

第3期末 (2016年11月21日)	
基準価額	11,931円
純資産総額	356億円
騰落率	△8.0%
分配金	0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

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：2015年11月21日～2016年11月21日

第3期 (決算日 2016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3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世界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。

今後とも是非ご継続頂き、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。

 <http://www.nam.co.jp/>

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

NISSAY
ASSET MANAGEMENT

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

運用経過

2015年11月21日～2016年11月21日

基準価額等の推移



第3期首	12,964円	既払分配金	0円
第3期末	11,931円	騰落率(分配金再投資ベース)	△8.0%

- (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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、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 Inc.が公表する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。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。MSCIコクサイ・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、同指数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ます。以下同じです。

基準価額の主な変動要因

当期は米国をはじめとした主な海外株式市場は上昇しましたが、為替市場において円高が進行したことから、基準価額は下落しました。

期初は、中国経済の減速懸念や資源価格の下落を背景に株式市場は下落しました。その後、原油価格の反発や米利上げペースの鈍化観測を受け、上昇基調に転じました。一方、為替市場は資源価格の下落や、イギリスの国民投票で欧州連合(EU)離脱派が勝利したことなどを背景に投資家のリスク回避的な姿勢が強まったことから、円高基調で推移しました。11月に入ると米大統領選の結果を受け、急速に円安が進行したものの、結局、期を通じてみると円高となり、基準価額を押し下げる要因となりました。

＜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

1 万口当たりの費用明細

2015年11月21日～2016年11月21日

項目	第3期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	30円	0.260%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は11,381円です。
(投信会社)	(13)	(0.114)	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)	(13)	(0.114)	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)	(4)	(0.032)	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	0.013	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(株式)	(1)	(0.009)	
(先物・オプション)	(0)	(0.004)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	3	0.027	$\text{有価証券取引税} = \text{期中の有価証券取引税} / \text{期中の平均受益権口数}$ 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(3)	(0.027)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	9	0.080	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$ 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
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(8)	(0.074)	
			・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	43	0.379	

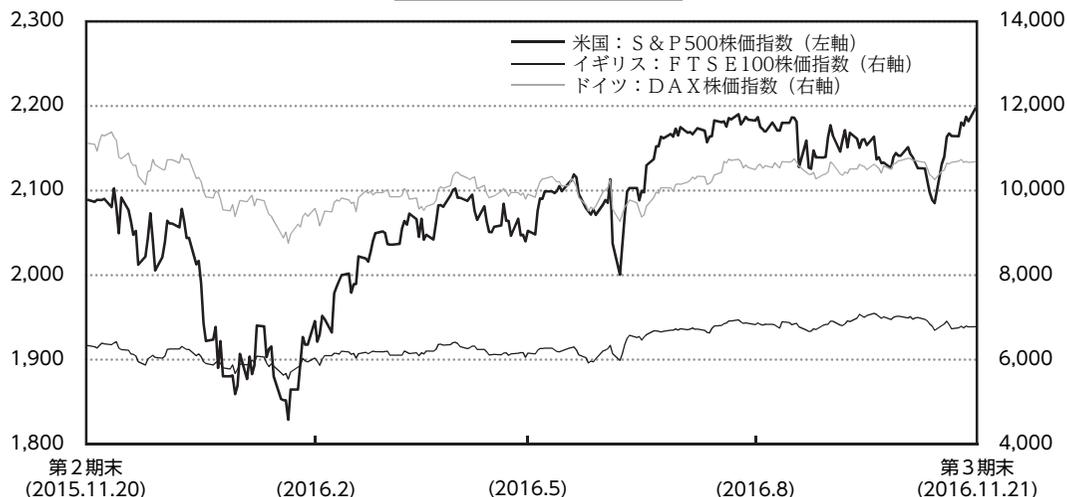
(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

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。

期初は、中国経済の減速懸念や原油価格の下落を背景に投資家のリスク回避的な姿勢が強まったことから、海外株式市場は下落しました。その後、原油価格が持ち直しを見せたことや、米連邦公開市場委員会（FOMC）の声明を受けて米利上げペースが鈍化するとの観測が強まったことから、市場に買い安心感が広がり、株価は上昇基調に転じました。

6月はイギリスの国民投票でEU離脱派が勝利したことから世界経済に対する不透明感が高まり、株式市場は一時急落しましたが、7月中旬以降は市場予想を大きく上回った米雇用統計や、欧米企業の堅調な決算などを背景に、反発しました。

また、11月には米大統領選においてトランプ氏が勝利したことを受け、減税や積極的な財政政策への期待感から株式市場は上昇基調となりました。

<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

ポートフォリオ

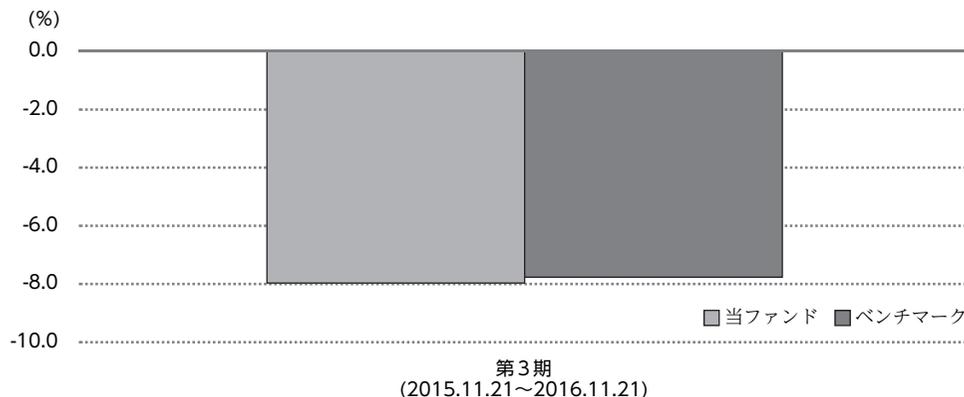
当ファンド

マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保つ運用を行いました（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

日本を除く世界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。

ベンチマークとの差異



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

当期の基準価額騰落率は-8.0%となり、ベンチマーク騰落率（-7.8%）との差異は-0.2%となりました。

設定・解約に伴うキャッシュフローの影響により、市場が大きく変動する局面で通常の水準と比較して大きなベンチマークとのかい離が生じた日もありましたが、期を通じてみると、信託報酬の影響を除き、おおむねベンチマークに連動した運用となりました。

<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

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
	2015年11月21日 ～2016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	2,218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世界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。

マザーファンド

日本を除く世界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。

<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

◆設定以来の運用実績

決算期	基準価額(分配落)			(ご参考) 基準価額+ 累計分配金	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
	税引前 分配金	期 中 騰落率	騰落率	騰落率		騰落率					
(設定日) 2013年12月10日	円 10,000	円 -	% -	円 10,000	10,000	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 27
1期(2014年11月20日)	12,526	0	25.3	12,526	12,589	25.9	92.0	6.3	2.0	5,755	
2期(2015年11月20日)	12,964	0	3.5	12,964	13,046	3.6	93.7	3.6	2.4	19,029	
3期(2016年11月21日)	11,931	0	△ 8.0	11,931	12,033	△ 7.8	94.1	3.5	2.4	35,666	

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注3) 「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4) ベンチマークはMSCI Inc.が公表するMSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)で、設定時を10,000として指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。MSCIコクサイ・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、同指数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ます。以下同じです。

(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

(注6) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

(注7) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		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
	騰落率	騰落率		騰落率	騰落率			
(期首) 2015年11月20日	円 12,964	% -	13,046	% -	% 93.7	% 3.6	% 2.4	
11月末	12,959	△ 0.0	13,039	△ 0.1	93.1	4.2	2.4	
12月末	12,648	△ 2.4	12,730	△ 2.4	92.5	5.0	2.4	
2016年1月末	11,530	△ 11.1	11,599	△ 11.1	92.1	5.3	2.4	
2月末	11,046	△ 14.8	11,115	△ 14.8	94.4	3.0	2.5	
3月末	11,682	△ 9.9	11,756	△ 9.9	90.4	2.8	2.5	
4月末	11,630	△ 10.3	11,700	△ 10.3	94.4	2.9	2.5	
5月末	11,756	△ 9.3	11,826	△ 9.4	94.2	2.9	2.6	
6月末	10,632	△ 18.0	10,692	△ 18.0	92.8	4.5	2.7	
7月末	11,301	△ 12.8	11,367	△ 12.9	93.5	3.5	2.7	
8月末	11,263	△ 13.1	11,329	△ 13.2	92.1	5.2	2.6	
9月末	10,989	△ 15.2	11,057	△ 15.2	94.5	2.7	2.7	
10月末	11,218	△ 13.5	11,286	△ 13.5	93.3	4.1	2.5	
(期末) 2016年11月21日	円 11,931	% △ 8.0	12,033	% △ 7.8	% 94.1	% 3.5	% 2.4	

(注) 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

(2015年11月21日～2016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	18,247,142	23,306,832	4,744,953	6,106,547

(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	33,845,681千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	46,755,318千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.72

(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

(2015年11月21日～2016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

(2016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	13,093,548	26,595,736	35,667,542

(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46,538,854千口です。

＜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

(2016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	35,667,542	99.1
コール・ローン等、その他	326,030	0.9
投資信託財産総額	35,993,573	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110.95円、1カナダ・ドル82.29円、1オーストラリア・ドル81.34円、1香港ドル14.30円、1シンガポール・ドル77.82円、1ニュージーランド・ドル77.85円、1イギリス・ポンド137.16円、1イスラエル・シェケル28.54円、1スイス・フラン109.93円、1デンマーク・クローネ15.81円、1ノルウェー・クローネ12.91円、1スウェーデン・クローナ12.01円、1ユーロ117.64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（62,040,530千円）の投資信託財産総額（62,911,328千円）に対する比率は98.6%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

(2016年11月21日現在)

項 目	当 期 末
(A)資 産	35,993,573,699円
コール・ローン等	37,599,429
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	35,667,542,867
未 収 入 金	288,431,403
(B)負 債	326,793,724
未 払 解 約 金	287,675,552
未 払 信 託 報 酬	38,353,416
そ の 他 未 払 費 用	764,756
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	35,666,779,975
元 本	29,894,160,896
次 期 繰 越 損 益 金	5,772,619,079
(D)受 益 権 総 口 数	29,894,160,896口
1万口当たり基準価額 (C/D)	11,931円

- (注) 期首元本額 14,678,659,497円
 期中追加設定元本額 20,482,172,909円
 期中一部解約元本額 5,266,671,510円

◆損益の状況

当期 (2015年11月21日～2016年11月21日)

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	△ 6,311円
受 取 利 息	1,309
支 払 利 息	△ 7,620
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 56,284,513
売 買 損 益	453,219,550
売 買 損 益	△ 509,504,063
(C)信 託 報 酬 等	△ 68,091,423
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 124,382,247
(E)前 期 繰 越 損 益 金	654,762,874
(分 配 準 備 積 立 金)	(654,762,874)
(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *	5,242,238,452
(配 当 等 相 当 額)	(5,403,040,819)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 160,802,367)
(G)合 計 (D+E+F)	5,772,619,079
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	5,772,619,079
追 加 信 託 差 損 益 金	5,242,238,452
(配 当 等 相 当 額)	(5,435,451,458)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 193,213,006)
分 配 準 備 積 立 金	1,195,457,247
繰 越 欠 損 金	△ 665,076,620

- (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。

＜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

◆分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	540,694,373円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0円
(c) 信託約款に定める収益調整金	5,435,451,458円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	654,762,874円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	6,630,908,705円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	2,218.13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

代表取締役社長に赤林富二が就任いたしました。 (2016年4月1日)

約款変更

信託報酬率の上限を引き下げたことに伴い、関連条項に所要の変更を行いました。
(2015年11月21日)

関連会社の実質保有比率

2016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、委託会社の主要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20.0%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。

＜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

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世界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とします。
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	日本を除く世界主要先進国の株式
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18期

(計算期間：2016年5月21日～2016年11月21日)

●受益者の皆様へ

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主に日本を除く世界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）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	日本を除く世界主要先進国の株式
組入制限	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。

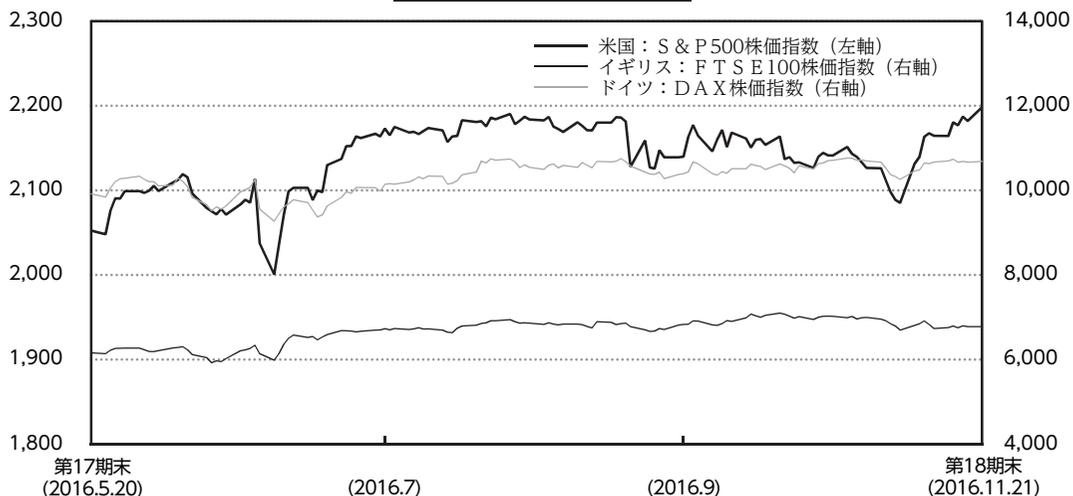


ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

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。

6月にイギリスの国民投票で欧州連合（EU）離脱派が勝利したことから世界経済に対する不透明感が高まり、株式市場は一時急落しましたが、7月中旬には市場予想を大きく上回った米雇用統計や、欧米企業の堅調な決算などを背景に反発しました。その後はイングランド銀行（BOE：中央銀行）による追加金融緩和の実施や原油価格の反発を受けて、上昇する場面はあったものの、米国における年内利上げ観測の高まりが重荷となり、市場は横ばい圏で推移しました。しかし、11月には米大統領選においてトランプ氏が勝利したことを受け、減税や積極的な財政政策への期待感から株式市場は上昇基調となりました。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

基準価額等の推移



(注) ベンチマークはMSCI Inc.が公表する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。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。同指数に関する著作権、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、同指数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ます。以下同じです。

基準価額の主な変動要因

当期は主な海外株式市場が上昇し、基準価額も同様の動きとなりました。期初は、イギリスの国民投票でEU離脱派が勝利したことから世界経済に対する不透明感が高まり、株式市場が急落し基準価額も一時急落しましたが、7月中旬以降は市場予想を大きく上回った米雇用統計や、欧米企業の堅調な決算などを背景に、反発しました。また、11月には米大統領選においてトランプ氏が勝利したことを受け、減税や積極的な財政政策への期待感から株式市場は上昇基調となり、基準価額も上昇し、当期末を迎えました。

ポートフォリオ

日本を除く世界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。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+5.8%となり、ベンチマーク騰落率 (+5.9%) との差異は-0.1%となりました。

設定・解約に伴うキャッシュフローの影響により、市場が大きく変動する局面で通常の水準と比較して大きなベンチマークとの乖離が生じた日もありましたが、期を通じてみると、おおむねベンチマークに連動した運用となりました。

今後の運用方針

日本を除く世界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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

◆最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	%		%	%	%	%	百万円
14期(2014年11月20日)	13,982	19.8	13,847	20.0	92.0	6.3	2.0	43,928
15期(2015年5月20日)	15,035	7.5	14,862	7.3	93.9	3.6	2.2	52,091
16期(2015年11月20日)	14,534	△3.3	14,349	△3.5	93.7	3.6	2.4	50,880
17期(2016年5月20日)	12,674	△12.8	12,494	△12.9	93.9	3.3	2.6	50,956
18期(2016年11月21日)	13,411	5.8	13,235	5.9	94.1	3.5	2.4	62,415

(注1) ベンチマークはMSCI Inc.が公表するMSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)で、設定時を10,000として、指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。同指数に関する著作権、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、同指数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ます。以下同じです。

(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
(期首)	円	%		%	%	%	%
2016年5月20日	12,674	-	12,494	-	93.9	3.3	2.6
5月末	13,198	4.1	13,007	4.1	94.2	2.9	2.6
6月末	11,938	△5.8	11,760	△5.9	92.8	4.5	2.7
7月末	12,692	0.1	12,502	0.1	93.5	3.5	2.7
8月末	12,653	△0.2	12,461	△0.3	92.1	5.2	2.6
9月末	12,347	△2.6	12,162	△2.7	94.5	2.7	2.7
10月末	12,608	△0.5	12,413	△0.6	93.3	4.1	2.5
(期末)							
2016年11月21日	13,411	5.8	13,235	5.9	94.1	3.5	2.4

(注) 騰落率は期首比です。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

◆ 1万口当たりの費用明細

(2016年5月21日～2016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)	1円 (1)	0.008% (0.006)	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)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税 (株式)	2 (2)	0.017 (0.016)	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 (その他)	4 (4)	0.033 (0.033)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	7	0.058	

(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（12,527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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

◆売買および取引の状況

(2016年5月21日～2016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 16,361 (△ 103)	千米ドル 98,046 (△ 227)	百株 8,165	千米ドル 48,626
	カ ナ ダ	2,116 (52)	千カナダ・ドル 8,038 (△ 7)	986	千カナダ・ドル 3,598
	オーストラリア	3,724 (9)	千オーストラリア・ドル 5,355	1,921	千オーストラリア・ドル 2,643
	香 港	4,720 (129)	千香港ドル 15,008	2,213	千香港ドル 7,796
	シンガポール	3,396 (697)	千シンガポール・ドル 973	1,958	千シンガポール・ドル 483
	ニュージーランド	335	千ニュージーランド・ドル 165	150	千ニュージーランド・ドル 77
	イ ギ リ ス	16,603 (13,842)	千イギリス・ポンド 9,382 (△ 70)	27,637	千イギリス・ポンド 5,120
	イ ス ラ エ ル	327	千イスラエル・シェケル 1,067	288	千イスラエル・シェケル 3,104
	ス イ ス	841	千スイス・フラン 5,354 (△ 23)	425	千スイス・フラン 2,647
	デン マ ー ク	260 (14)	千デンマーク・クローネ 7,498	130	千デンマーク・クローネ 4,299
	ノ ル ウ ェ ー	344	千ノルウェー・クローネ 3,937 (△ 32)	135	千ノルウェー・クローネ 1,496
	ス ウ ェ ー デ ン	1,174 (90)	千スウェーデン・クローナ 14,672	649	千スウェーデン・クローナ 6,935

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	1,400	252	651	116
		オランダ	1,131 (69)	2,202 (△ 32)	547	964
		ベルギー	94 (△ 16)	734	43	334
		ルクセンブルグ	245	150	51	41
		フランス	1,334 (76)	5,110 (△ 3)	656	2,310
		ドイツ	1,158 (29)	4,921 (△ 32)	555	2,308
		ポルトガル	153	82	6,239	56
		スペイン	3,097 (5,655)	1,781 (55)	6,016	815
		イタリア	3,011 (81)	1,038 (△0.331)	1,751	531
		フィンランド	460	534	204	250
オーストリア	40	107	16	41		
その他	10	84	5	44		

(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。

(2) 投資信託証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	BOSTON PROPERTIES INC	0.780	99	0.360	49
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	1	164	0.782	75
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	146	0.162	17
	PROLOGIS INC	2	138	1	64
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	5	60	2	21
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.723	126	0.319	57
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.442	36	0.190	16

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	
銘 柄		口 数	金 額	口 数	金 額
外	(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	DUKE REALTY CORP	1	43	0.760	20
	EQUITY RESIDENTIAL	1	119	0.853	56
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.330	72	0.171	37
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.376	56	0.154	25
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	2	78	1	46
	HCP INC	2	81	1	45
	WELLTOWER INC	1	130	0.829	64
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	3	60	1	28
	KIMCO REALTY CORP	2	56	0.931	28
	LIBERTY PROPERTY TRUST	0.699	28	0.321	12
	MACERICH CO/THE	0.521	38	0.298	26
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.370	35	0.166	17
	PUBLIC STORAGE	0.748	167	0.343	85
	REGENCY CENTERS CORP	0.527	39	0.216	17
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1	314	0.724	160
	SL GREEN REALTY CORP	0.519	54	0.221	25
	UDR INC	1	50	0.579	20
	VENTAS INC	1	120	0.785	57
	VORNADO REALTY TRUST	0.864	82	0.437	45
	REALTY INCOME CORP	1	84	0.590	41
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.749	60	0.274	24
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.943	92	0.349	36
	IRON MOUNTAIN INC	1	71	0.560	22
	AGNC INVESTMENT CORP	1	26	0.726	14
	AMERICAN TOWER REIT INC	2	250	0.991	116
	EQUINIX INC	0.403	147	0.161	60
	VEREIT	5	54	2	21
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3	85	0.463	12	
QUALITY CARE PROPERTIES	—	—	1	19	
	(1)				
国	(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.310	10	0.151	5
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	0.689	15	0.314	7
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.821	22	0.357	10
	BROOKFIELD BUSINESS PART	—	—	0.280	7
	(0.280)	(7)			

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			
	銘	柄	口	数	金	額	口	数	金	額
外	(オーストラリア)		千口		千オーストラリア・ドル		千口		千オーストラリア・ドル	
	DEXUS PROPERTY GROUP		5		47		2		23	
	GPT GROUP		10		54		4		25	
	GOODMAN GROUP		9		68		4		32	
	STOCKLAND		13		63		5		29	
	WESTFIELD CORP		10		102		5		57	
	MIRVAC GROUP		20		43		9		20	
	VICINITY CENTRES		18		57		8		28	
	SCENTRE GROUP		28		128		14		75	
	(香港)				千香港ドル				千香港ドル	
	LINK REIT		11		607		6		359	
	(シンガポール)				千シンガポール・ドル				千シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		13		32		4		12	
					(△0.040)					
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		10		15		4		6	
	CAPITALAND MALL TRUST		12		26		5		11	
	SUNTEC REIT		12		20		5		9	
				(△0.062)						
(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		31		2		14		
HAMMERSON PLC		4		23		1		9		
LAND SECURITIES GROUP PLC		3		34		1		20		
SEGRO PLC		3		16		1		7		
INTU PROPERTIES PLC		4		13		2		6		
国	(ユーロ/フランス)			千ユーロ				千ユーロ		
	UNIBAIL-RODAMCO SE		0.516		117		0.232		56	
	KLEPIERRE		1		43		0.491		20	
	GECINA SA		0.300		39		0.092		12	
	FONCIERE DES REGIONS		0.247		19		0.078		6	
	ICADE		0.266		17		0.084		5	

(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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(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 13,268	百万円 12,893	百万円 -	百万円 -

(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

(2016年5月21日～2016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	26	313,874	11,795	APPLE INC	13	139,954	10,749
MICROSOFT CORP	36	227,274	6,202	MICROSOFT CORP	17	105,152	5,865
EXXON MOBIL CORP	20	194,756	9,332	SABMILLER PLC	17	98,594	5,785
JOHNSON & JOHNSON	13	173,556	12,604	EXXON MOBIL CORP	9	91,960	9,492
AMAZON.COM INC	2	173,452	83,350	JOHNSON & JOHNSON	6	83,872	13,027
FACEBOOK INC-A	12	165,052	13,321	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	17	80,685	4,719
GENERAL ELECTRIC CO	44	142,635	3,201	GENERAL ELECTRIC CO	22	75,054	3,266
AT&T INC	31	132,252	4,206	AMAZON.COM INC	0.934	71,841	76,918
JPMORGAN CHASE & CO	18	132,003	7,226	FACEBOOK INC-A	5	68,950	12,878
ALPHABET INC-CL A	1	130,557	85,275	AT&T INC	14	64,184	4,464

(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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

◆組入有価証券明細表

(2016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	
3M CO	96	111	1,926 213,794	資本財
ABBOTT LABORATORIES	232	269	1,074 119,178	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	255	297	1,798 199,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCENTURE PLC	97	115	1,363 151,318	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	81	108	415 46,141	ソフトウェア・サービス
ACUITY BRANDS INC	6	7	193 21,517	資本財
ADOBE SYSTEMS INC	77	91	965 107,081	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	11	13	212 23,628	小売
AERCAP HOLDINGS NV	13	29	131 14,556	資本財
AES CORP	102	119	136 15,138	公益事業
AETNA INC	54	64	803 89,104	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	8	9	133 14,791	各種金融
AFLAC INC	66	75	548 60,884	保険
AGCO CORP	10	11	61 6,848	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	52	60	271 30,158	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AGL RESOURCES INC	18	-	- -	公益事業
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	31	37	520 57,706	素材
AIRGAS INC	9	-	- -	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	26	31	207 23,072	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	16	19	164 18,224	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	35	41	493 54,718	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALKERMES PLC	22	26	157 17,487	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	2	2	153 17,029	保険
ALLERGAN PLC	61	72	1,393 154,648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	9	10	230 25,518	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	17	41	147 16,335	公益事業
ALLSTATE CORP	60	68	495 54,927	保険
ALLY FINANCIAL INC	65	77	150 16,698	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11	13	63 7,018	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	45	53	4,187 464,562	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	48	56	4,317 479,036	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	306	359	2,256 250,402	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	62	73	5,599 621,246	小売
AMERCO	1	1	50 5,644	運輸
AMEREN CORPORATION	38	43	212 23,618	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	24	26	121 13,442	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	77	91	531 59,023	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	130	148	1,054 116,995	各種金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	192	205	1,310 145,439	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	29	32	230 25,614	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	27	30	343 38,123	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	
AMERISOURCEBERGEN CORP	31	33	268 29,766	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	39	46	184 20,448	各種金融
AMETEK INC	36	41	198 21,998	資本財
AMGEN INC	117	137	2,003 222,250	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	49	56	387 42,976	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	79	93	576 64,014	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	49	56	386 42,898	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	13	15	145 16,190	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	12	27	67 7,499	エネルギー
ANTHEM INC	40	48	653 72,487	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	42	48	546 60,581	保険
APACHE CORP	60	69	431 47,883	エネルギー
APPLE INC	870	1,006	11,073 1,228,625	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	187	199	614 68,137	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	34	41	140 15,540	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	18	21	175 19,474	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	92	107	468 51,933	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	202	78	155 17,230	資本財
ARROW ELECTRONICS INC	14	16	106 11,852	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	26	31	161 17,908	保険
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	-	11	123 13,672	素材
ASHLAND INC	9	-	-	素材
ASSURANT INC	9	10	93 10,346	保険
AT&T INC	961	1,132	4,253 471,928	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	15	18	133 14,790	公益事業
AUTODESK INC	35	36	277 30,800	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	13	15	153 17,063	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	71	83	789 87,561	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	10	12	56 6,252	小売
AUTOZONE INC	4	5	413 45,835	小売
AVERY DENNISON CORP	13	15	111 12,372	素材
AVNET INC	19	22	102 11,353	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	21	38	101 11,264	素材
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	14	16	99 10,993	保険
BAKER HUGHES INC	69	76	465 51,595	エネルギー
BALL CORP	19	29	227 25,189	素材
BANK OF AMERICA CORP	1,624	1,885	3,771 418,492	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	170	197	935 103,837	各種金融
BARD (C.R.) INC	11	13	291 32,384	ヘルスケア機器・サービス
BAXALTA INC -W/I	95	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAXTER INTERNATIONAL INC	85	90	424 47,094	ヘルスケア機器・サービス
BB&T CORPORATION	121	150	670 74,397	銀行
BE AEROSPACE INC	15	18	109 12,136	資本財
BECTON DICKINSON & CO	32	39	670 74,421	ヘルスケア機器・サービス
BED BATH & BEYOND INC	24	27	122 13,612	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	184	218	3,453	383,161	各種金融
BEST BUY CO INC	46	51	231	25,726	小売
BIOGEN INC	34	40	1,275	141,493	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	25	29	265	29,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	19	22	834	92,604	各種金融
BOEING CO	99	111	1,626	180,463	資本財
BORGWARNER INC	33	38	138	15,339	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	210	249	531	58,978	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	260	306	1,740	193,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM LTD	60	71	1,205	133,717	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	-	20	136	15,167	ソフトウェア・サービス
BROWN-FORMAN CORP -CL B	17	38	178	19,800	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	21	24	167	18,569	食品・飲料・タバコ
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	22	26	200	22,271	運輸
CA Inc	48	55	170	18,926	ソフトウェア・サービス
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	30	-	-	-	メディア
CABOT OIL & GAS CORP	69	82	182	20,210	エネルギー
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	-	53	140	15,626	ソフトウェア・サービス
CALPINE CORP	51	62	72	8,014	公益事業
CAMPBELL SOUP CO	27	35	193	21,468	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	82	93	769	85,430	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	51	59	423	46,954	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	30	34	191	21,287	小売
CARNIVAL CORP	64	66	343	38,077	消費者サービス
CATERPILLAR INC	90	107	991	109,971	資本財
CBRE GROUP INC	44	53	153	17,026	不動産
CBS CORP-CL B	68	76	460	51,125	メディア
CDK GLOBAL INC	20	23	135	15,057	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	21	26	137	15,286	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	22	26	204	22,662	素材
CELGENE CORP	122	142	1,735	192,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	16	30	172	19,084	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	62	74	174	19,406	公益事業
CENTURYLINK INC	88	101	251	27,900	電気通信サービス
CERNER CORP	49	55	276	30,708	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	35	41	120	13,356	素材
CHARLES SCHWAB CORP	184	218	817	90,686	各種金融
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	34	39	1,035	114,895	メディア
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10	22	191	21,201	ソフトウェア・サービス
CHENIERE ENERGY INC	33	35	138	15,332	エネルギー
CHEVRON CORP	293	345	3,777	419,156	エネルギー
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	14	-	-	-	資本財
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4	5	214	23,758	消費者サービス
CHUBB LTD	71	85	1,075	119,292	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	20	45	204	22,715	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル 千円	
CIGNA CORP	40	47	653 72,465	ヘルスケア機器・サービス
CIMAREX ENERGY CO	14	16	211 23,520	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	23	27	204 22,705	保険
CINTAS CORP	13	15	169 18,826	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	792	924	2,789 309,515	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIT GROUP INC	25	35	146 16,243	銀行
CITIGROUP INC	464	538	2,987 331,416	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	80	93	299 33,236	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	24	27	239 26,547	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	20	24	276 30,709	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	50	62	706 78,396	各種金融
CMS ENERGY CORP	42	51	203 22,545	公益事業
COACH INC	41	49	188 20,865	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA CO	644	754	3,088 342,614	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	32	-	-	食品・飲料・タバコ
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	94	111	617 68,566	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	133	156	1,028 114,108	家庭用品・パーソナル用品
COLUMBIA PIPELINE GROUP -W/I	58	-	-	エネルギー
COMCAST CORP	388	444	3,039 337,284	メディア
COMERICA INC	26	30	188 20,892	銀行
CONAGRA BRANDS INC	69	76	281 31,275	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	20	25	335 37,183	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	192	227	1,017 112,934	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	46	55	388 43,154	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	27	32	503 55,811	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13	16	84 9,405	エネルギー
COOPER COS INC/THE	7	8	147 16,392	ヘルスケア機器・サービス
CORE LABORATORIES N.V.	6	7	83 9,318	エネルギー
CORNING INC	184	197	470 52,233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	68	80	1,209 134,243	食品・生活必需品小売り
CROWN HOLDINGS INC	21	25	134 14,935	素材
CSX CORP	153	178	605 67,226	運輸
CUMMINS INC	26	29	400 44,450	資本財
CVS HEALTH CORP	172	197	1,459 161,969	食品・生活必需品小売り
D&B CORP	5	6	80 8,883	商業・専門サービス
DANAHER CORP	96	113	898 99,681	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	17	21	154 17,092	消費者サービス
DAVITA INC	26	29	183 20,347	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	48	49	454 50,433	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	-	38	202 22,444	ソフトウェア・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	43	50	342 37,979	自動車・自動車部品
DELTA AIR LINES INC	30	34	170 18,907	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	20	42	258 28,668	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	72	86	378 42,049	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	13	15	91 10,132	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外貨建金額 邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル 千円	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	66	75	502 55,774	各種金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	22	26	73 8,183	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	42	42	114 12,741	メディア
DISH NETWORK CORP	35	40	228 25,312	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	46	52	400 44,477	小売
DOLLAR TREE INC	35	43	354 39,387	小売
DOMINION RESOURCES INC/VA	93	113	808 89,700	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	-	8	147 16,352	消費者サービス
DOVER CORP	23	27	193 21,484	資本財
DOW CHEMICAL CO	175	206	1,097 121,755	素材
DR HORTON INC	51	62	179 19,879	耐久消費財・アパレル
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	30	34	286 31,778	食品・飲料・タバコ
DTE ENERGY COMPANY	29	33	306 34,016	公益事業
DUKE ENERGY CORP	108	127	935 103,846	公益事業
E*TRADE FINANCIAL	43	49	167 18,535	各種金融
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	22	26	195 21,744	素材
EATON CORP PLC	72	84	538 59,793	資本財
EATON VANCE CORP	17	20	80 8,915	各種金融
EBAY INC	169	200	575 63,901	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	41	48	555 61,647	素材
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	8	10	85 9,458	家庭用品・パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	51	60	414 46,038	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	34	38	346 38,395	ヘルスケア機器・サービス
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	136	160	1,104 122,540	素材
ELECTRONIC ARTS INC	48	55	437 48,517	ソフトウェア・サービス
ELI LILLY & CO	155	182	1,399 155,312	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMC CORP/MASSACHUSETTS	302	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EMERSON ELECTRIC CO	102	118	640 71,031	資本財
ENDO INTERNATIONAL PLC	32	37	64 7,175	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENTERGY CORP	28	33	225 25,015	公益事業
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	28	33	74 8,320	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	85	101	941 104,445	エネルギー
EQT CORP	23	30	206 22,936	エネルギー
EQUIFAX INC	18	21	266 29,550	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC	34	40	315 35,050	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	6	7	155 17,269	保険
EVERSOURCE ENERGY	51	59	307 34,111	公益事業
EXELON CORP	143	170	539 59,893	公益事業
EXPEDIA INC	19	22	282 31,316	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	29	34	179 19,901	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	105	116	879 97,626	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	649	761	6,493 720,479	エネルギー
F5 NETWORKS INC	10	12	171 18,985	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	354	424	4,969 551,364	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	42	51	230 25,553	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	
FEDEX CORP	42	47	887 98,475	運輸
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	45	57	440 48,891	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	126	140	361 40,088	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	22	26	215 23,911	銀行
FIRSTENERGY CORP	68	78	247 27,487	公益事業
FISERV INC	35	41	428 47,533	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	12	17	255 28,363	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	83	96	135 15,038	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLIR SYSTEMS INC	20	24	86 9,574	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWSERVE CORP	19	23	106 11,845	資本財
FLUOR CORP	21	24	126 14,029	資本財
FMC CORP	20	23	128 14,276	素材
FMC TECHNOLOGIES INC	34	40	137 15,292	エネルギー
FNF GROUP	37	43	145 16,154	保険
FOOT LOCKER INC	20	24	173 19,248	小売
FORD MOTOR CO	579	681	801 88,905	自動車・自動車部品
FORTINET INC	21	25	80 8,917	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	-	56	310 34,457	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	24	27	157 17,450	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	61	66	260 28,870	各種金融
FREEMONT-MCMORAN INC	178	212	291 32,346	素材
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	178	214	73 8,129	電気通信サービス
GAMESTOP CORP-CLASS A	15	-	-	小売
GAP INC	36	42	108 12,033	小売
GARMIN LTD	17	20	103 11,537	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	12	14	154 17,139	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	41	47	794 88,199	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,473	1,689	5,181 574,854	資本財
GENERAL MILLS INC	93	109	669 74,268	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	220	254	838 93,031	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	23	27	259 28,816	小売
GILEAD SCIENCES INC	224	244	1,824 202,415	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	19	27	194 21,543	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	59	68	1,444 160,240	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	40	47	142 15,830	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	35	40	92 10,276	消費者サービス
HALLIBURTON CO	133	157	778 86,353	エネルギー
HANESBRANDS INC	59	67	166 18,463	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	28	32	188 20,880	自動車・自動車部品
HARMAN INTERNATIONAL	10	12	137 15,238	耐久消費財・アパレル
HARRIS CORP	19	22	233 25,877	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	65	71	339 37,650	保険
HASBRO INC	16	20	169 18,757	耐久消費財・アパレル
HCA HOLDINGS INC	51	57	418 46,431	ヘルスケア機器・サービス
HELMERICH & PAYNE	16	19	130 14,440	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外貨建金額 邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル 千円	
HENRY SCHEIN INC	13	14	227 25,233	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	23	26	262 29,164	食品・飲料・タバコ
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	58	-	-	運輸
HESS CORP	44	52	266 29,615	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	281	315	736 81,709	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	74	96	235 26,145	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	26	29	81 8,988	エネルギー
HOLOGIC INC	36	44	171 19,076	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	197	228	2,933 325,485	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	114	132	1,489 165,254	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	90	212	132 14,700	不動産
HORMEL FOODS CORP	43	51	183 20,341	食品・飲料・タバコ
HP INC	280	318	505 56,128	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	23	27	547 60,760	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	118	192	240 26,726	銀行
IDEXX LABORATORIES INC	-	16	186 20,679	ヘルスケア機器・サービス
IHS INC-CLASS A	10	-	-	商業・専門サービス
IHS MARKIT LTD	-	63	222 24,647	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	51	59	737 81,818	資本財
ILLUMINA INC	22	27	357 39,620	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IMS HEALTH HOLDINGS INC	24	-	-	ヘルスケア機器・サービス
INCYTE CORP	25	31	321 35,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND PLC	41	47	352 39,133	資本財
INGEVITY CORP	6	-	-	素材
INGREDION INC	-	12	153 17,046	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	736	866	3,029 336,165	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	18	109	598 66,394	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	143	167	2,686 298,035	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	12	14	170 18,871	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	62	71	348 38,628	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	62	72	171 19,030	メディア
INTERVAL LEISURE GROUP	11	-	-	消費者サービス
INTUIT INC	39	44	517 57,468	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	5	6	455 50,571	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	65	73	232 25,840	各種金融
IONIS PHARMACEUTICALS INC	18	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	18	21	125 13,871	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	40	46	262 29,075	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9	10	117 13,054	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	14	17	159 17,658	運輸
JM SMUCKER CO	18	21	274 30,460	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	431	505	5,827 646,615	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INC	101	-	-	自動車・自動車部品
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	67	174	778 86,338	資本財
JONES LANG LASALLE INC	6	7	79 8,820	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル 千円	
JPMORGAN CHASE & CO	574	671	5,217 578,841	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	52	61	163 18,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	16	19	173 19,266	運輸
KELLOGG CO	41	48	354 39,295	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	124	192	326 36,275	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	56	66	750 83,253	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	296	348	755 83,777	エネルギー
KLA-TENCOR CORP	23	27	223 24,847	半導体・半導体製造装置
KOHL'S CORP	29	32	179 19,937	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	94	111	921 102,188	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	144	166	556 61,792	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	38	44	315 35,018	小売
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	11	13	208 23,117	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	15	18	235 26,183	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	24	29	304 33,830	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	-	25	83 9,256	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	61	80	485 53,813	消費者サービス
LEAR CORP	11	13	165 18,411	自動車・自動車部品
LEGG MASON INC	14	-	- -	各種金融
LEGGETT & PLATT INC	20	24	117 13,042	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	27	32	142 15,824	耐久消費財・アパレル
LEUCADIA NATIONAL CORP	48	57	121 13,495	各種金融
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	48	56	315 35,021	電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND-C	-	19	134 14,875	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	35	49	163 18,102	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	96	116	369 41,023	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP A	68	76	161 17,909	小売
LIBERTY LILAC GROUP-C	-	19	40 4,526	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	13	16	61 6,802	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	30	36	130 14,471	メディア
LINCOLN NATIONAL CORP	36	42	262 29,072	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP	35	43	266 29,589	半導体・半導体製造装置
LINKEDIN CORP - A	18	21	419 46,535	ソフトウェア・サービス
LKQ CORP	46	54	175 19,511	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	43	48	1,280 142,066	資本財
LOEWS CORP	42	51	224 24,856	保険
LOWE'S COS INC	143	162	1,128 125,192	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	16	19	107 11,875	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	59	66	552 61,327	素材
M&T BANK CORP	22	26	370 41,125	銀行
MACY'S INC	48	54	236 26,253	小売
MALLINCKRODT PLC	17	19	106 11,816	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MANPOWER GROUP	10	12	107 11,923	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	101	151	236 26,193	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	83	97	420 46,697	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外貨建金額 邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル 千円	
MARKEL CORP	2	2	226 25,175	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	32	61	472 52,379	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	81	95	663 73,592	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	8	10	235 26,102	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	62	78	115 12,837	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	51	59	193 21,489	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	154	178	1,867 207,198	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	51	60	185 20,577	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42	50	203 22,551	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	17	20	186 20,662	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	143	161	1,934 214,595	消費者サービス
MCKESSON CORP	35	41	578 64,158	ヘルスケア機器・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	31	34	245 27,208	食品・飲料・タバコ
MEDIVATION INC	24	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDNAX INC	14	16	105 11,673	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	220	257	2,080 230,836	ヘルスケア機器・サービス
MELCO PBL ENTERTAINMENT-ADR	14	34	64 7,148	消費者サービス
MERCK & CO INC	436	508	3,145 348,983	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	146	170	935 103,829	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	4	4	198 22,007	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	67	80	229 25,407	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	27	31	149 16,598	耐久消費財・アパレル
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	30	38	246 27,402	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	163	190	365 40,587	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	1,184	1,371	8,276 918,306	ソフトウェア・サービス
MOBILEYE NV	12	31	120 13,362	ソフトウェア・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	9	11	224 24,893	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	29	34	334 37,128	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	247	284	1,222 135,644	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	68	80	812 90,159	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	22	73	306 33,961	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	28	32	324 36,004	各種金融
MORGAN STANLEY	226	266	1,078 119,629	各種金融
MOSAIC CO/THE	47	58	166 18,483	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24	28	228 25,343	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	14	16	129 14,402	各種金融
MURPHY OIL CORP	24	29	89 9,901	エネルギー
MYLAN NV	65	83	305 33,847	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	17	20	132 14,699	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	56	67	236 26,252	エネルギー
NAVIENT CORP	54	58	103 11,504	各種金融
NETAPP INC	43	51	190 21,141	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	63	78	906 100,560	小売
NETSUITE INC	6	-	-	ソフトウェア・サービス
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	73	87	139 15,429	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	
NEWELL BRANDS INC	71	81	380 42,264	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	-	35	142 15,759	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	83	97	317 35,235	素材
NEWS CORP - CLASS A	57	68	80 8,976	メディア
NEXTERA ENERGY INC	72	85	971 107,759	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	55	66	284 31,555	商業・専門サービス
NIKE INC	211	244	1,250 138,699	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	-	58	127 14,199	公益事業
NOBLE ENERGY INC	68	79	276 30,704	エネルギー
NORDSTROM INC	20	23	137 15,223	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	47	55	569 63,196	運輸
NORTHERN TRUST CORP	34	39	322 35,835	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	27	31	773 85,868	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	24	28	111 12,366	消費者サービス
NRG ENERGY INC	47	57	63 7,095	公益事業
NUANCE COMMUNICATIONS INC	37	44	75 8,429	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	50	58	344 38,262	素材
NVIDIA CORP	85	97	914 101,438	半導体・半導体製造装置
NXP SEMICONDUCTORS NV	20	54	534 59,307	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	119	140	957 106,193	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	14	-	- -	エネルギー
OGЕ ENERGY CORP	30	36	112 12,435	公益事業
OMNICOM GROUP	38	44	376 41,808	メディア
ONEOK INC	31	37	189 20,989	エネルギー
ORACLE CORP	498	571	2,277 252,664	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	15	17	471 52,304	小売
PACCAR INC	55	64	385 42,793	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	14	16	146 16,243	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	12	16	266 29,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PARKER HANNIFIN CORP	21	24	336 37,367	資本財
PATTERSON COS INC	13	14	69 7,670	ヘルスケア機器・サービス
PAYCHEX INC	51	59	332 36,916	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	171	200	802 89,039	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	27	30	176 19,617	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	45	53	98 10,947	銀行
PEPSICO INC	227	265	2,688 298,318	食品・飲料・タバコ
PERRIGO CO PLC	23	26	231 25,719	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	963	1,113	3,506 389,052	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	77	91	536 59,532	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	241	285	2,539 281,798	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	83	86	725 80,484	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	16	20	147 16,378	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	25	30	535 59,369	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	34	16	57 6,337	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	79	91	1,019 113,164	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	
POLARIS INDUSTRIES INC	9	10	91	10,205	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	42	48	465	51,623	素材
PPL CORPORATION	106	126	414	46,007	公益事業
PRAXAIR INC	44	52	609	67,581	素材
PRICELINE GROUP INC/THE	7	9	1,373	152,356	小売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44	52	302	33,573	保険
PROCTER & GAMBLE CO	424	488	4,006	444,568	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	91	107	353	39,196	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	69	80	800	88,830	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	79	93	378	42,018	公益事業
PULTE GROUP INC	47	55	104	11,563	耐久消費財・アパレル
PVH CORP	12	14	153	17,053	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	21	22	125	13,947	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	234	269	1,815	201,428	半導体・半導体製造装置
QUANTA SERVICES INC	24	—	—	—	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	21	25	213	23,726	ヘルスケア機器・サービス
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	14	27	220	24,469	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RALPH LAUREN CORP	8	10	112	12,443	耐久消費財・アパレル
RANGE RESOURCES CORP	25	30	103	11,429	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19	22	164	18,195	各種金融
RAYTHEON CO	47	54	797	88,436	資本財
REALOLOGY HOLDINGS CORP	22	26	63	7,061	不動産
RED HAT INC	29	33	262	29,163	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	11	14	564	62,666	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	199	223	296	32,915	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6	7	100	11,170	保険
REPUBLIC SERVICES INC	36	42	234	25,974	商業・専門サービス
RESMED INC	20	24	145	16,156	ヘルスケア機器・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	133	157	845	93,856	食品・飲料・タバコ
RITE AID CORP	158	188	144	16,048	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	19	23	103	11,481	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	21	24	315	34,950	資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	20	23	203	22,607	資本財
ROPER TECHNOLOGIES INC	16	18	336	37,370	資本財
ROSS STORES INC	63	73	501	55,671	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27	30	253	28,097	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	42	48	593	65,825	各種金融
SABRE CORP	27	37	96	10,744	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	98	118	917	101,843	ソフトウェア・サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP	20	23	238	26,414	電気通信サービス
SCANA CORP	20	24	171	19,071	公益事業
SCHLUMBERGER LTD	218	255	2,044	226,852	エネルギー
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	11	14	102	11,367	メディア
SEAGATE TECHNOLOGY	44	53	209	23,195	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	29	35	167	18,560	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	
SEI INVESTMENTS COMPANY	20	24	115	12,812	各種金融
SEMPRA ENERGY	37	44	440	48,818	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	25	30	111	12,412	資本財
SERVICENOW INC	22	29	249	27,666	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12	14	377	41,874	素材
SIGNATURE BANK	7	9	140	15,642	銀行
SIGNET JEWELERS LTD	11	13	117	13,068	小売
SIRIUS XM HOLDINGS INC	333	369	168	18,694	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	29	34	271	30,162	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	-	26	123	13,745	資本財
SNAP-ON INC	8	10	173	19,228	資本財
SOUTHERN CO	142	172	814	90,358	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	25	28	136	15,120	運輸
SOUTHWESTERN ENERGY CO	57	85	90	10,004	エネルギー
SPECTRA ENERGY CORP	104	128	527	58,522	エネルギー
SPLUNK INC	19	23	141	15,672	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	121	142	105	11,657	電気通信サービス
ST JUDE MEDICAL INC	45	52	418	46,406	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	24	27	336	37,345	資本財
STAPLES INC	96	114	109	12,173	小売
STARBUCKS CORP	231	268	1,497	166,201	消費者サービス
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	26	-	-	-	消費者サービス
STATE STREET CORP	62	72	569	63,196	各種金融
STERICYCLE INC	12	15	115	12,823	商業・専門サービス
STRYKER CORP	52	61	687	76,299	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	81	91	473	52,543	銀行
SYMANTEC CORP	104	112	267	29,712	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	130	153	514	57,134	各種金融
SYNOPSYS INC	23	26	163	18,123	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	88	98	522	57,950	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	39	45	332	36,877	各種金融
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	7	-	-	-	ソフトウェア・サービス
TARGET CORP	91	102	783	86,933	小売
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	1	2	27	3,004	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TE CONNECTIVITY LTD	60	65	438	48,635	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TECO ENERGY INC	35	-	-	-	公益事業
TEGNA INC	32	37	86	9,577	メディア
TERADATA CORP	19	-	-	-	ソフトウェア・サービス
TESLA MOTORS INC	15	21	396	44,011	自動車・自動車部品
TESORO CORP	18	21	177	19,676	エネルギー
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	-	167	646	71,758	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	158	184	1,338	148,485	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	41	47	211	23,501	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	62	72	1,054	117,028	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	19	22	171	19,008	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外貨建金額 邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル 千円	
TIME WARNER INC	125	144	1,322 146,728	メディア
TJX COS INC	104	121	944 104,740	小売
T-MOBILE US INC	44	53	286 31,804	電気通信サービス
TOLL BROTHERS INC	25	28	83 9,282	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	18	20	140 15,600	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	24	29	147 16,358	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	20	23	173 19,196	小売
TRANSDIGM GROUP INC	8	9	246 27,352	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	47	53	598 66,448	保険
TRIMBLE INC	37	44	123 13,686	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	17	21	108 12,025	小売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	69	76	212 23,606	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	183	204	568 63,025	メディア
TWITTER INC	87	100	187 20,847	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	46	54	369 41,044	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	-	31	139 15,474	公益事業
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	9	10	273 30,328	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	27	32	100 11,108	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	27	33	79 8,864	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	133	155	1,551 172,134	運輸
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	14	15	105 11,668	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	109	128	1,468 162,924	運輸
UNITED RENTALS INC	13	15	143 15,963	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	131	146	1,554 172,516	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	6	7	103 11,447	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	148	174	2,607 289,280	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	14	15	195 21,706	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	36	41	177 19,643	保険
US BANCORP	272	316	1,559 173,016	銀行
VALERO ENERGY CORP	75	86	545 60,548	エネルギー
VALSPAR CORP	-	13	136 15,184	素材
VANTIV INC - CL A	23	28	166 18,481	ソフトウェア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	14	16	148 16,527	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	15	17	142 15,780	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	24	28	237 26,369	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	636	750	3,608 400,359	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	38	45	406 45,101	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	53	61	334 37,134	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	55	62	234 26,057	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	303	349	2,825 313,521	ソフトウェア・サービス
VMWARE INC-CLASS A	11	13	105 11,754	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	31	35	133 14,785	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	21	24	313 34,834	素材
WABCO HOLDINGS INC	8	9	95 10,551	資本財
WABTEC CORP	14	16	137 15,220	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		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	135	168	1,403 155,720	食品・生活必需品小売り	
WAL-MART STORES INC	250	288	1,973 219,009	食品・生活必需品小売り	
WALT DISNEY CO	245	283	2,784 308,952	メディア	
WASTE CONNECTIONS INC	18	—	—	商業・専門サービス	
WASTE CONNECTIONS INC	—	32	241 26,823	商業・専門サービス	
WASTE MANAGEMENT INC	70	81	564 62,638	商業・専門サービス	
WATERS CORP	12	14	195 21,702	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	117	160	77 8,604	エネルギー	
WEC ENERGY GROUP INC	51	58	327 36,337	公益事業	
WELLS FARGO & CO	757	885	4,678 519,071	銀行	
WESTAR ENERGY INC	—	25	146 16,268	公益事業	
WESTERN DIGITAL CORP	42	51	312 34,720	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WESTERN UNION CO	76	87	178 19,816	ソフトウェア・サービス	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	6	—	—	素材	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	38	45	226 25,109	素材	
WEYERHAEUSER CO	122	137	426 47,335	不動産	
WHIRLPOOL CORP	12	13	217 24,158	耐久消費財・アパレル	
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	26	31	173 19,213	食品・飲料・タバコ	
WHOLE FOODS MARKET INC	51	57	176 19,617	食品・生活必需品小売り	
WILLIAMS COS INC	113	131	395 43,831	エネルギー	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	20	24	301 33,430	保険	
WORKDAY INC-CLASS A	16	21	174 19,307	ソフトウェア・サービス	
WR BERKLEY CORP	14	17	105 11,709	保険	
WR GRACE & CO	10	12	86 9,612	素材	
WW GRAINGER INC	9	10	225 25,062	資本財	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	17	19	144 15,994	消費者サービス	
WYNN RESORTS LTD	12	14	133 14,867	消費者サービス	
XCEL ENERGY INC	80	94	368 40,875	公益事業	
XEROX CORP	137	152	143 15,976	ソフトウェア・サービス	
XILINX INC	39	46	246 27,339	半導体・半導体製造装置	
XL GROUP LTD	—	49	186 20,731	保険	
XL GROUP PLC	44	—	—	保険	
XYLEM INC	26	31	169 18,778	資本財	
YAHOO! INC	139	165	682 75,771	ソフトウェア・サービス	
YUM! BRANDS INC	67	74	466 51,746	消費者サービス	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	15	20	73 8,101	ソフトウェア・サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	29	36	367 40,811	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	74	87	435 48,278	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額	48,915	57,007	353,202	39,187,820
	銘 柄 数 < 比 率 >	598	590	—	< 62.8% >
(カナダ)				千カナダ・ドル	
AGNICO EAGLE MINES LTD	32	39	223 18,427	素材	
AGRIUM INC	20	23	312 25,749	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	67	77	482 39,683	食品・生活必需品小売り	
ALTAGAS LTD	22	29	96 7,946	エネルギー	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外貨建金額 邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル 千円	
ARC RESOURCES LTD	52	62	146 12,094	エネルギー
ATCO LTD -CL 'I'	12	14	64 5,282	公益事業
BANK OF MONTREAL	100	118	1,038 85,439	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	187	220	1,588 130,708	銀行
BARRICK GOLD CORP	185	214	442 36,399	素材
BCE INC	23	28	167 13,743	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD	75	90	92 7,598	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BOMBARDIER INC	295	351	68 5,610	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	138	159	728 59,926	各種金融
CAE INC	42	49	97 8,034	資本財
CAMECO CORP	60	70	86 7,124	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	62	72	754 62,102	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	125	144	1,259 103,665	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	171	201	868 71,491	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	23	27	535 44,079	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	10	12	176 14,497	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	19	23	87 7,160	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4	5	113 9,353	素材
CENOVUS ENERGY INC	129	149	292 24,107	エネルギー
CGI GROUP INC	33	38	245 20,225	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	35	44	114 9,401	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2	3	214 17,690	ソフトウェア・サービス
CRESCENT POINT ENERGY CORP	76	90	140 11,521	エネルギー
DOLLARAMA INC	18	20	203 16,737	小売
ELDORADO GOLD CORP	107	127	47 3,873	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	59	70	80 6,651	各種金融
EMPIRE CO LTD 'A'	25	29	52 4,316	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	134	170	976 80,339	エネルギー
ENCANA CORP	127	151	239 19,727	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	4	250 20,647	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	25	30	79 6,529	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	18	25	50 4,117	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	103	122	169 13,975	素材
FORTIS INC	43	52	211 17,379	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	26	31	246 20,262	素材
GEORGE WESTON LTD	7	9	101 8,378	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	35	40	144 11,856	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	131	148	267 22,021	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	44	52	184 15,195	保険
HUSKY ENERGY INC	52	62	90 7,432	エネルギー
HYDRO ONE LTD	-	35	82 6,775	公益事業
IGM FINANCIAL INC	15	17	66 5,434	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	44	53	237 19,526	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	15	18	102 8,418	保険
INTACT FINANCIAL CORP	20	23	222 18,279	保険

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外貨建金額 邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル 千円	
INTER PIPELINE LTD	50	60	165 13,578	エネルギー
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	12	14	29 2,438	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	26	32	126 10,411	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	173	221	101 8,365	素材
LINAMAR CORP	7	8	42 3,522	自動車・自動車部品
LOBLAW COS LTD	35	40	275 22,642	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	64	72	399 32,910	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	308	361	830 68,337	保険
METHANEX CORP	13	16	82 6,814	素材
METRO INC	36	42	174 14,350	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	53	59	295 24,286	銀行
ONEX CORPORATION	13	16	147 12,176	各種金融
OPEN TEXT CORP	18	21	181 14,967	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	56	69	267 21,974	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	23	29	100 8,298	エネルギー
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	132	154	370 30,503	素材
POWER CORP OF CANADA	56	67	197 16,249	保険
POWER FINANCIAL CORP	37	44	147 12,125	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	27	36	108 8,932	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	30	39	248 20,438	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	58	68	354 29,147	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	231	273	2,384 196,211	銀行
SAPUTO INC	38	45	211 17,415	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	25	38	116 9,578	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	63	76	199 16,400	メディア
SILVER WHEATON CORP	60	78	198 16,301	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	22	26	148 12,188	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	95	112	587 48,314	保険
SUNCOR ENERGY INC	246	305	1,277 105,125	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	85	100	311 25,596	素材
THOMSON REUTERS CORP	56	64	366 30,191	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	289	340	2,156 177,437	銀行
TOURMALINE OIL CORP	28	37	131 10,831	エネルギー
TRANSCANADA CORP	111	147	888 73,109	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	152	178	81 6,675	素材
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	50	57	141 11,639	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERESEN INC	44	55	68 5,652	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	16	20	109 9,025	エネルギー
WASTE CONNECTIONS INC	16	-	- -	商業・専門サービス
WEST FRASER TIMBER CO LTD	10	12	56 4,624	素材
YAMANA GOLD INC	142	168	69 5,681	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	6,102	7,285 28,696 2,361,422	
	銘柄 数<比 率>	89	89 - <3.8%>	
(オーストラリア)			オーストラリア・ドル	
AGL ENERGY LTD	111	135	272 22,139	公益事業

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	オーストラリア円 千円		
ALUMINA LTD	414	467	79	6,466	素材
AMCOR LTD	195	222	316	25,768	素材
AMP LTD	485	561	265	21,603	各種金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	91	102	149	12,167	消費者サービス
ASCIANO LTD	109	-	-	-	運輸
ASX LTD	33	38	183	14,921	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD	345	409	199	16,250	運輸
AUSNET SERVICES	364	453	66	5,443	公益事業
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	460	542	1,518	123,508	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	68	77	85	6,981	銀行
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	81	90	106	8,640	銀行
BHP BILLITON LTD	505	594	1,432	116,482	素材
BORAL LTD	129	151	93	7,576	素材
BRAMBLES LTD	269	311	369	30,054	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	43	49	145	11,855	エネルギー
CHALLENGER LTD	97	115	122	9,981	各種金融
CIMIC GROUP LIMITED	18	19	60	4,919	資本財
COCA-COLA AMATIL LIMITED	97	118	110	9,022	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	9	11	133	10,884	ヘルスケア機器・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	269	318	2,450	199,325	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED	82	94	110	9,004	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD	58	70	78	6,370	消費者サービス
CSL LIMITED	73	85	857	69,744	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	-	11	81	6,623	消費者サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	9	11	33	2,724	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	248	285	165	13,446	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	100	119	54	4,414	小売
HEALTHSCOPE LTD	295	349	77	6,336	ヘルスケア機器・サービス
ILUKA RESOURCES LIMITED	68	-	-	-	素材
INCITEC PIVOT LTD	279	322	101	8,252	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	402	469	254	20,716	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	72	85	170	13,839	素材
MACQUARIE GROUP LTD	51	58	486	39,553	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	445	529	131	10,722	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	417	493	1,404	114,210	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	117	139	289	23,517	素材
OIL SEARCH LTD	212	254	174	14,200	エネルギー
ORICA LTD	60	71	122	9,953	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED	269	320	181	14,784	エネルギー
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	48	57	29	2,434	各種金融
QANTAS AIRWAYS LTD	102	120	37	3,061	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	220	256	285	23,210	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	23	27	195	15,892	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	9	12	60	4,935	メディア
RIO TINTO LTD	69	80	461	37,565	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千円			
SANTOS LTD	257	291	113	9,215		エネルギー
SEEK LTD	55	64	94	7,685		商業・専門サービス
SONIC HEALTHCARE LTD	64	77	171	13,922		ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	822	965	249	20,254		素材
SUNCORP GROUP LTD	210	244	294	23,982		保険
TABCORP HOLDINGS LTD	144	155	71	5,804		消費者サービス
TATTS GROUP LTD	247	273	105	8,616		消費者サービス
TELSTRA CORP LTD	734	851	419	34,139		電気通信サービス
TPG TELECOM LTD	52	71	50	4,103		電気通信サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	116	139	146	11,952		食品・飲料・タバコ
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	78	103	55	4,505		電気通信サービス
WESFARMERS LIMITED	179	211	870	70,789		食品・生活必需品小売り
WESTPAC BANKING CORP	525	620	1,919	156,098		銀行
WOODSIDE PETROLEUM LTD	120	142	417	33,969		エネルギー
WOOLWORTHS LTD	202	239	556	45,234		食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	11,755	13,567	19,544	1,589,779	
	銘 柄 数<比 率>	60	59	-	<2.5%>	
(香港)			千香港ドル			
AIA GROUP LTD	1,886	2,220	10,404	148,780		保険
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	37	46	342	4,903		半導体・半導体製造装置
BANK OF EAST ASIA	182	218	687	9,835		銀行
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	555	680	1,908	27,291		銀行
CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD	200	250	263	3,760		運輸
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	90	120	771	11,033		公益事業
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	414	494	2,507	35,857		不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	419	494	4,688	67,051		資本財
CLP HOLDINGS LTD	311	296	2,184	31,241		公益事業
FIRST PACIFIC CO	380	400	210	3,008		各種金融
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	348	428	1,539	22,007		消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	341	401	682	9,762		不動産
HANG SENG BANK LTD	122	137	1,988	28,431		銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	171	187	785	11,230		不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,140	1,444	2,099	30,025		公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	180	213	4,326	61,863		各種金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	100	110	370	5,293		不動産
KERRY PROPERTIES LTD	100	125	259	3,709		不動産
LI & FUNG LTD	892	1,092	381	5,453		耐久消費財・アパレル
MGM CHINA HOLDINGS LTD	140	176	273	3,911		消費者サービス
MTR CORP	242	292	1,145	16,378		運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT	826	1,016	894	12,794		不動産
NWS HOLDINGS LTD	240	290	421	6,021		資本財
PCCW LTD	700	860	379	5,423		電気通信サービス
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	215	250	1,823	26,080		公益事業
SANDS CHINA LTD	361	433	1,602	22,921		消費者サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	200	240	208	2,985		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	株数	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		
SINO LAND CO	460	560	629	9,000	不動産	
SJM HOLDINGS LTD	290	350	203	2,902	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	280	270	2,710	38,758	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD	88	98	764	10,933	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD	180	214	470	6,732	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	210	250	717	10,260	耐久消費財・アパレル	
WH GROUP LTD	900	1,060	676	9,670	食品・飲料・タバコ	
WHARF HOLDINGS LTD	227	267	1,478	21,140	不動産	
WHEELLOCK & CO LTD	140	150	651	9,320	不動産	
WYNN MACAU LTD	237	285	365	5,225	消費者サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	115	140	385	5,505	耐久消費財・アパレル	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	13,927 38	16,564 38	52,203 -	746,508 <1.2%>	
(シンガポール)			千シンガポール・ドル			
CAPITALAND LTD	387	461	138	10,798	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	61	73	61	4,771	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	357	426	103	8,022	運輸	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	279	322	531	41,345	銀行	
GENTING SINGAPORE PLC	909	1,083	101	7,880	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	474	483	97	7,554	不動産	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,061	1,265	49	3,888	食品・飲料・タバコ	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	17	18	71	5,556	小売	
KEPPEL CORP LTD	217	259	139	10,843	資本財	
NOBLE GROUP LTD	716	1,563	27	2,165	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	484	569	504	39,275	銀行	
SEBACORP INDUSTRIES LTD	147	178	46	3,643	資本財	
SEBACORP MARINE LTD	124	158	21	1,659	資本財	
SINGAPORE AIRLINES LTD	88	104	100	7,858	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	121	144	102	8,001	各種金融	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	259	303	111	8,677	メディア	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	241	285	93	7,274	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,271	1,490	552	43,018	電気通信サービス	
STARHUB LTD	117	137	39	3,091	電気通信サービス	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	206	239	467	36,379	銀行	
UOL Group Limited	70	83	46	3,655	不動産	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	288	340	114	8,916	食品・飲料・タバコ	
YANGZHIJIANG SHIPBUILDING	280	326	25	1,966	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8,174 23	10,309 23	3,549 -	276,246 <0.4%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランド・ドル			
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	162	184	115	8,962	運輸	
CONTACT ENERGY LTD	114	135	63	4,918	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	102	122	130	10,185	素材	
MERCURY NZ LTD	112	134	40	3,183	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		
(ニュージーランド)	百株	百株	千円		
MERIDIAN ENERGY LTD	194	231	60	公益事業	
RYMAN HEALTHCARE LTD	56	67	57	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	283	334	112	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,026	1,211	580	45,174
		7	7	-	<0.1%>
(イギリス)			千イギリス・ポンド		
3I GROUP PLC	142	168	108	14,936	各種金融
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	133	160	46	6,314	各種金融
ADMIRAL GROUP PLC	31	37	71	9,867	保険
AGGREKO PLC	38	45	36	4,986	商業・専門サービス
ANGLO AMERICAN PLC	216	257	280	38,442	素材
ANTOFAGASTA PLC	58	69	46	6,314	素材
ARM HOLDINGS PLC	220	-	-	-	半導体・半導体製造装置
ASHTREAD GROUP PLC	75	89	126	17,355	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	56	63	161	22,157	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC	197	232	1,004	137,786	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	119	181	71	9,765	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC	630	743	337	46,301	保険
BABCOCK INTL GROUP PLC	37	44	43	6,005	商業・専門サービス
BAE SYSTEMS PLC	496	584	347	47,607	資本財
BARCLAYS PLC	2,617	3,101	658	90,255	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	150	177	86	11,910	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	19	23	58	8,066	耐久消費財・アパレル
BHP BILLITON PLC	329	387	489	67,168	素材
BP PLC	2,857	3,423	1,532	210,173	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	291	342	1,493	204,887	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC	1,330	1,557	565	77,509	電気通信サービス
BUNZL PLC	51	60	119	16,445	資本財
BURBERRY GROUP PLC	66	79	111	15,255	耐久消費財・アパレル
CAPITA PLC	100	119	69	9,495	商業・専門サービス
CARNIVAL PLC	28	33	137	18,927	消費者サービス
CENTRICA PLC	813	1,003	200	27,478	公益事業
COBHAM PLC	173	306	49	6,778	資本財
COCA-COLA HBC AG-CDI	29	31	53	7,340	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	256	301	416	57,134	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	19	23	73	10,141	素材
DCC PLC	-	15	98	13,495	資本財
DIAGEO PLC	392	462	938	128,746	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	204	243	86	11,851	保険
DIXONS CARPHONE PLC	146	173	58	8,091	小売
EASYJET PLC	25	29	31	4,299	運輸
EXPERIAN PLC	154	177	253	34,726	商業・専門サービス
FRESNILLO PLC	33	39	50	6,939	素材
G4S PLC	237	281	68	9,434	商業・専門サービス
GKN PLC	256	305	92	12,737	自動車・自動車部品

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	
			外貨建金額 邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イリス・ポンド 千円	
GLAXOSMITHKLINE PLC	760	895	1,364 187,099	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	1,906	2,245	588 80,666	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	38	45	56 7,695	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	-	25	42 5,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	3,054	3,634	2,303 315,971	銀行
ICAP PLC	82	98	46 6,380	各種金融
IMI PLC	40	48	45 6,268	資本財
IMPERIAL BRANDS PLC	149	176	610 83,767	食品・飲料・タバコ
INMARSAT PLC	70	82	59 8,185	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	29	33	108 14,897	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	24	29	93 12,857	商業・専門サービス
INVESTEC PLC	83	109	55 7,603	各種金融
ITV PLC	603	650	110 15,159	メディア
JOHNSON MATTHEY PLC	28	34	111 15,324	素材
KINGFISHER PLC	353	404	148 20,414	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	930	1,089	253 34,785	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,920	11,799	700 96,136	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	48	55	160 21,976	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	245	288	97 13,326	小売
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	55	65	49 6,829	ヘルスケア機器・サービス
MEGGITT PLC	116	138	62 8,528	資本財
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	106	125	55 7,550	消費者サービス
MONDI PLC/WI	54	65	102 13,994	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	333	393	86 11,796	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	588	693	644 88,390	公益事業
NEXT PLC	22	25	128 17,663	小売
OLD MUTUAL PLC	758	874	165 22,658	保険
PEARSON PLC	124	147	112 15,453	メディア
PERSIMMON PLC	46	54	96 13,285	耐久消費財・アパレル
PETROFAC LTD	38	46	36 4,991	エネルギー
PROVIDENT FINANCIAL PLC	22	26	77 10,675	各種金融
PRUDENTIAL PLC	400	471	715 98,069	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	13	16	96 13,182	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	99	116	805 110,454	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	176	204	277 38,041	商業・専門サービス
REXAM PLC	106	-	- -	素材
RIO TINTO PLC	193	226	665 91,270	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	291	337	222 30,479	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	-	13,864	1 190	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL	20,198	-	- -	資本財
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	533	627	128 17,657	銀行
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	613	778	1,545 212,002	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	619	693	1,434 196,741	エネルギー
ROYAL MAIL PLC	143	169	79 10,948	運輸
RSA INSURANCE GROUP PLC	153	181	94 12,955	保険

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数		評 価 額
		株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イリス・ポンド	千円
SABMILLER PLC		151	—	—	—
SAGE GROUP PLC		162	192	132	18,108
SAINSBURY (J) PLC		200	289	69	9,480
SCHRODERS PLC		18	23	67	9,261
SEVERN TRENT PLC		37	44	98	13,522
SHIRE PLC		92	164	791	108,522
SKY PLC		168	187	143	19,723
SMITH & NEPHEW PLC		142	164	182	25,005
SMITHS GROUP PLC		59	70	96	13,260
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL		39	—	—	—
SSE PLC		158	187	269	37,031
ST JAMES'S PLACE PLC		78	93	88	12,204
STANDARD CHARTERED PLC		509	603	377	51,739
STANDARD LIFE PLC		293	349	119	16,455
TATE & LYLE PLC		70	83	57	7,836
TAYLOR WIMPEY PLC		489	579	88	12,157
TESCO PLC		1,271	1,504	319	43,842
TRAVIS PERKINS PLC		37	44	62	8,615
TUI AG-DI		74	88	91	12,557
UNILEVER PLC		200	235	735	100,835
UNITED UTILITIES GROUP PLC		106	126	113	15,500
VODAFONE GROUP PLC		4,158	4,894	1,002	137,541
WEIR GROUP PLC/THE		31	38	66	9,129
WHITBREAD PLC		27	32	116	15,991
WILLIAM HILL PLC		132	153	44	6,164
WOLSELEY PLC		40	46	211	29,001
WORLDPAY GROUP PLC-W/I		178	256	70	9,697
WPP PLC		204	239	406	55,746
小 計	株 数 ・ 金 額	65,360	68,169	30,943	4,244,269
	銘 柄 数 < 比 率 >	109	107	—	< 6.8% >
(イスラエル)				千イスラエル・シケル	
AZRIELI GROUP		5	7	114	3,257
BANK HAPOALIM BM		157	186	427	12,200
BANK LEUMI LE-ISRAEL		209	255	391	11,181
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		299	381	252	7,217
DELEK GROUP LTD		0.73	—	—	—
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		75	91	132	3,789
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		21	26	142	4,066
NICE LTD		8	10	272	7,772
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD		142	—	—	—
小 計	株 数 ・ 金 額	920	959	1,733	49,485
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	7	—	< 0.1% >
(スイス)				千スイス・フラン	
ABB LTD		343	361	756	83,128

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等	
			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		
ACTELION LTD-REG	16	18	297	32,706	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	24	29	179	19,740	商業・専門サービス	
ARYZTA AG	13	15	66	7,339	食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDING AG	7	8	107	11,783	保険	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.33	0.40	49	5,434	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.13	0.16	81	8,908	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.02	119	13,145	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	81	95	633	69,668	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG	279	341	483	53,099	各種金融	
DUFREY AG-REG	6	8	102	11,241	小売	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1	1	72	7,996	素材	
GALENICA AG-REG	0.59	0.70	72	7,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GEBERIT AG-REG	6	7	286	31,467	資本財	
GIVAUDAN-REG	1	1	305	33,582	素材	
JULIUS BAER GROUP LTD	33	39	179	19,769	各種金融	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	9	10	139	15,296	運輸	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	70	83	450	49,554	素材	
LONZA GROUP AG	8	9	173	19,039	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NESTLE SA	497	585	4,008	440,661	食品・飲料・タバコ	
NOVARTIS AG	355	410	2,937	322,899	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PARGESA HOLDING SA-BR	4	6	40	4,404	各種金融	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2	3	151	16,605	各種金融	
ROCHE HOLDING AG	109	129	2,996	329,406	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	3	3	65	7,201	資本財	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6	7	141	15,561	資本財	
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	0.83	0.98	196	21,546	商業・専門サービス	
SIKA AG-BEARER	0.32	0.39	190	20,969	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	7	9	119	13,183	ヘルスケア機器・サービス	
SULZER AG-REG	3	-	-	-	資本財	
SWATCH GROUP AG	4	5	165	18,166	耐久消費財・アパレル	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	4	5	154	17,020	保険	
SWISS PRIME SITE-REG	10	12	105	11,569	不動産	
SWISS RE AG	54	60	565	62,185	保険	
SWISSCOM AG	4	4	208	22,931	電気通信サービス	
SYNGENTA AG	14	17	666	73,317	素材	
THE SWATCH GROUP AG-REG	7	8	49	5,442	耐久消費財・アパレル	
UBS GROUP AG	571	672	1,080	118,735	各種金融	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	23	27	735	80,800	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,590	3,007	19,134	2,103,452	
	銘 柄 数 < 比 率 >	39	38	-	< 3.4% >	
(デンマーク)				千デンマーク・クローネ		
A P MOLLER - MAERSK A/S	1	1	1,056	16,703	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S	0.60	0.67	572	9,046	運輸	
CARLSBERG AS-B	16	19	1,122	17,740	食品・飲料・タバコ	
CHR HANSEN HOLDING A/S	15	17	696	11,005	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	株数	株数	期末		業種等
			評価額	金額	
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円	
COLOPLAST-B	16	21	923	14,606	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	111	127	2,620	41,429	銀行
DSV A/S	30	35	1,108	17,527	運輸
GENMAB A/S	8	10	1,258	19,896	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S	22	29	721	11,406	商業・専門サービス
NOVO-NORDISK A/S	305	350	8,039	127,106	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S	35	41	995	15,734	素材
PANDORA A/S	17	20	1,698	26,848	耐久消費財・アパレル
TDC A/S	125	148	525	8,300	電気通信サービス
TRYGVESTA AS	17	20	263	4,158	保険
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	35	40	1,791	28,317	資本財
WILLIAM DEMANT HOLDING	3	21	247	3,916	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	761 16	906 16	23,639 -	373,745 <0.6%>
(ノルウェー)			千円	千円	
DNB ASA	151	175	2,157	27,857	銀行
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	30	36	508	6,569	保険
MARINE HARVEST	-	67	1,017	13,131	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA	202	237	921	11,896	素材
ORKLA ASA	123	145	1,100	14,206	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA	11	13	250	3,239	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS	14	16	303	3,914	メディア
STATOIL ASA	177	205	2,855	36,865	エネルギー
TELENOR ASA	118	135	1,701	21,965	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	26	31	1,023	13,211	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	856 9	1,065 10	11,840 -	152,857 <0.2%>
(スウェーデン)			千円	千円	
ALFA LAVAL AB	44	53	717	8,619	資本財
ASSA ABLOY AB	161	186	3,179	38,184	資本財
ATLAS COPCO AB	58	65	1,650	19,818	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS	106	127	3,571	42,897	資本財
BOLIDEN AB	40	48	1,108	13,312	素材
ELECTROLUX AB	36	43	929	11,165	耐久消費財・アパレル
GETINGE AB-B SHS	30	36	533	6,402	ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB	148	175	4,737	56,899	小売
HEXAGON AB-B SHS	39	46	1,471	17,675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUSQVARNA AB-B SHS	64	76	515	6,185	耐久消費財・アパレル
ICA GRUPPEN AB	12	14	399	4,792	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	24	29	463	5,569	各種金融
INVESTOR AB	73	84	2,615	31,417	各種金融
KINNEVIK AB - B	35	42	930	11,178	各種金融
LUNDIN PETROLEUM AB	33	34	545	6,547	エネルギー
NORDEA BANK AB	476	560	5,424	65,153	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		
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ・千円			
SANDVIK AB	161	191	2,073	24,903	資本財	
SECURITAS AB	47	56	764	9,183	商業・専門サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	244	280	2,606	31,302	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	57	60	1,264	15,186	資本財	
SKF AB	60	71	1,151	13,827	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB	96	112	2,759	33,137	家庭用品・パーソナル用品	
SVENSKA HANDELSBANKEN	241	282	3,573	42,920	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	143	168	3,573	42,911	銀行	
SWEDISH MATCH AB	30	34	1,006	12,082	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB	51	61	437	5,254	電気通信サービス	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	478	567	2,707	32,521	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB	411	475	1,657	19,905	電気通信サービス	
VOLVO AB	245	284	2,769	33,265	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,656	4,272	55,139	662,223	
	銘柄 数<比 率>	29	29	-	<1.1%>	
(ユーロ/アイルランド)			千ユーロ			
BANK OF IRELAND	4,297	5,017	109	12,868	銀行	
CRH PLC	130	154	491	57,821	素材	
KERRY GROUP PLC-A	26	30	195	23,049	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC	12	14	148	17,431	消費者サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,467	5,216	945	111,170	
	銘柄 数<比 率>	4	4	-	<0.2%>	
(ユーロ/オランダ)						
ABN AMRO GROUP NV-CVA	-	42	85	10,046	銀行	
AEGON NV	271	321	153	18,028	保険	
AIRBUS GROUP SE	92	107	595	70,072	資本財	
AKZO NOBEL NV	39	45	262	30,901	素材	
ALTICE NV - A-W/I	56	65	104	12,291	メディア	
ALTICE NV - B -W/I	15	20	32	3,817	メディア	
ASML HOLDING NV	54	67	667	78,494	半導体・半導体製造装置	
BOSKALIS WESTMINSTER	13	15	44	5,235	資本財	
CNH INDUSTRIAL NV	143	183	135	15,970	資本財	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	-	38	123	14,575	食品・飲料・タバコ	
FERRARI NV	19	22	110	13,023	自動車・自動車部品	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	135	160	112	13,268	自動車・自動車部品	
GEMALTO	12	14	69	8,196	ソフトウェア・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	15	17	118	13,958	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN NV	35	42	301	35,447	食品・飲料・タバコ	
ING GROEP NV	603	-	-	-	銀行	
ING GROEP NV-CVA	-	711	909	107,011	銀行	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	132	234	453	53,376	食品・生活必需品小売り	
KONINKLIJKE DSM NV	27	32	183	21,609	素材	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	148	171	464	54,698	資本財	
NN GROUP NV	35	55	166	19,549	保険	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等		
		株 数	株 数		評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
OCI NV	12	17	22	2,632		素材
QIAGEN NV	33	39	103	12,205		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD HOLDINGS NV	19	20	99	11,743		商業・専門サービス
RELX NV	161	187	279	32,890		商業・専門サービス
ROYAL KPN NV	517	622	159	18,805		電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	96	114	101	11,940		半導体・半導体製造装置
TNT EXPRESS NV - W/I	79	-	-	-		運輸
UNILEVER NV	253	298	1,095	128,923		家庭用品・パーソナル用品
VOPAK	10	12	54	6,414		エネルギー
WOLTERS KLUWER NV	47	54	179	21,170		商業・専門サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	3,084	3,738	7,194	846,302	
	銘 柄 数<比 率>	28	29	-	<1.4%>	
(ユーロ/ベルギー)						
AGEAS	30	34	121	14,287		保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	125	-	-	-		食品・飲料・タバコ
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	-	147	1,410	165,903		食品・飲料・タバコ
COLRUYT NV	10	11	55	6,507		食品・生活必需品小売り
DELHAIZE GROUP	15	-	-	-		食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11	14	106	12,580		各種金融
KBC GROEP NV	39	46	257	30,335		銀行
PROXIMUS	24	28	74	8,762		電気通信サービス
SOLVAY SA	11	13	132	15,589		素材
TELENET GROUP HOLDING NV	8	10	50	5,921		メディア
UCB SA	19	22	140	16,500		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE	14	16	91	10,772		素材
小 計	株 数 ・ 金 額	311	346	2,441	287,159	
	銘 柄 数<比 率>	11	10	-	<0.5%>	
(ユーロ/ルクセンブルグ)						
ARCELORMITTAL	150	329	216	25,471		素材
RTL GROUP	5	7	46	5,500		メディア
TENARIS SA	70	83	119	14,116		エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	227	420	383	45,089	
	銘 柄 数<比 率>	3	3	-	<0.1%>	
(ユーロ/フランス)						
ACCOR	31	30	102	12,085		消費者サービス
ADP	5	6	59	7,053		運輸
AIR LIQUIDE	53	63	596	70,162		素材
ALSTOM RGPT	24	28	75	8,828		資本財
ARKEMA	10	12	106	12,578		素材
ATOS SE	13	15	151	17,831		ソフトウェア・サービス
AXA	307	355	778	91,618		保険
BNP PARIBAS	165	194	1,058	124,552		銀行
BOLLORE	145	172	48	5,737		運輸
BOUYGUES	30	37	118	13,894		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	
BUREAU VERITAS SA	41	49	85	10,045	商業・専門サービス
CAP GEMINI SA	26	30	232	27,327	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	88	101	225	26,582	食品・生活必需品小売り
CASINO GUICHARD PERRACHON	8	10	45	5,300	食品・生活必需品小売り
CHRISTIAN DIOR SE	8	9	174	20,567	耐久消費財・アパレル
CIE DE SAINT-GOBAIN	74	90	375	44,192	資本財
CNP ASSURANCES	25	30	49	5,839	保険
CREDIT AGRICOLE SA	163	187	203	23,898	銀行
DANONE	92	108	640	75,333	食品・飲料・タバコ
DASSAULT SYSTEMES SA	19	23	165	19,473	ソフトウェア・サービス
EDENRED	31	37	70	8,344	商業・専門サービス
EDF	36	45	44	5,189	公益事業
EIFFAGE	-	11	69	8,158	資本財
ENGIE	229	270	304	35,812	公益事業
ESSILOR INTERNATIONA	32	37	387	45,562	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO	6	7	38	4,514	各種金融
EUTELSAT COMMUNICATIONS	27	32	52	6,140	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	79	89	74	8,726	運輸
HERMES INTERNATIONAL	4	4	178	21,002	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	4	4	87	10,258	電気通信サービス
IMERYS SA	5	6	43	5,070	素材
INGENICO GROUP	8	9	73	8,624	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JC DECAUX SA	11	13	35	4,148	メディア
KERING	11	13	278	32,705	耐久消費財・アパレル
LAGARDERE S.C.A.	19	22	51	6,049	メディア
LEGRAND SA	43	49	257	30,259	資本財
L'OREAL SA	39	46	742	87,345	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	43	51	848	99,805	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	29	33	332	39,066	自動車・自動車部品
NATIXIS	142	167	77	9,128	銀行
ORANGE S.A.	312	367	502	59,121	電気通信サービス
PERNOD-RICARD	33	39	403	47,468	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	66	86	120	14,148	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	30	35	212	25,040	メディア
REMY COINTREAU	3	3	29	3,471	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	30	35	261	30,779	自動車・自動車部品
REXEL SA	45	54	76	9,021	資本財
SAFRAN SA	48	57	360	42,440	資本財
SANOFI	183	212	1,619	190,462	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	87	102	638	75,071	資本財
SCOR REGROUPE	23	28	86	10,183	保険
SFR GROUP SA	16	20	46	5,469	電気通信サービス
SOCIETE BIC SA	4	5	63	7,492	商業・専門サービス
SOCIETE GENERALE	113	140	566	66,595	銀行
SODEXO	14	16	168	19,870	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	
(ユーロ/フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SUEZ	46	61	81	9,571		公益事業
TECHNIP SA	15	19	128	15,064		エネルギー
THALES SA	16	18	169	19,885		資本財
TOTAL SA	342	409	1,766	207,825		エネルギー
VALEO SA	12	42	218	25,761		自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	69	82	135	15,997		公益事業
VINCI SA	75	93	570	67,115		資本財
VIVENDI SA	184	216	396	46,685		メディア
WENDEL	4	5	58	6,924		各種金融
ZODIAC SA	30	36	78	9,205		資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	3,956	4,710	18,101	2,129,494	
	銘 柄 数 < 比 率 >	64	65	-	< 3.4% >	
(ユーロ/ドイツ)						
ADIDAS AG	32	34	480	56,467		耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE	71	83	1,260	148,297		保険
AXEL SPRINGER SE	7	8	35	4,128		メディア
BASF SE	143	168	1,351	158,993		素材
BAYER AG	129	151	1,388	163,391		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	51	61	494	58,155		自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	7	9	62	7,322		自動車・自動車部品
BEIERSDORF AG	14	17	136	16,022		家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG	23	27	132	15,568		資本財
COMMERZBANK AG	158	187	132	15,564		銀行
CONTINENTAL AG	17	20	342	40,258		自動車・自動車部品
COVESTRO AG	-	12	71	8,391		素材
DAIMLER AG	150	176	1,152	135,596		自動車・自動車部品
DEUTSCHE BANK AG	214	253	379	44,700		各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG	30	-	-	-		各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	-	27	209	24,632		各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	36	43	55	6,533		運輸
DEUTSCHE POST AG	153	180	525	61,859		運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG	505	595	857	100,834		電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	50	59	167	19,703		不動産
E.ON SE	318	368	224	26,352		公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	20	28	74	8,781		素材
FRAPORT AG	7	9	47	5,626		運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA	59	75	504	59,358		ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD	10	12	46	5,417		素材
GEA GROUP AG	27	32	109	12,830		資本財
HANNOVER RUECK SE	8	10	102	12,058		保険
HEIDELBERGCEMENT AG	21	24	208	24,577		素材
HENKEL AG & CO KGAA	15	17	164	19,385		家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG	28	33	362	42,608		家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	-	3	48	5,709		資本財
HUGO BOSS AG	10	11	63	7,500		耐久消費財・アパレル

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等		
		株 数	株 数		評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	179	207	331	38,996	半導体・半導体製造装置	
K+S AG	28	33	63	7,506	素材	
LANXESS	13	16	92	10,889	素材	
LINDE AG	28	34	519	61,113	素材	
MAN SE	5	6	60	7,126	資本財	
MERCK KGAA	19	23	224	26,381	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
METRO AG	26	31	87	10,245	食品・生活必需品小売り	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	25	29	509	59,902	保険	
OSRAM LICHT AG	13	15	74	8,814	資本財	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	22	26	124	14,634	自動車・自動車部品	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	33	39	133	15,692	メディア	
RWE AG	73	87	103	12,121	公益事業	
SAP SE	153	180	1,415	166,495	ソフトウェア・サービス	
SCHAEFFLER AG	-	29	36	4,330	自動車・自動車部品	
SIEMENS AG	123	140	1,495	175,969	資本財	
SYMRISE AG	18	22	124	14,606	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	117	138	48	5,744	電気通信サービス	
THYSSENKRUPP AG	55	65	139	16,362	素材	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	18	22	81	9,569	ソフトウェア・サービス	
VOLKSWAGEN AG	5	5	72	8,537	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG	28	34	400	47,124	自動車・自動車部品	
VONOVIA SE	74	86	261	30,750	不動産	
ZALANDO SE	13	15	55	6,480	小売	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,407	4,040	17,647	2,076,024	
	銘 柄 数 < 比 率 >	51	54	-	< 3.3% >	
(ユーロ/ポルトガル)						
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA	6,171	-	-	-	銀行	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	354	420	113	13,312	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	69	82	101	11,952	エネルギー	
JERONIMO MARTINS	37	44	66	7,837	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,633	547	281	33,102	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	3	-	< 0.1% >	
(ユーロ/スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	83	121	150	17,700	運輸	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	28	34	91	10,772	資本財	
AENA SA	10	12	158	18,601	運輸	
AMADEUS IT GROUP SA	70	80	337	39,683	ソフトウェア・サービス	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	990	1,187	695	81,832	銀行	
BANCO DE SABADELL SA	768	938	119	14,021	銀行	
BANCO POPULAR ESPANOL	255	601	51	6,076	銀行	
BANCO SANTANDER SA	2,247	2,648	1,129	132,926	銀行	
BANKIA SA	677	806	70	8,247	銀行	
BANKINTER SA	101	120	84	9,935	銀行	
CAIXABANK	390	468	132	15,603	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	
(ユーロ/スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	87	110	50	5,961	食品・生活必需品小売り	
ENAGAS SA	33	41	95	11,228	公益事業	
ENDESA SA	47	56	101	11,899	公益事業	
FERROVIAL S.A.	71	86	143	16,860	資本財	
GAS NATURAL SDG SA	52	62	100	11,804	公益事業	
GRIFOLS SA	44	53	98	11,532	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA	857	997	562	66,147	公益事業	
INDITEX SA	169	199	629	73,997	小売	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	125	145	75	8,882	運輸	
MAPFRE SA	142	181	49	5,838	保険	
RED ELECTRICA DE ESPANA	16	78	128	15,162	公益事業	
REPSOL SA	172	201	245	28,887	エネルギー	
TELEFONICA SA	706	825	658	77,509	電気通信サービス	
TELEFONICA SA-RTS	-	825	26	3,096	電気通信サービス	
ZARDOYA OTIS SA	26	33	24	2,919	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	8,179	10,916	6,010	707,128	
	銘柄 数<比 率>	25	26	-	<1.1%>	
(ユーロ/イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI SPA	185	214	240	28,323	保険	
ATLANTIA SPA	68	78	155	18,341	運輸	
BANCO POPOLARE SC	54	-	-	-	銀行	
ENEL SPA	1,246	1,406	508	59,842	公益事業	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA	396	467	578	68,039	エネルギー	
EXOR SPA	16	19	74	8,779	各種金融	
INTESA SANPAOLO	2,087	2,470	503	59,179	銀行	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	61	72	85	10,015	資本財	
LUXOTTICA GROUP SPA	25	30	147	17,346	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA	85	100	65	7,734	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	-	93	53	6,253	保険	
PRYSMIAN SPA	29	34	77	9,139	資本財	
SAIPEM SPA	920	1,083	42	4,958	エネルギー	
SNAM SPA	330	454	159	18,777	エネルギー	
TELECOM ITALIA SPA	2,491	2,537	174	20,479	電気通信サービス	
TERNA SPA	235	278	109	12,889	公益事業	
UNICREDIT SPA	760	935	185	21,836	銀行	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA	137	162	34	4,044	銀行	
UNIPOLSAI SPA	157	193	34	4,003	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	9,291	10,632	3,230	379,984	
	銘柄 数<比 率>	18	18	-	<0.6%>	
(ユーロ/フィンランド)						
ELISA OYJ	22	26	78	9,208	電気通信サービス	
FORTUM OYJ	66	79	107	12,679	公益事業	
KONE OYJ	53	61	255	30,028	資本財	
METSO OYJ	16	20	52	6,163	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	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額	評 価 額		
		株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
NESTE OYJ		19	22	82	9,733	エネルギー
NOKIA OYJ		901	1,074	420	49,420	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ		17	20	68	8,072	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B		15	18	72	8,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		69	81	343	40,387	保険
STORA ENSO OYJ		82	96	85	10,094	素材
UPM-KYMMENE OYJ		79	94	200	23,644	素材
WARTSILA OYJ		22	26	102	12,105	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	1,366	1,622	1,870	220,102	
	銘柄 数<比 率>	12	12	-	<0.4%>	
(ユーロ/オーストリア)						
ANDRITZ AG		11	13	62	7,319	資本財
ERSTE GROUP BANK AG		41	53	143	16,870	銀行
OMV AG		21	25	75	8,873	エネルギー
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING		17	20	34	4,052	銀行
VOESTALPINE AG		17	20	70	8,343	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	110	133	386	45,459	
	銘柄 数<比 率>	5	5	-	<0.1%>	
(ユーロ/その他)						
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		34	40	293	34,558	ヘルスケア機器・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	34	40	293	34,558	
	銘柄 数<比 率>	1	1	-	<0.1%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	41,070	42,366	58,785	6,915,577	
	銘柄 数<比 率>	226	230	-	<11.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	205,118	226,692	-	58,708,562	
	銘柄 数<比 率>	1,252	1,243	-	<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。

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円	
BOSTON PROPERTIES INC	2	2	343	38,163	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	5	6	528	58,678	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	1	141	15,657	
PROLOGIS INC	8	9	472	52,376	
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	14	17	178	19,807	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	2	409	45,473	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	1	117	13,036	
DUKE REALTY CORP	5	6	148	16,460	
EQUITY RESIDENTIAL	5	6	395	43,882	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	257	28,588	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	174	19,357	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	9	10	267	29,627	
HCP INC	7	8	246	27,321	
WELLTOWER INC	5	6	410	45,523	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	11	13	217	24,127	
KIMCO REALTY CORP	6	7	190	21,133	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	2	98	10,934	
MACERICH CO/THE	2	2	154	17,186	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	1	119	13,239	
PUBLIC STORAGE	2	2	551	61,192	
REGENCY CENTERS CORP	1	1	114	12,702	
SIMON PROPERTY GROUP INC	4	5	1,030	114,339	
SL GREEN REALTY CORP	1	1	185	20,585	
UDR INC	3	4	158	17,584	
VENTAS INC	5	6	372	41,330	
VORNADO REALTY TRUST	2	3	301	33,429	
REALTY INCOME CORP	3	4	259	28,746	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	2	157	17,501	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2	2	259	28,755	
IRON MOUNTAIN INC	3	4	140	15,636	
AGNC INVESTMENT CORP	5	5	109	12,142	
AMERICAN TOWER REIT INC	6	7	821	91,155	
EQUINIX INC	1	1	425	47,251	
VEREIT	13	17	142	15,785	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2	5	128	14,311	
小 計	口 数 ・ 金 額	153	187	10,031	1,113,029
	銘 柄 数 < 比 率 >	34	35	—	<1.8%>
(カナダ)				千カナダ・ドル	
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRU	1	1	36	3,034	
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	2	2	54	4,471	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2	2	75	6,245	
小 計	口 数 ・ 金 額	5	6	167	13,751
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<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		
	口 数	口 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	
DEXUS PROPERTY GROUP	16	19	172	14,004	
GPT GROUP	30	36	168	13,744	
GOODMAN GROUP	29	34	224	18,235	
STOCKLAND	39	47	197	16,066	
WESTFIELD CORP	33	38	347	28,258	
MIRVAC GROUP	63	75	148	12,082	
VICINITY CENTRES	56	66	186	15,206	
SCENTRE GROUP	90	103	427	34,738	
小 計	口 数 ・ 金 額	359	422	1,872	152,335
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	-	<0.2%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT		36	41	2,186	31,266
小 計	口 数 ・ 金 額	36	41	2,186	31,266
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	-	<0.1%>
(シンガポール)			千シンガポール・ドル		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	32	40	94	7,334	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	31	37	55	4,319	
CAPITALAND MALL TRUST	37	44	86	6,765	
SUNTEC REIT	37	43	72	5,641	
小 計	口 数 ・ 金 額	138	166	309	24,060
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	-	<0.0%>
(イギリス)			千イギリス・ポンド		
BRITISH LAND CO PLC	14	17	104	14,363	
HAMMERSON PLC	11	14	78	10,740	
LAND SECURITIES GROUP PLC	12	14	139	19,106	
SEGRO PLC	11	13	55	7,597	
INTU PROPERTIES PLC	14	16	45	6,240	
小 計	口 数 ・ 金 額	64	75	423	58,047
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	-	<0.1%>
(ユーロ/フランス)			千ユーロ		
UNIBAIL-RODAMCO SE	1	1	381	44,916	
KLEPIERRE	3	3	137	16,172	
GECINA SA	0.532	0.740	89	10,529	
FONCIERE DES REGIONS	0.478	0.647	48	5,708	
ICADE	0.510	0.692	43	5,084	
小 計	口 数 ・ 金 額	6	7	700	82,410
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	-	<0.1%>
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	6	7	700	82,410
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	-	<0.1%>
合 計	口 数 ・ 金 額	765	908	-	1,474,902
	銘柄 数 < 比 率 >	60	61	-	<2.4%>

(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。

(注2) 邦貨換算金額の< >内は、当期末の純資産総額に対する各国別投資信託証券評価額の比率です。

(注3) 口数および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、口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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(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
外 国	S&P 500 EMINI FUTURE	百万円 1,475	百万円 -
	DJ EURO STOXX 50	718	-

(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

(2016年11月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 58,708,562	% 93.3
投 資 信 託 証 券	1,474,902	2.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,727,863	4.4
投 資 信 託 財 産 総 額	62,911,328	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110.95円、1カナダ・ドル82.29円、1オーストラリア・ドル81.34円、1香港ドル14.30円、1シンガポール・ドル77.82円、1ニュージーランド・ドル77.85円、1イギリス・ポンド137.16円、1イスラエル・シェケル28.54円、1スイス・フラン109.93円、1デンマーク・クローネ15.81円、1ノルウェー・クローネ12.91円、1スウェーデン・クローナ12.01円、1ユーロ117.64円です。

(注2) 外貨建純資産 (62,040,530千円) の投資信託財産総額 (62,911,328千円) に対する比率は98.6%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

(2016年11月21日現在)

項 目	当 期 末
(A)資 産	62,903,430,311円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,716,467,326
株 式 (評 価 額)	58,708,562,978
投 資 信 託 証 券 (評 価 額)	1,474,902,228
未 収 入 金	21,153,439
未 収 配 当 金	105,372,858
差 入 委 託 証 拠 金	876,971,482
(B)負 債	488,376,804
未 払 解 約 金	488,374,428
そ の 他 未 払 費 用	2,376
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	62,415,053,507
元 本	46,538,854,861
次 期 繰 越 損 益 金	15,876,198,646
(D)受 益 権 総 口 数	46,538,854,861口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	13,411円

- (注1) 期首元本額 40,204,780,553円
 期中追加設定元本額 17,483,501,962円
 期中一部解約元本額 11,149,427,654円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーフンド別内訳は、次の通りです。
- | | |
|----------------------------------------|-----------------|
| DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) | 316,268,146円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) | 2,098,426,713円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) | 1,780,160,998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) | 12,274,209,247円 |
| ニッセイ厚生年金型バランス運用DB(適格機関投資家限定) | 1,891,324,584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 | 26,595,736,983円 |
| DCニッセイ外国株式インデックス | 1,336,069,884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資産等型) | 246,387,525円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2055 | 270,781円 |

◆損益の状況

当期 (2016年5月21日~2016年11月21日)

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	533,379,521円
受 取 配 当 金	533,454,285
受 取 利 息	19,892
そ の 他 収 益 金	169,227
支 払 利 息	△ 263,883
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	3,074,905,146
売 買 損 益	5,898,089,701
売 買 損	△ 2,823,184,555
(C)先 物 取 引 等 損 益	153,065,998
取 引 損 益	243,678,536
取 引 損	△ 90,612,538
(D)信 託 報 酬 等	△ 16,478,884
(E)当期損益金(A + B + C + D)	3,744,871,781
(F)前期繰越損益金	10,751,712,875
(G)追加信託差損益金	4,293,020,243
(H)解約差損益金	△ 2,913,406,253
(I)合 計 (E + F + G + H)	15,876,198,646
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	15,876,198,646

- (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。