| 日本郵船 | 22 | 50 | 154,277 |
| 商船三井 | 17 | 35 | 120,444 |
| 川崎汽船 | 8 | 18 | 38,409 |
| N S ユナイテッド海運 | 1 | 2 | 4,660 |
| 飯野海運 | 12 | 28 | 12,729 |
| 乾汽船 | 1 | 4 | 4,301 |
| 空運業(0.5%) | | | |
| 日本航空 | 48 | 147 | 355,393 |
| ANAホールディングス | 49 | 162 | 415,476 |
| パスコ | 0.600 | 1 | 1,644 |
| 倉庫・運輸関連業(0.2%) | | | |
| トランコム | 0.800 | 1 | 14,706 |
| 日新 | 2 | 4 | 6,676 |
| 三菱倉庫 | 8 | 20 | 70,851 |
| 三井倉庫ホールディングス | 3 | 6 | 14,336 |
| 住友倉庫 | 9 | 21 | 31,747 |
| 澁澤倉庫 | 1 | 3 | 7,557 |
| 東陽倉庫 | 5 | 13 | 4,316 |
| 日本トランスシティ | 5 | 13 | 7,567 |
| ケイヒン | 1 | 3 | 4,374 |
| 中央倉庫 | 1 | - | - |
| 安田倉庫 | 2 | 5 | 4,730 |
| 東洋埠頭 | 1 | 3 | 4,284 |
| 宇徳 | 3 | 9 | 4,194 |
| 上組 | 15 | 33 | 67,669 |
| キューソー流通システム | 0.900 | 2 | 4,247 |
| 近鉄エクスプレス | 5 | 11 | 31,589 |
| 東海運 | 5 | 13 | 4,256 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| エーアイティー | 1 | 2 | 2,572 |
| 内外トランスライン | - | 3 | 4,525 |
| 情報・通信業(9.7%) | | | |
| NEC ネットズエスアイ | 2 | 20 | 39,102 |
| クロスキャット | 1 | 3 | 4,004 |
| システナ | 9 | 22 | 43,418 |
| デジタルアーツ | 1 | 3 | 39,564 |
| 日鉄ソリューションズ | 4 | 9 | 30,315 |
| キューブシステム | - | 3 | 3,867 |
| コア | 1 | 2 | 4,314 |
| ラクーンホールディングス | - | 4 | 9,816 |
| ソリトンシステムズ | - | 3 | 5,772 |
| ソフトクリエイトホールディングス | 1 | 2 | 6,245 |
| T I S | 9 | 62 | 141,500 |
| 電算システム | 1 | 2 | 7,521 |
| グリー | 17 | 38 | 23,155 |
| コーエーテックホールディングス | 5 | 12 | 81,536 |
| 三菱総合研究所 | 1 | 2 | 11,083 |
| ボルテージ | 3 | - | - |
| 電算 | 0.800 | 1 | 4,333 |
| AGS | 2 | 5 | 4,258 |
| ファインデックス | 2 | 5 | 6,476 |
| ブレインパッド | 0.700 | 1 | 8,128 |
| K L a b | 5 | 11 | 9,883 |
| ポルトワイン・ビートルホールディングス | 3 | 8 | 9,677 |
| イーブックイニシアティブジャパン | - | 1 | 3,393 |
| ネクソン | 79 | 158 | 551,420 |
| アイスタイル | 7 | 19 | 10,524 |
| エムアップホールディングス | 0.800 | 1 | 4,581 |
| エイチーム | 1 | 4 | 5,323 |
| エニグモ | 2 | 5 | 7,327 |
| テクノスジャパン | 3 | 6 | 4,296 |
| コロプラ | 9 | 20 | 18,655 |
| オルトプラス | 2 | - | - |
| ブロードリーフ | 13 | 31 | 15,903 |
| クロス・マーケティンググループ | 5 | 11 | 4,528 |
| デジタルハーツホールディングス | 1 | - | - |
| システム情報 | 2 | 4 | 5,005 |
| メディアドゥ | 0.900 | 2 | 14,928 |
| じげん | 6 | 15 | 6,293 |
| ブイキューブ | - | 3 | 9,414 |

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 |
| サイバーリンクス | － | 2 | 4,014 |
| フィックスターズ | 3 | 6 | 6,720 |
| CARTAHOLDINGS | 1 | 3 | 4,857 |
| オプティム | 0.700 | 4 | 13,992 |
| セレス | 1 | 2 | 9,145 |
| SHIFT | 0.700 | 2 | 41,300 |
| ティーガイア | 2 | 6 | 12,575 |
| セック | 0.500 | 1 | 4,233 |
| 日本アジアグループ | － | 6 | 7,476 |
| 豆蔵ホールディングス | 1 | － | － |
| テクマトリックス | 2 | 9 | 16,984 |
| プロシップ | 1 | 2 | 3,932 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 6 | 15 | 35,681 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 4 | 13 | 210,539 |
| ザッパラス | 4 | 8 | 4,129 |
| インターネットイニシアティブ | 4 | 16 | 38,362 |
| さくらインターネット | 3 | 6 | 4,562 |
| ヴェンクス | － | 3 | 3,983 |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 0.700 | 1 | 11,844 |
| SRAホールディングス | 1 | 3 | 8,586 |
| 朝日ネット | 2 | 5 | 4,273 |
| eBASE | 1 | 7 | 6,975 |
| アバント | 2 | 6 | 9,440 |
| アドソル日進 | 1 | 2 | 6,023 |
| フリービット | 2 | 4 | 4,091 |
| コムチュア | 3 | 5 | 16,455 |
| サイバーコム | 0.900 | 2 | 3,972 |
| アステリア | 3 | 4 | 4,122 |
| アイル | 1 | 3 | 5,754 |
| マークラインズ | 1 | 2 | 6,240 |
| メディカル・データ・ビジョン | 2 | 7 | 15,321 |
| gumi | 3 | 8 | 8,604 |
| モバイルファクトリー | 1 | 3 | 3,955 |
| テラスカイ | 1 | 2 | 7,800 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 1 | 2 | 4,603 |
| PCIホールディングス | 0.800 | － | － |
| PRTIMES | 0.500 | 1 | 4,433 |
| ランドコンピュータ | 1 | 3 | 4,169 |
| ダブルスタンダード | 0.400 | 0.900 | 3,739 |
| オープンドア | 1 | 3 | 8,639 |
| アカツキ | 1 | 2 | 10,850 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| Ubicomホールディングス | 1 | 1 | 4,976 |
| LINE | 6 | － | － |
| カナミックネットワーク | － | 5 | 4,506 |
| チェンジ | 0.600 | 8 | 30,145 |
| シンクロ・フード | 3 | 11 | 4,319 |
| オークネット | 1 | 3 | 4,448 |
| AOITYOHOLDINGS | 2 | 9 | 4,483 |
| マクロミル | 5 | 12 | 11,174 |
| ビーグリー | 1 | － | － |
| オロ | 0.700 | 2 | 7,900 |
| ユーザーローカル | － | 1 | 4,620 |
| プロトコーポレーション | 2 | 5 | 6,557 |
| ハイマックス | － | 3 | 5,871 |
| 野村総合研究所 | 39 | 114 | 406,766 |
| サイバネットシステム | － | 4 | 3,766 |
| CEホールディングス | 3 | 6 | 3,610 |
| インテジホールディングス | 3 | 7 | 9,336 |
| 東邦システムサイエンス | 2 | 4 | 4,171 |
| ソースネクスト | 13 | 29 | 10,008 |
| インフォコム | 3 | 5 | 16,005 |
| HEROZ | － | 1 | 6,372 |
| ラクスル | 1 | 5 | 19,431 |
| FIG | 6 | 16 | 4,330 |
| イーソル | 1 | 3 | 4,800 |
| アルテリア・ネットワークス | 3 | 6 | 10,812 |
| EDULAB | － | 0.600 | 4,326 |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | 1 | 2 | 4,435 |
| トビラシステムズ | － | 3 | 4,824 |
| ギフトィ | － | 2 | 12,460 |
| フォーカスシステムズ | 1 | 4 | 4,011 |
| クレスコ | 1 | 4 | 5,959 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 26 | 64 | 85,668 |
| オービック | 9 | 19 | 381,195 |
| ジャストシステム | 4 | 8 | 62,033 |
| TDCソフト | 2 | 5 | 5,219 |
| Zホールディングス | 382 | 859 | 567,997 |
| トレンドマイクロ | 12 | 33 | 188,376 |
| IDホールディングス | 1 | 3 | 4,141 |
| 日本オラクル | 5 | 12 | 151,511 |
| アルファシステムズ | 0.900 | 1 | 6,120 |
| フューチャー | 3 | 7 | 14,250 |

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 |
| CACHoldings | 1 | 4 | 5,891 |
| S Bテクノロジー | 1 | 2 | 6,600 |
| トーセ | 1 | 5 | 4,232 |
| オーピックビジネスコンサルタント | 2 | 6 | 40,576 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 12 | 28 | 97,897 |
| アイティフォー | 3 | 8 | 7,076 |
| 東計電算 | 0.400 | 1 | 4,285 |
| エックスネット | 1 | - | - |
| 大塚商会 | 15 | 33 | 173,732 |
| サイボウズ | 3 | 7 | 18,228 |
| 電通国際情報サービス | 1 | 7 | 29,491 |
| ACCESS | - | 5 | 4,926 |
| デジタルガレージ | 5 | 10 | 45,783 |
| イーエムシステムズ | 3 | 10 | 8,816 |
| ウェザーニューズ | 0.900 | 1 | 10,070 |
| C I J | 2 | 4 | 4,098 |
| ビジネスエンジニアリング | 0.500 | 1 | 4,199 |
| 日本エンタープライズ | 6 | 17 | 4,386 |
| WOWOW | 1 | 3 | 8,616 |
| スカラ | 2 | 5 | 4,048 |
| IMAGICAGROUP | 3 | 10 | 5,489 |
| ネットワンシステムズ | 10 | 25 | 84,150 |
| システムソフト | 18 | 44 | 6,007 |
| アルゴグラフィックス | 2 | 4 | 14,945 |
| マーベラス | 4 | 9 | 9,375 |
| エイベックス | 4 | 10 | 16,124 |
| 日本ユニシス | 8 | 21 | 70,416 |
| 兼松エレクトロニクス | 1 | 3 | 12,427 |
| 都築電気 | - | 2 | 3,840 |
| TBSホールディングス | 17 | 41 | 85,199 |
| 日本テレビホールディングス | 23 | 52 | 73,967 |
| 朝日放送グループホールディングス | 2 | 6 | 4,482 |
| テレビ朝日ホールディングス | 7 | 19 | 41,765 |
| スカパーJ SATホールディングス | 18 | 41 | 18,952 |
| テレビ東京ホールディングス | 2 | 4 | 11,417 |
| 日本BS放送 | 1 | 3 | 4,204 |
| ビジョン | 2 | 7 | 7,714 |
| USEN-NEXTHOLDINGS | 1 | 2 | 4,684 |
| コネクシオ | 1 | 3 | 4,886 |
| 日本通信 | 21 | 55 | 14,267 |
| 日本電信電話 | 372 | 731 | 2,062,014 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| KDDI | 207 | 501 | 1,700,925 |
| ソフトバンク | 253 | 568 | 823,188 |
| 光通信 | 2 | 7 | 156,880 |
| NTTドコモ | 206 | - | - |
| エムティーアイ | 2 | 6 | 5,239 |
| GMOインターネット | 11 | 22 | 81,648 |
| ファイバーゲート | - | 2 | 4,264 |
| アйдママーケティングコミュニケーション | - | 9 | 4,656 |
| KADOKAWA | 7 | 16 | 70,224 |
| 学研ホールディングス | 0.900 | 8 | 13,314 |
| ゼンリン | 5 | 11 | 15,311 |
| インプレスホールディングス | 10 | 22 | 4,452 |
| アイネット | 1 | 3 | 4,825 |
| 松竹 | 1 | 4 | 64,083 |
| 東宝 | 16 | 36 | 156,087 |
| 東映 | 1 | 2 | 42,600 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 74 | 166 | 269,230 |
| ピー・シー・エー | - | 0.900 | 3,807 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 0.600 | 2 | 4,272 |
| DT S | 6 | 13 | 31,278 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 11 | 26 | 173,817 |
| シーイーシー | 3 | 6 | 9,815 |
| カプコン | 13 | 26 | 179,560 |
| アイ・エス・ビー | 0.900 | 3 | 3,840 |
| ジャステック | 1 | 4 | 5,008 |
| S C S K | 6 | 14 | 94,464 |
| 日本システムウエア | 0.900 | 2 | 4,311 |
| アイネス | 2 | 6 | 8,521 |
| T K C | 2 | 5 | 35,298 |
| 富士ソフト | 3 | 6 | 37,654 |
| NSD | 9 | 20 | 38,471 |
| コナミホールディングス | 10 | 22 | 169,342 |
| 福井コンピュータホールディングス | 1 | 2 | 10,512 |
| J B C Cホールディングス | 1 | 4 | 6,127 |
| ミロク情報サービス | 2 | 6 | 13,925 |
| ソフトバンクグループ | 221 | 496 | 5,226,039 |
| 卸売業(4.6%) | | | |
| 高千穂交易 | 1 | - | - |
| オルパルスケアホールディングス | - | 2 | 4,212 |
| 伊藤忠食品 | 0.700 | 1 | 7,905 |
| エレマテック | 2 | 5 | 4,940 |

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 |
| JALUX | 0.800 | — | — |
| あらた | 2 | 5 | 23,175 |
| トーメンデバイス | 0.500 | 1 | 4,367 |
| 東京エレクトロデバイス | 1 | 2 | 8,221 |
| フィールズ | 3 | — | — |
| 双日 | 154 | 346 | 97,450 |
| アルフレッサホールディングス | 31 | 65 | 141,332 |
| 横浜冷凍 | 7 | 16 | 14,776 |
| ラサ商事 | 2 | 4 | 4,199 |
| アルコニックス | 3 | 6 | 10,941 |
| 神戸物産 | 9 | 43 | 126,609 |
| あいホールディングス | 4 | 9 | 18,369 |
| ディーブイエックス | 1 | 4 | 4,280 |
| ダイワボウホールディングス | 2 | 5 | 46,341 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 6 | 15 | 31,665 |
| ラクト・ジャパン | 1 | 2 | 7,136 |
| グリムス | — | 1 | 2,452 |
| バイタルケーエスケーホールディングス | 5 | 10 | 8,611 |
| 八洲電機 | 2 | 4 | 4,564 |
| メディアスホールディングス | — | 5 | 4,373 |
| レスターホールディングス | 2 | 6 | 13,357 |
| ジュテックホールディングス | 1 | 4 | 4,333 |
| OCHIホールディングス | 1 | 3 | 4,310 |
| TOKAIホールディングス | 14 | 30 | 29,062 |
| 黒谷 | 3 | — | — |
| Cominix | 2 | 5 | 4,246 |
| 三洋貿易 | 2 | 6 | 6,791 |
| ビューティガレージ | 0.900 | 1 | 4,302 |
| ウイン・パートナーズ | 2 | 4 | 5,242 |
| シップヘルスケアホールディングス | 4 | 11 | 65,268 |
| 明治電機工業 | 1 | 2 | 3,815 |
| コメダホールディングス | 6 | 13 | 26,550 |
| アセンテック | — | 2 | 3,715 |
| 富士興産 | 2 | — | — |
| 協栄産業 | 1 | 3 | 4,296 |
| 小野建 | 2 | 5 | 7,408 |
| 佐鳥電機 | 2 | 5 | 4,277 |
| 伯東 | 1 | 3 | 4,871 |
| コンドーテック | 2 | 4 | 5,233 |
| 中山福 | — | 7 | 3,929 |
| ナガイレーベン | 4 | 8 | 23,115 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三菱食品 | 3 | 6 | 20,437 |
| 松田産業 | 2 | 4 | 8,928 |
| 第一興商 | 4 | 9 | 38,269 |
| メディパルホールディングス | 30 | 62 | 140,644 |
| SPK | 0.700 | 3 | 4,184 |
| 萩原電気ホールディングス | 1 | 2 | 5,945 |
| アズワン | 1 | 4 | 66,420 |
| スズデン | 1 | 3 | 4,311 |
| シモジマ | 1 | 3 | 5,316 |
| ドウシシャ | 2 | 5 | 10,808 |
| 小津産業 | 1 | 2 | 4,221 |
| 高速 | 1 | 3 | 5,095 |
| 丸文 | 2 | 7 | 3,967 |
| ハピネット | 2 | 5 | 7,982 |
| 橋本総業ホールディングス | — | 1 | 4,155 |
| 日本ライフライン | 8 | 20 | 26,796 |
| マルカ | 1 | 2 | 4,437 |
| IDOM | 7 | 21 | 13,440 |
| 進和 | 1 | 3 | 7,943 |
| ダイトロン | 1 | 2 | 4,074 |
| シークス | 3 | 8 | 14,048 |
| 田中商事 | 2 | 6 | 4,212 |
| オーハシテクニカ | 1 | 3 | 4,624 |
| 白銅 | 1 | 3 | 4,179 |
| ダイコー通産 | — | 2 | 3,946 |
| 伊藤忠商事 | 195 | 439 | 1,427,075 |
| 丸紅 | 291 | 619 | 486,984 |
| 高島 | 0.900 | 2 | 4,282 |
| 長瀬産業 | 15 | 35 | 61,422 |
| 蝶理 | 1 | 4 | 6,324 |
| 豊田通商 | 31 | 63 | 290,575 |
| 三共生興 | 4 | 9 | 4,740 |
| 兼松 | 10 | 25 | 34,838 |
| 三井物産 | 246 | 509 | 1,128,952 |
| 日本紙パルプ商事 | 1 | 3 | 12,094 |
| 日立ハイテク | 9 | — | — |
| カメイ | 3 | 8 | 9,782 |
| 東都水産 | 0.600 | — | — |
| OUGホールディングス | 0.700 | 1 | 4,231 |
| スターゼン | 1 | 2 | 9,913 |
| 山善 | 10 | 24 | 24,745 |

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 |
| 椿本興業 | 0.500 | 1 | 4,536 |
| 住友商事 | 176 | 396 | 620,251 |
| 内田洋行 | 1 | 2 | 11,387 |
| 三菱商事 | 196 | 382 | 1,140,209 |
| 第一実業 | 1 | 2 | 12,020 |
| キャノンマーケティングジャパン | 8 | 15 | 37,237 |
| 西華産業 | 1 | 3 | 4,613 |
| 佐藤商事 | 2 | 5 | 5,194 |
| 菱洋エレクトロ | 2 | 4 | 13,588 |
| 東京産業 | 3 | 6 | 4,643 |
| ユアサ商事 | 2 | 6 | 19,712 |
| 神鋼商事 | 0.700 | 2 | 4,413 |
| 阪和興業 | 5 | 12 | 35,998 |
| 正栄食品工業 | 1 | 4 | 16,031 |
| カナデン | 2 | 5 | 6,456 |
| 菱電商事 | 2 | 4 | 7,078 |
| フルサト工業 | 1 | 3 | 4,362 |
| 岩谷産業 | 6 | 15 | 96,036 |
| 昭光通商 | 2 | 6 | 4,888 |
| イワキ | 3 | 8 | 5,084 |
| 三愛石油 | 6 | 15 | 16,693 |
| 稲畑産業 | 6 | 15 | 23,133 |
| 明和産業 | — | 9 | 4,342 |
| ヤマエ久野 | — | 4 | 4,889 |
| ワキタ | 6 | 12 | 12,623 |
| 東邦ホールディングス | 9 | 20 | 39,576 |
| サンゲツ | 7 | 16 | 27,107 |
| ミツロコグループホールディングス | 4 | 9 | 11,643 |
| シナネンホールディングス | 1 | 2 | 7,429 |
| 伊藤忠エネクス | 6 | 13 | 14,358 |
| サンリオ | 7 | 17 | 30,307 |
| サンワテクノス | 2 | 4 | 4,292 |
| リョーサン | 3 | 6 | 15,690 |
| 新光商事 | 4 | 8 | 6,604 |
| トーヨー | 1 | 2 | 5,124 |
| 三信電気 | 1 | 3 | 6,898 |
| 東陽テクニカ | 3 | 6 | 7,577 |
| モスフードサービス | 3 | 8 | 27,768 |
| 加賀電子 | 2 | 5 | 13,611 |
| ソーダニッカ | 2 | 7 | 4,273 |
| 立花エレテック | 2 | 4 | 7,240 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フォーバル | — | 5 | 4,383 |
| PALTAC | 4 | 10 | 57,469 |
| 三谷産業 | 5 | 9 | 4,233 |
| 西本Wismettacホールディングス | 0.500 | — | — |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス | 0.800 | — | — |
| 国際紙パルプ商事 | 6 | 17 | 4,318 |
| ヤマタネ | 1 | 3 | 4,470 |
| 丸紅建材リース | 1 | 2 | 4,488 |
| 日鉄物産 | 2 | 4 | 17,707 |
| 泉州電業 | 0.900 | 1 | 6,615 |
| トラスコ中山 | 5 | 14 | 38,404 |
| オートバックスセブン | 10 | 23 | 33,342 |
| モリト | 2 | 6 | 4,236 |
| 加藤産業 | 4 | 9 | 33,624 |
| イノテック | 1 | 3 | 4,350 |
| イエローハット | 5 | 11 | 20,765 |
| JKホールディングス | 2 | 5 | 4,634 |
| 日伝 | 2 | 5 | 11,434 |
| 北沢産業 | 6 | 15 | 4,158 |
| 杉本商事 | 1 | 3 | 7,756 |
| 因幡電機産業 | 8 | 16 | 42,585 |
| 東テク | 0.900 | 2 | 5,840 |
| ミスミグループ本社 | 35 | 78 | 271,908 |
| タキヒヨー | 1 | 2 | 4,155 |
| 蔵王産業 | 1 | 3 | 4,309 |
| スズケン | 11 | 26 | 113,449 |
| ジェコス | 1 | 4 | 4,224 |
| 小売業(4.7%) | | | |
| ローソン | 7 | 15 | 81,885 |
| サンエー | 2 | 4 | 19,834 |
| カワチ薬品 | 2 | 4 | 13,085 |
| エービーシー・マート | 4 | 9 | 60,074 |
| ハードオフコーポレーション | 2 | 5 | 4,444 |
| アスクル | 2 | 5 | 20,542 |
| ゲオホールディングス | 5 | 8 | 9,844 |
| アダストリア | 3 | 8 | 17,887 |
| ジーフット | 2 | 10 | 4,231 |
| くら寿司 | 1 | 3 | 28,268 |
| キャンドウ | 1 | 3 | 5,745 |
| バルグループホールディングス | 1 | 5 | 9,020 |
| エディオン | 12 | 26 | 28,621 |

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 |
| サーラコーポレーション | 5 | 12 | 7,416 |
| ハローズ | 1 | 2 | 7,200 |
| フジオフードグループ本社 | 2 | 5 | 6,868 |
| あみやき亭 | 0.600 | 1 | 4,401 |
| ひらまつ | 6 | - | - |
| 大黒天物産 | 0.700 | 1 | 9,255 |
| ハニーズホールディングス | 2 | 5 | 5,165 |
| アルペン | 2 | 4 | 11,136 |
| クオールホールディングス | 4 | 8 | 12,282 |
| ジンズホールディングス | 1 | 3 | 24,156 |
| ビックカメラ | 16 | 37 | 44,044 |
| DCMホールディングス | 15 | 38 | 42,608 |
| ペッパーフードサービス | 2 | - | - |
| MonotaRO | 19 | 44 | 305,956 |
| 東京一番フーズ | 3 | 7 | 4,291 |
| DDホールディングス | 1 | - | - |
| きちりホールディングス | 2 | 7 | 4,377 |
| アーランドサービスホールディングス | 2 | 5 | 11,159 |
| J. フロントリテイリング | 33 | 75 | 75,900 |
| ドトール・日レスホールディングス | 4 | 9 | 16,384 |
| マツモトキヨシホールディングス | 11 | 26 | 111,280 |
| ブロンコビリー | 1 | 3 | 7,652 |
| ZOZO | 19 | 37 | 132,830 |
| トレジャー・ファクトリー | - | 5 | 4,605 |
| 物語コーポレーション | 0.700 | 1 | 20,910 |
| ココカラファイン | 2 | 5 | 41,664 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 48 | 109 | 80,373 |
| Hamee | 0.600 | 2 | 3,845 |
| ウエルシアホールディングス | 8 | 33 | 120,018 |
| クリエイトSDホールディングス | 4 | 9 | 31,573 |
| 丸善CHIホールディングス | 5 | 11 | 4,206 |
| ミサワ | 2 | 5 | 3,801 |
| ティーライフ | 2 | 3 | 4,402 |
| チムニー | 0.900 | 3 | 4,760 |
| シュッピン | 1 | 4 | 4,853 |
| オイシックス・ラ・大地 | - | 6 | 18,110 |
| ネクステージ | 4 | 10 | 18,414 |
| ジョイフル本田 | 8 | 18 | 26,036 |
| 鳥貴族ホールディングス | 0.900 | 2 | 4,925 |
| キリン堂ホールディングス | 1 | - | - |
| ホットランド | 1 | 4 | 5,766 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---------------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| すかいらーくホールディングス | 31 | 70 | 115,315 |
| SFPホールディングス | 1 | 2 | 3,036 |
| 綿半ホールディングス | 1 | 4 | 5,931 |
| コイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 8 | 18 | 20,511 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 2 | 4 | 6,067 |
| B E E N O S | 1 | 2 | 7,577 |
| あさひ | 2 | 4 | 7,115 |
| 日本調剤 | 0.800 | 3 | 6,061 |
| コスモス薬品 | 1 | 6 | 99,918 |
| オンリー | 2 | 9 | 4,287 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 109 | 245 | 1,032,011 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 7 | 33 | 28,308 |
| ツルハホールディングス | 6 | 13 | 193,307 |
| サンマルクホールディングス | 2 | 5 | 8,130 |
| フェリシモ | 1 | 3 | 4,197 |
| トリドールホールディングス | 3 | 15 | 23,327 |
| TOKYOBASE | 3 | 9 | 6,498 |
| JMホールディングス | 1 | 4 | 9,624 |
| サツドラホールディングス | 1 | - | - |
| アレンザホールディングス | - | 3 | 4,953 |
| パロックジャパンリミテッド | 1 | 5 | 4,575 |
| クスリのアオキホールディングス | 2 | 6 | 54,808 |
| スシローグローバルホールディングス | 3 | 34 | 147,487 |
| LIXILビバ | 2 | - | - |
| メディカルシステムネットワーク | 3 | 7 | 5,197 |
| ノジマ | 5 | 11 | 32,603 |
| カッパ・クリエイト | 3 | 8 | 13,296 |
| ライトオン | 3 | 6 | 4,311 |
| 良品計画 | 37 | 83 | 209,751 |
| アドヴァン | 4 | 6 | 7,161 |
| アルビス | 1 | 2 | 4,912 |
| コナカ | 4 | 13 | 5,023 |
| G-7ホールディングス | 1 | 3 | 8,565 |
| イオン北海道 | 2 | 8 | 9,578 |
| コジマ | 4 | 10 | 6,966 |
| ヒマラヤ | 2 | 4 | 4,086 |
| コーナン商事 | 4 | 8 | 26,833 |
| エコス | 1 | 2 | 4,496 |
| ワタミ | 3 | 8 | 8,358 |
| マルシェ | 2 | 8 | 4,377 |
| バ・バ・フィク・インターナショナルホールディングス | 61 | 125 | 320,025 |

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 | |
| 西松屋チェーン | 6 | 13 | 21,279 | |
| ゼンショーホールディングス | 13 | 33 | 97,224 | |
| 幸楽苑ホールディングス | 1 | 4 | 7,196 | |
| サイゼリヤ | 4 | 9 | 20,413 | |
| V Tホールディングス | 11 | 23 | 10,006 | |
| ユナイテッドアローズ | 2 | 7 | 14,630 | |
| ハイデイ日高 | 4 | 9 | 16,398 | |
| 京都きもの友禅 | 5 | 19 | 4,819 | |
| コロワイド | 9 | 20 | 41,674 | |
| ピーシーデポコーポレーション | 3 | 7 | 3,936 | |
| 壱番屋 | 2 | 4 | 21,956 | |
| P L A N T | 3 | - | - | |
| スギホールディングス | 5 | 12 | 93,125 | |
| 薬王堂ホールディングス | 1 | 2 | 7,333 | |
| ヴィア・ホールディングス | 3 | - | - | |
| スクロール | 5 | 9 | 11,259 | |
| ヨンドシーホールディングス | 2 | 5 | 11,350 | |
| ファミリーマート | 22 | - | - | |
| 木曽路 | 3 | 8 | 20,122 | |
| S R Sホールディングス | 3 | 7 | 6,786 | |
| 千趣会 | 5 | - | - | |
| リテールパートナーズ | - | 7 | 11,270 | |
| ケーヨー | 5 | 11 | 8,769 | |
| 上新電機 | 3 | 7 | 22,940 | |
| 日本瓦斯 | 4 | 10 | 51,706 | |
| ロイヤルホールディングス | 4 | 11 | 20,735 | |
| 東天紅 | 1 | 4 | 4,418 | |
| いなげや | 3 | 7 | 11,795 | |
| 島忠 | 5 | 4 | 23,016 | |
| チヨダ | 2 | 6 | 6,606 | |
| ライフコーポレーション | 2 | 4 | 15,888 | |
| リンガーハット | 3 | 7 | 18,518 | |
| MrMaxHD | 3 | 8 | 6,604 | |
| テンアライド | 4 | 12 | 4,412 | |
| AOKIホールディングス | 5 | 12 | 8,227 | |
| オークワ | 4 | 9 | 11,711 | |
| コメリ | 4 | 9 | 28,605 | |
| 青山商事 | 5 | 14 | 10,892 | |
| しまむら | 3 | 7 | 83,439 | |
| はせがわ | 4 | 14 | 4,219 | |
| 高島屋 | 20 | 45 | 48,076 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------|---------|-----|---------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 松屋 | 5 | 13 | 13,206 | |
| エイチ・ツー・オーリテイリング | 13 | 29 | 25,007 | |
| 近鉄百貨店 | 1 | 2 | 8,100 | |
| 丸井グループ | 25 | 53 | 109,492 | |
| アクシアルリテイリング | 2 | 5 | 24,908 | |
| イオン | 107 | 241 | 857,680 | |
| イズミ | 5 | 12 | 50,048 | |
| 平和堂 | 5 | 11 | 23,884 | |
| フジ | 3 | 7 | 15,078 | |
| ヤオコー | 3 | 7 | 47,357 | |
| ゼビオホールディングス | 3 | 7 | 7,075 | |
| ケーズホールディングス | 27 | 55 | 85,135 | |
| GenkyDrugStores | 1 | 2 | 10,066 | |
| 総合メディカルホールディングス | 2 | - | - | |
| ブックオフグループホールディングス | 1 | 4 | 4,341 | |
| アインホールディングス | 3 | 9 | 64,974 | |
| 元氣寿司 | 0.700 | 1 | 4,528 | |
| ヤマダホールディングス | 85 | 210 | 114,036 | |
| アークランドサカモト | 4 | 9 | 15,807 | |
| ニトリホールディングス | 12 | 24 | 515,056 | |
| グルメ杵屋 | 2 | 4 | 4,432 | |
| 愛眼 | 7 | 18 | 4,232 | |
| 吉野家ホールディングス | 9 | 20 | 45,423 | |
| 松屋フーズホールディングス | 1 | 3 | 11,025 | |
| サガミホールディングス | 3 | 8 | 9,919 | |
| 関西スーパーマーケット | 2 | 4 | 5,381 | |
| 王将フードサービス | 2 | 4 | 23,985 | |
| プレナス | 3 | 7 | 13,461 | |
| ミニストップ | 2 | 4 | 6,716 | |
| アークス | 5 | 12 | 28,848 | |
| パローホールディングス | 6 | 12 | 30,041 | |
| ベルク | 1 | 3 | 17,701 | |
| 大庄 | 1 | 4 | 4,450 | |
| ファーストリテイリング | 3 | 8 | 881,160 | |
| サンドラッグ | 10 | 23 | 95,816 | |
| サックスパーホールディングス | 2 | 7 | 4,728 | |
| やまや | 0.800 | 1 | 4,265 | |
| ベルーナ | 6 | 13 | 13,999 | |
| 銀行業(4.9%) | | | | |
| 島根銀行 | 2 | 6 | 4,209 | |
| じもとホールディングス | 18 | 5 | 4,144 | |

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 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 145 | 326 | 76,447 | |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 3 | 7 | 9,724 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 46 | 128 | 57,908 | |
| ゆうちょ銀行 | 79 | 178 | 179,168 | |
| 富山第一銀行 | 6 | 15 | 4,455 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 164 | 383 | 163,158 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 19 | 41 | 29,678 | |
| 関西みらいフィナンシャルグループ | 16 | 29 | 18,024 | |
| 三十三フィナンシャルグループ | 2 | 5 | 7,392 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 4 | 10 | 23,806 | |
| ひろぎんホールディングス | — | 92 | 60,255 | |
| 新生銀行 | 20 | 51 | 79,053 | |
| あおぞら銀行 | 16 | 37 | 86,287 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 1,929 | 4,301 | 2,422,753 | |
| りそなホールディングス | 307 | 683 | 298,298 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 53 | 118 | 429,224 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 193 | 435 | 1,637,657 | |
| 千葉銀行 | 96 | 209 | 149,167 | |
| 群馬銀行 | 55 | 129 | 45,031 | |
| 武蔵野銀行 | 4 | 9 | 15,124 | |
| 千葉興業銀行 | 7 | 17 | 4,732 | |
| 筑波銀行 | 11 | 26 | 4,880 | |
| 七十七銀行 | 9 | 19 | 28,407 | |
| 青森銀行 | 2 | 4 | 12,063 | |
| 秋田銀行 | 1 | 3 | 5,445 | |
| 山形銀行 | 3 | 7 | 7,916 | |
| 岩手銀行 | 1 | 4 | 8,782 | |
| 東邦銀行 | 25 | 56 | 11,970 | |
| みちのく銀行 | 1 | 4 | 4,370 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 23 | 56 | 114,987 | |
| 静岡銀行 | 69 | 153 | 122,173 | |
| 十六銀行 | 3 | 7 | 15,800 | |
| スルガ銀行 | 28 | 55 | 19,891 | |
| 八十二銀行 | 67 | 141 | 51,825 | |
| 山梨中央銀行 | 3 | 7 | 6,613 | |
| 大垣共立銀行 | 5 | 12 | 25,962 | |
| 福井銀行 | 2 | 5 | 10,470 | |
| 北國銀行 | 2 | 5 | 15,602 | |
| 清水銀行 | 1 | 2 | 4,308 | |
| 富山銀行 | 0.800 | 1 | 4,414 | |
| 滋賀銀行 | 5 | 12 | 25,905 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | |
|-------------------------|---------|-----|-----------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 南都銀行 | 4 | 9 | 16,891 | |
| 百五銀行 | 25 | 56 | 17,602 | |
| 京都銀行 | 10 | 22 | 148,725 | |
| 紀陽銀行 | 9 | 22 | 32,245 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 18 | 41 | 40,894 | |
| 広島銀行 | 41 | — | — | |
| 山陰合同銀行 | 16 | 39 | 19,681 | |
| 中国銀行 | 24 | 54 | 47,067 | |
| 鳥取銀行 | 1 | 3 | 4,282 | |
| 伊予銀行 | 40 | 83 | 53,395 | |
| 百十四銀行 | 3 | 6 | 10,713 | |
| 四国銀行 | 4 | 8 | 6,550 | |
| 阿波銀行 | 4 | 9 | 22,051 | |
| 大分銀行 | 1 | 3 | 7,758 | |
| 宮崎銀行 | 1 | 3 | 8,927 | |
| 佐賀銀行 | 1 | 3 | 5,097 | |
| 沖縄銀行 | 2 | 5 | 16,350 | |
| 琉球銀行 | 6 | 13 | 10,809 | |
| セブン銀行 | 93 | 210 | 51,054 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 3,808 | 854 | 1,357,214 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 35 | 78 | 52,830 | |
| 長野銀行 | 1 | 3 | 4,313 | |
| 名古屋銀行 | 2 | 5 | 14,494 | |
| 北洋銀行 | 42 | 94 | 22,467 | |
| 愛知銀行 | 1 | 2 | 6,159 | |
| 中京銀行 | 1 | 2 | 4,105 | |
| 大光銀行 | 1 | 3 | 4,550 | |
| 愛媛銀行 | 4 | 8 | 8,808 | |
| 京葉銀行 | 11 | 26 | 11,684 | |
| 栃木銀行 | 13 | 30 | 5,472 | |
| 北日本銀行 | 0.900 | 2 | 4,250 | |
| 東和銀行 | 4 | 11 | 7,645 | |
| トモニホールディングス | 21 | 48 | 15,163 | |
| フィデアホールディングス | 27 | 61 | 7,625 | |
| 池田泉州ホールディングス | 32 | 72 | 11,784 | |
| 証券・商品先物取引業(0.8%) | | | | |
| F P G | 8 | 19 | 11,911 | |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | — | 3 | 4,858 | |
| S B Iホールディングス | 31 | 77 | 240,552 | |
| ジャフコグループ | 4 | 9 | 66,542 | |
| 大和証券グループ本社 | 224 | 470 | 249,106 | |

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 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 野村ホールディングス | 493 | 960 | 606,816 | |
| 岡三証券グループ | 23 | 53 | 22,404 | |
| 丸三証券 | 8 | 18 | 11,687 | |
| 東洋証券 | 12 | 27 | 5,067 | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 32 | 67 | 25,996 | |
| 光世証券 | 3 | 6 | 4,639 | |
| 水戸証券 | 8 | 16 | 5,124 | |
| いちよし証券 | 5 | 12 | 8,026 | |
| 松井証券 | 16 | 30 | 28,520 | |
| だいら証券ビジネス | 2 | - | - | |
| マネックスグループ | 21 | 56 | 54,933 | |
| 極東証券 | 3 | 8 | 6,980 | |
| 岩井コスモホールディングス | 2 | 6 | 10,220 | |
| 藍澤證券 | 5 | 11 | 9,944 | |
| スパークス・グループ | 9 | 29 | 9,773 | |
| 保険業(1.9%) | | | | |
| かんぽ生命保険 | 9 | 77 | 169,198 | |
| SOMPOホールディングス | 52 | 110 | 456,939 | |
| アニコムホールディングス | 2 | 17 | 19,080 | |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 73 | 152 | 478,409 | |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 23 | - | - | |
| 第一生命ホールディングス | 158 | 332 | 631,844 | |
| 東京海上ホールディングス | 100 | 208 | 1,115,148 | |
| T & Dホールディングス | 83 | 187 | 275,649 | |
| アドバンスクリエイト | 0.700 | 1 | 2,545 | |
| その他金融業(1.1%) | | | | |
| 全国保証 | 7 | 16 | 84,624 | |
| イントラスト | - | 5 | 3,677 | |
| 日本モーゲージサービス | 0.800 | - | - | |
| アルヒ | 4 | 9 | 15,261 | |
| プレミアグループ | 1 | 2 | 7,052 | |
| クレディセゾン | 19 | 36 | 48,554 | |
| 芙蓉総合リース | 2 | 6 | 47,454 | |
| みずほリース | 4 | 9 | 32,737 | |
| 東京センチュリー | 5 | 14 | 107,310 | |
| 日本証券金融 | 12 | 26 | 16,252 | |
| アイフル | 42 | 105 | 29,434 | |
| リコーリース | 2 | 4 | 16,170 | |
| イオンフィナンシャルサービス | 17 | 38 | 53,784 | |
| アコム | 56 | 126 | 59,787 | |
| ジャックス | 3 | 6 | 14,372 | |

| 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 |
| オリエントコーポレーション | 75 | 170 | 26,195 | |
| 日立キャピタル | 6 | 14 | 42,979 | |
| アプラスフィナンシャル | 21 | - | - | |
| オリックス | 175 | 390 | 695,938 | |
| 三菱UFJリース | 71 | 141 | 81,251 | |
| 九州リースサービス | 3 | 6 | 4,372 | |
| 日本取引所グループ | 80 | 169 | 408,694 | |
| イー・ギャランティ | 3 | 7 | 15,638 | |
| アサックス | 2 | 5 | 4,212 | |
| NECキャピタルソリューション | 1 | 2 | 5,200 | |
| 不動産業(1.9%) | | | | |
| いちご | 35 | 70 | 23,660 | |
| 日本駐車場開発 | 30 | 62 | 8,818 | |
| スター・マイカ・ホールディングス | 1 | 3 | 4,417 | |
| ADワークスグループ | - | 26 | 4,207 | |
| ヒューリック | 59 | 133 | 159,946 | |
| 三栄建築設計 | 1 | 2 | 4,482 | |
| 野村不動産ホールディングス | 17 | 38 | 92,253 | |
| 三重交通グループホールディングス | 5 | 12 | 6,184 | |
| サムティ | 4 | 8 | 15,761 | |
| ディア・ライフ | 3 | 9 | 4,066 | |
| コーセーアールイー | 2 | 6 | 3,788 | |
| 日本商業開発 | 1 | 4 | 6,600 | |
| プレサンスコーポレーション | 4 | 10 | 15,480 | |
| ユニゾホールディングス | 4 | - | - | |
| THEグローバル社 | 3 | - | - | |
| 日本管理センター | 1 | 3 | 4,399 | |
| サンセイランディック | 2 | 5 | 4,377 | |
| エストラスト | 2 | 5 | 4,194 | |
| フージャースホールディングス | 5 | 10 | 7,127 | |
| オープンハウス | 8 | 19 | 81,180 | |
| 東急不動産ホールディングス | 76 | 171 | 115,938 | |
| 飯田グループホールディングス | 23 | 52 | 128,327 | |
| イーグランド | 2 | 5 | 4,416 | |
| ムゲンエステート | 2 | 9 | 4,489 | |
| ハウスドゥ | 1 | 3 | 4,212 | |
| ケイアイスター不動産 | - | 2 | 7,350 | |
| アグレ都市デザイン | 3 | - | - | |
| グッドコムアセット | - | 3 | 4,653 | |
| ジェイ・エス・ビー | 0.300 | - | - | |
| テンポイノベーション | 1 | - | - | |

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 |
| パーク24 | 15 | 33 | 75,285 |
| 三井不動産 | 138 | 286 | 686,407 |
| 三菱地所 | 196 | 413 | 764,028 |
| 平和不動産 | 5 | 10 | 38,610 |
| 東京建物 | 30 | 62 | 96,876 |
| ダイビル | 7 | 16 | 21,124 |
| 京阪神ビルディング | 4 | 10 | 16,578 |
| 住友不動産 | 63 | 141 | 519,277 |
| テーオーシー | 5 | 12 | 9,594 |
| 東京楽天地 | 0.500 | 1 | 4,430 |
| レオパレス21 | 36 | 52 | 6,786 |
| スターツコーポレーション | 3 | 7 | 21,720 |
| フジ住宅 | 3 | 7 | 4,774 |
| 空港施設 | 3 | 8 | 4,506 |
| 明和地所 | 2 | - | - |
| ワールドフレスト | 2 | 5 | 9,798 |
| エスリード | 1 | 1 | 2,550 |
| 日神グループホールディングス | 4 | 10 | 4,410 |
| 日本エスコン | 5 | 11 | 8,766 |
| タカラレーベン | 12 | 26 | 9,205 |
| AVANTIA | 1 | 4 | 4,356 |
| イオンモール | 14 | 31 | 58,684 |
| 毎日コムネット | 1 | 6 | 4,209 |
| ファースト住建 | 1 | 3 | 4,329 |
| カチタス | 3 | 15 | 47,190 |
| トーセイ | 3 | 8 | 8,934 |
| 穴吹興産 | 1 | 2 | 4,485 |
| サンフロンティア不動産 | 3 | 7 | 7,145 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 2 | 6 | 6,981 |
| グランディハウス | 3 | 10 | 4,661 |
| 日本空港ビルデング | 8 | 20 | 105,123 |
| サービス業(5.7%) | | | |
| 日本工営 | 1 | 3 | 10,985 |
| LIFULL | 9 | 21 | 8,988 |
| ミクシィ | - | 11 | 31,865 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 1 | 4 | 6,826 |
| 日本M&Aセンター | 20 | 49 | 303,891 |
| メンバーズ | 1 | 1 | 5,013 |
| UTグループ | 3 | 8 | 28,908 |
| アイティメディア | - | 2 | 3,816 |
| タケエイ | 2 | 6 | 8,649 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|------------------|---------|-----|---------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ビーネックスグループ | 3 | 7 | 10,693 |
| コシダカホールディングス | 6 | 14 | 8,099 |
| アルトナー | - | 4 | 3,854 |
| パソナグループ | 2 | 6 | 12,691 |
| CDS | 1 | 3 | 4,167 |
| リンクアンドモチベーション | 6 | 11 | 5,947 |
| GCA | 3 | 8 | 6,368 |
| エス・エム・エス | 8 | 20 | 76,590 |
| サニーサイドアップグループ | 1 | 6 | 4,910 |
| パーソルホールディングス | 27 | 60 | 132,092 |
| リニカル | 1 | 5 | 4,197 |
| クックパッド | 9 | 19 | 5,940 |
| アイ・ケイ・ケイ | 2 | 6 | 4,209 |
| 学情 | 1 | 3 | 4,531 |
| スタジオアリス | 1 | 3 | 6,630 |
| シミックホールディングス | 1 | 3 | 5,151 |
| NJS | 1 | 2 | 3,954 |
| 総合警備保障 | 10 | 24 | 120,274 |
| カカクコム | 20 | 45 | 158,850 |
| アイロムグループ | - | 2 | 4,443 |
| セントケア・ホールディング | 3 | 4 | 4,136 |
| ルネサンス | 1 | 4 | 5,283 |
| ディップ | 3 | 9 | 28,737 |
| デジタルホールディングス | 1 | 4 | 8,278 |
| 新日本科学 | 2 | 7 | 4,810 |
| ツクイホールディングス | 6 | 14 | 13,213 |
| ベネフィット・ワン | 7 | 22 | 65,068 |
| エムスリー | 59 | 107 | 946,000 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 3 | 15 | 5,380 |
| アウトソーシング | 15 | 34 | 51,756 |
| ウエルネット | 2 | 8 | 4,549 |
| ワールドホールディングス | 1 | 2 | 5,176 |
| ディー・エヌ・エー | 13 | 25 | 58,127 |
| 博報堂DYホールディングス | 37 | 84 | 154,166 |
| ぐるなび | 4 | 10 | 6,688 |
| タカミヤ | 2 | 7 | 3,876 |
| ジャパンベストレスキューシステム | 2 | 5 | 4,430 |
| ファンコミュニケーションズ | 7 | 16 | 6,780 |
| ライク | 0.900 | 2 | 3,932 |
| ビジネス・ブレイクスルー | 4 | 9 | 4,002 |
| エスプール | 5 | 15 | 15,880 |

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 |
| WDBホールディングス | 1 | 2 | 7,560 |
| アドウェイズ | - | 7 | 7,141 |
| バリューコマース | 1 | 4 | 12,628 |
| インフォマート | 29 | 61 | 64,556 |
| J Pホールディングス | 8 | 17 | 5,098 |
| E P Sホールディングス | 4 | 8 | 9,848 |
| レッグス | - | 2 | 4,212 |
| プレスステージ・インターナショナル | 10 | 22 | 17,419 |
| アミューズ | 1 | 3 | 8,302 |
| ドリームインキュベータ | - | 3 | 4,009 |
| クイック | 1 | 3 | 4,537 |
| T A C | 8 | 16 | 4,471 |
| ケネディクス | 25 | 17 | 13,072 |
| 電通グループ | 28 | 68 | 251,395 |
| びあ | 0.800 | 1 | 5,652 |
| イオンファンタジー | 1 | 2 | 5,648 |
| シーティーエス | 3 | 6 | 6,072 |
| ネクシィーズグループ | 1 | 4 | 4,945 |
| H. U. グループホールディングス | 7 | 17 | 55,930 |
| アルプス技研 | 2 | 5 | 10,945 |
| 日本空調サービス | 2 | 6 | 4,710 |
| オリエンタルランド | 28 | 64 | 1,168,992 |
| ダスキン | 7 | 14 | 39,508 |
| 明光ネットワークジャパン | 3 | 7 | 4,381 |
| ファルコホールディングス | 1 | 2 | 4,686 |
| 秀英予備校 | 4 | 9 | 4,184 |
| ラウンドワン | 7 | 20 | 23,088 |
| リゾートトラスト | 12 | 27 | 48,741 |
| ビー・エム・エル | 3 | 7 | 28,470 |
| りらいあコミュニケーションズ | 4 | 9 | 12,982 |
| リソー教育 | 12 | 30 | 10,320 |
| 早稲田アカデミー | - | 4 | 4,287 |
| ユー・エス・エス | 30 | 68 | 143,220 |
| 東京個別指導学院 | 1 | 6 | 4,050 |
| サイバーエージェント | 15 | 37 | 262,125 |
| 楽天 | 126 | 283 | 325,065 |
| クリーク・アンド・リバー社 | 1 | 3 | 4,529 |
| テー・オー・ダブリュー | 2 | 15 | 4,590 |
| 山田コンサルティンググループ | 1 | 4 | 4,317 |
| セントラルスポーツ | 1 | 2 | 5,586 |
| 丸キャストホールディングス | 2 | 5 | 10,494 |
| エン・ジャパン | 4 | 10 | 36,396 |
| リソルホールディングス | 0.400 | - | - |
| テクノプロ・ホールディングス | 5 | 12 | 98,820 |
| インターワークス | 3 | 11 | 4,343 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|-----------------------|---------|-----|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 1 | 2 | 34,950 |
| Keeper 技研 | 1 | 3 | 7,620 |
| 三機サービス | 1 | 4 | 4,141 |
| Gunosy | 1 | 5 | 4,363 |
| イー・ガーディアン | 1 | 2 | 8,667 |
| リブセンス | 6 | 17 | 4,071 |
| ジャパンマテリアル | 8 | 18 | 27,376 |
| ベクトル | 3 | 7 | 9,104 |
| ウチヤマホールディングス | 3 | 12 | 4,453 |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 2 | 4 | 6,421 |
| キャリアリンク | 3 | 2 | 5,534 |
| I B J | 1 | 5 | 5,120 |
| アサンテ | 1 | 2 | 4,505 |
| N・フィールド | 3 | 5 | 5,985 |
| バリューHR | 0.600 | 2 | 4,788 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 1 | 5 | 24,450 |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 1 | 2 | 3,958 |
| E R Iホールディングス | 2 | 6 | 4,140 |
| アビスト | 0.700 | 1 | 4,160 |
| シグマクシス | 1 | 3 | 5,874 |
| ウィルグループ | 1 | 4 | 4,414 |
| エスコロー・エージェント・ジャパン | 8 | - | - |
| メドピア | - | 2 | 17,835 |
| リクルートホールディングス | 194 | 436 | 2,389,290 |
| エラン | 1 | 8 | 11,760 |
| 日本郵政 | 222 | 460 | 414,810 |
| ベルシステム24ホールディングス | 4 | 10 | 18,839 |
| 鎌倉新書 | 2 | 6 | 5,508 |
| S M N | - | 5 | 3,835 |
| 一蔵 | 2 | 12 | 4,779 |
| L I T A L I C O | 0.900 | 2 | 9,562 |
| エアトリ | 1 | 3 | 6,583 |
| アトラエ | 0.700 | 1 | 6,213 |
| ストライク | 1 | 2 | 10,844 |
| ソラスト | 7 | 14 | 22,275 |
| セラク | 1 | 2 | 4,098 |
| インソース | 1 | 5 | 11,469 |
| バイカレント・コンサルティング | 1 | 4 | 85,080 |
| M S - J a p a n | 1 | 3 | 3,896 |
| グレイステクノロジー | 1 | 3 | 17,856 |
| ジャパンエパーターサービスホールディングス | 2 | 17 | 39,217 |
| フルテック | 1 | - | - |
| グリーンズ | - | 9 | 5,214 |
| ミダック | - | 1 | 5,824 |
| 日総工産 | 2 | 5 | 4,352 |

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 |
| キュービーネットホールディングス | 1 | 3 | 5,202 |
| RPAホールディングス | 1 | 7 | 4,473 |
| スプリックス | 1 | 5 | 4,362 |
| マネジメントソリューションズ | - | 3 | 5,970 |
| プロレド・パートナーズ | - | 1 | 3,872 |
| andfactory | - | 5 | 4,647 |
| カーブスホールディングス | - | 16 | 16,232 |
| ダイレクトマーケティングミックス | - | 2 | 7,956 |
| リログループ | 14 | 33 | 85,647 |
| 東祥 | 1 | 3 | 7,562 |
| エイチ・アイ・エス | 4 | 8 | 20,706 |
| ラックランド | 0.800 | 1 | 4,022 |
| 共立メンテナンス | 4 | 10 | 39,289 |
| イチネンホールディングス | 3 | 6 | 8,379 |
| 建設技術研究所 | 1 | 3 | 9,297 |
| スペース | 1 | 5 | 4,679 |
| 燦ホールディングス | 1 | 3 | 4,035 |
| 東京テアトル | 1 | 3 | 4,306 |
| タナベ経営 | - | 3 | 4,185 |
| ナガワ | 0.900 | 1 | 19,912 |
| よみうりランド | 0.600 | - | - |
| 東京都競馬 | 1 | 4 | 19,240 |
| 常磐興産 | 1 | - | - |
| カナモト | 4 | 10 | 25,658 |
| 東京ドーム | 11 | 24 | 32,060 |
| 西尾レントオール | 2 | 5 | 15,142 |
| トランス・コスモス | 2 | 5 | 16,077 |
| 乃村工藝社 | 11 | 26 | 21,454 |
| 藤田観光 | 1 | - | - |
| KNT-CTホールディングス | 1 | - | - |
| 日本管財 | 2 | 6 | 13,825 |
| トーカイ | 2 | 5 | 13,168 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|--------------|---------|--------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 白洋舎 | 0.700 | - | - |
| セコム | 28 | 60 | 580,620 |
| セントラル警備保障 | 1 | 2 | 9,961 |
| 丹青社 | 5 | 11 | 9,464 |
| メイテック | 3 | 7 | 43,725 |
| 応用地質 | 2 | 7 | 8,995 |
| 船井総研ホールディングス | 5 | 12 | 28,737 |
| 進学会ホールディングス | 3 | 8 | 4,153 |
| 学究社 | 1 | 3 | 4,252 |
| ベネッセホールディングス | 9 | 22 | 47,922 |
| イオンディライト | 3 | 7 | 23,512 |
| ナック | 1 | 4 | 4,503 |
| ニチイ学館 | 3 | - | - |
| ダイセキ | 4 | 10 | 35,343 |
| ステップ | 1 | 2 | 4,063 |
| 合計 | 株数・金額 | 33,485 | 66,696 169,111,924 |
| | 銘柄数<比率> | 1,860 | 1,853 <99.3%> |

(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 | 1,260 | - |

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2021年2月22日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 169,111,924 | 99.1 |
| コール・ローン等、その他 | 1,568,664 | 0.9 |
| 投資信託財産総額 | 170,680,588 | 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

(2021年2月22日現在)

| 項目 | 当期末 |
|----------------------|-------------------------|
| (A)資産 | 170,586,553,890円 |
| コール・ローン等 | 1,185,077,080 |
| 株式(評価額) | 169,111,924,060 |
| 未収入金 | 100,174,250 |
| 未収配当金 | 221,013,500 |
| 差入委託証拠金 | △ 31,635,000 |
| (B)負債 | 292,677,385 |
| 未払解約金 | 292,673,611 |
| その他未払費用 | 3,774 |
| (C)純資産総額(A-B) | 170,293,876,505 |
| 元本 | 79,813,755,893 |
| 次期繰越損益金 | 90,480,120,612 |
| (D)受益権総口数 | 79,813,755,893口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 21,336円 |

| | |
|---|-----------------|
| (注1) 期首元本額 | 37,895,533,054円 |
| 期中追加設定元本額 | 61,502,961,494円 |
| 期中一部解約元本額 | 19,584,738,655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 | 5,791,943,526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) | 3,838,721,766円 |
| ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定) | 3,845,110円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) | 1,824,833,310円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) | 6,083,058,971円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) | 4,223,461,711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) | 4,505,216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) | 21,672,934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) | 28,960,592円 |
| DCニッセイ国内株式インデックス | 492,190,490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 | 17,275,669,670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) | 1,180,490,320円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2055 | 152,517,938円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 143,266,411円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2045 | 153,665,546円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2035 | 328,688,648円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2025 | 57,347,460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) | 56,221,283円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式) | 6,193,882円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート) | 6,520,617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) | 1,793,965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) | 4,798,597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) | 19,125,276円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2060 | 51,866,593円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2050 | 34,906,904円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2040 | 112,843,783円 |
| DCニッセイターゲットデートファンド2030 | 140,615,947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) | 37,763,633,451円 |
| <購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型/スケット) | 10,242,693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) | 50,342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) | 102,941円 |

損益の状況

当期(2020年2月21日~2021年2月22日)

| 項目 | 当期 |
|--------------------------|-------------------------|
| (A)配当等収益 | 3,131,929,084円 |
| 受取配当金 | 3,133,530,037 |
| 受取利息 | 126,579 |
| その他収益 | 663,999 |
| 支払利息 | △ 2,391,531 |
| (B)有価証券売買損益 | 37,204,153,206 |
| 売買益 | 39,236,306,637 |
| 売買損 | △ 2,032,153,431 |
| (C)先物取引等損益 | 1,598,109,850 |
| 取引益 | 2,005,074,250 |
| 取引損 | △ 406,964,400 |
| (D)信託報酬等 | △ 155,561 |
| (E)当期損益金(A+B+C+D) | 41,934,036,579 |
| (F)前期繰越損益金 | 30,329,774,311 |
| (G)追加信託差損益金 | 33,262,730,980 |
| (H)解約差損益金 | △ 15,046,421,258 |
| (I)合計(E+F+G+H) | 90,480,120,612 |
| 次期繰越損益金(I) | 90,480,120,612 |

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

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 20 期

(計算期間：2020年2月21日～2021年2月22日)

運用方針

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

主要運用 対象

国内の公社債

運用方法

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



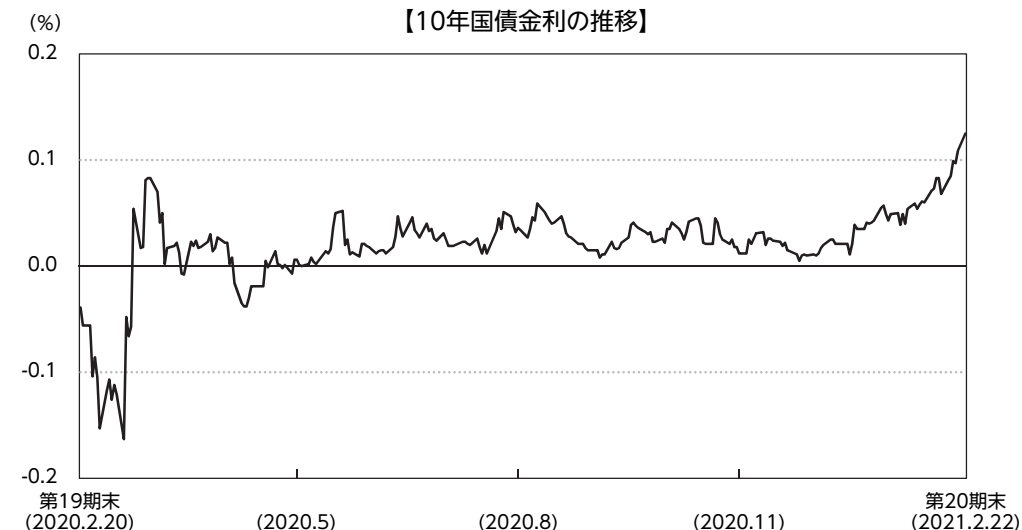
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2020年2月21日～2021年2月22日

国内債券市況

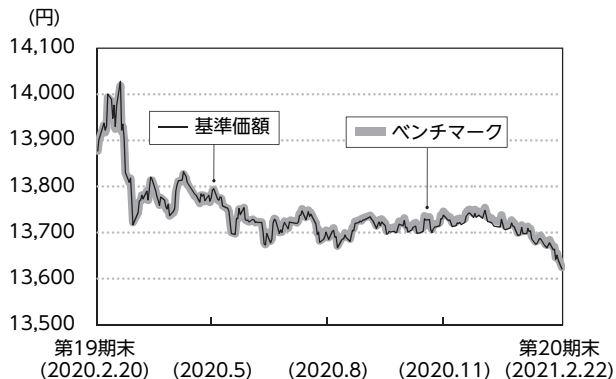


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は上昇しました。

期初以降、新型コロナウイルスの感染拡大から投資家のリスク回避姿勢が強まり、安全資産とされる国債が買われたことから国内金利は低下しました。3月になると欧米で同ウイルスの感染者数が急増し、市場の先行き不透明感が強まったことから投資家が債券を売却し現金化する動きが強まり金利は上昇しましたが、その後、4月に日銀が国債の買入れ上限を撤廃するとの観測報道を受けて低下しました。5月になると経済活動再開への期待感などから世界的に株価と金利が上昇したことから国内金利も上昇しました。しかし、6月以降は経済活動再開への期待感や国債増発見通しなどが金利上昇要因となる一方、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念などが低下要因となり、レンジ圏でもみ合う展開となりました。11月後半以降は米大統領選で民主党のバイデン候補が当選を確実にしたことで先行き不透明感が後退したことや、ワクチンの実用化への期待感から世界的な株高の流れが強まり、国内金利は上昇傾向となりました。1月以降は米ジョージア州の上院決選投票で大統領・上下院の多数派を民主党が占める「トリプルブルー」が実現したことで、米景気の回復期待が強まり米金利が上昇したことなどから国内金利も上昇基調を強め、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

<上昇要因>

- ・ 期初から2020年3月初旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大懸念などから金利が低下（債券価格は上昇）したこと

<下落要因>

- ・ 2020年3月に欧米において新型コロナウイルスの感染者数が急増し、市場の先行き不透明感が強まったことを背景に投資家が債券を売却し現金化する動きが強まり、金利が上昇したこと
- ・ 米大統領選において民主党のバイデン政権が成立したことから先行き不透明感が後退したことや、ワクチン実用化への期待感から世界的な株高の流れが強まり、11月から期末にかけて金利が上昇したこと

ポートフォリオ

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

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

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-1.8%となり、ベンチマーク騰落率（-1.8%）に連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 期中 | ベンチ マーク | 期中 | 債券 組入比率 | 純資産 総額 |
|------------------|--------|------|------------|------|------------|-----------|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | |
| | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 16期(2017年 2月20日) | 13,369 | △0.1 | 13,372 | △0.0 | 99.3 | 28,941 |
| 17期(2018年 2月20日) | 13,502 | 1.0 | 13,506 | 1.0 | 99.0 | 29,566 |
| 18期(2019年 2月20日) | 13,728 | 1.7 | 13,736 | 1.7 | 99.0 | 33,405 |
| 19期(2020年 2月20日) | 13,877 | 1.1 | 13,894 | 1.2 | 99.2 | 41,491 |
| 20期(2021年 2月22日) | 13,621 | △1.8 | 13,642 | △1.8 | 99.2 | 47,767 |

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | ベンチ マーク | 騰落率 | 債券 組入比率 |
|-----------------|--------|------|------------|------|------------|
| | | % | | % | |
| (期首)2020年 2月20日 | 円 | % | | % | % |
| | 13,877 | — | 13,894 | — | 99.2 |
| 2月末 | 14,000 | 0.9 | 14,011 | 0.8 | 98.9 |
| 3月末 | 13,771 | △0.8 | 13,787 | △0.8 | 99.7 |
| 4月末 | 13,822 | △0.4 | 13,835 | △0.4 | 99.7 |
| 5月末 | 13,758 | △0.9 | 13,776 | △0.9 | 101.1 |
| 6月末 | 13,702 | △1.3 | 13,720 | △1.3 | 99.2 |
| 7月末 | 13,747 | △0.9 | 13,768 | △0.9 | 98.9 |
| 8月末 | 13,682 | △1.4 | 13,703 | △1.4 | 99.1 |
| 9月末 | 13,723 | △1.1 | 13,744 | △1.1 | 99.4 |
| 10月末 | 13,698 | △1.3 | 13,723 | △1.2 | 99.4 |
| 11月末 | 13,715 | △1.2 | 13,740 | △1.1 | 99.1 |
| 12月末 | 13,714 | △1.2 | 13,743 | △1.1 | 99.3 |
| 2021年 1月末 | 13,686 | △1.4 | 13,709 | △1.3 | 99.0 |
| (期末)2021年 2月22日 | 13,621 | △1.8 | 13,642 | △1.8 | 99.2 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2020年2月21日～2021年2月22日

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|----------------|-----------|-------------------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| その他費用 (その他) | 0円 (0) | 0.000% (0.000) | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 0 | 0.000 | |

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（13,739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

2020年2月21日～2021年2月22日

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|------|------------|------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 45,570,848 | 38,206,847 |

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

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

主要な売買銘柄

2020年2月21日～2021年2月22日

公社債

| 買付 | | 売付 | |
|------------------|-----------|------------------|-----------|
| 銘柄 | 金額 | 銘柄 | 金額 |
| 千円 | | 千円 | |
| 第354回 利付国債 (10年) | 3,708,142 | 第117回 利付国債 (20年) | 2,748,977 |
| 第346回 利付国債 (10年) | 3,656,287 | 第342回 利付国債 (10年) | 2,677,545 |
| 第4回 利付国債 (40年) | 3,633,302 | 第131回 利付国債 (5年) | 2,501,671 |
| 第325回 利付国債 (10年) | 3,625,563 | 第328回 利付国債 (10年) | 2,411,248 |
| 第143回 利付国債 (5年) | 3,510,382 | 第100回 利付国債 (20年) | 2,153,480 |
| 第328回 利付国債 (10年) | 2,503,011 | 第54回 利付国債 (30年) | 2,153,307 |
| 第125回 利付国債 (20年) | 2,282,727 | 第133回 利付国債 (5年) | 2,048,755 |
| 第338回 利付国債 (10年) | 2,218,754 | 第403回 利付国債 (2年) | 2,017,934 |
| 第330回 利付国債 (10年) | 2,096,509 | 第67回 利付国債 (20年) | 1,923,742 |
| 第321回 利付国債 (10年) | 2,000,442 | 第333回 利付国債 (10年) | 1,868,911 |

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2021年2月22日現在

国内（邦貨建）公社債

| 区分 | 当期末 | | | | | | |
|------|---------------------------|---------------------------|----------------|-----------------|---------------|---------------|---------------|
| | 額面金額 | 評価額 | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 43,752,000 (8,457,000) | 47,364,805 (8,466,974) | 99.2 (17.7) | – | 63.0 (9.7) | 25.0 (7.3) | 11.1 (0.7) |
| 合計 | 43,752,000 (8,457,000) | 47,364,805 (8,466,974) | 99.2 (17.7) | – | 63.0 (9.7) | 25.0 (7.3) | 11.1 (0.7) |

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

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(国内公社債の内訳)

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|------|-----------------|--------|-----------|-----------|-----------|
| | | % | | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | 第416回 利付国債（2年） | 0.1000 | 2022/9/1 | 337,000 | 338,152 |
| | 第133回 利付国債（5年） | 0.1000 | 2022/9/20 | 817,000 | 819,826 |
| | 第137回 利付国債（5年） | 0.1000 | 2023/9/20 | 1,011,000 | 1,016,469 |
| | 第143回 利付国債（5年） | 0.1000 | 2025/3/20 | 3,477,000 | 3,503,216 |
| | 第3回 利付国債（40年） | 2.2000 | 2050/3/20 | 59,000 | 82,465 |
| | 第4回 利付国債（40年） | 2.2000 | 2051/3/20 | 2,523,000 | 3,546,682 |
| | 第8回 利付国債（40年） | 1.4000 | 2055/3/20 | 634,000 | 766,613 |
| | 第11回 利付国債（40年） | 0.8000 | 2058/3/20 | 55,000 | 56,618 |
| | 第12回 利付国債（40年） | 0.5000 | 2059/3/20 | 346,000 | 321,814 |
| | 第321回 利付国債（10年） | 1.0000 | 2022/3/20 | 559,000 | 565,646 |
| | 第325回 利付国債（10年） | 0.8000 | 2022/9/20 | 3,544,000 | 3,594,998 |
| | 第328回 利付国債（10年） | 0.6000 | 2023/3/20 | 1,089,000 | 1,105,008 |
| | 第330回 利付国債（10年） | 0.8000 | 2023/9/20 | 2,043,000 | 2,090,642 |
| | 第333回 利付国債（10年） | 0.6000 | 2024/3/20 | 1,405,000 | 1,435,460 |
| | 第338回 利付国債（10年） | 0.4000 | 2025/3/20 | 2,755,000 | 2,808,915 |
| | 第342回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2026/3/20 | 1,006,000 | 1,014,168 |
| | 第346回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2027/3/20 | 3,562,000 | 3,591,208 |
| | 第350回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2028/3/20 | 1,044,000 | 1,051,746 |

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|------------------|------------------|-----------|------------|-----------|------------|
| 国債証券 | | % | | 千円 | 千円 |
| | 第354回 利付国債 (10年) | 0.1000 | 2029/3/20 | 3,562,000 | 3,579,168 |
| | 第18回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2035/3/20 | 448,000 | 570,850 |
| | 第26回 利付国債 (30年) | 2.4000 | 2037/3/20 | 207,000 | 271,544 |
| | 第30回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2039/3/20 | 45,000 | 59,155 |
| | 第34回 利付国債 (30年) | 2.2000 | 2041/3/20 | 843,000 | 1,111,428 |
| | 第37回 利付国債 (30年) | 1.9000 | 2042/9/20 | 12,000 | 15,270 |
| | 第38回 利付国債 (30年) | 1.8000 | 2043/3/20 | 986,000 | 1,238,268 |
| | 第49回 利付国債 (30年) | 1.4000 | 2045/12/20 | 411,000 | 485,169 |
| | 第94回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2027/3/20 | 669,000 | 755,816 |
| | 第100回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2028/3/20 | 496,000 | 573,301 |
| | 第110回 利付国債 (20年) | 2.1000 | 2029/3/20 | 50,000 | 58,281 |
| | 第125回 利付国債 (20年) | 2.2000 | 2031/3/20 | 1,403,000 | 1,693,224 |
| | 第126回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2031/3/20 | 1,185,000 | 1,406,559 |
| | 第143回 利付国債 (20年) | 1.6000 | 2033/3/20 | 2,342,000 | 2,726,673 |
| | 第152回 利付国債 (20年) | 1.2000 | 2035/3/20 | 1,312,000 | 1,473,349 |
| 第160回 利付国債 (20年) | 0.7000 | 2037/3/20 | 2,780,000 | 2,912,467 | |
| 第168回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2039/3/20 | 735,000 | 724,621 | |
| | 合計 | - | - | - | 47,364,805 |

投資信託財産の構成

2021年2月22日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 47,364,805 | 98.9 |
| コール・ローン等、その他 | 511,438 | 1.1 |
| 投資信託財産総額 | 47,876,243 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内債券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

(2021年2月22日現在)

| 項目 | 当期末 |
|----------------------|------------------------|
| (A)資産 | 47,876,243,942円 |
| コール・ローン等 | 354,169,449 |
| 公社債(評価額) | 47,364,805,230 |
| 未収利息 | 125,297,302 |
| 前払費用 | 31,971,961 |
| (B)負債 | 109,054,402 |
| 未払解約金 | 109,053,801 |
| その他未払費用 | 601 |
| (C)純資産総額(A-B) | 47,767,189,540 |
| 元本 | 35,069,978,508 |
| 次期繰越損益金 | 12,697,211,032 |
| (D)受益権総口数 | 35,069,978,508口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,621円 |

(注1) 期首元本額 29,898,975,550円
 期中追加設定元本額 14,117,934,367円
 期中一部解約元本額 8,946,931,409円

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

ニッセイ国内債券インデックスSA (適格機関投資家限定) 1,698,687,565円
 DCニッセイ国内債券インデックス 7,809,491,186円
 ニッセイ日本バランス(成長型)SA (適格機関投資家限定) 3,049,457円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) 6,300,241,671円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) 9,029,456,364円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) 2,354,067,901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) 18,959,362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) 39,633,531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) 23,123,863円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド 5,996,521,872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) 1,795,443,796円
 ニッセイ日経225高値参照型アロケーションファンド 250,972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) 594,823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) 456,145円

損益の状況

当期(2020年2月21日~2021年2月22日)

| 項目 | 当期 |
|------------------------|------------------------|
| (A)配当等収益 | 341,012,493円 |
| 受取利息 | 341,264,331 |
| 支払利息 | △ 251,838 |
| (B)有価証券売買損益 | △ 1,149,251,358 |
| 売買益 | 43,469,290 |
| 売買損 | △ 1,192,720,648 |
| (C)信託報酬等 | △ 15,448 |
| (D)当期損益金(A+B+C) | △ 808,254,313 |
| (E)前期繰越損益金 | 11,592,675,088 |
| (F)追加信託差損益金 | 5,290,828,169 |
| (G)解約差損益金 | △ 3,378,037,912 |
| (H)合計(D+E+F+G) | 12,697,211,032 |
| 次期繰越損益金(H) | 12,697,211,032 |

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 28 期

(計算期間：2021年5月21日～2021年11月22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

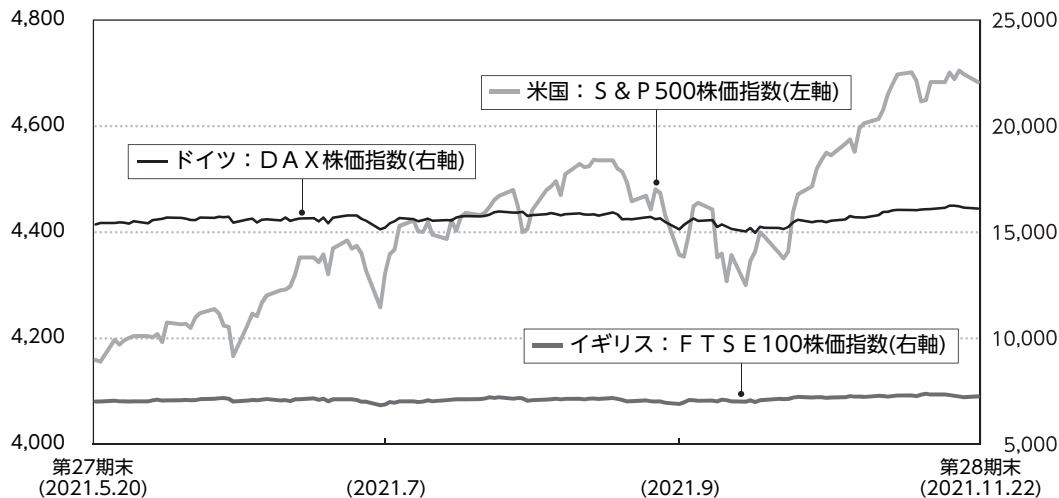
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2021年5月21日～2021年11月22日

海外株式市況

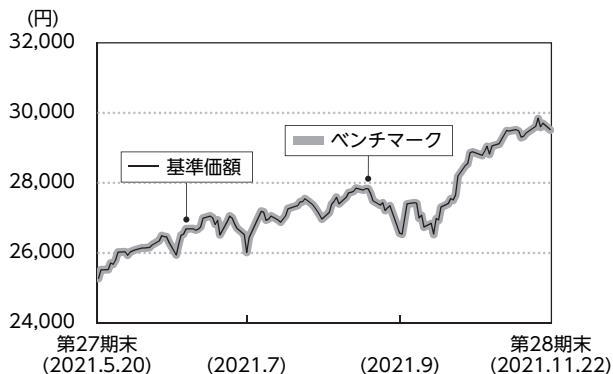
【海外主要株価指数の推移】



(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、期初から8月にかけて米債券市場における金利低下や堅調な企業業績を背景に上昇しました。9月には感染力が強い新型コロナウイルスの変異株（デルタ型）の感染拡大やサプライチェーン（供給網）問題による業績懸念等から下落する場面もありましたが、その後は堅調な企業業績を背景に反発し、結局、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

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>

- ・ 堅調な企業業績等を背景に海外株式市場が上昇基調で推移したこと

<下落要因>

- ・ 9月にデルタ型の感染拡大やサプライチェーン問題による業績懸念等から海外株式市場が下落したこと

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+16.8%となり、ベンチマーク騰落率(+16.8%)に連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 期中騰落率 | ベンチマーク | 期中騰落率 | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|------------|---------|
| | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 24期(2019年11月20日) | 19,016 | 7.2 | 18,631 | 7.1 | 94.4 | 2.9 | 2.6 | 211,043 |
| 25期(2020年5月20日) | 17,256 | △ 9.3 | 16,893 | △ 9.3 | 95.1 | 2.3 | 2.4 | 227,678 |
| 26期(2020年11月20日) | 20,729 | 20.1 | 20,257 | 19.9 | 94.9 | 2.8 | 2.2 | 300,923 |
| 27期(2021年5月20日) | 25,274 | 21.9 | 24,672 | 21.8 | 94.7 | 3.2 | 2.1 | 392,650 |
| 28期(2021年11月22日) | 29,525 | 16.8 | 28,808 | 16.8 | 94.9 | 2.9 | 2.1 | 513,761 |

(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)2021年5月20日 | 25,274 | — | 24,672 | — | 94.7 | 3.2 | 2.1 |
| 5月末 | 26,030 | 3.0 | 25,412 | 3.0 | 95.2 | 2.5 | 2.1 |
| 6月末 | 26,677 | 5.6 | 26,047 | 5.6 | 94.5 | 3.2 | 2.2 |
| 7月末 | 27,052 | 7.0 | 26,413 | 7.1 | 94.6 | 3.1 | 2.2 |
| 8月末 | 27,720 | 9.7 | 27,061 | 9.7 | 94.4 | 3.2 | 2.2 |
| 9月末 | 27,076 | 7.1 | 26,424 | 7.1 | 95.4 | 2.2 | 2.2 |
| 10月末 | 29,057 | 15.0 | 28,357 | 14.9 | 93.9 | 3.7 | 2.2 |
| (期末)2021年11月22日 | 29,525 | 16.8 | 28,808 | 16.8 | 94.9 | 2.9 | 2.1 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2021年5月21日～2021年11月22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 | 0.005 | | |
| (株式) | (1) | (0.004) | 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 | 8 | 0.028 | 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) | (0.011) | | 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (その他) | (5) | (0.017) | | ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 9 | 0.034 | | |

(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（27,361円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2021年5月21日～2021年11月22日

(1) 株式

| | 買付 | | 売付 | | |
|----|----------|---------------------------|-------------------------------------|-------------|-----------------------|
| | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 | |
| 外国 | アメリカ | 百株 30,350 (△ 1,446) | 千米ドル 362,647 (△ 1,797) | 百株 2,645 | 千米ドル 16,171 |
| | カナダ | 3,987 (6) | 千カナダ・ドル 22,446 (△ 43) | 612 | 千カナダ・ドル 1,785 |
| | オーストラリア | 6,422 (918) | 千オーストラリア・ドル 13,847 (△ 175) | 3,070 | 千オーストラリア・ドル 782 |
| | 香港 | 9,326 (366) | 千香港ドル 36,167 (△ 33) | 5,117 | 千香港ドル 7,012 |
| | シンガポール | 2,689 (1,954) | 千シンガポール・ドル 1,744 (△ 237) | 2,062 | 千シンガポール・ドル 53 |
| | ニュージーランド | 625 | 千ニュージーランド・ドル 529 | 2 | 千ニュージーランド・ドル 4 |
| | イギリス | 25,553 (△ 270) | 千イギリス・ポンド 16,499 (△ 249) | 3,067 | 千イギリス・ポンド 1,389 |
| | イスラエル | 379 | 千イスラエル・シケル 1,630 | 0.27 | 千イスラエル・シケル 4 |
| | スイス | 1,522 | 千スイス・フラン 13,332 (△ 12) | 67 | 千スイス・フラン 282 |
| | デンマーク | 579 | 千デンマーク・クローネ 25,386 | 78 | 千デンマーク・クローネ 3,550 |
| | ノルウェー | 516 | 千ノルウェー・クローネ 8,222 | 5 | 千ノルウェー・クローネ 120 |
| | スウェーデン | 3,288 (1,115) | 千スウェーデン・クローナ 60,303 (△ 2,492) | 1,219 | 千スウェーデン・クローナ 3,086 |

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 | 125 | 889 | — | — |
| | | オランダ | 1,977 (514) | 9,767 (△ 9) | 245 | 536 |
| | | ベルギー | 164 | 1,118 | 0.54 | 3 |
| | | ルクセンブルグ | 90 | 181 | 1 | 1 |
| | | フランス | 2,179 (781) | 13,080 | 1,277 | 972 |
| | | ドイツ | 2,201 (305) | 11,624 (186) | 614 | 2,021 |
| | | ポルトガル | 523 | 621 | — | — |
| | | スペイン | 4,488 (21) | 3,866 (0.407) | 256 | 273 |
| | | イタリア | 5,357 | 2,595 (△ 2) | 17 | 26 |
| | | フィンランド | 745 | 1,319 | 146 | 61 |
| | | オーストリア | 62 | 248 | 2 | 5 |
| | | その他 | 15 | 98 | 4 | 30 |

(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 | 141 | — | — |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 3 | 668 | — | — |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 1 | 342 | 0.234 | 41 |
| PROLOGIS INC | 6 | 783 | — | — |
| ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT | 10 | 90 | — | — |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 1 | 246 | — | — |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 0.766 | 110 | — | — |
| DUKE REALTY CORP | 3 | 161 | — | — |
| EQUITY RESIDENTIAL | 2 | 219 | 1 | 79 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 0.513 | 163 | — | — |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 4 | 148 | — | — |
| WELLTOWER INC | 3 | 277 | — | — |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 5 | 99 | — | — |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 0.930 | 170 | — | — |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 2 | 86 | — | — |
| PUBLIC STORAGE | 1 | 399 | — | — |
| REGENCY CENTERS CORP | 1 | 82 | 1 | 73 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 2 | 374 | — | — |
| SUN COMMUNITIES INC | 1 | 225 | — | — |
| UDR INC | 2 | 126 | — | — |
| VENTAS INC | 3 | 174 | — | — |
| VORNADO REALTY TRUST | 1 | 57 | — | — |
| WP CAREY INC | 1 | 123 | — | — |
| REALTY INCOME CORP | 4 | 332 | — | 0.062 |
| | (11) | | | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 1 | 109 | 0.030 | 2 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 1 | 235 | — | — |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 2 | 369 | — | — |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 6 | 128 | — | — |
| IRON MOUNTAIN INC | 2 | 101 | — | — |
| AGNC INVESTMENT CORP | 3 | 63 | 1 | 32 |
| AMERICAN TOWER REIT INC | 4 | 1,216 | — | — |
| EQUINIX INC | 0.758 | 610 | — | — |
| VEREIT | 2 | 115 | — | — |
| | (△ 16) | | | |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 0.811 | 273 | 0.057 | 17 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 買付 | | 売付 | |
|--|--------|-------------|-------|-------------|
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 |
| (アメリカ) | | 千□ | 千□ | 千米ドル |
| INVITATION HOMES INC | 5 | 193 | — | — |
| VICI PROPERTIES INC | 4 | 139 | — | — |
| ORION OFFICE REIT INC | — | — | — | — |
| | (4) | | | |
| (カナダ) | | 千カナダ・ドル | | 千カナダ・ドル |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 0.838 | 49 | — | — |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 1 | 30 | 0.123 | 2 |
| (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 |
| DEXUS | 1 | 20 | — | — |
| | (△ 83) | | | |
| GPT GROUP | 15 | 78 | 0.675 | 3 |
| GOODMAN GROUP | 14 | 310 | — | — |
| STOCKLAND | 22 | 102 | — | — |
| MIRVAC GROUP | 32 | 95 | 1 | 4 |
| VICINITY CENTRES | 36 | 59 | — | — |
| SCENTRE GROUP | 48 | 137 | — | — |
| DEXUS/AU | 6 | 72 | 0.830 | 8 |
| | (83) | | | |
| (香港) | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| LINK REIT | 16 | 1,208 | — | — |
| (シンガポール) | | 千シンガポール・ドル | | 千シンガポール・ドル |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 34 | 105 | — | — |
| | | (△ 1) | | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 42 | 90 | — | — |
| | (30) | (49) | | |
| SUNTEC REIT | — | — | 127 | 184 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 32 | 65 | 1 | 3 |
| | | (△ 2) | | |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 17 | 36 | 1 | 2 |
| | | (△0.128) | | |
| (イギリス) | | 千イギリス・ポンド | | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 6 | 34 | — | — |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 5 | 39 | — | — |
| SEGRO PLC | 10 | 122 | — | — |
| (ユーロ/フランス) | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| KLEPIERRE | 2 | 53 | — | — |

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 | 0.388 | 50 | — | — |
| COVIVIO | 0.398 | 31 | — | — |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 0.945 | 69 | 0.917 | 64 |

(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 |
| | 72,425 | 72,630 | — | — |

(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

2021年5月21日～2021年11月22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 |
| AMAZON.COM INC | 5 | 2,122,324 | 384,548 | ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR | 33 | 219,647 | 6,522 |
| APPLE INC | 119 | 1,918,046 | 16,027 | DEUTSCHE WOHNEN SE | 25 | 153,897 | 6,073 |
| MICROSOFT CORP | 56 | 1,813,799 | 32,362 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 2 | 85,936 | 31,982 |
| TESLA, INC. | 10 | 916,886 | 85,666 | APPLE INC | 5 | 84,515 | 14,561 |
| ALPHABET INC-CL A | 2 | 742,609 | 298,836 | MORRISON VM SUPERMARKETS | 177 | 79,774 | 449 |
| META PLATFORMS INC-A | 18 | 725,702 | 38,474 | RSA INSURANCE GROUP PLC | 69 | 73,176 | 1,049 |
| ALPHABET INC-CL C | 2 | 640,621 | 305,639 | REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 4 | 63,358 | 12,962 |
| NVIDIA CORP | 15 | 513,802 | 34,198 | XPO LOGISTICS INC | 6 | 62,137 | 9,472 |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 12 | 438,216 | 34,190 | ELI LILLY & CO | 2 | 58,084 | 22,060 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 23 | 427,976 | 18,010 | INTER PIPELINE LTD | 31 | 56,206 | 1,786 |

(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

2021年11月22日現在

(1) 外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|-------|---------|------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A | 43 | 56 | 840 | 95,852 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 3M CO | 388 | 437 | 7,845 | 895,164 | 資本財 |
| ABBOTT LABORATORIES | 1,194 | 1,341 | 17,011 | 1,940,986 | ヘルスケア機器・サービス |
| ABBVIE INC | 1,190 | 1,333 | 15,501 | 1,768,698 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ABIOMED INC | 30 | 34 | 1,160 | 132,438 | ヘルスケア機器・サービス |
| ACCENTURE PLC | 426 | 479 | 17,732 | 2,023,324 | ソフトウェア・サービス |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 519 | 586 | 3,656 | 417,217 | メディア・娯楽 |
| ADOBE INC | 323 | 360 | 24,819 | 2,831,868 | ソフトウェア・サービス |
| ADVANCE AUTO PARTS | 45 | 49 | 1,133 | 129,351 | 小売 |
| ADVANCED MICRO DEVICES INC | 810 | 917 | 14,254 | 1,626,475 | 半導体・半導体製造装置 |
| AES CORP | 449 | 505 | 1,241 | 141,656 | 公益事業 |
| AFLAC INC | 447 | 485 | 2,691 | 307,125 | 保険 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 207 | 229 | 3,776 | 430,947 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 149 | 167 | 4,978 | 568,082 | 素材 |
| AIRBNB INC-CLASS A | 35 | 94 | 1,861 | 212,371 | 消費者サービス |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 109 | 122 | 1,361 | 155,309 | ソフトウェア・サービス |
| ALBEMARLE CORP | 77 | 88 | 2,476 | 282,610 | 素材 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 147 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 50 | 56 | 3,873 | 441,974 | ヘルスケア機器・サービス |
| ALLEGHANY CORP | 9 | 10 | 700 | 79,965 | 保険 |
| ALLEGION PLC | 63 | 68 | 920 | 105,003 | 資本財 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 169 | 188 | 1,072 | 122,369 | 公益事業 |
| ALLSTATE CORP | 203 | 224 | 2,518 | 287,339 | 保険 |
| ALLY FINANCIAL INC | 251 | 279 | 1,338 | 152,765 | 各種金融 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 78 | 88 | 1,608 | 183,493 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALPHABET INC-CL A | 202 | 226 | 67,597 | 7,712,901 | メディア・娯楽 |
| ALPHABET INC-CL C | 200 | 219 | 65,931 | 7,522,740 | メディア・娯楽 |
| ALTICE USA INC- A | 156 | 165 | 278 | 31,799 | メディア・娯楽 |
| ALTRIA GROUP INC | 1,254 | 1,398 | 6,069 | 692,523 | 食品・飲料・タバコ |
| AMAZON.COM INC | 287 | 342 | 125,966 | 14,372,793 | 小売 |
| AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A | - | 379 | 1,549 | 176,765 | メディア・娯楽 |
| AMCOR PLC | 1,065 | 1,173 | 1,396 | 159,301 | 素材 |
| AMERCO | 6 | 7 | 578 | 66,028 | 運輸 |
| AMEREN CORPORATION | 166 | 192 | 1,646 | 187,852 | 公益事業 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|--------------------------------|---------|--------|---------|------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC | 335 | 377 | 3,147 | 359,121 | 公益事業 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 461 | 515 | 8,951 | 1,021,370 | 各種金融 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 49 | 53 | 758 | 86,488 | 保険 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 581 | 647 | 3,557 | 405,856 | 保険 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 121 | 137 | 2,375 | 271,042 | 公益事業 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 78 | 87 | 2,609 | 297,730 | 各種金融 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 104 | 117 | 1,412 | 161,110 | ヘルスケア機器・サービス |
| AMETEK INC | 155 | 174 | 2,484 | 283,440 | 資本財 |
| AMGEN INC | 392 | 433 | 8,937 | 1,019,743 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMPHENOL CORP-CL A | 403 | 451 | 3,844 | 438,705 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ANALOG DEVICES INC | 249 | 406 | 7,673 | 875,534 | 半導体・半導体製造装置 |
| ANSYS INC | 57 | 65 | 2,645 | 301,835 | ソフトウェア・サービス |
| ANTHEM INC | 167 | 184 | 7,669 | 875,072 | ヘルスケア機器・サービス |
| AON PLC | 154 | 170 | 5,054 | 576,665 | 保険 |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 117 | 132 | 992 | 113,251 | 各種金融 |
| APPLE INC | 11,457 | 12,596 | 202,232 | 23,074,761 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| APPLIED MATERIALS INC | 614 | 692 | 10,387 | 1,185,176 | 半導体・半導体製造装置 |
| APTIV PLC | 182 | 204 | 3,599 | 410,668 | 自動車・自動車部品 |
| ARAMARK | 155 | 173 | 634 | 72,432 | 消費者サービス |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 271 | 302 | 1,274 | 145,382 | 保険 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 374 | 421 | 2,750 | 313,867 | 食品・飲料・タバコ |
| ARISTA NETWORKS INC | 38 | 172 | 2,224 | 253,792 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 49 | 55 | 695 | 79,410 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 129 | 155 | 2,537 | 289,558 | 保険 |
| ASSURANT INC | 39 | 45 | 726 | 82,867 | 保険 |
| AT&T INC | 4,808 | 5,397 | 13,023 | 1,485,950 | 電気通信サービス |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A | 81 | 100 | 859 | 98,052 | 保険 |
| ATMOS ENERGY CORP | 85 | 98 | 936 | 106,808 | 公益事業 |
| AUTODESK INC | 147 | 166 | 5,357 | 611,240 | ソフトウェア・サービス |
| AUTOLIV INC | 56 | 63 | 667 | 76,144 | 自動車・自動車部品 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | 289 | 321 | 7,640 | 871,724 | ソフトウェア・サービス |
| AUTOZONE INC | 15 | 16 | 3,033 | 346,081 | 小売 |
| AVALARA INC | 54 | 64 | 974 | 111,182 | ソフトウェア・サービス |
| AVANTOR INC | 351 | 396 | 1,572 | 179,365 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AVERY DENNISON CORP | 56 | 62 | 1,368 | 156,181 | 素材 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 144 | - | - | - | 素材 |
| BAKER HUGHES COMPANY | 464 | 556 | 1,254 | 143,097 | 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| BALL CORP | 221 | 248 | 2,378 | 271,422 | 素材 |
| BANK OF AMERICA CORP | 5,244 | 5,819 | 26,420 | 3,014,566 | 銀行 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 536 | 627 | 3,583 | 408,881 | 各種金融 |
| BATH & BODY WORKS INC | - | 199 | 1,524 | 173,975 | 小売 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 344 | 380 | 3,012 | 343,682 | ヘルスケア機器・サービス |
| BECTON DICKINSON & CO | 195 | 219 | 5,459 | 622,982 | ヘルスケア機器・サービス |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | - | 129 | 716 | 81,789 | ソフトウェア・サービス |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 923 | 1,001 | 28,037 | 3,199,062 | 各種金融 |
| BEST BUY CO INC | 156 | 169 | 2,310 | 263,663 | 小売 |
| BIOGEN INC | 103 | 113 | 2,920 | 333,275 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 122 | 138 | 1,263 | 144,110 | 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 | 14 | 16 | 1,302 | 148,604 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIO-TECHNE CORP | - | 29 | 1,470 | 167,772 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACK KNIGHT INC | 105 | 118 | 883 | 100,808 | ソフトウェア・サービス |
| BLACKROCK INC | 102 | 115 | 10,524 | 1,200,864 | 各種金融 |
| BLACKSTONE INC | 454 | 515 | 7,555 | 862,124 | 各種金融 |
| BOEING CO | 362 | 420 | 8,994 | 1,026,324 | 資本財 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 27 | 30 | 7,251 | 827,410 | 消費者サービス |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 93 | 102 | 897 | 102,455 | 商業・専門サービス |
| BORGWARNER INC | 165 | 181 | 833 | 95,144 | 自動車・自動車部品 |
| BOSTON BEER COMPANY INC-A | - | 6 | 317 | 36,271 | 食品・飲料・タバコ |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 965 | 1,072 | 4,400 | 502,135 | ヘルスケア機器・サービス |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 1,524 | 1,687 | 9,759 | 1,113,506 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BROADCOM INC | 272 | 308 | 17,540 | 2,001,366 | 半導体・半導体製造装置 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 77 | 87 | 1,531 | 174,721 | ソフトウェア・サービス |
| BROWN & BROWN INC | 161 | 179 | 1,158 | 132,184 | 保険 |
| BROWN-FORMAN CORP -CL B | 208 | 234 | 1,761 | 200,962 | 食品・飲料・タバコ |
| BUNGE LIMITED | 93 | 106 | 998 | 113,908 | 食品・飲料・タバコ |
| BURLINGTON STORES INC | 44 | 50 | 1,334 | 152,223 | 小売 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 94 | 104 | 1,009 | 115,204 | 運輸 |
| CABLE ONE INC | 3 | 4 | 753 | 86,013 | メディア・娯楽 |
| CABOT OIL & GAS CORP | 265 | - | - | - | エネルギー |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | 186 | 209 | 3,936 | 449,208 | ソフトウェア・サービス |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | - | 157 | 1,501 | 171,353 | 消費者サービス |
| CAMPBELL SOUP CO | 122 | 149 | 605 | 69,114 | 食品・飲料・タバコ |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 307 | 340 | 5,153 | 588,032 | 各種金融 |
| CARDINAL HEALTH INC | 198 | 219 | 1,064 | 121,466 | 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 | |
| CARLYLE GROUP INC/THE | 97 | 121 | 714 | 81,536 | 各種金融 |
| CARMAX INC | 110 | 123 | 1,811 | 206,726 | 小売 |
| CARNIVAL CORP | 527 | 624 | 1,279 | 145,965 | 消費者サービス |
| CARRIER GLOBAL CORP | 555 | 624 | 3,566 | 406,924 | 資本財 |
| CARVANA CO | 42 | 55 | 1,606 | 183,335 | 小売 |
| CATALENT INC | 111 | 128 | 1,637 | 186,874 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CATERPILLAR INC | 366 | 413 | 8,293 | 946,231 | 資本財 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 72 | 80 | 1,041 | 118,839 | 各種金融 |
| CBRE GROUP INC | 226 | 253 | 2,528 | 288,449 | 不動産 |
| CDW CORP/DE | 96 | 105 | 2,076 | 236,903 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 78 | 84 | 1,407 | 160,629 | 素材 |
| CENTENE CORP | 391 | 439 | 3,211 | 366,431 | ヘルスケア機器・サービス |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 372 | 439 | 1,167 | 133,194 | 公益事業 |
| CENTURYLINK INC | 635 | 717 | 957 | 109,198 | 電気通信サービス |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | 89 | 101 | 1,166 | 133,044 | ソフトウェア・サービス |
| CERNER CORP | 204 | 226 | 1,644 | 187,596 | ヘルスケア機器・サービス |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 144 | 161 | 1,052 | 120,126 | 素材 |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | - | 37 | 1,438 | 164,188 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHARLES SCHWAB CORP | 1,030 | 1,090 | 8,745 | 997,916 | 各種金融 |
| CHARTER COMMUNICATIONS-CL A | 94 | 99 | 6,797 | 775,591 | メディア・娯楽 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 75 | 82 | 951 | 108,570 | ソフトウェア・サービス |
| CHENIERE ENERGY INC | 152 | 182 | 1,900 | 216,874 | エネルギー |
| CHEVRON CORP | 1,297 | 1,458 | 16,323 | 1,862,463 | エネルギー |
| CHEWY INC - CLASS A | 50 | 67 | 488 | 55,753 | 小売 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 17 | 21 | 3,723 | 424,896 | 消費者サービス |
| CHUBB LTD | 303 | 338 | 6,381 | 728,106 | 保険 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 167 | 185 | 1,710 | 195,167 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CIGNA CORP | 243 | 259 | 5,453 | 622,289 | ヘルスケア機器・サービス |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 102 | 115 | 1,367 | 156,072 | 保険 |
| CINTAS CORP | 59 | 71 | 3,184 | 363,385 | 商業・専門サービス |
| CISCO SYSTEMS INC | 2,846 | 3,179 | 16,932 | 1,932,051 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CITIGROUP INC | 1,402 | 1,559 | 10,346 | 1,180,568 | 銀行 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 286 | 319 | 1,584 | 180,824 | 銀行 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 78 | 93 | 798 | 91,069 | ソフトウェア・サービス |
| CLARIVATE PLC | - | 267 | 628 | 71,680 | 商業・専門サービス |
| CLOROX CO | 84 | 94 | 1,572 | 179,454 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | 133 | 173 | 3,668 | 418,624 | 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 | |
| CME GROUP INC | 242 | 271 | 6,056 | 691,059 | 各種金融 |
| CMS ENERGY CORP | 195 | 219 | 1,337 | 152,621 | 公益事業 |
| COCA-COLA CO | 2,753 | 3,093 | 17,056 | 1,946,134 | 食品・飲料・タバコ |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC | 139 | 154 | 801 | 91,504 | 食品・飲料・タバコ |
| COGNEX CORP | 117 | 132 | 1,062 | 121,283 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP | 359 | 397 | 3,260 | 371,994 | ソフトウェア・サービス |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 548 | 607 | 4,691 | 535,320 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| COMCAST CORP | 3,077 | 3,459 | 17,958 | 2,049,049 | メディア・娯楽 |
| CONAGRA BRANDS INC | 329 | 362 | 1,113 | 127,089 | 食品・飲料・タバコ |
| CONOCOPHILLIPS | 912 | 1,015 | 7,067 | 806,449 | エネルギー |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 226 | 259 | 2,021 | 230,664 | 公益事業 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 114 | 128 | 3,025 | 345,247 | 食品・飲料・タバコ |
| COOPER COS INC/THE | 35 | 37 | 1,498 | 171,008 | ヘルスケア機器・サービス |
| COPART INC | 143 | 160 | 2,446 | 279,161 | 商業・専門サービス |
| CORNING INC | 515 | 610 | 2,300 | 262,447 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CORTEVA INC | 500 | 555 | 2,655 | 303,004 | 素材 |
| COSTAR GROUP INC | 26 | 298 | 2,434 | 277,827 | 商業・専門サービス |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 297 | 333 | 17,814 | 2,032,658 | 食品・生活必需品小売り |
| COUPA SOFTWARE INC | 46 | 55 | 1,174 | 133,957 | ソフトウェア・サービス |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 117 | 142 | 3,678 | 419,768 | ソフトウェア・サービス |
| CROWN HOLDINGS INC | 91 | 102 | 1,143 | 130,485 | 素材 |
| CSX CORP | 521 | 1,737 | 6,270 | 715,413 | 運輸 |
| CUMMINS INC | 99 | 110 | 2,473 | 282,281 | 資本財 |
| CVS HEALTH CORP | 881 | 993 | 9,258 | 1,056,450 | ヘルスケア機器・サービス |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 26 | 30 | 589 | 67,276 | ソフトウェア・サービス |
| DANAHER CORP | 430 | 484 | 15,217 | 1,736,305 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 87 | 98 | 1,409 | 160,846 | 消費者サービス |
| DATADOG INC - CLASS A | 119 | 141 | 2,721 | 310,494 | ソフトウェア・サービス |
| DAVITA INC | 52 | 51 | 516 | 58,917 | ヘルスケア機器・サービス |
| DEERE & CO | 200 | 224 | 7,783 | 888,140 | 資本財 |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 166 | 209 | 1,152 | 131,513 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DELTA AIR LINES INC | 108 | 122 | 484 | 55,330 | 運輸 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 147 | 164 | 866 | 98,878 | ヘルスケア機器・サービス |
| DEVON ENERGY CORPORATION | 402 | 480 | 1,952 | 222,737 | エネルギー |
| DEXCOM INC | 64 | 73 | 4,681 | 534,131 | ヘルスケア機器・サービス |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 206 | 230 | 2,637 | 300,885 | 各種金融 |
| DISCOVERY INC-A | 105 | 126 | 319 | 36,450 | メディア・娯楽 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|-----------------------------|---------|-----|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| DISCOVERY INC-C | 209 | 235 | 583 | 66,552 | メディア・娯楽 |
| DISH NETWORK CORP | 165 | 185 | 622 | 71,024 | メディア・娯楽 |
| DOCUSIGN INC | 118 | 146 | 3,866 | 441,151 | ソフトウェア・サービス |
| DOLLAR GENERAL CORP | 167 | 178 | 4,003 | 456,773 | 小売 |
| DOLLAR TREE INC | 158 | 175 | 2,362 | 269,558 | 小売 |
| DOMINION ENERGY INC | 550 | 609 | 4,525 | 516,310 | 公益事業 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 26 | 29 | 1,569 | 179,054 | 消費者サービス |
| DOORDASH INC - A | - | 55 | 1,197 | 136,602 | 小売 |
| DOVER CORP | 97 | 108 | 1,907 | 217,686 | 資本財 |
| DOW INC | 500 | 564 | 3,235 | 369,120 | 素材 |
| DR HORTON INC | 233 | 258 | 2,642 | 301,488 | 耐久消費財・アパレル |
| DRAFTKINGS INC - CL A | 118 | 241 | 873 | 99,691 | 消費者サービス |
| DROPBOX INC-CLASS A | 213 | 239 | 599 | 68,433 | ソフトウェア・サービス |
| DTE ENERGY COMPANY | 131 | 146 | 1,631 | 186,161 | 公益事業 |
| DUKE ENERGY CORP | 496 | 580 | 5,716 | 652,267 | 公益事業 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 361 | 401 | 3,211 | 366,425 | 素材 |
| DYNATRACE INC | 123 | 138 | 927 | 105,832 | ソフトウェア・サービス |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 91 | 103 | 1,168 | 133,283 | 素材 |
| EATON CORP PLC | 268 | 300 | 5,181 | 591,159 | 資本財 |
| EBAY INC | 463 | 513 | 3,833 | 437,421 | 小売 |
| ECOLAB INC | 173 | 194 | 4,570 | 521,453 | 素材 |
| EDISON INTERNATIONAL | 256 | 288 | 1,871 | 213,533 | 公益事業 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 419 | 468 | 5,487 | 626,141 | ヘルスケア機器・サービス |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 287 | 322 | 1,034 | 117,980 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ELECTRONIC ARTS INC | 194 | 216 | 2,867 | 327,219 | メディア・娯楽 |
| ELI LILLY & CO | 580 | 615 | 16,041 | 1,830,322 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EMERSON ELECTRIC CO | 403 | 452 | 4,227 | 482,385 | 資本財 |
| ENPHASE ENERGY INC | 80 | 97 | 2,606 | 297,365 | 半導体・半導体製造装置 |
| ENTERGY CORP | 136 | 152 | 1,612 | 183,956 | 公益事業 |
| EOG RESOURCES INC | 390 | 438 | 3,756 | 428,573 | エネルギー |
| EPAM SYSTEMS INC | 37 | 42 | 2,817 | 321,458 | ソフトウェア・サービス |
| EQUIFAX INC | 82 | 91 | 2,655 | 302,991 | 商業・専門サービス |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 268 | 291 | 955 | 109,042 | 各種金融 |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 16 | 19 | 415 | 47,443 | 保険 |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 157 | 177 | 863 | 98,578 | 公益事業 |
| ESTEE LAUDER COS INC | 152 | 175 | 6,178 | 704,915 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| ETSY INC | 84 | 95 | 2,823 | 322,149 | 小売 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|---|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| EVEREST RE GROUP LTD | 26 | 30 | 801 | 91,431 | 保険 |
| EVERGY INC | 154 | 173 | 1,138 | 129,951 | 公益事業 |
| EVERSOURCE ENERGY | 231 | 259 | 2,178 | 248,578 | 公益事業 |
| EXACT SCIENCES CORP | 107 | 129 | 1,091 | 124,575 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| EXELON CORP | 657 | 736 | 3,950 | 450,797 | 公益事業 |
| EXPEDIA GROUP INC | 92 | 106 | 1,869 | 213,327 | 消費者サービス |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC | 115 | 130 | 1,684 | 192,253 | 運輸 |
| EXXON MOBIL CORP | 2,849 | 3,196 | 19,392 | 2,212,739 | エネルギー |
| F5 INC | 41 | 44 | 1,039 | 118,613 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 25 | 28 | 1,313 | 149,870 | 各種金融 |
| FAIR ISAAC CORP | 19 | 21 | 778 | 88,803 | ソフトウェア・サービス |
| FASTENAL CO | 385 | 432 | 2,639 | 301,123 | 資本財 |
| FEDEX CORP | 169 | 191 | 4,654 | 531,028 | 運輸 |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 186 | 206 | 1,079 | 123,193 | 保険 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 419 | 468 | 5,152 | 587,906 | ソフトウェア・サービス |
| FIFTH THIRD BANCORP | 478 | 530 | 2,312 | 263,846 | 銀行 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 117 | 132 | 2,899 | 330,861 | 銀行 |
| FIRSTENERGY CORP | 368 | 412 | 1,588 | 181,218 | 公益事業 |
| FISERV INC | 384 | 453 | 4,540 | 518,027 | ソフトウェア・サービス |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 56 | 59 | 1,362 | 155,447 | ソフトウェア・サービス |
| FMC CORP | 87 | 97 | 1,018 | 116,156 | 素材 |
| FORD MOTOR CO | 2,633 | 2,959 | 5,739 | 654,859 | 自動車・自動車部品 |
| FORTINET INC | 92 | 104 | 3,582 | 408,819 | ソフトウェア・サービス |
| FORTIVE CORP | 205 | 243 | 1,923 | 219,524 | 資本財 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 93 | 104 | 1,126 | 128,561 | 資本財 |
| FOX CORP - CLASS A | 219 | 236 | 921 | 105,088 | メディア・娯楽 |
| FOX CORP- CLASS B | 121 | 125 | 454 | 51,817 | メディア・娯楽 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 201 | 227 | 787 | 89,879 | 各種金融 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 977 | 1,104 | 4,226 | 482,277 | 素材 |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR | - | 38 | 210 | 24,028 | 各種金融 |
| GARMIN LTD | 96 | 115 | 1,652 | 188,531 | 耐久消費財・アパレル |
| GARTNER INC | 60 | 64 | 2,174 | 248,080 | ソフトウェア・サービス |
| GENERAC HOLDINGS INC | 42 | 47 | 2,059 | 235,005 | 資本財 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 164 | 181 | 3,563 | 406,608 | 資本財 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 5,904 | 828 | 8,284 | 945,316 | 資本財 |
| GENERAL MILLS INC | 411 | 459 | 2,852 | 325,488 | 食品・飲料・タバコ |
| GENERAL MOTORS CO | 867 | 985 | 6,090 | 694,885 | 自動車・自動車部品 |

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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| GENUINE PARTS CO | 97 | 108 | 1,473 | 168,073 | 小売 |
| GILEAD SCIENCES INC | 844 | 946 | 6,501 | 741,861 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 202 | 223 | 2,810 | 320,721 | ソフトウェア・サービス |
| GLOBE LIFE INC | 66 | 73 | 679 | 77,521 | 保険 |
| GODADDY INC - CLASS A | 114 | 127 | 907 | 103,552 | ソフトウェア・サービス |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 219 | 256 | 9,928 | 1,132,832 | 各種金融 |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | 56 | 60 | 740 | 84,452 | ソフトウェア・サービス |
| HALLIBURTON CO | 596 | 671 | 1,480 | 168,878 | エネルギー |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC | 239 | 268 | 1,870 | 213,414 | 保険 |
| HASBRO INC | 88 | 99 | 995 | 113,581 | 耐久消費財・アパレル |
| HCA HEALTHCARE INC | 182 | 203 | 4,861 | 554,672 | ヘルスケア機器・サービス |
| HEICO CORP | 29 | 32 | 475 | 54,305 | 資本財 |
| HEICO CORP-CLASS A | 48 | 54 | 747 | 85,299 | 資本財 |
| HENRY SCHEIN INC | 95 | 105 | 802 | 91,619 | ヘルスケア機器・サービス |
| HERSHEY CO/THE | 99 | 110 | 1,983 | 226,304 | 食品・飲料・タバコ |
| HESS CORP | 185 | 208 | 1,586 | 180,969 | エネルギー |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS | 866 | 978 | 1,407 | 160,631 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 187 | 209 | 3,027 | 345,463 | 消費者サービス |
| HOLOGIC INC | 172 | 193 | 1,454 | 165,963 | ヘルスケア機器・サービス |
| HOME DEPOT INC | 725 | 802 | 32,803 | 3,742,833 | 小売 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 473 | 524 | 11,459 | 1,307,488 | 資本財 |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 821 | 932 | 538 | 61,465 | 不動産 |
| HORIZON PHARMA PLC | 148 | 160 | 1,724 | 196,799 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HORMEL FOODS CORP | 198 | 223 | 951 | 108,532 | 食品・飲料・タバコ |
| HOWMET AEROSPACE INC | 262 | 294 | 889 | 101,518 | 資本財 |
| HP INC | 924 | 945 | 2,972 | 339,219 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HUBSPOT INC | 29 | 33 | 2,754 | 314,327 | ソフトウェア・サービス |
| HUMANA INC | 88 | 97 | 4,232 | 482,938 | ヘルスケア機器・サービス |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 686 | 1,114 | 1,784 | 203,633 | 銀行 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 27 | 30 | 556 | 63,524 | 資本財 |
| IAC/INTERACTIVECORP | 53 | 59 | 766 | 87,458 | メディア・娯楽 |
| IDEX CORP | 51 | 57 | 1,346 | 153,583 | 資本財 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 57 | 64 | 4,159 | 474,582 | ヘルスケア機器・サービス |
| IHS MARKIT LTD | 255 | 285 | 3,688 | 420,875 | 商業・専門サービス |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 213 | 239 | 5,782 | 659,767 | 資本財 |
| ILLUMINA INC | 98 | 110 | 4,180 | 476,975 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INCYTE CORP | 125 | 141 | 910 | 103,909 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|--|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| INGERSOLL-RAND INC | 239 | 307 | 1,888 | 215,433 | 資本財 |
| INSULET CORP | 44 | 50 | 1,510 | 172,338 | ヘルスケア機器・サービス |
| INTEL CORP | 2,761 | 3,047 | 15,093 | 1,722,134 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 377 | 424 | 5,664 | 646,283 | 各種金融 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | 601 | 674 | 7,832 | 893,708 | ソフトウェア・サービス |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC | 151 | 188 | 2,825 | 322,374 | 素材 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 251 | 280 | 1,336 | 152,513 | 素材 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 265 | 295 | 1,016 | 115,988 | メディア・娯楽 |
| INTUIT INC | 176 | 206 | 14,267 | 1,627,870 | ソフトウェア・サービス |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 79 | 267 | 9,340 | 1,065,732 | ヘルスケア機器・サービス |
| INVESCO LTD | 258 | 259 | 626 | 71,469 | 各種金融 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | 90 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| IPG PHOTONICS CORP | 25 | 28 | 463 | 52,848 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 129 | 144 | 3,882 | 443,000 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 51 | 55 | 855 | 97,632 | ソフトウェア・サービス |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 87 | 98 | 1,442 | 164,575 | 商業・専門サービス |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 147 | 164 | 985 | 112,498 | 資本財 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 37 | 45 | 584 | 66,746 | 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 | 59 | 67 | 1,309 | 149,436 | 運輸 |
| JM SMUCKER CO | 76 | 81 | 1,014 | 115,711 | 食品・飲料・タバコ |
| JOHNSON & JOHNSON | 1,773 | 1,987 | 32,376 | 3,694,103 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 488 | 542 | 4,383 | 500,169 | 資本財 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 2,053 | 2,284 | 36,759 | 4,194,288 | 銀行 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 221 | 245 | 791 | 90,351 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 64 | 69 | 2,121 | 242,014 | 運輸 |
| KELLOGG CO | 174 | 192 | 1,194 | 136,264 | 食品・飲料・タバコ |
| KEURIG DR PEPPER INC | 382 | 537 | 1,889 | 215,555 | 食品・飲料・タバコ |
| KEYCORP | 657 | 730 | 1,706 | 194,717 | 銀行 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN | 124 | 138 | 2,704 | 308,614 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 229 | 255 | 3,434 | 391,819 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| KINDER MORGAN INC | 1,376 | 1,537 | 2,485 | 283,559 | エネルギー |
| KKR & CO INC -A | 345 | 394 | 3,090 | 352,626 | 各種金融 |
| KLA CORPORATION | 104 | 115 | 4,890 | 557,985 | 半導体・半導体製造装置 |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 93 | 126 | 722 | 82,395 | 運輸 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 452 | 506 | 1,790 | 204,276 | 食品・飲料・タバコ |
| KROGER CO | 518 | 539 | 2,205 | 251,692 | 食品・生活必需品小売り |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 141 | 154 | 3,405 | 388,578 | 資本財 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|-------------------------------------|---------|-----|--------|-----------|--------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | 65 | 73 | 2,082 | 237,666 | ヘルスケア機器・サービス |
| LAM RESEARCH CORP | 97 | 107 | 6,939 | 791,851 | 半導体・半導体製造装置 |
| LAMB WESTON HOLDING INC | 99 | 111 | 627 | 71,631 | 食品・飲料・タバコ |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 232 | 260 | 996 | 113,650 | 消費者サービス |
| LEAR CORP | 38 | 45 | 809 | 92,326 | 自動車・自動車部品 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 91 | 101 | 937 | 107,023 | 商業・専門サービス |
| LENNAR CORP-CL A | 185 | 208 | 2,321 | 264,912 | 耐久消費財・アパレル |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 23 | 26 | 842 | 96,101 | 資本財 |
| LIBERTY BROADBAND-A | 18 | 21 | 355 | 40,607 | メディア・娯楽 |
| LIBERTY BROADBAND-C | 106 | 111 | 1,855 | 211,709 | メディア・娯楽 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 140 | 144 | 403 | 46,022 | 電気通信サービス |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 219 | 244 | 684 | 78,070 | 電気通信サービス |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 53 | 59 | 310 | 35,463 | メディア・娯楽 |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 122 | 132 | 692 | 78,970 | メディア・娯楽 |
| LIBERTY MEDIA GROUP-C | 138 | 146 | 876 | 100,044 | メディア・娯楽 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 129 | 135 | 942 | 107,528 | 保険 |
| LINDE PLC | 354 | 393 | 13,057 | 1,489,886 | 素材 |
| LIVE NATION INC | 110 | 124 | 1,399 | 159,714 | メディア・娯楽 |
| LKQ CORP | 194 | 215 | 1,256 | 143,398 | 小売 |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 169 | 188 | 6,450 | 735,961 | 資本財 |
| LOEWS CORP | 167 | 167 | 930 | 106,128 | 保険 |
| LOWE'S COS INC | 493 | 533 | 13,313 | 1,519,114 | 小売 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 83 | 93 | 4,421 | 504,451 | 耐久消費財・アパレル |
| LYFT INC-A | - | 197 | 936 | 106,840 | 運輸 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 180 | 202 | 1,811 | 206,662 | 素材 |
| M&T BANK CORP | 85 | 96 | 1,522 | 173,669 | 銀行 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 439 | 492 | 2,970 | 338,890 | エネルギー |
| MARKEL CORP | 9 | 10 | 1,284 | 146,613 | 保険 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 25 | 28 | 1,028 | 117,408 | 各種金融 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL INC | 185 | 208 | 3,228 | 368,410 | 消費者サービス |
| MARSH & MCLENNAN COS INC | 342 | 384 | 6,503 | 742,039 | 保険 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 41 | 47 | 1,966 | 224,331 | 素材 |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 451 | 618 | 4,612 | 526,342 | 半導体・半導体製造装置 |
| MASCO CORP | 176 | 193 | 1,306 | 149,087 | 資本財 |
| MASIMO CORPORATION | 35 | 39 | 1,192 | 136,102 | ヘルスケア機器・サービス |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 599 | 667 | 22,690 | 2,588,994 | ソフトウェア・サービス |
| MATCH GROUP INC | 170 | 193 | 2,732 | 311,805 | メディア・娯楽 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---------|-------|---------|------------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 179 | - | - | - | 半導体・半導体製造装置 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 168 | 188 | 1,584 | 180,812 | 食品・飲料・タバコ |
| MCDONALD'S CORP | 502 | 563 | 14,195 | 1,619,720 | 消費者サービス |
| MCKESSON CORP | 108 | 119 | 2,643 | 301,649 | ヘルスケア機器・サービス |
| MEDTRONIC PLC | 906 | 1,017 | 11,928 | 1,361,019 | ヘルスケア機器・サービス |
| MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR | 147 | 166 | 182 | 20,795 | 消費者サービス |
| MERCADOLIBRE INC | 30 | 33 | 4,746 | 541,530 | 小売 |
| MERCK & CO INC | 1,705 | 1,912 | 15,434 | 1,761,032 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| META PLATFORMS INC-A | 1,619 | 1,808 | 62,446 | 7,125,102 | メディア・娯楽 |
| METLIFE INC | 512 | 559 | 3,421 | 390,361 | 保険 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 15 | 17 | 2,725 | 310,972 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MGM MIRAGE | 314 | 294 | 1,303 | 148,731 | 消費者サービス |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 176 | 413 | 3,422 | 390,492 | 半導体・半導体製造装置 |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 750 | 846 | 7,025 | 801,590 | 半導体・半導体製造装置 |
| MICROSOFT CORP | 4,840 | 5,400 | 185,298 | 21,142,571 | ソフトウェア・サービス |
| MODERNA INC | 186 | 257 | 6,793 | 775,155 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 40 | 44 | 793 | 90,488 | 耐久消費財・アパレル |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 39 | 43 | 1,309 | 149,403 | ヘルスケア機器・サービス |
| MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B | 127 | 143 | 657 | 75,002 | 食品・飲料・タバコ |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 963 | 1,059 | 6,413 | 731,751 | 食品・飲料・タバコ |
| MONGODB INC | 35 | 42 | 2,405 | 274,475 | ソフトウェア・サービス |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 28 | 32 | 1,870 | 213,477 | 半導体・半導体製造装置 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 265 | 298 | 2,664 | 304,002 | 食品・飲料・タバコ |
| MOODY'S CORP | 114 | 127 | 4,924 | 561,929 | 各種金融 |
| MORGAN STANLEY | 946 | 1,052 | 10,201 | 1,164,015 | 各種金融 |
| MOSAIC CO/THE | 242 | 270 | 981 | 112,006 | 素材 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 114 | 128 | 3,246 | 370,412 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MSCI INC | 55 | 62 | 4,083 | 465,889 | 各種金融 |
| NASDAQ INC | 76 | 86 | 1,788 | 204,113 | 各種金融 |
| NETAPP INC | 149 | 167 | 1,443 | 164,724 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| NETFLIX INC | 297 | 334 | 22,718 | 2,592,210 | メディア・娯楽 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 59 | 71 | 615 | 70,176 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NEWELL BRANDS INC | 271 | 288 | 654 | 74,697 | 耐久消費財・アパレル |
| NEWMONT CORP | 541 | 603 | 3,412 | 389,315 | 素材 |
| NEWS CORP - CLASS A | 263 | 293 | 649 | 74,071 | メディア・娯楽 |
| NEXTERA ENERGY INC | 1,319 | 1,480 | 13,077 | 1,492,180 | 公益事業 |
| NIKE INC | 845 | 962 | 16,834 | 1,920,833 | 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 | |
| NISOURCE INC | 266 | 299 | 756 | 86,305 | 公益事業 |
| NORDSON CORP | 37 | 39 | 1,054 | 120,317 | 資本財 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 173 | 191 | 5,251 | 599,175 | 運輸 |
| NORTHERN TRUST CORP | 133 | 149 | 1,799 | 205,336 | 各種金融 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 106 | 115 | 4,075 | 464,971 | 資本財 |
| NORTONLIFELOCK INC | 379 | 437 | 1,094 | 124,930 | ソフトウェア・サービス |
| NOVAVAX INC | - | 53 | 1,022 | 116,642 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NOVOCURE LTD | 58 | 70 | 728 | 83,122 | ヘルスケア機器・サービス |
| NRG ENERGY INC | 161 | 184 | 669 | 76,341 | 公益事業 |
| NUCOR CORP | 202 | 225 | 2,542 | 290,061 | 素材 |
| NVIDIA CORP | 417 | 1,881 | 62,046 | 7,079,535 | 半導体・半導体製造装置 |
| NVR INC | 2 | 2 | 1,366 | 155,928 | 耐久消費財・アパレル |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 188 | 208 | 4,603 | 525,313 | 半導体・半導体製造装置 |
| OAK STREET HEALTH INC | - | 73 | 266 | 30,363 | ヘルスケア機器・サービス |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 628 | 705 | 2,053 | 234,259 | エネルギー |
| OGE ENERGY CORP | 138 | - | - | - | 公益事業 |
| OKTA INC | 80 | 94 | 2,273 | 259,429 | ソフトウェア・サービス |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 65 | 76 | 2,701 | 308,255 | 運輸 |
| OMNICOM GROUP | 146 | 162 | 1,091 | 124,548 | メディア・娯楽 |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 277 | 322 | 2,042 | 233,052 | 半導体・半導体製造装置 |
| ONEOK INC | 300 | 336 | 2,067 | 235,897 | エネルギー |
| ORACLE CORP | 1,318 | 1,414 | 13,291 | 1,516,570 | ソフトウェア・サービス |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 48 | 52 | 3,346 | 381,807 | 小売 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 278 | 308 | 2,659 | 303,505 | 資本財 |
| OWENS CORNING | 73 | 78 | 703 | 80,280 | 資本財 |
| PACCAR INC | 233 | 263 | 2,272 | 259,240 | 資本財 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 63 | 71 | 952 | 108,728 | 素材 |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | - | 1,158 | 2,480 | 283,049 | ソフトウェア・サービス |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 64 | 73 | 3,901 | 445,185 | ソフトウェア・サービス |
| PARKER HANNIFIN CORP | 86 | 97 | 3,214 | 366,763 | 資本財 |
| PAYCHEX INC | 218 | 244 | 3,058 | 348,932 | ソフトウェア・サービス |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 33 | 38 | 1,818 | 207,443 | ソフトウェア・サービス |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 749 | 842 | 16,307 | 1,860,716 | ソフトウェア・サービス |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A | 163 | 192 | 908 | 103,673 | 耐久消費財・アパレル |
| PENTAIR PLC | 111 | 124 | 987 | 112,724 | 資本財 |
| PEPSICO INC | 931 | 1,043 | 17,090 | 1,950,058 | 食品・飲料・タバコ |
| PERKINELMER INC | 75 | 84 | 1,595 | 182,092 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|-------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| PFIZER INC | 3,746 | 4,225 | 21,463 | 2,449,038 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PG&E CORP | 1,005 | 1,125 | 1,393 | 159,044 | 公益事業 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 1,049 | 1,177 | 10,640 | 1,214,043 | 食品・飲料・タバコ |
| PHILLIPS 66 | 293 | 330 | 2,302 | 262,731 | エネルギー |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 76 | 85 | 572 | 65,277 | 公益事業 |
| PINTEREST INC- CLASS A | 344 | 413 | 1,849 | 211,015 | メディア・娯楽 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 137 | 174 | 3,071 | 350,494 | エネルギー |
| PLUG POWER INC | 315 | 386 | 1,722 | 196,530 | 資本財 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 285 | 320 | 6,385 | 728,585 | 銀行 |
| POOL CORP | 26 | 30 | 1,742 | 198,823 | 小売 |
| PPD INC | 83 | 93 | 441 | 50,397 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PPG INDUSTRIES INC | 159 | 179 | 2,881 | 328,809 | 素材 |
| PPL CORPORATION | 521 | 585 | 1,662 | 189,682 | 公益事業 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 184 | 204 | 1,448 | 165,307 | 保険 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 1,671 | 1,848 | 27,134 | 3,096,017 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PROGRESSIVE CORP | 394 | 441 | 3,985 | 454,794 | 保険 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 266 | 296 | 3,162 | 360,811 | 保険 |
| PTC INC | 74 | 83 | 982 | 112,159 | ソフトウェア・サービス |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 341 | 381 | 2,407 | 274,739 | 公益事業 |
| PULTE GROUP INC | 180 | 199 | 1,044 | 119,151 | 耐久消費財・アパレル |
| QORVO INC | 76 | 84 | 1,316 | 150,174 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUALCOMM INC | 762 | 851 | 15,757 | 1,797,979 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 90 | 98 | 1,459 | 166,541 | ヘルスケア機器・サービス |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 82 | 138 | 1,361 | 155,402 | 各種金融 |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 1,025 | 1,144 | 9,773 | 1,115,160 | 資本財 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 70 | 78 | 5,151 | 587,797 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 641 | 720 | 1,707 | 194,774 | 銀行 |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 45 | - | - | - | 保険 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 34 | 37 | 611 | 69,727 | 保険 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 152 | 169 | 2,311 | 263,722 | 商業・専門サービス |
| RESMED INC | 97 | 109 | 2,854 | 325,705 | ヘルスケア機器・サービス |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | 50 | 58 | 1,334 | 152,313 | ソフトウェア・サービス |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 76 | 84 | 994 | 113,518 | 商業・専門サービス |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 78 | 87 | 3,053 | 348,398 | 資本財 |
| ROKU INC | 73 | 86 | 2,035 | 232,277 | メディア・娯楽 |
| ROLLINS INC | 148 | 167 | 592 | 67,621 | 商業・専門サービス |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 70 | 79 | 3,962 | 452,123 | 資本財 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| ROSS STORES INC | 240 | 269 | 3,038 | 346,720 | 小売 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 128 | 173 | 1,392 | 158,888 | 消費者サービス |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A | 117 | 134 | 558 | 63,751 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RPM INTERNATIONAL INC | 88 | 98 | 935 | 106,785 | 素材 |
| S&P GLOBAL INC | 162 | 181 | 8,385 | 956,754 | 各種金融 |
| SALESFORCE.COM INC | 613 | 733 | 22,088 | 2,520,287 | ソフトウェア・サービス |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC | 51 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCHLUMBERGER LTD | 938 | 1,056 | 3,174 | 362,160 | エネルギー |
| SEA LTD-ADR | - | 52 | 1,613 | 184,100 | メディア・娯楽 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 155 | 155 | 1,564 | 178,510 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SEAGEN INC | 85 | 102 | 1,888 | 215,460 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SEALED AIR CORP | 104 | 115 | 742 | 84,699 | 素材 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 80 | 89 | 568 | 64,876 | 各種金融 |
| SEMPRA ENERGY | 194 | 239 | 2,943 | 335,843 | 公益事業 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 106 | 119 | 717 | 81,919 | 資本財 |
| SERVICENOW INC | 131 | 149 | 10,071 | 1,149,209 | ソフトウェア・サービス |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 165 | 192 | 6,380 | 728,056 | 素材 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 735 | 778 | 481 | 54,967 | メディア・娯楽 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 111 | 124 | 1,999 | 228,149 | 半導体・半導体製造装置 |
| SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A | 309 | - | - | - | ソフトウェア・サービス |
| SMITH (A.O.) CORP | 91 | 102 | 843 | 96,213 | 資本財 |
| SNAP INC - A | 623 | 717 | 3,683 | 420,333 | メディア・娯楽 |
| SNAP-ON INC | 34 | 40 | 877 | 100,120 | 資本財 |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 17 | 145 | 5,698 | 650,179 | ソフトウェア・サービス |
| SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC | 34 | 39 | 1,434 | 163,645 | 半導体・半導体製造装置 |
| SOUTHERN CO | 713 | 800 | 5,019 | 572,702 | 公益事業 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 99 | 110 | 517 | 59,091 | 運輸 |
| SPLUNK INC | 108 | 124 | 1,643 | 187,467 | ソフトウェア・サービス |
| SQUARE INC - A | 258 | 295 | 6,662 | 760,224 | ソフトウェア・サービス |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 156 | 174 | 1,402 | 159,972 | ソフトウェア・サービス |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 108 | 122 | 2,322 | 264,962 | 資本財 |
| STARBUCKS CORP | 791 | 889 | 9,857 | 1,124,707 | 消費者サービス |
| STATE STREET CORP | 236 | 261 | 2,477 | 282,706 | 各種金融 |
| STEEL DYNAMICS INC | 140 | 158 | 998 | 113,888 | 素材 |
| STERIS PLC | 57 | 75 | 1,752 | 200,011 | ヘルスケア機器・サービス |
| STRYKER CORP | 227 | 256 | 6,751 | 770,348 | ヘルスケア機器・サービス |
| SUNRUN INC | 79 | 131 | 720 | 82,162 | 資本財 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|--------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| SVB FINANCIAL GROUP | 34 | 42 | 3,057 | 348,854 | 銀行 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 353 | 439 | 2,103 | 240,054 | 各種金融 |
| SYNOPSIS INC | 101 | 114 | 4,113 | 469,357 | ソフトウェア・サービス |
| SYSCO CORP | 326 | 386 | 2,869 | 327,442 | 食品・生活必需品小売り |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 151 | 170 | 3,584 | 408,960 | 各種金融 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 77 | 87 | 1,486 | 169,658 | メディア・娯楽 |
| TARGET CORP | 337 | 373 | 9,353 | 1,067,276 | 小売 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 222 | 249 | 4,115 | 469,584 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELADOC HEALTH INC | 78 | 105 | 1,229 | 140,293 | ヘルスケア機器・サービス |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 24 | 35 | 1,557 | 177,754 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELEFLEX INC | 31 | 35 | 1,127 | 128,670 | ヘルスケア機器・サービス |
| TERADYNE INC | 111 | 125 | 1,895 | 216,249 | 半導体・半導体製造装置 |
| TESLA, INC. | 511 | 618 | 70,280 | 8,019,009 | 自動車・自動車部品 |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 740 | 835 | 741 | 84,633 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 618 | 697 | 13,606 | 1,552,530 | 半導体・半導体製造装置 |
| TEXTRON INC | 153 | 169 | 1,276 | 145,698 | 資本財 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 267 | 296 | 18,868 | 2,152,887 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TJX COS INC | 808 | 911 | 6,471 | 738,347 | 小売 |
| T-MOBILE US INC | 376 | 471 | 5,456 | 622,634 | 電気通信サービス |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 78 | 86 | 2,003 | 228,580 | 小売 |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 28 | 325 | 3,508 | 400,302 | ソフトウェア・サービス |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 61 | 78 | 769 | 87,754 | 各種金融 |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 162 | 181 | 3,548 | 404,827 | 資本財 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 34 | 39 | 2,493 | 284,478 | 資本財 |
| TRANSUNION | 129 | 144 | 1,700 | 194,031 | 商業・専門サービス |
| TRAVELERS COS INC/THE | 169 | 189 | 2,885 | 329,277 | 保険 |
| TRIMBLE INC | 168 | 189 | 1,678 | 191,526 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 910 | 1,016 | 6,163 | 703,235 | 銀行 |
| TWILIO INC - A | 94 | 122 | 3,493 | 398,611 | ソフトウェア・サービス |
| TWITTER INC | 535 | 602 | 2,914 | 332,489 | メディア・娯楽 |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 27 | 30 | 1,680 | 191,727 | ソフトウェア・サービス |
| TYSON FOODS INC-CL A | 197 | 222 | 1,811 | 206,671 | 食品・飲料・タバコ |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 656 | 922 | 4,079 | 465,512 | 運輸 |
| UGI CORP | 142 | 158 | 694 | 79,212 | 公益事業 |
| ULTA BEAUTY INC | 36 | 39 | 1,599 | 182,496 | 小売 |
| UNION PACIFIC CORP | 457 | 505 | 12,206 | 1,392,753 | 運輸 |
| UNITED PARCEL SERVICE INC | 483 | 547 | 11,421 | 1,303,186 | 運輸 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|-------------------------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| UNITED RENTALS INC | 48 | 54 | 2,044 | 233,267 | 資本財 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 639 | 712 | 31,338 | 3,575,729 | ヘルスケア機器・サービス |
| UNITY SOFTWARE INC | - | 42 | 800 | 91,321 | ソフトウェア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 52 | 58 | 725 | 82,740 | ヘルスケア機器・サービス |
| US BANCORP | 914 | 1,067 | 6,150 | 701,751 | 銀行 |
| VAIL RESORTS INC | 27 | 30 | 1,042 | 118,893 | 消費者サービス |
| VALERO ENERGY CORP | 274 | 308 | 2,132 | 243,306 | エネルギー |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 91 | 104 | 3,177 | 362,578 | ヘルスケア機器・サービス |
| VERISIGN INC | 69 | 76 | 1,882 | 214,771 | ソフトウェア・サービス |
| VERISK ANALYTICS INC | 104 | 116 | 2,680 | 305,902 | 商業・専門サービス |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 2,793 | 3,133 | 15,934 | 1,818,119 | 電気通信サービス |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 175 | 195 | 3,572 | 407,566 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VF CORP | 224 | 252 | 1,918 | 218,920 | 耐久消費財・アパレル |
| VIACOMCBS INC | 380 | 456 | 1,537 | 175,431 | メディア・娯楽 |
| VIATRIS INC | 829 | 914 | 1,196 | 136,500 | 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 | 1,140 | 1,277 | 25,650 | 2,926,736 | ソフトウェア・サービス |
| VISTRA CORP | 296 | 330 | 661 | 75,528 | 公益事業 |
| VMWARE INC-CLASS A | 57 | 153 | 1,851 | 211,286 | ソフトウェア・サービス |
| VOYA FINANCIAL INC | 85 | 90 | 590 | 67,375 | 各種金融 |
| VULCAN MATERIALS CO | 89 | 100 | 1,966 | 224,411 | 素材 |
| WABTEC CORP | 122 | 136 | 1,299 | 148,324 | 資本財 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 495 | 554 | 2,602 | 296,967 | 食品・生活必需品小売り |
| WALMART INC | 954 | 1,167 | 16,623 | 1,896,704 | 食品・生活必需品小売り |
| WALT DISNEY CO | 1,220 | 1,371 | 21,122 | 2,410,040 | メディア・娯楽 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 178 | 198 | 2,723 | 310,767 | 商業・専門サービス |
| WASTE MANAGEMENT INC | 286 | 319 | 5,219 | 595,544 | 商業・専門サービス |
| WATERS CORP | 41 | 46 | 1,623 | 185,184 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WAYFAIR INC- CLASS A | 46 | 55 | 1,531 | 174,714 | 小売 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 213 | 238 | 2,157 | 246,165 | 公益事業 |
| WELLS FARGO & CO | 2,646 | 3,118 | 15,226 | 1,737,312 | 銀行 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 49 | 55 | 2,488 | 283,932 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WESTERN DIGITAL CORP | 205 | 231 | 1,295 | 147,786 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WESTERN UNION CO | 278 | 311 | 518 | 59,126 | ソフトウェア・サービス |
| WESTROCK CO-WHEN ISSUED | 177 | 201 | 942 | 107,556 | 素材 |
| WEYERHAEUSER CO | 499 | 563 | 2,144 | 244,696 | 不動産 |
| WHIRLPOOL CORP | 42 | 47 | 1,085 | 123,798 | 耐久消費財・アパレル |
| WILLIAMS COS INC | 818 | 918 | 2,517 | 287,291 | 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 86 | 97 | 2,263 | 258,240 | 保険 |
| WIX.COM LTD | 37 | 42 | 719 | 82,044 | ソフトウェア・サービス |
| WORKDAY INC-CLASS A | 121 | 142 | 4,088 | 466,513 | ソフトウェア・サービス |
| WR BERKLEY CORP | 95 | 106 | 853 | 97,400 | 保険 |
| WW GRAINGER INC | 30 | 33 | 1,612 | 184,033 | 資本財 |
| WYNN RESORTS LTD | 69 | 78 | 713 | 81,454 | 消費者サービス |
| XCEL ENERGY INC | 355 | 406 | 2,648 | 302,219 | 公益事業 |
| XILINX INC | 165 | 185 | 4,099 | 467,785 | 半導体・半導体製造装置 |
| XPO LOGISTICS INC | 63 | - | - | - | 運輸 |
| XYLEM INC | 121 | 136 | 1,756 | 200,361 | 資本財 |
| YUM! BRANDS INC | 202 | 224 | 2,850 | 325,213 | 消費者サービス |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 35 | 40 | 2,404 | 274,331 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| ZENDESK INC | 78 | 89 | 873 | 99,714 | ソフトウェア・サービス |
| ZILLOW GROUP INC - C W/I | 101 | 122 | 686 | 78,304 | 不動産 |
| ZILLOW GROUP INC - CL A | 40 | 46 | 262 | 29,918 | 不動産 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 139 | 157 | 2,027 | 231,378 | ヘルスケア機器・サービス |
| ZOETIS INC | 320 | 358 | 8,120 | 926,570 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 131 | 160 | 4,032 | 460,120 | ソフトウェア・サービス |
| ZSCALER INC | 49 | 61 | 2,271 | 259,157 | ソフトウェア・サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 211,578 592 | 237,836 598 | 3,145,419 - | 358,892,357 <69.9%> |
| (カナダ) | | | 千カナダ・ドル | | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 163 | 183 | 1,260 | 113,678 | 素材 |
| AIR CANADA | 112 | 135 | 319 | 28,797 | 運輸 |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 411 | 476 | 856 | 77,228 | 公益事業 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B | 579 | 622 | 3,173 | 286,221 | 食品・生活必需品小売り |
| ALTAGAS LTD | 191 | 215 | 533 | 48,093 | 公益事業 |
| ATCO LTD -CL 'I' | 54 | 60 | 255 | 23,069 | 公益事業 |
| B2GOLD CORP | 686 | 772 | 430 | 38,783 | 素材 |
| BALLARD POWER SYSTEMS INC | 152 | 181 | 373 | 33,693 | 資本財 |
| BANK OF MONTREAL | 433 | 488 | 6,742 | 608,005 | 銀行 |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 816 | 916 | 7,569 | 682,588 | 銀行 |
| BARRICK GOLD CORP | 1,197 | 1,342 | 3,439 | 310,140 | 素材 |
| BAUSCH HEALTH COMPANIES INC | 216 | 231 | 761 | 68,681 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BCE INC | 115 | 67 | 439 | 39,647 | 電気通信サービス |
| BLACKBERRY LTD | 356 | 407 | 538 | 48,548 | ソフトウェア・サービス |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC | 867 | 970 | 7,318 | 659,952 | 各種金融 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------------|---------|-------|---------|---------|------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| BROOKFIELD RENEWABLE CORP-A | 87 | 98 | 486 | 43,862 | 公益事業 |
| CAE INC | 190 | 221 | 781 | 70,460 | 資本財 |
| CAMECO CORP | 265 | 299 | 959 | 86,570 | エネルギー |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 301 | 338 | 4,981 | 449,275 | 銀行 |
| CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO | 487 | 544 | 8,904 | 803,039 | 運輸 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 795 | 893 | 4,561 | 411,323 | エネルギー |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 463 | 515 | 4,880 | 440,132 | 運輸 |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 38 | 43 | 752 | 67,896 | 小売 |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A | 93 | 104 | 372 | 33,584 | 公益事業 |
| CANOPY GROWTH CORP | 151 | 176 | 272 | 24,588 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 101 | 115 | 760 | 68,553 | 素材 |
| CENOVUS ENERGY INC | 882 | 985 | 1,511 | 136,345 | エネルギー |
| CGI INC | 154 | 167 | 1,825 | 164,639 | ソフトウェア・サービス |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 13 | 15 | 3,424 | 308,814 | ソフトウェア・サービス |
| DOLLARAMA INC | 200 | 224 | 1,290 | 116,417 | 小売 |
| EMERA INC | 174 | 197 | 1,174 | 105,921 | 公益事業 |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 113 | 128 | 486 | 43,907 | 食品・生活必需品小売り |
| ENBRIDGE INC | 1,371 | 1,535 | 7,719 | 696,172 | エネルギー |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 17 | 19 | 1,143 | 103,160 | 保険 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 394 | 441 | 1,195 | 107,800 | 素材 |
| FIRSTSERVICE CORP | 27 | 30 | 754 | 68,036 | 不動産 |
| FORTIS INC | 319 | 362 | 2,044 | 184,329 | 公益事業 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 128 | 143 | 2,618 | 236,174 | 素材 |
| GEORGE WESTON LTD | 52 | 57 | 816 | 73,591 | 食品・生活必需品小売り |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 129 | 120 | 616 | 55,625 | 商業・専門サービス |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 135 | 150 | 800 | 72,208 | 耐久消費財・アパレル |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 192 | 215 | 817 | 73,766 | 保険 |
| HYDRO ONE LTD | 226 | 257 | 795 | 71,727 | 公益事業 |
| IA FINANCIAL CORP INC | 71 | 80 | 586 | 52,853 | 保険 |
| IGM FINANCIAL INC | 57 | 64 | 324 | 29,274 | 各種金融 |
| IMPERIAL OIL LTD | 170 | 193 | 827 | 74,592 | エネルギー |
| INTACT FINANCIAL CORP | 96 | 133 | 2,210 | 199,357 | 保険 |
| INTER PIPELINE LTD | 290 | - | - | - | エネルギー |
| IVANHOE MINES LTD-CL A | - | 458 | 464 | 41,871 | 素材 |
| KEYERA CORP | 149 | 167 | 497 | 44,858 | エネルギー |
| KINROSS GOLD CORP | 820 | 923 | 778 | 70,191 | 素材 |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD | 175 | 201 | 1,088 | 98,174 | 素材 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------|-------|---------|-----------|-------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| LIGHTSPEED COMMERCE INC | - | 80 | 590 | 53,230 | ソフトウェア・サービス |
| LOBLAW COS LTD | 118 | 127 | 1,253 | 113,015 | 食品・生活必需品小売り |
| LUNDIN MINING CORP | 441 | 499 | 528 | 47,673 | 素材 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 192 | 217 | 2,359 | 212,794 | 自動車・自動車部品 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 1,303 | 1,469 | 3,589 | 323,698 | 保険 |
| METRO INC | 171 | 187 | 1,177 | 106,147 | 食品・生活必需品小売り |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 227 | 255 | 2,675 | 241,246 | 銀行 |
| NORTHLAND POWER INC | 129 | 172 | 691 | 62,362 | 公益事業 |
| NUTRIEN LTD | 384 | 431 | 3,707 | 334,344 | 素材 |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG | - | 42 | 539 | 48,651 | ソフトウェア・サービス |
| ONEX CORPORATION | 52 | 57 | 534 | 48,165 | 各種金融 |
| OPEN TEXT CORP | 186 | 208 | 1,375 | 124,012 | ソフトウェア・サービス |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 141 | 158 | 538 | 48,567 | 素材 |
| PARKLAND CORP | 102 | 116 | 399 | 36,004 | エネルギー |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 371 | 416 | 1,732 | 156,272 | エネルギー |
| POWER CORP OF CANADA | 378 | 425 | 1,826 | 164,709 | 保険 |
| QUEBECOR INC -CL B | 122 | 131 | 380 | 34,352 | メディア・娯楽 |
| RESTAURANT BRANDS INTERN | 195 | 209 | 1,519 | 137,045 | 消費者サービス |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS | 74 | 84 | 780 | 70,354 | 商業・専門サービス |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC | 244 | 273 | 1,607 | 144,977 | 電気通信サービス |
| ROYAL BANK OF CANADA | 960 | 1,077 | 14,216 | 1,282,015 | 銀行 |
| SAPUTO INC | 167 | 189 | 572 | 51,659 | 食品・飲料・タバコ |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 325 | 345 | 1,277 | 115,170 | メディア・娯楽 |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 74 | 85 | 18,218 | 1,642,937 | ソフトウェア・サービス |
| SSR MINING INC | 149 | - | - | - | 素材 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 394 | 445 | 3,145 | 283,624 | 保険 |
| SUNCOR ENERGY INC | 1,029 | 1,138 | 3,606 | 325,195 | エネルギー |
| TC ENERGY CORP | 636 | 742 | 4,474 | 403,476 | エネルギー |
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 316 | 354 | 1,172 | 105,720 | 素材 |
| THOMSON REUTERS CORP | 118 | 131 | 2,046 | 184,542 | 商業・専門サービス |
| TMX GROUP LTD | 39 | 43 | 587 | 52,955 | 各種金融 |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | 56 | 63 | 720 | 64,938 | 資本財 |
| TORONTO-DOMINION BANK | 1,222 | 1,374 | 12,622 | 1,138,312 | 銀行 |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 56 | 71 | 785 | 70,832 | 素材 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 302 | 338 | 1,893 | 170,745 | 素材 |
| WSP GLOBAL INC | 76 | 88 | 1,587 | 143,183 | 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 | |
| (カナダ) | | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| YAMANA GOLD INC | | 631 | 713 | 388 | 34,998 | 素材 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 27,097 86 | 30,477 87 | 192,661 - | 17,374,171 <3.4%> | |
| (オーストラリア) | | | | 千オーストラリア・ドル | | |
| AFTERPAY LTD | | 145 | 165 | 1,928 | 159,081 | ソフトウェア・サービス |
| AGL ENERGY LTD | | 500 | 577 | 296 | 24,419 | 公益事業 |
| AMP LTD | | 2,512 | - | - | - | 各種金融 |
| AMPOL LTD | | 182 | 197 | 596 | 49,235 | エネルギー |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | | 402 | 446 | 2,005 | 165,430 | 消費者サービス |
| ASX LTD | | 144 | 157 | 1,476 | 121,809 | 各種金融 |
| AURIZON HOLDINGS LTD | | 1,514 | 1,675 | 571 | 47,132 | 運輸 |
| AUSNET SERVICES | | 1,624 | 1,822 | 466 | 38,486 | 公益事業 |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP | | 1,951 | 2,193 | 5,988 | 493,950 | 銀行 |
| BHP GROUP LIMITED | | 1,997 | 2,237 | 8,156 | 672,822 | 素材 |
| BLUESCOPE STEEL LTD | | 362 | 403 | 835 | 68,956 | 素材 |
| BRAMBLES LTD | | 1,067 | 1,177 | 1,226 | 101,136 | 商業・専門サービス |
| CIMIC GROUP LIMITED | | 82 | - | - | - | 資本財 |
| COCHLEAR LTD | | 47 | 52 | 1,213 | 100,132 | ヘルスケア機器・サービス |
| COLES GROUP LTD | | 931 | 1,048 | 1,887 | 155,695 | 食品・生活必需品小売り |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | | 1,210 | 1,352 | 13,226 | 1,091,090 | 銀行 |
| COMPUTERSHARE LIMITED | | 389 | 458 | 900 | 74,253 | ソフトウェア・サービス |
| CROWN RESORTS LTD | | 312 | 332 | 384 | 31,682 | 消費者サービス |
| CSL LIMITED | | 309 | 346 | 10,926 | 901,292 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | | - | 48 | 601 | 49,636 | 消費者サービス |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA | | - | 1,154 | 823 | 67,901 | 食品・生活必需品小売り |
| EVOLUTION MINING LTD | | 1,157 | 1,460 | 645 | 53,238 | 素材 |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | | 1,146 | 1,288 | 1,993 | 164,412 | 素材 |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD | | 1,755 | 1,984 | 898 | 74,138 | 保険 |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | | 311 | 346 | 1,897 | 156,546 | 素材 |
| MACQUARIE GROUP LTD | | 238 | 267 | 5,568 | 459,368 | 各種金融 |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | | 96 | 118 | 411 | 33,943 | 各種金融 |
| MEDIBANK PRIVATE LTD | | 1,992 | 2,238 | 801 | 66,118 | 保険 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | | 2,264 | 2,552 | 7,293 | 601,616 | 銀行 |
| NEWCREST MINING LIMITED | | 566 | 641 | 1,593 | 131,477 | 素材 |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD | | 761 | 868 | 908 | 74,954 | 素材 |
| OIL SEARCH LTD | | 1,397 | 1,599 | 671 | 55,432 | エネルギー |
| ORICA LTD | | 338 | 374 | 566 | 46,765 | 素材 |
| ORIGIN ENERGY LIMITED | | 1,308 | 1,458 | 729 | 60,139 | 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 | |
| (オーストラリア) | 百株 | 百株 | オーストラリアドル | 千円 | |
| QANTAS AIRWAYS LTD | 708 | 793 | 434 | 35,865 | 運輸 |
| QBE INSURANCE GROUP LTD | 1,054 | 1,161 | 1,417 | 116,910 | 保険 |
| RAMSAY HEALTH CARE LIMITED | 137 | 151 | 1,031 | 85,053 | ヘルスケア機器・サービス |
| REA GROUP LTD | 39 | 45 | 777 | 64,151 | メディア・娯楽 |
| REECE LTD | - | 235 | 533 | 44,038 | 資本財 |
| RIO TINTO LTD | 253 | 284 | 2,566 | 211,698 | 素材 |
| SANTOS LTD | 1,254 | 1,511 | 1,018 | 84,032 | エネルギー |
| SEEK LTD | 246 | 274 | 976 | 80,585 | メディア・娯楽 |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 325 | 362 | 1,485 | 122,575 | ヘルスケア機器・サービス |
| SOUTH32 LTD | 3,443 | 3,830 | 1,344 | 110,908 | 素材 |
| SUNCORP GROUP LTD | 955 | 1,050 | 1,158 | 95,563 | 保険 |
| TABCORP HOLDINGS LTD | 1,652 | 1,818 | 934 | 77,082 | 消費者サービス |
| TELSTRA CORP LTD | 3,067 | 3,449 | 1,400 | 115,534 | 電気通信サービス |
| TPG TELECOM LTD | 322 | - | - | - | 電気通信サービス |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 504 | 565 | 679 | 56,034 | 食品・飲料・タバコ |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 80 | 92 | 292 | 24,133 | エネルギー |
| WESFARMERS LIMITED | 785 | 877 | 5,197 | 428,703 | 小売 |
| WESTPAC BANKING CORP | 2,472 | 2,823 | 6,251 | 515,654 | 銀行 |
| WISETECH GLOBAL LTD | 103 | 115 | 660 | 54,503 | ソフトウェア・サービス |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 687 | 770 | 1,703 | 140,522 | エネルギー |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 871 | 979 | 3,939 | 324,976 | 食品・生活必需品小売り |
| XERO LTD | 84 | 103 | 1,561 | 128,782 | ソフトウェア・サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 48,074 53 | 52,345 53 | 112,857 - | 9,309,612 <1.8%> |
| (香港) | | | 千香港ドル | | |
| AIA GROUP LTD | 8,150 | 9,136 | 77,296 | 1,132,399 | 保険 |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 208 | - | - | - | 半導体・半導体製造装置 |
| BANK OF EAST ASIA | 914 | - | - | - | 銀行 |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 2,525 | 2,825 | 6,908 | 101,203 | 銀行 |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 1,166 | 1,311 | 2,720 | 39,852 | 食品・飲料・タバコ |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | - | 1,506 | 2,566 | 37,595 | 小売 |
| CK ASSET HOLDINGS LTD | 1,759 | 1,524 | 6,980 | 102,261 | 不動産 |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 1,824 | 2,044 | 10,649 | 156,018 | 資本財 |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED | 470 | 520 | 2,418 | 35,423 | 公益事業 |
| CLP HOLDINGS LTD | 1,126 | 1,246 | 9,472 | 138,777 | 公益事業 |
| ESR CAYMAN LTD | 1,244 | 1,518 | 4,053 | 59,377 | 不動産 |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 1,458 | 1,648 | 7,622 | 111,669 | 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 | | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | | |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 1,391 | 1,561 | 2,598 | 38,067 | 不動産 | |
| HANG SENG BANK LTD | 518 | 582 | 8,335 | 122,121 | 銀行 | |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 1,046 | 1,156 | 3,902 | 57,177 | 不動産 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 7,357 | 8,544 | 9,979 | 146,204 | 公益事業 | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 811 | 909 | 42,219 | 618,509 | 各種金融 | |
| MTR CORP | 1,117 | 1,247 | 5,208 | 76,304 | 運輸 | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 1,099 | 1,229 | 4,240 | 62,125 | 不動産 | |
| PCCW LTD | 3,460 | - | - | - | 電気通信サービス | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 950 | 1,060 | 5,002 | 73,279 | 公益事業 | |
| SANDS CHINA LTD | 1,645 | 1,877 | 3,657 | 53,589 | 消費者サービス | |
| SINO LAND CO | 2,200 | 2,600 | 2,592 | 37,975 | 不動産 | |
| SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | - | 1,060 | 2,750 | 40,297 | 運輸 | |
| SJM HOLDINGS LTD | 1,350 | 1,570 | 965 | 14,145 | 消費者サービス | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD | 890 | 995 | 10,002 | 146,530 | 不動産 | |
| SWIRE PACIFIC LTD | 348 | 398 | 1,893 | 27,741 | 不動産 | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 820 | 938 | 1,969 | 28,857 | 不動産 | |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 925 | 1,035 | 17,636 | 258,373 | 資本財 | |
| WH GROUP LTD | 6,465 | 7,235 | 3,769 | 55,222 | 食品・飲料・タバコ | |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 1,137 | 1,287 | 5,432 | 79,586 | 不動産 | |
| WYNN MACAU LTD | 1,105 | 1,333 | 959 | 14,060 | 消費者サービス | |
| XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD | 1,220 | 1,380 | 2,801 | 41,040 | 資本財 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 56,705 31 | 61,281 30 | 266,606 - | 3,905,789 <0.8%> | |
| (シンガポール) | | | 千シンガポール・ドル | | | |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | - | 2,065 | 695 | 58,268 | 不動産 | |
| CAPITALAND LTD | 1,890 | - | - | - | 不動産 | |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 321 | 333 | 238 | 19,991 | 不動産 | |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 1,209 | 1,360 | 4,417 | 369,858 | 銀行 | |
| GENTING SINGAPORE LTD | 3,946 | 4,449 | 369 | 30,918 | 消費者サービス | |
| KEPPEL CORP LTD | 1,009 | 1,121 | 598 | 50,121 | 資本財 | |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 2,264 | 2,531 | 2,984 | 249,854 | 銀行 | |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 935 | 1,016 | 539 | 45,172 | 運輸 | |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 537 | 603 | 566 | 47,409 | 各種金融 | |
| SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD | 1,063 | 1,208 | 477 | 39,952 | 資本財 | |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 5,601 | 6,354 | 1,582 | 132,473 | 電気通信サービス | |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 793 | 889 | 2,456 | 205,666 | 銀行 | |
| UOL Group Limited | 318 | 355 | 250 | 21,014 | 不動産 | |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|--------------|--------------|-------------|---------------------|------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | | 百株 | 百株 | 千シンガポールドル | 千円 | |
| VENTURE CORP LTD | | 187 | 207 | 400 | 33,537 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | | 1,281 | 1,444 | 616 | 51,626 | 食品・飲料・タバコ |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 21,354 14 | 23,935 14 | 16,193 - | 1,355,866 <0.3%> | |
| (ニュージーランド) | | | | 千ニュージーランドドル | | |
| A2 MILK CO LTD | | 505 | 566 | 367 | 29,262 | 食品・飲料・タバコ |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | | 890 | 1,007 | 798 | 63,686 | 運輸 |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | | 388 | 436 | 1,378 | 109,901 | ヘルスケア機器・サービス |
| MERCURY NZ LTD | | 463 | 525 | 303 | 24,225 | 公益事業 |
| MERIDIAN ENERGY LTD | | 864 | 973 | 450 | 35,931 | 公益事業 |
| RYMAN HEALTHCARE LTD | | 277 | 328 | 426 | 33,992 | ヘルスケア機器・サービス |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | | 1,314 | 1,487 | 659 | 52,538 | 電気通信サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 4,703 7 | 5,325 7 | 4,385 - | 349,539 <0.1%> | |
| (イギリス) | | | | 千イギリスポンド | | |
| 3I GROUP PLC | | 649 | 730 | 1,054 | 161,749 | 各種金融 |
| ABRDN PLC | | 1,481 | 1,626 | 412 | 63,187 | 各種金融 |
| ADMIRAL GROUP PLC | | 130 | 145 | 434 | 66,623 | 保険 |
| ANGLO AMERICAN PLC | | 823 | 973 | 2,768 | 424,615 | 素材 |
| ANTOFAGASTA PLC | | 262 | 294 | 415 | 63,720 | 素材 |
| ASHTED GROUP PLC | | 303 | 338 | 2,133 | 327,204 | 資本財 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | | 239 | 269 | 511 | 78,428 | 食品・飲料・タバコ |
| ASTRAZENECA PLC | | 884 | 1,169 | 9,918 | 1,521,150 | 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 | | 650 | 725 | 533 | 81,762 | メディア・娯楽 |
| AVEVA GROUP PLC | | 78 | 91 | 315 | 48,341 | ソフトウェア・サービス |
| AVIVA PLC | | 2,618 | 2,964 | 1,161 | 178,100 | 保険 |
| BAE SYSTEMS PLC | | 2,168 | 2,436 | 1,376 | 211,111 | 資本財 |
| BARCLAYS PLC | | 11,636 | 12,774 | 2,438 | 374,000 | 銀行 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | | 688 | 773 | 529 | 81,211 | 耐久消費財・アパレル |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT | | 85 | 83 | 371 | 56,913 | 耐久消費財・アパレル |
| BHP GROUP PLC | | 1,418 | 1,590 | 2,996 | 459,488 | 素材 |
| BP PLC | | 13,689 | 15,290 | 4,992 | 765,649 | エネルギー |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | | 1,546 | 1,645 | 4,187 | 642,243 | 食品・飲料・タバコ |
| BT GROUP PLC | | 6,028 | 6,764 | 1,086 | 166,604 | 電気通信サービス |
| BUNZL PLC | | 227 | 254 | 723 | 110,919 | 資本財 |
| BURBERRY GROUP PLC | | 273 | 306 | 592 | 90,866 | 耐久消費財・アパレル |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | | 135 | 150 | 372 | 57,117 | 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 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| COMPASS GROUP PLC | 1,201 | 1,345 | 1,991 | 305,374 | 消費者サービス |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 93 | 105 | 1,056 | 162,007 | 素材 |
| DCC PLC | 66 | 74 | 433 | 66,440 | 資本財 |
| DIAGEO PLC | 1,577 | 1,765 | 6,848 | 1,050,257 | 食品・飲料・タバコ |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 912 | 1,018 | 275 | 42,254 | 保険 |
| ENTAIN PLC | 393 | 440 | 844 | 129,586 | 消費者サービス |
| EVRAZ PLC | 338 | 379 | 223 | 34,346 | 素材 |
| EXPERIAN PLC | 619 | 697 | 2,370 | 363,609 | 商業・専門サービス |
| FERGUSON PLC | 151 | 168 | 2,026 | 310,739 | 資本財 |
| FRESNILLO PLC | 122 | - | - | - | 素材 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 3,391 | 3,804 | 5,789 | 887,897 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GLENCORE PLC | 6,724 | 7,528 | 2,781 | 426,511 | 素材 |
| HALMA PLC | 255 | 285 | 904 | 138,781 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 222 | 268 | 402 | 61,703 | 各種金融 |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 115 | 130 | 300 | 46,094 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HSBC HOLDINGS PLC | 13,728 | 15,418 | 6,656 | 1,020,806 | 銀行 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 637 | 714 | 1,131 | 173,550 | 食品・飲料・タバコ |
| INFORMA PLC | 1,026 | 1,142 | 587 | 90,085 | メディア・娯楽 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 117 | 139 | 683 | 104,868 | 消費者サービス |
| INTERTEK GROUP PLC | 109 | 122 | 641 | 98,329 | 商業・専門サービス |
| JD SPORTS FASHION PLC | 347 | 387 | 452 | 69,331 | 小売 |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 129 | 146 | 326 | 50,068 | 素材 |
| KINGFISHER PLC | 1,406 | 1,577 | 508 | 78,004 | 小売 |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 4,031 | 4,510 | 1,316 | 201,829 | 保険 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 47,693 | 53,401 | 2,616 | 401,295 | 銀行 |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 213 | 248 | 1,666 | 255,540 | 各種金融 |
| M&G PLC | 1,763 | 1,986 | 384 | 58,938 | 各種金融 |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 3,289 | 3,298 | 525 | 80,623 | 資本財 |
| MONDI PLC/WI | 325 | 366 | 668 | 102,568 | 素材 |
| MORRISON WM SUPERMARKETS | 1,602 | - | - | - | 食品・生活必需品小売り |
| NATIONAL GRID PLC | 2,378 | 2,691 | 2,647 | 406,016 | 公益事業 |
| NATWEST GROUP PLC | 3,263 | 4,349 | 959 | 147,160 | 銀行 |
| NEXT PLC | 89 | 100 | 831 | 127,461 | 小売 |
| NMC HEALTH PLC | 47 | 47 | 0.005 | 0.728 | ヘルスケア機器・サービス |
| OCADO GROUP PLC | 328 | 369 | 700 | 107,382 | 食品・生活必需品小売り |
| PEARSON PLC | 505 | 567 | 357 | 54,865 | メディア・娯楽 |
| PERSIMMON PLC | 215 | 241 | 673 | 103,298 | 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 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 386 | 507 | 334 | 51,297 | 保険 |
| PRUDENTIAL PLC | 1,757 | 1,974 | 2,865 | 439,431 | 保険 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 481 | 540 | 3,375 | 517,606 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| RELX PLC | 1,304 | 1,462 | 3,460 | 530,743 | 商業・専門サービス |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 1,255 | 1,410 | 889 | 136,406 | 商業・専門サービス |
| RIO TINTO PLC | 754 | 845 | 3,766 | 577,559 | 素材 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 5,677 | 6,329 | 860 | 132,014 | 資本財 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 2,758 | 3,106 | 4,999 | 766,669 | エネルギー |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 2,498 | 2,787 | 4,489 | 688,462 | エネルギー |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 690 | - | - | - | 保険 |
| SAGE GROUP PLC | 740 | 812 | 649 | 99,609 | ソフトウェア・サービス |
| SAINSBURY (J) PLC | 1,181 | 1,245 | 364 | 55,877 | 食品・生活必需品小売り |
| SCHRODERS PLC | 82 | 92 | 337 | 51,686 | 各種金融 |
| SEVERN TRENT PLC | 164 | 190 | 534 | 82,042 | 公益事業 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 588 | 664 | 848 | 130,151 | ヘルスケア機器・サービス |
| SMITHS GROUP PLC | 268 | 301 | 450 | 69,109 | 資本財 |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 49 | 55 | 923 | 141,602 | 資本財 |
| SSE PLC | 705 | 790 | 1,262 | 193,604 | 公益事業 |
| ST JAMES'S PLACE PLC | 361 | 406 | 631 | 96,882 | 各種金融 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 1,800 | 1,994 | 900 | 138,123 | 銀行 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 2,462 | 2,774 | 433 | 66,498 | 耐久消費財・アパレル |
| TESCO PLC | 5,212 | 5,825 | 1,624 | 249,100 | 食品・生活必需品小売り |
| UNILEVER PLC | 1,772 | 1,979 | 7,617 | 1,168,175 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 465 | 517 | 546 | 83,799 | 公益事業 |
| VODAFONE GROUP PLC | 18,144 | 21,288 | 2,418 | 370,873 | 電気通信サービス |
| WHITBREAD PLC | 135 | 152 | 458 | 70,327 | 消費者サービス |
| WPP PLC | 834 | 912 | 1,005 | 154,193 | メディア・娯楽 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 197,995 86 | 220,211 83 | 135,957 - | 20,850,490 <4.1%> |
| (イスラエル) | | | 千イスラエル・シケル | | |
| AZRIELI GROUP | 29 | 32 | 996 | 36,728 | 不動産 |
| BANK HAPOALIM BM | 764 | 851 | 2,562 | 94,473 | 銀行 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | 967 | 1,084 | 3,336 | 123,015 | 銀行 |
| ELBIT SYSTEMS LTD | 18 | 20 | 958 | 35,351 | 資本財 |
| ICL GROUP LTD | 468 | 528 | 1,558 | 57,468 | 素材 |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 778 | 872 | 1,666 | 61,447 | 銀行 |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 96 | 106 | 1,226 | 45,209 | 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 | |
| (イスラエル) | 百株 | 百株 | 千イスラエル・シケル | 千円 | |
| NICE LTD | 42 | 47 | 4,319 | 159,265 | ソフトウェア・サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,166 8 | 3,545 8 | 16,622 - | 612,958 <0.1%> |
| (スイス) | | | 千スイス・フラン | | |
| ABB LTD | 1,242 | 1,308 | 4,349 | 534,225 | 資本財 |
| ADECCO GROUP AG-REG | 104 | 117 | 543 | 66,789 | 商業・専門サービス |
| ALCON INC | 331 | 377 | 2,909 | 357,398 | ヘルスケア機器・サービス |
| BALOISE HOLDING AG | 31 | 35 | 501 | 61,622 | 保険 |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 22 | 25 | 185 | 22,794 | 銀行 |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | 2 | 2 | 621 | 76,271 | 食品・飲料・タバコ |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 0.69 | 0.79 | 910 | 111,776 | 食品・飲料・タバコ |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 0.07 | 0.08 | 921 | 113,190 | 食品・飲料・タバコ |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG | 351 | 394 | 5,433 | 667,380 | 耐久消費財・アパレル |
| CLARIANT AG | 137 | 166 | 329 | 40,408 | 素材 |
| CREDIT SUISSE GROUP AG | 1,644 | 1,927 | 1,764 | 216,662 | 各種金融 |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 5 | 5 | 492 | 60,514 | 素材 |
| GEBERIT AG-REG | 25 | 28 | 2,073 | 254,711 | 資本財 |
| GIVAUDAN-REG | 6 | 6 | 3,231 | 396,952 | 素材 |
| HOLCIM LTD | 351 | 394 | 1,839 | 225,896 | 素材 |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 150 | 169 | 1,062 | 130,474 | 各種金融 |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 36 | 41 | 1,204 | 147,904 | 運輸 |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 109 | 130 | 991 | 121,732 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| LONZA GROUP AG | 50 | 56 | 4,262 | 523,580 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NESTLE SA | 1,941 | 2,174 | 26,693 | 3,278,471 | 食品・飲料・タバコ |
| NOVARTIS AG | 1,496 | 1,676 | 12,746 | 1,565,488 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 12 | 17 | 2,814 | 345,726 | 各種金融 |
| ROCHE HOLDING AG | 472 | 529 | 19,601 | 2,407,402 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ROCHE HOLDING AG-BR | 22 | 24 | 967 | 118,849 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 14 | 16 | 409 | 50,317 | 資本財 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 26 | 29 | 766 | 94,155 | 資本財 |
| SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE | 4 | 4 | 1,347 | 165,536 | 商業・専門サービス |
| SIKA AG-BEARER | 95 | 107 | 3,954 | 485,637 | 素材 |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 36 | 41 | 1,500 | 184,268 | ヘルスケア機器・サービス |
| STRAUMANN HOLDING AG | 6 | 7 | 1,549 | 190,258 | ヘルスケア機器・サービス |
| SWATCH GROUP AG | 18 | 20 | 607 | 74,662 | 耐久消費財・アパレル |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 20 | 24 | 1,222 | 150,197 | 保険 |
| SWISS PRIME SITE-REG | 53 | 59 | 556 | 68,350 | 不動産 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|---------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|----------------------|------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| (スイス) | | 百株 | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | |
| SWISS RE AG | | 193 | 227 | 1,994 | 245,004 | 保険 |
| SWISSCOM AG | | 17 | 20 | 1,040 | 127,821 | 電気通信サービス |
| TEMENOS GROUP AG-REG | | 45 | 50 | 676 | 83,028 | ソフトウェア・サービス |
| THE SWATCH GROUP AG-REG | | 37 | 43 | 246 | 30,254 | 耐久消費財・アパレル |
| UBS GROUP AG | | 2,468 | 2,765 | 4,490 | 551,527 | 各種金融 |
| VIFOR PHARMA AG | | 31 | 36 | 439 | 53,938 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | | 101 | 113 | 4,455 | 547,244 | 保険 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 11,723 40 | 13,178 40 | 121,710 - | 14,948,430 <2.9%> | |
| (デンマーク) | | | | 千デンマーク・クローネ | | |
| A P MOLLER - MAERSK A/S | | 4 | 4 | 8,864 | 153,347 | 運輸 |
| A P MOLLER - MAERSK A/S | | 2 | 2 | 4,401 | 76,144 | 運輸 |
| AMBU A/S-B | | 110 | 126 | 2,399 | 41,517 | ヘルスケア機器・サービス |
| CARLSBERG AS-B | | 69 | 75 | 8,165 | 141,269 | 食品・飲料・タバコ |
| CHR HANSEN HOLDING A/S | | 71 | 80 | 4,305 | 74,478 | 素材 |
| COLOPLAST-B | | 79 | 89 | 10,511 | 181,857 | ヘルスケア機器・サービス |
| DANSKE BANK A/S | | 464 | 519 | 5,831 | 100,876 | 銀行 |
| DEMANT A/S | | 72 | 80 | 2,759 | 47,733 | ヘルスケア機器・サービス |
| DSV A/S | | 140 | 153 | 23,975 | 414,778 | 運輸 |
| GENMAB A/S | | 44 | 49 | 13,533 | 234,126 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GN STORE NORD A/S | | 86 | 93 | 3,818 | 66,062 | ヘルスケア機器・サービス |
| H LUNDBECK A/S | | 48 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NOVO-NORDISK A/S | | 1,159 | 1,270 | 95,448 | 1,651,266 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NOVOZYMES A/S | | 140 | 154 | 7,919 | 137,001 | 素材 |
| ORSTED A/S | | 127 | 142 | 12,111 | 209,533 | 公益事業 |
| PANDORA A/S | | 67 | 75 | 6,841 | 118,359 | 耐久消費財・アパレル |
| ROCKWOOL INTL A/S-B SHS | | 5 | 6 | 1,952 | 33,785 | 資本財 |
| TRYGVESTA AS | | 104 | 274 | 4,440 | 76,827 | 保険 |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | | 662 | 762 | 17,134 | 296,426 | 資本財 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,460 19 | 3,961 18 | 234,415 - | 4,055,391 <0.8%> | |
| (ノルウェー) | | | | 千ノルウェー・クローネ | | |
| ADEVINTA ASA-B | | 163 | 208 | 3,128 | 39,945 | メディア・娯楽 |
| DNB ASA | | 629 | - | - | - | 銀行 |
| DNB BANK ASA | | - | 706 | 14,731 | 188,116 | 銀行 |
| EQUINOR ASA | | 653 | 738 | 16,287 | 207,997 | エネルギー |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | | 138 | 154 | 3,341 | 42,672 | 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 | | |
| (ノルウェー) | 百株 | 百株 | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | | |
| MOWI ASA | 297 | 332 | 7,805 | 99,670 | 食品・飲料・タバコ | |
| NORSK HYDRO ASA | 903 | 1,006 | 6,288 | 80,299 | 素材 | |
| ORKLA ASA | 507 | 572 | 4,929 | 62,950 | 食品・飲料・タバコ | |
| SCHIBSTED ASA | 50 | 53 | 2,473 | 31,591 | メディア・娯楽 | |
| SCHIBSTED ASA-B SHS | 68 | 74 | 3,029 | 38,687 | メディア・娯楽 | |
| TELENOR ASA | 494 | 554 | 7,727 | 98,678 | 電気通信サービス | |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 116 | 130 | 5,842 | 74,603 | 素材 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 4,022 11 | 4,533 11 | 75,584 - | 965,212 <0.2%> | |
| (スウェーデン) | | | 千スウェーデン・クローナ | | | |
| ALFA LAVAL AB | 214 | 237 | 8,938 | 113,791 | 資本財 | |
| ASSA ABLOY AB | 680 | 761 | 20,626 | 262,576 | 資本財 | |
| ATLAS COPCO AB | 263 | 296 | 14,659 | 186,620 | 資本財 | |
| ATLAS COPCO AB-A SHS | 452 | 505 | 29,234 | 372,157 | 資本財 | |
| BOLIDEN AB | 182 | 202 | 6,338 | 80,692 | 素材 | |
| BOLIDEN AB-RED | 179 | - | - | - | 素材 | |
| ELECTROLUX AB | 153 | 171 | 3,666 | 46,671 | 耐久消費財・アパレル | |
| EMBRACER GROUP AB | - | 353 | 3,091 | 39,352 | メディア・娯楽 | |
| EPIROC AB-A | 435 | 490 | 10,879 | 138,496 | 資本財 | |
| EPIROC AB-A RED SHS | 435 | - | - | - | 資本財 | |
| EPIROC AB-B | 273 | 303 | 5,627 | 71,641 | 資本財 | |
| EPIROC AB-B RED SHS | 273 | - | - | - | 資本財 | |
| EQT AB | 159 | 179 | 9,724 | 123,792 | 各種金融 | |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B | 413 | 462 | 13,953 | 177,625 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| EVOLUTION AB | 107 | 127 | 18,428 | 234,592 | 消費者サービス | |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 69 | 80 | 5,746 | 73,155 | 不動産 | |
| HENNES & MAURITZ AB | 541 | 553 | 8,927 | 113,640 | 小売 | |
| HEXAGON AB-B SHS | 1,328 | 1,483 | 20,819 | 265,029 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 281 | 314 | 4,285 | 54,557 | 資本財 | |
| ICA GRUPPEN AB | 67 | 74 | 3,964 | 50,473 | 食品・生活必需品小売り | |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | 61 | 97 | 2,840 | 36,164 | 各種金融 | |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 113 | 118 | 3,382 | 43,059 | 各種金融 | |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 99 | 110 | 3,945 | 50,223 | 資本財 | |
| INVESTOR AB | 1,212 | 1,364 | 29,412 | 374,426 | 各種金融 | |
| KINNEVIK AB - B | 158 | 180 | 6,570 | 83,636 | 各種金融 | |
| KINNEVIK AB-B-RED | 158 | - | - | - | 各種金融 | |
| LUNDBERGS AB-B SHS | 49 | 56 | 3,000 | 38,190 | 各種金融 | |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|----------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| | | | | 外貨建金額 | |
| (スウェーデン) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ/千円 | |
| LUNDIN ENERGY AB | | 124 | 151 | 4,767 | 60,690 エネルギー |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | | 211 | 1,077 | 13,899 | 176,935 資本財 |
| NORDEA BANK ABP | | 2,185 | 2,440 | 26,596 | 338,575 銀行 |
| SANDVIK AB | | 760 | 852 | 19,802 | 252,086 資本財 |
| SECURITAS AB | | 215 | 237 | 3,247 | 41,341 商業・専門サービス |
| SINCH AB | | - | 380 | 4,823 | 61,397 ソフトウェア・サービス |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | | 1,101 | 1,231 | 16,729 | 212,963 銀行 |
| SKANSKA AB-B SHS | | 232 | 259 | 5,674 | 72,241 資本財 |
| SKF AB | | 257 | 288 | 6,125 | 77,973 資本財 |
| SVENSKA CELLULOSA AB | | 402 | 456 | 6,646 | 84,610 素材 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN | | 1,056 | 1,105 | 11,013 | 140,197 銀行 |
| SWEDBANK AB - A SHARES | | 608 | 681 | 13,053 | 166,172 銀行 |
| SWEDISH MATCH AB | | 1,074 | 1,192 | 7,794 | 99,219 食品・飲料・タバコ |
| TELE2 AB | | 358 | 393 | 4,889 | 62,248 電気通信サービス |
| TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON | | 1,966 | 2,203 | 21,636 | 275,433 テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TELIA CO AB | | 1,710 | 2,076 | 7,273 | 92,588 電気通信サービス |
| VOLVO AB | | 960 | 1,073 | 22,497 | 286,398 資本財 |
| VOLVO AB-A SHS | | - | 157 | 3,348 | 42,625 資本財 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 21,597 42 | 24,782 41 | 437,884 - | 5,574,267 <1.1%> |
| (ユーロ/アイルランド) | | | | 千ユーロ | |
| CRH PLC | | 527 | 590 | 2,575 | 331,395 素材 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC. | | 109 | 125 | 1,711 | 220,234 消費者サービス |
| KERRY GROUP PLC-A | | 106 | 119 | 1,386 | 178,439 食品・飲料・タバコ |
| KINGSPAN GROUP PLC | | 104 | 116 | 1,170 | 150,618 資本財 |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | | 164 | 184 | 855 | 110,093 素材 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,011 5 | 1,136 5 | 7,700 - | 990,780 <0.2%> |
| (ユーロ/オランダ) | | | | | |
| ABN AMRO BANK NV | | 288 | 318 | 406 | 52,303 銀行 |
| ADYEN NV | | 12 | 14 | 3,901 | 501,967 ソフトウェア・サービス |
| AEGON NV | | 1,187 | 1,337 | 564 | 72,597 保険 |
| AIRBUS SE | | 396 | 445 | 4,869 | 626,559 資本財 |
| AKZO NOBEL NV | | 130 | 143 | 1,489 | 191,609 素材 |
| ASM INTERNATIONAL NV | | 31 | 35 | 1,531 | 197,109 半導体・半導体製造装置 |
| ASML HOLDING NV | | 286 | 316 | 24,057 | 3,095,500 半導体・半導体製造装置 |

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 | | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 690 | 772 | 1,255 | 161,584 | 資本財 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 387 | 392 | 522 | 67,286 | 食品・飲料・タバコ | |
| EXOR NV | 72 | 81 | 687 | 88,405 | 各種金融 | |
| FERRARI NV | 85 | 95 | 2,284 | 293,926 | 自動車・自動車部品 | |
| GALAPAGOS NV | 29 | - | - | - | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 78 | 87 | 686 | 88,287 | 食品・飲料・タバコ | |
| HEINEKEN NV | 175 | 196 | 1,820 | 234,186 | 食品・飲料・タバコ | |
| ING GROEP NV-CVA | 2,627 | 2,942 | 3,775 | 485,831 | 銀行 | |
| INPOST SA | - | 157 | 181 | 23,386 | 運輸 | |
| JDE PEET'S BV | 52 | 58 | 150 | 19,366 | 食品・飲料・タバコ | |
| JUST EAT TAKEAWAY | 85 | 135 | 868 | 111,707 | 小売 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 740 | 783 | 2,355 | 303,128 | 食品・生活必需品小売り | |
| KONINKLIJKE DSM NV | 116 | 131 | 2,615 | 336,486 | 素材 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 612 | 687 | 2,525 | 324,897 | ヘルスケア機器・サービス | |
| NN GROUP NV | 200 | 202 | 943 | 121,459 | 保険 | |
| PROSUS | 328 | 705 | 5,455 | 701,942 | 小売 | |
| QIAGEN NV | 155 | 172 | 854 | 109,982 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| RANDSTAD NV | 79 | 90 | 554 | 71,365 | 商業・専門サービス | |
| ROYAL KPN NV | 2,449 | 2,592 | 666 | 85,769 | 電気通信サービス | |
| STMICROELECTRONICS NV | 429 | 514 | 2,357 | 303,371 | 半導体・半導体製造装置 | |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP BV | - | 536 | 1,343 | 172,817 | メディア・娯楽 | |
| VOPAK | 46 | 52 | 177 | 22,797 | エネルギー | |
| WOLTERS KLUWER NV | 180 | 201 | 2,025 | 260,643 | 商業・専門サービス | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 11,958 28 | 14,203 29 | 70,927 - | 9,126,278 <1.8%> | |
| (ユーロ/ベルギー) | | | | | | |
| AGEAS | 116 | 131 | 620 | 79,831 | 保険 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 514 | 575 | 2,985 | 384,107 | 食品・飲料・タバコ | |
| ARGENX SE | 30 | 34 | 881 | 113,362 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| COLRUYT NV | 34 | 39 | 167 | 21,519 | 食品・生活必需品小売り | |
| ELIA GROUP SA/NV | 21 | 24 | 248 | 32,005 | 公益事業 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 76 | 85 | 860 | 110,720 | 各種金融 | |
| KBC GROEP NV | 167 | 187 | 1,406 | 180,951 | 銀行 | |
| PROXIMUS | 107 | 121 | 198 | 25,552 | 電気通信サービス | |
| SOFINA | 10 | 11 | 458 | 59,026 | 各種金融 | |
| SOLVAY SA | 50 | 55 | 583 | 75,041 | 素材 | |
| UCB SA | 85 | 95 | 977 | 125,719 | 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 | |
| UMICORE | | 132 | 148 | 660 | 84,972 | 素材 |
| 小計 | 株数・金額 | 1,346 | 1,510 | 10,047 | 1,292,811 | |
| | 銘柄数<比率> | 12 | 12 | - | <0.3%> | |
| (ユーロ/ルクセンブルグ) | | | | | | |
| ARCELORMITTAL | | 481 | 535 | 1,415 | 182,130 | 素材 |
| TENARIS SA | | 310 | 344 | 326 | 42,037 | エネルギー |
| 小計 | 株数・金額 | 791 | 879 | 1,742 | 224,167 | |
| | 銘柄数<比率> | 2 | 2 | - | <0.0%> | |
| (ユーロ/フランス) | | | | | | |
| ACCOR | | 124 | 128 | 376 | 48,505 | 消費者サービス |
| ADP | | 22 | 26 | 283 | 36,476 | 運輸 |
| AIR LIQUIDE | | 319 | 357 | 5,486 | 705,954 | 素材 |
| ALSTOM RGPT | | 179 | 239 | 794 | 102,206 | 資本財 |
| AMUNDI SA | | 41 | 46 | 350 | 45,140 | 各種金融 |
| ARKEMA | | 46 | 45 | 557 | 71,760 | 素材 |
| ATOS SE | | 66 | 74 | 289 | 37,246 | ソフトウェア・サービス |
| AXA SA | | 1,300 | 1,456 | 3,665 | 471,650 | 保険 |
| BIOMERIEUX | | 27 | 31 | 380 | 48,965 | ヘルスケア機器・サービス |
| BNP PARIBAS | | 756 | 846 | 4,885 | 628,666 | 銀行 |
| BOLLORE | | 617 | 669 | 330 | 42,559 | メディア・娯楽 |
| BOUYGUES | | 155 | 173 | 536 | 68,988 | 資本財 |
| BUREAU VERITAS SA | | 202 | 223 | 664 | 85,452 | 商業・専門サービス |
| CAPGEMINI SA | | 108 | 120 | 2,606 | 335,425 | ソフトウェア・サービス |
| CARREFOUR SA | | 410 | 458 | 727 | 93,555 | 食品・生活必需品小売り |
| CIE DE SAINT-GOBAIN | | 343 | 382 | 2,329 | 299,786 | 資本財 |
| CNP ASSURANCES | | 113 | 129 | 279 | 35,922 | 保険 |
| CREDIT AGRICOLE SA | | 775 | 880 | 1,098 | 141,371 | 銀行 |
| DANONE | | 417 | 493 | 2,770 | 356,459 | 食品・飲料・タバコ |
| DASSAULT AVIATION SA | | 1 | 18 | 166 | 21,415 | 資本財 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | | 89 | 499 | 2,810 | 361,676 | ソフトウェア・サービス |
| EDENRED | | 168 | 187 | 819 | 105,426 | ソフトウェア・サービス |
| EDF | | 420 | 351 | 443 | 57,028 | 公益事業 |
| EIFFAGE | | 57 | 65 | 559 | 71,979 | 資本財 |
| ENGIE | | 1,233 | 1,381 | 1,811 | 233,048 | 公益事業 |
| ESSILORLUXOTTICA | | 192 | 215 | 4,168 | 536,404 | 耐久消費財・アパレル |
| EURAZEO | | 27 | 29 | 231 | 29,769 | 各種金融 |
| EUROFINS SCIENTIFIC | | 90 | 100 | 1,109 | 142,756 | 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/フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| FAURECIA | 79 | 88 | 409 | 52,630 | 自動車・自動車部品 |
| GETLINK SE - REGR | 322 | 362 | 477 | 61,437 | 運輸 |
| HERMES INTERNATIONAL | 21 | 23 | 4,002 | 515,036 | 耐久消費財・アパレル |
| ILIAD SA | 10 | - | - | - | 電気通信サービス |
| IPSEN | 25 | 28 | 252 | 32,537 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KERING | 51 | 56 | 4,057 | 522,098 | 耐久消費財・アパレル |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 56 | 70 | 304 | 39,170 | 消費者サービス |
| LEGRAND SA | 180 | 201 | 1,973 | 253,975 | 資本財 |
| L'OREAL SA | 169 | 190 | 8,088 | 1,040,780 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 187 | 209 | 15,368 | 1,977,438 | 耐久消費財・アパレル |
| MICHELIN (C.G.D.E.) | 113 | 127 | 1,752 | 225,534 | 自動車・自動車部品 |
| NATIXIS | 636 | - | - | - | 各種金融 |
| ORANGE S.A. | 1,360 | 1,536 | 1,483 | 190,921 | 電気通信サービス |
| ORPEA | 35 | 39 | 340 | 43,751 | ヘルスケア機器・サービス |
| PERNOD-RICARD | 141 | 158 | 3,353 | 431,481 | 食品・飲料・タバコ |
| PUBLICIS GROUPE | 150 | 167 | 1,005 | 129,372 | メディア・娯楽 |
| REMY COINTREAU | 15 | 16 | 327 | 42,098 | 食品・飲料・タバコ |
| RENAULT SA | 130 | 144 | 476 | 61,289 | 自動車・自動車部品 |
| SAFRAN SA | 215 | 258 | 2,915 | 375,122 | 資本財 |
| SANOFI | 763 | 856 | 7,612 | 979,558 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 18 | 20 | 1,045 | 134,514 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 362 | 406 | 6,555 | 843,507 | 資本財 |
| SCOR REGROUPE | 106 | 119 | 323 | 41,678 | 保険 |
| SEB SA | 16 | 20 | 288 | 37,093 | 耐久消費財・アパレル |
| SOCIETE GENERALE | 546 | 607 | 1,751 | 225,426 | 銀行 |
| SODEXO | 59 | 66 | 523 | 67,366 | 消費者サービス |
| SUEZ | 233 | 266 | 524 | 67,433 | 公益事業 |
| TELEPERFORMANCE | 39 | 44 | 1,617 | 208,146 | 商業・専門サービス |
| THALES SA | 71 | 79 | 625 | 80,506 | 資本財 |
| TOTALENERGIES SE | 1,697 | 1,884 | 7,896 | 1,016,074 | エネルギー |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 62 | 69 | 318 | 41,029 | メディア・娯楽 |
| VALEO SA | 155 | 173 | 492 | 63,400 | 自動車・自動車部品 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 364 | 415 | 1,206 | 155,252 | 公益事業 |
| VINCI SA | 353 | 403 | 3,577 | 460,278 | 資本財 |
| VIVENDI SA | 559 | 536 | 592 | 76,293 | メディア・娯楽 |
| WENDEL | 19 | 20 | 228 | 29,449 | 各種金融 |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|----------------------|------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ/フランス) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| WORLDLINE SA | | 160 | 179 | 900 | 115,884 | ソフトウェア・サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 17,801 65 | 19,484 63 | 123,207 - | 15,853,171 <3.1%> | |
| (ユーロ/ドイツ) | | | | | | |
| ADIDAS AG | | 128 | 143 | 4,061 | 522,534 | 耐久消費財・アパレル |
| ALLIANZ SE | | 277 | 310 | 6,302 | 810,914 | 保険 |
| AROUNDTOWN SA | | 689 | 772 | 462 | 59,483 | 不動産 |
| BASF SE | | 618 | 693 | 4,271 | 549,603 | 素材 |
| BAYER AG | | 663 | 742 | 3,574 | 459,912 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | | 223 | 250 | 2,331 | 300,016 | 自動車・自動車部品 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | | 38 | 42 | 329 | 42,435 | 自動車・自動車部品 |
| BECHTLE AG | | 18 | 61 | 397 | 51,186 | ソフトウェア・サービス |
| BEIERSDORF AG | | 67 | 75 | 709 | 91,267 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| BRENNTAG SE | | 103 | 115 | 924 | 119,009 | 資本財 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | | 26 | 30 | 565 | 72,699 | ヘルスケア機器・サービス |
| COMMERZBANK AG | | 668 | 752 | 503 | 64,800 | 銀行 |
| CONTINENTAL AG | | 74 | 83 | 878 | 113,032 | 自動車・自動車部品 |
| COVESTRO AG | | 122 | 145 | 817 | 105,126 | 素材 |
| DAIMLER AG | | 575 | 644 | 5,790 | 745,013 | 自動車・自動車部品 |
| DELIVERY HERO SE | | 87 | 122 | 1,572 | 202,293 | 小売 |
| DEUTSCHE BANK AG | | 1,324 | 1,556 | 1,684 | 216,752 | 各種金融 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | | 127 | 143 | 2,118 | 272,547 | 各種金融 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG | | 201 | 228 | 138 | 17,784 | 運輸 |
| DEUTSCHE POST AG | | 672 | 753 | 4,302 | 553,665 | 運輸 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG | | 2,255 | 2,529 | 4,169 | 536,447 | 電気通信サービス |
| DEUTSCHE WOHNEN SE | | 231 | - | - | - | 不動産 |
| E.ON SE | | 1,532 | 1,702 | 1,877 | 241,581 | 公益事業 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | | 139 | 157 | 435 | 56,001 | 素材 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | | 281 | 314 | 1,123 | 144,588 | ヘルスケア機器・サービス |
| FUCHS PETROLUB AG -PFD | | 45 | 51 | 219 | 28,300 | 素材 |
| GEA GROUP AG | | 103 | 114 | 519 | 66,782 | 資本財 |
| HANNOVER RUECK SE | | 40 | 45 | 725 | 93,346 | 保険 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | | 99 | 112 | 717 | 92,370 | 素材 |
| HELLOFRESH SE | | 99 | 124 | 1,170 | 150,608 | 食品・生活必需品小売り |
| HENKEL AG & CO KGAA | | 70 | 79 | 560 | 72,107 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HENKEL KGAA-VORZUG | | 118 | 133 | 1,006 | 129,473 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HOCHTIEF AG | | 18 | - | - | - | 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 | | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 880 | 986 | 4,258 | 547,933 | 半導体・半導体製造装置 | |
| KION GROUP AG | 48 | 54 | 549 | 70,750 | 資本財 | |
| KNORR-BREMSE AG | 49 | 55 | 510 | 65,708 | 資本財 | |
| LANXESS | 54 | 62 | 344 | 44,299 | 素材 | |
| LEG IMMOBILIEN SE | 49 | 54 | 711 | 91,543 | 不動産 | |
| MERCK KGAA | 86 | 97 | 2,151 | 276,796 | 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 | 35 | 40 | 728 | 93,731 | 資本財 | |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG | 94 | 105 | 2,609 | 335,820 | 保険 | |
| NEMETSCHKE SE | 39 | 43 | 489 | 62,994 | ソフトウェア・サービス | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF | 101 | 114 | 942 | 121,261 | 自動車・自動車部品 | |
| PUMA AG | 66 | 79 | 917 | 118,052 | 耐久消費財・アパレル | |
| RATIONAL AG | 3 | 3 | 333 | 42,847 | 資本財 | |
| RWE AG | 431 | 483 | 1,585 | 203,942 | 公益事業 | |
| SAP SE | 703 | 787 | 9,917 | 1,276,062 | ソフトウェア・サービス | |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 23 | 19 | 1,136 | 146,217 | ヘルスケア機器・サービス | |
| SCOUT24 SE | 72 | 65 | 424 | 54,560 | メディア・娯楽 | |
| SIEMENS AG | 515 | 577 | 8,959 | 1,152,824 | 資本財 | |
| SIEMENS ENERGY AG | 269 | 301 | 732 | 94,244 | 資本財 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 180 | 212 | 1,408 | 181,276 | ヘルスケア機器・サービス | |
| SYMRISE AG | 86 | 97 | 1,268 | 163,160 | 素材 | |
| TEAMVIEWER AG | 108 | 121 | 158 | 20,432 | ソフトウェア・サービス | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 761 | 832 | 199 | 25,680 | 電気通信サービス | |
| UNIPER SE | 135 | 69 | 262 | 33,762 | 公益事業 | |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 71 | 74 | 256 | 32,987 | 電気通信サービス | |
| VOLKSWAGEN AG | 22 | 24 | 687 | 88,411 | 自動車・自動車部品 | |
| VOLKSWAGEN AG | 125 | 140 | 2,533 | 325,935 | 自動車・自動車部品 | |
| VONOVIA SE | 365 | 414 | 2,308 | 297,003 | 不動産 | |
| ZALANDO SE | 102 | 167 | 1,431 | 184,146 | 小売 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 17,230 61 | 19,121 59 | 102,075 - | 13,134,079 <2.6%> | |
| (ユーロ/ポルトガル) | | | | | | |
| EDP RENOVAVEIS SA | - | 216 | 484 | 62,316 | 公益事業 | |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 1,860 | 2,102 | 1,004 | 129,270 | 公益事業 | |
| GALP ENERGIA SGPS SA | 337 | 381 | 323 | 41,592 | エネルギー | |
| JERONIMO MARTINS | 164 | 186 | 359 | 46,273 | 食品・生活必需品小売り | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,362 3 | 2,886 4 | 2,171 - | 279,453 <0.1%> | |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 | |
|------------------------------------|------------------|--------------|--------------|-------------|------------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ/スペイン) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 161 | 189 | 411 | 52,928 | 資本財 | |
| AENA SME SA | 47 | 59 | 819 | 105,405 | 運輸 | |
| AMADEUS IT GROUP SA | 303 | 340 | 2,048 | 263,524 | ソフトウェア・サービス | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | 4,471 | 5,006 | 2,705 | 348,052 | 銀行 | |
| BANCO SANTANDER SA | 11,670 | 13,043 | 3,988 | 513,228 | 銀行 | |
| CAIXABANK | 2,389 | 3,298 | 783 | 100,748 | 銀行 | |
| CELLNEX TELECOM SAU | 215 | 386 | 2,027 | 260,940 | 電気通信サービス | |
| ENAGAS SA | 166 | 185 | 366 | 47,149 | 公益事業 | |
| ENDESA SA | 214 | 240 | 461 | 59,409 | 公益事業 | |
| FERROVIAL S.A. | 337 | 366 | 951 | 122,388 | 資本財 | |
| FERROVIAL SA-RTS | 337 | - | - | - | 資本財 | |
| FERROVIAL SA-RTS | - | 358 | 10 | 1,411 | 資本財 | |
| GRIFOLS SA | 201 | 225 | 396 | 51,079 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| IBERDROLA SA | 4,108 | 4,461 | 4,501 | 579,221 | 公益事業 | |
| INDITEX SA | 733 | 821 | 2,504 | 322,232 | 小売 | |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 197 | 220 | 505 | 65,072 | 公益事業 | |
| RED ELECTRICA DE ESPANA | 290 | 326 | 590 | 75,962 | 公益事業 | |
| REPSOL SA | 1,010 | 1,089 | 1,130 | 145,468 | エネルギー | |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | 159 | 180 | 394 | 50,756 | 資本財 | |
| TELEFONICA SA | 3,440 | 3,908 | 1,550 | 199,515 | 電気通信サービス | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 30,456 19 | 34,709 19 | 26,148 - | 3,364,494 <0.7%> | |
| (ユーロ/イタリア) | | | | | | |
| AMPLIFON SPA | 83 | 93 | 415 | 53,493 | ヘルスケア機器・サービス | |
| ASSICURAZIONI GENERALI SPA | 738 | 832 | 1,522 | 195,897 | 保険 | |
| ATLANTIA SPA | 340 | 383 | 639 | 82,290 | 運輸 | |
| DIASORIN SPA | 16 | 18 | 355 | 45,694 | ヘルスケア機器・サービス | |
| ENEL SPA | 5,473 | 6,137 | 4,265 | 548,860 | 公益事業 | |
| ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA | 1,693 | 1,896 | 2,307 | 296,939 | エネルギー | |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 1,393 | 1,529 | 2,679 | 344,767 | 自動車・自動車部品 | |
| FINCOBANK SPA | 408 | 457 | 778 | 100,146 | 銀行 | |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 233 | 267 | 269 | 34,717 | 電気通信サービス | |
| INTESA SANPAOLO | 11,076 | 12,433 | 2,964 | 381,407 | 銀行 | |
| MEDIOBANCA SPA | 417 | 465 | 491 | 63,284 | 銀行 | |
| MONCLER SPA | 130 | 154 | 1,049 | 135,036 | 耐久消費財・アパレル | |
| NEXI SPA | 295 | 331 | 478 | 61,510 | ソフトウェア・サービス | |
| POSTE ITALIANE SPA | 371 | 410 | 495 | 63,757 | 保険 | |
| PRYSMIAN SPA | 161 | 191 | 668 | 86,046 | 資本財 | |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA | 70 | 78 | 443 | 57,044 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

| 銘柄 | | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|---------------------|---------------------------------------|------------------|------------------|--------------|------------------------|------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ/イタリア) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| | SNAM SPA | 1,349 | 1,509 | 757 | 97,423 | 公益事業 |
| | TELECOM ITALIA SPA | 9,842 | 11,964 | 413 | 53,264 | 電気通信サービス |
| | TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA | 948 | 1,062 | 713 | 91,789 | 公益事業 |
| | UNICREDIT SPA | 1,433 | 1,599 | 1,754 | 225,729 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 36,479 20 | 41,819 20 | 23,463 - | 3,019,101 <0.6%> | |
| (ユーロ/フィンランド) | | | | | | |
| | ELISA OYJ | 98 | 109 | 587 | 75,615 | 電気通信サービス |
| | FORTUM OYJ | 297 | 336 | 839 | 108,020 | 公益事業 |
| | KESKO OYJ-B SHS | 183 | 203 | 580 | 74,657 | 食品・生活必需品小売り |
| | KONE OYJ | 229 | 256 | 1,604 | 206,457 | 資本財 |
| | NESTE OYJ | 283 | 317 | 1,433 | 184,414 | エネルギー |
| | NOKIA OYJ | 3,803 | 4,059 | 2,117 | 272,522 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| | ORION OYJ-CLASS B | 71 | 79 | 291 | 37,519 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| | SAMPO OYJ | 317 | 376 | 1,646 | 211,907 | 保険 |
| | STORA ENSO OYJ | 388 | 435 | 651 | 83,866 | 素材 |
| | UPM-KYMMENE OYJ | 358 | 400 | 1,294 | 166,561 | 素材 |
| | WARTSILA OYJ | 302 | 355 | 452 | 58,269 | 資本財 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 6,333 11 | 6,931 11 | 11,500 - | 1,479,811 <0.3%> | |
| (ユーロ/オーストリア) | | | | | | |
| | ERSTE GROUP BANK AG | 189 | 211 | 809 | 104,176 | 銀行 |
| | OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A | 45 | 51 | 438 | 56,456 | 公益事業 |
| | OMV AG | 97 | 109 | 536 | 69,053 | エネルギー |
| | RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING | 98 | 110 | 289 | 37,274 | 銀行 |
| | VOESTALPINE AG | 77 | 85 | 261 | 33,593 | 素材 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 507 5 | 567 5 | 2,335 - | 300,555 <0.1%> | |
| (ユーロ/その他) | | | | | | |
| | FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA | 143 | 154 | 861 | 110,880 | ヘルスケア機器・サービス |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 143 1 | 154 1 | 861 - | 110,880 <0.0%> | |
| ユーロ計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 126,422 232 | 143,406 230 | 382,183 - | 49,175,587 <9.6%> | |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 737,902 1,221 | 824,822 1,220 | - - | 487,369,676 <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。以下同じです。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | |
|---------------------------------|------------------|-----------|-----------|-------------|---------------------|
| | □数 | □数 | 評価額 | | 千円 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千米ドル | | |
| BOSTON PROPERTIES INC | 9 | 11 | 1,308 | | 149,266 |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 29 | 32 | 5,996 | | 684,226 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 9 | 10 | 2,182 | | 249,025 |
| PROLOGIS INC | 49 | 55 | 8,383 | | 956,571 |
| ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT | 95 | 105 | 885 | | 101,053 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 9 | 10 | 2,537 | | 289,553 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 6 | 7 | 1,208 | | 137,867 |
| DUKE REALTY CORP | 24 | 28 | 1,653 | | 188,621 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 25 | 26 | 2,298 | | 262,226 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 4 | 4 | 1,697 | | 193,644 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 36 | 40 | 1,385 | | 158,062 |
| WELLTOWER INC | 28 | 31 | 2,651 | | 302,543 |
| HOST HOTELS AND RESORTS INC | 47 | 53 | 910 | | 103,917 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 7 | 8 | 1,715 | | 195,706 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 15 | 17 | 519 | | 59,221 |
| PUBLIC STORAGE | 10 | 11 | 3,930 | | 448,464 |
| REGENCY CENTERS CORP | 11 | 11 | 843 | | 96,289 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 22 | 24 | 4,134 | | 471,725 |
| SUN COMMUNITIES INC | 7 | 8 | 1,647 | | 188,017 |
| UDR INC | 19 | 22 | 1,252 | | 142,933 |
| VENTAS INC | 25 | 28 | 1,450 | | 165,529 |
| VORNADO REALTY TRUST | 11 | 12 | 546 | | 62,375 |
| WP CAREY INC | 11 | 13 | 1,036 | | 118,279 |
| REALTY INCOME CORP | 23 | 40 | 2,843 | | 324,474 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 11 | 12 | 1,101 | | 125,628 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 8 | 10 | 2,031 | | 231,748 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 18 | 21 | 3,519 | | 401,620 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 38 | 44 | 971 | | 110,871 |
| IRON MOUNTAIN INC | 19 | 21 | 1,016 | | 116,032 |
| AGNC INVESTMENT CORP | 37 | 39 | 632 | | 72,217 |
| AMERICAN TOWER REIT INC | 29 | 34 | 8,958 | | 1,022,183 |
| EQUINIX INC | 6 | 6 | 5,332 | | 608,385 |
| VEREIT | 14 | — | — | | — |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 7 | 8 | 2,847 | | 324,865 |
| INVITATION HOMES INC | 37 | 42 | 1,744 | | 199,101 |
| VICI PROPERTIES INC | 36 | 40 | 1,157 | | 132,021 |
| ORION OFFICE REIT INC | — | 4 | 70 | | 8,071 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 807 36 | 905 36 | 82,404 — | 9,402,346 <1.8%> |

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 | | 5 | 6 | 374 | 33,781 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | | 10 | 11 | 270 | 24,409 |
| 小計 | □数・金額 | 16 | 18 | 645 | 58,191 |
| | 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 | |
| DEXUS | | 82 | — | — | — |
| GPT GROUP | | 142 | 158 | 817 | 67,433 |
| GOODMAN GROUP | | 115 | 129 | 3,181 | 262,425 |
| STOCKLAND | | 167 | 189 | 832 | 68,634 |
| MIRVAC GROUP | | 288 | 319 | 897 | 74,046 |
| VICINITY CENTRES | | 280 | 316 | 554 | 45,708 |
| SCENTRE GROUP | | 360 | 408 | 1,282 | 105,823 |
| DEXUS/AU | | — | 89 | 992 | 81,897 |
| 小計 | □数・金額 | 1,437 | 1,612 | 8,558 | 705,969 |
| | 銘柄数<比率> | 7 | 7 | — | <0.1%> |
| (香港) | | | | 千香港ドル | |
| LINK REIT | | 140 | 157 | 11,251 | 164,831 |
| 小計 | □数・金額 | 140 | 157 | 11,251 | 164,831 |
| | 銘柄数<比率> | 1 | 1 | — | <0.0%> |
| (シンガポール) | | | | 千シンガポール・ドル | |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | | 218 | 253 | 770 | 64,474 |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | | 305 | 378 | 828 | 69,403 |
| SUNTEC REIT | | 127 | — | — | — |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | 198 | 228 | 447 | 37,466 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | | 147 | 163 | 349 | 29,224 |
| 小計 | □数・金額 | 996 | 1,023 | 2,395 | 200,569 |
| | 銘柄数<比率> | 5 | 4 | — | <0.0%> |
| (イギリス) | | | | 千イギリス・ポンド | |
| BRITISH LAND CO PLC | | 59 | 66 | 350 | 53,806 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 47 | 53 | 396 | 60,750 |
| SEGRO PLC | | 80 | 90 | 1,263 | 193,735 |
| 小計 | □数・金額 | 187 | 209 | 2,010 | 308,292 |
| | 銘柄数<比率> | 3 | 3 | — | <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 | | |
|---------------------------|---------|-------|-------|--------|------------|
| | □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 | 13 | 15 | 307 | 39,600 | |
| GECINA SA | 3 | 3 | 409 | 52,667 | |
| COVIVIO | 3 | 3 | 281 | 36,282 | |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 9 | 9 | 584 | 75,203 | |
| 小計 | □数・金額 | 28 | 32 | 1,583 | 203,754 |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 4 | — | <0.0%> |
| 合計 | □数・金額 | 3,614 | 3,958 | — | 11,043,955 |
| | 銘柄数<比率> | 58 | 57 | — | <2.1%> |

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 当期末 | |
|-------------------------|--------|-----|
| | 買建額 | 売建額 |
| | 百万円 | 百万円 |
| 外国 S&P 500 EMINI FUTURE | 10,953 | — |
| FTSE 100 | 1,073 | — |
| DJ EURO STOXX 50 | 2,695 | — |

(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

2021年11月22日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 487,369,676 | 94.7 |
| 投資信託証券 | 11,043,955 | 2.1 |
| コール・ローン等、その他 | 16,003,837 | 3.1 |
| 投資信託財産総額 | 514,417,469 | 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22日における邦貨換算レートは、1米ドル114.10円、1カナダ・ドル90.18円、1オーストラリア・ドル82.49円、1香港ドル14.65円、1シンガポール・ドル83.73円、1ニュージーランド・ドル79.71円、1イギリス・ポンド153.36円、1イスラエル・シェケル36.874円、1スイス・フラン122.82円、1デンマーク・クローネ17.30円、1ノルウェー・クローネ12.77円、1スウェーデン・クローナ12.73円、1ユーロ128.67円です。

(注2) 外貨建純資産 (509,970,711千円) の投資信託財産総額 (514,417,469千円) に対する比率は99.1%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

(2021年11月22日現在)

| 項目 | 当期末 |
|--------------------------|-------------------------|
| (A)資産 | 518,581,302,474円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 6,260,185,719 |
| 株 式(評価額) | 487,369,676,341 |
| 投 資 信 託 証 券(評価額) | 11,043,955,063 |
| 未 収 入 金 | 4,744,281,487 |
| 未 収 配 当 金 | 452,315,583 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 8,710,888,281 |
| (B)負債 | 4,819,339,137 |
| 未 払 金 | 4,187,345,338 |
| 未 払 解 約 金 | 631,988,046 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 5,753 |
| (C)純 資 産 総 額(A-B) | 513,761,963,337 |
| 元 本 | 174,007,653,499 |
| 次 期 繰 越 損 益 | 339,754,309,838 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | 174,007,653,499口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 29,525円 |

| | |
|--|------------------|
| (注1) 期首元本額 | 155,354,575,597円 |
| 期中追加設定元本額 | 29,466,550,805円 |
| 期中一部解約元本額 | 10,813,472,903円 |
| (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペビーフンド別内訳は、次の通りです。 | |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) | 773,420,733円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) | 3,492,406,987円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) | 2,922,862,164円 |
| ニッセイ外国株式インデックスA(適格機関投資家限定) | 1,788,512,420円 |
| ニッセイアジア/パシフィック(債券重視型) SA(適格機関投資家限定) | 1,498,948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) | 9,984,994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) | 11,746,239円 |
| ニッセイ外国株式インデックスファンドII(適格機関投資家限定) | 10,878,039,552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 | 122,197,928,567円 |
| DCニッセイ外国株式インデックス | 27,196,292,331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) | 1,437,543,963円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2055 | 197,151,288円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) | 144,457,796円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2045 | 218,012,951円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2035 | 458,538,673円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2025 | 38,683,975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) | 64,661,782円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式) | 5,544,776円 |
| ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート) | 7,317,522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) | 2,727,779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) | 18,791,742円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2060 | 129,686,377円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2050 | 90,287,551円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2040 | 189,928,484円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2030 | 184,089,952円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定) | 237,940,760円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-06(適格機関投資家限定) | 245,015,301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 | 140,681,761円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適格機関投資家限定) | 239,598,388円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-01(適格機関投資家限定) | 234,179,609円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-05(適格機関投資家限定) | 215,312,521円 |
| ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2021-08(適格機関投資家限定) | 200,685,991円 |
| ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用) | 33,783,784円 |
| ニッセイ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用) | 337,838円 |

損益の状況

当期(2021年5月21日~2021年11月22日)

| 項目 | 当期 |
|---------------------------|-------------------------|
| (A)配 当 等 収 益 | 3,340,681,665円 |
| 受 取 配 当 金 | 3,338,948,141 |
| 受 取 利 息 | 46,944 |
| 受 取 そ の 他 収 益 | 3,599,200 |
| 支 払 利 息 | △ 1,912,620 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 65,100,582,264 |
| 売 買 損 益 | 80,379,882,673 |
| 売 買 損 益 | △ 15,279,300,409 |
| (C)先 物 取 引 等 損 益 | 2,158,133,009 |
| 取 引 損 益 | 2,281,643,579 |
| 取 引 損 益 | △ 123,510,570 |
| (D)信 託 報 酬 等 | △ 125,901,736 |
| (E)当期損益金(A+B+C+D) | 70,473,495,202 |
| (F)前期繰越損益金 | 237,295,715,915 |
| (G)追加信託差損益金 | 50,909,923,587 |
| (H)解約差損益金 | △ 18,924,824,866 |
| (I)合 計(E+F+G+H) | 339,754,309,838 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I) | 339,754,309,838 |

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

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 30 期

(計算期間：2021年5月21日～2021年11月22日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く主要国の国債

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

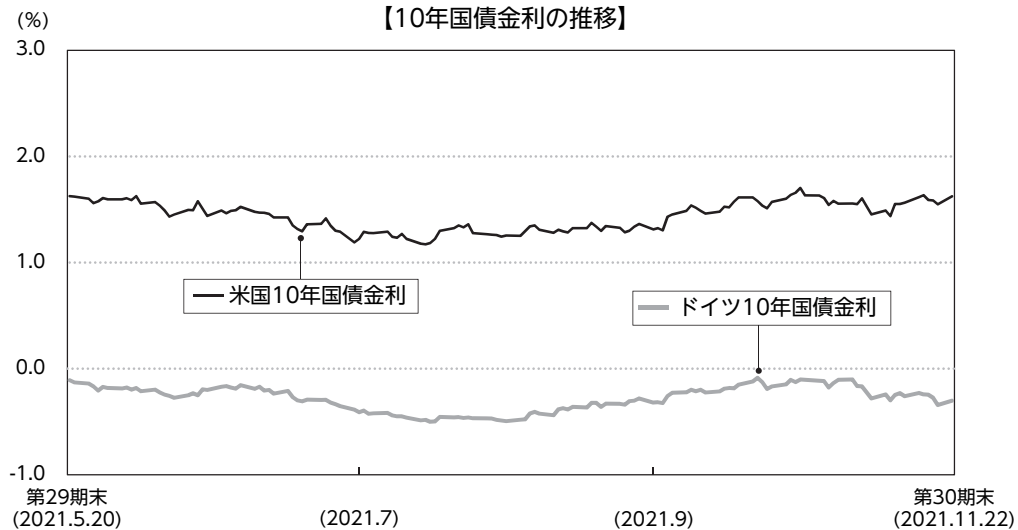
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2021年5月21日～2021年11月22日

投資環境

■ 海外債券市況

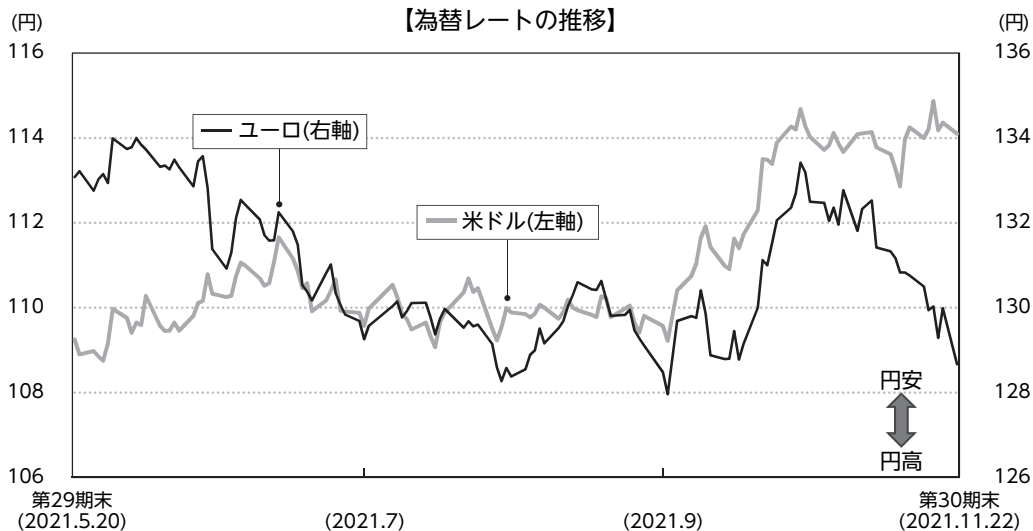


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、期初から7月にかけて米連邦準備制度理事会（F R B）が早期のテーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）に慎重な姿勢を示したことで低下基調となりました。9月から10月にかけては原油価格の高騰を背景にインフレ懸念が高まり金融政策正常化が意識され金利は上昇し、結局、期初と同水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初から6月にかけておおむね横ばいで推移した後、8月にかけては欧州中央銀行（E C B）が金融緩和を継続する姿勢を示したことで低下基調となりました。9月以降はE C Bが金融政策正常化に向かうとの見方から再度金利は上昇しましたが、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

■為替市況

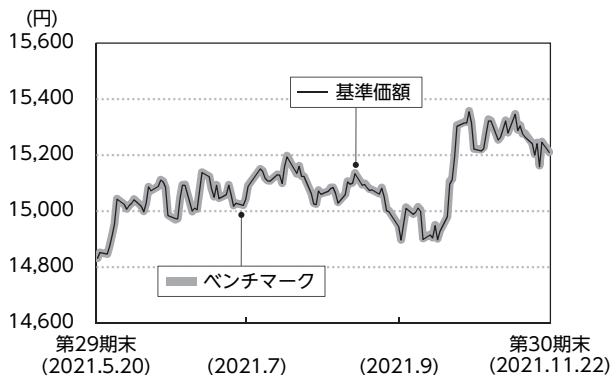


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは上昇しました。期初から9月中旬まではおおむね横ばい圏で推移しましたが、9月下旬から10月にかけてFRBの金融政策正常化観測の高まりを背景とした金利上昇を受けて米ドル高円安となりました。その後は金利上昇が止まったことで米ドルの上昇は止まりましたが、高値圏で横ばい推移となりました。

当期のユーロ／円レートは下落しました。期初以降、ECBがコロナ危機に対応する資産購入の特別枠(PEPP)の購入ペース維持等の金融緩和姿勢を示したことからユーロ安基調となりました。10月には欧州域内の景気回復やインフレ加速を背景にユーロ高に転じる場面もありましたが、感染力が強い新型コロナウイルスの変異株(デルタ型)への懸念から当期末にかけては急速にユーロ安が進行しました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・ 期初から7月にかけて、FRBが早期のテーパリングに慎重な姿勢を示したことで米10年国債金利が低下（債券価格は上昇）基調となったこと

<下落要因>

- ・ 9月から10月にかけて、原油価格の高騰を背景にインフレ懸念が高まり金融政策正常化が意識され米10年国債金利が上昇したこと

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+2.5%となり、ベンチマーク騰落率（+2.6%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | 期中 | ベンチ マーク | 期中 | 債券 組入比率 | 純資産 総額 |
|------------------|--------|-----|------------|-----|------------|-----------|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | |
| | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 26期(2019年11月20日) | 13,803 | 2.8 | 13,945 | 2.8 | 99.1 | 24,872 |
| 27期(2020年5月20日) | 14,139 | 2.4 | 14,296 | 2.5 | 99.0 | 26,883 |
| 28期(2020年11月20日) | 14,455 | 2.2 | 14,625 | 2.3 | 99.1 | 32,658 |
| 29期(2021年5月20日) | 14,832 | 2.6 | 15,011 | 2.6 | 99.2 | 38,541 |
| 30期(2021年11月22日) | 15,210 | 2.5 | 15,395 | 2.6 | 99.2 | 46,402 |

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | ベンチ マーク | 騰落率 | 債券 組入比率 |
|-----------------|--------|-----|------------|-----|------------|
| | | % | | % | |
| (期首)2021年5月20日 | 円 | % | | % | % |
| | 14,832 | — | 15,011 | — | 99.2 |
| 5月末 | 15,024 | 1.3 | 15,206 | 1.3 | 100.0 |
| 6月末 | 15,005 | 1.2 | 15,189 | 1.2 | 99.3 |
| 7月末 | 15,107 | 1.9 | 15,291 | 1.9 | 99.2 |
| 8月末 | 15,105 | 1.8 | 15,289 | 1.9 | 99.4 |
| 9月末 | 14,999 | 1.1 | 15,185 | 1.2 | 99.3 |
| 10月末 | 15,322 | 3.3 | 15,508 | 3.3 | 99.5 |
| (期末)2021年11月22日 | 15,210 | 2.5 | 15,395 | 2.6 | 99.2 |

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2021年5月21日～2021年11月22日

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|--------|-----|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| その他費用 | 3円 | 0.017% | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| (保管費用) | (2) | (0.016) | 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (その他) | (0) | (0.000) | <ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息 |
| 合計 | 3 | 0.017 | |

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（15,093円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2021年5月21日～2021年11月22日

公社債

| | | 買付額 | 売付額 | |
|--------|---------|-----------------------|-----------------------|-------------|
| 外国 | アメリカ | 千米ドル 56,316 | 千米ドル 21,709 | |
| | カナダ | 千カナダ・ドル 3,000 | 千カナダ・ドル 1,579 | |
| | オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 1,179 | 千オーストラリア・ドル 1,347 | |
| | シンガポール | 千シンガポール・ドル 575 | 千シンガポール・ドル 163 | |
| | イギリス | 千イギリス・ポンド 3,866 | 千イギリス・ポンド 2,192 | |
| | イスラエル | 千イスラエル・シケル 1,108 | 千イスラエル・シケル 280 | |
| | デンマーク | 千デンマーク・クローネ 2,433 | 千デンマーク・クローネ 351 | |
| | ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 1,548 | 千ノルウェー・クローネ 163 | |
| | スウェーデン | 千スウェーデン・クローナ 1,820 | 千スウェーデン・クローナ 1,883 | |
| | メキシコ | 千メキシコ・ペソ 10,559 | 千メキシコ・ペソ 6,528 | |
| | 中国 | 千人民元 4,462 | 千人民元 - | |
| | マレーシア | 千マレーシア・リンギット 1,670 | 千マレーシア・リンギット 436 | |
| | ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 1,502 | 千ポーランド・ズロチ 997 | |
| | ユーロ | アイルランド | 千ユーロ 505 | 千ユーロ 131 |
| | | オランダ | 1,437 | 421 |
| | | ベルギー | 1,439 | 454 |
| | | フランス | 6,911 | 1,728 |
| | | ドイツ | 5,931 | 2,331 |
| | | スペイン | 3,895 | 638 |
| | | イタリア | 6,945 | 1,998 |
| フィンランド | | 462 | 134 | |
| オーストリア | 986 | 162 | | |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2021年5月21日～2021年11月22日

公社債

| 買付 | | 売付 | |
|-------------|---------|-------------|---------|
| 銘柄 | 金額 | 銘柄 | 金額 |
| | 千円 | | 千円 |
| US TREASURY | 320,040 | US TREASURY | 267,094 |
| US TREASURY | 311,148 | US TREASURY | 241,765 |
| US TREASURY | 244,060 | US TREASURY | 232,218 |
| US TREASURY | 243,222 | US TREASURY | 217,953 |
| US TREASURY | 238,501 | US TREASURY | 215,783 |
| US TREASURY | 227,590 | US TREASURY | 191,792 |
| US TREASURY | 209,208 | US TREASURY | 137,851 |
| US TREASURY | 206,192 | US TREASURY | 123,903 |
| US TREASURY | 178,294 | US TREASURY | 116,461 |
| US TREASURY | 176,019 | US TREASURY | 115,931 |

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2021年11月22日現在

外国（外貨建）公社債

| 区分 | 当期末 | | | | | | | |
|---------|-------------|-------------|------------|------|-----------------|-----------|------|------|
| | 額面金額 | 評価額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 181,580 | 189,441 | 21,615,267 | 46.6 | — | 21.1 | 16.9 | 8.5 |
| | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | | | | | | |
| カナダ | 9,950 | 10,161 | 916,374 | 2.0 | — | 0.9 | 0.6 | 0.5 |
| | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | | | | | | |
| オーストラリア | 9,420 | 9,775 | 806,409 | 1.7 | — | 1.2 | 0.4 | 0.2 |
| | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | | | | | | |
| シンガポール | 2,270 | 2,389 | 200,093 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | | | | | | |
| イギリス | 15,120 | 18,482 | 2,834,442 | 6.1 | — | 4.7 | 0.9 | 0.4 |
| | 千イスラエル・シケル | 千イスラエル・シケル | | | | | | |
| イスラエル | 5,460 | 6,125 | 225,881 | 0.5 | — | 0.2 | 0.2 | 0.1 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 区分 | 当期末 | | | | | | | | |
|--------|-----------------------|------------------------|---------------|-----------|-----------------|-----------|----------|----------|-----|
| | 額面金額 | 評価額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 | |
| デンマーク | 千デンマーク・クローネ 11,310 | 千デンマーク・クローネ 13,445 | 千円 232,601 | % 0.5 | % - | % 0.3 | % 0.1 | % 0.1 | |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 8,660 | 千ノルウェー・クローネ 8,748 | 111,714 | 0.2 | - | 0.1 | 0.1 | 0.0 | |
| スウェーデン | 千スウェーデン・クローナ 9,780 | 千スウェーデン・クローナ 10,713 | 136,385 | 0.3 | - | 0.2 | 0.1 | 0.1 | |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ 56,810 | 千メキシコ・ペソ 58,119 | 318,109 | 0.7 | - | 0.4 | 0.3 | 0.0 | |
| 中国 | 千人民元 4,420 | 千人民元 4,461 | 79,611 | 0.2 | - | 0.1 | 0.0 | 0.0 | |
| マレーシア | 千マレーシア・リンギット 7,960 | 千マレーシア・リンギット 8,179 | 222,830 | 0.5 | - | 0.3 | 0.1 | 0.0 | |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 8,420 | 千ポーランド・ズロチ 8,153 | 223,690 | 0.5 | - | 0.2 | 0.2 | 0.1 | |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | | |
| | アイルランド | 2,540 | 2,821 | 363,103 | 0.8 | - | 0.6 | 0.2 | 0.0 |
| | オランダ | 5,700 | 6,785 | 873,042 | 1.9 | - | 1.3 | 0.4 | 0.2 |
| | ベルギー | 6,720 | 8,123 | 1,045,189 | 2.3 | - | 1.7 | 0.4 | 0.1 |
| | フランス | 30,500 | 35,751 | 4,600,208 | 9.9 | - | 6.6 | 2.5 | 0.9 |
| | ドイツ | 22,250 | 26,013 | 3,347,127 | 7.2 | - | 4.5 | 1.8 | 0.8 |
| | スペイン | 18,120 | 21,143 | 2,720,526 | 5.9 | - | 3.7 | 1.6 | 0.6 |
| | イタリア | 28,440 | 32,693 | 4,206,644 | 9.1 | - | 5.5 | 2.4 | 1.1 |
| | フィンランド | 1,960 | 2,145 | 276,025 | 0.6 | - | 0.4 | 0.2 | 0.1 |
| | オーストリア | 4,490 | 5,259 | 676,743 | 1.5 | - | 0.9 | 0.3 | 0.2 |
| 合計 | - | - | 46,032,023 | 99.2 | - | 55.2 | 30.0 | 14.1 | |

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------------|--------|------------|-------|-------|---------|
| | | | | 千米ドル | 千円 |
| アメリカ | % | | 千米ドル | 千米ドル | 千円 |
| 国債証券 | | | | | |
| US TREASURY | 6.0000 | 2026/02/15 | 100 | 120 | 13,728 |
| US TREASURY | 6.1250 | 2027/11/15 | 120 | 153 | 17,500 |
| US TREASURY | 5.5000 | 2028/08/15 | 90 | 113 | 12,972 |
| US TREASURY | 5.2500 | 2028/11/15 | 120 | 150 | 17,206 |
| US TREASURY | 5.3750 | 2031/02/15 | 170 | 227 | 25,977 |
| US TREASURY | 1.6250 | 2022/11/15 | 1,260 | 1,277 | 145,798 |
| US TREASURY | 1.6250 | 2022/12/15 | 2,500 | 2,537 | 289,537 |
| US TREASURY | 2.1250 | 2022/12/31 | 1,470 | 1,500 | 171,244 |
| US TREASURY | 2.0000 | 2023/02/15 | 3,190 | 3,257 | 371,640 |
| US TREASURY | 1.5000 | 2023/02/28 | 1,760 | 1,786 | 203,874 |
| US TREASURY | 1.5000 | 2023/03/31 | 3,090 | 3,138 | 358,146 |
| US TREASURY | 1.7500 | 2023/05/15 | 3,730 | 3,805 | 434,219 |
| US TREASURY | 0.2500 | 2023/06/15 | 3,050 | 3,042 | 347,173 |
| US TREASURY | 1.3750 | 2023/06/30 | 1,720 | 1,746 | 199,286 |
| US TREASURY | 2.5000 | 2023/08/15 | 3,690 | 3,820 | 435,975 |
| US TREASURY | 0.1250 | 2023/09/15 | 3,720 | 3,696 | 421,748 |
| US TREASURY | 1.3750 | 2023/09/30 | 1,850 | 1,880 | 214,555 |
| US TREASURY | 2.7500 | 2023/11/15 | 3,020 | 3,152 | 359,667 |
| US TREASURY | 0.1250 | 2023/12/15 | 1,740 | 1,724 | 196,711 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2023/12/31 | 2,740 | 2,835 | 323,563 |
| US TREASURY | 2.7500 | 2024/02/15 | 3,710 | 3,886 | 443,418 |
| US TREASURY | 2.1250 | 2024/03/31 | 3,110 | 3,215 | 366,923 |
| US TREASURY | 2.5000 | 2024/05/15 | 4,730 | 4,938 | 563,536 |
| US TREASURY | 2.0000 | 2024/06/30 | 1,680 | 1,734 | 197,938 |
| US TREASURY | 2.3750 | 2024/08/15 | 3,470 | 3,620 | 413,078 |
| US TREASURY | 0.3750 | 2024/09/15 | 2,150 | 2,125 | 242,476 |
| US TREASURY | 2.1250 | 2024/09/30 | 1,540 | 1,597 | 182,289 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2024/11/15 | 2,510 | 2,613 | 298,247 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2024/12/31 | 1,440 | 1,500 | 171,254 |
| US TREASURY | 2.0000 | 2025/02/15 | 2,670 | 2,762 | 315,166 |
| US TREASURY | 2.6250 | 2025/03/31 | 1,720 | 1,815 | 207,198 |
| US TREASURY | 2.1250 | 2025/05/15 | 2,670 | 2,775 | 316,677 |
| US TREASURY | 2.7500 | 2025/06/30 | 1,550 | 1,646 | 187,811 |
| US TREASURY | 2.0000 | 2025/08/15 | 3,490 | 3,613 | 412,345 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2025/09/30 | 1,980 | 2,126 | 242,586 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2025/11/15 | 3,270 | 3,419 | 390,213 |
| US TREASURY | 2.6250 | 2025/12/31 | 2,280 | 2,420 | 276,222 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------------|--------|------------|-------|-------|---------|
| | | | | 千米ドル | 千円 |
| アメリカ | % | | 千米ドル | 千米ドル | 千円 |
| 国債証券 | | | | | |
| US TREASURY | 1.6250 | 2026/02/15 | 3,060 | 3,123 | 356,387 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2026/03/31 | 2,540 | 2,659 | 303,464 |
| US TREASURY | 1.6250 | 2026/05/15 | 3,040 | 3,102 | 353,950 |
| US TREASURY | 1.8750 | 2026/06/30 | 2,190 | 2,259 | 257,812 |
| US TREASURY | 1.5000 | 2026/08/15 | 2,860 | 2,901 | 331,090 |
| US TREASURY | 0.7500 | 2026/08/31 | 1,270 | 1,243 | 141,917 |
| US TREASURY | 1.6250 | 2026/09/30 | 1,560 | 1,592 | 181,707 |
| US TREASURY | 2.0000 | 2026/11/15 | 1,380 | 1,433 | 163,595 |
| US TREASURY | 1.7500 | 2026/12/31 | 480 | 493 | 56,260 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2027/02/15 | 1,470 | 1,544 | 176,276 |
| US TREASURY | 0.6250 | 2027/03/31 | 420 | 406 | 46,392 |
| US TREASURY | 2.3750 | 2027/05/15 | 2,190 | 2,318 | 264,509 |
| US TREASURY | 0.5000 | 2027/06/30 | 790 | 756 | 86,293 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2027/08/15 | 2,370 | 2,493 | 284,475 |
| US TREASURY | 0.3750 | 2027/09/30 | 1,180 | 1,117 | 127,490 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2027/11/15 | 2,130 | 2,242 | 255,877 |
| US TREASURY | 0.6250 | 2027/12/31 | 1,710 | 1,636 | 186,703 |
| US TREASURY | 2.7500 | 2028/02/15 | 2,210 | 2,393 | 273,120 |
| US TREASURY | 1.1250 | 2028/02/29 | 1,070 | 1,054 | 120,364 |
| US TREASURY | 1.2500 | 2028/03/31 | 1,060 | 1,051 | 119,939 |
| US TREASURY | 1.2500 | 2028/04/30 | 1,370 | 1,358 | 154,972 |
| US TREASURY | 2.8750 | 2028/05/15 | 1,950 | 2,129 | 242,986 |
| US TREASURY | 1.2500 | 2028/05/31 | 1,500 | 1,486 | 169,583 |
| US TREASURY | 2.8750 | 2028/08/15 | 2,690 | 2,943 | 335,857 |
| US TREASURY | 1.1250 | 2028/08/31 | 1,870 | 1,833 | 209,165 |
| US TREASURY | 3.1250 | 2028/11/15 | 1,140 | 1,268 | 144,758 |
| US TREASURY | 2.6250 | 2029/02/15 | 1,160 | 1,253 | 143,078 |
| US TREASURY | 2.3750 | 2029/05/15 | 940 | 1,001 | 114,245 |
| US TREASURY | 1.6250 | 2029/08/15 | 860 | 871 | 99,475 |
| US TREASURY | 1.7500 | 2029/11/15 | 640 | 654 | 74,692 |
| US TREASURY | 1.5000 | 2030/02/15 | 1,110 | 1,113 | 126,996 |
| US TREASURY | 0.6250 | 2030/08/15 | 1,990 | 1,848 | 210,960 |
| US TREASURY | 0.8750 | 2030/11/15 | 2,050 | 1,943 | 221,798 |
| US TREASURY | 1.1250 | 2031/02/15 | 2,100 | 2,033 | 231,990 |
| US TREASURY | 1.6250 | 2031/05/15 | 2,130 | 2,153 | 245,689 |
| US TREASURY | 1.2500 | 2031/08/15 | 2,200 | 2,145 | 244,744 |
| US TREASURY | 4.5000 | 2036/02/15 | 160 | 221 | 25,228 |
| US TREASURY | 5.0000 | 2037/05/15 | 120 | 175 | 20,028 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------------|--------|------------|-------|-------|---------|
| | | | | 千米ドル | 千円 |
| アメリカ | % | | 千米ドル | 千米ドル | 千円 |
| 国債証券 | | | | | |
| US TREASURY | 4.3750 | 2038/02/15 | 130 | 179 | 20,527 |
| US TREASURY | 4.5000 | 2038/05/15 | 150 | 210 | 24,035 |
| US TREASURY | 3.5000 | 2039/02/15 | 150 | 188 | 21,526 |
| US TREASURY | 4.2500 | 2039/05/15 | 230 | 315 | 36,053 |
| US TREASURY | 4.5000 | 2039/08/15 | 230 | 325 | 37,123 |
| US TREASURY | 4.3750 | 2039/11/15 | 250 | 348 | 39,795 |
| US TREASURY | 4.6250 | 2040/02/15 | 250 | 359 | 40,994 |
| US TREASURY | 1.1250 | 2040/05/15 | 780 | 681 | 77,775 |
| US TREASURY | 1.1250 | 2040/08/15 | 990 | 862 | 98,455 |
| US TREASURY | 3.8750 | 2040/08/15 | 240 | 316 | 36,111 |
| US TREASURY | 1.3750 | 2040/11/15 | 1,060 | 963 | 109,965 |
| US TREASURY | 4.2500 | 2040/11/15 | 230 | 317 | 36,224 |
| US TREASURY | 1.8750 | 2041/02/15 | 1,310 | 1,295 | 147,817 |
| US TREASURY | 4.7500 | 2041/02/15 | 250 | 366 | 41,853 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2041/05/15 | 1,320 | 1,386 | 158,189 |
| US TREASURY | 1.7500 | 2041/08/15 | 970 | 938 | 107,079 |
| US TREASURY | 3.1250 | 2041/11/15 | 260 | 312 | 35,606 |
| US TREASURY | 3.1250 | 2042/02/15 | 270 | 324 | 37,058 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2042/05/15 | 250 | 295 | 33,717 |
| US TREASURY | 2.7500 | 2042/08/15 | 290 | 329 | 37,650 |
| US TREASURY | 2.7500 | 2042/11/15 | 430 | 489 | 55,850 |
| US TREASURY | 3.1250 | 2043/02/15 | 370 | 445 | 50,866 |
| US TREASURY | 2.8750 | 2043/05/15 | 580 | 673 | 76,849 |
| US TREASURY | 3.6250 | 2043/08/15 | 410 | 532 | 60,716 |
| US TREASURY | 3.7500 | 2043/11/15 | 420 | 555 | 63,402 |
| US TREASURY | 3.6250 | 2044/02/15 | 460 | 599 | 68,375 |
| US TREASURY | 3.3750 | 2044/05/15 | 410 | 516 | 58,925 |
| US TREASURY | 3.1250 | 2044/08/15 | 550 | 668 | 76,242 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2044/11/15 | 500 | 596 | 68,103 |
| US TREASURY | 2.5000 | 2045/02/15 | 650 | 715 | 81,674 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2045/05/15 | 320 | 383 | 43,785 |
| US TREASURY | 2.8750 | 2045/08/15 | 420 | 494 | 56,394 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2045/11/15 | 240 | 288 | 32,951 |
| US TREASURY | 2.5000 | 2046/02/15 | 530 | 586 | 66,947 |
| US TREASURY | 2.5000 | 2046/05/15 | 540 | 598 | 68,246 |
| US TREASURY | 2.2500 | 2046/08/15 | 640 | 678 | 77,382 |
| US TREASURY | 2.8750 | 2046/11/15 | 320 | 379 | 43,339 |
| US TREASURY | 3.0000 | 2047/02/15 | 580 | 704 | 80,421 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------------|---------------------|------------|------------|---------|---------|------------|
| | | | | | 千円 | 邦貨換算金額 |
| アメリカ | | % | | 千円ドル | 千円ドル | 千円 |
| 国債証券 | US TREASURY | 3.0000 | 2047/05/15 | 420 | 511 | 58,406 |
| | US TREASURY | 2.7500 | 2047/08/15 | 620 | 723 | 82,579 |
| | US TREASURY | 2.7500 | 2047/11/15 | 630 | 736 | 83,993 |
| | US TREASURY | 3.0000 | 2048/02/15 | 730 | 893 | 101,988 |
| | US TREASURY | 3.1250 | 2048/05/15 | 770 | 965 | 110,143 |
| | US TREASURY | 3.0000 | 2048/08/15 | 850 | 1,042 | 118,999 |
| | US TREASURY | 3.3750 | 2048/11/15 | 840 | 1,102 | 125,813 |
| | US TREASURY | 3.0000 | 2049/02/15 | 900 | 1,109 | 126,576 |
| | US TREASURY | 2.8750 | 2049/05/15 | 880 | 1,062 | 121,206 |
| | US TREASURY | 2.2500 | 2049/08/15 | 850 | 911 | 103,963 |
| | US TREASURY | 2.3750 | 2049/11/15 | 770 | 848 | 96,792 |
| | US TREASURY | 2.0000 | 2050/02/15 | 980 | 997 | 113,848 |
| | US TREASURY | 1.3750 | 2050/08/15 | 1,280 | 1,124 | 128,271 |
| | US TREASURY | 1.6250 | 2050/11/15 | 1,270 | 1,186 | 135,322 |
| | US TREASURY | 1.8750 | 2051/02/15 | 1,390 | 1,376 | 157,043 |
| | US TREASURY | 2.3750 | 2051/05/15 | 1,390 | 1,537 | 175,375 |
| | US TREASURY | 2.0000 | 2051/08/15 | 1,470 | 1,500 | 171,185 |
| | US TREASURY | 6.2500 | 2030/05/15 | 130 | 179 | 20,529 |
| | US TREASURY | 0.6250 | 2030/05/15 | 1,520 | 1,416 | 161,569 |
| | US TREASURY | 4.3750 | 2040/05/15 | 250 | 349 | 39,929 |
| | US TREASURY | 4.3750 | 2041/05/15 | 230 | 323 | 36,943 |
| US TREASURY | 3.7500 | 2041/08/15 | 230 | 299 | 34,213 | |
| US TREASURY | 1.2500 | 2050/05/15 | 1,140 | 970 | 110,739 | |
| 小計 | | - | - | - | - | 21,615,267 |
| カナダ | | | | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | |
| 国債証券 | CANADA GOVERNMENT | 2.7500 | 2064/12/01 | 100 | 118 | 10,642 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.2500 | 2022/11/01 | 420 | 418 | 37,711 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.2500 | 2023/02/01 | 370 | 367 | 33,150 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2023/03/01 | 330 | 333 | 30,109 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.2500 | 2023/05/01 | 370 | 366 | 33,073 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2023/06/01 | 320 | 323 | 29,129 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0000 | 2023/09/01 | 570 | 580 | 52,341 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.5000 | 2023/11/01 | 200 | 198 | 17,873 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.2500 | 2024/03/01 | 210 | 215 | 19,439 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.2500 | 2024/04/01 | 430 | 421 | 38,015 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5000 | 2024/06/01 | 200 | 206 | 18,651 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2024/09/01 | 180 | 181 | 16,377 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.7500 | 2024/10/01 | 80 | 78 | 7,119 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|---------|-----------------------|--------|------------|-------------|-------------|---------|
| | | | | | 千カナダ・ドル | 千円 |
| カナダ | | % | | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 |
| 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2025/03/01 | 200 | 199 | 18,032 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.2500 | 2025/06/01 | 210 | 217 | 19,575 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.5000 | 2025/09/01 | 530 | 513 | 46,344 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.2500 | 2026/03/01 | 380 | 362 | 32,648 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2026/06/01 | 130 | 130 | 11,775 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0000 | 2026/09/01 | 370 | 362 | 32,667 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0000 | 2027/06/01 | 210 | 204 | 18,452 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0000 | 2028/06/01 | 170 | 175 | 15,792 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.2500 | 2029/06/01 | 170 | 178 | 16,123 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.7500 | 2029/06/01 | 140 | 181 | 16,396 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2030/06/01 | 620 | 604 | 54,473 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.5000 | 2030/12/01 | 510 | 462 | 41,665 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2031/06/01 | 700 | 690 | 62,225 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2031/12/01 | 80 | 78 | 7,072 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.7500 | 2033/06/01 | 170 | 240 | 21,665 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0000 | 2037/06/01 | 110 | 156 | 14,075 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0000 | 2041/06/01 | 150 | 199 | 17,990 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5000 | 2045/12/01 | 200 | 257 | 23,195 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2048/12/01 | 200 | 231 | 20,833 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0000 | 2051/12/01 | 750 | 748 | 67,461 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2053/12/01 | 170 | 158 | 14,269 |
| 小計 | | - | - | - | - | 916,374 |
| オーストラリア | | | | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | |
| 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.2500 | 2022/11/21 | 440 | 448 | 37,027 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5000 | 2023/04/21 | 390 | 417 | 34,470 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2024/04/21 | 270 | 283 | 23,367 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 0.2500 | 2024/11/21 | 470 | 460 | 37,965 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.2500 | 2025/04/21 | 330 | 353 | 29,163 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 0.2500 | 2025/11/21 | 340 | 326 | 26,963 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.2500 | 2026/04/21 | 380 | 428 | 35,309 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 0.5000 | 2026/09/21 | 390 | 374 | 30,855 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.7500 | 2027/04/21 | 370 | 434 | 35,805 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2027/11/21 | 340 | 364 | 30,059 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.2500 | 2028/05/21 | 310 | 323 | 26,672 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2028/11/21 | 240 | 258 | 21,310 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.2500 | 2029/04/21 | 340 | 378 | 31,213 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2029/11/21 | 350 | 377 | 31,165 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.5000 | 2030/05/21 | 500 | 530 | 43,769 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|----------------|-----------------------|--------|------------|-------------|-------------|---------|
| | | | | | 千円 | 邦貨換算金額 |
| オーストラリア | | % | | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円 |
| 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.0000 | 2030/12/21 | 540 | 505 | 41,659 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2031/06/21 | 460 | 448 | 36,973 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.0000 | 2031/11/21 | 530 | 490 | 40,497 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2032/05/21 | 390 | 368 | 30,369 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2032/11/21 | 340 | 336 | 27,721 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5000 | 2033/04/21 | 330 | 419 | 34,608 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2035/06/21 | 160 | 173 | 14,323 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.7500 | 2037/04/21 | 230 | 277 | 22,904 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.2500 | 2039/06/21 | 190 | 215 | 17,780 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.7500 | 2041/05/21 | 250 | 263 | 21,706 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2047/03/21 | 250 | 273 | 22,542 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2051/06/21 | 290 | 244 | 20,202 |
| 小計 | | - | - | - | - | 806,409 |
| シンガポール | | | | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | |
| 国債証券 | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.7500 | 2023/07/01 | 330 | 340 | 28,533 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.0000 | 2024/02/01 | 60 | 61 | 5,149 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0000 | 2024/09/01 | 200 | 210 | 17,660 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.3750 | 2025/06/01 | 140 | 145 | 12,208 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 0.5000 | 2025/11/01 | 60 | 58 | 4,880 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.1250 | 2026/06/01 | 140 | 144 | 12,109 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5000 | 2027/03/01 | 150 | 164 | 13,809 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.6250 | 2028/05/01 | 90 | 95 | 8,008 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.8750 | 2029/07/01 | 130 | 140 | 11,780 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.8750 | 2030/09/01 | 160 | 173 | 14,562 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.6250 | 2031/07/01 | 80 | 78 | 6,612 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.3750 | 2033/09/01 | 120 | 138 | 11,569 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.2500 | 2036/08/01 | 140 | 144 | 12,120 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.3750 | 2039/07/01 | 60 | 63 | 5,287 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.7500 | 2042/04/01 | 100 | 111 | 9,311 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.7500 | 2046/03/01 | 130 | 144 | 12,109 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.8750 | 2050/03/01 | 130 | 123 | 10,340 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.8750 | 2051/10/01 | 50 | 48 | 4,039 |
| 小計 | | - | - | - | - | 200,093 |
| イギリス | | | | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | |
| 国債証券 | UK TREASURY | 4.5000 | 2034/09/07 | 220 | 312 | 47,855 |
| | UK TREASURY | 4.5000 | 2042/12/07 | 350 | 575 | 88,221 |
| | UK TREASURY | 4.2500 | 2036/03/07 | 310 | 442 | 67,871 |
| | UK TREASURY | 4.2500 | 2046/12/07 | 310 | 524 | 80,368 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------------|--------|------------|------|-----|--------|
| | | | | 千円 | 千円 |
| イギリス | % | | 千円 | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | | | 千円 | 千円 | 千円 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2027/12/07 | 230 | 279 | 42,819 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2032/06/07 | 330 | 440 | 67,581 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2039/09/07 | 230 | 348 | 53,509 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2040/12/07 | 270 | 417 | 63,988 |
| UK TREASURY | 4.2500 | 2055/12/07 | 310 | 601 | 92,312 |
| UK TREASURY | 4.7500 | 2030/12/07 | 300 | 403 | 61,848 |
| UK TREASURY | 4.0000 | 2060/01/22 | 230 | 456 | 70,074 |
| UK TREASURY | 4.7500 | 2038/12/07 | 270 | 426 | 65,352 |
| UK TREASURY | 5.0000 | 2025/03/07 | 300 | 343 | 52,731 |
| UK TREASURY | 6.0000 | 2028/12/07 | 180 | 245 | 37,715 |
| UK TREASURY | 0.2500 | 2031/07/31 | 520 | 489 | 75,127 |
| UK TREASURY | 0.5000 | 2061/10/22 | 270 | 233 | 35,832 |
| UK TREASURY | 0.1250 | 2023/01/31 | 640 | 638 | 97,887 |
| UK TREASURY | 0.1250 | 2024/01/31 | 590 | 585 | 89,785 |
| UK TREASURY | 0.1250 | 2026/01/30 | 310 | 304 | 46,743 |
| UK TREASURY | 0.1250 | 2028/01/31 | 240 | 232 | 35,634 |
| UK TREASURY | 0.3750 | 2026/10/22 | 290 | 286 | 43,906 |
| UK TREASURY | 0.3750 | 2030/10/22 | 270 | 259 | 39,856 |
| UK TREASURY | 0.6250 | 2025/06/07 | 290 | 291 | 44,710 |
| UK TREASURY | 0.6250 | 2050/10/22 | 190 | 171 | 26,280 |
| UK TREASURY | 1.5000 | 2026/07/22 | 240 | 250 | 38,421 |
| UK TREASURY | 1.5000 | 2047/07/22 | 340 | 372 | 57,153 |
| UK TREASURY | 1.2500 | 2027/07/22 | 240 | 248 | 38,143 |
| UK TREASURY | 1.2500 | 2041/10/22 | 430 | 440 | 67,594 |
| UK TREASURY | 1.6250 | 2028/10/22 | 270 | 287 | 44,099 |
| UK TREASURY | 1.6250 | 2054/10/22 | 250 | 292 | 44,853 |
| UK TREASURY | 1.6250 | 2071/10/22 | 200 | 267 | 41,025 |
| UK TREASURY | 1.0000 | 2024/04/22 | 280 | 283 | 43,523 |
| UK TREASURY | 1.7500 | 2049/01/22 | 200 | 233 | 35,773 |
| UK TREASURY | 1.7500 | 2057/07/22 | 340 | 420 | 64,451 |
| UK TREASURY | 2.2500 | 2023/09/07 | 290 | 299 | 45,902 |
| UK TREASURY | 2.7500 | 2024/09/07 | 210 | 223 | 34,221 |
| UK TREASURY | 2.0000 | 2025/09/07 | 260 | 274 | 42,110 |
| UK TREASURY | 0.8750 | 2029/10/22 | 250 | 252 | 38,722 |
| UK TREASURY | 3.5000 | 2068/07/22 | 280 | 561 | 86,132 |
| UK TREASURY | 3.2500 | 2044/01/22 | 380 | 541 | 82,984 |
| UK TREASURY | 3.7500 | 2052/07/22 | 230 | 395 | 60,590 |
| UK TREASURY | 3.5000 | 2045/01/22 | 360 | 537 | 82,406 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------|--------------------|--------|------------|-------------|-------------|---------|
| | | | | | 千円 | 邦貨換算金額 |
| イギリス | | % | | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | 千円 |
| 国債証券 | UK TREASURY | 4.2500 | 2049/12/07 | 230 | 409 | 62,841 |
| | UK TREASURY | 0.6250 | 2035/07/31 | 420 | 395 | 60,717 |
| | UK TREASURY | 0.8750 | 2046/01/31 | 190 | 180 | 27,703 |
| | UK TREASURY | 0.7500 | 2023/07/22 | 370 | 372 | 57,076 |
| | UK TREASURY | 0.2500 | 2025/01/31 | 30 | 29 | 4,556 |
| | UK TREASURY | 0.5000 | 2029/01/31 | 110 | 108 | 16,579 |
| | UK TREASURY | 0.8750 | 2033/07/31 | 190 | 188 | 28,982 |
| | UK TREASURY | 1.7500 | 2037/09/07 | 380 | 416 | 63,917 |
| | UK TREASURY | 1.1250 | 2039/01/31 | 160 | 160 | 24,567 |
| | UK TREASURY | 1.2500 | 2051/07/31 | 150 | 157 | 24,202 |
| | UK TREASURY | 1.5000 | 2053/07/31 | 110 | 125 | 19,194 |
| | UK TREASURY | 2.5000 | 2065/07/22 | 280 | 443 | 67,976 |
| | 小計 | | - | - | - | - |
| イスラエル | | | | 千イスラエル・シケル | 千イスラエル・シケル | |
| 国債証券 | ISRAEL FIXED BOND | 1.2500 | 2022/11/30 | 590 | 604 | 22,294 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 0.1500 | 2023/07/31 | 80 | 80 | 2,954 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.5000 | 2023/11/30 | 650 | 677 | 24,975 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 3.7500 | 2024/03/31 | 440 | 487 | 17,979 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.7500 | 2025/08/31 | 860 | 906 | 33,445 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 0.5000 | 2026/02/27 | 150 | 151 | 5,575 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 6.2500 | 2026/10/30 | 290 | 371 | 13,710 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 2.0000 | 2027/03/31 | 380 | 412 | 15,218 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 2.2500 | 2028/09/28 | 360 | 397 | 14,658 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.0000 | 2030/03/31 | 480 | 481 | 17,759 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 1.5000 | 2037/05/31 | 330 | 318 | 11,752 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 5.5000 | 2042/01/31 | 370 | 604 | 22,294 |
| | ISRAEL FIXED BOND | 3.7500 | 2047/03/31 | 480 | 630 | 23,265 |
| 小計 | | - | - | - | - | 225,881 |
| デンマーク | | | | 千デンマーク・クローネ | 千デンマーク・クローネ | |
| 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK | 0.2500 | 2022/11/15 | 1,390 | 1,402 | 24,267 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 1.5000 | 2023/11/15 | 1,010 | 1,054 | 18,244 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.0000 | 2024/11/15 | 730 | 743 | 12,855 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 1.7500 | 2025/11/15 | 1,040 | 1,135 | 19,636 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.5000 | 2027/11/15 | 1,390 | 1,462 | 25,307 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.5000 | 2029/11/15 | 1,740 | 1,841 | 31,857 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.0000 | 2031/11/15 | 1,000 | 1,006 | 17,420 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 4.5000 | 2039/11/15 | 2,190 | 3,972 | 68,724 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.2500 | 2052/11/15 | 820 | 825 | 14,287 |
| 小計 | | - | - | - | - | 232,601 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | | 評価額 | |
|--------|-------------------------|---------|------------|--------------|--------------|---------|---------|
| | | | | | | 邦貨換算金額 | |
| ノルウェー | | % | | 千ノルウェー・クローネ | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | |
| 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0000 | 2023/05/24 | 1,590 | 1,610 | 20,568 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.0000 | 2024/03/14 | 1,250 | 1,297 | 16,570 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2025/03/13 | 980 | 990 | 12,650 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.5000 | 2026/02/19 | 850 | 850 | 10,866 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2027/02/17 | 770 | 779 | 9,953 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0000 | 2028/04/26 | 740 | 761 | 9,726 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.7500 | 2029/09/06 | 780 | 790 | 10,098 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.3750 | 2030/08/19 | 1,070 | 1,054 | 13,460 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.2500 | 2031/09/17 | 630 | 612 | 7,820 | |
| 小計 | | - | - | - | - | 111,714 | |
| スウェーデン | | | | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | | |
| 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT | 1.5000 | 2023/11/13 | 1,910 | 1,975 | 25,147 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 2.5000 | 2025/05/12 | 1,460 | 1,592 | 20,272 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.0000 | 2026/11/12 | 1,510 | 1,584 | 20,169 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.7500 | 2028/05/12 | 1,170 | 1,220 | 15,537 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.7500 | 2029/11/12 | 1,220 | 1,279 | 16,288 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.1250 | 2031/05/12 | 1,000 | 991 | 12,620 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 2.2500 | 2032/06/01 | 690 | 834 | 10,625 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5000 | 2039/03/30 | 820 | 1,235 | 15,724 | |
| | 小計 | | - | - | - | - | 136,385 |
| メキシコ | | | | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | | |
| 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.7500 | 2023/03/09 | 3,350 | 3,367 | 18,432 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000 | 2023/12/07 | 4,790 | 4,896 | 26,799 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000 | 2024/09/05 | 3,560 | 3,639 | 19,918 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0000 | 2024/12/05 | 6,840 | 7,371 | 40,346 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.7500 | 2026/03/05 | 6,970 | 6,584 | 36,041 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.5000 | 2027/03/04 | 200 | 183 | 1,006 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5000 | 2027/06/03 | 5,770 | 5,816 | 31,833 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2029/05/31 | 5,440 | 5,788 | 31,681 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500 | 2031/05/29 | 5,060 | 5,156 | 28,224 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500 | 2034/11/23 | 1,720 | 1,749 | 9,573 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0000 | 2036/11/20 | 1,250 | 1,513 | 8,282 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5000 | 2038/11/18 | 4,310 | 4,559 | 24,954 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.7500 | 2042/11/13 | 3,570 | 3,500 | 19,157 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0000 | 2047/11/07 | 3,980 | 3,993 | 21,856 | |
| | 小計 | | - | - | - | - | 318,109 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|-------|------------------------|--------|------------|--------------|--------------|---------|
| | | | | | 千人民元 | 千円 |
| 中国 | | % | | 千人民元 | 千人民元 | 千円 |
| 国債証券 | CHINAGOVERNMENTBOND | 2.5700 | 2023/05/20 | 1,000 | 1,001 | 17,874 |
| | CHINAGOVERNMENTBOND | 2.6900 | 2026/08/12 | 1,100 | 1,097 | 19,581 |
| | CHINAGOVERNMENTBOND | 3.0100 | 2028/05/13 | 720 | 725 | 12,937 |
| | CHINAGOVERNMENTBOND | 3.0200 | 2031/05/27 | 1,000 | 1,007 | 17,983 |
| | CHINAGOVERNMENTBOND | 3.7200 | 2051/04/12 | 600 | 629 | 11,233 |
| 小計 | | - | - | - | - | 79,611 |
| マレーシア | | | | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | |
| 国債証券 | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.4800 | 2023/03/15 | 640 | 649 | 17,690 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.1810 | 2024/07/15 | 770 | 798 | 21,759 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.0590 | 2024/09/30 | 60 | 62 | 1,695 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.9550 | 2025/09/15 | 830 | 860 | 23,449 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.3920 | 2026/04/15 | 360 | 379 | 10,349 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.9000 | 2026/11/30 | 370 | 382 | 10,431 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8920 | 2027/03/15 | 610 | 630 | 17,170 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.7330 | 2028/06/15 | 450 | 457 | 12,472 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8850 | 2029/08/15 | 370 | 379 | 10,340 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.4980 | 2030/04/15 | 420 | 445 | 12,146 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.2320 | 2031/06/30 | 380 | 397 | 10,819 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8440 | 2033/04/15 | 410 | 410 | 11,173 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.6420 | 2033/11/07 | 40 | 42 | 1,163 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.8280 | 2034/07/05 | 320 | 316 | 8,621 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.2540 | 2035/05/31 | 270 | 277 | 7,568 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.7620 | 2037/04/07 | 230 | 245 | 6,691 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.8930 | 2038/06/08 | 180 | 193 | 5,275 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3.7570 | 2040/05/22 | 390 | 368 | 10,043 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.9350 | 2043/09/30 | 130 | 140 | 3,837 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.7360 | 2046/03/15 | 210 | 218 | 5,948 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.9210 | 2048/07/06 | 190 | 202 | 5,503 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 4.0650 | 2050/06/15 | 330 | 318 | 8,680 |
| 小計 | | - | - | - | - | 222,830 |
| ポーランド | | | | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | |
| 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2023/01/25 | 460 | 458 | 12,592 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 0.0000 | 2023/04/25 | 400 | 384 | 10,549 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 4.0000 | 2023/10/25 | 420 | 428 | 11,765 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2024/04/25 | 1,080 | 1,069 | 29,337 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.2500 | 2024/10/25 | 210 | 205 | 5,642 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 0.7500 | 2025/04/25 | 540 | 500 | 13,722 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.2500 | 2025/07/25 | 1,050 | 1,057 | 29,014 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | | 評価額 | |
|--------|------------------------|--------|------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | | | | | | 千ポ-ランド・ズチ | 千ポ-ランド・ズチ |
| ポーランド | | % | | 千ポ-ランド・ズチ | 千ポ-ランド・ズチ | 千円 | |
| 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2026/07/25 | 840 | 819 | 22,493 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 0.2500 | 2026/10/25 | 380 | 329 | 9,040 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5000 | 2027/07/25 | 700 | 675 | 18,526 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2028/04/25 | 670 | 651 | 17,876 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.7500 | 2029/04/25 | 160 | 186 | 5,128 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.7500 | 2029/10/25 | 880 | 850 | 23,346 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 1.2500 | 2030/10/25 | 630 | 534 | 14,653 | |
| | 小計 | | - | - | - | - | 223,690 |
| ユーロ | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| アイルランド | | | | | | | |
| 国債証券 | IRISH TREASURY | 0.0000 | 2031/10/18 | 170 | 167 | 21,572 | |
| | IRISH TREASURY | 0.2000 | 2030/10/18 | 150 | 152 | 19,648 | |
| | IRISH TREASURY | 0.2000 | 2027/05/15 | 140 | 144 | 18,530 | |
| | IRISH TREASURY | 0.4000 | 2035/05/15 | 100 | 101 | 13,034 | |
| | IRISH TREASURY | 0.5500 | 2041/04/22 | 80 | 80 | 10,298 | |
| | IRISH TREASURY | 1.0000 | 2026/05/15 | 240 | 256 | 32,939 | |
| | IRISH TREASURY | 1.1000 | 2029/05/15 | 190 | 206 | 26,617 | |
| | IRISH TREASURY | 1.3000 | 2033/05/15 | 100 | 112 | 14,450 | |
| | IRISH TREASURY | 1.3500 | 2031/03/18 | 120 | 135 | 17,376 | |
| | IRISH TREASURY | 1.5000 | 2050/05/15 | 130 | 154 | 19,825 | |
| | IRISH TREASURY | 1.7000 | 2037/05/15 | 120 | 143 | 18,455 | |
| | IRISH TREASURY | 2.0000 | 2045/02/18 | 180 | 235 | 30,263 | |
| | IRISH TREASURY | 2.4000 | 2030/05/15 | 180 | 218 | 28,059 | |
| | IRISH TREASURY | 0.9000 | 2028/05/15 | 150 | 160 | 20,705 | |
| | IRISH TREASURY | 3.4000 | 2024/03/18 | 150 | 164 | 21,165 | |
| | IRISH TREASURY | 3.9000 | 2023/03/20 | 130 | 137 | 17,746 | |
| | IRISH TREASURY | 5.4000 | 2025/03/13 | 210 | 251 | 32,415 | |
| 小計 | | - | - | - | - | 363,103 | |
| オランダ | | | | | | | |
| 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.7500 | 2023/01/15 | 170 | 179 | 23,047 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.7500 | 2023/07/15 | 400 | 417 | 53,709 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2024/01/15 | 290 | 295 | 37,969 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0000 | 2024/07/15 | 300 | 322 | 41,479 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.2500 | 2025/07/15 | 380 | 393 | 50,571 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5000 | 2026/07/15 | 360 | 378 | 48,747 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2027/01/15 | 290 | 297 | 38,340 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.7500 | 2027/07/15 | 290 | 311 | 40,030 | |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | | |
|------|------------------------|--------|------------|------|-----|---------|
| | | | | 千ユーロ | 千円 | |
| ユーロ | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| オランダ | | | | | | |
| 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5000 | 2028/01/15 | 230 | 316 | 40,675 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.7500 | 2028/07/15 | 300 | 324 | 41,715 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2029/01/15 | 110 | 112 | 14,526 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.2500 | 2029/07/15 | 230 | 240 | 30,967 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2030/07/15 | 270 | 276 | 35,582 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2031/07/15 | 200 | 203 | 26,220 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5000 | 2033/01/15 | 290 | 375 | 48,377 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0000 | 2037/01/15 | 340 | 549 | 70,765 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2038/01/15 | 120 | 119 | 15,353 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5000 | 2040/01/15 | 200 | 218 | 28,117 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.7500 | 2042/01/15 | 350 | 614 | 79,079 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.7500 | 2047/01/15 | 390 | 655 | 84,295 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.0000 | 2052/01/15 | 190 | 182 | 23,470 |
| 小計 | | | - | - | - | 873,042 |
| ベルギー | | | | | | |
| 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | 2.2500 | 2023/06/22 | 250 | 262 | 33,719 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.2000 | 2023/10/22 | 180 | 183 | 23,603 |
| | BELGIUM KINGDOM | 2.6000 | 2024/06/22 | 280 | 304 | 39,194 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.5000 | 2024/10/22 | 250 | 259 | 33,340 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.8000 | 2025/06/22 | 400 | 421 | 54,183 |
| | BELGIUM KINGDOM | 4.5000 | 2026/03/28 | 180 | 220 | 28,425 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.0000 | 2026/06/22 | 360 | 386 | 49,667 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.8000 | 2027/06/22 | 260 | 278 | 35,841 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.0000 | 2027/10/22 | 160 | 164 | 21,108 |
| | BELGIUM KINGDOM | 5.5000 | 2028/03/28 | 330 | 457 | 58,803 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.8000 | 2028/06/22 | 340 | 366 | 47,161 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.9000 | 2029/06/22 | 320 | 348 | 44,857 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.1000 | 2030/06/22 | 240 | 245 | 31,607 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.0000 | 2031/06/22 | 300 | 331 | 42,649 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.0000 | 2031/10/22 | 270 | 269 | 34,731 |
| | BELGIUM KINGDOM | 4.0000 | 2032/03/28 | 160 | 227 | 29,216 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.2500 | 2033/04/22 | 200 | 227 | 29,303 |
| | BELGIUM KINGDOM | 3.0000 | 2034/06/22 | 170 | 230 | 29,714 |
| | BELGIUM KINGDOM | 5.0000 | 2035/03/28 | 370 | 606 | 77,977 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.4500 | 2037/06/22 | 130 | 152 | 19,577 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.9000 | 2038/06/22 | 160 | 199 | 25,715 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.4000 | 2040/06/22 | 130 | 128 | 16,517 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|------------------|------------------|------------|------------|-------|---------|---------|
| | | | | | 千ユーロ | 千円 |
| ユーロ | | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| ベルギー | | | | | | |
| 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | 4.2500 | 2041/03/28 | 330 | 561 | 72,253 |
| | BELGIUM KINGDOM | 3.7500 | 2045/06/22 | 190 | 323 | 41,634 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.6000 | 2047/06/22 | 210 | 256 | 33,021 |
| | BELGIUM KINGDOM | 1.7000 | 2050/06/22 | 210 | 263 | 33,926 |
| | BELGIUM KINGDOM | 2.2500 | 2057/06/22 | 120 | 173 | 22,361 |
| | BELGIUM KINGDOM | 2.1500 | 2066/06/22 | 130 | 192 | 24,759 |
| | BELGIUM KINGDOM | 0.6500 | 2071/06/22 | 90 | 80 | 10,316 |
| | 小計 | | - | - | - | - |
| フランス | | | | | | |
| 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2023/02/25 | 350 | 353 | 45,499 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2023/03/25 | 840 | 848 | 109,236 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.7500 | 2023/05/25 | 990 | 1,027 | 132,272 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.2500 | 2023/10/25 | 780 | 856 | 110,197 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2024/03/25 | 1,310 | 1,332 | 171,455 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.2500 | 2024/05/25 | 780 | 839 | 107,959 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.7500 | 2024/11/25 | 730 | 784 | 100,893 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2025/03/25 | 910 | 929 | 119,624 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2025/05/25 | 840 | 873 | 112,456 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 6.0000 | 2025/10/25 | 560 | 708 | 91,115 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.0000 | 2025/11/25 | 720 | 766 | 98,611 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2026/02/25 | 800 | 818 | 105,373 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 3.5000 | 2026/04/25 | 810 | 956 | 123,101 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2026/05/25 | 850 | 889 | 114,513 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.2500 | 2026/11/25 | 750 | 778 | 100,105 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2027/02/25 | 260 | 266 | 34,226 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.0000 | 2027/05/25 | 790 | 853 | 109,846 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.7500 | 2027/10/25 | 950 | 1,131 | 145,643 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2028/05/25 | 930 | 997 | 128,292 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2028/11/25 | 920 | 988 | 127,202 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 5.5000 | 2029/04/25 | 720 | 1,033 | 133,019 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2029/05/25 | 880 | 929 | 119,654 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2029/11/25 | 810 | 822 | 105,840 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.5000 | 2030/05/25 | 990 | 1,219 | 156,917 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2030/11/25 | 920 | 929 | 119,553 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.5000 | 2031/05/25 | 1,000 | 1,150 | 147,975 |
| FRANCE (GOVT OF) | 0.0000 | 2031/11/25 | 720 | 719 | 92,574 | |
| FRANCE (GOVT OF) | 5.7500 | 2032/10/25 | 670 | 1,092 | 140,586 | |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|------|--------------------------|--------|------------|------|-------|-----------|
| | | | | | 千ユーロ | 千円 |
| ユーロ | | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| フランス | | | | | | |
| 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 1.2500 | 2034/05/25 | 730 | 827 | 106,474 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.7500 | 2035/04/25 | 550 | 886 | 114,039 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.2500 | 2036/05/25 | 790 | 900 | 115,842 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.0000 | 2038/10/25 | 500 | 806 | 103,818 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.7500 | 2039/06/25 | 540 | 672 | 86,478 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2040/05/25 | 390 | 394 | 50,748 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.5000 | 2041/04/25 | 710 | 1,255 | 161,539 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2044/06/25 | 220 | 218 | 28,129 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 3.2500 | 2045/05/25 | 490 | 786 | 101,195 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2.0000 | 2048/05/25 | 550 | 737 | 94,851 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.5000 | 2050/05/25 | 620 | 752 | 96,888 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2052/05/25 | 570 | 574 | 73,862 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.7500 | 2053/05/25 | 130 | 129 | 16,705 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.0000 | 2055/04/25 | 380 | 749 | 96,471 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 4.0000 | 2060/04/25 | 320 | 664 | 85,507 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 1.7500 | 2066/05/25 | 270 | 361 | 46,565 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 0.5000 | 2072/05/25 | 160 | 134 | 17,343 |
| 小計 | | - | - | - | - | 4,600,208 |
| ドイツ | | | | | | |
| 国債証券 | BUNDES OBLIGATION | 0.0000 | 2023/04/14 | 430 | 435 | 55,988 |
| | BUNDES OBLIGATION | 0.0000 | 2023/10/13 | 420 | 426 | 54,937 |
| | BUNDES OBLIGATION | 0.0000 | 2024/04/05 | 50 | 50 | 6,561 |
| | BUNDES OBLIGATION | 0.0000 | 2024/10/18 | 420 | 429 | 55,311 |
| | BUNDES OBLIGATION | 0.0000 | 2025/04/11 | 380 | 389 | 50,165 |
| | BUNDES OBLIGATION | 0.0000 | 2025/10/10 | 90 | 92 | 11,947 |
| | BUNDES OBLIGATION | 0.0000 | 2025/10/10 | 470 | 483 | 62,222 |
| | BUNDES OBLIGATION | 0.0000 | 2026/04/10 | 460 | 474 | 61,010 |
| | BUNDES OBLIGATION | 0.0000 | 2026/10/09 | 320 | 330 | 42,475 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5000 | 2023/02/15 | 380 | 391 | 50,329 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5000 | 2023/05/15 | 590 | 610 | 78,587 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0000 | 2023/08/15 | 580 | 608 | 78,324 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.7500 | 2024/02/15 | 700 | 741 | 95,357 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5000 | 2024/05/15 | 770 | 814 | 104,849 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0000 | 2024/08/15 | 480 | 504 | 64,849 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5000 | 2025/02/15 | 530 | 552 | 71,062 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0000 | 2025/08/15 | 520 | 554 | 71,308 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5000 | 2026/02/15 | 580 | 610 | 78,491 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|------|--------------------------|--------|------------|------|------|-----------|
| | | | | | 千ユーロ | 千円 |
| ユーロ | | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| ドイツ | | | | | | |
| 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2026/08/15 | 570 | 588 | 75,740 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.2500 | 2027/02/15 | 580 | 607 | 78,118 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5000 | 2027/08/15 | 560 | 596 | 76,708 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2027/11/15 | 440 | 455 | 58,620 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5000 | 2028/02/15 | 510 | 544 | 70,118 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.2500 | 2028/08/15 | 540 | 569 | 73,301 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2028/11/15 | 330 | 342 | 44,035 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.2500 | 2029/02/15 | 510 | 539 | 69,366 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2029/08/15 | 500 | 519 | 66,786 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.2500 | 2030/01/04 | 200 | 313 | 40,322 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2030/02/15 | 510 | 530 | 68,207 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2030/08/15 | 130 | 135 | 17,480 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2030/08/15 | 570 | 592 | 76,230 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2031/02/15 | 540 | 559 | 72,022 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2031/08/15 | 140 | 145 | 18,674 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2031/08/15 | 460 | 475 | 61,172 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.7500 | 2034/07/04 | 460 | 764 | 98,384 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2035/05/15 | 430 | 442 | 56,916 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2036/05/15 | 340 | 348 | 44,802 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0000 | 2037/01/04 | 520 | 864 | 111,227 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.2500 | 2039/07/04 | 350 | 634 | 81,627 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.7500 | 2040/07/04 | 390 | 761 | 97,965 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.2500 | 2042/07/04 | 370 | 639 | 82,236 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5000 | 2044/07/04 | 540 | 872 | 112,256 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5000 | 2046/08/15 | 570 | 946 | 121,732 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.2500 | 2048/08/15 | 570 | 772 | 99,387 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2050/08/15 | 110 | 112 | 14,460 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2050/08/15 | 550 | 555 | 71,471 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.0000 | 2052/08/15 | 120 | 120 | 15,472 |
| | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 0.0000 | 2022/12/15 | 260 | 262 | 33,742 |
| | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 0.0000 | 2023/03/10 | 310 | 313 | 40,326 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5000 | 2027/07/04 | 270 | 381 | 49,085 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.6250 | 2028/01/04 | 270 | 376 | 48,408 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.7500 | 2028/07/04 | 220 | 300 | 38,611 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5000 | 2031/01/04 | 340 | 531 | 68,324 |
| 小計 | | - | - | - | - | 3,347,127 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|--------------------------|--------|------------|------|------|--------|
| | | | | 千ユーロ | 千円 |
| ユーロ | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| スペイン | | | | | |
| 国債証券 | | | | | |
| BONOS Y OBLIG DE | 0.5000 | 2031/10/31 | 330 | 333 | 42,931 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.4500 | 2022/10/31 | 350 | 354 | 45,551 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.4000 | 2023/01/31 | 350 | 375 | 48,281 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2023/04/30 | 440 | 444 | 57,166 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.3500 | 2023/07/30 | 430 | 437 | 56,272 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.4000 | 2023/10/31 | 360 | 395 | 50,923 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.8000 | 2024/01/31 | 290 | 324 | 41,775 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.8000 | 2024/04/30 | 400 | 442 | 56,991 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2024/05/31 | 400 | 404 | 52,101 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.2500 | 2024/07/30 | 370 | 377 | 48,586 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7500 | 2024/10/31 | 470 | 515 | 66,365 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2025/01/31 | 430 | 436 | 56,146 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.6000 | 2025/04/30 | 440 | 471 | 60,654 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.6500 | 2025/07/30 | 380 | 451 | 58,156 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.1500 | 2025/10/31 | 440 | 484 | 62,396 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2026/01/31 | 410 | 415 | 53,503 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.9500 | 2026/04/30 | 470 | 518 | 66,653 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9000 | 2026/07/30 | 390 | 505 | 64,989 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.3000 | 2026/10/31 | 490 | 529 | 68,089 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2027/01/31 | 30 | 30 | 3,897 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.5000 | 2027/04/30 | 440 | 481 | 61,939 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8000 | 2027/07/30 | 390 | 410 | 52,851 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4500 | 2027/10/31 | 450 | 492 | 63,336 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.0000 | 2028/01/31 | 280 | 280 | 36,134 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4000 | 2028/04/30 | 450 | 492 | 63,318 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4000 | 2028/07/30 | 420 | 460 | 59,292 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.1500 | 2028/10/31 | 320 | 434 | 55,931 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 6.0000 | 2029/01/31 | 450 | 645 | 83,081 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4500 | 2029/04/30 | 500 | 551 | 70,985 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.6000 | 2029/10/31 | 410 | 425 | 54,798 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5000 | 2030/04/30 | 400 | 410 | 52,825 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.9500 | 2030/07/30 | 430 | 494 | 63,654 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.2500 | 2030/10/31 | 470 | 511 | 65,854 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.1000 | 2031/04/30 | 410 | 401 | 51,691 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.7500 | 2032/07/30 | 430 | 672 | 86,535 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.3500 | 2033/07/30 | 360 | 435 | 56,006 |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.8500 | 2035/07/30 | 410 | 473 | 60,871 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|------|--------------------------|--------|------------|------|------|-----------|
| | | | | | 千ユーロ | 千円 |
| ユーロ | | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| スペイン | | | | | | |
| 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.2000 | 2037/01/31 | 410 | 617 | 79,499 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8500 | 2037/07/30 | 180 | 180 | 23,256 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9000 | 2040/07/30 | 360 | 614 | 79,055 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.2000 | 2040/10/31 | 310 | 323 | 41,665 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7000 | 2041/07/30 | 410 | 693 | 89,262 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0000 | 2042/07/30 | 100 | 100 | 12,958 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.1500 | 2044/10/31 | 290 | 539 | 69,406 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.9000 | 2046/10/31 | 330 | 462 | 59,487 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7000 | 2048/10/31 | 290 | 395 | 50,941 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0000 | 2050/10/31 | 370 | 352 | 45,320 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.4500 | 2066/07/30 | 280 | 444 | 57,206 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4500 | 2071/10/31 | 100 | 92 | 11,919 |
| 小計 | | - | - | - | - | 2,720,526 |
| イタリア | | | | | | |
| 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5000 | 2022/11/01 | 420 | 443 | 57,118 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.0500 | 2023/01/15 | 570 | 574 | 73,856 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2023/03/15 | 650 | 662 | 85,272 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5000 | 2023/05/01 | 520 | 558 | 71,806 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.7500 | 2023/08/01 | 400 | 435 | 56,092 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.3000 | 2023/08/15 | 160 | 162 | 20,880 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.6500 | 2023/10/15 | 810 | 827 | 106,462 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9.0000 | 2023/11/01 | 180 | 213 | 27,417 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.0000 | 2024/01/15 | 850 | 856 | 110,260 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5000 | 2024/03/01 | 390 | 433 | 55,730 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.8500 | 2024/05/15 | 850 | 895 | 115,280 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.0000 | 2024/08/15 | 170 | 171 | 22,004 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.7500 | 2024/09/01 | 370 | 411 | 52,926 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.4500 | 2024/11/15 | 420 | 440 | 56,724 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5000 | 2024/12/01 | 600 | 649 | 83,558 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.3500 | 2025/02/01 | 430 | 437 | 56,276 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2025/03/01 | 480 | 561 | 72,265 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5000 | 2025/06/01 | 750 | 793 | 102,080 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0000 | 2025/12/01 | 650 | 703 | 90,580 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.5000 | 2026/02/01 | 610 | 623 | 80,188 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5000 | 2026/03/01 | 380 | 453 | 58,384 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.0000 | 2026/04/01 | 140 | 139 | 17,996 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.6000 | 2026/06/01 | 690 | 739 | 95,103 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|--------------------------|--------|------------|------|------|---------|
| | | | | 千ユーロ | 千円 |
| ユーロ | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| イタリア | | | | | |
| 国債証券 | | | | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.0000 | 2026/08/01 | 230 | 229 | 29,466 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.2500 | 2026/12/01 | 520 | 549 | 70,767 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.8500 | 2027/01/15 | 40 | 41 | 5,332 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.2000 | 2027/06/01 | 580 | 644 | 82,868 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0500 | 2027/08/01 | 690 | 760 | 97,869 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2027/09/15 | 130 | 135 | 17,382 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5000 | 2027/11/01 | 430 | 587 | 75,603 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.0000 | 2028/02/01 | 770 | 849 | 109,342 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.2500 | 2028/03/15 | 50 | 49 | 6,387 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.5000 | 2028/07/15 | 310 | 311 | 40,096 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.7500 | 2028/09/01 | 410 | 528 | 68,047 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8000 | 2028/12/01 | 400 | 465 | 59,890 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.0000 | 2029/08/01 | 420 | 498 | 64,119 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.2500 | 2029/11/01 | 550 | 752 | 96,882 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5000 | 2030/03/01 | 490 | 605 | 77,905 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.3500 | 2030/04/01 | 480 | 508 | 65,400 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2030/08/01 | 370 | 378 | 48,654 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.6500 | 2030/12/01 | 450 | 486 | 62,544 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9000 | 2031/04/01 | 470 | 475 | 61,173 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0000 | 2031/05/01 | 510 | 756 | 97,294 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.6000 | 2031/08/01 | 430 | 421 | 54,253 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2031/12/01 | 350 | 352 | 45,405 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.6500 | 2032/03/01 | 470 | 506 | 65,144 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.7500 | 2033/02/01 | 390 | 590 | 75,981 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.4500 | 2033/09/01 | 360 | 417 | 53,719 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2034/08/01 | 480 | 704 | 90,614 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.3500 | 2035/03/01 | 280 | 356 | 45,866 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.4500 | 2036/03/01 | 270 | 280 | 36,049 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.2500 | 2036/09/01 | 290 | 331 | 42,605 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0000 | 2037/02/01 | 530 | 731 | 94,119 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.9500 | 2037/03/01 | 270 | 258 | 33,312 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.9500 | 2038/09/01 | 280 | 349 | 44,911 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2039/08/01 | 430 | 674 | 86,786 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.1000 | 2040/03/01 | 250 | 317 | 40,896 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0000 | 2040/09/01 | 420 | 669 | 86,114 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.8000 | 2041/03/01 | 280 | 295 | 37,963 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.7500 | 2044/09/01 | 340 | 548 | 70,555 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|--------------------|--------------------------|------------|------------|------|-------|-----------|
| | | | | | 千ユーロ | 千円 |
| ユーロ | | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| イタリア | | | | | | |
| 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5000 | 2045/04/30 | 260 | 256 | 33,005 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.2500 | 2046/09/01 | 310 | 412 | 53,015 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.7000 | 2047/03/01 | 330 | 401 | 51,699 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.4500 | 2048/03/01 | 310 | 427 | 55,033 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.8500 | 2049/09/01 | 250 | 368 | 47,470 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.4500 | 2050/09/01 | 300 | 349 | 44,963 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.7000 | 2051/09/01 | 300 | 297 | 38,331 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8000 | 2067/03/01 | 180 | 211 | 27,218 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.1500 | 2072/03/01 | 90 | 88 | 11,435 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.2500 | 2026/11/01 | 200 | 271 | 34,873 |
| 小計 | | - | - | - | - | 4,206,644 |
| フィンランド | | | | | | |
| 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | 1.5000 | 2023/04/15 | 90 | 93 | 11,966 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.0000 | 2023/09/15 | 110 | 111 | 14,362 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2.0000 | 2024/04/15 | 130 | 138 | 17,868 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.0000 | 2024/09/15 | 40 | 40 | 5,255 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 4.0000 | 2025/07/04 | 90 | 105 | 13,584 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.8750 | 2025/09/15 | 130 | 137 | 17,726 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.5000 | 2026/04/15 | 130 | 136 | 17,550 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.0000 | 2026/09/15 | 40 | 41 | 5,282 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.5000 | 2027/09/15 | 130 | 137 | 17,683 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2.7500 | 2028/07/04 | 150 | 182 | 23,419 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.5000 | 2028/09/15 | 40 | 42 | 5,449 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.5000 | 2029/09/15 | 120 | 127 | 16,393 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.0000 | 2030/09/15 | 110 | 111 | 14,375 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.7500 | 2031/04/15 | 80 | 86 | 11,166 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.1250 | 2031/09/15 | 90 | 91 | 11,821 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1.1250 | 2034/04/15 | 90 | 102 | 13,168 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.1250 | 2036/04/15 | 70 | 69 | 8,972 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 0.2500 | 2040/09/15 | 70 | 70 | 9,045 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2.6250 | 2042/07/04 | 110 | 163 | 21,068 |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1.3750 | 2047/04/15 | 70 | 88 | 11,445 |
| FINNISH GOVERNMENT | 0.1250 | 2052/04/15 | 70 | 65 | 8,419 | |
| 小計 | | - | - | - | - | 276,025 |
| オーストリア | | | | | | |
| 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.4000 | 2022/11/22 | 180 | 187 | 24,124 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2023/04/20 | 120 | 121 | 15,608 |

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 | |
|---------------------|--------|------------|------|------|------------|
| | | | | 千ユーロ | 千円 |
| ユーロ | % | | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 |
| オーストリア | | | | | |
| 国債証券 | | | | | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2023/07/15 | 230 | 233 | 29,990 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.7500 | 2023/10/20 | 290 | 304 | 39,166 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2024/07/15 | 20 | 20 | 2,622 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.6500 | 2024/10/21 | 370 | 395 | 50,950 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2025/04/20 | 10 | 10 | 1,314 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.2000 | 2025/10/20 | 280 | 300 | 38,623 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.8500 | 2026/03/15 | 150 | 186 | 23,938 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7500 | 2026/10/20 | 300 | 318 | 41,001 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.5000 | 2027/04/20 | 230 | 242 | 31,143 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.2500 | 2027/07/15 | 150 | 208 | 26,772 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7500 | 2028/02/20 | 200 | 214 | 27,541 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.5000 | 2029/02/20 | 220 | 232 | 29,907 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2030/02/20 | 220 | 222 | 28,686 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2031/02/20 | 200 | 201 | 25,943 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.4000 | 2034/05/23 | 160 | 207 | 26,643 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.2500 | 2036/10/20 | 110 | 110 | 14,216 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.1500 | 2037/03/15 | 280 | 451 | 58,091 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.0000 | 2040/10/20 | 70 | 65 | 8,490 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.1500 | 2044/06/20 | 130 | 212 | 27,333 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5000 | 2047/02/20 | 150 | 191 | 24,593 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7500 | 2051/03/20 | 110 | 119 | 15,355 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.8000 | 2062/01/26 | 80 | 174 | 22,406 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5000 | 2086/11/02 | 50 | 69 | 8,983 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.1000 | 2117/09/20 | 110 | 189 | 24,414 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.8500 | 2120/06/30 | 70 | 68 | 8,877 |
| 小計 | - | - | - | - | 676,743 |
| ユーロ小計 | - | - | - | - | 18,108,610 |
| 合計 | - | - | - | - | 46,032,023 |

投資信託財産の構成

2021年11月22日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 46,032,023 | 98.8 |
| コール・ローン等、その他 | 547,386 | 1.2 |
| 投資信託財産総額 | 46,579,409 | 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22日における邦貨換算レートは、1米ドル114.10円、1カナダ・ドル90.18円、1オーストラリア・ドル82.49円、1シンガポール・ドル83.73円、1イギリス・ポンド153.36円、1イスラエル・シェケル36.874円、1デンマーク・クローネ17.30円、1ノルウェー・クローネ12.77円、1スウェーデン・クローナ12.73円、1メキシコ・ペソ5.473円、1人民元17.842円、1マレーシア・リンギット27.243円、1ポーランド・ズロチ27.436円、1ユーロ128.67円です。

(注2) 外貨建純資産（46,312,944千円）の投資信託財産総額（46,579,409千円）に対する比率は99.4%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年11月22日現在)

| 項目 | | 当期末 |
|-----------------------------|----------|------------------------|
| (A)資産 | 産 | 46,690,899,797円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | | 317,727,504 |
| 公 社 債 (評価額) | | 46,032,023,199 |
| 未 収 入 金 | | 111,540,707 |
| 未 収 利 息 | | 213,297,401 |
| 前 払 費 用 | | 16,310,986 |
| (B)負債 | 債 | 288,522,591 |
| 未 払 金 | | 188,900,317 |
| 未 払 解 約 金 | | 99,622,048 |
| そ の 他 未 払 費 用 | | 226 |
| (C)純 資 産 総 額 (A - B) | | 46,402,377,206 |
| 元 本 | | 30,507,939,274 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | | 15,894,437,932 |
| (D)受 益 権 総 口 数 | | 30,507,939,274口 |
| 1万口当たり基準価額 (C / D) | | 15,210円 |

(注1) 期首元本額 25,985,960,019円
 期中追加設定元本額 6,635,343,992円
 期中一部解約元本額 2,113,364,737円

(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペビエーファンド別内訳は、次の通りです。
 DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型) 2,986,163,468円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) 5,056,378,960円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) 1,880,695,095円
 ニッセイ外国債券インデックス S A (適格機関投資家限定) 794,936,383円
 ニッセイインデックスバランス (債券重視型)
 S A (適格機関投資家限定) 2,894,140円
 ニッセイインデックスバランス (標準型)
 S A (適格機関投資家限定) 9,637,810円
 ニッセイインデックスバランス (成長型)
 S A (適格機関投資家限定) 8,084,024円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券
 インデックスファンド 12,544,184,354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) 2,775,104,707円
 DCニッセイ外国債券インデックス 1,797,970,791円
 DCニッセイターゲットデートファンド2055 129,096,191円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型) 1,394,471,048円
 DCニッセイターゲットデートファンド2045 145,528,684円
 DCニッセイターゲットデートファンド2035 316,245,375円
 DCニッセイターゲットデートファンド2025 70,634,260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) 124,824,289円
 ニッセイ・インデックスパッケージジ
 (内外・株式/リート/債券) 13,130,579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) 36,185,694円
 DCニッセイターゲットデートファンド2060 84,716,044円
 DCニッセイターゲットデートファンド2050 59,442,181円
 DCニッセイターゲットデートファンド2040 127,218,574円
 DCニッセイターゲットデートファンド2030 150,396,623円

損益の状況

当期 (2021年5月21日~2021年11月22日)

| 項目 | 当期 |
|---------------------------------|------------------------|
| (A)配 当 等 収 益 | 403,071,135円 |
| 受 取 利 息 | 403,128,086 |
| 支 払 利 息 | △ 56,951 |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益 | 640,875,335 |
| 売 買 益 | 1,641,562,071 |
| 売 買 損 | △ 1,000,686,736 |
| (C)信 託 報 酬 等 | △ 7,055,568 |
| (D)当 期 損 益 金 (A + B + C) | 1,036,890,902 |
| (E)前 期 繰 越 損 益 金 | 12,555,864,932 |
| (F)追 加 信 託 差 損 益 金 | 3,378,753,828 |
| (G)解 約 差 損 益 金 | △ 1,077,071,730 |
| (H)合 計 (D + E + F + G) | 15,894,437,932 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (H) | 15,894,437,932 |

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

・ T O P I X（東証株価指数）（配当込み）

T O P I X（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、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T O P I Xの商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。なお、当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

・ N O M U R A－B P I 総合

N O M U R A－B P I 総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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

・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

F T S E 世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。