

第9期末 (2022年11月21日)

基準価額	27,035円
純資産総額	4,377億円
騰落率	3.7%
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:2021年11月23日～2022年11月21日

第9期(決算日 2022年11月21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9期の決算を行いました。

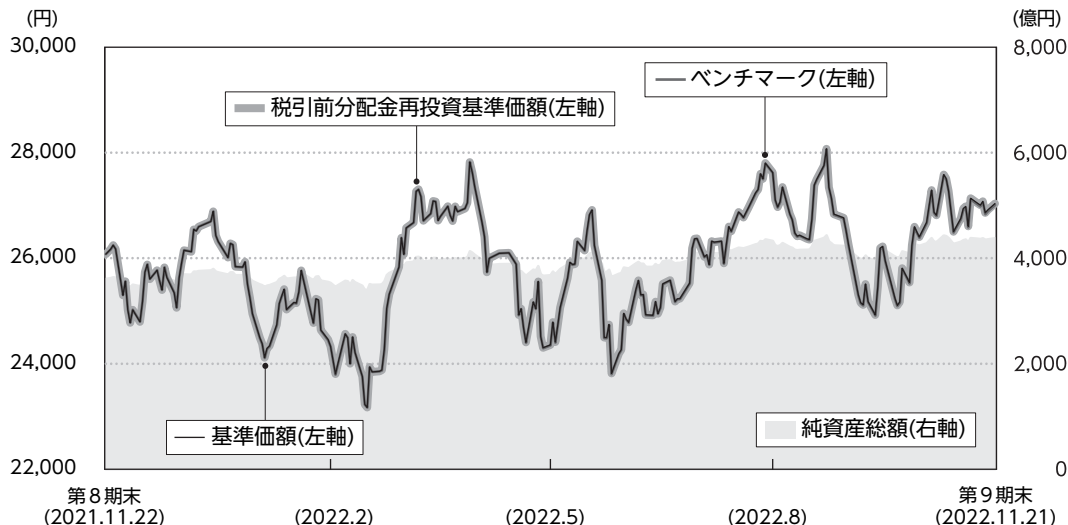
当ファンドは、「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

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

2021年11月23日～2022年11月21日

基準価額等の推移



第9期首	26,076円	既払分配金	0円
第9期末	27,035円	騰落率(分配金再投資ベース)	3.7%

(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>

- ・2022年7月から8月中旬における米景気の軟着陸(ソフトランディング)期待や、10月以降の米利上げペース鈍化への期待感を受けて海外株式市場が上昇したこと
- ・期を通じて世界的に金融緩和縮小が進み、内外金利差の拡大などから円安が進んだこと

<下落要因>

- ・2022年2月に発生したロシアによるウクライナ侵攻や、5月から6月にかけて世界の主要な中央銀行が相次いで利上げを実施したことを受けて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9期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	26円	0.102%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は25,866円です。
(投信会社)	(10)	(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)	(11)	(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)	(6)	(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	1	0.002	
(株式)	(0)	(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
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.005	
(株式)	(1)	(0.005)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	7	0.027	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)	(5)	(0.020)	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)	(2)	(0.007)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	35	0.137	

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

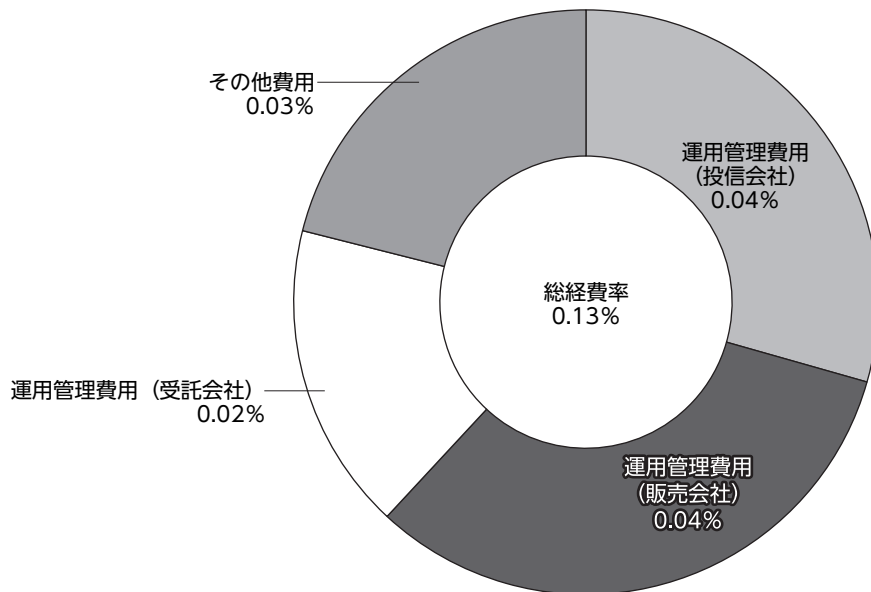
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(参考情報)

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.13%**です。



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

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

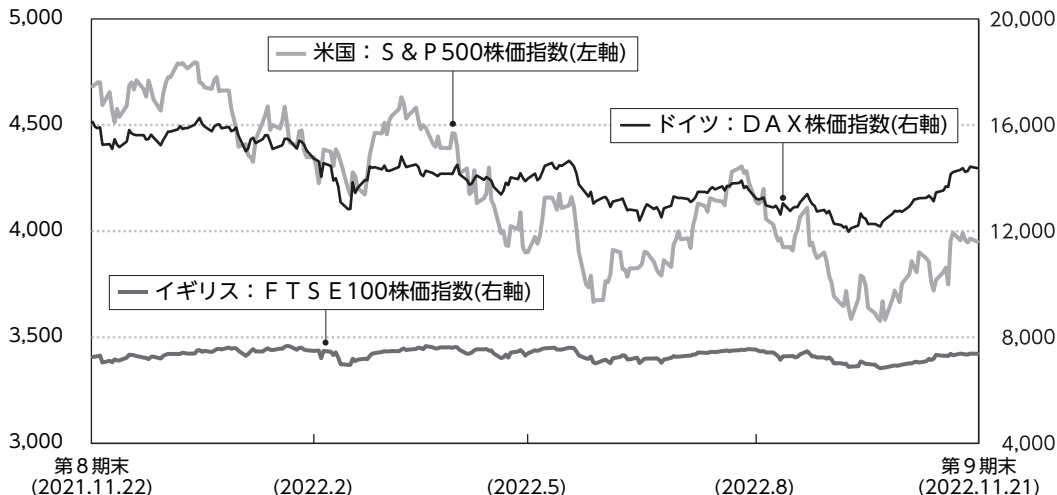
(注3) 各比率は年率換算した値です。

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

投資環境

■海外株式市況

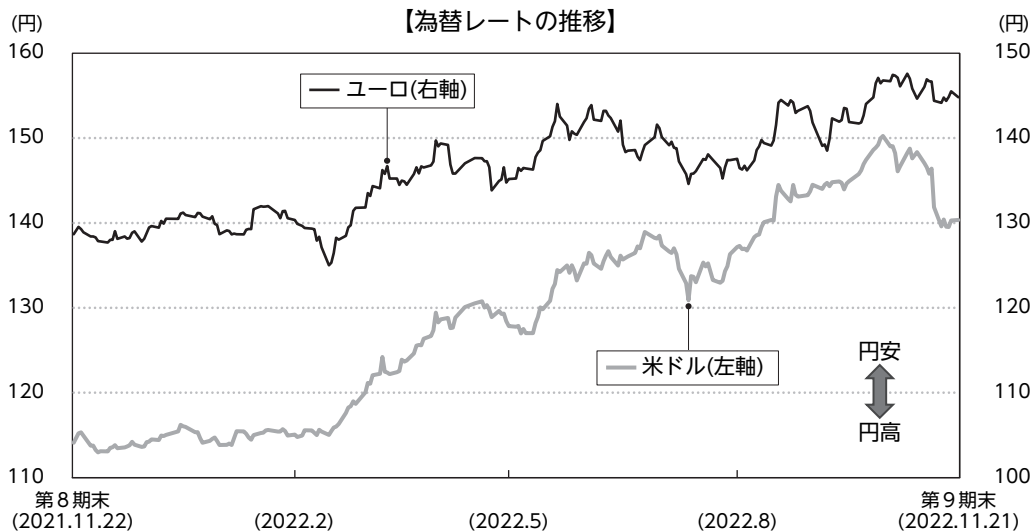
【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は、期初以降、米金融政策の引き締め懸念やロシアによるウクライナ侵攻を背景に下落基調で推移しました。3月中旬から6月にかけては、堅調な経済指標やコモディティ価格上昇の一服を受けて一時上昇する場面もありましたが、中国の都市封鎖（ロックダウン）や世界の主要な中央銀行が相次いで利上げを実施したことを懸念し下落しました。7月から8月中旬にかけては、米金融政策・景気のソフトランディング期待から上昇しましたが、8月下旬から9月にかけては、ジャクソンホール会議におけるパウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長の金融引き締めに関する積極的なスタンスが警戒されたことや米消費者物価指数（CPI）が市場予想を上回ったことから米金融引き締めの長期化が懸念され、下落しました。その後は、イギリスにおける政治的混乱が沈静化したことや、10月の米CPIの上昇ペースが市場予想を下回り米利上げペース鈍化への期待感が高まったことを受けて株式市場は上昇しましたが、結局、前期末と比較すると下落して当期末を迎えました。

■為替市況



(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、米国が物価上昇を背景に金融引き締め姿勢であった一方で、国内においては金融緩和を維持したことから日米金利差が拡大し、3月から10月にかけて大幅な米ドル高円安基調となりました。11月は米利上げペースの鈍化観測を受けてやや米ドル安円高となりましたが、結局、期初を上回る水準（米ドル高円安）で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、2022年2月中旬から3月上旬にかけてウクライナ情勢の緊迫からリスク回避的な動きとなりユーロ安となりましたが、その後はECBの金融引き締め姿勢を背景にユーロ高に転じました。7月にはロシアからの天然ガス供給の不透明感による景気減速懸念等を受けて一時ユーロ安となる場面がありましたが、その後はECBによる積極的な利上げ観測が高まり、再びユーロ高となりました。11月は小幅にユーロ安に転じましたが、結局、期初を上回る水準（ユーロ高円安）で当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

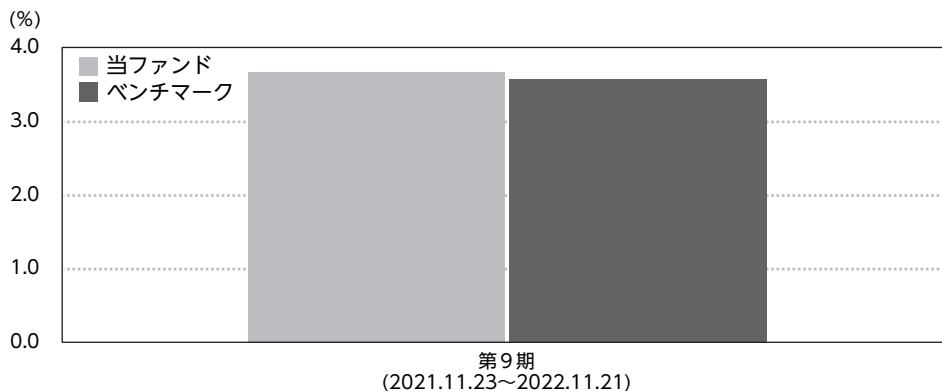
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

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

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

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+3.7%となり、ベンチマーク騰落率（+3.6%）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
	2021年11月23日～2022年11月21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	17,035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9期末 2022年11月21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。

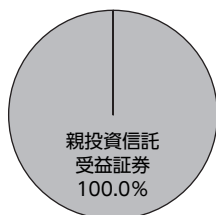
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

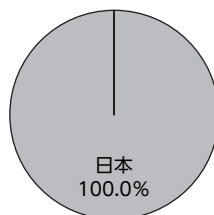
項目	第9期末 2022年11月21日
純資産総額	437,730,061,915円
受益権総口数	161,912,324,116口
1万口当たり基準価額	27,035円

(注) 当期間中における追加設定元本額は39,071,401,582円、同解約元本額は15,521,179,056円です。

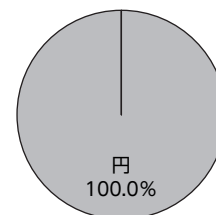
■資産別配分



■国別配分



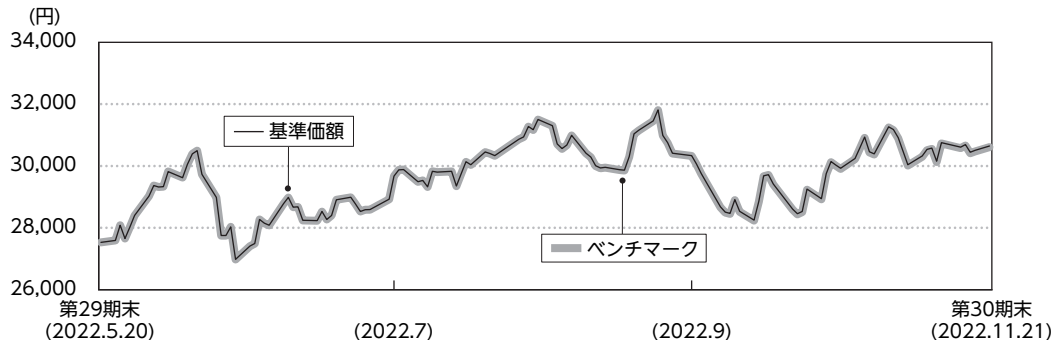
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2022年11月21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

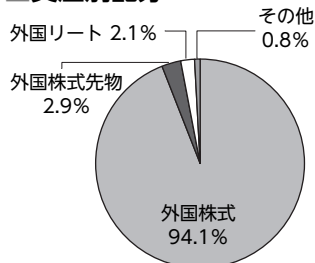
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	4.9%
MICROSOFT CORP	米ドル	3.4%
S&P 500 EMINI FUTURE 202212 買	米ドル	2.2%
AMAZON.COM INC	米ドル	1.7%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.2%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.1%
UNITEDHEALTH GROUP INC	米ドル	1.0%
TESLA, INC.	米ドル	1.0%
EXXON MOBIL CORP	米ドル	0.9%
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	0.9%
組入銘柄数		1,271

■ 1万口当たりの費用明細

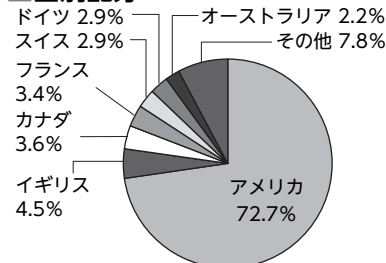
2022.5.21~2022.11.21

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

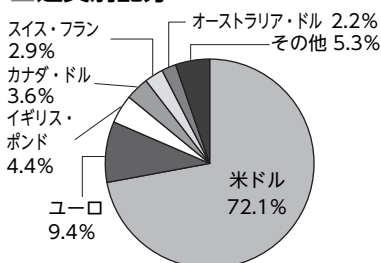
■ 資産別配分



■ 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(2022年11月21日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	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
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
9期(2022年11月21日)	27,035	0	3.7	27,035	27,130	3.6	94.1	2.9	2.1	437,730

(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) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注5) 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)2021年11月22日	26,076	-	26,192	-	94.9	2.9	2.1
11月末	25,560	△2.0	25,677	△2.0	95.4	2.4	2.2
12月末	26,595	2.0	26,718	2.0	95.0	2.7	2.3
2022年1月末	24,739	△5.1	24,840	△5.2	93.9	3.8	2.2
2月末	24,566	△5.8	24,668	△5.8	93.7	3.8	2.2
3月末	27,166	4.2	27,288	4.2	94.0	3.7	2.3
4月末	25,997	△0.3	26,115	△0.3	95.3	2.0	2.5
5月末	25,921	△0.6	26,030	△0.6	94.5	3.1	2.3
6月末	25,310	△2.9	25,416	△3.0	93.7	3.7	2.3
7月末	26,302	0.9	26,413	0.8	94.5	3.0	2.4
8月末	26,478	1.5	26,590	1.5	93.3	4.3	2.3
9月末	25,177	△3.4	25,278	△3.5	94.4	3.3	2.2
10月末	27,585	5.8	27,692	5.7	95.0	2.6	2.2
(期末)2022年11月21日	27,035	3.7	27,130	3.6	94.1	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

2021年11月23日～2022年11月21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	34,489,982	100,625,642	13,838,399	40,655,220

(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	118,486,232千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	519,363,072千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.22

(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

2021年11月23日～2022年11月21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

2022年11月21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	122,197,928	142,849,511	437,733,758

(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196,274,174千口です。

<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

投資信託財産の構成

2022年11月21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	437,733,758	99.9
コール・ローン等、その他	593,666	0.1
投資信託財産総額	438,327,424	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21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1カナダ・ドル104.82円、1オーストラリア・ドル93.41円、1香港ドル17.95円、1シンガポール・ドル102.07円、1ニュージーランド・ドル86.21円、1イギリス・ポンド166.59円、1イスラエル・シェケル40.408円、1スイス・フラン147.10円、1デンマーク・クローネ19.47円、1ノルウェー・クローネ13.74円、1スウェーデン・クローナ13.18円、1ユーロ144.81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（589,615,254千円）の投資信託財産総額（606,882,149千円）に対する比率は97.2%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

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
(A) 資産	438,327,424,488円
コール・ローン等	207,257,177
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	437,733,758,028
未収入金	386,409,283
(B) 負債	597,362,573
未払解約金	382,701,562
未払信託報酬	212,377,329
その他未払費用	2,283,682
(C) 純資産総額(A-B)	437,730,061,915
元本	161,912,324,116
次期繰越損益金	275,817,737,799
(D) 受益権総口数	161,912,324,116口
1万口当たり基準価額(C/D)	27,035円

- (注) 期首元本額 138,362,101,590円
 期中追加設定元本額 39,071,401,582円
 期中一部解約元本額 15,521,179,056円

損益の状況

当期(2021年11月23日~2022年11月21日)

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 44,473円
受取利息	2,992
支払利息	△ 47,465
(B) 有価証券売買損益	17,092,438,843
売買益	18,558,948,188
売買損	△ 1,466,509,345
(C) 信託報酬等	△ 602,594,114
(D) 当期損益金(A+B+C)	16,689,800,256
(E) 前期繰越損益金(分配準備積立金)	108,219,313,441
(F) 追加信託差損益金*(配当等相当額)(売買損益相当額)	150,908,624,102
(G) 合計(D+E+F)	275,817,737,799
次期繰越損益金(G)	275,817,737,799
追加信託差損益金(配当等相当額)(売買損益相当額)	150,908,624,102
分配準備積立金	124,909,113,697

- (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	6,759,666,105円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	9,930,134,151円
(c) 信託約款に定める収益調整金	150,908,624,102円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	108,219,313,441円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	275,817,737,799円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	17,035.01円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■運用体制の変更について

運用部門については、CO-CIO（取締役執行役員、統括部長）の2名体制からCIO（取締役執行役員）1名とCO-CIO（統括部長）1名の体制に変更しました。

新たにCIOが就任し、従来のCO-CIOのうちの1名（統括部長）が、引き続きCO-CIOを務めています。（2022年3月25日）

■約款変更

信託金の限度額を引き上げたことに伴い、関連条項に所要の変更を行いました。

（2022年2月19日）

■関連会社の実質保有比率

2022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3.6%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 30 期

(計算期間：2022年5月21日～2022年11月21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

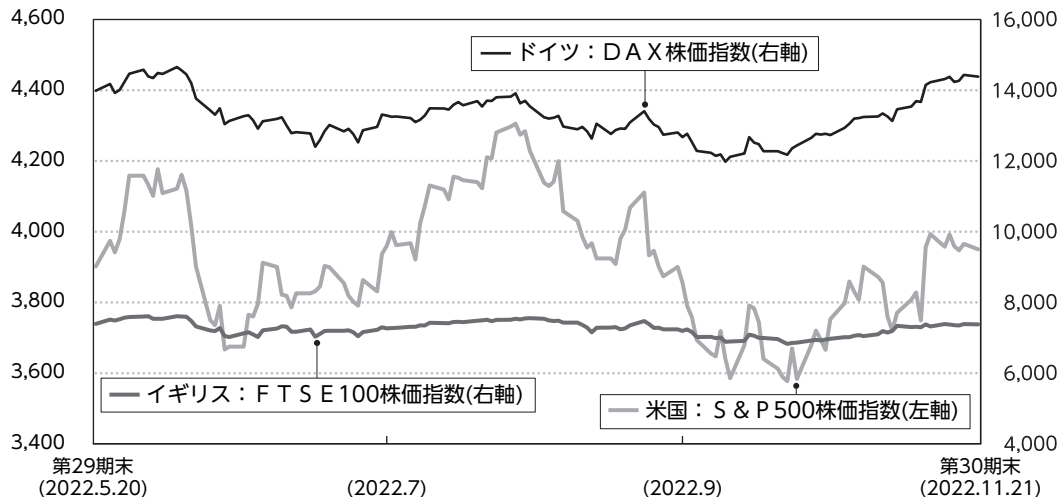
運用経過

2022年5月21日～2022年11月21日

投資環境

■ 海外株式市況

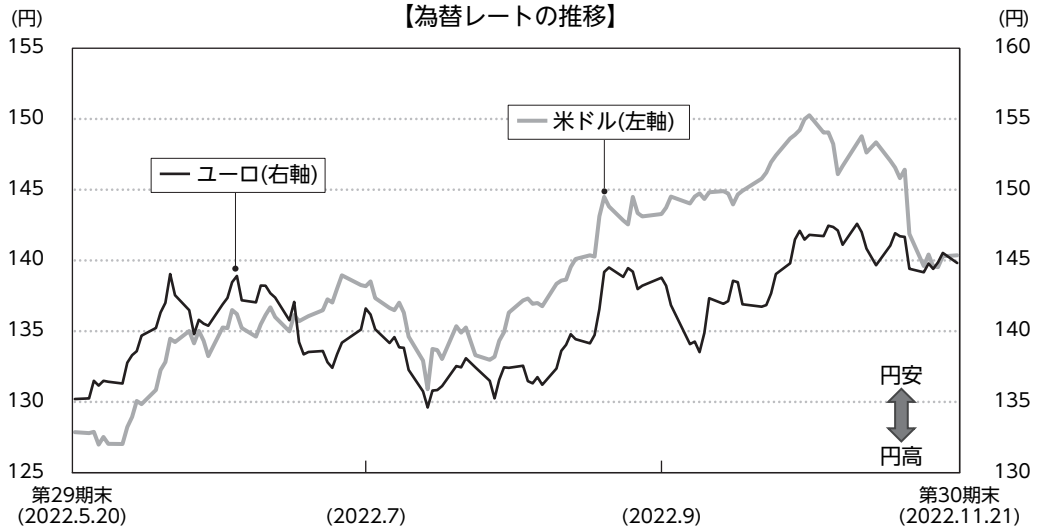
【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は、米金融政策の急激な引き締め観測の後退から一時上昇する場面もありましたが、期初から6月にかけては世界の主要な中央銀行が相次いで利上げを実施したことを懸念し下落しました。7月から8月中旬にかけては、米金融政策・景気の軟着陸（ソフトランディング）期待から上昇しましたが、8月下旬から9月にかけては、ジャクソンホール会議におけるパウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長の金融引き締めに積極的なスタンスが警戒されたことや、米消費者物価指数（CPI）が市場予想を上回ったことから米金融引き締めの長期化が懸念され、下落しました。その後は、イギリスにおける政治的混乱が沈静化したことや、10月の米CPIの上昇ペースが市場予想を下回り米利上げペース鈍化への期待感が高まったことを受けて株式市場は上昇基調となり、結局、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

■為替市況

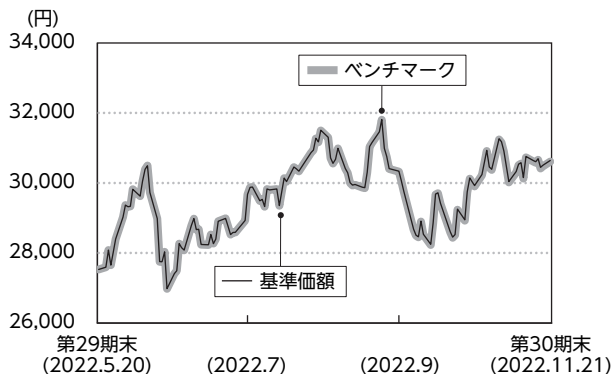


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは、米国が物価上昇を背景に金融引き締め姿勢であった一方で、国内においては金融緩和を維持したことから日米金利差が拡大し、期初から10月にかけて大幅なドル高円安基調となりました。11月は米利上げペースの鈍化観測を受けてややドル安円高となりましたが、結局、期初を上回る水準（米ドル高円安）で当期末を迎えました。

当期のユーロ／円レートは、欧州中央銀行（ECB）の金融引き締め姿勢を背景にユーロ高基調で始まりましたが、7月にはロシアからの天然ガス供給の不透明感による景気減速懸念等を受けて一時ユーロ安となりました。その後は再びECBによる利上げ観測が高まったことからユーロ高となり、11月は小幅ユーロ安に転じましたが、結局、期初を上回る水準（ユーロ高円安）で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・ 7月から8月中旬における米景気のソフトランディング期待や、10月以降の米利上げペース鈍化への期待感を受けて海外株式市場が上昇したこと
- ・ 期を通じて世界的に金融緩和縮小が進み、内外金利差の拡大などから円安が進んだこと

<下落要因>

- ・ 期初から6月にかけて世界の主要な中央銀行が相次いで利上げを実施したことや、8月下旬から9月における米金融引き締め長期化懸念を受けて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+11.3%となり、ベンチマーク騰落率(+11.2%)にほぼ連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
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
29期(2022年5月20日)	27,529	△ 6.8	26,838	△ 6.8	94.8	2.8	2.3	510,207
30期(2022年11月21日)	30,643	11.3	29,840	11.2	94.1	2.9	2.1	601,452

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%
(期首)2022年5月20日	27,529	-	26,838	-	94.8	2.8	2.3
5月末	29,366	6.7	28,630	6.7	94.5	3.1	2.3
6月末	28,676	4.2	27,954	4.2	93.7	3.7	2.3
7月末	29,802	8.3	29,052	8.2	94.5	3.0	2.4
8月末	30,005	9.0	29,246	9.0	93.3	4.3	2.3
9月末	28,533	3.6	27,803	3.6	94.4	3.3	2.2
10月末	31,264	13.6	30,458	13.5	95.0	2.6	2.2
(期末)2022年11月21日	30,643	11.3	29,840	11.2	94.1	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

2022年5月21日～2022年11月21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 (株式)	1	0.003	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用 (保管費用)	3	0.011	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.001)	
			・ 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	4	0.014	

(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（29,639円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2022年5月21日～2022年11月21日

(1) 株式

	買付		売付		
	株数	金額	株数	金額	
外国	アメリカ	百株 26,220 (19,680)	千米ドル 239,053 (△ 109)	百株 10,687	千米ドル 84,813
	カナダ	3,471 (841)	千カナダ・ドル 17,108	1,347	千カナダ・ドル 6,778
	オーストラリア	5,193 (2,884)	千オーストラリア・ドル 11,510	3,925	千オーストラリア・ドル 4,054
	香港	5,589	千香港ドル 21,852	1,454	千香港ドル 5,507
	シンガポール	2,423	千シンガポール・ドル 1,567	626	千シンガポール・ドル 449
	ニュージーランド	453	千ニュージーランド・ドル 315	464	千ニュージーランド・ドル 436
	イギリス	16,803 (3,599)	千イギリス・ポンド 10,803 (△ 194)	7,198	千イギリス・ポンド 3,890
	イスラエル	2,584	千イスラエル・シェケル 5,109	139	千イスラエル・シェケル 497
	スイス	1,501 (70)	千スイス・フラン 10,138 (△ 18)	453	千スイス・フラン 3,564
	デンマーク	308	千デンマーク・クローネ 15,057	253	千デンマーク・クローネ 8,597
	ノルウェー	711	千ノルウェー・クローネ 19,117	275	千ノルウェー・クローネ 5,065
	スウェーデン	4,055 (1,645)	千スウェーデン・クローナ 55,966	3,819	千スウェーデン・クローナ 22,546

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	95	515	28	157
		オランダ	1,331	4,784 (△ 56)	640	2,090
		ベルギー	178 (25)	1,457	117	444
		ルクセンブルグ	56	92	95	233
		フランス	1,688 (456)	9,159 (△ 38)	859	3,852
		ドイツ	1,924	7,636 (△ 40)	696	3,164
		ポルトガル	271	211	73	57
		スペイン	2,952 (28)	2,684 (2)	931	782
		イタリア	3,650	1,843 (△ 3)	962	546
		フィンランド	632	860	197	317
		オーストリア	42	156	131	200
		その他	13	53	3	11

(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	87	0.283	20
CROWN CASTLE INC	3	494	0.827	112
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	256	0.296	43
PROLOGIS INC	5	645	1	200
	(15)			
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	32	220	0.832	17
	(△ 112)			
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.987	190	0.266	44
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.806	101	0.394	50
DUKE REALTY CORP	2	137	—	0.065
	(△ 33)			
EQUITY RESIDENTIAL	2	185	0.681	41
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.459	118	0.124	26
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3	100	1	25
WELLTOWER INC	4	362	0.866	59
HOST HOTELS AND RESORTS INC	4	86	1	25
KIMCO REALTY CORP	4	97	1	25
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.828	136	0.218	34
PUBLIC STORAGE	1	353	0.301	87
REGENCY CENTERS CORP	1	71	0.293	18
SIMON PROPERTY GROUP INC	2	227	0.626	72
SUN COMMUNITIES INC	1	196	0.232	32
UDR INC	2	130	0.606	24
VENTAS INC	2	132	0.761	33
VORNADO REALTY TRUST	1	33	0.315	7
WP CAREY INC	1	157	0.367	28
REALTY INCOME CORP	7	488	1	73
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1	96	0.336	21
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.974	176	0.256	40
DIGITAL REALTY TRUST INC	2	239	0.543	59
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4	59	1	14
IRON MOUNTAIN INC	2	104	0.555	28
AGNC INVESTMENT CORP	—	—	42	524
AMERICAN TOWER REIT INC	3	761	0.871	190
EQUINIX INC	0.704	445	0.174	112
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPORATED-A	33	815	0.731	14

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	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	27	1,002	0.592	18
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22	1,079	0.486	24
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.670	203	0.206	60
INVITATION HOMES INC	5	189	1	36
VICI PROPERTIES INC	33	1,048	1	58
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.745	32	0.292	13
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.958	18	0.499	10
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
GPT GROUP	19	85	4	18
GOODMAN GROUP	12	224	3	58
STOCKLAND	23	86	5	18
MIRVAC GROUP	33	70	8	17
VICINITY CENTRES	41	77	8	16
SCENTRE GROUP	52	148	10	30
DEXUS/AU	12	108	2	17
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	17	1,057	4	229
(シンガポール)		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
CAPITALAND ASCENDAS REIT	20	56	6	17
		(△ 4)		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	69	148	10	20
		(△0.133)		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	25	42	6	9
		(△ 4)		
CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	—	5	7
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	31	56	4	7
		(△0.221)		
(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	4	20	1	6
LAND SECURITIES GROUP PLC	3	23	1	8
SEGRO PLC	7	71	2	18
(ユーロ／ベルギー)		千ユーロ		千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW SCA	12	435	0.275	7
(ユーロ／フランス)				
KLEPIERRE	2	48	0.408	9

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	0.224	18	0.156	15
COVIVIO	0.160	7	0.504	33
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.673	31	0.654	40

(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
	81,587	79,760	-	-

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

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2022年5月21日～2022年11月21日

株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC	93	1,939,637	20,667	APPLE INC	30	645,460	20,883
MICROSOFT CORP	46	1,680,792	35,882	TWITTER INC	68	521,050	7,639
AMAZON.COM INC	53	1,102,139	20,465	MICROSOFT CORP	13	460,331	33,927
TESLA, INC.	15	866,147	54,777	CERNER CORP	24	312,338	12,969
ALPHABET INC-CL A	25	630,428	24,895	AMAZON.COM INC	17	238,354	13,631
ALPHABET INC-CL C	20	498,045	24,484	CITRIX SYSTEMS INC	10	168,884	15,419
UNITEDHEALTH GROUP INC	6	444,372	71,893	ALPHABET INC-CL A	11	159,328	13,873
JOHNSON & JOHNSON	18	432,622	23,884	ALPHABET INC-CL C	10	149,690	13,893
NVIDIA CORP	17	365,702	20,772	CHEVRON CORP	6	149,689	24,697
EXXON MOBIL CORP	27	361,657	13,274	ALLEGHANY CORP	1	148,825	125,697

(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

2022年11月21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	63	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	467	489	6,208	871,436	資本財
ABBOTT LABORATORIES	1,432	1,505	15,641	2,195,451	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	1,432	1,520	23,559	3,306,759	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	36	38	1,467	206,000	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC	511	544	15,602	2,190,007	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	630	672	4,985	699,705	メディア・娯楽
ADOBE INC	385	406	13,435	1,885,769	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	50	52	769	108,028	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	1,323	1,393	10,249	1,438,689	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	108	116	689	96,840	資本財
AES CORP	541	575	1,591	223,406	公益事業
AFFIRM HOLDINGS INC	135	165	224	31,443	ソフトウェア・サービス
AFLAC INC	507	524	3,723	522,620	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	244	256	3,755	527,138	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	179	190	5,660	794,493	素材
AIRBNB INC-CLASS A	238	322	3,151	442,278	消費者サービス
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	131	137	1,251	175,720	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	94	100	2,785	390,985	素材
ALCOA CORP	-	157	745	104,699	素材
ALIGN TECHNOLOGY INC	60	63	1,238	173,767	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	11	-	-	-	保険
ALLEGION PLC	74	76	863	121,196	資本財
ALLIANT ENERGY CORP	203	215	1,192	167,357	公益事業
ALLSTATE CORP	231	235	3,127	438,936	保険
ALLY FINANCIAL INC	293	274	714	100,348	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	97	103	2,258	316,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	243	5,171	50,382	7,071,635	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	231	4,851	47,446	6,659,603	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	1,489	1,558	6,886	966,619	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	369	7,873	74,125	10,404,262	小売
AMC ENTERTAINMENT HLDGS	-	431	59	8,357	メディア・娯楽
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	417	431	327	45,964	メディア・娯楽
AMCOR PLC	1,257	1,308	1,546	217,035	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AMERCO	8	-	-	-	運輸
AMERCO-NON VOTING	-	82	481	67,553	運輸
AMEREN CORPORATION	209	222	1,918	269,286	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	408	441	4,033	566,113	公益事業
A M E R I C A N E X P R E S S C O	533	550	8,398	1,178,874	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	57	61	871	122,338	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	669	677	4,050	568,574	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	146	155	2,284	320,661	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	90	93	3,087	433,312	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	127	136	2,207	309,855	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	188	199	2,782	390,551	資本財
AMGEN INC	456	459	13,205	1,853,493	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	486	516	4,114	577,462	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES INC	435	448	7,251	1,017,756	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	70	74	1,820	255,477	ソフトウェア・サービス
AON PLC	178	182	5,500	772,106	保険
APA CORP	-	288	1,336	187,544	エネルギー
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	291	346	2,149	301,643	各種金融
APPLE INC	13,288	13,917	210,564	29,554,771	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	731	747	7,824	1,098,194	半導体・半導体製造装置
APPLOVIN CORP-CLASS A	-	101	142	19,969	ソフトウェア・サービス
APTIV PLC	219	233	2,517	353,360	自動車・自動車部品
ARAMARK	187	202	824	115,658	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	309	319	1,842	258,661	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	452	483	4,604	646,260	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	186	211	2,869	402,777	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	55	57	617	86,673	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	168	180	3,516	493,562	保険
ASANA INC - CL A	53	-	-	-	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	46	46	576	80,972	保険
AT&T INC	5,790	6,161	11,689	1,640,690	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	107	120	1,380	193,781	公益事業
AUTODESK INC	177	186	3,932	551,928	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	341	361	9,261	1,299,875	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	16	16	4,144	581,659	小売
AVALARA INC	70	-	-	-	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	444	525	1,097	154,064	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	
AVERY DENNISON CORP	67	70	1,323	185,801	素材
BAKER HUGHES COMPANY	669	847	2,469	346,630	エネルギー
BALL CORP	263	275	1,516	212,889	素材
BANK OF AMERICA CORP	5,963	6,232	23,180	3,253,577	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	634	659	2,940	412,686	各種金融
BATH & BODY WORKS INC	213	203	778	109,261	小売
BAXTER INTERNATIONAL INC	406	434	2,388	335,294	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	230	245	5,544	778,233	ヘルスケア機器・サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	142	166	640	89,845	ソフトウェア・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,056	1,106	34,384	4,826,231	各種金融
BEST BUY CO INC	178	173	1,248	175,277	小売
BILL.COM HOLDINGS INC	62	80	913	128,267	ソフトウェア・サービス
BIOGEN INC	118	125	3,811	535,034	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	148	159	1,408	197,628	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	17	19	765	107,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-TECHNE CORP	31	33	1,104	154,975	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	126	134	817	114,806	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	122	130	9,376	1,316,096	各種金融
BLACKSTONE INC	555	601	5,518	774,537	各種金融
BLOCK INC	411	445	2,932	411,658	ソフトウェア・サービス
BOEING CO	453	484	8,416	1,181,381	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	33	34	6,769	950,186	消費者サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	108	113	1,219	171,172	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	195	205	869	122,057	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,155	1,230	5,285	741,902	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,798	1,832	14,194	1,992,404	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	333	347	17,897	2,512,047	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	95	101	1,469	206,248	ソフトウェア・サービス
BROWN & BROWN INC	193	204	1,166	163,718	保険
BROWN-FORMAN CORP -CL B	251	266	1,861	261,232	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	112	130	1,312	184,268	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	54	56	896	125,808	小売
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	108	112	1,089	152,942	運輸
CABLE ONE INC	4	4	317	44,600	メディア・娯楽
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	223	236	3,904	547,971	ソフトウェア・サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	173	183	917	128,728	消費者サービス
CAMPBELL SOUP CO	159	182	939	131,886	食品・飲料・タバコ

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	344	337	3,335	468,232	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	229	236	1,835	257,576	ヘルスケア機器・サービス
CARLISLE COS INC	-	44	1,120	157,217	資本財
CARLYLE GROUP INC/THE	128	169	479	67,280	各種金融
CARMAX INC	131	137	917	128,765	小売
CARNIVAL CORP	682	857	811	113,958	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	668	730	3,210	450,620	資本財
CARVANA CO	62	-	-	-	小売
CATALENT INC	138	146	630	88,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	438	458	10,619	1,490,538	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	86	91	1,117	156,804	各種金融
CBRE GROUP INC	270	280	2,115	296,875	不動産
CDW CORP/DE	110	116	2,163	303,726	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	87	92	933	131,088	素材
CENTENE CORP	472	502	4,157	583,520	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	511	545	1,619	227,326	公益事業
CENTURYLINK INC	710	805	472	66,370	電気通信サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	110	117	767	107,744	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	237	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	172	179	1,817	255,165	素材
CHARLES RIVER LABORATORIES	40	43	1,052	147,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHARLES SCHWAB CORP	1,173	1,250	9,976	1,400,344	各種金融
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	101	100	3,777	530,261	メディア・娯楽
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	85	88	1,139	159,930	ソフトウェア・サービス
CHENIERE ENERGY INC	194	197	3,307	464,268	エネルギー
CHEVRON CORP	1,561	1,605	29,374	4,123,051	エネルギー
CHEWY INC - CLASS A	73	79	325	45,620	小売
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	22	23	3,604	505,920	消費者サービス
CHUBB LTD	348	366	7,692	1,079,673	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	197	209	1,599	224,533	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	268	272	8,708	1,222,261	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	123	130	1,392	195,510	保険
CINTAS CORP	75	79	3,550	498,407	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	3,416	3,561	17,018	2,388,649	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CITIGROUP INC	1,606	1,669	8,123	1,140,241	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	343	423	1,710	240,053	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	101	-	-	-	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	
CLARIVATE PLC	286	260	241	33,860	商業・専門サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	-	447	641	90,010	素材
CLOROX CO	99	105	1,555	218,293	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	210	217	1,021	143,355	ソフトウェア・サービス
CME GROUP INC	291	309	5,337	749,170	各種金融
CMS ENERGY CORP	236	250	1,503	211,070	公益事業
COCA-COLA CO	3,326	3,543	21,666	3,041,048	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	166	176	896	125,831	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	143	148	709	99,654	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	424	447	2,685	376,972	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	31	104	472	66,252	各種金融
COLGATE-PALMOLIVE CO	650	685	5,242	735,770	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	3,692	3,842	13,255	1,860,549	メディア・娯楽
CONAGRA BRANDS INC	389	412	1,483	208,271	食品・飲料・タバコ
CONOCOPHILLIPS	1,066	1,111	14,294	2,006,332	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	287	305	2,854	400,688	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	133	140	3,473	487,476	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION ENERGY	263	280	2,618	367,593	公益事業
COOPER COS INC/THE	39	42	1,298	182,251	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	172	366	2,358	331,036	商業・専門サービス
CORNING INC	656	691	2,341	328,709	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	589	622	4,061	570,109	素材
COSTAR GROUP INC	320	340	2,750	386,095	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	357	380	19,940	2,798,894	食品・生活必需品小売り
COTERRA ENERGY INC	623	692	1,843	258,725	エネルギー
COUPA SOFTWARE INC	60	64	295	41,546	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	158	174	2,419	339,625	ソフトウェア・サービス
CROWN HOLDINGS INC	104	106	856	120,162	素材
CSX CORP	1,815	1,890	5,837	819,337	運輸
CUMMINS INC	116	121	3,048	427,891	資本財
CVS HEALTH CORP	1,068	1,127	10,979	1,541,072	ヘルスケア機器・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	32	35	521	73,190	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	520	593	15,482	2,173,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DARDEN RESTAURANTS INC	104	106	1,570	220,404	消費者サービス
DATADOG INC - CLASS A	176	206	1,580	221,852	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	53	48	343	48,283	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	238	249	10,344	1,452,010	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	
DELL TECHNOLOGIES -C	234	235	988	138,814	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	129	132	458	64,333	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	176	185	576	80,868	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	518	537	3,744	525,608	エネルギー
DEXCOM INC	78	337	3,832	537,926	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	138	144	2,257	316,823	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	237	241	2,589	363,412	各種金融
DISH NETWORK CORP	200	211	322	45,314	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	159	170	786	110,349	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	189	195	5,034	706,596	小売
DOLLAR TREE INC	182	193	3,155	442,923	小売
DOMINION ENERGY INC	658	699	4,138	580,934	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	29	30	1,136	159,506	消費者サービス
DOORDASH INC - A	88	165	963	135,298	小売
DOVER CORP	116	123	1,729	242,683	資本財
DOW INC	596	625	3,132	439,618	素材
DR HORTON INC	273	286	2,330	327,146	耐久消費財・アパレル
DRAFTKINGS INC	264	-	-	-	消費者サービス
DROPBOX INC-CLASS A	250	250	558	78,396	ソフトウェア・サービス
DTE ENERGY COMPANY	158	167	1,924	270,119	公益事業
DUKE ENERGY CORP	624	662	6,416	900,551	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	419	439	3,047	427,739	素材
DYNATRACE INC	149	172	630	88,504	ソフトウェア・サービス
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	108	110	930	130,598	素材
EATON CORP PLC	323	343	5,668	795,643	資本財
EBAY INC	505	480	2,195	308,118	小売
ECOLAB INC	209	221	3,280	460,511	素材
EDISON INTERNATIONAL	309	329	2,032	285,325	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	505	534	4,009	562,789	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	347	368	438	61,543	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	228	240	3,131	439,580	メディア・娯楽
ELEVANCE HEALTH, INC	196	207	10,260	1,440,171	ヘルスケア機器・サービス
ELI LILLY & CO	658	694	25,119	3,525,762	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	482	511	4,792	672,619	資本財
ENPHASE ENERGY INC	103	116	3,620	508,199	半導体・半導体製造装置
ENTEGRIS INC	109	128	939	131,855	半導体・半導体製造装置
ENTERGY CORP	163	175	1,963	275,553	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	
EOG RESOURCES INC	472	503	7,093	995,636	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	45	49	1,674	235,035	ソフトウェア・サービス
EQT CORP	-	285	1,171	164,401	エネルギー
EQUIFAX INC	98	105	2,104	295,330	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	295	327	1,004	141,020	各種金融
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	20	21	587	82,524	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	197	215	1,016	142,632	公益事業
ESTEE LAUDER COS INC	187	198	4,645	652,059	家庭用品・パーソナル用品
ETSY INC	102	108	1,241	174,272	小売
EVEREST RE GROUP LTD	31	33	1,080	151,607	保険
EVERGY INC	187	197	1,161	162,979	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	279	296	2,364	331,946	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	140	151	646	90,724	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	791	842	3,250	456,253	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	117	129	1,275	178,984	消費者サービス
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	140	148	1,678	235,653	運輸
EXXON MOBIL CORP	3,430	3,622	40,598	5,698,438	エネルギー
F5 INC	49	51	773	108,601	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	30	32	1,426	200,189	各種金融
FAIR ISAAC CORP	22	22	1,284	180,271	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	465	493	2,551	358,192	資本財
FEDEX CORP	206	213	3,723	522,575	運輸
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	216	227	904	126,964	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	493	525	3,228	453,144	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	553	588	2,096	294,330	銀行
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	9	10	810	113,754	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	143	154	1,885	264,695	銀行
FIRSTENERGY CORP	442	468	1,802	253,066	公益事業
FISERV INC	482	528	5,279	741,100	ソフトウェア・サービス
FIVERR INTERNATIONAL LTD	23	-	-	-	小売
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	62	63	1,191	167,301	ソフトウェア・サービス
FMC CORP	103	108	1,389	194,972	素材
FORD MOTOR CO	3,175	3,394	4,749	666,591	自動車・自動車部品
FORTINET INC	112	585	3,054	428,741	ソフトウェア・サービス
FORTUNE CORP	276	293	1,958	274,862	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	110	112	725	101,896	資本財
FOX CORP - CLASS A	246	256	794	111,559	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	
FOX CORP- CLASS B	134	138	402	56,537	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	241	256	669	93,999	各種金融
FREEMONT-MCMORAN INC	1,185	1,242	4,515	633,764	素材
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	40	50	256	36,029	各種金融
GARMIN LTD	124	132	1,207	169,435	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	66	69	2,340	328,469	ソフトウェア・サービス
GEN DIGITAL INC	471	500	1,131	158,750	ソフトウェア・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	51	54	562	78,937	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	192	203	5,050	708,823	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	889	946	8,092	1,135,836	資本財
GENERAL MILLS INC	490	517	4,194	588,799	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	1,057	1,189	4,730	663,920	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	115	122	2,215	310,992	小売
GILEAD SCIENCES INC	1,016	1,079	9,027	1,267,057	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	235	242	2,374	333,296	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	77	80	914	128,428	保険
GODADDY INC - CLASS A	134	139	1,035	145,295	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	272	295	11,195	1,571,400	各種金融
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	885	1,144	367	51,578	運輸
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	65	70	404	56,815	ソフトウェア・サービス
HALLIBURTON CO	724	775	2,848	399,781	エネルギー
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	273	279	2,062	289,524	保険
HASBRO INC	106	114	683	95,898	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	201	202	4,669	655,342	ヘルスケア機器・サービス
HEICO CORP	34	37	618	86,838	資本財
HEICO CORP-CLASS A	59	62	800	112,333	資本財
HENRY SCHEIN INC	111	118	935	131,270	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	117	125	2,829	397,185	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	225	240	3,462	486,000	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,052	1,114	1,757	246,654	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	224	238	3,326	466,845	消費者サービス
HOLOGIC INC	202	214	1,572	220,784	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	845	883	27,677	3,884,827	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	558	586	12,571	1,764,590	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	964	999	396	55,667	不動産
HORIZON PHARMA PLC	174	187	1,428	200,472	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	242	258	1,258	176,594	食品・飲料・タバコ

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HOWMET AEROSPACE INC	310	323	1,199	168,348	資本財
HP INC	931	904	2,665	374,157	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUBSPOT INC	36	38	1,059	148,686	ソフトウェア・サービス
HUMANA INC	103	108	5,757	808,103	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,172	1,240	1,847	259,341	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	32	34	783	109,913	資本財
IAC INC	64	69	327	46,035	メディア・娯楽
IDEX CORP	62	65	1,536	215,601	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	68	71	2,974	417,518	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	255	268	6,090	854,907	資本財
ILLUMINA INC	120	134	2,976	417,837	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	151	161	1,252	175,771	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	332	351	1,885	264,582	資本財
INMODE LTD	39	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
INSULET CORP	55	59	1,761	247,182	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	3,294	3,515	10,501	1,473,946	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	456	480	5,006	702,662	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	727	774	11,429	1,604,251	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	207	219	2,160	303,270	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	298	304	1,087	152,628	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	318	338	1,119	157,175	メディア・娯楽
INTUIT INC	217	230	8,751	1,228,359	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	288	308	8,079	1,134,044	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	275	287	544	76,408	各種金融
IPG PHOTONICS CORP	30	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IQVIA HOLDINGS INC	154	162	3,482	488,830	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	59	62	1,176	165,139	ソフトウェア・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	104	110	1,395	195,803	商業・専門サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	176	137	632	88,762	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	49	53	792	111,203	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	70	74	1,350	189,496	運輸
JM SMUCKER CO	87	93	1,360	190,968	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	2,132	2,263	39,885	5,598,380	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	572	599	4,013	563,401	資本財
JPMORGAN CHASE & CO	2,393	2,525	33,799	4,744,067	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	263	278	878	123,288	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KELLOGG CO	208	218	1,544	216,779	食品・飲料・タバコ

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
KEURIG DR PEPPER INC	578	677	2,533	355,605	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	752	799	1,488	208,897	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	149	156	2,690	377,673	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	274	290	3,818	535,943	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	1,653	1,757	3,237	454,451	エネルギー
KKR & CO INC -A	425	483	2,505	351,734	各種金融
KLA CORPORATION	122	128	4,835	678,670	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	136	143	782	109,858	運輸
KORNIT DIGITAL LTD	37	-	-	-	資本財
KRAFT HEINZ CO/THE	545	632	2,408	338,039	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	569	592	2,860	401,495	食品・生活必需品小売り
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	159	165	3,714	521,411	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	77	79	1,833	257,398	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	114	119	5,447	764,613	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	279	296	1,294	181,648	消費者サービス
LEAR CORP	48	51	750	105,337	自動車・自動車部品
LEIDOS HOLDINGS INC	108	112	1,190	167,166	商業・専門サービス
LENNAR CORP-CL A	219	221	1,876	263,361	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	27	27	749	105,173	資本財
LIBERTY BROADBAND-A	22	-	-	-	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	111	112	968	135,942	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-A	182	100	193	27,173	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	223	290	581	81,655	電気通信サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	66	58	249	35,023	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	138	146	616	86,505	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA GROUP-C	157	170	980	137,682	メディア・娯楽
LINCOLN NATIONAL CORP	136	137	519	72,938	保険
LINDE PLC	415	432	14,491	2,034,081	素材
LIVE NATION INC	134	148	981	137,809	メディア・娯楽
LKQ CORP	222	230	1,246	174,983	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	201	205	9,820	1,378,350	資本財
LOEWS CORP	172	178	1,012	142,135	保険
LOWE'S COS INC	545	549	11,536	1,619,262	小売
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	-	68	1,494	209,719	各種金融
LUCID GROUP INC	333	361	406	57,082	自動車・自動車部品
LULULEMON ATHLETICA INC	95	100	3,485	489,218	耐久消費財・アパレル
LYFT INC-A	221	271	303	42,668	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	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	215	224	1,845	259,056	素材
M&T BANK CORP	104	154	2,633	369,571	銀行
MARATHON OIL CORP	-	602	1,856	260,522	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	497	463	5,614	788,103	エネルギー
MARKEL CORP	11	11	1,470	206,448	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	30	32	841	118,070	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	223	238	3,855	541,201	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	409	431	7,235	1,015,527	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	50	53	1,916	268,970	素材
MARVELL TECHNOLOGY INC	666	731	3,219	451,824	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	198	202	1,010	141,894	資本財
MASIMO CORPORATION	41	44	635	89,229	ヘルスケア機器・サービス
MASTERCARD INC-CLASS A	710	746	25,664	3,602,298	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	217	244	1,135	159,424	メディア・娯楽
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	202	216	1,809	254,023	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	605	636	17,396	2,441,841	消費者サービス
MCKESSON CORP	123	125	4,636	650,818	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	1,089	1,144	9,305	1,306,156	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	178	-	-	-	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	36	38	3,748	526,106	小売
MERCK & CO INC	2,046	2,175	22,670	3,182,037	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
META PLATFORMS INC-A	1,916	1,971	22,092	3,100,912	メディア・娯楽
METLIFE INC	576	592	4,470	627,501	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	18	19	2,728	382,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	302	289	1,064	149,449	消費者サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	450	477	3,544	497,528	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	905	959	5,623	789,265	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	5,776	6,109	147,376	20,685,798	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	278	290	5,272	739,992	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC	46	43	434	60,996	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	47	50	1,602	224,870	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	154	154	828	116,340	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,130	1,190	7,739	1,086,283	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	48	58	934	131,166	ソフトウェア・サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	35	38	1,435	201,509	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	320	340	3,397	476,813	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	135	142	4,173	585,846	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MORGAN STANLEY	1,089	1,128	10,062	1,412,356	各種金融
MOSAIC CO/THE	298	310	1,518	213,158	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	137	144	3,790	532,077	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	66	69	3,411	478,780	各種金融
NASDAQ INC	94	296	1,945	273,040	各種金融
NETAPP INC	181	191	1,411	198,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	358	381	10,992	1,542,905	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	76	82	988	138,720	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWELL BRANDS INC	310	338	452	63,480	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	644	681	3,075	431,629	素材
NEWS CORP - CLASS A	316	332	593	83,324	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	1,589	1,689	14,054	1,972,663	公益事業
NIKE INC	1,035	1,091	11,503	1,614,591	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	322	351	925	129,968	公益事業
NORDSON CORP	42	44	1,034	145,132	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	199	208	5,132	720,412	運輸
NORTHERN TRUST CORP	159	170	1,573	220,817	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	121	126	6,605	927,174	資本財
NOVAVAX INC	58	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOCURE LTD	75	80	625	87,827	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	196	202	853	119,773	公益事業
NUCOR CORP	230	228	3,238	454,605	素材
NVIDIA CORP	2,024	2,152	33,175	4,656,459	半導体・半導体製造装置
NVR INC	2	2	1,181	165,850	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	215	225	3,885	545,344	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	757	805	5,739	805,612	エネルギー
OKTA INC	119	129	645	90,649	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	80	84	2,518	353,550	運輸
OMNICOM GROUP	172	177	1,368	192,053	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	348	373	2,705	379,806	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	361	383	2,473	347,210	エネルギー
ORACLE CORP	1,328	1,376	10,977	1,540,741	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	54	56	4,737	665,011	小売
OTIS WORLDWIDE CORP	328	364	2,835	397,993	資本財
OWENS CORNING	80	82	747	104,893	資本財
PACCAR INC	281	300	3,116	437,448	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	76	80	1,042	146,381	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,313	1,420	1,049	147,373	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	79	257	4,305	604,354	ソフトウェア・サービス
PARAMOUNT GLOBAL	489	522	974	136,759	メディア・娯楽
PARKER HANNIFIN CORP	104	110	3,375	473,725	資本財
PAYCHEX INC	262	279	3,376	473,921	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	41	43	1,390	195,175	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	903	945	8,029	1,126,976	ソフトウェア・サービス
PELOTON INTERACTIVE INC-A	229	-	-	-	耐久消費財・アパレル
PENTAIR PLC	133	141	635	89,225	資本財
PEPSICO INC	1,120	1,189	21,568	3,027,377	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	91	108	1,478	207,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	4,545	4,824	23,270	3,266,198	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	1,208	1,287	1,933	271,435	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,261	1,332	12,830	1,800,843	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	354	413	4,502	631,999	エネルギー
PINTEREST INC- CLASS A	454	493	1,202	168,771	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	187	197	4,935	692,720	エネルギー
PLUG POWER INC	421	447	709	99,532	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	342	355	5,734	804,902	銀行
POOL CORP	32	34	1,104	155,012	小売
PPG INDUSTRIES INC	192	203	2,609	366,230	素材
PPL CORPORATION	615	634	1,781	250,117	公益事業
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	213	215	1,963	275,562	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,960	2,063	29,423	4,129,896	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	473	502	6,448	905,100	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	304	322	3,460	485,690	保険
PTC INC	90	95	1,179	165,500	ソフトウェア・サービス
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	411	432	2,494	350,097	公益事業
PULTE GROUP INC	203	201	865	121,473	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	89	90	896	125,834	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	907	963	11,927	1,674,143	半導体・半導体製造装置
QUANTA SERVICES INC	-	123	1,841	258,486	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	99	101	1,480	207,816	ヘルスケア機器・サービス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	148	166	2,020	283,626	各種金融
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,213	1,280	12,207	1,713,446	資本財
REGENERON PHARMACEUTICALS	85	92	6,840	960,137	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	765	800	1,800	252,740	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
REPUBLIC SERVICES INC	180	190	2,554	358,566	商業・専門サービス
RESMED INC	117	125	2,820	395,883	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	63	69	249	35,073	ソフトウェア・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	145	270	819	115,018	自動車・自動車部品
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	89	93	707	99,306	商業・専門サービス
ROBINHOOD MARKETS INC - A	149	-	-	-	各種金融
ROBLOX CORP -CLASS A	-	302	960	134,750	メディア・娯楽
ROCKWELL AUTOMATION INC	94	100	2,649	371,849	資本財
ROKU INC	95	102	570	80,024	メディア・娯楽
ROLLINS INC	179	189	806	113,210	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	85	91	3,954	555,018	ソフトウェア・サービス
ROSS STORES INC	288	302	3,252	456,573	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	186	198	1,164	163,502	消費者サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	279	300	1,287	180,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RPM INTERNATIONAL INC	106	112	1,128	158,442	素材
S&P GLOBAL INC	280	298	10,322	1,448,864	各種金融
SALESFORCE INC	793	854	12,654	1,776,221	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,135	1,215	6,496	911,786	エネルギー
SEA LTD-ADR	259	310	1,765	247,795	メディア・娯楽
SEAGATE TECHNOLOGY	161	175	955	134,124	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEAGEN INC	111	118	1,567	220,039	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEALED AIR CORP	120	126	646	90,773	素材
SEI INVESTMENTS COMPANY	93	97	592	83,162	各種金融
SEMPRA ENERGY	259	270	4,272	599,720	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	129	136	600	84,351	資本財
SERVICENOW INC	161	172	6,881	965,861	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	202	212	5,101	716,056	素材
SIGNATURE BANK	48	53	710	99,682	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	813	689	440	61,805	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	134	137	1,301	182,621	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	108	112	688	96,574	資本財
SNAP INC - A	877	950	999	140,293	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	43	45	1,082	151,989	資本財
SNOWFLAKE INC-CLASS A	170	191	2,798	392,744	ソフトウェア・サービス
SOFI TECHNOLOGIES INC	428	-	-	-	各種金融
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	42	47	1,458	204,703	半導体・半導体製造装置
SOUTHERN CO	861	915	6,003	842,617	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	
SOUTHWEST AIRLINES CO	118	123	472	66,296	運輸
SPLUNK INC	131	138	1,072	150,530	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	186	197	1,032	144,935	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	132	129	1,039	145,956	資本財
STARBUCKS CORP	950	985	9,656	1,355,331	消費者サービス
STATE STREET CORP	295	314	2,375	333,381	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	158	160	1,619	227,298	素材
STERIS PLC	81	86	1,432	201,135	ヘルスケア機器・サービス
STRYKER CORP	275	292	6,545	918,728	ヘルスケア機器・サービス
SUNRUN INC	143	-	-	-	資本財
SVB FINANCIAL GROUP	47	50	1,127	158,222	銀行
SYNCHRONY FINANCIAL	441	428	1,537	215,822	各種金融
SYNOPSIS INC	123	131	4,283	601,186	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	415	437	3,722	522,475	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	180	193	2,357	330,852	各種金融
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	93	139	1,376	193,144	メディア・娯楽
TARGA RESOURCES CORP	-	184	1,336	187,552	エネルギー
TARGET CORP	387	398	6,486	910,495	小売
TE CONNECTIVITY LTD	264	277	3,508	492,429	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELADOC HEALTH INC	117	139	401	56,407	ヘルスケア機器・サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	37	40	1,648	231,413	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	38	40	874	122,728	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	131	137	1,275	179,044	半導体・半導体製造装置
TESLA, INC.	691	2,271	40,932	5,745,260	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	892	954	832	116,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	748	793	13,894	1,950,169	半導体・半導体製造装置
TEXAS PACIFIC LAND CORP	-	5	1,438	201,903	エネルギー
TEXTRON INC	177	183	1,287	180,757	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	319	336	18,021	2,529,502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TJX COS INC	974	1,008	7,879	1,105,906	小売
T-MOBILE US INC	507	539	8,033	1,127,651	電気通信サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	92	96	2,115	296,868	小売
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	352	379	1,889	265,226	メディア・娯楽
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	85	92	529	74,281	各種金融
TRANE TECHNOLOGIES PLC	193	201	3,554	498,872	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	42	44	2,768	388,592	資本財
TRANSUNION	155	165	997	140,000	商業・専門サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TRAVELERS COS INC/THE	198	205	3,796	532,862	保険
TRIMBLE INC	203	214	1,246	174,966	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRUIST FINANCIAL CORP	1,084	1,147	5,241	735,702	銀行
TWILIO INC - A	136	147	726	101,921	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	647	-	-	-	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	33	35	1,119	157,153	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	237	249	1,633	229,339	食品・飲料・タバコ
UBER TECHNOLOGIES INC	1,183	1,272	3,684	517,127	運輸
UGI CORP	169	179	693	97,352	公益事業
ULTA BEAUTY INC	41	44	1,958	274,951	小売
UNION PACIFIC CORP	523	543	11,450	1,607,132	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	592	633	11,336	1,591,215	運輸
UNITED RENTALS INC	58	61	2,114	296,860	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	762	806	42,754	6,001,031	ヘルスケア機器・サービス
UNITY SOFTWARE INC	46	165	572	80,331	ソフトウェア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	58	56	728	102,184	ヘルスケア機器・サービス
UPSTART HOLDINGS INC	33	-	-	-	各種金融
US BANCORP	1,141	1,214	5,268	739,468	銀行
VAIL RESORTS INC	32	34	844	118,528	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	330	350	4,817	676,187	エネルギー
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	112	120	2,213	310,618	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	81	84	1,644	230,879	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	124	135	2,356	330,782	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,363	3,616	13,942	1,957,011	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	205	219	6,918	971,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	271	284	942	132,305	耐久消費財・アパレル
VIATRIS INC	982	1,042	1,147	161,019	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	1,352	1,415	29,833	4,187,425	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	353	336	771	108,299	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	169	181	2,113	296,695	ソフトウェア・サービス
VULCAN MATERIALS CO	107	114	2,052	288,050	素材
WABTEC CORP	144	150	1,491	209,369	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	594	629	2,501	351,150	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,242	1,301	19,547	2,743,641	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	1,472	1,566	14,376	2,017,862	メディア・娯楽
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,789	1,979	2,132	299,256	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	211	221	3,109	436,468	商業・専門サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
WASTE MANAGEMENT INC	339	357	5,760	808,554	商業・専門サービス
WATERS CORP	49	51	1,660	233,053	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	60	65	217	30,512	小売
WEBSTER FINANCIAL CORP	144	152	803	112,721	銀行
WEC ENERGY GROUP INC	256	271	2,600	365,026	公益事業
WELLS FARGO & CO	3,227	3,257	15,149	2,126,340	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	59	63	1,427	200,381	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WESTERN DIGITAL CORP	251	269	992	139,316	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	327	334	465	65,276	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	-	32	340	47,725	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	214	219	800	112,314	素材
WEYERHAEUSER CO	602	637	2,058	288,958	不動産
WHIRLPOOL CORP	49	48	714	100,355	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	984	1,049	3,504	491,848	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	100	95	2,222	311,927	保険
WIX.COM LTD	46	49	418	58,736	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	156	171	2,509	352,301	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	170	181	1,328	186,440	保険
WW GRAINGER INC	35	39	2,358	331,090	資本財
WYNN RESORTS LTD	84	95	728	102,267	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	437	469	3,208	450,281	公益事業
XYLEM INC	146	155	1,746	245,114	資本財
YUM! BRANDS INC	237	244	3,049	428,074	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	43	44	1,151	161,685	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZENDESK INC	97	105	815	114,452	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C W/I	136	139	490	68,856	不動産
ZILLOW GROUP INC - CL A	49	-	-	-	不動産
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	-	74	185	25,974	運輸
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	169	180	2,060	289,270	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	383	404	5,895	827,472	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	176	194	1,583	222,327	ソフトウェア・サービス
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	228	224	598	83,988	メディア・娯楽
ZSCALER INC	67	72	1,006	141,309	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	258,879 606	294,092 599	2,950,807 -	414,175,303 <68.9%>
(カナダ)			千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD	367	389	2,493	261,393	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	
AIR CANADA	148	161	301	31,589	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	564	600	617	64,745	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	689	712	4,398	461,054	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	234	250	560	58,790	公益事業
ARC RESOURCES LTD	-	583	1,106	116,033	エネルギー
BALLARD POWER SYSTEMS INC	196	-	-	-	資本財
BANK OF MONTREAL	524	578	7,654	802,313	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	986	1,031	7,121	746,473	銀行
BARRICK GOLD CORP	1,439	1,527	3,193	334,709	素材
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	248	230	233	24,447	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	78	77	490	51,439	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD	439	475	301	31,628	ソフトウェア・サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	1,145	1,213	7,267	761,804	各種金融
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	107	113	468	49,127	公益事業
BRP INC/CA- SUB VOTING	-	32	305	32,012	耐久消費財・アパレル
CAE INC	257	273	777	81,445	資本財
CAMECO CORP	321	342	1,092	114,497	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	731	777	4,943	518,158	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	577	510	8,497	890,706	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	952	992	7,932	831,499	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	762	809	8,505	891,575	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	46	48	716	75,122	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	112	119	427	44,841	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	199	-	-	-	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	124	131	819	85,897	素材
CENOVUS ENERGY INC	1,058	1,192	3,236	339,221	エネルギー
CGI INC	177	187	2,138	224,109	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC	16	17	3,510	367,991	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC	236	240	1,868	195,859	小売
EMERA INC	219	236	1,211	127,006	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	137	140	488	51,232	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	1,648	1,751	9,453	990,954	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	20	19	1,489	156,112	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	472	502	1,482	155,395	素材
FIRSTSERVICE CORP	32	35	582	61,093	不動産
FORTIS INC	393	420	2,244	235,267	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	154	164	3,048	319,543	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	
GEORGE WESTON LTD	61	63	999	104,763	食品・生活必需品小売り
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	134	160	595	62,443	商業・専門サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	158	162	623	65,346	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC	232	247	776	81,415	保険
HYDRO ONE LTD	279	298	1,059	111,043	公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	86	91	670	70,284	保険
IGM FINANCIAL INC	69	75	292	30,622	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	197	201	1,519	159,277	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	143	152	2,963	310,668	保険
IVANHOE MINES LTD-CL A	491	527	548	57,461	素材
KEYERA CORP	179	192	564	59,156	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	983	1,088	596	62,546	素材
LIGHTSPEED COMMERCE INC	90	114	231	24,249	ソフトウェア・サービス
LOBLAW COS LTD	135	143	1,590	166,686	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	530	558	429	44,977	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	232	242	2,007	210,457	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,574	1,656	3,903	409,142	保険
METRO INC	200	208	1,597	167,401	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	274	290	2,832	296,922	銀行
NORTHLAND POWER INC	187	200	741	77,687	公益事業
NUTRIEN LTD	461	474	4,935	517,376	素材
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	53	55	223	23,464	ソフトウェア・サービス
ONEX CORPORATION	61	65	452	47,453	各種金融
OPEN TEXT CORP	223	237	919	96,391	ソフトウェア・サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	170	184	365	38,345	素材
PARKLAND CORP	127	136	352	36,989	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	448	476	2,241	234,975	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	458	484	1,603	168,084	保険
QUEBECOR INC -CL B	140	141	383	40,226	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERN	231	253	2,268	237,799	消費者サービス
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	90	95	704	73,834	商業・専門サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	293	311	1,859	194,924	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,156	1,222	16,216	1,699,838	銀行
SAPUTO INC	205	217	749	78,592	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	372	415	1,516	158,921	メディア・娯楽
SHOPIFY INC - CLASS A	92	982	4,815	504,794	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
SUN LIFE FINANCIAL INC	477	507	3,138	328,988	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,181	1,234	5,883	616,721	エネルギー
TC ENERGY CORP	798	847	5,420	568,214	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	380	409	1,800	188,731	素材
TFI INTERNATIONAL INC	69	73	1,026	107,579	運輸
THOMSON REUTERS CORP	138	149	2,268	237,732	商業・専門サービス
TMX GROUP LTD	48	50	683	71,691	各種金融
TOROMONT INDUSTRIES LTD	68	72	722	75,769	資本財
TORONTO-DOMINION BANK	1,477	1,566	14,003	1,467,859	銀行
TOURMALINE OIL CORP	251	272	2,174	227,953	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD	75	52	568	59,587	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	363	386	1,913	200,596	素材
WSP GLOBAL INC	95	107	1,715	179,769	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	32,086 85	35,051 85	206,457 -	21,640,852 <3.6%>
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル		
AMPOL LTD	213	223	644	60,245	エネルギー
ARISTOCRAT LEISURE LTD	506	534	1,934	180,724	消費者サービス
ASX LTD	169	180	1,313	122,669	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD	1,748	1,894	699	65,309	運輸
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	2,335	2,630	6,445	602,088	銀行
BHP GROUP LIMITED	4,115	4,371	19,208	1,794,278	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	422	444	738	68,964	素材
BRAMBLES LTD	1,257	1,310	1,510	141,062	商業・専門サービス
COCHLEAR LTD	56	60	1,243	116,124	ヘルスケア機器・サービス
COLES GROUP LTD	1,124	1,211	2,051	191,627	食品・生活必需品小売り
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,392	1,478	15,649	1,461,840	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED	468	494	1,339	125,091	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD	331	-	-	-	消費者サービス
CSL LIMITED	390	417	12,292	1,148,258	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	52	56	360	33,677	消費者サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	1,146	1,226	878	82,020	食品・生活必需品小売り
EVOLUTION MINING LTD	1,559	1,656	424	39,610	素材
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,381	1,472	2,938	274,501	素材
IDP EDUCATION LTD	177	189	573	53,537	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	2,127	2,262	1,108	103,567	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	374	400	1,184	110,656	素材
LOTTERY CORP LTD/THE	-	2,099	944	88,266	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	
(オーストラリア)	百株	百株	オーストラリアドル	千円	
MACQUARIE GROUP LTD	282	322	5,789	540,766	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,421	2,599	735	68,706	保険
MINERAL RESOURCES LTD	141	149	1,246	116,471	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,698	2,816	8,634	806,548	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	691	807	1,539	143,773	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	925	1,045	1,045	97,648	素材
ORICA LTD	365	429	648	60,591	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,547	1,652	1,239	115,741	公益事業
QANTAS AIRWAYS LTD	870	949	558	52,137	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	1,240	1,334	1,655	154,621	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	164	169	1,058	98,829	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	48	51	621	58,063	メディア・娯楽
REECE LTD	250	217	325	30,449	資本財
RIO TINTO LTD	305	325	3,463	323,547	素材
SANTOS LTD	2,707	2,877	2,123	198,396	エネルギー
SEEK LTD	295	323	696	65,069	メディア・娯楽
SONIC HEALTHCARE LTD	387	416	1,328	124,095	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	3,898	4,159	1,626	151,921	素材
SUNCORP GROUP LTD	1,112	1,178	1,408	131,590	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	1,979	-	-	-	消費者サービス
TELSTRA GROUP LTD	3,724	4,019	1,583	147,932	電気通信サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	615	668	899	84,040	食品・飲料・タバコ
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	192	213	585	54,732	エネルギー
WESFARMERS LIMITED	940	1,001	4,765	445,182	小売
WESTPAC BANKING CORP	3,019	3,063	7,235	675,878	銀行
WISETECH GLOBAL LTD	123	132	779	72,775	ソフトウェア・サービス
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	809	1,647	6,244	583,256	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,008	1,071	3,715	347,059	食品・生活必需品小売り
XERO LTD	113	121	835	78,019	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	54,231 50	58,384 49	135,873 -	12,691,970 <2.1%>
(香港)			千香港ドル		
AIA GROUP LTD	9,804	10,356	78,814	1,414,726	保険
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,005	3,205	7,692	138,088	銀行
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,389	1,477	3,308	59,387	食品・飲料・タバコ
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,616	1,728	2,833	50,868	小売
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,624	1,734	8,132	145,985	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,194	2,324	10,121	181,679	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	560	565	2,189	39,299	公益事業
CLP HOLDINGS LTD	1,351	1,436	8,216	147,484	公益事業
ESR GROUP LIMITED	1,616	1,748	2,985	53,591	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,768	1,888	8,666	155,561	消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,701	1,801	2,316	41,586	不動産
HANG SENG BANK LTD	624	666	8,133	145,993	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,236	1,306	3,017	54,169	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	9,194	9,764	6,434	115,503	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	976	1,037	31,217	560,345	各種金融
MTR CORP	1,377	1,472	5,514	98,988	運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,299	1,379	2,650	47,581	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,150	1,220	4,804	86,234	公益事業
SANDS CHINA LTD	1,981	2,125	4,170	74,866	消費者サービス
SINO LAND CO	2,760	3,120	3,113	55,891	不動産
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1,140	1,200	1,800	32,310	運輸
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	1,075	1,255	11,453	205,598	不動産
SWIRE PACIFIC LTD	413	433	2,634	47,288	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD	1,000	1,094	1,921	34,483	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,110	1,180	10,926	196,136	資本財
WH GROUP LTD	6,695	7,090	3,069	55,105	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,367	1,457	5,341	95,873	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	1,460	1,560	2,137	38,362	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	61,492 28	65,627 28	243,620 -	4,372,991 <0.7%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	2,151	2,286	827	84,466	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	366	380	310	31,688	不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,462	1,553	5,519	563,361	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	4,867	5,341	461	47,155	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD	1,197	1,283	950	97,038	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,740	2,906	3,647	372,252	銀行
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,119	1,199	657	67,065	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	649	739	693	70,828	各種金融
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	1,304	1,373	476	48,629	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,802	7,218	1,934	197,446	電気通信サービス
UNITED OVERSEAS BANK LTD	952	1,013	3,064	312,775	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(シンガポール)		百株	百株	シンガポールドル	千円	
UOL Group Limited		391	400	264	26,987	不動産
VENTURE CORP LTD		222	242	425	43,399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,541	1,627	670	68,419	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	25,763	27,560	19,903	2,031,514	
	銘柄数<比率>	14	14	-	<0.3%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		1,089	1,186	939	80,974	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		466	495	1,014	87,492	ヘルスケア機器・サービス
MERCURY NZ LTD		562	605	342	29,545	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		1,037	1,108	520	44,898	公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD		351	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,617	1,717	879	75,814	電気通信サービス
小計	株数・金額	5,124	5,112	3,697	318,725	
	銘柄数<比率>	6	5	-	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
3I GROUP PLC		777	821	1,078	179,669	各種金融
ABRDN PLC		1,741	1,814	367	61,195	各種金融
ADMIRAL GROUP PLC		158	154	323	53,913	保険
ANGLO AMERICAN PLC		1,032	1,088	3,439	573,014	素材
ANTOFAGASTA PLC		317	336	445	74,256	素材
ASHTED GROUP PLC		360	379	1,903	317,103	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		288	305	468	78,098	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC		1,255	1,333	14,557	2,425,107	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		763	802	455	75,818	メディア・娯楽
AVEVA GROUP PLC		99	104	330	54,986	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC		2,360	2,443	1,111	185,228	保険
BAE SYSTEMS PLC		2,571	2,713	2,089	348,164	資本財
BARCLAYS PLC		13,501	14,344	2,269	378,037	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		829	876	349	58,267	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT		92	97	362	60,465	耐久消費財・アパレル
BP PLC		16,005	16,648	7,924	1,320,152	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,765	1,852	6,132	1,021,685	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC		7,257	6,001	736	122,767	電気通信サービス
BUNZL PLC		274	292	885	147,540	資本財
BURBERRY GROUP PLC		328	342	717	119,530	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA HBC AG-CDI		162	170	340	56,768	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC		1,442	1,532	2,836	472,489	消費者サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
CRODA INTERNATIONAL PLC	113	119	828	138,009	素材
DCC PLC	80	85	371	61,939	資本財
DIAGEO PLC	1,889	1,967	7,228	1,204,168	食品・飲料・タバコ
ENTAIN PLC	473	501	671	111,894	消費者サービス
EXPERIAN PLC	747	790	2,282	380,224	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	178	183	1,811	301,747	資本財
GLENCORE PLC	8,021	8,454	4,276	712,368	素材
GSK PLC	4,079	3,499	4,788	797,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HALEON PLC	-	4,352	1,250	208,239	家庭用品・パーソナル用品
HALMA PLC	308	325	725	120,806	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARGREAVES LANSDOWN PLC	286	302	253	42,171	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	140	139	199	33,289	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	16,478	17,295	8,282	1,379,824	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	764	776	1,646	274,218	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	1,222	1,270	751	125,259	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	148	158	749	124,936	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	131	139	547	91,191	商業・専門サービス
JD SPORTS FASHION PLC	2,064	2,158	258	43,006	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	156	158	322	53,654	素材
KINGFISHER PLC	1,674	1,702	419	69,809	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,833	5,147	1,345	224,162	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	57,428	59,774	2,713	452,084	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	266	283	2,305	384,156	各種金融
M&G PLC	2,146	2,322	460	76,729	各種金融
MELROSE INDUSTRIES PLC	3,555	3,760	491	81,938	資本財
MONDI PLC/WI	394	414	652	108,627	素材
NATIONAL GRID PLC	2,936	3,144	3,199	532,934	公益事業
NATWEST GROUP PLC	4,561	4,497	1,160	193,362	銀行
NEXT PLC	107	111	641	106,785	小売
NMC HEALTH PLC	47	47	0.005	0.791	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	396	494	335	55,874	食品・生活必需品小売り
PEARSON PLC	609	576	562	93,761	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	260	273	355	59,221	耐久消費財・アパレル
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	589	697	415	69,245	保険
PRUDENTIAL PLC	2,227	2,360	2,309	384,756	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	579	615	3,579	596,385	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,569	1,657	3,783	630,365	商業・専門サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
RENTOKIL INITIAL PLC		1,512	1,607	859	143,127	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC		907	963	5,188	864,307	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		6,787	7,240	618	103,012	資本財
SAGE GROUP PLC		828	878	703	117,155	ソフトウェア・サービス
SAINSBURY (J) PLC		1,399	1,476	320	53,319	食品・生活必需品小売り
SCHRODERS PLC		100	626	287	47,938	各種金融
SEVERN TRENT PLC		206	220	601	100,208	公益事業
SHELL PLC-NEW		6,233	6,394	14,990	2,497,325	エネルギー
SMITH & NEPHEW PLC		713	750	801	133,522	ヘルスケア機器・サービス
SMITHS GROUP PLC		323	323	508	84,772	資本財
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		60	63	722	120,347	資本財
SSE PLC		864	918	1,557	259,538	公益事業
ST JAMES'S PLACE PLC		439	470	559	93,124	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC		2,110	2,160	1,256	209,339	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC		2,973	3,065	316	52,653	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC		6,193	6,511	1,506	250,901	食品・生活必需品小売り
UNILEVER PLC		2,081	2,195	8,872	1,477,994	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC		562	600	615	102,561	公益事業
VODAFONE GROUP PLC		22,283	23,152	2,255	375,672	電気通信サービス
WHITBREAD PLC		164	175	440	73,333	消費者サービス
WPP PLC		949	940	816	136,089	メディア・娯楽
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	232,548 79	245,752 80	154,903 -	25,805,447 <4.3%>	
(イスラエル)				千イスラエル・シケル		
AZRIELI GROUP		35	37	988	39,958	不動産
BANK HAPOALIM BM		921	1,094	3,604	145,660	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		1,172	1,327	4,311	174,211	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		-	1,833	1,125	45,464	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		21	22	1,538	62,187	資本財
ICL GROUP LTD		572	610	1,728	69,843	素材
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		935	1,062	2,116	85,508	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		115	133	1,756	70,957	銀行
NICE LTD		51	54	3,759	151,897	ソフトウェア・サービス
TOWER SEMICONDUCTOR LTD		-	94	1,424	57,579	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,825 8	6,271 10	22,353 -	903,269 <0.2%>	

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	
ABB LTD	1,330	1,412	4,134	608,182	資本財
ADECCO GROUP AG-REG	129	138	458	67,475	商業・専門サービス
ALCON INC	404	430	2,675	393,625	ヘルスケア機器・サービス
BACHEM HOLDING AG-REG B	24	28	233	34,302	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BALOISE HOLDING AG	37	39	547	80,492	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	3	597	87,873	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.85	0.91	908	133,593	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.09	0.09	889	130,801	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	422	448	5,217	767,481	耐久消費財・アパレル
CLARIANT AG	176	187	301	44,319	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,147	2,297	932	137,099	各種金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	5	403	59,332	素材
GEBERIT AG-REG	29	30	1,434	211,064	資本財
GIVAUDAN-REG	7	7	2,544	374,335	素材
HOLCIM LTD	423	476	2,293	337,340	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	178	190	1,000	147,209	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	44	47	1,064	156,612	運輸
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	139	147	824	121,251	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG	60	63	3,167	465,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA	2,280	2,420	26,842	3,948,498	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG	1,774	1,860	15,163	2,230,486	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDING AG	18	19	1,875	275,928	各種金融
ROCHE HOLDING AG	568	603	18,595	2,735,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG-BR	26	23	845	124,442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	17	22	378	55,678	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	31	33	584	85,908	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	4	5	1,260	185,388	商業・専門サービス
SIG GROUP AG	-	264	531	78,236	素材
SIKA AG-BEARER	114	125	3,072	451,935	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	43	45	1,157	170,197	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG	83	95	1,036	152,474	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG	21	23	580	85,378	耐久消費財・アパレル
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	25	27	1,362	200,430	保険
SWISS PRIME SITE-REG	64	68	559	82,345	不動産
SWISS RE AG	244	258	2,082	306,334	保険
SWISSCOM AG	21	22	1,143	168,254	電気通信サービス
TEMENOS GROUP AG-REG	54	54	319	46,931	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	
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
THE SWATCH GROUP AG-REG		51	53	243	35,884	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG		2,845	3,020	5,281	776,911	各種金融
VAT GROUP AG		21	22	597	87,841	資本財
VIFOR PHARMA AG		39	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		121	129	5,715	840,759	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,040 41	15,158 41	118,858 -	17,484,066 <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	6,518	126,918	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S		2	2	4,116	80,138	運輸
AMBU A/S-B		134	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG AS-B		80	83	7,613	148,227	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S		85	91	3,980	77,492	素材
COLOPLAST-B		96	101	9,019	175,608	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S		555	590	7,224	140,668	銀行
DEMANT A/S		86	76	1,561	30,399	ヘルスケア機器・サービス
DSV A/S		167	164	17,857	347,682	運輸
GENMAB A/S		53	56	17,649	343,634	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		100	110	1,912	37,237	ヘルスケア機器・サービス
NOVO-NORDISK A/S		1,362	1,422	115,543	2,249,632	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S		166	175	7,050	137,279	素材
ORSTED A/S		153	162	10,353	201,574	公益事業
PANDORA A/S		80	76	3,881	75,565	耐久消費財・アパレル
ROCKWOOL A/S-B SHS		6	7	1,235	24,053	資本財
TRYGVESTA AS		296	312	5,082	98,951	保険
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		817	867	15,031	292,656	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,249 18	4,305 17	235,630 -	4,587,721 <0.8%>	
(ノルウェー)				千ノルウェー・クローネ		
ADEVINTA ASA-B		239	248	1,988	27,324	メディア・娯楽
AKER BP ASA		101	271	9,160	125,862	エネルギー
DNB BANK ASA		757	809	14,898	204,705	銀行
EQUINOR ASA		791	840	28,789	395,564	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		166	178	3,380	46,443	保険
KONGSBERG GRUPPEN ASA		-	77	2,941	40,419	資本財
MOWI ASA		356	355	5,341	73,394	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		1,076	1,143	8,145	111,914	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	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
ORKLA ASA		610	651	4,448	61,124	食品・飲料・タバコ
SALMAR ASA		-	50	1,724	23,697	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA		53	-	-	-	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS		83	-	-	-	メディア・娯楽
TELENOR ASA		601	636	6,249	85,864	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		133	142	6,541	89,873	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,971	5,407	93,609	1,286,189	
		12	12	-	<0.2%>	
(スウェーデン)				千スウェーデン・クローナ		
ALFA LAVAL AB		254	248	7,365	97,073	資本財
ASSA ABLOY AB		816	865	20,746	273,433	資本財
ATLAS COPCO AB		1,265	1,347	15,742	207,491	資本財
ATLAS COPCO AB- A RDS		549	-	-	-	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		2,173	2,297	29,740	391,977	資本財
ATLAS COPCO AB-B RDS		319	-	-	-	資本財
BIOVITRUM		-	146	3,106	40,948	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOLIDEN AB		218	231	8,578	113,062	素材
BOLIDEN AB-RED SHS		220	-	-	-	素材
ELECTROLUX AB		183	191	2,721	35,867	耐久消費財・アパレル
EMBRACER GROUP AB		450	581	2,671	35,204	メディア・娯楽
EPIROC AB-A		529	561	10,625	140,041	資本財
EPIROC AB-B		320	339	5,503	72,534	資本財
EQT AB		238	252	6,106	80,484	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B		495	524	13,001	171,355	家庭用品・パーソナル用品
EVOLUTION AB		138	156	15,632	206,034	消費者サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		84	527	2,431	32,051	不動産
GETINGE AB-B SHS		182	192	4,549	59,965	ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB		590	626	7,375	97,211	小売
HEXAGON AB-B SHS		1,578	1,673	20,263	267,073	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLMEN AB-B SHARES		-	81	3,419	45,062	素材
HUSQVARNA AB-B SHS		333	350	2,804	36,959	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		100	52	1,389	18,311	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		137	200	5,323	70,169	各種金融
INDUTRADE AB		-	235	5,131	67,627	資本財
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		117	123	2,592	34,169	資本財
INVESTOR AB		1,457	1,547	29,640	390,659	各種金融
INVESTOR AB-A SHS		413	447	8,912	117,470	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		
KINNEVIK AB - B	192	209	3,285	43,297	各種金融	
LIFCO AB-B SHS	186	196	3,596	47,407	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	62	65	3,080	40,595	各種金融	
LUNDIN ENERGY AB	161	-	-	-	エネルギー	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	1,152	1,300	12,859	169,489	資本財	
NORDEA BANK ABP	2,599	2,937	31,820	419,393	銀行	
SAGAX AB-B	128	160	3,642	48,007	不動産	
SANDVIK AB	912	915	17,468	230,229	資本財	
SECURITAS AB	253	260	2,353	31,017	商業・専門サービス	
SINCH AB	419	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,324	1,404	16,595	218,731	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	278	296	5,367	70,742	資本財	
SKF AB	308	328	5,687	74,958	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB	491	522	7,250	95,567	素材	
SVENSKA HANDELSBANKEN	1,193	1,264	13,422	176,913	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	734	778	12,919	170,280	銀行	
SWEDISH MATCH AB	1,277	1,308	15,065	198,567	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB	428	507	4,732	62,372	電気通信サービス	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	2,360	2,509	16,291	214,720	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB	2,291	2,371	6,930	91,349	電気通信サービス	
VOLVO AB	1,119	1,268	24,361	321,082	資本財	
VOLVO AB-A SHS	196	200	4,058	53,486	資本財	
VOLVO CAR AB-B	-	512	2,598	34,247	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	31,244 47	33,126 46	448,763 -	5,914,700 <1.0%>	
(ユーロ/アイルランド)			千ユーロ			
CRH PLC	624	654	2,490	360,610	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	134	143	1,912	277,017	消費者サービス	
KERRY GROUP PLC-A	128	136	1,257	182,090	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC	124	132	770	111,595	資本財	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	198	210	739	107,029	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,210 5	1,277 5	7,170 -	1,038,342 <0.2%>	
(ユーロ/オランダ)						
ABN AMRO BANK NV	341	360	420	60,943	銀行	
ADYEN NV	16	18	2,833	410,278	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	
(ユーロ/オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AEGON NV	1,427	1,523	716	103,745	保険
AIRBUS SE	477	508	5,824	843,381	資本財
AKZO NOBEL NV	151	155	1,091	158,081	素材
ASM INTERNATIONAL NV	37	40	1,012	146,661	半導体・半導体製造装置
ASML HOLDING NV	334	349	19,969	2,891,835	半導体・半導体製造装置
CNH INDUSTRIAL NV	823	880	1,310	189,824	資本財
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	422	449	450	65,252	食品・飲料・タバコ
EURONEXT NV	69	75	526	76,287	各種金融
EXOR NV	87	94	701	101,552	各種金融
FERRARI NV	102	108	2,262	327,664	自動車・自動車部品
HEINEKEN HOLDING NV	94	86	618	89,583	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN NV	210	222	1,952	282,706	食品・飲料・タバコ
IMCD NV	46	49	672	97,416	資本財
ING GROEP NV-CVA	3,155	3,348	3,829	554,574	銀行
INPOST SA	173	-	-	-	運輸
JDE PEET'S BV	82	86	244	35,430	食品・飲料・タバコ
JUST EAT TAKEAWAY	147	158	339	49,094	小売
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	842	893	2,465	356,997	食品・生活必需品小売り
KONINKLIJKE DSM NV	141	150	1,916	277,466	素材
KONINKLIJKE PHILIPS NV	741	755	1,036	150,157	ヘルスケア機器・サービス
NN GROUP NV	217	237	1,008	145,969	保険
OCI NV	-	91	326	47,275	素材
PROSUS	755	713	4,211	609,840	小売
QIAGEN NV	187	196	909	131,749	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD NV	96	101	557	80,800	商業・専門サービス
ROYAL KPN NV	2,798	2,931	821	118,955	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	551	586	2,171	314,400	半導体・半導体製造装置
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	587	623	1,292	187,165	メディア・娯楽
WOLTERS KLUWER NV	212	225	2,305	333,864	商業・専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,333 30	16,024 30	63,800 -	9,238,959 <1.5%>
(ユーロ/ベルギー)					
AGEAS	138	137	520	75,443	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	703	747	4,003	579,723	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE	37	47	1,691	244,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT NV	41	-	-	-	食品・生活必需品小売り
D'IETEREN GROUP	-	21	372	53,989	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
(ユーロ/ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ELIA GROUP SA/NV		25	28	389	56,388	公益事業
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		90	89	700	101,484	各種金融
KBC GROEP NV		201	213	1,119	162,091	銀行
PROXIMUS		131	141	150	21,856	電気通信サービス
SOFINA		11	12	282	40,839	各種金融
SOLVAY SA		60	63	626	90,705	素材
UCB SA		102	108	806	116,730	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE		159	179	613	88,827	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,704 12	1,790 12	11,276 -	1,632,971 <0.3%>	
(ユーロ/ルクセンブルグ)						
ARCELORMITTAL		512	446	1,118	161,962	素材
TENARIS SA		378	405	666	96,470	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	890 2	851 2	1,784 -	258,432 <0.0%>	
(ユーロ/フランス)						
ACCOR		137	147	361	52,365	消費者サービス
ADP		27	29	421	60,972	運輸
AIR LIQUIDE		384	450	6,153	891,021	素材
ALSTOM RGPT		257	274	671	97,221	資本財
AMUNDI SA		50	52	283	41,012	各種金融
ARKEMA		48	50	434	62,905	素材
AXA SA		1,571	1,603	4,341	628,746	保険
BIOMERIEUX		33	35	349	50,557	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS		908	952	5,077	735,204	銀行
BOLLORE SE		728	765	388	56,219	メディア・娯楽
BOUYGUES		186	202	584	84,612	資本財
BUREAU VERITAS SA		241	256	667	96,588	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA		129	140	2,506	363,004	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA		498	515	837	121,253	食品・生活必需品小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN		409	427	1,893	274,177	資本財
CNP ASSURANCES		137	-	-	-	保険
CREDIT AGRICOLE SA		1,003	1,029	998	144,629	銀行
DANONE		529	552	2,755	399,001	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA		19	21	315	45,655	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA		538	573	2,077	300,899	ソフトウェア・サービス
EDENRED		204	216	1,104	159,969	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	
(ユーロ/フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
EDF	382	484	578	83,767	公益事業
EIFFAGE	68	72	680	98,509	資本財
ENGIE	1,481	1,571	2,259	327,181	公益事業
ESSILORLUXOTTICA	233	247	4,298	622,499	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO	32	37	224	32,448	各種金融
EUROFINS SCIENTIFIC	108	115	767	111,101	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FAURECIA	98	-	-	-	自動車・自動車部品
GETLINK SE - REGR	401	411	650	94,160	運輸
HERMES INTERNATIONAL	25	27	4,004	579,859	耐久消費財・アパレル
IPSEN	30	32	335	48,569	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KERING	60	64	3,544	513,224	耐久消費財・アパレル
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	75	88	317	45,913	消費者サービス
LEGRAND SA	217	230	1,831	265,286	資本財
L'OREAL SA	203	207	7,212	1,044,511	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	224	238	16,668	2,413,711	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	136	581	1,526	221,120	自動車・自動車部品
ORANGE S.A.	1,650	1,751	1,717	248,670	電気通信サービス
ORPEA	41	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス
PERNOD-RICARD	169	180	3,344	484,257	食品・飲料・タバコ
PUBLICIS GROUPE	183	195	1,213	175,658	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	18	19	318	46,088	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	154	165	548	79,372	自動車・自動車部品
SAFRAN SA	276	294	3,374	488,695	資本財
SANOFI	921	979	8,426	1,220,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	22	23	784	113,633	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	437	466	6,636	960,970	資本財
SEB SA	22	21	161	23,328	耐久消費財・アパレル
SOCIETE GENERALE	650	677	1,627	235,699	銀行
SODEXO	71	76	677	98,137	消費者サービス
TELEPERFORMANCE	47	50	1,131	163,784	商業・専門サービス
THALES SA	85	91	1,072	155,297	資本財
TOTALENERGIES SE	2,029	2,130	12,227	1,770,650	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT	75	81	210	30,414	メディア・娯楽
VALEO SA	186	176	322	46,730	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	530	572	1,420	205,705	公益事業
VINCI SA	436	460	4,398	636,939	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/フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
VIVENDI SA		623	616	520	75,440	メディア・娯楽
WENDEL		23	23	207	30,022	各種金融
WORLDLINE SA		193	205	909	131,685	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	20,682	21,967	128,370	18,589,285	
	銘柄数<比率>	60	57	-	<3.1%>	
(ユーロ/ドイツ)						
ADIDAS AG		154	148	1,919	277,947	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE		330	351	7,160	1,036,850	保険
AROUNDTOWN SA		828	874	217	31,516	不動産
BASF SE		743	788	3,911	566,495	素材
BAYER AG		796	845	4,547	658,533	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		267	284	2,390	346,099	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		46	50	407	58,963	自動車・自動車部品
BECHTLE AG		65	70	257	37,224	ソフトウェア・サービス
BEIERSDORF AG		81	86	887	128,589	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG SE		124	132	869	125,898	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		32	34	454	65,829	ヘルスケア機器・サービス
COMMERZBANK AG		807	905	730	105,739	銀行
CONTINENTAL AG		88	93	531	76,991	自動車・自動車部品
COVESTRO AG		154	163	592	85,737	素材
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		332	388	1,169	169,305	資本財
DELIVERY HERO SE		132	140	621	90,004	小売
DEUTSCHE BANK AG		1,671	1,769	1,806	261,670	各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG		154	164	2,794	404,729	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG		484	520	381	55,253	運輸
DEUTSCHE POST AG		807	860	3,329	482,189	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG		2,644	2,803	5,419	784,852	電気通信サービス
E.ON SE		1,819	1,933	1,762	255,239	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG		169	177	345	50,061	素材
FRESENIUS SE & CO KGAA		339	358	875	126,804	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD		55	-	-	-	素材
GEA GROUP AG		123	130	520	75,398	資本財
HANNOVER RUECK SE		48	51	917	132,895	保険
HEIDELBERGCEMENT AG		120	120	623	90,296	素材
HELLOFRESH SE		132	139	334	48,374	食品・生活必需品小売り
HENKEL AG & CO KGAA		86	97	610	88,455	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG		142	147	986	142,803	家庭用品・パーソナル用品

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,057	1,122	3,602	521,622	半導体・半導体製造装置
KION GROUP AG	58	60	164	23,863	資本財
KNORR-BREMSE AG	59	62	340	49,240	資本財
LANXESS	64	-	-	-	素材
LEG IMMOBILIEN SE	59	62	396	57,390	不動産
MERCEDES-BENZ GROUP AG	691	688	4,285	620,569	自動車・自動車部品
MERCK KGAA	104	111	1,955	283,222	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	43	45	886	128,314	資本財
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	112	120	3,524	510,437	保険
NEMETSCHKE SE	46	49	230	33,410	ソフトウェア・サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	123	129	765	110,841	自動車・自動車部品
PUMA AG	85	90	466	67,510	耐久消費財・アパレル
RATIONAL AG	4	4	257	37,250	資本財
RHEINMETALL AG	-	37	670	97,130	資本財
RWE AG	518	554	2,285	331,023	公益事業
SAP SE	845	898	9,447	1,368,088	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	21	20	787	113,972	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCOUT24 SE	67	69	381	55,270	メディア・娯楽
SIEMENS AG	619	657	8,715	1,262,123	資本財
SIEMENS ENERGY AG	323	377	553	80,160	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	228	242	1,265	183,225	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG	108	114	1,278	185,190	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	926	986	234	33,953	電気通信サービス
UNIPER SE	75	80	43	6,337	公益事業
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	80	86	169	24,490	電気通信サービス
VOLKSWAGEN AG	27	25	489	70,927	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG	149	159	2,260	327,369	自動車・自動車部品
VONOVIA SE	599	617	1,503	217,722	不動産
ZALANDO SE	179	189	567	82,115	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	21,070 59	22,297 58	94,907 -	13,743,527 <2.3%>
(ユーロ/ポルトガル)					
EDP RENOVAVEIS SA	230	245	547	79,259	公益事業
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,250	2,396	1,062	153,833	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	410	432	486	70,431	エネルギー
JERONIMO MARTINS	225	240	492	71,319	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,117 4	3,315 4	2,588 -	374,843 <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		
ACCIONA SA	-	20	378	54,755	公益事業	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	192	201	532	77,152	資本財	
AENA SME SA	64	68	826	119,739	運輸	
AMADEUS IT GROUP SA	364	388	1,929	279,470	ソフトウェア・サービス	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	5,374	5,689	3,099	448,828	銀行	
BANCO SANTANDER SA	13,993	14,551	3,792	549,148	銀行	
CAIXABANK	3,550	3,771	1,281	185,530	銀行	
CELLNEX TELECOM SAU	416	468	1,561	226,127	電気通信サービス	
ENAGAS SA	203	219	379	54,932	公益事業	
ENDESA SA	255	270	504	73,074	公益事業	
FERROVIAL S.A.	402	425	1,059	153,421	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	406	-	-	-	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	-	435	19	2,835	資本財	
GRIFOLS SA	242	256	249	36,084	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA	4,709	5,108	5,409	783,346	公益事業	
INDITEX SA	880	936	2,257	326,980	小売	
NATURGY ENERGY GROUP SA	154	125	336	48,735	公益事業	
RED ELECTRICA DE ESPANA	350	348	603	87,376	公益事業	
REPSOL SA	1,158	1,232	1,699	246,132	エネルギー	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	192	205	371	53,739	資本財	
TELEFONICA SA	4,305	4,545	1,609	233,086	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	37,220 19	39,269 20	27,902 -	4,040,497 <0.7%>	
(ユーロ/イタリア)						
AMPLIFON SPA	99	106	293	42,507	ヘルスケア機器・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	891	949	1,637	237,195	保険	
ATLANTIA SPA	417	437	1,004	145,458	運輸	
DIASORIN ITALIA SPA	20	21	283	41,013	ヘルスケア機器・サービス	
ENEL SPA	6,581	6,983	3,601	521,530	公益事業	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	2,040	2,159	3,063	443,637	エネルギー	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,644	1,880	2,709	392,364	自動車・自動車部品	
FINCOBANK SPA	491	518	777	112,628	銀行	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	291	311	296	42,891	電気通信サービス	
INTESA SANPAOLO	13,358	14,122	3,129	453,195	銀行	
MEDIOBANCA SPA	500	518	527	76,453	銀行	
MONCLER SPA	165	175	875	126,819	耐久消費財・アパレル	
NEXI SPA	423	450	388	56,289	ソフトウェア・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	444	476	457	66,275	保険	
PRYSMIAN SPA	205	219	715	103,647	資本財	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	84	90	355	51,546	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	
(ユーロ/イタリア)					
SNAM SPA	百株	百株	千ユーロ	千円	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	1,626	1,754	836	121,195	電気通信サービス
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	8,152	8,810	196	28,451	公益事業
UNICREDIT SPA	1,139	1,213	887	128,514	銀行
	1,706	1,774	2,324	336,675	
小計	株数・金額	40,285	42,973	24,364	3,528,291
	銘柄数<比率>	20	20	-	<0.6%>
(ユーロ/フィンランド)					
ELISA OYJ	120	125	622	90,085	電気通信サービス
FORTUM OYJ	358	382	576	83,465	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	217	230	484	70,195	食品・生活必需品小売り
KONE OYJ	276	292	1,383	200,314	資本財
NESTE OYJ	339	361	1,634	236,655	エネルギー
NOKIA OYJ	4,359	4,646	2,182	315,981	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ORION OYJ-CLASS B	85	91	432	62,614	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ	403	412	1,972	285,681	保険
STORA ENSO OYJ	464	468	663	96,016	素材
UPM-KYMMENE OYJ	431	458	1,577	228,398	素材
WARTSILA OYJ	380	402	326	47,327	資本財
小計	株数・金額	7,438	7,873	11,855	1,716,737
	銘柄数<比率>	11	11	-	<0.3%>
(ユーロ/オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG	278	293	859	124,500	銀行
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	54	58	515	74,648	公益事業
OMV AG	116	124	604	87,545	エネルギー
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	117	-	-	-	銀行
VOESTALPINE AG	92	93	239	34,751	素材
小計	株数・金額	659	570	2,219	321,446
	銘柄数<比率>	5	4	-	<0.1%>
(ユーロ/その他)					
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	166	176	525	76,129	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	166	176	525	76,129
	銘柄数<比率>	1	1	-	<0.0%>
ユーロ計	株数・金額	149,777	158,388	376,765	54,559,464
	銘柄数<比率>	228	224	-	<9.1%>
合計	株数・金額	878,235	954,236	-	565,772,218
	銘柄数<比率>	1,222	1,210	-	<94.1%>

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	□数	□数	評価額		千円
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千□	千□	千米ドル		
BOSTON PROPERTIES INC	12	12	902		126,744
CROWN CASTLE INC	35	37	5,057		709,826
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11	13	1,998		280,525
PROLOGIS INC	59	79	9,077		1,274,102
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	118	37	746		104,737
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11	11	2,027		284,637
CAMDEN PROPERTY TRUST	8	8	988		138,792
DUKE REALTY CORP	30	—	—		—
EQUITY RESIDENTIAL	28	30	1,931		271,036
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5	5	1,180		165,748
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	43	46	1,143		160,434
WELLTOWER INC	35	38	2,641		370,811
HOST HOTELS AND RESORTS INC	58	61	1,131		158,852
KIMCO REALTY CORP	49	53	1,174		164,865
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9	9	1,559		218,956
PUBLIC STORAGE	12	13	3,982		558,920
REGENCY CENTERS CORP	12	13	864		121,273
SIMON PROPERTY GROUP INC	26	28	3,324		466,649
SUN COMMUNITIES INC	9	10	1,492		209,465
UDR INC	24	27	1,096		153,875
VENTAS INC	32	34	1,510		211,982
VORNADO REALTY TRUST	13	14	339		47,714
WP CAREY INC	14	16	1,318		185,107
REALTY INCOME CORP	45	51	3,349		470,129
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14	15	988		138,717
EXTRA SPACE STORAGE INC	10	11	1,820		255,526
DIGITAL REALTY TRUST INC	22	24	2,701		379,247
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	48	51	634		89,014
IRON MOUNTAIN INC	23	24	1,306		183,395
AGNC INVESTMENT CORP	42	—	—		—
AMERICAN TOWER REIT INC	36	39	8,472		1,189,222
EQUINIX INC	7	7	5,062		710,607
HEALTHCARE REALTY TRUST INCORPOR	—	32	639		89,825
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	—	26	853		119,820
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	—	21	1,097		154,047
SBA COMMUNICATIONS CORP	8	9	2,692		377,888
INVITATION HOMES INC	48	52	1,632		229,196
VICI PROPERTIES INC	50	82	2,668		374,581
小計	□数・金額	1,022	1,056	79,412	11,146,282
	銘柄数<比率>	35	36	—	<1.9%>

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		6	7	317	33,305
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		12	13	277	29,117
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	19	20	595	62,423
		2	2	—	<0.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル	
GPT GROUP		172	187	803	75,062
GOODMAN GROUP		139	148	2,717	253,874
STOCKLAND		209	228	836	78,181
MIRVAC GROUP		347	373	791	73,946
VICINITY CENTRES		338	372	713	66,604
SCENTRE GROUP		441	482	1,381	129,028
DEXUS/AU		96	106	802	74,950
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,745	1,898	8,046	751,647
		7	7	—	<0.1%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		170	183	10,098	181,263
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	170	183	10,098	181,263
		1	1	—	<0.0%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
CAPITALAND ASCENDAS REIT		273	287	791	80,783
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		395	455	924	94,399
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		253	273	451	46,078
CDL HOSPITALITY TRUSTS		5	—	—	—
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TR		172	199	348	35,599
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,101	1,216	2,516	256,860
		5	4	—	<0.0%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		71	74	302	50,465
LAND SECURITIES GROUP PLC		57	59	372	62,018
SEGRO PLC		96	102	852	142,064
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	225	236	1,527	254,548
		3	3	—	<0.0%>
(ユーロ/ベルギー)				千ユーロ	
WAREHOUSES DE PAUW SCA		—	12	331	48,011
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	—	12	331	48,011
		—	1	—	<0.0%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	□数	□数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	
KLEPIERRE	16	18	407	59,060	
GECINA SA	3	3	359	52,024	
COVIVIO	4	3	218	31,594	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10	10	520	75,390	
小計	□数・金額	34	36	1,505	218,068
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
ユーロ計	□数・金額	34	48	1,837	266,080
	銘柄数<比率>	4	5	—	<0.0%>
合計	□数・金額	4,319	4,659	—	12,919,106
	銘柄数<比率>	57	58	—	<2.1%>

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
外 S&P 500 EMINI FUTURE	13,108	—
国 FTSE 100	1,305	—
DJ EURO STOXX 50	3,283	—

(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

2022年11月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	565,772,218	93.2
投資信託証券	12,919,106	2.1
コール・ローン等、その他	28,190,825	4.6
投資信託財産総額	606,882,149	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21日における邦貨換算レートは、1米ドル140.36円、1カナダ・ドル104.82円、1オーストラリア・ドル93.41円、1香港ドル17.95円、1シンガポール・ドル102.07円、1ニュージーランド・ドル86.21円、1イギリス・ポンド166.59円、1イスラエル・シェケル40.408円、1スイス・フラン147.10円、1デンマーク・クローネ19.47円、1ノルウェー・クローネ13.74円、1スウェーデン・クローナ13.18円、1ユーロ144.81円です。

(注2) 外貨建純資産 (589,615,254千円) の投資信託財産総額 (606,882,149千円) に対する比率は97.2%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

(2022年11月21日現在)

項目	当期末
(A)資産	622,328,238,403円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	18,364,308,361
株 式(評価額)	565,772,218,149
投 資 信 託 証 券(評価額)	12,919,106,397
未 収 入 金	16,446,812,968
未 収 配 当 金	700,778,656
差 入 委 託 証 拠 金	8,125,013,872
(B)負債	20,875,843,929
未 払 金	15,836,185,046
未 払 解 約 金	5,039,648,281
そ の 他 未 払 費 用	10,602
(C)純 資 産 総 額(A - B)	601,452,394,474
元 本	196,274,174,923
次 期 繰 越 損 益 金	405,178,219,551
(D)受 益 権 総 口 数	196,274,174,923口
1万口当たり基準価額(C / D)	30,643円

(注1) 期首元本額	185,334,551,926円
期中追加設定元本額	24,836,221,270円
期中一部解約元本額	13,896,598,273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)	825,022,663円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,718,273,868円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,185,594,884円
DCニッセイ外国株式インデックスA(適格機関投資家限定)	2,032,763,097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)	1,412,743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)	6,943,163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)	7,433,298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)	3,496,818,251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	142,849,511,480円
DCニッセイ外国株式インデックス	33,441,839,240円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	2,076,464,020円
DCニッセイスターゲットデットファンド2055	294,419,641円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	178,471,014円
DCニッセイスターゲットデットファンド2045	330,717,293円
DCニッセイスターゲットデットファンド2035	616,417,169円
DCニッセイスターゲットデットファンド2025	16,828,661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)	87,947,391円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	6,246,980円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	8,988,067円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	3,838,200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)	21,274,392円
DCニッセイスターゲットデットファンド2060	213,426,091円
DCニッセイスターゲットデットファンド2050	140,608,871円
DCニッセイスターゲットデットファンド2040	304,173,587円
DCニッセイスターゲットデットファンド2030	219,200,953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)	195,635,840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	199,656,819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)	197,031,619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)	193,095,563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)	193,060,286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)	173,825,784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)	28,452,808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)	979,463,778円
F Wニッセイ先進国株式インデックス	17,645,667円
DCニッセイスターゲットデットファンド2065	11,671,742円

損益の状況

当期(2022年5月21日~2022年11月21日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	5,060,935,024円
受 取 配 当 金	5,013,437,177
受 取 の 他 収 益	13,899,753
支 払 利 息	35,946,992
△	2,348,898
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	54,816,002,381
売 買 損 益	86,284,932,039
△	31,468,929,658
(C)先 物 取 引 等 損 益	△ 172,058,869
取 引 損 益	2,235,089,847
△	2,407,148,716
(D)信 託 報 酬 等	△ 61,945,344
(E)当期損益金(A + B + C + D)	59,642,933,192
(F)前期繰越損益金	324,872,915,991
(G)追加信託差損益金	48,473,060,431
(H)解約差損益金	△ 27,810,690,063
(I)合 計(E + F + G + H)	405,178,219,551
次 期 繰 越 損 益 金(I)	405,178,219,551

- (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。