

第7期末 (2020年11月20日)

基準価額	11,858円
純資産総額	148億円
騰落率	4.6%
分配金	0円

<購入・換金手数料なし> ニッセイ外国債券 インデックスファンド

追加型投信／海外／債券／インデックス型

運用報告書(全体版)

作成対象期間:2019年11月21日～2020年11月20日

第7期(決算日 2020年11月20日)

受益者の皆様へ


平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド」は、このたび第7期の決算を行いました。

当ファンドは、「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 0120-762-506 (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

 <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

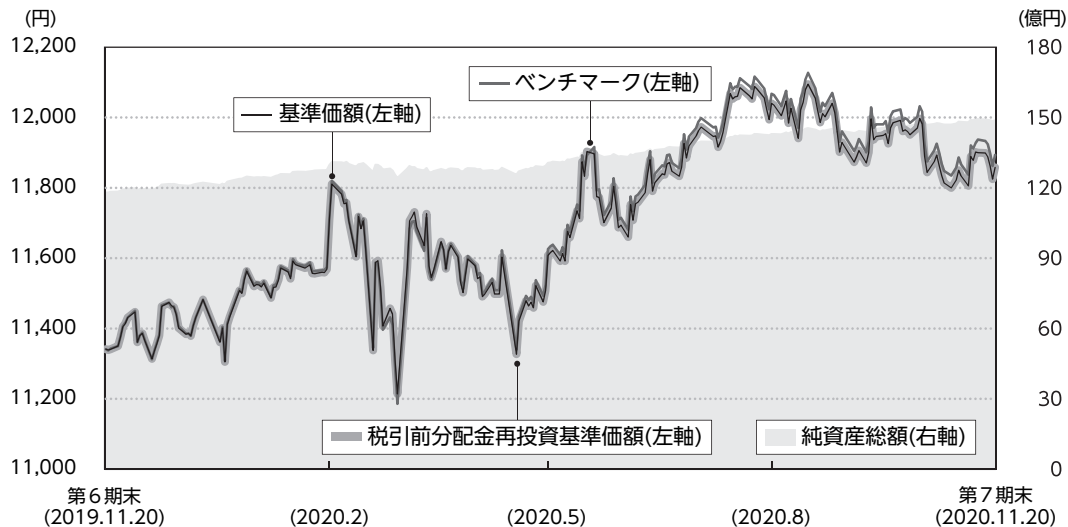
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2019年11月21日～2020年11月20日

基準価額等の推移



第7期首	11,341円	既払分配金	0円
第7期末	11,858円	騰落率(分配金再投資ベース)	4.6%

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

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金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F T S E 世界国債インデックス(除く日本、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>

- ・2020年5月から8月にかけて、経済活動再開の動きに加えて、新型コロナウイルスの治療薬開発や欧州復興基金への期待感などからユーロが対円で上昇したこと

<下落要因>

- ・2020年2月下旬から3月上旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大懸念を背景とした投資家のリスク回避姿勢などから米ドルが対円で下落したこと

1万口当たりの費用明細

項目	第7期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	18円	0.154%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は11,712円です。
(投信会社)	(8)	(0.066)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(8)	(0.066)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
その他費用	4	0.035	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$
(保管費用)	(4)	(0.034)	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)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	22	0.188	

(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、その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

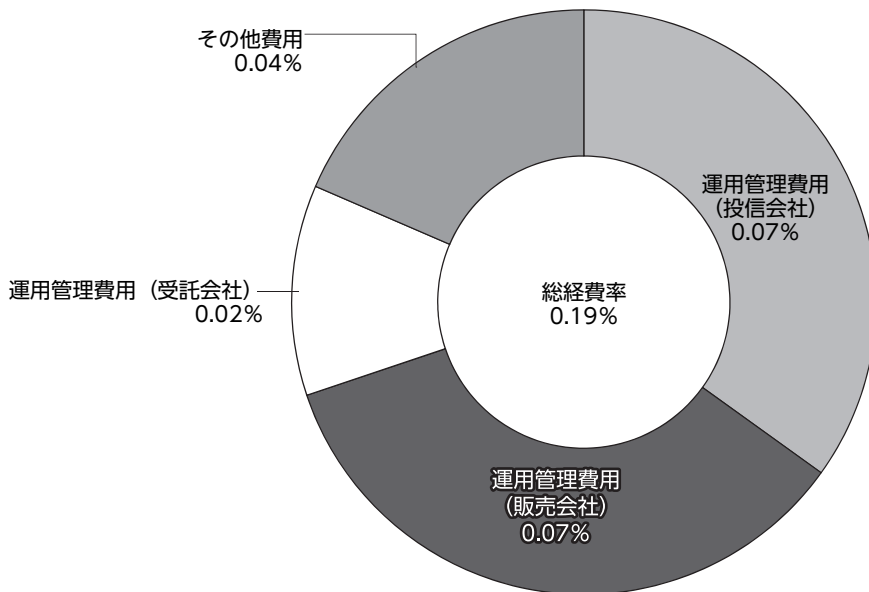
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

(参考情報)

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.19%**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

■ 海外債券市況

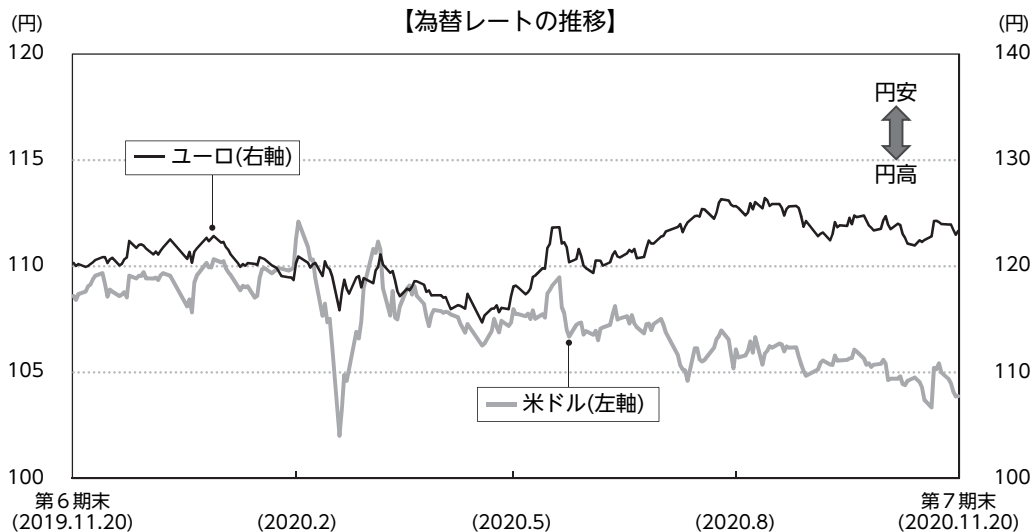


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、期初以降、米中貿易協議への進展期待などから上昇しましたが、年明け以降は中東情勢の緊迫化などから低下し、その後も新型コロナウイルスの感染拡大懸念などを受けて低下を続けました。3月中旬には財政支出の増大懸念などから金利は上昇しましたが、その後は各国中央銀行の大規模緩和策などが低下圧力となり、徐々に低下しました。4月以降は同ウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感などが上昇要因となる一方、同ウイルスの感染再拡大への警戒感などから金利は上下する展開となり、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初以降、イギリスの欧州連合（EU）離脱を巡る不透明要因の低下などから上昇しましたが、年明け以降は中東情勢の緊迫化などを受けて低下し、新型コロナウイルスの感染拡大懸念等からさらに低下しました。3月中旬には財政支出の増大懸念などから金利は上昇しましたが、各国中央銀行の大規模緩和策等が低下圧力となり、徐々に低下しました。4月以降は同ウイルスの治療薬開発やEUの復興基金への期待感などが上昇要因となる一方、同ウイルスの感染再拡大への警戒感から金利は低下基調となり、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

■為替市況



当期の米ドル／円レートは下落しました。期初以降、対円でおおむね横ばいで推移した後、2020年1月には中東情勢や新型コロナウイルスの感染拡大懸念等から上下しました。2月に入り堅調な株式市場などを背景に上昇しましたが、同ウイルスの感染拡大懸念が強まったことから、3月上旬にかけて大きく下落しました。その後は企業や機関投資家による流動性確保の動きから米ドル需要が旺盛となり急反発しましたが、各国中央銀行の流動性供給策を受けて、5月上旬まで下落しました。以降は同ウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感などから上昇する場面もありましたが、米中对立懸念や感染再拡大への懸念などもあり、米ドルはおおむね下落基調となりました。

当期のユーロ／円レートは上昇しました。期初以降、対円では横ばい推移した後、新型コロナウイルスの感染拡大懸念等を背景に5月上旬まで下落基調となりました。その後は欧米における同ウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感などからユーロは上昇しましたが、6月に入ると感染拡大第2波への警戒感などから下落しました。7月以降は欧州復興基金への期待感などもあり上昇基調となりましたが、9月から当期末にかけてはイギリス・EU間の通商交渉への観測などを背景に、ユーロは上下しつつおおむね横ばいとなりました。

ポートフォリオ

■当ファンド

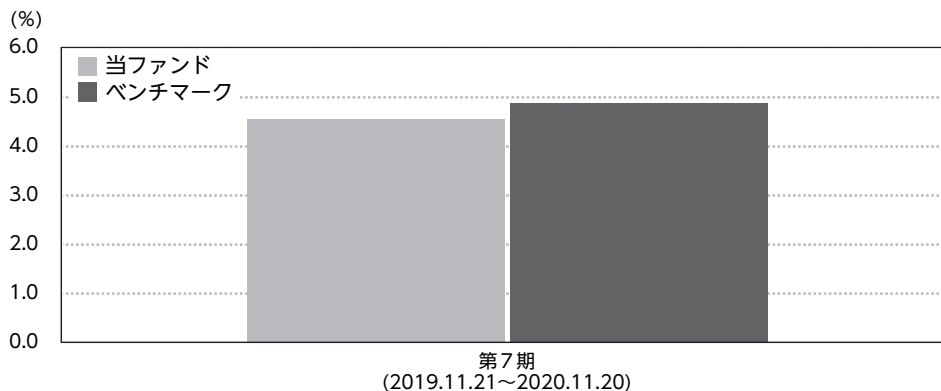
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

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

*ベンチマークはF T S E 世界国債インデックス（除く日本、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+4.6%となり、ベンチマーク騰落率（+4.9%）におおむね連動しました。

(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 2019年11月21日～2020年11月20日
当期分配金(税引前)	—
対基準価額比率	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,629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国の国債に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

■マザーファンド

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

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■組入ファンド

	第7期末 2020年11月20日
ニッセイ外国債券インデックス 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。

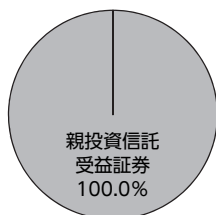
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

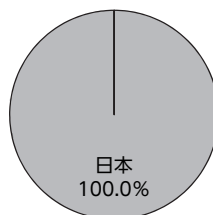
項目	第7期末 2020年11月20日
純資産総額	14,870,805,047円
受益権総口数	12,540,215,869口
1万口当たり基準価額	11,858円

(注) 当期間中における追加設定元本額は5,074,714,628円、同解約元本額は2,925,304,127円です。

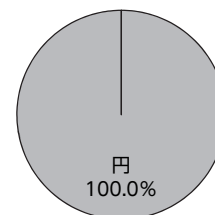
■資産別配分



■国別配分



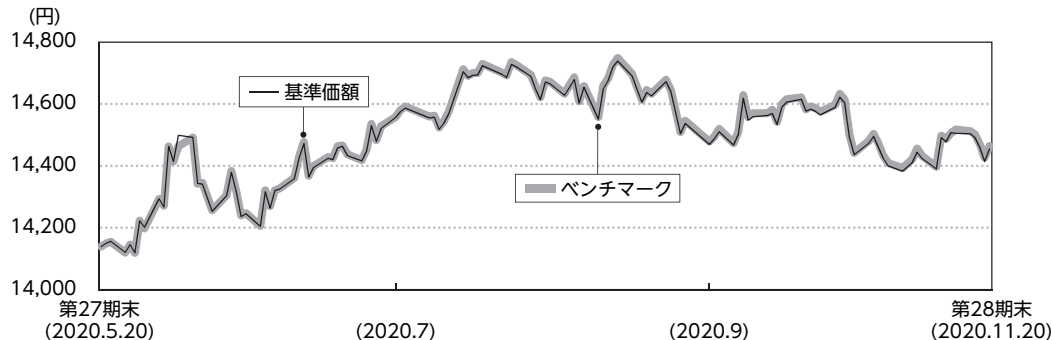
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2020年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

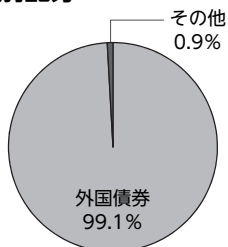
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.0% 2025/8/15	米ドル	0.9%
US TREASURY 2.375% 2024/8/15	米ドル	0.8
US TREASURY 1.625% 2022/8/15	米ドル	0.8
US TREASURY 2.25% 2024/11/15	米ドル	0.8
US TREASURY 2.0% 2025/2/15	米ドル	0.8
US TREASURY 1.75% 2022/5/15	米ドル	0.7
US TREASURY 2.5% 2024/5/15	米ドル	0.7
US TREASURY 2.5% 2023/8/15	米ドル	0.7
US TREASURY 2.125% 2025/5/15	米ドル	0.7
US TREASURY 1.75% 2023/5/15	米ドル	0.7
組入銘柄数		642

■ 1万口当たりの費用明細

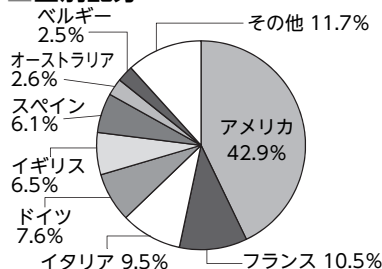
2020.5.21~2020.11.20

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

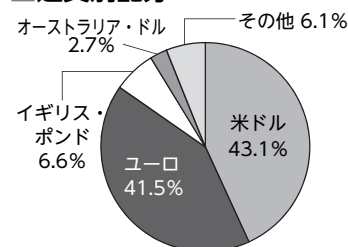
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2020年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 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	債券 組入比率	純資産 総額
				基準価額+ 累計分配金				
	円	円	%	円		%	%	百万円
3期(2016年11月21日)	10,303	0	△10.4	10,303	10,443	△10.2	98.7	4,494
4期(2017年11月20日)	11,156	0	8.3	11,156	11,339	8.6	98.8	7,564
5期(2018年11月20日)	10,892	0	△2.4	10,892	11,099	△2.1	99.1	9,632
6期(2019年11月20日)	11,341	0	4.1	11,341	11,580	4.3	99.1	11,784
7期(2020年11月20日)	11,858	0	4.6	11,858	12,144	4.9	99.1	14,870

(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) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」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	債券 組入比率	
			%			%
	円		%		%	%
(期首)2019年11月20日	11,341		—	11,580	—	99.1
11月末	11,431		0.8	11,673	0.8	99.1
12月末	11,482		1.2	11,724	1.2	99.2
2020年1月末	11,572		2.0	11,821	2.1	99.0
2月末	11,707		3.2	11,956	3.2	99.0
3月末	11,726		3.4	11,961	3.3	98.9
4月末	11,498		1.4	11,751	1.5	98.7
5月末	11,659		2.8	11,920	2.9	100.9
6月末	11,841		4.4	12,116	4.6	99.6
7月末	11,957		5.4	12,237	5.7	99.2
8月末	11,941		5.3	12,223	5.6	99.5
9月末	11,996		5.8	12,282	6.1	99.1
10月末	11,814		4.2	12,098	4.5	99.2
(期末)2020年11月20日	11,858		4.6	12,144	4.9	99.1

(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>ニッセイ外国債券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

2019年11月21日～2020年11月20日

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	4,166,404	5,944,542	2,416,312	3,442,264

(注) 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

2019年11月21日～2020年11月20日

当期における利害関係人との取引はありません。

親投資信託残高

2020年11月20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
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	8,537,605	10,287,697	14,870,866

(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債券インデックスマザーファンド全体の口数は22,593,334千口です。

投資信託財産の構成

2020年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	14,870,866	99.6
コール・ローン等、その他	55,503	0.4
投資信託財産総額	14,926,369	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル103.88円、1カナダ・ドル79.43円、1オーストラリア・ドル75.60円、1シンガポール・ドル77.26円、1イギリス・ポンド137.68円、1イスラエル・シケル31.04円、1デンマーク・クローネ16.55円、1ノルウェー・クローネ11.53円、1スウェーデン・クローナ12.08円、1メキシコ・ペソ5.14円、1マレーシア・リングギット25.38円、1ポーランド・ズロチ27.59円、1ユーロ123.34円です。

(注2) ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(32,615,187千円)の投資信託財産総額(32,748,830千円)に対する比率は99.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	14,926,369,709円
コール・ローン等	10,758,546
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	14,870,866,571
未収入金	44,744,592
(B)負債	55,564,662
未払解約金	44,555,309
未払信託報酬	10,931,355
その他未払費用	77,998
(C)純資産総額(A-B)	14,870,805,047
元本	12,540,215,869
次期繰越損益金	2,330,589,178
(D)受益権総口数	12,540,215,869口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,858円

(注) 期首元本額 10,390,805,368円
 期中追加設定元本額 5,074,714,628円
 期中一部解約元本額 2,925,304,127円

損益の状況

当期(2019年11月21日~2020年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 2,299円
受取利息	335
支払利息	△ 2,634
(B)有価証券売買損益	494,159,567
売買益	579,687,542
売買損	△ 85,527,975
(C)信託報酬等	△ 20,678,030
(D)当期損益金(A+B+C)	473,479,238
(E)前期繰越損益金	281,657,283
(分配準備積立金)	(437,206,521)
(繰越欠損金)	(△ 155,549,238)
(F)追加信託差損益金*	1,575,452,657
(配当等相当額)	(2,533,161,863)
(売買損益相当額)	(△ 957,709,206)
(G)合計(D+E+F)	2,330,589,178
次期繰越損益金(G)	2,330,589,178
追加信託差損益金	1,575,452,657
(配当等相当額)	(2,541,808,049)
(売買損益相当額)	(△ 966,355,392)
分配準備積立金	755,136,521

(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	263,040,922円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	54,889,078円
(c) 信託約款に定める収益調整金	2,541,808,049円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	437,206,521円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	3,296,944,570円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	2,629.10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

代表取締役社長に大関洋が就任いたしました。

(2020年3月25日)

当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信 託 期 間	無期限	
運 用 方 針	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を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> ニッセイ外国債券 インデックスファンド	ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ外国債券 インデックス マザーファンド	日本を除く主要国の国債
運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイ外国債券 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。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ外国債券 インデックス マザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。	

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 28 期

(計算期間：2020年5月21日～2020年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く主要国の国債

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

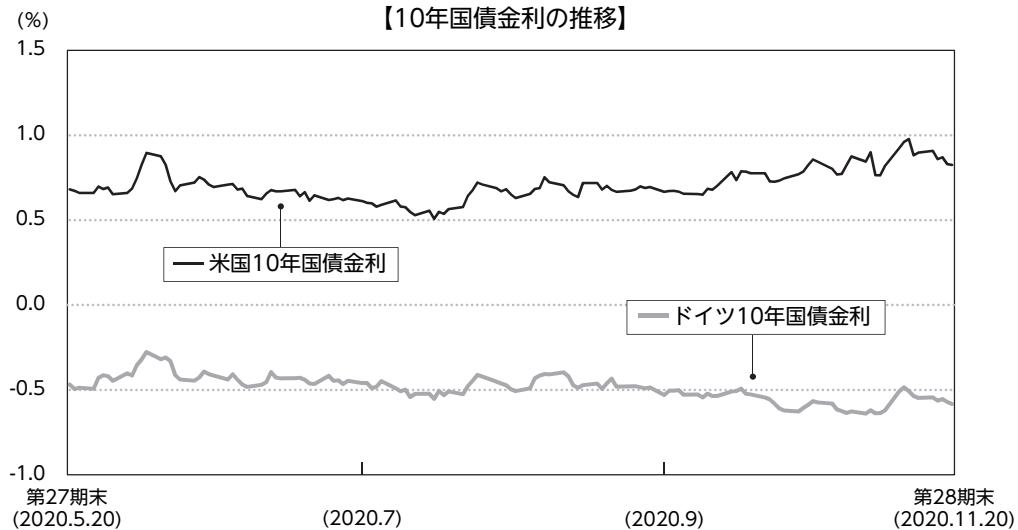
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2020年5月21日～2020年11月20日

投資環境

海外債券市況

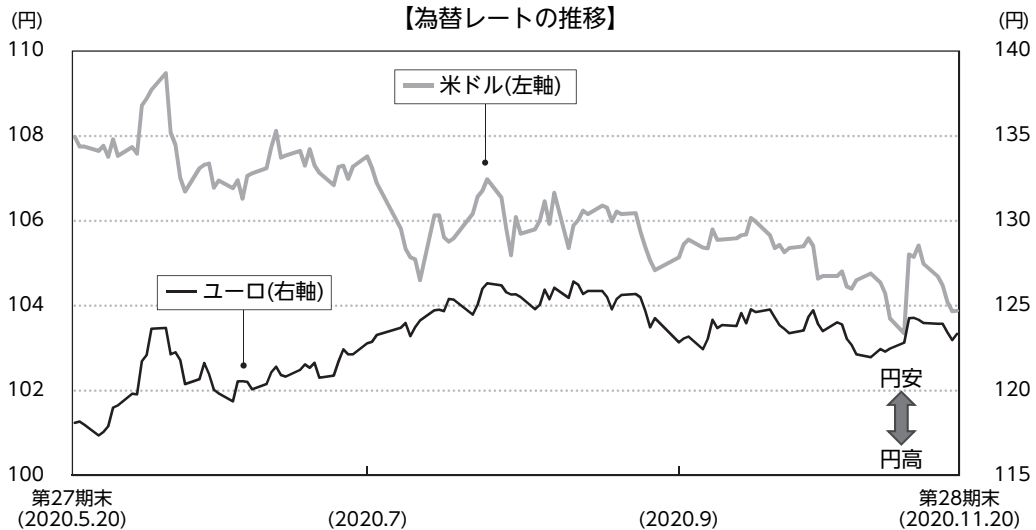


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、期初以降、新型コロナウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感などが上昇要因となる一方、同ウイルスの感染再拡大に対する警戒感などもあったことから上下に推移し、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初以降、新型コロナウイルスの治療薬開発や欧州連合（EU）の復興基金への期待感などが上昇要因となる一方、同ウイルスの感染再拡大への警戒感が低下要因となり、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

■為替市況

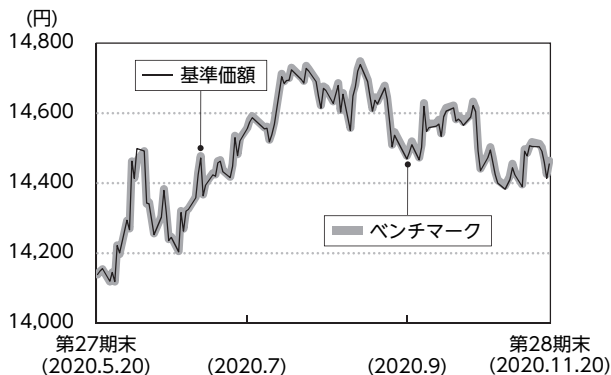


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは下落しました。期初以降、新型コロナウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感等から上昇する場面もありましたが、米中対立懸念や同ウイルスの感染再拡大への懸念などもあり、米ドルはおおむね下落基調で推移しました。

当期のユーロ／円レートは上昇しました。期初以降、欧米における新型コロナウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感などから上昇しました。その後、6月に入ると同ウイルスの感染拡大第2波への警戒感などから下落しましたが、7月以降は欧州復興基金への期待感などもあり上昇基調となりました。9月から当期末にかけてはイギリス・EU間の通商交渉への観測などを背景に、ユーロは上下しつつもおおむね横ばいで推移しました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・ 期初から8月にかけて、新型コロナウイルスの治療薬開発や欧州復興基金への期待感などからユーロが対円で上昇したこと

<下落要因>

- ・ 9月頃、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念などを背景とした投資家のリスク回避姿勢により、ユーロが対円で下落したこと

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+2.2%となり、ベンチマーク騰落率(+2.3%)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国債に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	債券組入比率	純資産総額
24期(2018年11月20日)	13,234	△0.0	13,366	△0.0	99.1	17,768
25期(2019年5月20日)	13,428	1.5	13,563	1.5	99.1	19,686
26期(2019年11月20日)	13,803	2.8	13,945	2.8	99.1	24,872
27期(2020年5月20日)	14,139	2.4	14,296	2.5	99.0	26,883
28期(2020年11月20日)	14,455	2.2	14,625	2.3	99.1	32,658

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	債券組入比率
(期首)2020年5月20日	14,139	—	14,296	—	99.0
5月末	14,201	0.4	14,355	0.4	100.9
6月末	14,425	2.0	14,591	2.1	99.6
7月末	14,568	3.0	14,737	3.1	99.2
8月末	14,551	2.9	14,719	3.0	99.5
9月末	14,619	3.4	14,791	3.5	99.1
10月末	14,400	1.8	14,569	1.9	99.2
(期末)2020年11月20日	14,455	2.2	14,625	2.3	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2020年5月21日～2020年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	3円	0.018%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.018)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	3	0.018	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（14,495円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2020年5月21日～2020年11月20日

公社債

		買付額	売付額	
外国	アメリカ	千米ドル 34,214	千米ドル 12,425	
	カナダ	千カナダ・ドル 2,592	千カナダ・ドル 1,069	
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 4,088	千オーストラリア・ドル 347	
	シンガポール	千シンガポール・ドル 481	千シンガポール・ドル 222	
	イギリス	千イギリス・ポンド 3,722	千イギリス・ポンド 969	
	イスラエル	千イスラエル・シェケル 1,252	千イスラエル・シェケル 103	
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 2,361	千デンマーク・クローネ -	
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 1,223	千ノルウェー・クローネ 1,169	
	スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 2,053	千スウェーデン・クローナ -	
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 9,673	千メキシコ・ペソ 3,201	
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 1,461	千マレーシア・リンギット 457	
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 2,182	千ポーランド・ズロチ 838	
	ユーロ	アイルランド	千ユーロ 458	千ユーロ -
		オランダ	1,134	279
		ベルギー	1,170	303
		フランス	5,885	1,067
		ドイツ	4,960	1,405
		スペイン	3,318	842
		イタリア	5,510	1,970
フィンランド		366	-	
オーストリア	792	260		

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2020年5月21日～2020年11月20日

公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
US TREASURY	165,133	US TREASURY	240,207
US TREASURY	164,991	US TREASURY	182,629
US TREASURY	157,250	US TREASURY	181,270
US TREASURY	144,425	US TREASURY	179,155
US TREASURY	138,065	US TREASURY	163,903
US TREASURY	135,731	US TREASURY	94,113
US TREASURY	125,466	FRANCE (GOVT OF)	71,655
US TREASURY	110,886	US TREASURY	58,221
US TREASURY	107,960	BUONI POLIENNALI DEL TES	52,745
US TREASURY	98,709	BUONI POLIENNALI DEL TES	45,981

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2020年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	122,640	134,720	13,994,787	42.9	—	18.7	15.9	8.2
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	7,330	8,163	648,428	2.0	—	0.9	0.6	0.5
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア	10,180	11,434	864,482	2.6	—	1.9	0.6	0.2
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	1,610	1,835	141,780	0.4	—	0.3	0.1	0.1
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	12,020	15,488	2,132,511	6.5	—	5.1	1.1	0.4
	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル						
イスラエル	3,910	4,546	141,117	0.4	—	0.2	0.2	—

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

区分	当期末								
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	%	%	%	%	%	
デンマーク	8,750	10,971	181,577	0.6	—	0.4	0.1	0.1	
	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ							
ノルウェー	5,710	6,091	70,238	0.2	—	0.1	0.1	—	
	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ							
スウェーデン	7,920	8,836	106,739	0.3	—	0.2	0.1	0.1	
	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ							
メキシコ	45,710	51,116	262,739	0.8	—	0.4	0.2	0.1	
	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット							
マレーシア	5,890	6,381	161,974	0.5	—	0.3	0.1	0.1	
	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ							
ポーランド	6,780	7,453	205,646	0.6	—	0.3	0.2	0.1	
	千ユーロ	千ユーロ							
ユーロ	アイルランド	1,920	2,227	274,772	0.8	—	0.6	0.2	0.1
	オランダ	4,280	5,223	644,253	2.0	—	1.3	0.5	0.2
	ベルギー	5,250	6,685	824,600	2.5	—	1.9	0.4	0.2
	フランス	22,580	27,782	3,426,640	10.5	—	7.3	2.4	0.9
	ドイツ	16,690	20,187	2,489,941	7.6	—	4.7	2.0	1.0
	スペイン	13,240	16,248	2,004,115	6.1	—	4.0	1.6	0.5
	イタリア	20,900	25,088	3,094,383	9.5	—	6.0	2.3	1.1
	フィンランド	1,480	1,679	207,125	0.6	—	0.4	0.2	0.1
オーストリア	3,200	4,011	494,746	1.5	—	1.0	0.4	0.1	
合計	—	—	32,372,603	99.1	—	56.0	29.3	13.8	

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/02/15	100	128	13,393
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	120	165	17,195
	US TREASURY	5.5000	2028/08/15	90	122	12,766
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	120	162	16,901
	US TREASURY	5.2500	2029/02/15	80	109	11,344
	US TREASURY	5.3750	2031/02/15	120	173	18,057
	US TREASURY	2.0000	2021/11/15	1,990	2,026	210,564
	US TREASURY	2.6250	2021/12/15	1,770	1,817	188,765
	US TREASURY	2.1250	2021/12/31	1,710	1,747	181,574
	US TREASURY	2.0000	2022/02/15	2,170	2,220	230,622
	US TREASURY	2.3750	2022/03/15	1,720	1,770	183,914
	US TREASURY	1.7500	2022/03/31	1,670	1,706	177,252
	US TREASURY	1.7500	2022/05/15	2,290	2,343	243,487
	US TREASURY	1.7500	2022/06/15	1,960	2,008	208,654
	US TREASURY	2.1250	2022/06/30	1,930	1,990	206,791
	US TREASURY	1.6250	2022/08/15	2,380	2,440	253,472
	US TREASURY	1.6250	2022/08/31	2,030	2,082	216,321
	US TREASURY	1.7500	2022/09/30	1,940	1,996	207,429
	US TREASURY	1.6250	2022/11/15	1,700	1,748	181,637
	US TREASURY	1.6250	2022/12/15	1,290	1,328	137,998
	US TREASURY	2.1250	2022/12/31	1,200	1,249	129,758
	US TREASURY	2.0000	2023/02/15	1,820	1,893	196,659
	US TREASURY	1.5000	2023/02/28	1,140	1,173	121,942
	US TREASURY	1.5000	2023/03/31	1,290	1,329	138,144
	US TREASURY	1.7500	2023/05/15	2,160	2,242	232,979
	US TREASURY	0.2500	2023/06/15	1,500	1,501	156,014
	US TREASURY	1.3750	2023/06/30	1,390	1,432	148,820
	US TREASURY	2.5000	2023/08/15	2,170	2,305	239,508
	US TREASURY	0.1250	2023/09/15	1,580	1,575	163,706
	US TREASURY	1.3750	2023/09/30	1,580	1,632	169,586
	US TREASURY	2.7500	2023/11/15	1,950	2,096	217,780
	US TREASURY	2.2500	2023/12/31	1,200	1,275	132,470
	US TREASURY	2.7500	2024/02/15	1,930	2,086	216,713
	US TREASURY	2.1250	2024/03/31	1,260	1,338	139,078
	US TREASURY	2.5000	2024/05/15	2,170	2,338	242,880
	US TREASURY	2.0000	2024/06/30	1,240	1,317	136,841
	US TREASURY	2.3750	2024/08/15	2,290	2,468	256,404

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千円	千ドル
アメリカ	%		千円	千ドル	千円
国債証券					
US TREASURY	2.1250	2024/09/30	1,290	1,380	143,432
US TREASURY	2.2500	2024/11/15	2,250	2,423	251,734
US TREASURY	2.2500	2024/12/31	1,400	1,510	156,951
US TREASURY	2.0000	2025/02/15	2,210	2,365	245,716
US TREASURY	2.6250	2025/03/31	1,430	1,571	163,275
US TREASURY	2.1250	2025/05/15	2,130	2,297	238,713
US TREASURY	2.7500	2025/06/30	1,540	1,708	177,478
US TREASURY	2.0000	2025/08/15	2,490	2,680	278,484
US TREASURY	3.0000	2025/09/30	1,530	1,723	179,002
US TREASURY	2.2500	2025/11/15	1,570	1,713	178,004
US TREASURY	2.6250	2025/12/31	630	700	72,783
US TREASURY	1.6250	2026/02/15	1,280	1,359	141,255
US TREASURY	2.2500	2026/03/31	840	920	95,657
US TREASURY	1.6250	2026/05/15	1,390	1,478	153,575
US TREASURY	1.8750	2026/06/30	600	646	67,189
US TREASURY	1.5000	2026/08/15	1,340	1,416	147,197
US TREASURY	1.6250	2026/09/30	680	724	75,234
US TREASURY	2.0000	2026/11/15	1,190	1,294	134,447
US TREASURY	1.7500	2026/12/31	620	665	69,165
US TREASURY	2.2500	2027/02/15	1,160	1,282	133,176
US TREASURY	0.6250	2027/03/31	590	592	61,549
US TREASURY	2.3750	2027/05/15	1,500	1,673	173,829
US TREASURY	0.5000	2027/06/30	910	904	93,994
US TREASURY	2.2500	2027/08/15	1,950	2,164	224,799
US TREASURY	0.3750	2027/09/30	840	826	85,841
US TREASURY	2.2500	2027/11/15	790	878	91,249
US TREASURY	2.7500	2028/02/15	930	1,068	111,016
US TREASURY	2.8750	2028/05/15	1,000	1,161	120,646
US TREASURY	2.8750	2028/08/15	990	1,153	119,789
US TREASURY	3.1250	2028/11/15	980	1,164	120,917
US TREASURY	2.6250	2029/02/15	960	1,105	114,851
US TREASURY	2.3750	2029/05/15	800	907	94,234
US TREASURY	1.6250	2029/08/15	680	729	75,817
US TREASURY	1.7500	2029/11/15	580	629	65,373
US TREASURY	1.5000	2030/02/15	1,010	1,073	111,467
US TREASURY	0.6250	2030/08/15	1,590	1,557	161,839
US TREASURY	4.5000	2036/02/15	120	177	18,482
US TREASURY	5.0000	2037/05/15	100	158	16,474

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	4.3750	2038/02/15	100	150	15,640
	US TREASURY	4.5000	2038/05/15	110	168	17,485
	US TREASURY	3.5000	2039/02/15	130	178	18,583
	US TREASURY	4.2500	2039/05/15	190	285	29,695
	US TREASURY	4.5000	2039/08/15	190	294	30,604
	US TREASURY	4.3750	2039/11/15	200	306	31,840
	US TREASURY	4.6250	2040/02/15	200	316	32,826
	US TREASURY	1.1250	2040/05/15	820	789	81,973
	US TREASURY	1.1250	2040/08/15	720	690	71,777
	US TREASURY	3.8750	2040/08/15	190	275	28,652
	US TREASURY	4.2500	2040/11/15	200	304	31,637
	US TREASURY	4.7500	2041/02/15	210	339	35,297
	US TREASURY	3.1250	2041/11/15	190	251	26,147
	US TREASURY	3.1250	2042/02/15	240	318	33,111
	US TREASURY	3.0000	2042/05/15	200	260	27,070
	US TREASURY	2.7500	2042/08/15	280	351	36,519
	US TREASURY	2.7500	2042/11/15	360	451	46,928
	US TREASURY	3.1250	2043/02/15	350	465	48,343
	US TREASURY	2.8750	2043/05/15	470	602	62,549
	US TREASURY	3.6250	2043/08/15	390	558	57,981
	US TREASURY	3.7500	2043/11/15	380	554	57,570
	US TREASURY	3.6250	2044/02/15	480	688	71,560
	US TREASURY	3.3750	2044/05/15	460	637	66,237
	US TREASURY	3.1250	2044/08/15	510	681	70,807
	US TREASURY	3.0000	2044/11/15	470	616	64,067
	US TREASURY	2.5000	2045/02/15	530	640	66,540
	US TREASURY	3.0000	2045/05/15	440	578	60,106
	US TREASURY	2.8750	2045/08/15	440	567	58,945
	US TREASURY	3.0000	2045/11/15	320	422	43,845
	US TREASURY	2.5000	2046/02/15	480	581	60,403
	US TREASURY	2.5000	2046/05/15	480	581	60,430
	US TREASURY	2.2500	2046/08/15	510	590	61,333
	US TREASURY	2.8750	2046/11/15	440	570	59,247
	US TREASURY	3.0000	2047/02/15	450	596	62,015
	US TREASURY	3.0000	2047/05/15	340	451	46,910
	US TREASURY	2.7500	2047/08/15	510	648	67,417
	US TREASURY	2.7500	2047/11/15	520	662	68,813
	US TREASURY	3.0000	2048/02/15	600	799	83,007

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	3.1250	2048/05/15	610	830	86,311
	US TREASURY	3.0000	2048/08/15	680	907	94,312
	US TREASURY	3.3750	2048/11/15	690	983	102,147
	US TREASURY	3.0000	2049/02/15	730	977	101,502
	US TREASURY	2.8750	2049/05/15	730	956	99,348
	US TREASURY	2.2500	2049/08/15	750	871	90,542
	US TREASURY	2.3750	2049/11/15	650	775	80,564
	US TREASURY	2.0000	2050/02/15	790	871	90,553
	US TREASURY	1.3750	2050/08/15	1,090	1,036	107,673
	US TREASURY	6.2500	2030/05/15	110	165	17,169
	US TREASURY	0.6250	2030/05/15	1,280	1,256	130,576
	US TREASURY	4.3750	2040/05/15	200	307	31,986
	US TREASURY	4.3750	2041/05/15	180	279	29,037
	US TREASURY	3.7500	2041/08/15	200	287	29,901
	US TREASURY	1.2500	2050/05/15	910	838	87,145
小計		-	-	-	-	13,994,787
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.7500	2064/12/01	60	91	7,257
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2021/11/01	120	121	9,625
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2022/02/01	110	111	8,871
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2022/03/01	230	230	18,332
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2022/05/01	170	173	13,749
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2022/06/01	170	176	14,020
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2022/08/01	260	259	20,651
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2022/09/01	340	344	27,362
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2022/11/01	460	459	36,525
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2023/03/01	370	382	30,370
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2023/06/01	200	206	16,372
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2023/09/01	370	387	30,776
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2024/03/01	150	159	12,667
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2024/04/01	120	119	9,511
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2024/06/01	160	172	13,679
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2024/09/01	200	208	16,582
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2025/03/01	200	207	16,482
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2025/06/01	170	184	14,630
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2025/09/01	550	552	43,870
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2026/03/01	90	89	7,075
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/06/01	180	190	15,107

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千カナダ・ドル	千円
カナダ		%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2027/06/01	180	185	14,750
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0000	2027/06/01	60	88	7,054
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/06/01	160	177	14,069
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/06/01	170	193	15,343
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2029/06/01	140	199	15,856
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2030/06/01	580	609	48,429
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2030/12/01	130	126	10,085
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/06/01	170	269	21,414
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/06/01	130	211	16,792
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/06/01	150	232	18,430
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/01	220	332	26,442
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/01	200	274	21,812
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2051/12/01	360	433	34,424
	小計		-	-	-	-
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0000	2021/12/21	260	265	20,068
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2022/07/15	360	393	29,753
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2022/11/21	410	427	32,325
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5000	2023/04/21	500	564	42,702
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/04/21	660	719	54,389
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.2500	2024/11/21	280	280	21,223
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/04/21	500	566	42,811
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.2500	2025/11/21	360	359	27,150
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/04/21	510	617	46,648
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.5000	2026/09/21	400	402	30,411
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	440	559	42,291
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	420	483	36,585
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	450	504	38,138
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	470	546	41,320
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	490	591	44,733
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2029/11/21	490	573	43,392
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5000	2030/05/21	530	610	46,189
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2030/12/21	440	444	33,631
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/06/21	360	380	28,800
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2031/11/21	360	361	27,330
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.2500	2032/05/21	280	287	21,753
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	210	294	22,298
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	140	168	12,738

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
オーストラリア		%		千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/04/21	180	242	18,348
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	150	191	14,483
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2041/05/21	100	119	9,010
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	200	251	18,997
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2051/06/21	230	224	16,953
小計		-	-	-	-	864,482
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	1.7500	2022/04/01	70	71	5,518
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.1250	2022/09/01	140	147	11,365
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2023/07/01	220	233	18,069
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2024/09/01	170	186	14,409
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/06/01	90	97	7,543
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/06/01	70	75	5,857
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	110	128	9,947
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2028/05/01	60	67	5,238
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	110	127	9,864
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	100	117	9,107
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	100	127	9,812
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	90	103	7,987
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2039/07/01	50	59	4,577
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	60	76	5,889
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	110	144	11,133
SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2050/03/01	60	70	5,459	
小計		-	-	-	-	141,780
イギリス				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	
国債証券	UK TREASURY	4.5000	2034/09/07	210	319	43,986
	UK TREASURY	4.5000	2042/12/07	280	484	66,772
	UK TREASURY	4.2500	2036/03/07	280	426	58,709
	UK TREASURY	4.2500	2046/12/07	260	461	63,588
	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	200	257	35,513
	UK TREASURY	4.2500	2032/06/07	270	385	53,090
	UK TREASURY	4.2500	2039/09/07	200	321	44,266
	UK TREASURY	4.2500	2040/12/07	240	392	54,017
	UK TREASURY	4.2500	2055/12/07	260	522	71,961
	UK TREASURY	4.7500	2030/12/07	250	359	49,477
	UK TREASURY	4.0000	2022/03/07	210	220	30,426
	UK TREASURY	4.0000	2060/01/22	190	387	53,416
	UK TREASURY	4.7500	2038/12/07	230	386	53,166

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						千円	千円
イギリス		%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
国債証券	UK TREASURY	5.0000	2025/03/07	230	279	38,504	
	UK TREASURY	6.0000	2028/12/07	160	233	32,167	
	UK TREASURY	0.5000	2061/10/22	160	140	19,356	
	UK TREASURY	0.1250	2023/01/31	510	511	70,418	
	UK TREASURY	0.1250	2026/01/30	250	250	34,521	
	UK TREASURY	0.1250	2028/01/31	250	248	34,271	
	UK TREASURY	0.3750	2030/10/22	400	401	55,231	
	UK TREASURY	0.6250	2025/06/07	410	421	58,039	
	UK TREASURY	0.6250	2050/10/22	250	230	31,792	
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	230	249	34,294	
	UK TREASURY	1.5000	2047/07/22	300	341	47,013	
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	280	301	41,444	
	UK TREASURY	1.2500	2041/10/22	240	257	35,464	
	UK TREASURY	1.6250	2028/10/22	250	278	38,322	
	UK TREASURY	1.6250	2054/10/22	190	229	31,649	
	UK TREASURY	1.6250	2071/10/22	110	149	20,605	
	UK TREASURY	1.0000	2024/04/22	350	362	49,897	
	UK TREASURY	1.7500	2022/09/07	350	361	49,740	
	UK TREASURY	1.7500	2049/01/22	170	205	28,302	
	UK TREASURY	1.7500	2057/07/22	290	368	50,785	
	UK TREASURY	2.2500	2023/09/07	220	234	32,235	
	UK TREASURY	2.7500	2024/09/07	170	187	25,873	
	UK TREASURY	2.0000	2025/09/07	180	197	27,155	
	UK TREASURY	0.8750	2029/10/22	240	252	34,786	
	UK TREASURY	3.5000	2068/07/22	220	449	61,886	
	UK TREASURY	3.2500	2044/01/22	320	478	65,838	
	UK TREASURY	3.7500	2052/07/22	210	375	51,670	
	UK TREASURY	3.5000	2045/01/22	340	532	73,270	
	UK TREASURY	4.2500	2049/12/07	190	352	48,514	
	UK TREASURY	0.6250	2035/07/31	150	148	20,488	
	UK TREASURY	0.5000	2022/07/22	400	403	55,569	
	UK TREASURY	0.7500	2023/07/22	320	326	45,000	
	UK TREASURY	1.7500	2037/09/07	370	428	58,997	
	UK TREASURY	2.5000	2065/07/22	230	370	51,006	
小計		-	-	-	-	2,132,511	
イスラエル				千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル		
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1.2500	2022/11/30	710	734	22,810	
	ISRAEL FIXED BOND	1.5000	2023/11/30	650	684	21,242	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
イスラエル		%		千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	3.7500	2024/03/31	300	342	10,624
	ISRAEL FIXED BOND	1.7500	2025/08/31	490	524	16,275
	ISRAEL FIXED BOND	6.2500	2026/10/30	250	336	10,447
	ISRAEL FIXED BOND	2.0000	2027/03/31	280	310	9,638
	ISRAEL FIXED BOND	2.2500	2028/09/28	270	304	9,456
	ISRAEL FIXED BOND	1.0000	2030/03/31	210	215	6,685
	ISRAEL FIXED BOND	1.5000	2037/05/31	180	183	5,684
	ISRAEL FIXED BOND	5.5000	2042/01/31	290	510	15,834
	ISRAEL FIXED BOND	3.7500	2047/03/31	280	400	12,418
小計		-	-	-	-	141,117
デンマーク				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	3.0000	2021/11/15	920	952	15,767
	KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2022/11/15	910	926	15,327
	KINGDOM OF DENMARK	1.5000	2023/11/15	920	979	16,211
	KINGDOM OF DENMARK	1.7500	2025/11/15	950	1,063	17,595
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2027/11/15	1,240	1,330	22,023
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2029/11/15	1,550	1,686	27,915
	KINGDOM OF DENMARK	4.5000	2039/11/15	1,900	3,639	60,229
	KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2052/11/15	360	393	6,506
小計		-	-	-	-	181,577
ノルウェー				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2023/05/24	1,180	1,231	14,194
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0000	2024/03/14	880	957	11,039
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2025/03/13	600	633	7,308
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/02/19	560	588	6,788
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2027/02/17	640	685	7,905
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/04/26	560	614	7,084
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2029/09/06	630	684	7,888
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.3750	2030/08/19	660	696	8,027
小計		-	-	-	-	70,238
スウェーデン				千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2022/06/01	1,620	1,717	20,746
	SWEDISH GOVERNMENT	1.5000	2023/11/13	1,370	1,447	17,482
	SWEDISH GOVERNMENT	2.5000	2025/05/12	1,070	1,208	14,601
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0000	2026/11/12	950	1,022	12,351
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2028/05/12	860	920	11,117
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2029/11/12	900	970	11,719
	SWEDISH GOVERNMENT	0.1250	2031/05/12	450	455	5,504

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	千円
スウェーデン		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	700	1,093	13,215
小計		-	-	-	-	106,739
メキシコ				千ペソ	千ペソ	
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.2500	2021/12/09	3,150	3,241	16,658
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2022/06/09	4,550	4,685	24,085
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2023/12/07	6,440	7,042	36,200
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/05	6,840	8,104	41,656
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	2,970	3,040	15,627
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	4,140	4,601	23,650
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	4,640	5,513	28,340
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	2,050	2,332	11,986
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	1,520	1,714	8,811
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	1,100	1,472	7,570
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	2,660	3,128	16,082
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	2,870	3,137	16,125
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	2,780	3,101	15,943
小計		-	-	-	-	262,739
マレーシア				千リンギット	千リンギット	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3.6200	2021/11/30	310	316	8,026
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4180	2022/08/15	470	483	12,280
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4800	2023/03/15	560	580	14,742
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1810	2024/07/15	490	526	13,352
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/09/15	350	379	9,625
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/04/15	140	155	3,935
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9000	2026/11/30	300	325	8,268
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/03/15	510	554	14,075
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/06/15	200	216	5,504
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8850	2029/08/15	290	316	8,034
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/04/15	220	251	6,391
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	260	293	7,440
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	410	442	11,235
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8280	2034/07/05	220	236	6,000
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/05/31	110	122	3,108
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	180	211	5,369
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.8930	2038/06/08	130	153	3,893
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7570	2040/05/22	200	208	5,288
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	130	150	3,812
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	160	180	4,584

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						千円	邦貨換算金額
マレーシア		%		千円・シリング	千円・シリング	千円	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9210	2048/07/06	170	195	4,966	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.0650	2050/06/15	80	80	2,037	
小計		-	-	-	-	161,974	
ポーランド				千円・ズロチ	千円・ズロチ		
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.2500	2022/04/25	640	660	18,223	
	POLAND GOVERNMENT BOND	-	2022/07/25	350	349	9,651	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2022/09/23	470	519	14,333	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2023/01/25	460	484	13,365	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2023/10/25	420	468	12,924	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2024/04/25	990	1,070	29,529	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	760	860	23,743	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	700	775	21,397	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	460	512	14,131	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	510	579	15,983	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/04/25	130	181	5,013	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/10/25	690	790	21,796	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.2500	2030/10/25	200	201	5,551	
	小計		-	-	-	-	205,646
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド							
国債証券	IRISH TREASURY	0.2000	2030/10/18	100	104	12,908	
	IRISH TREASURY	0.2000	2027/05/15	100	104	12,887	
	IRISH TREASURY	0.4000	2035/05/15	70	74	9,193	
	IRISH TREASURY	0.8000	2022/03/15	110	112	13,826	
	IRISH TREASURY	1.0000	2026/05/15	180	195	24,120	
	IRISH TREASURY	1.1000	2029/05/15	130	146	18,055	
	IRISH TREASURY	1.3000	2033/05/15	70	82	10,205	
	IRISH TREASURY	1.3500	2031/03/18	90	105	12,966	
	IRISH TREASURY	1.5000	2050/05/15	80	106	13,137	
	IRISH TREASURY	1.7000	2037/05/15	90	114	14,170	
	IRISH TREASURY	2.0000	2045/02/18	130	185	22,905	
	IRISH TREASURY	2.4000	2030/05/15	140	176	21,772	
	IRISH TREASURY	0.0000	2022/10/18	80	80	9,989	
	IRISH TREASURY	0.9000	2028/05/15	150	165	20,361	
	IRISH TREASURY	3.4000	2024/03/18	120	136	16,796	
	IRISH TREASURY	3.9000	2023/03/20	110	121	15,013	
	IRISH TREASURY	5.4000	2025/03/13	170	214	26,461	
小計		-	-	-	-	274,772	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ						
%						
千ユーロ						
千ユーロ						
千円						
オランダ						
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2022/01/15	230	231	28,600
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.2500	2022/07/15	230	241	29,768
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2023/01/15	210	230	28,418
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.7500	2023/07/15	270	287	35,519
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2024/01/15	240	245	30,287
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2024/07/15	220	242	29,868
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2025/07/15	230	240	29,657
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2026/07/15	260	277	34,239
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2027/01/15	180	187	23,085
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2027/07/15	230	251	31,035
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/01/15	190	274	33,918
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2028/07/15	230	254	31,367
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2029/07/15	180	192	23,785
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2030/07/15	220	230	28,451
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/01/15	200	272	33,640
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/01/15	240	412	50,828
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2040/01/15	140	160	19,772
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/01/15	240	448	55,371
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/01/15	250	447	55,183
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2052/01/15	90	92	11,452
小計						
		-	-	-	-	644,253
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2022/03/28	210	223	27,548
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2022/09/28	240	262	32,345
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2023/06/22	200	215	26,578
	BELGIUM KINGDOM	0.2000	2023/10/22	140	143	17,726
	BELGIUM KINGDOM	2.6000	2024/06/22	230	257	31,765
	BELGIUM KINGDOM	0.5000	2024/10/22	200	209	25,833
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/06/22	270	288	35,573
	BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/03/28	170	217	26,819
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/06/22	230	251	30,971
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2027/06/22	220	240	29,622
	BELGIUM KINGDOM	0.0000	2027/10/22	130	134	16,643
	BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	290	421	51,961
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2028/06/22	220	242	29,903
	BELGIUM KINGDOM	0.9000	2029/06/22	250	279	34,493
	BELGIUM KINGDOM	0.1000	2030/06/22	190	198	24,543

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/06/22	230	262	32,399
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/03/28	120	179	22,167
	BELGIUM KINGDOM	1.2500	2033/04/22	120	142	17,617
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/06/22	130	187	23,073
	BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	290	508	62,677
	BELGIUM KINGDOM	1.4500	2037/06/22	70	87	10,771
	BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/06/22	140	186	23,052
	BELGIUM KINGDOM	0.4000	2040/06/22	80	84	10,452
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/03/28	270	494	61,027
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/06/22	150	277	34,192
	BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/06/22	160	214	26,487
	BELGIUM KINGDOM	1.7000	2050/06/22	110	153	18,916
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2057/06/22	90	147	18,249
	BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/06/22	100	171	21,185
小計		-	-	-	-	824,600
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2022/02/25	440	443	54,740
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2022/04/25	700	736	90,897
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2022/05/25	480	485	59,830
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2022/10/25	560	592	73,042
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2023/02/25	80	81	10,022
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2023/03/25	770	782	96,550
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2023/05/25	860	913	112,669
	FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2023/10/25	660	756	93,361
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2024/03/25	600	614	75,737
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2024/05/25	520	574	70,858
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	580	637	78,610
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2025/03/25	670	689	85,039
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/05/25	610	642	79,263
	FRANCE (GOVT OF)	6.0000	2025/10/25	470	627	77,343
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	530	574	70,859
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2026/02/25	330	340	42,039
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/04/25	680	835	103,051
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/05/25	610	648	79,973
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	560	588	72,633
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2027/05/25	540	596	73,550
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	720	888	109,631

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス					
国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/05/25	700	767	94,716
FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/11/25	600	660	81,498
FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/04/25	610	924	113,990
FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2029/05/25	500	541	66,781
FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2029/11/25	610	633	78,094
FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/05/25	750	960	118,505
FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2030/11/25	370	382	47,213
FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/05/25	730	872	107,643
FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	490	850	104,843
FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2034/05/25	550	657	81,061
FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/04/25	440	757	93,460
FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/05/25	530	640	79,044
FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	400	692	85,363
FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2039/06/25	410	544	67,156
FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2040/05/25	150	162	20,067
FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/04/25	560	1,067	131,717
FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/05/25	380	661	81,593
FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2048/05/25	410	603	74,472
FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2050/05/25	440	592	73,080
FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2052/05/25	280	315	38,926
FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/04/25	250	547	67,571
FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/04/25	250	581	71,771
FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/05/25	200	311	38,360
小計	-	-	-	-	3,426,640
ドイツ					
国債証券					
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2022/04/08	310	313	38,616
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2022/10/07	300	304	37,522
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2023/04/14	270	275	33,923
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2023/10/13	290	296	36,587
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2024/10/18	330	339	41,933
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2025/04/11	300	310	38,249
BUNDES OBLIGATION	0.0000	2025/10/10	270	280	34,544
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2022/01/04	330	340	41,957
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2022/07/04	400	416	51,336
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2022/09/04	410	426	52,613
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/02/15	320	336	41,486
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/05/15	330	348	43,019

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ					
国債証券					
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2023/08/15	340	366	45,158
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2024/02/15	570	617	76,147
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2024/05/15	680	734	90,626
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2024/08/15	340	362	44,762
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/02/15	420	443	54,641
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	420	455	56,211
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	470	501	61,864
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	440	459	56,646
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	470	499	61,628
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2027/08/15	440	477	58,858
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2027/11/15	330	346	42,721
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2028/02/15	380	413	51,061
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2028/08/15	380	408	50,352
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2029/02/15	400	430	53,150
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2029/08/15	410	433	53,462
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/01/04	170	280	34,608
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/02/15	380	401	49,560
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	100	105	13,069
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	430	454	56,074
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/07/04	380	661	81,598
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2035/05/15	310	327	40,453
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	410	713	87,958
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	290	549	67,792
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	310	633	78,143
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	290	523	64,538
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	430	723	89,241
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	470	812	100,239
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	380	537	66,323
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	250	263	32,481
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2021/12/10	240	241	29,821
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2022/03/11	210	211	26,141
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2022/06/10	220	222	27,440
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2022/09/16	80	81	9,999
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	200	298	36,810
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	250	366	45,170
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	220	314	38,756
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	320	524	64,630
小計	-	-	-	-	2,489,941

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン					
国債証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0500	2021/10/31	310	311	38,459
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.8500	2022/01/31	340	366	45,151
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4000	2022/04/30	320	324	40,029
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4500	2022/10/31	280	285	35,244
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4000	2023/01/31	330	373	46,075
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2023/04/30	320	324	40,005
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.3500	2023/07/30	330	337	41,687
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4000	2023/10/31	320	366	45,263
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8000	2024/01/31	270	316	39,026
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8000	2024/04/30	310	356	43,985
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.2500	2024/07/30	250	257	31,721
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	370	417	51,541
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2025/01/31	330	336	41,495
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/04/30	320	349	43,127
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/07/30	340	422	52,067
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	360	406	50,108
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	340	383	47,300
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	340	462	57,021
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	390	428	52,822
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	300	334	41,302
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2027/07/30	280	299	36,931
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	330	368	45,431
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/04/30	340	379	46,853
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/07/30	320	358	44,202
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	270	383	47,313
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/01/31	400	600	74,115
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2029/04/30	320	361	44,563
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6000	2029/10/31	320	338	41,724
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2030/04/30	330	345	42,583
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/07/30	350	415	51,206
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2500	2030/10/31	370	413	50,977
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/07/30	340	560	69,147
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.3500	2033/07/30	290	366	45,148
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.8500	2035/07/30	300	363	44,790
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/01/31	320	510	62,924
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/07/30	280	506	62,513
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2000	2040/10/31	180	199	24,584

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/07/30	320	574	70,802
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	220	434	53,645
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	260	389	48,088
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7000	2048/10/31	210	308	38,054
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0000	2050/10/31	200	206	25,527
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/07/30	220	401	49,549
小計		-	-	-	-	2,004,115
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.3500	2021/11/01	240	241	29,846
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2021/12/15	280	287	35,521
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2022/04/15	840	861	106,225
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0000	2022/07/15	200	204	25,260
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9000	2022/08/01	270	276	34,062
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/09/01	270	298	36,814
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2022/09/15	290	299	36,999
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/11/01	500	557	68,776
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0500	2023/01/15	30	30	3,735
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2023/03/15	480	494	61,018
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2023/05/01	480	537	66,275
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2023/08/01	370	421	51,934
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2023/10/15	750	770	95,091
	BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0000	2023/11/01	180	229	28,308
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2024/01/15	40	40	4,971
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2024/03/01	350	404	49,884
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8500	2024/05/15	500	536	66,112
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2024/09/01	300	344	42,484
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2024/12/01	540	597	73,673
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.3500	2025/02/01	220	224	27,661
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2025/03/01	440	536	66,131
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2025/06/01	820	878	108,308
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/01	560	616	76,011
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5000	2026/02/01	70	71	8,833
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/03/01	380	468	57,808
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6000	2026/06/01	550	595	73,502
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2500	2026/12/01	580	618	76,277	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2000	2027/06/01	250	281	34,753	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0500	2027/08/01	500	559	69,012	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5000	2027/11/01	400	569	70,278
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2028/02/01	360	402	49,704
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/09/01	360	480	59,225
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2028/12/01	300	356	44,010
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0000	2029/08/01	300	364	44,994
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/01	450	637	78,633
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/03/01	380	482	59,499
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2030/04/01	340	365	45,084
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2030/08/01	250	259	31,962
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2030/12/01	350	385	47,548
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9000	2031/04/01	90	92	11,389
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/05/01	440	677	83,532
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/03/01	380	418	51,630
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/02/01	310	488	60,225
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2033/09/01	280	334	41,210
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/08/01	390	595	73,444
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.3500	2035/03/01	220	290	35,835
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2036/03/01	190	202	24,951
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/09/01	240	283	34,928
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/02/01	420	601	74,230
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.9500	2038/09/01	230	297	36,632
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/08/01	340	558	68,891
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1000	2040/03/01	200	264	32,577
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/09/01	330	547	67,488
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8000	2041/03/01	160	174	21,537
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/09/01	270	455	56,178
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/09/01	250	349	43,115
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/03/01	270	345	42,636
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2048/03/01	240	348	43,010
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2049/09/01	200	311	38,481
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2050/09/01	240	295	36,422
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7000	2051/09/01	120	125	15,467
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/03/01	140	184	22,789
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/01	180	255	31,530
	小計	-	-	-	-	3,094,383
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2022/04/15	80	80	9,967

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.6250	2022/09/15	70	73	9,008
	FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2023/04/15	70	73	9,100
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2023/09/15	90	91	11,329
	FINNISH GOVERNMENT	2.0000	2024/04/15	140	153	18,885
	FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/07/04	90	109	13,549
	FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/09/15	80	86	10,617
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/04/15	100	106	13,115
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2027/09/15	100	107	13,262
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/07/04	140	176	21,708
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2029/09/15	100	108	13,421
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2030/09/15	50	52	6,419
	FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/04/15	60	67	8,304
	FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2034/04/15	80	95	11,743
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2036/04/15	60	62	7,762
	FINNISH GOVERNMENT	0.2500	2040/09/15	50	53	6,598
	FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/07/04	70	112	13,828
	FINNISH GOVERNMENT	1.3750	2047/04/15	50	68	8,502
小計						
		-	-	-	-	207,125
オーストリア						
国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.6500	2022/04/20	130	138	17,022
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2022/09/20	110	111	13,747
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4000	2022/11/22	150	162	20,040
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2023/07/15	240	244	30,166
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.7500	2023/10/20	170	182	22,492
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.6500	2024/10/21	280	306	37,769
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2000	2025/10/20	180	196	24,291
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	150	195	24,051
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2026/10/20	200	216	26,718
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2027/04/20	150	160	19,850
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	130	190	23,519
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2028/02/20	160	175	21,655
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2029/02/20	160	173	21,412
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2030/02/20	150	156	19,248
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/05/23	130	177	21,920
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	210	361	44,550
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2040/10/20	40	40	4,983
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/06/20	100	176	21,807

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
オーストリア					
国債証券					
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/02/20	110	152	18,863
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2051/03/20	60	72	8,904
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/01/26	60	147	18,193
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2086/11/02	40	68	8,405
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1000	2117/09/20	90	203	25,131
小計	-	-	-	-	494,746
ユーロ小計	-	-	-	-	13,460,580
合計	-	-	-	-	32,372,603

投資信託財産の構成

2020年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	32,372,603	98.9
コール・ローン等、その他	376,227	1.1
投資信託財産総額	32,748,830	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル103.88円、1カナダ・ドル79.43円、1オーストラリア・ドル75.60円、1シンガポール・ドル77.26円、1イギリス・ポンド137.68円、1イスラエル・シェケル31.04円、1デンマーク・クローネ16.55円、1ノルウェー・クローネ11.53円、1スウェーデン・クローナ12.08円、1メキシコ・ペソ5.14円、1マレーシア・リングギット25.38円、1ポーランド・ズロチ27.59円、1ユーロ123.34円です。

(注2) 外貨建純資産（32,615,187千円）の投資信託財産総額（32,748,830千円）に対する比率は99.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	32,780,636,764円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	197,941,405
公 社 債(評価額)	32,372,603,021
未 収 入 金	31,806,192
未 収 利 息	164,814,898
前 払 費 用	13,471,248
(B)負債	122,350,745
未 払 金	32,114,574
未 払 解 約 金	90,235,999
そ の 他 未 払 費 用	172
(C)純 資 産 総 額(A - B)	32,658,286,019
元 本	22,593,334,379
次 期 繰 越 損 益 金	10,064,951,640
(D)受 益 権 総 口 数	22,593,334,379口
1万口当たり基準価額(C / D)	14,455円

(注1)	期首元本額	19,013,517,824円
	期中追加設定元本額	5,435,391,147円
	期中一部解約元本額	1,855,574,592円
(注2)	当マザーファンドの当期末元本額におけるペビエファンド別内訳は、次の通りです。	
	DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	2,334,887,551円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,866,542,648円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,302,630,172円
	ニッセイ外国債券インデックスS A(適格機関投資家限定)	758,947,512円
	ニッセイインデックスバランス(債券重視型)	
	S A(適格機関投資家限定)	3,966,949円
	ニッセイインデックスバランス(標準型)	
	S A(適格機関投資家限定)	11,348,657円
	ニッセイインデックスバランス(成長型)	
	S A(適格機関投資家限定)	9,906,781円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	10,287,697,386円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)	1,348,446,447円
	DCニッセイ外国債券インデックス	1,310,372,857円
	DCニッセイターゲットデートファンド2055	46,718,492円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	911,353,650円
	DCニッセイターゲットデートファンド2045	47,289,025円
	DCニッセイターゲットデートファンド2035	106,427,690円
	DCニッセイターゲットデートファンド2025	33,342,256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)	72,331,508円
	ニッセイ・インデックスパッケージジ(内外・株式/リート/債券)	5,350,294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)	24,383,814円
	DCニッセイターゲットデートファンド2060	12,556,140円
	DCニッセイターゲットデートファンド2050	10,025,784円
	DCニッセイターゲットデートファンド2040	34,004,065円
	DCニッセイターゲットデートファンド2030	54,804,701円

損益の状況

当期(2020年5月21日~2020年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	299,437,915円
受 取 利 息	299,476,632
支 払 利 息	△ 38,717
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	313,464,001
売 買 益	1,128,844,066
売 買 損	△ 815,380,065
(C)信 託 報 酬 等	△ 5,511,109
(D)当 期 損 益 金(A + B + C)	607,390,807
(E)前 期 繰 越 損 益 金	7,869,584,698
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	2,424,003,038
(G)解 約 差 損 益 金	△ 836,026,903
(H)合 計(D + E + F + G)	10,064,951,640
次 期 繰 越 損 益 金(H)	10,064,951,640

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

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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