

第8期末 (2021年11月22日)

基準価額	26,076円
純資産総額	3,607億円
騰落率	42.3%
分配金	0円

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

コールセンター **0120-762-506**

(9:00～17:00 土日祝日・年末年始を除く)

ホームページ <https://www.nam.co.jp/>

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



NISSAY
ASSET MANAGEMENT

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

<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

追加型投信／海外／株式／インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2020年11月21日～2021年11月22日

第8期(決算日 2021年11月22日)

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<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」は、このたび第8期の決算を行いました。

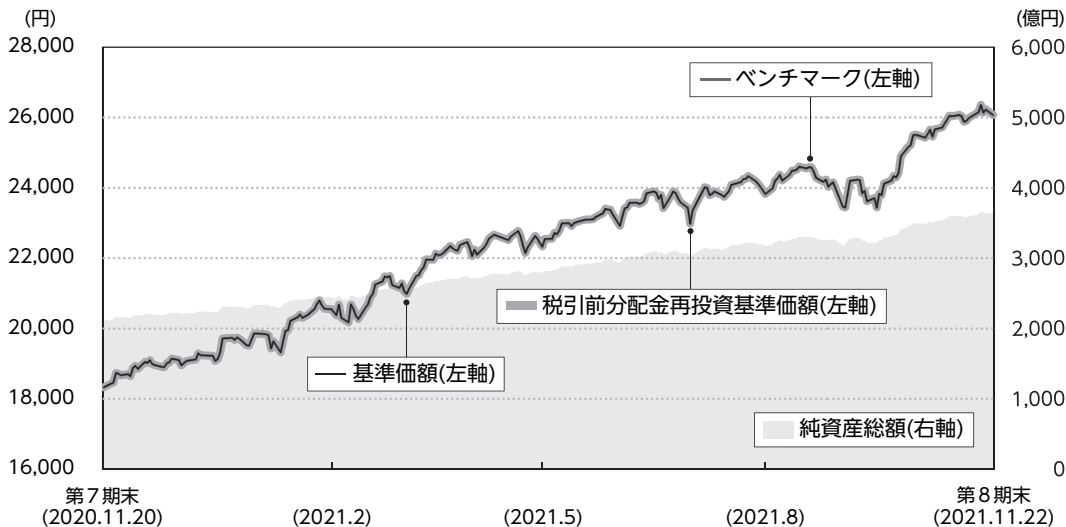
当ファンドは、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

運用経過

2020年11月21日～2021年11月22日

基準価額等の推移



第8期首	18,326円	既払分配金	0円
第8期末	26,076円	騰落率(分配金再投資ベース)	42.3%

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

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

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

■基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・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海外株式市場が下落したこと

1万口当たりの費用明細

項目	第8期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	23円	0.103%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は22,420円です。
(投信会社)	(9)	(0.038)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(9)	(0.042)	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)	(5)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.002	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 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
(株式)	(0)	(0.001)	
(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	2	0.008	$\text{有価証券取引税} = \text{期中の有価証券取引税} / \text{期中の平均受益権口数}$ 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
(株式)	(2)	(0.008)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	10	0.046	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(保管費用)	(5)	(0.021)	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)	(6)	(0.025)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	36	0.160	

(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。

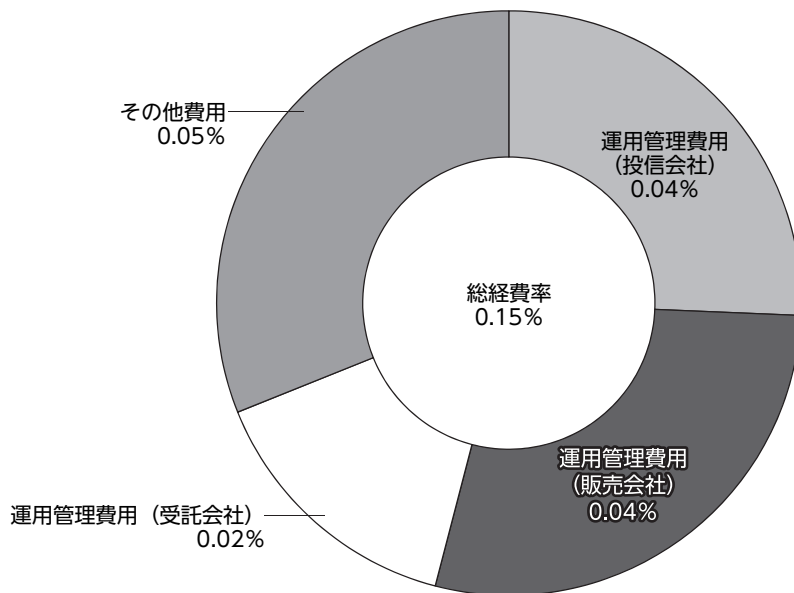
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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0.15%**です。



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

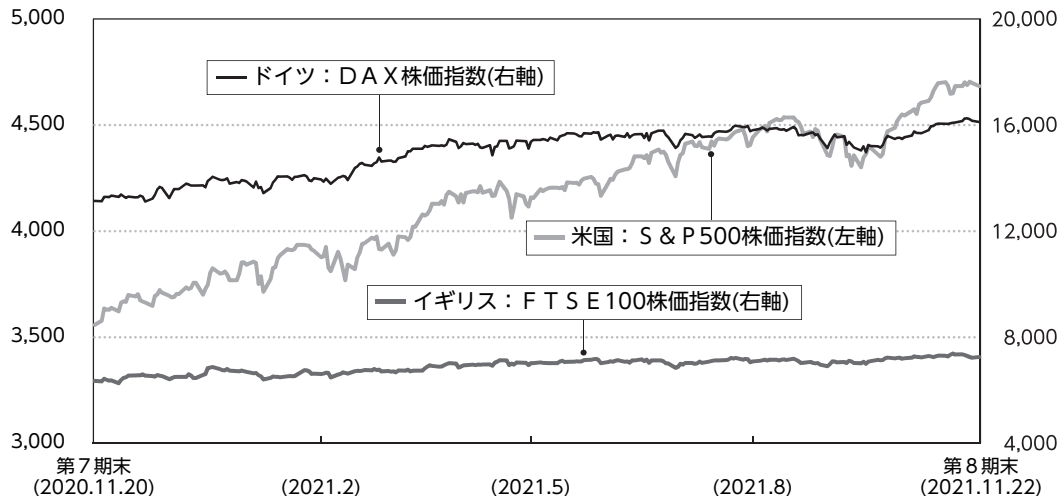
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は、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。

ポートフォリオ

■当ファンド

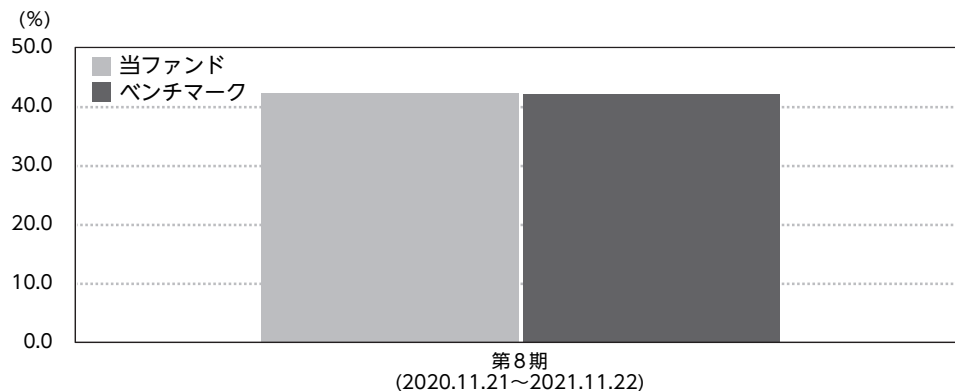
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

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

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

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+42.3%となり、ベンチマーク騰落率（+42.2%）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	16,075円

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

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

今後の運用方針

■当ファンド

マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■マザーファンド

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

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

組入ファンド

	第8期末 2021年11月22日
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	100.0%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

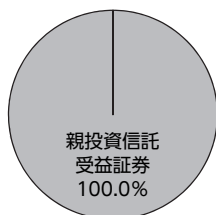
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

純資産等

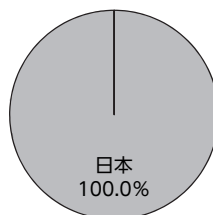
項目	第8期末 2021年11月22日
純資産総額	360,786,307,678円
受益権総口数	138,362,101,590口
1万口当たり基準価額	26,076円

(注) 当期間中における追加設定元本額は44,052,162,526円、同解約元本額は20,129,190,625円です。

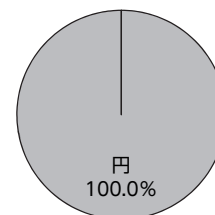
資産別配分



国別配分



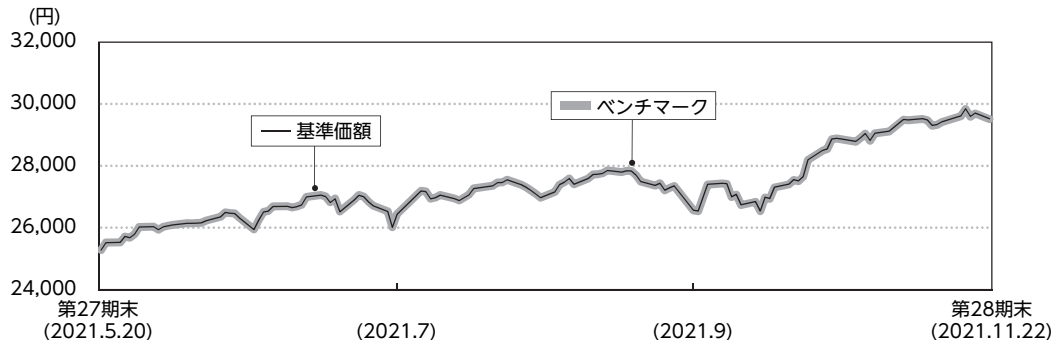
通貨別配分



(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

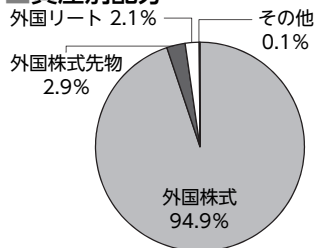
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	4.5%
MICROSOFT CORP	米ドル	4.1%
AMAZON.COM INC	米ドル	2.8%
TESLA, INC.	米ドル	1.6%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.5%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.5%
META PLATFORMS INC-A	米ドル	1.4%
NVIDIA CORP	米ドル	1.4%
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	0.8%
HOME DEPOT INC	米ドル	0.7%
組入銘柄数		1,277

■ 1万口当たりの費用明細

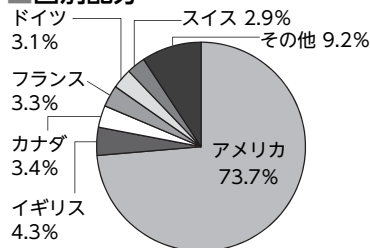
2021.5.21~2021.11.22

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

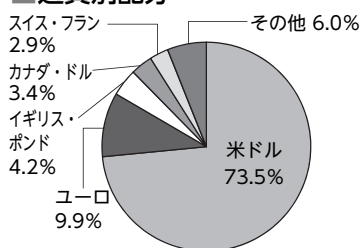
■ 資産別配分



■ 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。

<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

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	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
4期(2017年11月20日)	14,711	0	23.3	14,711	14,834	23.3	94.3	2.1	2.4	68,498
5期(2018年11月20日)	14,973	0	1.8	14,973	15,091	1.7	94.2	3.3	2.4	101,893
6期(2019年11月20日)	16,829	0	12.4	16,829	16,939	12.3	94.4	2.9	2.6	143,238
7期(2020年11月20日)	18,326	0	8.9	18,326	18,418	8.7	94.9	2.8	2.2	209,723
8期(2021年11月22日)	26,076	0	42.3	26,076	26,192	42.2	94.9	2.9	2.1	360,786

(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」、「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	投資信託 証券 組入比率
(期首)2020年11月20日	18,326	-	18,418	-	94.9	2.8	2.2
11月末	18,700	2.0	18,795	2.1	95.6	2.1	2.1
12月末	19,239	5.0	19,336	5.0	94.7	3.1	2.1
2021年1月末	19,635	7.1	19,734	7.1	95.3	2.5	2.1
2月末	20,301	10.8	20,399	10.8	94.4	3.4	2.1
3月末	21,657	18.2	21,757	18.1	94.3	3.5	2.1
4月末	22,669	23.7	22,776	23.7	94.2	3.6	2.1
5月末	23,000	25.5	23,104	25.4	95.2	2.5	2.1
6月末	23,570	28.6	23,681	28.6	94.5	3.2	2.2
7月末	23,899	30.4	24,014	30.4	94.6	3.1	2.2
8月末	24,487	33.6	24,603	33.6	94.4	3.2	2.2
9月末	23,916	30.5	24,025	30.4	95.4	2.2	2.2
10月末	25,664	40.0	25,782	40.0	93.9	3.7	2.2
(期末)2021年11月22日	26,076	42.3	26,192	42.2	94.9	2.9	2.1

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

<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

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
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	38,925,708	98,554,934	17,901,886	44,200,646

(注) 単位未満は切り捨てています。

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	90,016,841千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	375,888,387千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	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
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	101,174,107	122,197,928	360,789,384

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ外国株式インデックスマザーファンド全体の口数は174,007,653千口です。

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	%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	360,789,384	99.9
コール・ローン等、その他	531,994	0.1
投資信託財産総額	361,321,378	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) 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。

(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	361,321,378,357円
コール・ローン等	161,717,218
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	360,789,384,094
未収入金	370,277,045
(B) 負債	535,070,679
未払解約金	367,200,099
未払信託報酬	166,084,642
その他未払費用	1,785,938
(C) 純資産総額(A-B)	360,786,307,678
元本	138,362,101,590
次期繰越損益金	222,424,206,088
(D) 受益権総口数	138,362,101,590口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,076円

(注) 期首元本額 114,439,129,689円
 期中追加設定元本額 44,052,162,526円
 期中一部解約元本額 20,129,190,625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	△ 35,352円
受取利息	2,504
支払利息	△ 37,856
(B) 有価証券売買損益	90,469,551,750
売買益	96,423,287,621
売買損	△ 5,953,735,871
(C) 信託報酬等	△ 292,391,537
(D) 当期損益金(A+B+C)	90,177,124,861
(E) 前期繰越損益金	29,871,474,305
(分配準備積立金)	(29,871,474,305)
(F) 追加信託差損益金*	102,375,606,922
(配当等相当額)	(72,811,409,679)
(売買損益相当額)	(29,564,197,243)
(G) 合計(D+E+F)	222,424,206,088
次期繰越損益金(G)	222,424,206,088
追加信託差損益金	102,375,606,922
(配当等相当額)	(72,910,243,559)
(売買損益相当額)	(29,465,363,363)
分配準備積立金	120,048,599,166

(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	4,438,927,419円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	85,738,197,442円
(c) 信託約款に定める収益調整金	102,375,606,922円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	29,871,474,305円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	222,424,206,088円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	16,075.52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／海外／株式／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。	
主要運用対象	<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	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	日本を除く主要先進国の株式
運用方法	<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	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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

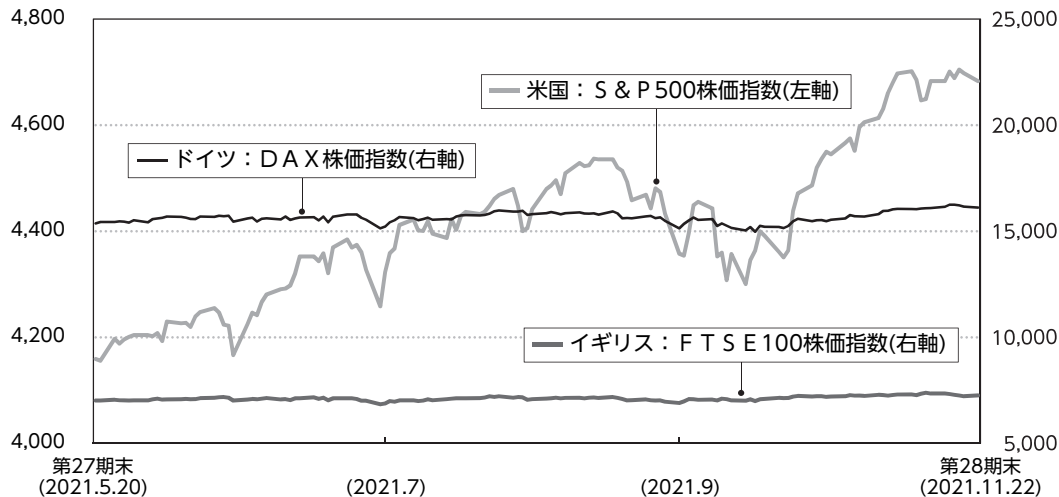
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2021年5月21日～2021年11月22日

海外株式市況

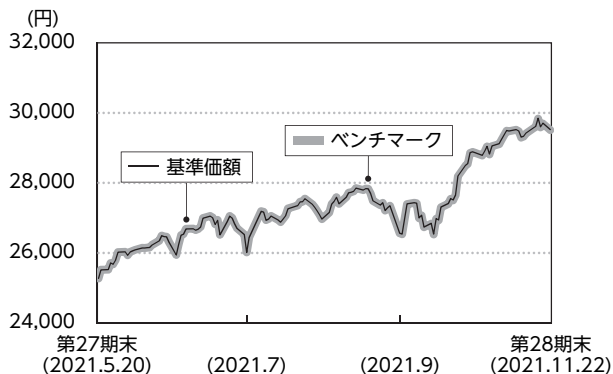
【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバーグ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		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	騰落率	騰落率				
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		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
(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

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
(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
SYNOPSYS 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)				千オーストラリア・ドル		
AFTERPAY LTD		145	165	1,928	159,081	ソフトウェア・サービス
AGL ENERGY LTD		500	577	296	24,419	公益事業
AMP LTD		2,512	-	-	-	各種金融
AMPOL LTD		182	197	596	49,235	エネルギー
ARISTOCRAT LEISURE LTD		402	446	2,005	165,430	消費者サービス
ASX LTD		144	157	1,476	121,809	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD		1,514	1,675	571	47,132	運輸
AUSNET SERVICES		1,624	1,822	466	38,486	公益事業
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP		1,951	2,193	5,988	493,950	銀行
BHP GROUP LIMITED		1,997	2,237	8,156	672,822	素材
BLUESCOPE STEEL LTD		362	403	835	68,956	素材
BRAMBLES LTD		1,067	1,177	1,226	101,136	商業・専門サービス
CIMIC GROUP LIMITED		82	-	-	-	資本財
COCHLEAR LTD		47	52	1,213	100,132	ヘルスケア機器・サービス
COLES GROUP LTD		931	1,048	1,887	155,695	食品・生活必需品小売り
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		1,210	1,352	13,226	1,091,090	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED		389	458	900	74,253	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD		312	332	384	31,682	消費者サービス
CSL LIMITED		309	346	10,926	901,292	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		-	48	601	49,636	消費者サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA		-	1,154	823	67,901	食品・生活必需品小売り
EVOLUTION MINING LTD		1,157	1,460	645	53,238	素材
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,146	1,288	1,993	164,412	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		1,755	1,984	898	74,138	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		311	346	1,897	156,546	素材
MACQUARIE GROUP LTD		238	267	5,568	459,368	各種金融
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		96	118	411	33,943	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD		1,992	2,238	801	66,118	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		2,264	2,552	7,293	601,616	銀行
NEWCREST MINING LIMITED		566	641	1,593	131,477	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		761	868	908	74,954	素材
OIL SEARCH LTD		1,397	1,599	671	55,432	エネルギー
ORICA LTD		338	374	566	46,765	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED		1,308	1,458	729	60,139	公益事業

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	オーストラリアドル	千円	
QANTAS AIRWAYS LTD	708	793	434	35,865	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,054	1,161	1,417	116,910	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	137	151	1,031	85,053	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	39	45	777	64,151	メディア・娯楽
REECE LTD	-	235	533	44,038	資本財
RIO TINTO LTD	253	284	2,566	211,698	素材
SANTOS LTD	1,254	1,511	1,018	84,032	エネルギー
SEEK LTD	246	274	976	80,585	メディア・娯楽
SONIC HEALTHCARE LTD	325	362	1,485	122,575	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	3,443	3,830	1,344	110,908	素材
SUNCORP GROUP LTD	955	1,050	1,158	95,563	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	1,652	1,818	934	77,082	消費者サービス
TELSTRA CORP LTD	3,067	3,449	1,400	115,534	電気通信サービス
TPG TELECOM LTD	322	-	-	-	電気通信サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	504	565	679	56,034	食品・飲料・タバコ
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	80	92	292	24,133	エネルギー
WESFARMERS LIMITED	785	877	5,197	428,703	小売
WESTPAC BANKING CORP	2,472	2,823	6,251	515,654	銀行
WISETECH GLOBAL LTD	103	115	660	54,503	ソフトウェア・サービス
WOODSIDE PETROLEUM LTD	687	770	1,703	140,522	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	871	979	3,939	324,976	食品・生活必需品小売り
XERO LTD	84	103	1,561	128,782	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	48,074 53	52,345 53	112,857 -	9,309,612 <1.8%>
(香港)			千香港ドル		
AIA GROUP LTD	8,150	9,136	77,296	1,132,399	保険
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	208	-	-	-	半導体・半導体製造装置
BANK OF EAST ASIA	914	-	-	-	銀行
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,525	2,825	6,908	101,203	銀行
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,166	1,311	2,720	39,852	食品・飲料・タバコ
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	-	1,506	2,566	37,595	小売
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,759	1,524	6,980	102,261	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,824	2,044	10,649	156,018	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	470	520	2,418	35,423	公益事業
CLP HOLDINGS LTD	1,126	1,246	9,472	138,777	公益事業
ESR CAYMAN LTD	1,244	1,518	4,053	59,377	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,458	1,648	7,622	111,669	消費者サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,391	1,561	2,598	38,067	不動産	
HANG SENG BANK LTD	518	582	8,335	122,121	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,046	1,156	3,902	57,177	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	7,357	8,544	9,979	146,204	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	811	909	42,219	618,509	各種金融	
MTR CORP	1,117	1,247	5,208	76,304	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,099	1,229	4,240	62,125	不動産	
PCCW LTD	3,460	-	-	-	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	950	1,060	5,002	73,279	公益事業	
SANDS CHINA LTD	1,645	1,877	3,657	53,589	消費者サービス	
SINO LAND CO	2,200	2,600	2,592	37,975	不動産	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	-	1,060	2,750	40,297	運輸	
SJM HOLDINGS LTD	1,350	1,570	965	14,145	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	890	995	10,002	146,530	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD	348	398	1,893	27,741	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD	820	938	1,969	28,857	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	925	1,035	17,636	258,373	資本財	
WH GROUP LTD	6,465	7,235	3,769	55,222	食品・飲料・タバコ	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,137	1,287	5,432	79,586	不動産	
WYNN MACAU LTD	1,105	1,333	959	14,060	消費者サービス	
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	1,220	1,380	2,801	41,040	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	56,705 31	61,281 30	266,606 -	3,905,789 <0.8%>	
(シンガポール)			千シンガポール・ドル			
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	-	2,065	695	58,268	不動産	
CAPITALAND LTD	1,890	-	-	-	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	321	333	238	19,991	不動産	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,209	1,360	4,417	369,858	銀行	
GENTING SINGAPORE LTD	3,946	4,449	369	30,918	消費者サービス	
KEPPEL CORP LTD	1,009	1,121	598	50,121	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,264	2,531	2,984	249,854	銀行	
SINGAPORE AIRLINES LTD	935	1,016	539	45,172	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	537	603	566	47,409	各種金融	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	1,063	1,208	477	39,952	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,601	6,354	1,582	132,473	電気通信サービス	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	793	889	2,456	205,666	銀行	
UOL Group Limited	318	355	250	21,014	不動産	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
VENTURE CORP LTD		187	207	400	33,537	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,281	1,444	616	51,626	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	21,354 14	23,935 14	16,193 -	1,355,866 <0.3%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
A2 MILK CO LTD		505	566	367	29,262	食品・飲料・タバコ
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		890	1,007	798	63,686	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		388	436	1,378	109,901	ヘルスケア機器・サービス
MERCURY NZ LTD		463	525	303	24,225	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		864	973	450	35,931	公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD		277	328	426	33,992	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,314	1,487	659	52,538	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,703 7	5,325 7	4,385 -	349,539 <0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
3I GROUP PLC		649	730	1,054	161,749	各種金融
ABRDN PLC		1,481	1,626	412	63,187	各種金融
ADMIRAL GROUP PLC		130	145	434	66,623	保険
ANGLO AMERICAN PLC		823	973	2,768	424,615	素材
ANTOFAGASTA PLC		262	294	415	63,720	素材
ASHTED GROUP PLC		303	338	2,133	327,204	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		239	269	511	78,428	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC		884	1,169	9,918	1,521,150	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTO TRADER GROUP PLC-WI		650	725	533	81,762	メディア・娯楽
AVEVA GROUP PLC		78	91	315	48,341	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC		2,618	2,964	1,161	178,100	保険
BAE SYSTEMS PLC		2,168	2,436	1,376	211,111	資本財
BARCLAYS PLC		11,636	12,774	2,438	374,000	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		688	773	529	81,211	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT		85	83	371	56,913	耐久消費財・アパレル
BHP GROUP PLC		1,418	1,590	2,996	459,488	素材
BP PLC		13,689	15,290	4,992	765,649	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,546	1,645	4,187	642,243	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC		6,028	6,764	1,086	166,604	電気通信サービス
BUNZL PLC		227	254	723	110,919	資本財
BURBERRY GROUP PLC		273	306	592	90,866	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA HBC AG-CDI		135	150	372	57,117	食品・飲料・タバコ

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
COMPASS GROUP PLC	1,201	1,345	1,991	305,374	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	93	105	1,056	162,007	素材
DCC PLC	66	74	433	66,440	資本財
DIAGEO PLC	1,577	1,765	6,848	1,050,257	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	912	1,018	275	42,254	保険
ENTAIN PLC	393	440	844	129,586	消費者サービス
EVRAZ PLC	338	379	223	34,346	素材
EXPERIAN PLC	619	697	2,370	363,609	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	151	168	2,026	310,739	資本財
FRESNILLO PLC	122	-	-	-	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,391	3,804	5,789	887,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	6,724	7,528	2,781	426,511	素材
HALMA PLC	255	285	904	138,781	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARGREAVES LANSDOWN PLC	222	268	402	61,703	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	115	130	300	46,094	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	13,728	15,418	6,656	1,020,806	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	637	714	1,131	173,550	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	1,026	1,142	587	90,085	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	117	139	683	104,868	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	109	122	641	98,329	商業・専門サービス
JD SPORTS FASHION PLC	347	387	452	69,331	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	129	146	326	50,068	素材
KINGFISHER PLC	1,406	1,577	508	78,004	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,031	4,510	1,316	201,829	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	47,693	53,401	2,616	401,295	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	213	248	1,666	255,540	各種金融
M&G PLC	1,763	1,986	384	58,938	各種金融
MELROSE INDUSTRIES PLC	3,289	3,298	525	80,623	資本財
MONDI PLC/WI	325	366	668	102,568	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	1,602	-	-	-	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	2,378	2,691	2,647	406,016	公益事業
NATWEST GROUP PLC	3,263	4,349	959	147,160	銀行
NEXT PLC	89	100	831	127,461	小売
NMC HEALTH PLC	47	47	0.005	0.728	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	328	369	700	107,382	食品・生活必需品小売り
PEARSON PLC	505	567	357	54,865	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	215	241	673	103,298	耐久消費財・アパレル

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	386	507	334	51,297	保険
PRUDENTIAL PLC	1,757	1,974	2,865	439,431	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	481	540	3,375	517,606	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,304	1,462	3,460	530,743	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,255	1,410	889	136,406	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	754	845	3,766	577,559	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	5,677	6,329	860	132,014	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,758	3,106	4,999	766,669	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,498	2,787	4,489	688,462	エネルギー
RSA INSURANCE GROUP PLC	690	-	-	-	保険
SAGE GROUP PLC	740	812	649	99,609	ソフトウェア・サービス
SAINSBURY (J) PLC	1,181	1,245	364	55,877	食品・生活必需品小売り
SCHRODERS PLC	82	92	337	51,686	各種金融
SEVERN TRENT PLC	164	190	534	82,042	公益事業
SMITH & NEPHEW PLC	588	664	848	130,151	ヘルスケア機器・サービス
SMITHS GROUP PLC	268	301	450	69,109	資本財
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	49	55	923	141,602	資本財
SSE PLC	705	790	1,262	193,604	公益事業
ST JAMES'S PLACE PLC	361	406	631	96,882	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC	1,800	1,994	900	138,123	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	2,462	2,774	433	66,498	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	5,212	5,825	1,624	249,100	食品・生活必需品小売り
UNILEVER PLC	1,772	1,979	7,617	1,168,175	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	465	517	546	83,799	公益事業
VODAFONE GROUP PLC	18,144	21,288	2,418	370,873	電気通信サービス
WHITBREAD PLC	135	152	458	70,327	消費者サービス
WPP PLC	834	912	1,005	154,193	メディア・娯楽
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	197,995 86	220,211 83	135,957 -	20,850,490 <4.1%>
(イスラエル)			千イスラエル・シケル		
AZRIELI GROUP	29	32	996	36,728	不動産
BANK HAPOALIM BM	764	851	2,562	94,473	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	967	1,084	3,336	123,015	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	18	20	958	35,351	資本財
ICL GROUP LTD	468	528	1,558	57,468	素材
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	778	872	1,666	61,447	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	96	106	1,226	45,209	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
NICE LTD		42	47	4,319	159,265	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	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	4,533	75,584	965,212	
		11	11	-	<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	14,203	70,927	9,126,278	
		28	29	-	<1.8%>	
(ユーロ/ベルギー)						
AGEAS	116	131	620	79,831	保険	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	514	575	2,985	384,107	食品・飲料・タバコ	
ARGENX SE	30	34	881	113,362	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT NV	34	39	167	21,519	食品・生活必需品小売り	
ELIA GROUP SA/NV	21	24	248	32,005	公益事業	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	76	85	860	110,720	各種金融	
KBC GROEP NV	167	187	1,406	180,951	銀行	
PROXIMUS	107	121	198	25,552	電気通信サービス	
SOFINA	10	11	458	59,026	各種金融	
SOLVAY SA	50	55	583	75,041	素材	
UCB SA	85	95	977	125,719	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE		132	148	660	84,972	素材
小計	株数・金額	1,346	1,510	10,047	1,292,811	
	銘柄数<比率>	12	12	-	<0.3%>	
(ユーロ/ルクセンブルグ)						
ARCELORMITTAL		481	535	1,415	182,130	素材
TENARIS SA		310	344	326	42,037	エネルギー
小計	株数・金額	791	879	1,742	224,167	
	銘柄数<比率>	2	2	-	<0.0%>	
(ユーロ/フランス)						
ACCOR		124	128	376	48,505	消費者サービス
ADP		22	26	283	36,476	運輸
AIR LIQUIDE		319	357	5,486	705,954	素材
ALSTOM RGPT		179	239	794	102,206	資本財
AMUNDI SA		41	46	350	45,140	各種金融
ARKEMA		46	45	557	71,760	素材
ATOS SE		66	74	289	37,246	ソフトウェア・サービス
AXA SA		1,300	1,456	3,665	471,650	保険
BIOMERIEUX		27	31	380	48,965	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS		756	846	4,885	628,666	銀行
BOLLORE		617	669	330	42,559	メディア・娯楽
BOUYGUES		155	173	536	68,988	資本財
BUREAU VERITAS SA		202	223	664	85,452	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA		108	120	2,606	335,425	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA		410	458	727	93,555	食品・生活必需品小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN		343	382	2,329	299,786	資本財
CNP ASSURANCES		113	129	279	35,922	保険
CREDIT AGRICOLE SA		775	880	1,098	141,371	銀行
DANONE		417	493	2,770	356,459	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA		1	18	166	21,415	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA		89	499	2,810	361,676	ソフトウェア・サービス
EDENRED		168	187	819	105,426	ソフトウェア・サービス
EDF		420	351	443	57,028	公益事業
EIFFAGE		57	65	559	71,979	資本財
ENGIE		1,233	1,381	1,811	233,048	公益事業
ESSILORLUXOTTICA		192	215	4,168	536,404	耐久消費財・アパレル
EURAZEO		27	29	231	29,769	各種金融
EUROFINS SCIENTIFIC		90	100	1,109	142,756	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
FAURECIA	79	88	409	52,630	自動車・自動車部品
GETLINK SE - REGR	322	362	477	61,437	運輸
HERMES INTERNATIONAL	21	23	4,002	515,036	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	10	-	-	-	電気通信サービス
IPSEN	25	28	252	32,537	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KERING	51	56	4,057	522,098	耐久消費財・アパレル
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	56	70	304	39,170	消費者サービス
LEGRAND SA	180	201	1,973	253,975	資本財
L'OREAL SA	169	190	8,088	1,040,780	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	187	209	15,368	1,977,438	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	113	127	1,752	225,534	自動車・自動車部品
NATIXIS	636	-	-	-	各種金融
ORANGE S.A.	1,360	1,536	1,483	190,921	電気通信サービス
ORPEA	35	39	340	43,751	ヘルスケア機器・サービス
PERNOD-RICARD	141	158	3,353	431,481	食品・飲料・タバコ
PUBLICIS GROUPE	150	167	1,005	129,372	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	15	16	327	42,098	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	130	144	476	61,289	自動車・自動車部品
SAFRAN SA	215	258	2,915	375,122	資本財
SANOFI	763	856	7,612	979,558	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	18	20	1,045	134,514	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	362	406	6,555	843,507	資本財
SCOR REGROUPE	106	119	323	41,678	保険
SEB SA	16	20	288	37,093	耐久消費財・アパレル
SOCIETE GENERALE	546	607	1,751	225,426	銀行
SODEXO	59	66	523	67,366	消費者サービス
SUEZ	233	266	524	67,433	公益事業
TELEPERFORMANCE	39	44	1,617	208,146	商業・専門サービス
THALES SA	71	79	625	80,506	資本財
TOTALENERGIES SE	1,697	1,884	7,896	1,016,074	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT	62	69	318	41,029	メディア・娯楽
VALEO SA	155	173	492	63,400	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	364	415	1,206	155,252	公益事業
VINCI SA	353	403	3,577	460,278	資本財
VIVENDI SA	559	536	592	76,293	メディア・娯楽
WENDEL	19	20	228	29,449	各種金融

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
WORLDLINE SA		160	179	900	115,884	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,801 65	19,484 63	123,207 -	15,853,171 <3.1%>	
(ユーロ/ドイツ)						
ADIDAS AG		128	143	4,061	522,534	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE		277	310	6,302	810,914	保険
AROUNDTOWN SA		689	772	462	59,483	不動産
BASF SE		618	693	4,271	549,603	素材
BAYER AG		663	742	3,574	459,912	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		223	250	2,331	300,016	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		38	42	329	42,435	自動車・自動車部品
BECHTLE AG		18	61	397	51,186	ソフトウェア・サービス
BEIERSDORF AG		67	75	709	91,267	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG SE		103	115	924	119,009	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		26	30	565	72,699	ヘルスケア機器・サービス
COMMERZBANK AG		668	752	503	64,800	銀行
CONTINENTAL AG		74	83	878	113,032	自動車・自動車部品
COVESTRO AG		122	145	817	105,126	素材
DAIMLER AG		575	644	5,790	745,013	自動車・自動車部品
DELIVERY HERO SE		87	122	1,572	202,293	小売
DEUTSCHE BANK AG		1,324	1,556	1,684	216,752	各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG		127	143	2,118	272,547	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG		201	228	138	17,784	運輸
DEUTSCHE POST AG		672	753	4,302	553,665	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG		2,255	2,529	4,169	536,447	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		231	-	-	-	不動産
E.ON SE		1,532	1,702	1,877	241,581	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG		139	157	435	56,001	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA		281	314	1,123	144,588	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD		45	51	219	28,300	素材
GEA GROUP AG		103	114	519	66,782	資本財
HANNOVER RUECK SE		40	45	725	93,346	保険
HEIDELBERGCEMENT AG		99	112	717	92,370	素材
HELLOFRESH SE		99	124	1,170	150,608	食品・生活必需品小売り
HENKEL AG & CO KGAA		70	79	560	72,107	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG		118	133	1,006	129,473	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG		18	-	-	-	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ/ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	880	986	4,258	547,933	半導体・半導体製造装置	
KION GROUP AG	48	54	549	70,750	資本財	
KNORR-BREMSE AG	49	55	510	65,708	資本財	
LANXESS	54	62	344	44,299	素材	
LEG IMMOBILIEN SE	49	54	711	91,543	不動産	
MERCK KGAA	86	97	2,151	276,796	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	35	40	728	93,731	資本財	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	94	105	2,609	335,820	保険	
NEMETSCHKE SE	39	43	489	62,994	ソフトウェア・サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	101	114	942	121,261	自動車・自動車部品	
PUMA AG	66	79	917	118,052	耐久消費財・アパレル	
RATIONAL AG	3	3	333	42,847	資本財	
RWE AG	431	483	1,585	203,942	公益事業	
SAP SE	703	787	9,917	1,276,062	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG	23	19	1,136	146,217	ヘルスケア機器・サービス	
SCOUT24 SE	72	65	424	54,560	メディア・娯楽	
SIEMENS AG	515	577	8,959	1,152,824	資本財	
SIEMENS ENERGY AG	269	301	732	94,244	資本財	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	180	212	1,408	181,276	ヘルスケア機器・サービス	
SYMRISE AG	86	97	1,268	163,160	素材	
TEAMVIEWER AG	108	121	158	20,432	ソフトウェア・サービス	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	761	832	199	25,680	電気通信サービス	
UNIPER SE	135	69	262	33,762	公益事業	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	71	74	256	32,987	電気通信サービス	
VOLKSWAGEN AG	22	24	687	88,411	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG	125	140	2,533	325,935	自動車・自動車部品	
VONOVIA SE	365	414	2,308	297,003	不動産	
ZALANDO SE	102	167	1,431	184,146	小売	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,230 61	19,121 59	102,075 -	13,134,079 <2.6%>	
(ユーロ/ポルトガル)						
EDP RENOVAVEIS SA	-	216	484	62,316	公益事業	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,860	2,102	1,004	129,270	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	337	381	323	41,592	エネルギー	
JERONIMO MARTINS	164	186	359	46,273	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,362 3	2,886 4	2,171 -	279,453 <0.1%>	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
	SNAM SPA	1,349	1,509	757	97,423	公益事業
	TELECOM ITALIA SPA	9,842	11,964	413	53,264	電気通信サービス
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	948	1,062	713	91,789	公益事業
	UNICREDIT SPA	1,433	1,599	1,754	225,729	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	36,479 20	41,819 20	23,463 -	3,019,101 <0.6%>	
(ユーロ/フィンランド)						
	ELISA OYJ	98	109	587	75,615	電気通信サービス
	FORTUM OYJ	297	336	839	108,020	公益事業
	KESKO OYJ-B SHS	183	203	580	74,657	食品・生活必需品小売り
	KONE OYJ	229	256	1,604	206,457	資本財
	NESTE OYJ	283	317	1,433	184,414	エネルギー
	NOKIA OYJ	3,803	4,059	2,117	272,522	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
	ORION OYJ-CLASS B	71	79	291	37,519	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
	SAMPO OYJ	317	376	1,646	211,907	保険
	STORA ENSO OYJ	388	435	651	83,866	素材
	UPM-KYMMENE OYJ	358	400	1,294	166,561	素材
	WARTSILA OYJ	302	355	452	58,269	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,333 11	6,931 11	11,500 -	1,479,811 <0.3%>	
(ユーロ/オーストリア)						
	ERSTE GROUP BANK AG	189	211	809	104,176	銀行
	OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	45	51	438	56,456	公益事業
	OMV AG	97	109	536	69,053	エネルギー
	RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	98	110	289	37,274	銀行
	VOESTALPINE AG	77	85	261	33,593	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	507 5	567 5	2,335 -	300,555 <0.1%>	
(ユーロ/その他)						
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	143	154	861	110,880	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	143 1	154 1	861 -	110,880 <0.0%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	126,422 232	143,406 230	382,183 -	49,175,587 <9.6%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	737,902 1,221	824,822 1,220	- -	487,369,676 <94.9%>	

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)		千□	千□	千カナダ・ドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		5	6	374	33,781
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		10	11	270	24,409
小計	□数・金額	16	18	645	58,191
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル	
DEXUS		82	—	—	—
GPT GROUP		142	158	817	67,433
GOODMAN GROUP		115	129	3,181	262,425
STOCKLAND		167	189	832	68,634
MIRVAC GROUP		288	319	897	74,046
VICINITY CENTRES		280	316	554	45,708
SCENTRE GROUP		360	408	1,282	105,823
DEXUS/AU		—	89	992	81,897
小計	□数・金額	1,437	1,612	8,558	705,969
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		140	157	11,251	164,831
小計	□数・金額	140	157	11,251	164,831
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		218	253	770	64,474
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		305	378	828	69,403
SUNTEC REIT		127	—	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		198	228	447	37,466
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		147	163	349	29,224
小計	□数・金額	996	1,023	2,395	200,569
	銘柄数<比率>	5	4	—	<0.0%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		59	66	350	53,806
LAND SECURITIES GROUP PLC		47	53	396	60,750
SEGRO PLC		80	90	1,263	193,735
小計	□数・金額	187	209	2,010	308,292
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	□数	□数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	
KLEPIERRE	13	15	307	39,600	
GECINA SA	3	3	409	52,667	
COVIVIO	3	3	281	36,282	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	9	9	584	75,203	
小計	□数・金額	28	32	1,583	203,754
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
合計	□数・金額	3,614	3,958	—	11,043,955
	銘柄数<比率>	58	57	—	<2.1%>

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2021年11月22日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	487,369,676	94.7
投資信託証券	11,043,955	2.1
コール・ローン等、その他	16,003,837	3.1
投資信託財産総額	514,417,469	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月22日における邦貨換算レートは、1米ドル114.10円、1カナダ・ドル90.18円、1オーストラリア・ドル82.49円、1香港ドル14.65円、1シンガポール・ドル83.73円、1ニュージーランド・ドル79.71円、1イギリス・ポンド153.36円、1イスラエル・シェケル36.874円、1スイス・フラン122.82円、1デンマーク・クローネ17.30円、1ノルウェー・クローネ12.77円、1スウェーデン・クローナ12.73円、1ユーロ128.67円です。

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

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年11月22日現在)

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

(注1) 期首元本額	155,354,575,597円
期中追加設定元本額	29,466,550,805円
期中一部解約元本額	10,813,472,903円
(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペビーフンド別内訳は、次の通りです。	
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	773,420,733円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,492,406,987円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,922,862,164円
ニッセイ外国株式インデックスA(適格機関投資家限定)	1,788,512,420円
ニッセイアジア/ラフランス(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 他 収 益	3,599,200
支 払 利 息	△ 1,912,620
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	65,100,582,264
売 買 損 益	80,379,882,673
売 買 損 益	△ 15,279,300,409
(C)先 物 取 引 等 損 益	2,158,133,009
取 引 損 益	2,281,643,579
取 引 損 益	△ 123,510,570
(D)信 託 報 酬 等	△ 125,901,736
(E)当期損益金(A+B+C+D)	70,473,495,202
(F)前期繰越損益金	237,295,715,915
(G)追加信託差損益金	50,909,923,587
(H)解約差損益金	△ 18,924,824,866
(I)合 計(E+F+G+H)	339,754,309,838
次 期 繰 越 損 益 金(I)	339,754,309,838

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

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