

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。

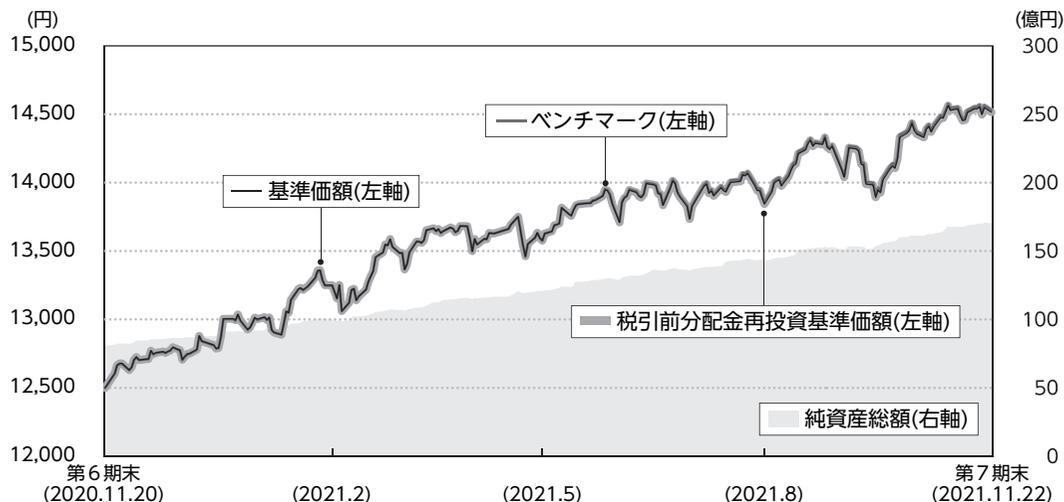
当ファンドは、投資対象の異なる4つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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。

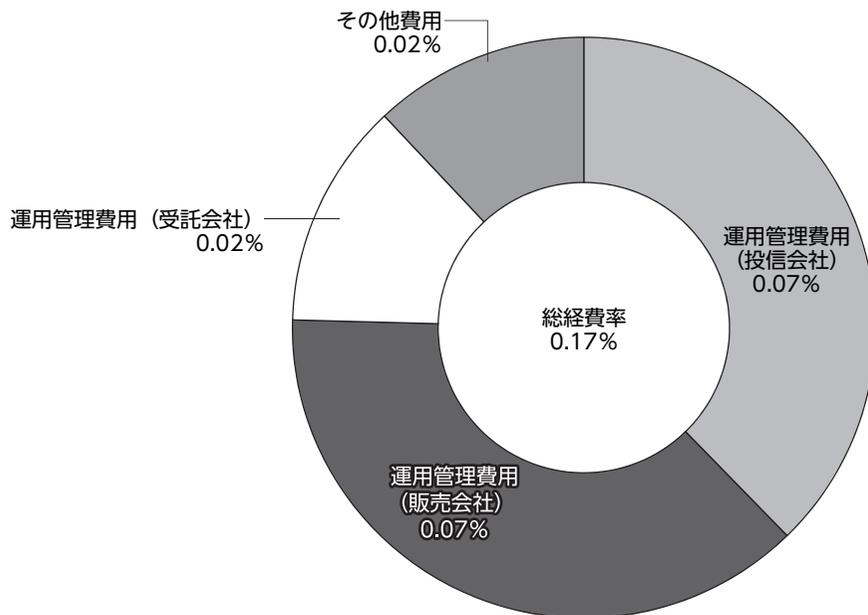
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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）に言及したことから、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F R B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（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が、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、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F R B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E C Bがコロナ危機に対応する資産購入の特別枠（P E P P）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>

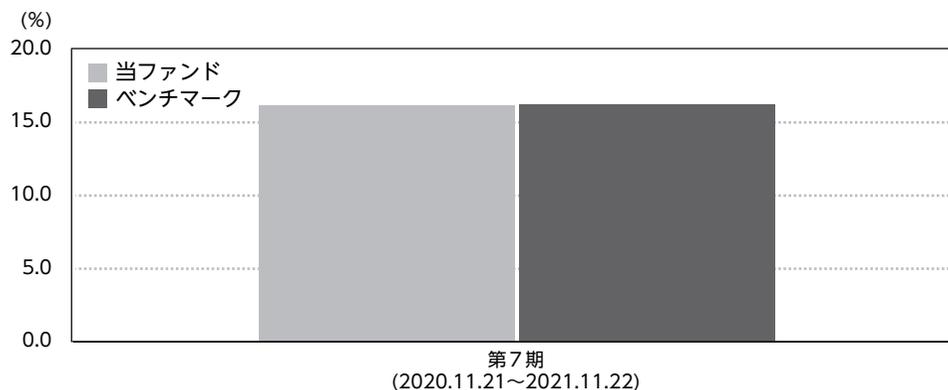
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークであるM S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<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

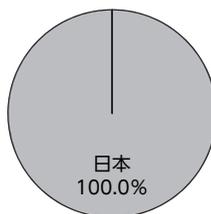
項目	第7期末 2021年11月22日
純資産総額	16,944,062,410円
受益権総口数	11,673,573,356口
1万口当たり基準価額	14,515円

(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。

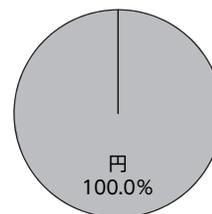
■資産別配分



■国別配分



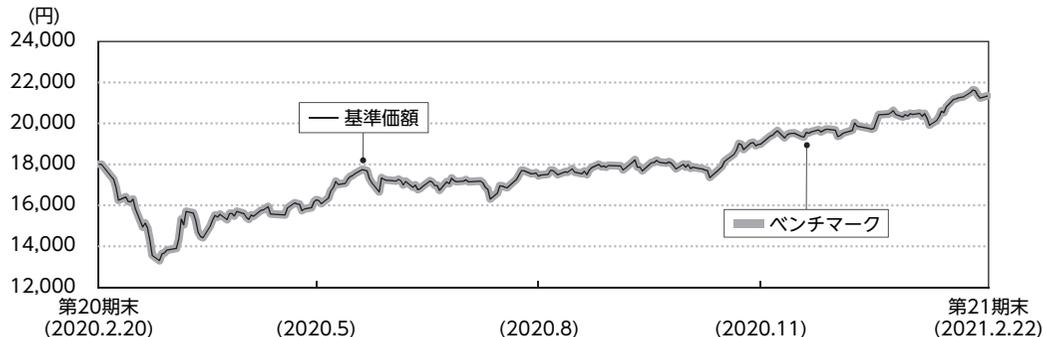
■通貨別配分



(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

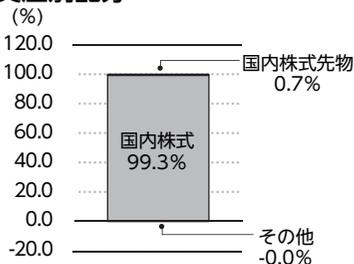
銘柄名	通貨	比率
ソフトバンクグループ	円	3.1%
トヨタ自動車	円	3.1
ソニー	円	2.8
キーエンス	円	2.1
任天堂	円	1.5
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.4
リクルートホールディングス	円	1.4
日本電産	円	1.3
信越化学工業	円	1.3
日本電信電話	円	1.2
組入銘柄数		1,853

■ 1万口当たりの費用明細

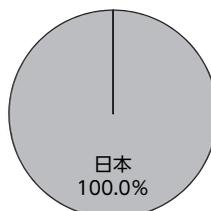
2020.2.21～2021.2.22

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

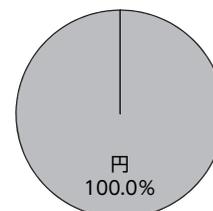
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



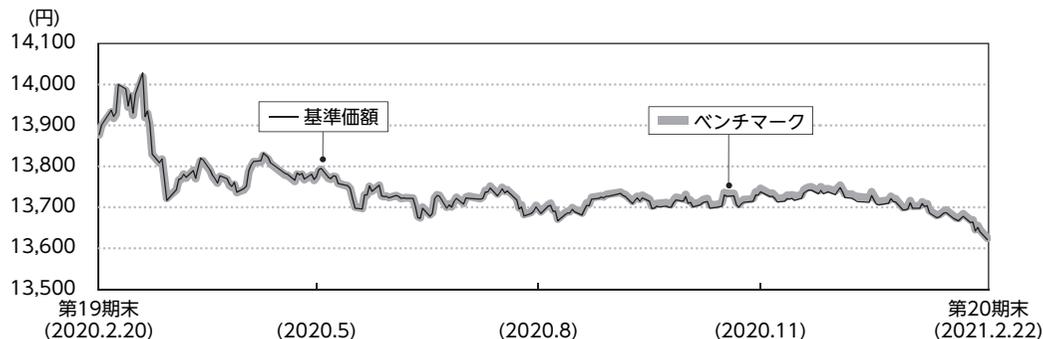
（注1）基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

（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

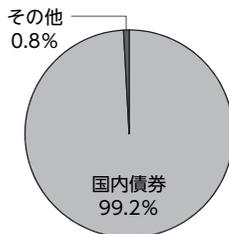
銘柄名	通貨	比率
第325回 利付国債（10年）	円	7.5%
第346回 利付国債（10年）	円	7.5
第354回 利付国債（10年）	円	7.5
第 4 回 利付国債（40年）	円	7.4
第143回 利付国債（5年）	円	7.3
第160回 利付国債（20年）	円	6.1
第338回 利付国債（10年）	円	5.9
第143回 利付国債（20年）	円	5.7
第330回 利付国債（10年）	円	4.4
第125回 利付国債（20年）	円	3.5
組入銘柄数		35

■ 1万口当たりの費用明細

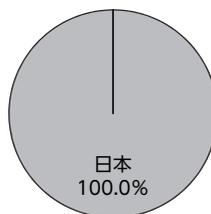
2020.2.21～2021.2.22

項目	金額
その他費用 （その他）	0円 (0)
合計	0

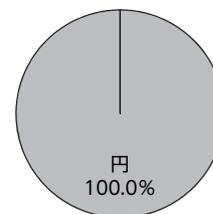
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



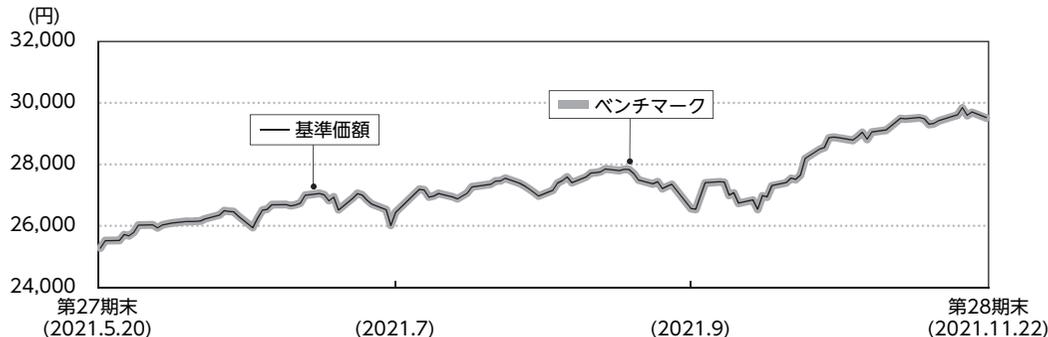
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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

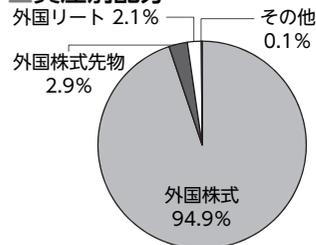
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	4.5%
MICROSOFT CORP	米ドル	4.1%
AMAZON.COM INC	米ドル	2.8%
TESLA, INC.	米ドル	1.6%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.5%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.5%
META PLATFORMS INC-A	米ドル	1.4%
NVIDIA CORP	米ドル	1.4%
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	0.8%
HOME DEPOT INC	米ドル	0.7%
組入銘柄数		1,277

■ 1万口当たりの費用明細

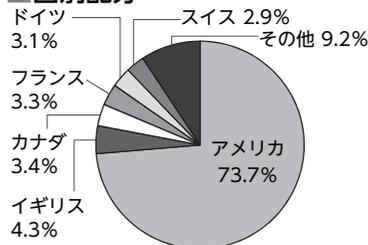
2021.5.21~2021.11.22

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

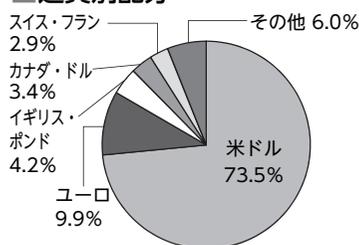
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



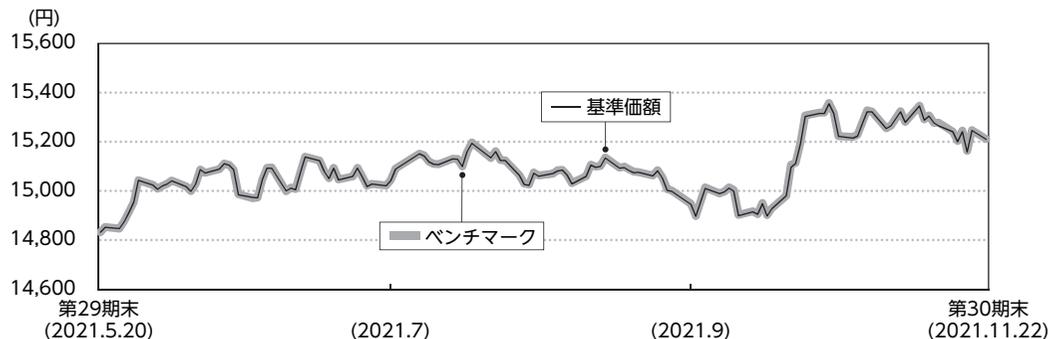
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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

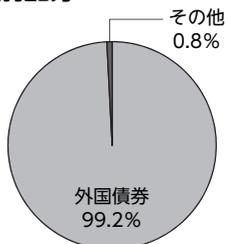
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.5% 2024/5/15	米ドル	1.2%
US TREASURY 2.75% 2024/2/15	米ドル	1.0%
US TREASURY 2.5% 2023/8/15	米ドル	0.9%
US TREASURY 1.75% 2023/5/15	米ドル	0.9%
US TREASURY 0.125% 2023/9/15	米ドル	0.9%
US TREASURY 2.375% 2024/8/15	米ドル	0.9%
US TREASURY 2.0% 2025/8/15	米ドル	0.9%
US TREASURY 2.25% 2025/11/15	米ドル	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

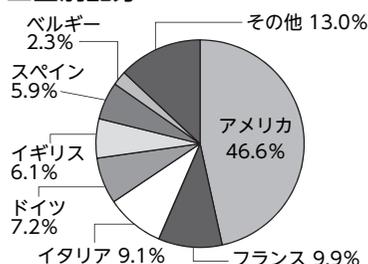
2021.5.21～2021.11.22

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

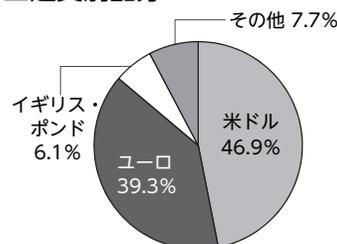
■ 資産別配分



■ 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。



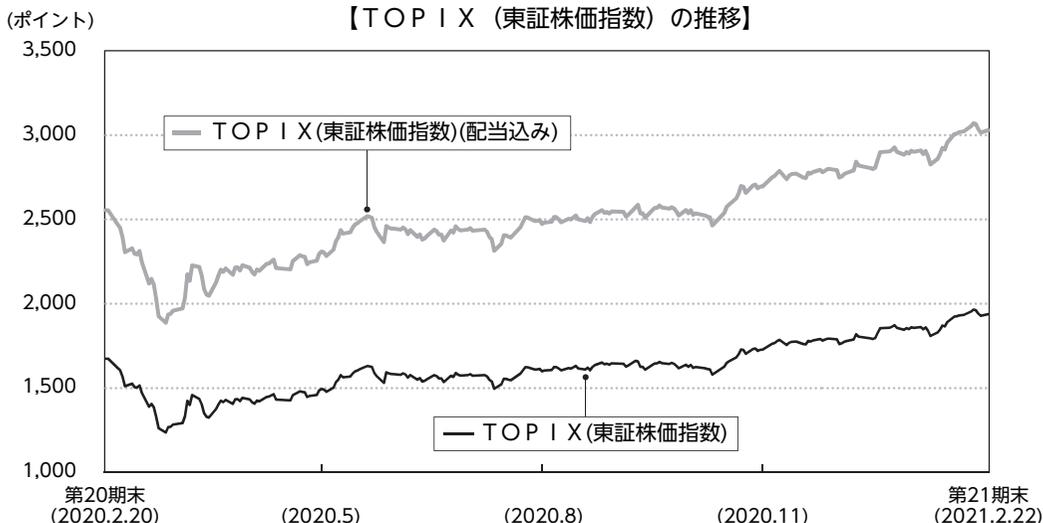
ニッセイアセットマネジメント株式会社

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
N I P P O	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	評価額
	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	評価額
	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
小松マテーレ	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
クラウドシアホールディングス	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
TOYOTIRE	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
	千株	千株	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トッド	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
	千株	千株	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
アールスティ	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	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
アルインコ	2	4	4	4,285
L I X I L	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	株数	評価額
	千株	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	
ペガサスマシン製造	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	
日精イー・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	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	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	
トップパン・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
ピジョン	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
インテー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
オービ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
SCSK	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
J K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
パ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
Mr M a x H D	3	8	6,604
テンアライド	4	12	4,412
A O K I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
ジャパリエルパートナ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



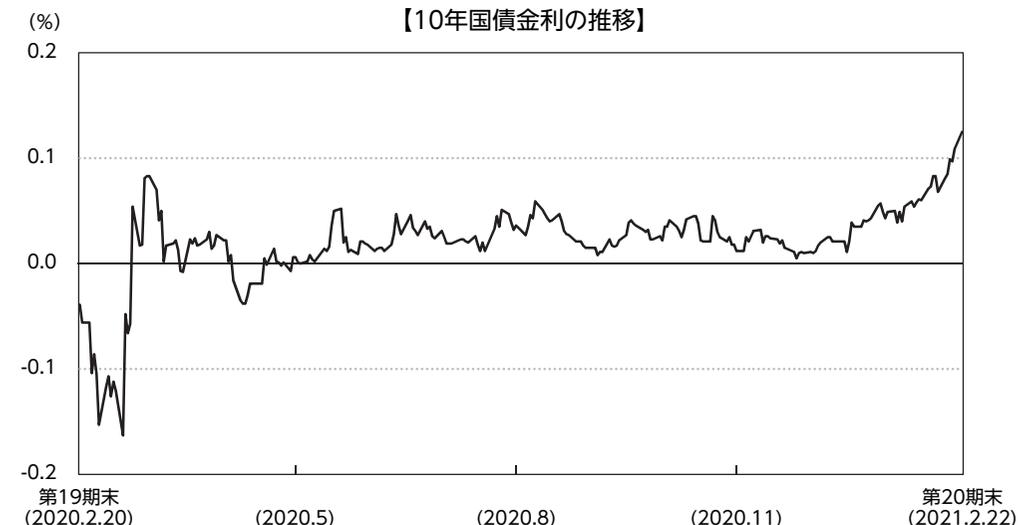
ニッセイアセットマネジメント株式会社

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

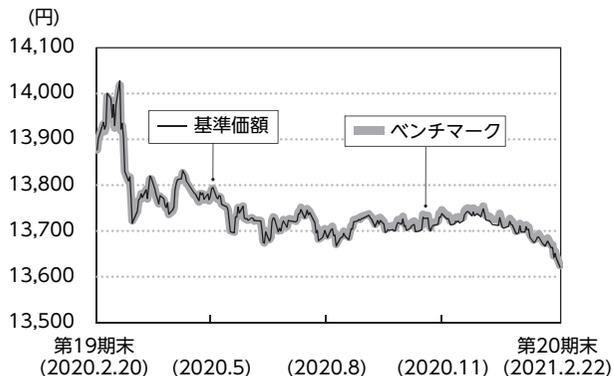


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

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
		%		千円	千円
国債証券	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

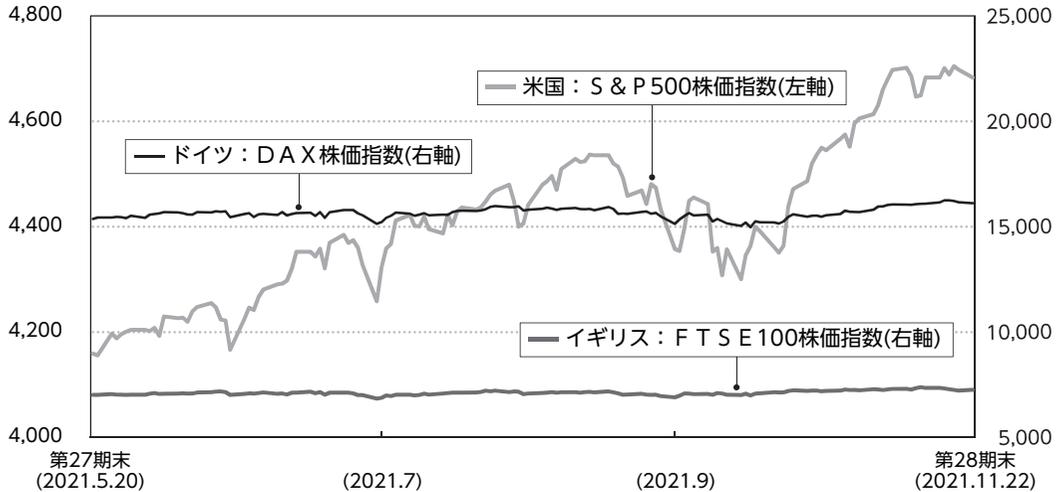
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2021年5月21日～2021年11月22日

海外株式市況

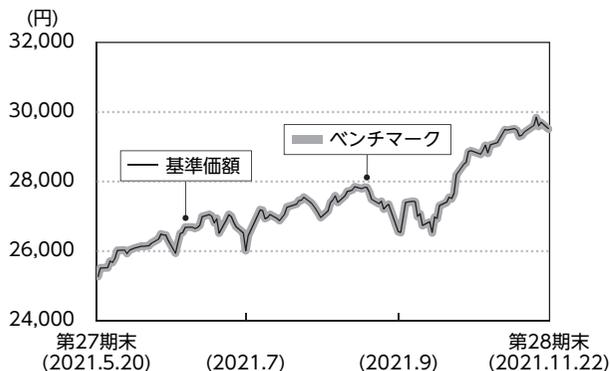
【海外主要株価指数の推移】



(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	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)		千口	千口	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
SOLAREDGE 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 COR-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)				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	3,166	3,545	16,622	612,958	
	銘柄数<比率>	8	8	-	<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		邦貨換算金額
(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 S&P 500 EMINI FUTURE	10,953	—
国 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
コーポレート債等	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ーパーファンド別内訳は、次の通りです。	
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	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
売却益	80,379,882,673
売却損	△ 15,279,300,409
(C)先物取引等損益	2,158,133,009
取引利益	2,281,643,579
取引損	△ 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

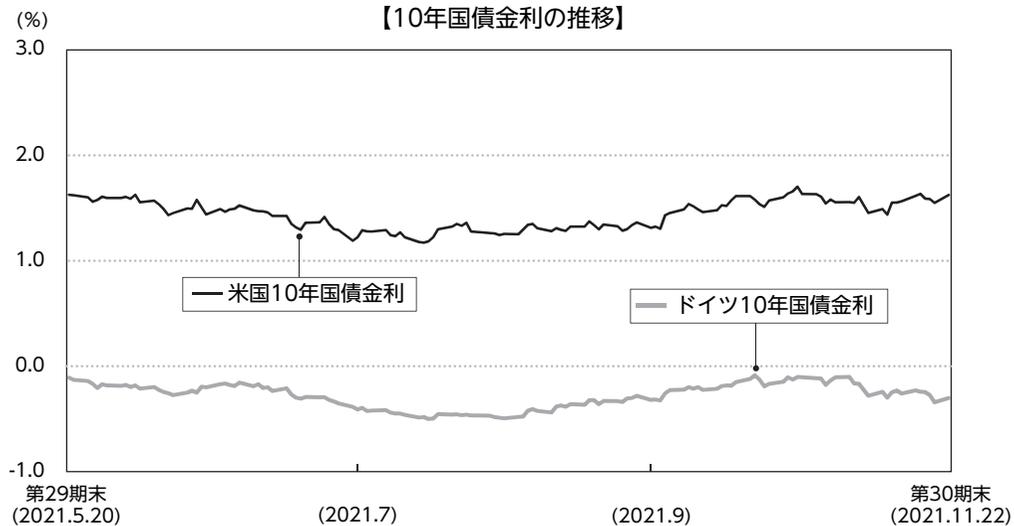
東京都千代田区丸の内1-6-6

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

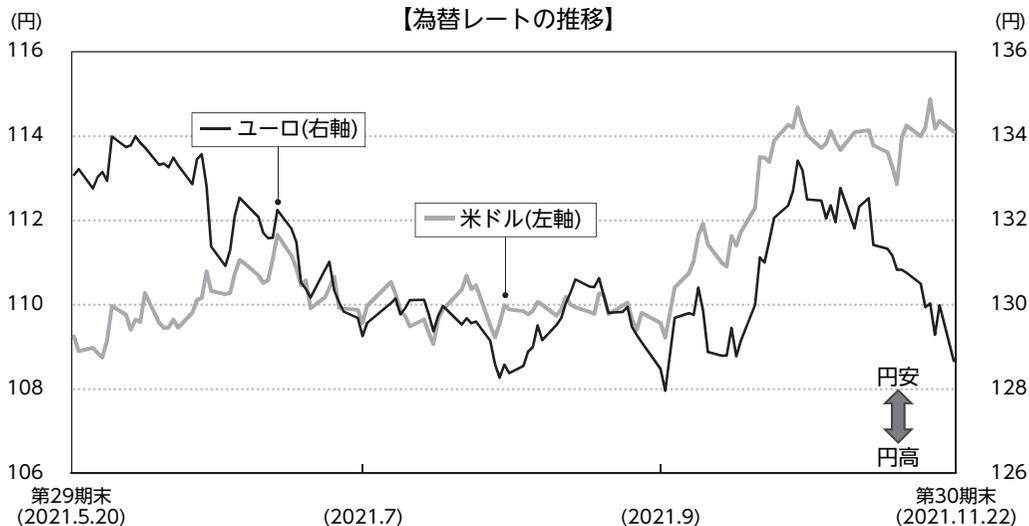


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

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

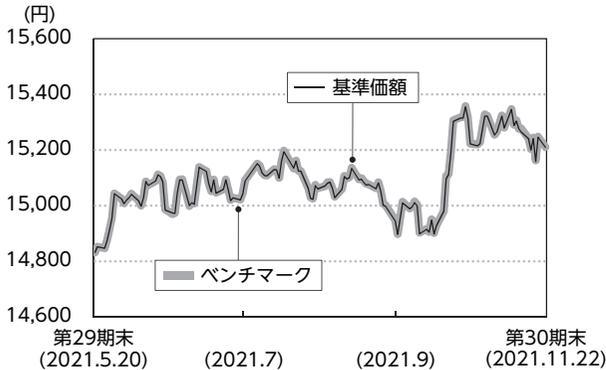


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

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F R B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、E C Bがコロナ危機に対応する資産購入の特別枠(P E P P)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
	円	%		%	%
(期首)2021年5月20日	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・シェケル 1,108	千イスラエル・シェケル 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					
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		-	-	-	-	2,834,442
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	
					千円	千円
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		-	-	-	-
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		-	-	-	-

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		-	-	-	-	1,045,189
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	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ベビーフンド別内訳は、次の通りです。
 DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) 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。