

第5期末(2018年11月20日)

基準価額	14,973円
純資産総額	1,018億円
騰落率	1.8%
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:2017年11月21日～2018年11月20日

第5期(決算日 2018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>ニッセイ外国株式インデックスファンド」は、このたび第5期の決算を行いました。

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

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

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。



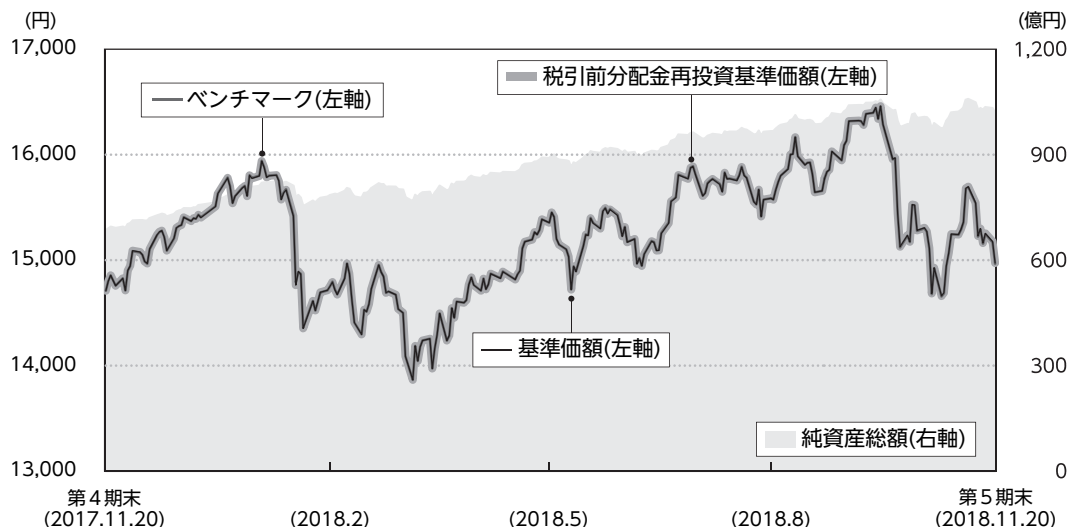
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2017年11月21日～2018年11月20日

基準価額等の推移



第5期首	14,711円	既払分配金	0円
第5期末	14,973円	騰落率(分配金再投資ベース)	1.8%

- (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ています。以下同じです。

基準価額の主な変動要因

期前半は、堅調な世界経済や企業業績に支えられ株式市場が上昇したことを受けて、基準価額は上昇しました。その後は、米利上げペースの加速に対する警戒感やトランプ米大統領による保護主義政策への懸念から、株式市場は一時下落する場面もありましたが、堅調な米マクロ経済指標や企業業績等に支えられ、上昇基調が続きました。10月以降は、米長期金利の上昇や米中貿易摩擦懸念、加えて中東情勢不安による地政学リスクの高まりなどを背景に株式市場が下落したことを受けて基準価額は下落しましたが、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

1 万口当たりの費用明細

項目	第 5 期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	28円	0.182%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は15,262円です。
(投信会社)	(13)	(0.084)	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)	(12)	(0.076)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	1	0.005	
(株式)	(0)	(0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	3	0.019	
(株式)	(3)	(0.018)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	10	0.064	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)	(8)	(0.051)	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)	(1)	(0.005)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(1)	(0.008)	・ 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	41	0.269	

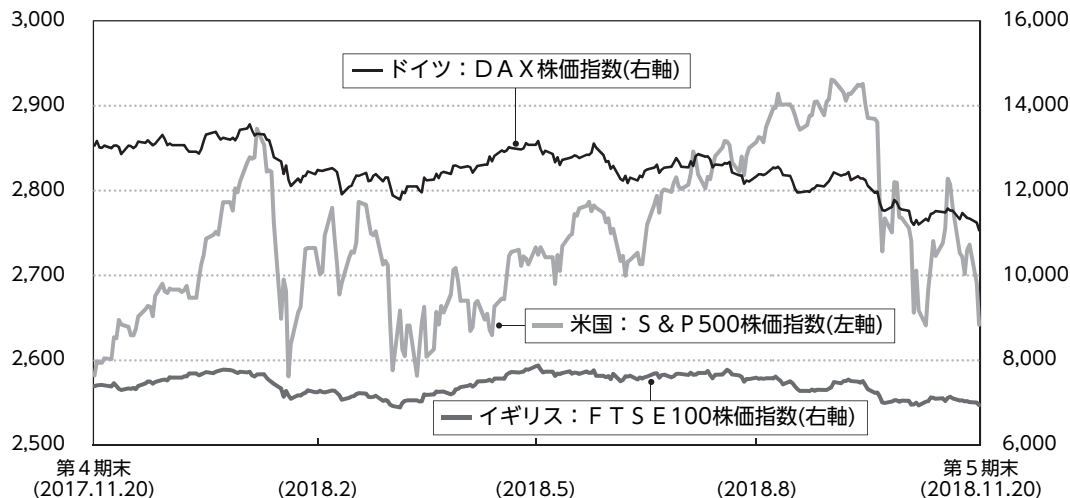
(注 1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(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。

当期の海外株式市場は、期を通じて見ると米国は上昇、そのほかについては下落しました。

期前半は、堅調な世界経済や企業業績に支えられ株式市場は上昇しました。その後は、米利上げペースの加速に対する警戒感やトランプ米大統領による保護主義政策への懸念から、株式市場は一時下落する場面もありましたが、堅調な米マクロ経済指標や企業業績等に支えられ、上昇基調が続きました。10月以降は、米長期金利の上昇や米中貿易摩擦懸念、加えて中東情勢不安による地政学リスクの高まりなどを背景に、株式市場は下落基調で推移しました。

ポートフォリオ

■当ファンド

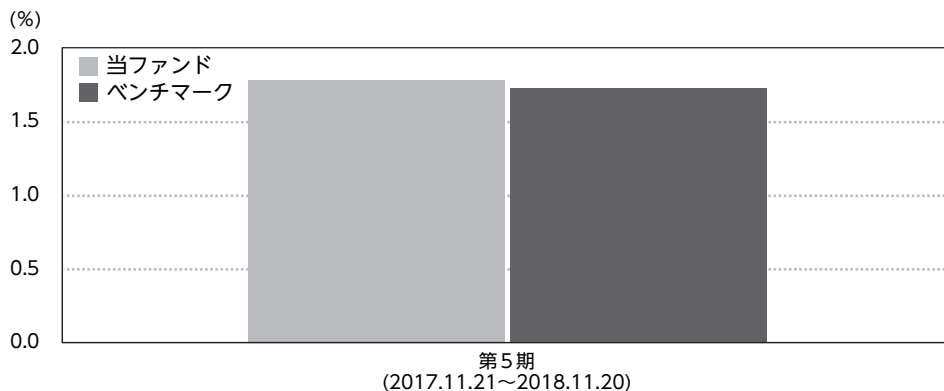
マザーファンド受益証券の組入比率を高位に保った運用を行いました（ただし、当ファンドから信託報酬等の費用を控除する関係などから、当ファンドの収益率はマザーファンドとは必ずしも一致しません）。

■マザーファンド

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

※ベンチマークの詳細につきましては、後掲のマザーファンドの概要をご参照ください。

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。

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+1.8%となり、ベンチマーク騰落率（+1.7%）におおむね連動しました。

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 2017年11月21日～2018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	4,973円

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

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■マザーファンド

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

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

組入ファンド

	第5期末 2018年11月20日
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	100.0%

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

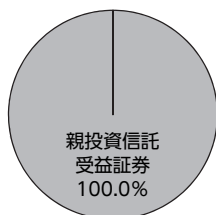
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

純資産等

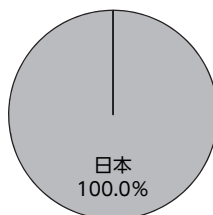
項目	第5期末 2018年11月20日
純資産総額	101,893,777,237円
受益権総口数	68,051,165,791口
1万口当たり基準価額	14,973円

(注) 当期間中における追加設定元本額は33,677,588,111円、同解約元本額は12,189,939,740円です。

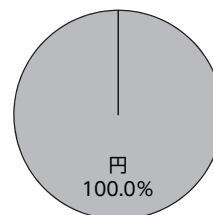
資産別配分



国別配分



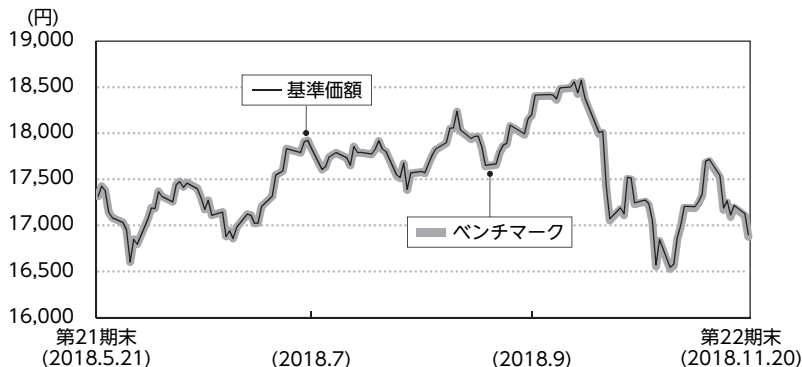
通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2018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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■基準価額の推移



(注) ベンチマークは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ています。

■上位銘柄

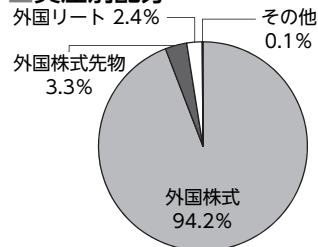
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	2.5%
MICROSOFT CORP	米ドル	2.1
AMAZON.COM INC	米ドル	1.7
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	1.1
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	1.0
EXXON MOBIL CORP	米ドル	0.9
ALPHABET INC-CL C	米ドル	0.9
FACEBOOK INC-A	米ドル	0.9
ALPHABET INC-CL A	米ドル	0.8
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	米ドル	0.8
組入銘柄数		1,301

■1万口当たりの費用明細

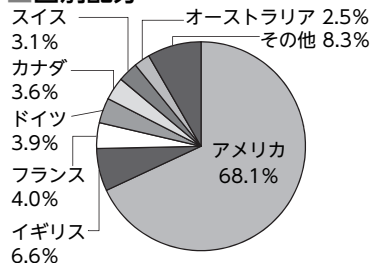
2018.5.22~2018.11.20

項目	金額
売買委託手数料	0円
(株式)	(0)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	1
(株式)	(1)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	5
(保管費用)	(4)
(その他)	(1)
合計	7

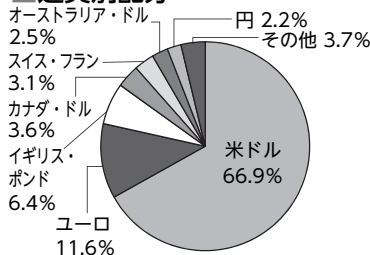
■資産別配分



■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（2018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。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 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
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	百万円
2013年12月10日	10,000	—	—	10,000	10,000	—	—	—	—	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
4期(2017年11月20日)	14,711	0	23.3	14,711	14,834	23.3	94.3	2.1	2.4	68,498
5期(2018年11月20日)	14,973	0	1.8	14,973	15,091	1.7	94.2	3.3	2.4	101,893

(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ています。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	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%
(期首)2017年11月20日	14,711	—	14,834	—	94.3	2.1	2.4
11月末	14,945	1.6	15,070	1.6	95.5	1.9	2.4
12月末	15,404	4.7	15,535	4.7	95.4	2.1	2.4
2018年1月末	15,575	5.9	15,709	5.9	95.0	2.7	2.2
2月末	14,872	1.1	14,997	1.1	94.5	3.3	2.1
3月末	14,239	△ 3.2	14,357	△ 3.2	95.0	2.6	2.3
4月末	14,872	1.1	14,997	1.1	94.8	2.7	2.2
5月末	14,939	1.5	15,066	1.6	95.8	1.9	2.2
6月末	15,056	2.3	15,184	2.4	95.4	2.1	2.2
7月末	15,648	6.4	15,782	6.4	95.7	1.9	2.2
8月末	15,984	8.7	16,120	8.7	95.1	2.4	2.2
9月末	16,387	11.4	16,523	11.4	95.8	1.9	2.2
10月末	14,947	1.6	15,066	1.6	94.2	3.4	2.3
(期末)2018年11月20日	14,973	1.8	15,091	1.7	94.2	3.3	2.4

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2017年11月21日～2018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
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	29,866,066	51,479,447	10,904,920	18,836,681

(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	48,258,907千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	123,952,182千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.38

(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

2017年11月21日～2018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

2018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
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	41,334,797	60,295,944	101,894,115

(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88,596,175千口です。

投資信託財産の構成

2018年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	101,894,115	99.8
コール・ローン等、その他	166,138	0.2
投資信託財産総額	102,060,254	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112.67円、1カナダ・ドル85.52円、1オーストラリア・ドル82.23円、1香港ドル14.38円、1シンガポール・ドル82.17円、1ニュージーランド・ドル77.08円、1イギリス・ポンド144.81円、1イスラエル・シェケル30.43円、1スイス・フラン113.42円、1デンマーク・クローネ17.28円、1ノルウェー・クローネ13.28円、1スウェーデン・クローナ12.51円、1ユーロ128.98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（146,483,125千円）の投資信託財産総額（150,189,252千円）に対する比率は97.5%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

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	102,060,254,192円
コール・ローン等	77,437,625
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	101,894,115,768
未収入金	88,700,799
(B)負債	166,476,955
未払解約金	86,970,412
未払信託報酬	77,277,967
その他未払費用	2,228,576
(C)純資産総額(A-B)	101,893,777,237
元本	68,051,165,791
次期繰越損益金	33,842,611,446
(D)受益権総口数	68,051,165,791口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,973円

(注) 期首元本額 46,563,517,420円
 期中追加設定元本額 33,677,588,111円
 期中一部解約元本額 12,189,939,740円

損益の状況

当期 (2017年11月21日～2018年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 28,602円
受取利息	2,497
支払利息	△ 31,099
(B)有価証券売買損益	164,759,022
売却益	857,562,495
売却損	△ 692,803,473
(C)信託報酬等	△ 161,630,767
(D)当期損益金(A+B+C)	3,099,653
(E)前期繰越損益金	6,841,088,946
(分配準備積立金)	(6,841,088,946)
(F)追加信託差損益金*	26,998,422,847
(配当等相当額)	(19,568,645,125)
(売買損益相当額)	(7,429,777,722)
(G)合計(D+E+F)	33,842,611,446
次期繰越損益金(G)	33,842,611,446
追加信託差損益金	26,998,422,847
(配当等相当額)	(19,638,125,954)
(売買損益相当額)	(7,360,296,893)
分配準備積立金	8,552,809,036
繰越欠損金	△ 1,708,620,437

(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	1,711,720,090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	25,289,802,410円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	6,841,088,946円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	33,842,611,446円
(f) 分配対象額 (1 万口当たり)	4,973.11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

代表取締役社長に西啓介が就任いたしました。

(2018年3月25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。

(2017年11月21日・2018年8月21日)

■関連会社の実質保有比率

2018年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるマザーファンドの信託財産において、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に13.6%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

当ファンドの概要

商	品	分	類	追加型投信／海外／株式／インデックス型
信	託	期	間	無期限
運	用	方	針	ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。
主要運用対象	<購入・換金手数料なし> ニッセイ外国株式 インデックスファンド			ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド受益証券
	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド			日本を除く主要先進国の株式
運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイ外国株式 インデックスファンド			以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ニッセイ外国株式 インデックス マザーファンド			以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分	配	方	針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 22 期

(計算期間：2018年5月22日～2018年11月20日)

運用方針

主に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

主要運用 対象

日本を除く主要先進国の株式

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

- ・ 株式への投資割合には、制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。



ニッセイアセットマネジメント株式会社

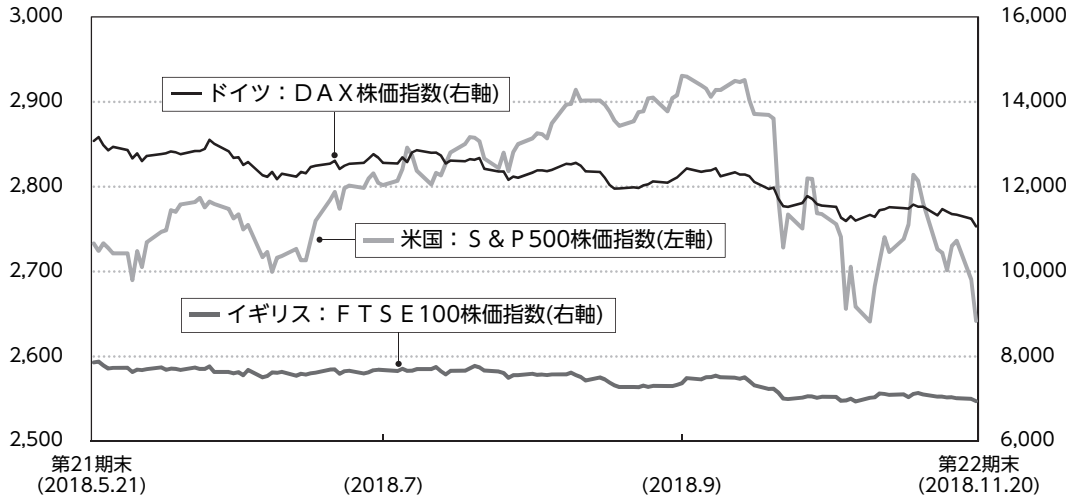
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2018年5月22日～2018年11月20日

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】

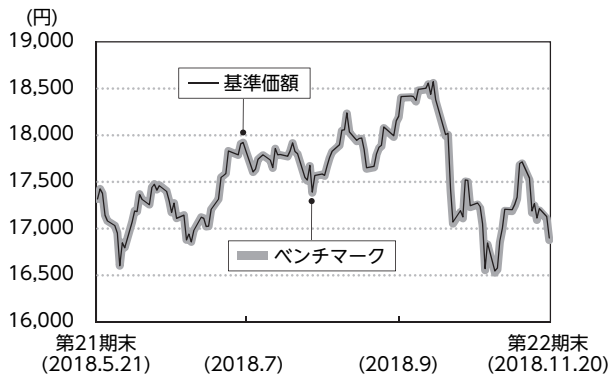


(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は、期を通じて見ると下落しました。

期前半は、イタリアの政情不安や米朝首脳会談の延期を背景に株式市場は下落して始まりました。その後は、米中貿易摩擦懸念により一時下落する場面もありましたが、堅調な米マクロ経済指標や企業業績などに支えられ、上昇基調が続きました。しかし期後半に入ると、米長期金利の上昇や米中貿易摩擦懸念の再燃、中東情勢不安等の地政学リスクの高まりなどを背景に株式市場は大きく下落する展開となりました。

基準価額等の推移



■基準価額の主な変動要因

当期は、海外株式市場が下落したことから、基準価額も同様の動きとなりました。期前半は、イタリアの政情不安や米朝首脳会談の延期から株式市場が下落して始まったことを受けて、基準価額は下落しました。その後は、米中貿易摩擦懸念により一時下落する場面もありましたが、堅調な米マクロ経済指標や企業業績などに支えられ、株式市場が上昇基調となったことから、基準価額も同様の動きとなりました。しかし期後半に入ると、米長期金利の上昇や米中貿易摩擦懸念の再燃、中東情勢不安等の地政学リスクの高まりなどを背景として株価が大きく下落したため、基準価額は下落して当期末を迎えました。

(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ています。以下同じです。

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は－2.4%となり、ベンチマーク騰落率（－2.5%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	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
18期(2016年11月21日)	13,411	5.8	13,235	5.9	94.1	3.5	2.4	62,415
19期(2017年5月22日)	15,268	13.8	15,052	13.7	94.6	2.8	2.4	82,206
20期(2017年11月20日)	16,572	8.5	16,316	8.4	94.3	2.1	2.4	105,613
21期(2018年5月21日)	17,317	4.5	17,031	4.4	95.6	1.9	2.2	131,686
22期(2018年11月20日)	16,899	△ 2.4	16,598	△ 2.5	94.2	3.3	2.4	149,718

(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ています。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
	円	%		%	%	%	%
(期首)2018年5月21日	17,317	—	17,031	—	95.6	1.9	2.2
5月末	16,847	△ 2.7	16,571	△ 2.7	95.8	1.9	2.2
6月末	16,982	△ 1.9	16,701	△ 1.9	95.4	2.1	2.2
7月末	17,653	1.9	17,358	1.9	95.7	1.9	2.2
8月末	18,035	4.1	17,730	4.1	95.1	2.4	2.2
9月末	18,492	6.8	18,174	6.7	95.8	1.9	2.2
10月末	16,868	△ 2.6	16,571	△ 2.7	94.2	3.4	2.3
(期末)2018年11月20日	16,899	△ 2.4	16,598	△ 2.5	94.2	3.3	2.4

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2018年5月22日～2018年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料	0円	0.002%	
(株式)	(0)	(0.001)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.008	
(株式)	(1)	(0.008)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	5	0.029	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)	(4)	(0.023)	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)	(1)	(0.006)	・ 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	0.040	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（17,533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

2018年5月22日～2018年11月20日

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 16,961 (710)	千米ドル 132,982 (△ 1,479)	百株 1,507	千米ドル 9,567
	カナダ	2,605 (75)	千カナダ・ドル 10,191	173	千カナダ・ドル 316
	オーストラリア	4,048 (△ 8)	千オーストラリア・ドル 6,642 (△ 17)	222	千オーストラリア・ドル 156
	香港	5,473 (311)	千香港ドル 19,336	2,000	千香港ドル 779
	シンガポール	2,446	千シンガポール・ドル 1,368	529	千シンガポール・ドル 99
	ニュージーランド	662	千ニュージーランド・ドル 539	218	千ニュージーランド・ドル 68
	イギリス	19,298 (27,453)	千イギリス・ポンド 11,563 (△ 90)	39,408	千イギリス・ポンド 1,501
	イスラエル	326 (△ 10)	千イスラエル・シェケル 797 (△ 347)	4	千イスラエル・シェケル 178
	スイス	1,036 (67)	千スイス・フラン 6,483	54	千スイス・フラン 189
	デンマーク	229	千デンマーク・クローネ 8,509	46	千デンマーク・クローネ 1,587
	ノルウェー	358	千ノルウェー・クローネ 5,784	—	千ノルウェー・クローネ —
	スウェーデン	1,326 (342)	千スウェーデン・クローナ 17,797	512	千スウェーデン・クローナ 1,435

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	251	613	—	—
		オランダ	1,067	2,825	557	903
		ベルギー	105	683	0.99	4
		ルクセンブルグ	65	148	—	—
		フランス	1,655	7,176	47	149
				(△ 2)		
		ドイツ	1,507	6,789	411	1,754
			(298)	(△ 9)		
		ポルトガル	240	126	—	—
		スペイン	2,927	2,102	—	—
			(20)	(0.1000)		
		イタリア	3,260	1,649	388	93
			(68)			
		フィンランド	452	663	43	26
		オーストリア	40	151	0.27	1
				(△ 11)		
		その他	11	92	—	—

(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

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	0.920	113	—	—
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2	279	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.873	109	—	—
PROLOGIS INC	6	431	—	—
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	5	61	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.807	142	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.592	54	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1	48	—	—
DUKE REALTY CORP	2	62	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	2	141	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.391	94	—	—
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.491	61	—	—
GGP INC	4	99	—	—
	(△ 22)			
HCP INC	2	73	—	—
WELLTOWER INC	2	138	—	—
HOST HOTELS AND RESORTS INC	4	89	—	—
KIMCO REALTY CORP	2	41	—	—
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	44	—	—
MACERICH CO/THE	0.622	34	0.384	21
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.704	70	—	—
PUBLIC STORAGE	0.893	187	—	—
REGENCY CENTERS CORP	0.938	59	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	323	0.209	38
SL GREEN REALTY CORP	0.452	44	0.205	19
UDR INC	1	64	—	—
VENTAS INC	2	114	—	—
VORNADO REALTY TRUST	1	74	—	—
REALTY INCOME CORP	1	103	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.761	69	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	134	—	—
IRON MOUNTAIN INC	1	61	—	—
AGNC INVESTMENT CORP	4	94	—	—
AMERICAN TOWER REIT INC	2	406	—	—
EQUINIX INC	0.481	201	—	—
VEREIT	6	48	—	—

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	—	9	150
COLONY CAPITAL INC	—	—	15	94
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.581	92	—	—
INVITATION HOMES INC	2	46	—	—
BROOKFIELD PROPERTY PARTNERS	—	—	0.355	6
	(0.355)	(8)		
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	0.589	11	—	0.010
	(8)	(△ 271)		
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1	37	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	1	39	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1	43	—	—
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
DEXUS	8	83	—	—
GPT GROUP	15	80	—	—
GOODMAN GROUP	10	102	5	48
STOCKLAND	18	74	—	—
WESTFIELD CORP	—	—	64	569
MIRVAC GROUP	28	66	—	—
VICINITY CENTRES	26	70	—	—
SCENTRE GROUP	37	154	—	—
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	11	820	0.500	34
(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	18	50	0.200	0.528
		(△0.648)		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	25	45	—	—
CAPITALAND MALL TRUST	21	45	1	2
SUNTEC REIT	16	29	11	19
		(△0.583)		
(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	6	39	0.176	1
HAMMERSON PLC	4	23	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	5	48	—	—
SEGRO PLC	7	49	—	—

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(ユーロ／フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO SE	1	242	4	835
KLEPIERRE	1	57	0.412	13
GECINA SA	0.403	58	0.084	11
COVIVIO	0.678	60	—	—
ICADE	0.564	46	—	—

(注1) ()内は分割、合併などによる増減分で、上段の数字には含まれていません。

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外 国 株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
	30,329	27,759	—	—

(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

2018年5月22日～2018年11月20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	22	531,819	23,195	MONSANTO CO	14	198,582	14,149
AMAZON.COM INC	2	454,037	201,704	LINDE PLC	10	188,369	18,406
MICROSOFT CORP	37	448,098	12,010	APPLE INC	4	104,876	25,850
FACEBOOK INC-A	12	249,131	19,174	SKY PLC	36	89,988	2,479
JOHNSON & JOHNSON	13	209,145	15,039	KEURIG DR PEPPER INC	5	79,763	13,641
ALPHABET INC-CL C	1	208,989	128,214	RELX PLC	33	78,357	2,361
ALPHABET INC-CL A	1	205,138	129,998	XL GROUP LTD	8	57,559	6,541
EXXON MOBIL CORP	22	201,250	9,129	CA Inc	11	55,863	5,013
JPMORGAN CHASE & CO	15	197,343	12,498	OLD MUTUAL PLC	156	47,539	304
LINDE PLC	10	192,403	18,651	AMGEN INC	1	31,429	20,044

(注1) 金額は受渡代金で、外国株式は各月末（決算日の属する月については決算日）における国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

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

組入有価証券明細表

2018年11月20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	186	217	4,467	503,371	資本財
ABBOTT LABORATORIES	546	641	4,528	510,181	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	501	555	4,970	559,998	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	－	15	463	52,260	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC	192	235	3,829	431,450	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	225	264	1,300	146,576	ソフトウェア・サービス
ACUITY BRANDS INC	13	14	185	20,863	資本財
ADOBE INC	154	180	3,962	446,410	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	23	27	480	54,193	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	257	337	644	72,590	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	42	45	230	25,938	資本財
AES CORP	210	245	377	42,503	公益事業
AETNA INC	102	119	2,484	279,880	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	17	19	216	24,425	各種金融
AFLAC INC	245	282	1,279	144,153	保険
AGCO CORP	19	22	131	14,777	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	100	116	731	82,400	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	68	80	1,280	144,226	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	53	62	425	47,990	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	34	40	403	45,419	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	70	81	936	105,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	23	27	569	64,193	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	48	56	193	21,774	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	4	5	344	38,820	保険
ALLEGION PLC	30	34	310	34,937	資本財
ALLERGAN PLC	104	124	1,936	218,145	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	15	18	353	39,876	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	73	85	389	43,899	公益事業
ALLSTATE CORP	112	128	1,133	127,670	保険
ALLY FINANCIAL INC	138	157	392	44,255	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	27	33	236	26,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	93	109	11,239	1,266,407	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	98	115	11,730	1,321,619	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	598	692	3,858	434,732	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	128	151	22,844	2,573,907	小売
AMERCO	2	3	120	13,583	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AMEREN CORPORATION	76	89	627	70,702	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	38	44	160	18,072	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	154	181	1,403	158,149	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	231	267	2,899	326,683	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	23	26	278	31,407	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	281	328	1,422	160,277	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	56	65	615	69,342	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	46	52	664	74,904	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	51	60	547	61,703	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	88	103	539	60,832	各種金融
AMETEK INC	72	84	611	68,898	資本財
AMGEN INC	227	242	4,722	532,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	95	110	950	107,065	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	171	188	1,046	117,962	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	115	135	1,159	130,696	半導体・半導体製造装置
ANDEAVOR	46	－	－	－	エネルギー
ANSYS INC	26	30	458	51,632	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	69	74	105	11,891	エネルギー
ANTHEM INC	80	93	2,632	296,633	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	78	89	1,479	166,727	保険
APACHE CORP	118	139	509	57,374	エネルギー
APPLE INC	1,611	1,800	33,457	3,769,666	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	334	368	1,270	143,094	半導体・半導体製造装置
APTIV PLC	83	96	699	78,820	自動車・自動車部品
ARAMARK	76	89	321	36,272	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	41	147	417	46,989	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	175	203	943	106,322	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	135	158	323	36,435	資本財
ARISTA NETWORKS INC	14	19	426	48,039	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	27	31	233	26,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	56	66	518	58,399	保険
ASSURANT INC	16	18	188	21,182	保険
AT&T INC	1,930	2,663	8,084	910,875	電気通信サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	33	56	247	27,891	保険
ATMOS ENERGY CORP	33	41	407	45,945	公益事業
AUTODESK INC	61	80	1,010	113,832	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	27	31	269	30,413	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	139	161	2,312	260,570	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	16	－	－	－	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	
AUTOZONE INC	8	9	811	91,387	小売
AVERY DENNISON CORP	27	32	296	33,432	素材
AVNET INC	37	42	183	20,639	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	69	81	197	22,302	素材
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	25	29	160	18,033	保険
BAKER HUGHES A GE CO	127	151	349	39,350	エネルギー
BALL CORP	104	121	600	67,703	素材
BANK OF AMERICA CORP	3,108	3,525	9,784	1,102,377	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	320	369	1,851	208,640	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	153	186	1,210	136,347	ヘルスケア機器・サービス
BB&T CORPORATION	246	283	1,466	165,204	銀行
BECTON DICKINSON & CO	83	97	2,382	268,424	ヘルスケア機器・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	398	468	10,203	1,149,679	各種金融
BEST BUY CO INC	84	92	576	64,992	小売
BIOGEN INC	66	77	2,466	277,868	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	55	64	606	68,280	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	37	43	1,789	201,650	各種金融
BOEING CO	177	202	6,505	732,933	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	15	17	3,141	353,975	小売
BORGWARNER INC	66	76	301	33,937	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	431	504	1,781	200,730	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	26	38	153	17,307	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	513	598	3,200	360,559	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	128	150	3,445	388,222	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	36	43	435	49,032	ソフトウェア・サービス
BROWN-FORMAN CORP -CL B	80	96	460	51,864	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	44	51	300	33,846	食品・飲料・タバコ
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	45	52	474	53,451	運輸
CA Inc	98	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	145	165	426	48,021	エネルギー
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	88	102	440	49,624	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	56	65	253	28,522	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	151	177	1,561	175,895	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	98	113	620	69,882	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	57	65	406	45,805	小売
CARNIVAL CORP	108	155	921	103,769	消費者サービス
CATERPILLAR INC	186	218	2,757	310,681	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	32	41	455	51,364	各種金融
CBRE GROUP INC	95	119	522	58,878	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	
CBS CORP-CL B	109	126	694	78,285	メディア
CDK GLOBAL INC	39	46	228	25,759	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	48	55	488	55,059	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	42	49	503	56,714	素材
CELGENE CORP	247	265	1,842	207,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	54	75	986	111,129	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	130	151	425	47,885	公益事業
CENTURYLINK INC	303	357	679	76,598	電気通信サービス
CERNER CORP	93	109	614	69,232	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	73	85	387	43,707	素材
CHARLES SCHWAB CORP	378	444	2,043	230,215	各種金融
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	58	61	1,976	222,734	メディア
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	40	46	517	58,286	ソフトウェア・サービス
CHEMOURS CO/THE - W/I	57	65	190	21,438	素材
CHENIERE ENERGY INC	63	77	463	52,239	エネルギー
CHEVRON CORP	596	699	8,354	941,328	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	7	9	426	48,027	消費者サービス
CHUBB LTD	145	170	2,284	257,400	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	78	89	577	65,123	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	77	89	1,880	211,892	ヘルスケア機器・サービス
CIMAREX ENERGY CO	29	34	306	34,565	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	48	56	455	51,278	保険
CINTAS CORP	28	33	595	67,073	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	1,552	1,723	7,883	888,234	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIT GROUP INC	41	41	186	21,038	銀行
CITIGROUP INC	829	933	6,031	679,612	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	153	176	633	71,430	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	47	49	531	59,858	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	40	47	768	86,542	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	106	124	2,435	274,368	各種金融
CMS ENERGY CORP	90	105	542	61,133	公益事業
COCA-COLA CO	1,270	1,480	7,478	842,558	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	68	79	390	43,987	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	54	63	257	29,025	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	184	214	1,483	167,108	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	262	303	1,904	214,630	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	1,465	1,683	6,429	724,378	メディア
COMERICA INC	54	62	504	56,808	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	60	71	128	14,525	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

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	
CONAGRA BRANDS INC	128	143	479	54,067	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	46	73	1,016	114,476	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	374	427	2,841	320,115	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	97	114	887	100,015	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	54	61	1,190	134,112	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	28	33	160	18,030	エネルギー
COOPER COS INC/THE	15	17	459	51,791	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	－	76	370	41,750	商業・専門サービス
CORNING INC	272	303	947	106,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTAR GROUP INC	11	13	464	52,303	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	137	160	3,674	414,003	食品・生活必需品小売り
COTY INC-CL A	152	178	162	18,356	家庭用品・パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	42	49	242	27,378	素材
CSX CORP	268	306	2,207	248,672	運輸
CUMMINS INC	49	57	831	93,699	資本財
CVS HEALTH CORP	317	372	2,923	329,405	ヘルスケア機器・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	－	124	110	12,434	食品・生活必需品小売り
DANAHER CORP	196	230	2,330	262,544	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	38	45	512	57,704	消費者サービス
DAVITA INC	46	51	309	34,905	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	85	112	1,608	181,242	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	63	72	752	84,800	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	57	65	369	41,625	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	71	83	306	34,563	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	155	191	566	63,785	エネルギー
DIAMONDBACK ENERGY INC	27	36	410	46,213	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	113	127	893	100,679	各種金融
DISCOVERY INC-A	47	60	182	20,612	メディア
DISCOVERY INC-C	95	110	306	34,522	メディア
DISH NETWORK CORP	72	85	267	30,167	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	85	97	1,082	121,909	小売
DOLLAR TREE INC	74	87	731	82,425	小売
DOMINION ENERGY INC	202	240	1,787	201,346	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	13	14	371	41,805	消費者サービス
DOVER CORP	48	56	487	54,885	資本財
DOWDUPONT INC	734	849	4,909	553,189	素材
DR HORTON INC	111	131	458	51,694	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	56	67	799	90,111	公益事業
DUKE ENERGY CORP	220	257	2,258	254,443	公益事業

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
DXC TECHNOLOGY CO	89	104	618	69,633	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL	83	96	494	55,705	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	44	51	272	30,746	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	45	51	425	47,918	素材
EATON CORP PLC	137	159	1,171	132,033	資本財
EATON VANCE CORP	36	42	179	20,193	各種金融
EBAY INC	311	345	967	108,989	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	81	95	1,523	171,615	素材
EDISON INTERNATIONAL	102	119	645	72,754	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	66	77	1,155	130,232	ヘルスケア機器・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	96	112	932	105,059	ソフトウェア・サービス
ELI LILLY & CO	310	357	4,140	466,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	201	230	1,576	177,577	資本財
ENTERGY CORP	57	66	579	65,269	公益事業
ENVISION HEALTHCARE CORP	38	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	180	211	2,235	251,844	エネルギー
EQT CORP	79	－	－	－	エネルギー
EQUIFAX INC	37	43	446	50,282	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC	70	81	1,169	131,803	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	12	14	320	36,083	保険
EVERGY INC	－	100	598	67,446	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	100	116	787	88,754	公益事業
EXELON CORP	301	354	1,635	184,270	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	39	45	512	57,687	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	58	65	485	54,666	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	177	205	1,992	224,446	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	1,329	1,549	12,278	1,383,423	エネルギー
F5 NETWORKS INC	19	22	381	42,979	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	748	878	11,556	1,302,089	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	90	105	603	68,013	資本財
FEDEX CORP	80	93	2,119	238,806	運輸
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	80	99	321	36,265	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	104	120	1,262	142,235	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	220	249	682	76,934	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	143	193	327	36,852	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	49	58	551	62,127	銀行
FIRSTENERGY CORP	140	176	680	76,619	公益事業
FISERV INC	131	149	1,177	132,681	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	28	32	626	70,615	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FLEX LTD	166	192	155	17,519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLIR SYSTEMS INC	43	50	229	25,908	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWERVE CORP	40	47	231	26,127	資本財
FLUOR CORP	43	51	224	25,259	資本財
FMC CORP	42	49	402	45,390	素材
FORD MOTOR CO	1,162	1,361	1,259	141,869	自動車・自動車部品
FORTINET INC	46	52	353	39,848	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	98	114	844	95,130	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	47	53	226	25,543	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	103	116	376	42,444	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	430	502	578	65,147	素材
GAP INC	72	85	216	24,401	小売
GARMIN LTD	38	41	266	30,018	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	28	33	486	54,775	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	79	92	1,655	186,484	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,721	3,181	2,493	280,989	資本財
GENERAL MILLS INC	178	216	959	108,129	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	400	464	1,657	186,703	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	45	53	544	61,370	小売
GILEAD SCIENCES INC	409	476	3,237	364,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	50	58	609	68,634	ソフトウェア・サービス
GODADDY INC - CLASS A	－	59	350	39,480	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	112	131	2,606	293,662	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	77	87	195	21,978	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	65	76	213	24,049	消費者サービス
HALLIBURTON CO	273	319	1,055	118,891	エネルギー
HANESBRANDS INC	114	132	197	22,268	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	53	61	245	27,631	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	37	43	641	72,268	資本財
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	111	130	570	64,297	保険
HASBRO INC	35	43	412	46,474	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	89	102	1,384	156,030	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	55	64	242	27,374	資本財
HELMERICH & PAYNE	33	39	251	28,382	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	49	56	485	54,740	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	44	51	560	63,138	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	89	100	574	64,760	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	499	558	828	93,309	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	60	104	744	83,855	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HOLLYFRONTIER CORP	52	61	381	42,993	エネルギー
HOLOGIC INC	86	99	415	46,808	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	366	422	7,335	826,537	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	226	273	4,029	454,017	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	375	446	286	32,261	不動産
HORMEL FOODS CORP	90	105	480	54,107	食品・飲料・タバコ
HP INC	523	601	1,415	159,468	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	44	50	1,564	176,227	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	337	401	595	67,066	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	14	16	343	38,735	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	23	28	477	53,819	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	23	27	374	42,208	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	27	31	616	69,445	ヘルスケア機器・サービス
IHS MARKIT LTD	124	142	722	81,388	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	96	111	1,494	168,342	資本財
ILLUMINA INC	45	53	1,623	182,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	56	65	423	47,770	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND PLC	78	90	933	105,197	資本財
INGREDION INC	22	26	274	30,912	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	1,468	1,706	8,190	922,799	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	183	211	1,722	194,050	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	275	336	4,043	455,553	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	24	32	453	51,069	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	123	143	664	74,880	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	123	142	334	37,682	メディア
INTUIT INC	76	89	1,776	200,194	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	35	41	2,001	225,523	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	127	149	300	33,835	各種金融
IPG PHOTONICS CORP	11	13	186	21,028	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IQVIA HOLDINGS INC	42	58	677	76,374	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	24	28	379	42,765	ソフトウェア・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	39	46	337	37,995	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	68	82	522	58,842	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	70	82	292	33,001	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	18	21	313	35,299	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	28	33	363	40,956	運輸
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	100	113	240	27,141	各種金融
JM SMUCKER CO	35	41	463	52,223	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	843	982	14,507	1,634,613	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	290	338	1,132	127,551	資本財
JONES LANG LASALLE INC	14	16	236	26,592	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	1,088	1,246	13,813	1,556,419	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	118	128	360	40,666	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	33	38	384	43,325	運輸
KELLOGG CO	81	95	587	66,225	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	56	－	－	－	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	336	386	705	79,494	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	－	68	378	42,700	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	110	127	1,412	159,151	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	631	726	1,265	142,539	エネルギー
KLA-TENCOR CORP	49	57	526	59,327	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	44	51	165	18,604	運輸
KOHL'S CORP	52	61	436	49,165	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	190	222	1,156	130,346	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	276	297	908	102,410	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	75	86	300	33,827	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	24	28	536	60,419	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	31	37	604	68,156	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	50	60	863	97,235	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	123	143	726	81,846	消費者サービス
LEAR CORP	21	24	325	36,649	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	41	47	179	20,248	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	44	52	335	37,811	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	89	105	438	49,359	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	13	294	33,142	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	33	39	322	36,369	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62	71	170	19,191	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	176	200	464	52,336	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29	32	125	14,166	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	57	65	252	28,456	メディア
LIBERTY MEDIA GROUP-C	63	74	223	25,197	メディア
LINCOLN NATIONAL CORP	68	79	498	56,148	保険
LINDE PLC	－	205	3,285	370,163	素材
LIVE NATION INC	46	54	287	32,443	メディア
LKQ CORP	97	113	311	35,145	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	81	94	2,775	312,663	資本財
LOEWS CORP	89	98	476	53,671	保険
LOWE'S COS INC	260	301	2,750	309,883	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	
LULULEMON ATHLETICA INC	31	37	473	53,297	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	105	121	1,128	127,198	素材
M&T BANK CORP	42	50	843	95,045	銀行
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	27	－	－	－	運輸
MACY'S INC	95	111	370	41,695	小売
MANPOWER GROUP	20	23	185	20,926	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	264	310	531	59,844	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	153	254	1,612	181,725	エネルギー
MARKEL CORP	4	5	561	63,250	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	97	109	1,280	144,268	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	160	185	1,646	185,517	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	19	23	427	48,172	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	122	224	340	38,403	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	99	113	350	39,479	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	294	339	6,426	724,087	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	108	126	167	18,892	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	88	102	530	59,812	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	37	44	662	74,596	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	250	287	5,369	605,024	消費者サービス
MCKESSON CORP	65	73	932	105,112	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	424	495	4,480	504,822	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	77	90	148	16,699	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	13	15	515	58,118	ソフトウェア・サービス
MERCK & CO INC	854	984	7,519	847,237	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	279	314	1,374	154,910	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8	9	536	60,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	142	193	496	55,930	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	47	54	244	27,542	耐久消費財・アパレル
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	73	85	634	71,478	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	361	424	1,563	176,152	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	2,299	2,673	27,965	3,150,902	ソフトウェア・サービス
MIDDLEBY CORP	17	20	235	26,520	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	19	23	288	32,478	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	59	69	459	51,740	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	468	539	2,398	270,260	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	138	－	－	－	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	123	154	880	99,247	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	54	63	938	105,739	各種金融
MORGAN STANLEY	425	486	2,160	243,398	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	
MOSAIC CO/THE	104	133	467	52,622	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	51	59	755	85,161	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	28	32	475	53,584	各種金融
MYLAN NV	142	188	652	73,472	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	36	42	377	42,582	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	118	139	457	51,546	エネルギー
NEKTAR THERAPEUTICS	－	62	238	26,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	83	98	659	74,288	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	135	159	4,308	485,437	小売
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	151	174	167	18,859	銀行
NEWELL BRANDS INC	153	177	380	42,922	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	62	72	140	15,844	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	165	193	635	71,594	素材
NEWS CORP - CLASS A	121	143	191	21,541	メディア
NEXTERA ENERGY INC	147	173	3,149	354,895	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	111	130	334	37,658	商業・専門サービス
NIKE INC	411	469	3,406	383,857	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	108	134	349	39,382	公益事業
NOBLE ENERGY INC	144	176	440	49,669	エネルギー
NORDSTROM INC	39	42	220	24,799	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	91	104	1,781	200,763	運輸
NORTHERN TRUST CORP	67	77	761	85,762	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	51	60	1,632	183,966	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	57	77	383	43,249	消費者サービス
NUCOR CORP	99	115	717	80,816	素材
NVIDIA CORP	190	211	3,055	344,261	半導体・半導体製造装置
NVR INC	1	1	309	34,847	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	106	125	1,024	115,483	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	239	279	2,051	231,102	エネルギー
OGE ENERGY CORP	63	73	291	32,830	公益事業
OLD DOMINION FREIGHT LINE	20	23	312	35,198	運輸
OMNICOM GROUP	73	84	646	72,854	メディア
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	－	155	274	30,948	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	120	150	937	105,572	エネルギー
ORACLE CORP	982	1,121	5,554	625,859	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	26	30	1,063	119,856	小売
OWENS CORNING	34	40	196	22,193	資本財
PACCAR INC	110	128	775	87,380	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	29	34	333	37,522	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	
PALO ALTO NETWORKS INC	28	33	551	62,113	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PARKER HANNIFIN CORP	41	48	813	91,681	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	70	90	193	21,784	エネルギー
PAYCHEX INC	101	117	806	90,912	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	358	413	3,309	372,884	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	53	61	257	29,043	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	105	120	193	21,772	銀行
PEPSICO INC	446	519	6,182	696,536	食品・飲料・タバコ
PERRIGO CO PLC	39	47	301	33,936	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	1,869	2,141	9,459	1,065,843	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	161	189	440	49,664	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	487	569	4,990	562,243	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	136	162	1,537	173,237	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	35	41	368	41,543	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	53	62	977	110,152	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	45	54	111	12,561	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	149	171	2,319	261,332	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	18	21	202	22,842	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	79	91	982	110,642	素材
PPL CORPORATION	217	257	809	91,226	公益事業
PRAXAIR INC	89	－	－	－	素材
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	89	103	509	57,395	保険
PROCTER & GAMBLE CO	795	920	8,585	967,357	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	182	212	1,383	155,854	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	132	153	1,402	157,990	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	159	185	1,012	114,124	公益事業
PULTE GROUP INC	83	99	250	28,270	耐久消費財・アパレル
PVH CORP	24	28	312	35,211	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	39	46	292	32,900	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	462	515	2,827	318,582	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	42	49	467	52,665	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC	142	160	365	41,203	小売
RALPH LAUREN CORP	17	20	230	25,984	耐久消費財・アパレル
RANGE RESOURCES CORP	77	－	－	－	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	40	47	371	41,889	各種金融
RAYTHEON CO	90	105	1,854	208,953	資本財
RED HAT INC	55	65	1,126	126,961	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	24	29	985	111,068	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	362	407	657	74,094	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	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	20	23	349	39,390	保険
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	12	14	182	20,510	保険
REPUBLIC SERVICES INC	73	83	640	72,169	商業・専門サービス
RESMED INC	44	52	534	60,267	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	38	44	271	30,623	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	40	45	769	86,732	資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	51	59	781	88,064	資本財
ROLLINS INC	30	35	216	24,394	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	32	37	1,106	124,662	資本財
ROSS STORES INC	120	138	1,262	142,289	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	53	61	661	74,566	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	80	92	1,633	184,021	各種金融
SABRE CORP	65	96	231	26,045	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	215	258	3,124	352,021	ソフトウェア・サービス
SCANA CORP	42	49	218	24,619	公益事業
SCHLUMBERGER LTD	434	507	2,449	276,024	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	90	99	419	47,284	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	57	59	216	24,406	素材
SEATTLE GENETICS INC	34	40	230	25,998	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	41	48	259	29,281	各種金融
SEMPRA ENERGY	75	92	1,063	119,830	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	53	62	288	32,551	資本財
SERVICENOW INC	54	64	1,015	114,409	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26	30	1,281	144,432	素材
SIGNATURE BANK	17	19	233	26,319	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	515	586	354	39,946	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	57	66	470	53,033	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	45	52	239	26,986	資本財
SNAP-ON INC	17	20	337	38,016	資本財
SOUTHERN CO	316	372	1,752	197,408	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	47	54	285	32,199	運輸
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	8	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	36	41	338	38,160	資本財
SPLUNK INC	43	53	474	53,428	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	256	301	186	21,050	電気通信サービス
SQUARE INC - A	84	106	668	75,332	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	54	78	354	39,943	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	47	56	714	80,463	資本財
STARBUCKS CORP	446	505	3,430	386,534	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
STATE STREET CORP	116	133	958	107,944	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	74	85	339	38,256	素材
STERICYCLE INC	26	31	144	16,247	商業・専門サービス
STRYKER CORP	105	123	2,064	232,584	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	148	169	1,067	120,273	銀行
SVB FINANCIAL GROUP	16	19	463	52,262	銀行
SYMANTEC CORP	194	227	506	57,027	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	245	262	669	75,426	各種金融
SYNOPSYS INC	46	54	464	52,369	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	155	181	1,195	134,725	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	75	88	838	94,473	各種金融
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	35	41	443	49,933	ソフトウェア・サービス
TAPESTRY INC	89	105	412	46,431	耐久消費財・アパレル
TARGA RESOURCES CORP	67	79	377	42,504	エネルギー
TARGET CORP	161	185	1,441	162,443	小売
TE CONNECTIVITY LTD	110	127	954	107,589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TECHNIPFMC PLC	138	159	387	43,664	エネルギー
TELEFLEX INC	14	16	421	47,446	ヘルスケア機器・サービス
TESARO INC	11	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA, INC.	42	46	1,649	185,905	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	286	353	778	87,744	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	309	358	3,390	381,956	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	82	93	520	58,661	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	125	147	3,429	386,389	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	38	40	418	47,178	小売
TIME WARNER INC	244	—	—	—	メディア
TJX COS INC	198	458	2,246	253,088	小売
T-MOBILE US INC	93	125	854	96,244	電気通信サービス
TOLL BROTHERS INC	47	52	163	18,455	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	34	38	336	37,969	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	51	59	506	57,061	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	39	44	411	46,382	小売
TRANSDIGM GROUP INC	16	17	584	65,895	資本財
TRANSUNION	48	67	411	46,412	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	85	98	1,287	145,101	保険
TRIMBLE INC	78	90	317	35,827	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	35	38	235	26,561	小売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	138	160	780	87,952	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	330	387	1,893	213,340	メディア

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	
TWITTER INC	198	248	793	89,395	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	93	108	645	72,726	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	55	64	366	41,267	公益事業
ULTA BEAUTY INC	18	21	659	74,300	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	55	70	148	16,675	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	59	67	131	14,839	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	248	285	4,300	484,567	運輸
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	23	26	239	27,008	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	218	254	2,827	318,579	運輸
UNITED RENTALS INC	26	30	344	38,775	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	237	278	3,554	400,527	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	13	15	183	20,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	304	351	9,362	1,054,910	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	27	31	417	47,075	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	69	79	283	31,889	保険
US BANCORP	519	569	3,134	353,115	銀行
VAIL RESORTS INC	12	14	386	43,547	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	137	157	1,272	143,325	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	28	33	385	43,386	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	35	44	373	42,029	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	28	40	607	68,451	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	49	57	702	79,168	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,283	1,515	9,189	1,035,388	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	79	93	1,503	169,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	105	122	982	110,655	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	110	130	409	46,095	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	569	654	8,815	993,283	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	80	124	294	33,151	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	22	26	413	46,561	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	55	61	266	30,059	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	41	48	503	56,694	素材
WABCO HOLDINGS INC	15	19	227	25,626	資本財
WABTEC CORP	27	31	275	31,026	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	263	308	2,527	284,733	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	468	540	5,229	589,230	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	474	545	6,294	709,154	メディア
WASTE CONNECTIONS INC	82	95	734	82,747	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	136	158	1,465	165,132	商業・専門サービス
WATERS CORP	24	28	565	63,750	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
			株数	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	
WEC ENERGY GROUP INC		99	116	833	93,869	公益事業
WELLS FARGO & CO		1,467	1,694	9,036	1,018,113	銀行
WESTAR ENERGY INC		45	－	－	－	公益事業
WESTERN DIGITAL CORP		92	109	493	55,653	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO		143	167	314	35,387	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP		－	13	97	10,953	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED		79	93	430	48,543	素材
WEYERHAEUSER CO		236	280	758	85,468	不動産
WHIRLPOOL CORP		22	23	279	31,535	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC		259	443	1,122	126,440	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC		39	48	769	86,689	保険
WORKDAY INC-CLASS A		43	53	664	74,871	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC		93	108	854	96,220	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP		30	34	274	30,892	保険
WR GRACE & CO		21	－	－	－	素材
WW GRAINGER INC		16	17	531	59,847	資本財
WYNDHAM DESTINATIONS INC		31	－	－	－	消費者サービス
WYNN RESORTS LTD		25	35	373	42,085	消費者サービス
XCEL ENERGY INC		160	187	969	109,178	公益事業
XEROX CORP		68	83	221	25,004	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XILINX INC		78	92	814	91,768	半導体・半導体製造装置
XL GROUP LTD		80	－	－	－	保険
XPO LOGISTICS INC		－	44	331	37,300	運輸
XYLEM INC		56	65	455	51,276	資本財
YUM! BRANDS INC		100	118	1,043	117,556	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC		61	80	209	23,590	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C W/I		33	42	116	13,072	ソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		63	74	844	95,117	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORP, N.A.		62	70	343	38,683	銀行
ZOETIS INC		153	177	1,596	179,824	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	96,098	112,261	850,286	95,801,747	
	銘柄数<比率>	601	595	－	<64.0%>	
(カナダ)				千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD		72	85	402	34,388	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		135	158	1,033	88,391	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD		55	97	154	13,206	公益事業
ARC RESOURCES LTD		107	128	140	11,995	エネルギー
ATCO LTD -CL 'I'		26	31	126	10,831	公益事業
AURORA CANNABIS INC		－	239	192	16,428	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
BANK OF MONTREAL	203	234	2,295	196,268	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	375	438	3,101	265,232	銀行
BARRICK GOLD CORP	364	426	735	62,905	素材
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	104	115	357	30,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	53	62	350	30,005	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD	157	186	211	18,096	ソフトウェア・サービス
BOMBARDIER INC	608	770	159	13,646	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	266	311	1,793	153,397	各種金融
CAE INC	85	97	256	21,973	資本財
CAMECO CORP	124	144	233	19,931	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	136	162	1,845	157,853	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	238	272	3,100	265,114	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	343	450	1,614	138,110	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	46	53	1,474	126,117	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	20	22	350	29,976	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	44	51	163	14,016	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B	44	54	287	24,607	素材
CENOVUS ENERGY INC	326	382	405	34,663	エネルギー
CGI GROUP INC	80	93	757	64,809	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	86	98	193	16,542	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	6	7	660	56,513	ソフトウェア・サービス
CRESCENT POINT ENERGY CORP	169	199	99	8,469	エネルギー
DOLLARAMA INC	33	114	397	33,960	小売
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	117	—	—	—	各種金融
EMERA INC	22	26	116	9,980	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	53	63	157	13,501	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	520	624	2,736	234,020	エネルギー
ENCANA CORP	305	353	355	30,391	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	8	10	618	52,921	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	53	61	166	14,199	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	52	77	151	12,935	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	215	251	311	26,606	素材
FORTIS INC	135	159	735	62,922	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	57	68	604	51,684	素材
GEORGE WESTON LTD	16	28	269	23,039	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	69	78	325	27,806	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	271	317	396	33,935	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	93	107	331	28,310	保険
HUSKY ENERGY INC	110	128	216	18,520	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	
HYDRO ONE LTD	100	127	248	21,257	公益事業
IGM FINANCIAL INC	27	32	108	9,240	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	93	106	440	37,641	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	33	39	193	16,518	保険
INTACT FINANCIAL CORP	44	51	528	45,191	保険
INTER PIPELINE LTD	119	141	321	27,468	エネルギー
KEYERA CORP	63	75	223	19,085	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	387	454	154	13,206	素材
LINAMAR CORP	15	16	80	6,921	自動車・自動車部品
LOBLAW COS LTD	67	69	409	34,992	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	204	235	126	10,858	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	107	123	815	69,731	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	620	725	1,580	135,136	保険
METHANEX CORP	26	24	183	15,724	素材
METRO INC	71	89	384	32,846	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	107	124	754	64,493	銀行
NUTRIEN LTD	202	232	1,600	136,870	素材
ONEX CORPORATION	26	32	274	23,455	各種金融
OPEN TEXT CORP	84	98	421	36,076	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	159	184	828	70,864	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	112	130	350	30,014	保険
POWER FINANCIAL CORP	79	91	258	22,124	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	67	76	143	12,256	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	71	87	618	52,888	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	118	136	962	82,300	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	457	527	5,003	427,936	銀行
SAPUTO INC	67	85	337	28,848	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	76	98	118	10,099	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	138	171	433	37,037	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A	27	32	570	48,782	ソフトウェア・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	55	64	303	25,969	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	192	222	1,077	92,135	保険
SUNCOR ENERGY INC	519	598	2,583	220,907	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	178	185	524	44,828	素材
THOMSON REUTERS CORP	90	105	672	57,478	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	579	675	4,846	414,431	銀行
TOURMALINE OIL CORP	70	94	188	16,123	エネルギー
TRANSCANADA CORP	274	328	1,745	149,312	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	312	355	87	7,469	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
VERMILION ENERGY INC		36	52	176	15,086	エネルギー	
WEST FRASER TIMBER CO LTD		21	21	153	13,163	素材	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		137	161	340	29,079	素材	
WSP GLOBAL INC		－	37	245	20,988	資本財	
小計	株数・金額	12,669	15,178	61,805	5,285,617		
	銘柄数<比率>	86	87	－	<3.5%>		
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル			
AGL ENERGY LTD		217	253	467	38,420	公益事業	
ALUMINA LTD		818	936	217	17,860	素材	
AMCOR LTD		383	452	610	50,171	素材	
AMP LTD		976	1,127	290	23,922	各種金融	
ARISTOCRAT LEISURE LTD		176	217	561	46,187	消費者サービス	
ASX LTD		68	78	476	39,142	各種金融	
AURIZON HOLDINGS LTD		723	846	350	28,805	運輸	
AUSNET SERVICES		843	941	150	12,380	公益事業	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP		933	1,078	2,713	223,148	銀行	
BANK OF QUEENSLAND LTD		139	170	166	13,652	銀行	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED		167	201	203	16,745	銀行	
BHP BILLITON LTD		1,016	1,188	3,849	316,561	素材	
BLUESCOPE STEEL LTD		181	207	266	21,947	素材	
BORAL LTD		390	455	241	19,855	素材	
BRAMBLES LTD		521	609	625	51,448	商業・専門サービス	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		88	103	272	22,435	エネルギー	
CHALLENGER LTD		198	222	215	17,682	各種金融	
CIMIC GROUP LIMITED		33	39	168	13,824	資本財	
COCA-COLA AMATIL LIMITED		191	212	215	17,760	食品・飲料・タバコ	
COCHLEAR LTD		19	22	349	28,701	ヘルスケア機器・サービス	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		556	652	4,471	367,723	銀行	
COMPUTERSHARE LIMITED		155	181	349	28,721	ソフトウェア・サービス	
CROWN RESORTS LTD		131	154	181	14,897	消費者サービス	
CSL LIMITED		143	166	3,037	249,787	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		20	23	113	9,334	消費者サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		18	22	103	8,474	消費者サービス	
FORTESCUE METALS GROUP LTD		500	600	243	19,987	素材	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		190	234	73	6,078	小売	
HEALTHSCOPE LTD		589	693	162	13,392	ヘルスケア機器・サービス	
INCITEC PIVOT LTD		572	670	261	21,501	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		785	890	629	51,797	保険	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		147	173	278	22,892	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	千オーストラリアドル	千円		
MACQUARIE GROUP LTD		104	121	1,417	116,554	各種金融	
MEDIBANK PRIVATE LTD		928	1,090	283	23,324	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		856	1,017	2,399	197,336	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED		247	290	598	49,227	素材	
OIL SEARCH LTD		460	525	391	32,227	エネルギー	
ORICA LTD		125	150	263	21,692	素材	
ORIGIN ENERGY LIMITED		566	667	457	37,627	エネルギー	
QBE INSURANCE GROUP LTD		442	521	591	48,672	保険	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED		47	55	303	24,982	ヘルスケア機器・サービス	
REA GROUP LTD		20	22	164	13,496	ソフトウェア・サービス	
RIO TINTO LTD		132	154	1,230	101,205	素材	
SANTOS LTD		606	664	405	33,324	エネルギー	
SEEK LTD		114	135	238	19,616	商業・専門サービス	
SONIC HEALTHCARE LTD		136	160	348	28,627	ヘルスケア機器・サービス	
SOUTH32 LTD		1,649	1,909	632	51,974	素材	
SUNCORP GROUP LTD		433	510	685	56,328	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD		629	735	331	27,266	消費者サービス	
TELSTRA CORP LTD		1,408	1,631	494	40,639	電気通信サービス	
TPG TELECOM LTD		136	162	119	9,804	電気通信サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD		236	272	390	32,090	食品・飲料・タバコ	
WESFARMERS LIMITED		362	421	1,848	151,982	食品・生活必需品小売り	
WESTPAC BANKING CORP		1,078	1,274	3,200	263,217	銀行	
WOODSIDE PETROLEUM LTD		303	349	1,137	93,509	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD		418	494	1,417	116,567	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	23,350	27,167	41,670	3,426,540		
	銘柄数<比率>	56	56	—	<2.3%>		
(香港)				千香港ドル			
AIA GROUP LTD		3,792	4,426	29,017	417,269	保険	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		98	111	831	11,955	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA		402	454	1,189	17,104	銀行	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		1,165	1,350	4,091	58,838	銀行	
CK ASSET HOLDINGS LTD		809	964	5,437	78,190	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		854	989	8,194	117,838	資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED		220	250	1,453	20,904	公益事業	
CLP HOLDINGS LTD		526	606	5,382	77,394	公益事業	
FIRST PACIFIC CO		720	—	—	—	各種金融	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD		758	868	4,071	58,546	消費者サービス	
HANG LUNG GROUP LTD		300	360	779	11,207	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD		631	791	1,238	17,802	不動産	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
HANG SENG BANK LTD		241	279	5,010	72,046	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		382	510	1,985	28,549	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		2,713	3,426	5,236	75,295	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		370	433	9,874	142,001	各種金融
HYSAN DEVELOPMENT CO		190	260	1,032	14,843	不動産
KERRY PROPERTIES LTD		210	250	666	9,580	不動産
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD		1,220	—	—	—	各種金融
LI & FUNG LTD		1,872	2,212	367	5,282	耐久消費財・アパレル
MGM CHINA HOLDINGS LTD		308	352	428	6,155	消費者サービス
MINTH GROUP LTD		220	260	704	10,132	自動車・自動車部品
MTR CORP		527	597	2,372	34,113	運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,876	2,336	2,514	36,155	不動産
NWS HOLDINGS LTD		500	560	917	13,190	資本財
PCCW LTD		1,560	1,830	796	11,447	電気通信サービス
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		445	515	2,775	39,909	公益事業
SANDS CHINA LTD		765	889	2,927	42,096	消費者サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD		380	480	560	8,062	消費者サービス
SINO LAND CO		1,000	1,260	1,638	23,554	不動産
SJM HOLDINGS LTD		590	720	501	7,206	消費者サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD		460	595	6,553	94,239	不動産
SWIRE PACIFIC LTD		163	193	1,710	24,603	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD		376	452	1,337	19,239	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		440	505	2,179	31,335	耐久消費財・アパレル
WH GROUP LTD		2,785	3,240	2,106	30,284	食品・飲料・タバコ
WHARF HOLDINGS LTD		387	467	974	14,011	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		387	457	2,380	34,230	不動産
WHEELOCK & CO LTD		270	330	1,527	21,971	不動産
WYNN MACAU LTD		493	577	967	13,906	消費者サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		235	270	638	9,182	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額	31,648	35,433	122,369	1,759,679	
	銘柄数<比率>	41	39	—	<1.2%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND LTD		812	986	309	25,440	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		129	156	130	10,703	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		742	843	181	14,892	運輸
DBS GROUP HOLDINGS LTD		561	651	1,510	124,102	銀行
GENTING SINGAPORE LTD		1,886	2,171	204	16,768	消費者サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		2,154	2,237	52	4,319	食品・飲料・タバコ
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		32	35	122	10,060	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
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円		
KEPPEL CORP LTD		458	524	329	27,082	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		984	1,139	1,263	103,793	銀行	
SATS LTD		248	284	137	11,318	運輸	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		315	357	96	7,891	資本財	
SINGAPORE AIRLINES LTD		185	207	194	15,988	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD		252	281	203	16,740	各種金融	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		516	604	161	13,251	メディア	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD		497	545	190	15,673	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		2,635	3,060	942	77,443	電気通信サービス	
STARHUB LTD		244	－	－	－	電気通信サービス	
UNITED OVERSEAS BANK LTD		417	484	1,173	96,442	銀行	
UOL Group Limited		153	193	119	9,784	不動産	
VENTURE CORP LTD		－	98	146	12,038	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WILMAR INTERNATIONAL LTD		503	677	220	18,079	食品・飲料・タバコ	
YANGZIJANG SHIPBUILDING		703	811	102	8,463	資本財	
小計	株数・金額	14,426	16,343	7,792	640,280		
	銘柄数<比率>	21	21	－	<0.4%>		
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル			
A2 MILK CO LTD		－	267	279	21,571	食品・飲料・タバコ	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		326	393	279	21,520	運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		178	209	271	20,914	ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD		214	311	172	13,319	素材	
MERCURY NZ LTD		218	－	－	－	公益事業	
MERIDIAN ENERGY LTD		395	467	151	11,687	公益事業	
RYMAN HEALTHCARE LTD		123	146	173	13,389	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD		608	715	294	22,737	電気通信サービス	
小計	株数・金額	2,065	2,510	1,623	125,139		
	銘柄数<比率>	7	7	－	<0.1%>		
(イギリス)				千イギリス・ポンド			
3I GROUP PLC		300	348	282	40,886	各種金融	
ADMIRAL GROUP PLC		63	72	144	20,956	保険	
ANGLO AMERICAN PLC		416	382	659	95,519	素材	
ANTOFAGASTA PLC		121	139	113	16,452	素材	
ASHTREAD GROUP PLC		156	179	322	46,715	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		111	130	322	46,715	食品・飲料・タバコ	
ASTRAZENECA PLC		397	463	2,863	414,735	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		307	349	149	21,651	ソフトウェア・サービス	
AVIVA PLC		1,256	1,460	608	88,047	保険	
BABCOCK INTL GROUP PLC		76	90	53	7,732	商業・専門サービス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BAE SYSTEMS PLC	1,000	1,166	606	87,804	資本財
BARCLAYS PLC	5,348	6,264	1,039	150,586	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	316	368	181	26,233	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	40	46	155	22,557	耐久消費財・アパレル
BHP GROUP PLC	659	770	1,251	181,183	素材
BP PLC	6,210	7,305	3,818	552,954	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	719	840	2,287	331,211	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC	2,666	3,116	797	115,531	電気通信サービス
BUNZL PLC	106	122	281	40,813	資本財
BURBERRY GROUP PLC	133	153	273	39,538	耐久消費財・アパレル
CARNIVAL PLC	57	65	295	42,739	消費者サービス
CENTRICA PLC	1,763	2,074	294	42,717	公益事業
COBHAM PLC	755	－	－	－	資本財
COCA-COLA HBC AG-CDI	57	73	169	24,479	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	496	580	921	133,457	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC	432	504	81	11,781	ヘルスケア機器・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	41	48	232	33,691	素材
DCC PLC	28	32	189	27,474	資本財
DIAGEO PLC	782	901	2,511	363,705	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	431	497	157	22,858	保険
EASYJET PLC	52	61	72	10,489	運輸
EXPERIAN PLC	290	336	620	89,861	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	78	84	414	60,069	資本財
FRESNILLO PLC	68	78	70	10,224	素材
G4S PLC	490	569	104	15,124	商業・専門サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,545	1,816	2,849	412,702	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	3,830	4,212	1,266	183,378	素材
GVC HOLDINGS PLC	－	199	155	22,562	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	81	103	189	27,489	各種金融
HSBC HOLDINGS PLC	6,272	7,338	4,780	692,259	銀行
IMI PLC	85	－	－	－	資本財
IMPERIAL BRANDS PLC	299	349	895	129,634	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	－	466	341	49,413	メディア
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	56	66	276	39,992	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	50	59	266	38,609	商業・専門サービス
INVESTEC PLC	210	245	122	17,805	各種金融
ITV PLC	1,149	1,348	197	28,530	メディア
JOHNSON MATTHEY PLC	60	70	203	29,496	素材
KINGFISHER PLC	677	781	191	27,742	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,863	2,166	533	77,252	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	22,587	26,401	1,473	213,333	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	97	114	465	67,351	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	507	591	174	25,198	小売
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	114	135	44	6,507	ヘルスケア機器・サービス
MEGGITT PLC	242	280	144	20,889	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	－	1,773	301	43,731	資本財
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	223	260	87	12,613	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	136	159	234	33,954	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC/WI	115	134	236	34,225	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	699	813	199	28,847	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	1,069	1,239	1,023	148,202	公益事業
NEXT PLC	45	51	266	38,556	小売
NMC HEALTH PLC	－	38	135	19,567	ヘルスケア機器・サービス
OLD MUTUAL PLC	1,544	－	－	－	保険
PEARSON PLC	254	288	271	39,351	メディア
PERSIMMON PLC	96	113	238	34,546	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	811	948	1,485	215,157	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	29	34	219	31,753	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	209	245	1,585	229,579	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	335	734	1,188	172,099	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	379	432	1,682	243,653	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	521	613	488	70,731	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENT	－	27,577	2	399	資本財
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENT	36,227	－	－	－	資本財
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	1,127	1,755	381	55,213	銀行
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,425	1,682	4,027	583,291	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,176	1,372	3,343	484,152	エネルギー
ROYAL MAIL PLC	299	344	106	15,417	運輸
RSA INSURANCE GROUP PLC	320	371	199	28,904	保険
SAGE GROUP PLC	340	397	218	31,708	ソフトウェア・サービス
SAINSBURY (J) PLC	509	638	195	28,381	食品・生活必需品小売り
SCHRODERS PLC	38	44	109	15,899	各種金融
SEVERN TRENT PLC	77	89	165	24,027	公益事業
SHIRE PLC	285	334	1,539	222,925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SKY PLC	326	－	－	－	メディア
SMITH & NEPHEW PLC	274	320	445	64,488	ヘルスケア機器・サービス
SMITHS GROUP PLC	124	144	203	29,518	資本財
SSE PLC	322	378	418	60,587	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	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ST JAMES'S PLACE PLC		166	194	195	28,359	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC		1,035	1,028	614	88,940	銀行
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		835	853	219	31,751	各種金融
TAYLOR WIMPEY PLC		1,023	1,189	176	25,519	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC		2,572	3,581	735	106,519	食品・生活必需品小売り
TRAVIS PERKINS PLC		78	90	91	13,261	資本財
TUI AG-DI		136	158	201	29,170	消費者サービス
UNILEVER PLC		386	447	1,906	276,024	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC		222	258	192	27,850	公益事業
VODAFONE GROUP PLC		8,426	9,847	1,534	222,168	電気通信サービス
WEIR GROUP PLC/THE		70	87	132	19,129	資本財
WHITBREAD PLC		57	66	304	44,067	消費者サービス
WOOD GROUP (JOHN) PLC		211	248	159	23,089	エネルギー
WPP PLC		398	465	398	57,735	メディア
小計	株数・金額	130,936	138,280	64,786	9,381,730	
	銘柄数<比率>	97	97	—	<6.3%>	
(イスラエル)				千イスラエル・シェケル		
AZRIELI GROUP		12	16	309	9,420	不動産
BANK HAPOALIM BM		326	380	1,009	30,722	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		449	519	1,263	38,441	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		647	792	369	11,237	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		7	8	366	11,146	資本財
FRUTAROM		12	—	—	—	素材
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		213	252	575	17,524	素材
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		41	48	323	9,832	銀行
NICE LTD		18	22	930	28,305	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	1,728	2,040	5,147	156,631	
	銘柄数<比率>	9	8	—	<0.1%>	
(スイス)				千スイス・フラン		
ABB LTD		577	674	1,340	152,031	資本財
ADECCO GROUP AG-REG		50	59	280	31,832	商業・専門サービス
BALOISE HOLDING AG		15	17	255	28,955	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.67	0.82	141	16,043	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.33	0.39	271	30,764	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.03	0.03	238	27,084	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		164	191	1,262	143,222	耐久消費財・アパレル
CLARIANT AG		73	73	152	17,295	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG		760	938	1,156	131,163	各種金融
DUFY AG-REG		11	11	123	13,993	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
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		2	2	161	18,346	素材	
GEBERIT AG-REG		11	13	511	58,043	資本財	
GIVAUDAN-REG		2	3	817	92,734	素材	
JULIUS BAER GROUP LTD		70	82	360	40,894	各種金融	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		18	21	282	32,054	運輸	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		142	178	814	92,364	素材	
LONZA GROUP AG		23	27	818	92,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NESTLE SA		976	1,140	9,497	1,077,172	食品・飲料・タバコ	
NOVARTIS AG		697	793	6,929	785,925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PARGESA HOLDING SA-BR		12	13	97	11,114	各種金融	
PARTNERS GROUP HOLDING AG		5	6	427	48,438	各種金融	
ROCHE HOLDING AG		220	257	6,343	719,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG		6	6	134	15,235	資本財	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		12	15	300	34,113	資本財	
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE		1	1	445	50,529	商業・専門サービス	
SIKA AG-BEARER		0.66	47	589	66,912	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG		16	20	305	34,655	ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG		3	3	239	27,145	ヘルスケア機器・サービス	
SWATCH GROUP AG		9	11	364	41,352	耐久消費財・アパレル	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		10	12	471	53,494	保険	
SWISS PRIME SITE-REG		22	28	233	26,506	不動産	
SWISS RE AG		98	114	1,013	115,007	保険	
SWISSCOM AG		8	9	461	52,324	電気通信サービス	
TEMENOS GROUP AG-REG		－	22	274	31,110	ソフトウェア・サービス	
THE SWATCH GROUP AG-REG		15	16	97	11,097	耐久消費財・アパレル	
UBS GROUP AG		1,149	1,414	1,919	217,737	各種金融	
VIFOR PHARMA AG		15	16	212	24,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG		47	55	1,688	191,459	保険	
小計	株数・金額	5,256	6,307	41,037	4,654,480		
	銘柄数<比率>	37	38	－	<3.1%>		
(デンマーク)				千デンマーク・クローネ			
A P MOLLER - MAERSK A/S		2	2	2,120	36,639	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S		1	1	1,156	19,979	運輸	
CARLSBERG AS-B		33	39	2,855	49,341	食品・飲料・タバコ	
CHR HANSEN HOLDING A/S		31	36	2,270	39,237	素材	
COLOPLAST-B		37	43	2,669	46,133	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S		235	261	3,544	61,248	銀行	
DSV A/S		61	70	3,559	61,506	運輸	
GENMAB A/S		18	22	2,088	36,080	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
			株数	株数	評価額	
					外貨建金額	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
H LUNDBECK A/S		21	25	695	12,009	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S		52	60	1,350	23,338	商業・専門サービス
NOVO-NORDISK A/S		584	665	19,629	339,198	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S		70	79	2,542	43,930	素材
ORSTED A/S		59	69	3,090	53,411	公益事業
PANDORA A/S		33	40	1,382	23,888	耐久消費財・アパレル
TRYGVESTA AS		35	41	669	11,567	保険
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		67	71	3,265	56,433	資本財
WILLIAM DEMANT HOLDING		36	36	719	12,440	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	1,383	1,566	53,610	926,384	
	銘柄数<比率>	17	17	－	<0.6%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
AKER BP ASA		－	39	958	12,729	エネルギー
DNB ASA		307	357	5,369	71,303	銀行
EQUINOR ASA		362	428	8,789	116,724	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		62	72	980	13,023	保険
MARINE HARVEST		130	152	3,019	40,092	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		415	485	2,039	27,084	素材
ORKLA ASA		256	299	2,142	28,445	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-B SHS		30	36	1,027	13,648	メディア
TELENOR ASA		238	280	4,610	61,223	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		55	65	2,237	29,707	素材
小計	株数・金額	1,860	2,219	31,173	413,985	
	銘柄数<比率>	9	10	－	<0.3%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
ALFA LAVAL AB		93	108	2,151	26,909	資本財
ASSA ABLOY AB		316	369	6,331	79,212	資本財
ATLAS COPCO AB		122	142	2,727	34,127	資本財
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION		207	－	－	－	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		211	247	5,084	63,609	資本財
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION		119	－	－	－	資本財
BOLIDEN AB		84	98	2,014	25,205	素材
BOLIDEN AB-REDEMPTION		83	－	－	－	素材
ELECTROLUX AB		76	89	1,691	21,160	耐久消費財・アパレル
EPIROC AB-A		－	247	1,949	24,392	資本財
EPIROC AB-B		－	143	1,087	13,603	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		192	223	4,922	61,584	家庭用品・パーソナル用品
GETINGE AB-B SHS		72	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB		298	322	5,170	64,677	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
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円		
HEXAGON AB-B SHS		82	95	4,050	50,667	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUSQVARNA AB-B SHS		135	155	1,045	13,084	耐久消費財・アパレル	
ICA GRUPPEN AB		24	29	968	12,122	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		52	63	1,160	14,523	各種金融	
INVESTOR AB		143	168	6,425	80,378	各種金融	
KINNEVIK AB - B		73	86	2,031	25,417	各種金融	
LUNDBERGS AB-B SHS		24	28	773	9,677	各種金融	
LUNDIN PETROLEUM AB		61	69	1,684	21,068	エネルギー	
NORDEA BANK AB		954	－	－	－	銀行	
NORDEA BANK ABP		－	1,119	9,096	113,792	銀行	
SANDVIK AB		356	415	5,545	69,376	資本財	
SECURITAS AB		101	117	1,796	22,478	商業・専門サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		478	602	5,626	70,383	銀行	
SKANSKA AB-B SHS		107	125	1,795	22,463	資本財	
SKF AB		120	139	1,927	24,114	資本財	
SVENSKA HANDELSBANKEN		483	565	5,489	68,667	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES		286	336	6,926	86,651	銀行	
SWEDISH MATCH AB		58	65	2,643	33,076	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB		123	139	1,497	18,730	電気通信サービス	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON		970	1,130	8,581	107,352	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB		921	1,066	4,377	54,758	電気通信サービス	
VOLVO AB		492	575	7,194	89,998	資本財	
小計	株数・金額	7,931	9,088	113,770	1,423,266		
	銘柄数<比率>	33	31	－	<1.0%>		
(ユーロ／アイルランド)				千ユーロ			
AIB GROUP PLC		259	301	114	14,746	銀行	
BANK OF IRELAND GROUP PLC		293	361	213	27,489	銀行	
CRH PLC		266	310	743	95,958	素材	
KERRY GROUP PLC-A		50	58	539	69,616	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC		25	31	256	33,020	消費者サービス	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		－	83	209	26,985	素材	
小計	株数・金額	895	1,146	2,076	267,817		
	銘柄数<比率>	5	6	－	<0.2%>		
(ユーロ／オランダ)							
ABN AMRO GROUP NV-CVA		132	154	349	45,078	銀行	
AEGON NV		553	648	345	44,559	保険	
AIRBUS SE		182	213	1,980	255,485	資本財	
AKZO NOBEL NV		78	92	679	87,650	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
(ユーロ／オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円		
ALTICE NV - A-W/I		171	－	－	－	メディア	
ASML HOLDING NV		121	150	2,162	278,909	半導体・半導体製造装置	
BOSKALIS WESTMINSTER		27	－	－	－	資本財	
CNH INDUSTRIAL NV		322	373	316	40,821	資本財	
EXOR NV		34	39	201	26,037	各種金融	
FERRARI NV		38	45	429	55,388	自動車・自動車部品	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		337	394	567	73,149	自動車・自動車部品	
HEINEKEN HOLDING NV		36	42	329	42,477	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN NV		81	95	765	98,759	食品・飲料・タバコ	
ING GROEP NV-CVA		1,217	1,425	1,551	200,142	銀行	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		401	456	1,044	134,710	食品・生活必需品小売り	
KONINKLIJKE DSM NV		56	66	516	66,670	素材	
KONINKLIJKE PHILIPS NV		295	344	1,127	145,478	ヘルスケア機器・サービス	
NN GROUP NV		95	109	416	53,725	保険	
QIAGEN NV		68	82	246	31,743	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RANDSTAD NV		37	43	182	23,523	商業・専門サービス	
RELX NV		303	－	－	－	商業・専門サービス	
ROYAL KPN NV		1,101	1,299	312	40,361	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV		200	252	308	39,763	半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV		511	565	2,755	355,348	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK		21	25	100	12,948	エネルギー	
WOLTERS KLUWER NV		90	106	552	71,238	商業・専門サービス	
小計	株数・金額	6,518	7,028	17,242	2,223,972		
	銘柄数<比率>	26	23	－	<1.5%>		
(ユーロ／ベルギー)							
AGEAS		58	66	295	38,062	保険	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		239	279	1,911	246,516	食品・飲料・タバコ	
COLRUYT NV		17	21	122	15,758	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		24	29	235	30,385	各種金融	
KBC GROEP NV		78	91	568	73,338	銀行	
PROXIMUS		51	60	142	18,347	電気通信サービス	
SOLVAY SA		23	27	275	35,536	素材	
TELENET GROUP HOLDING NV		17	20	88	11,439	メディア	
UCB SA		39	46	351	45,289	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UMICORE		65	76	312	40,248	素材	
小計	株数・金額	616	720	4,302	554,924		
	銘柄数<比率>	10	10	－	<0.4%>		

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／ルクセンブルグ)		百株	百株	千ユーロ	千円		
ARCELORMITTAL		207	244	530	68,389	素材	
RTL GROUP		12	14	76	9,855	メディア	
TENARIS SA		147	172	209	26,998	エネルギー	
小計	株数・金額	367	432	815	105,243		
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.1%>		
(ユーロ／フランス)							
ACCOR		58	71	277	35,735	消費者サービス	
ADP		10	12	214	27,604	運輸	
AIR LIQUIDE		134	158	1,666	214,945	素材	
ALSTOM RGPT		48	59	227	29,302	資本財	
AMUNDI SA		18	23	113	14,596	各種金融	
ARKEMA		21	26	229	29,662	素材	
ATOS SE		29	35	252	32,591	ソフトウェア・サービス	
AXA		607	714	1,549	199,874	保険	
BIOMERIEUX		12	16	103	13,393	ヘルスケア機器・サービス	
BNP PARIBAS		352	413	1,873	241,677	銀行	
BOLLORE		301	376	145	18,795	運輸	
BOUYGUES		67	82	270	34,928	資本財	
BUREAU VERITAS SA		84	103	199	25,732	商業・専門サービス	
CAPGEMINI SA		50	59	610	78,788	ソフトウェア・サービス	
CARREFOUR SA		182	215	374	48,283	食品・生活必需品小売り	
CASINO GUICHARD PERRACHON		16	21	81	10,525	食品・生活必需品小売り	
CIE DE SAINT-GOBAIN		156	185	579	74,763	資本財	
CNP ASSURANCES		54	70	142	18,328	保険	
CREDIT AGRICOLE SA		357	427	465	60,066	銀行	
DANONE		189	227	1,474	190,145	食品・飲料・タバコ	
DASSAULT AVIATION SA		0.80	0.97	131	16,902	資本財	
DASSAULT SYSTEMES SA		40	48	513	66,241	ソフトウェア・サービス	
EDENRED		70	88	290	37,415	商業・専門サービス	
EDF		181	220	329	42,494	公益事業	
EIFFAGE		23	31	272	35,127	資本財	
ENGIE		574	681	830	107,181	公益事業	
ESSILORLUXOTTICA		65	77	889	114,730	ヘルスケア機器・サービス	
EURAZEO		14	18	123	15,959	各種金融	
EUROFINS SCIENTIFIC		3	4	165	21,362	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS		56	67	125	16,176	メディア	
FAURECIA		23	29	115	14,948	自動車・自動車部品	
GETLINK SE - REGR		162	195	214	27,649	運輸	
HERMES INTERNATIONAL		10	11	570	73,604	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／フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ILIAD SA		8	10	112	14,512	電気通信サービス
IMERYS SA		11	14	73	9,531	素材
INGENICO GROUP		18	22	141	18,268	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPSEN		11	14	170	22,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JC DECAUX SA		23	31	89	11,594	メディア
KERING		23	27	1,068	137,778	耐久消費財・アパレル
LAGARDERE S.C.A.		37	－	－	－	メディア
LEGRAND SA		83	100	531	68,534	資本財
L'OREAL SA		79	93	1,915	247,042	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		87	102	2,651	341,937	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)		53	63	565	72,993	自動車・自動車部品
NATIXIS		296	368	181	23,376	各種金融
ORANGE S.A.		636	756	1,109	143,045	電気通信サービス
PERNOD-RICARD		66	78	1,103	142,354	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA		183	217	429	55,421	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE		65	78	414	53,473	メディア
REMY COINTREAU		7	8	91	11,787	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA		60	71	419	54,153	自動車・自動車部品
REXEL SA		95	115	117	15,124	資本財
SAFRAN SA		104	123	1,328	171,369	資本財
SANOFI		356	413	3,245	418,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		177	201	1,279	165,002	資本財
SCOR REGROUPE		53	63	266	34,399	保険
SEB SA		7	8	102	13,253	耐久消費財・アパレル
SOCIETE BIC SA		8	10	95	12,267	商業・専門サービス
SOCIETE GENERALE		240	283	936	120,734	銀行
SODEXO		28	33	309	39,881	消費者サービス
SUEZ		118	145	192	24,869	公益事業
TELEPERFORMANCE		18	21	310	40,097	商業・専門サービス
THALES SA		33	40	440	56,862	資本財
TOTAL SA		753	879	4,355	561,810	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT		19	29	198	25,570	ソフトウェア・サービス
VALEO SA		75	89	221	28,583	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT		152	205	378	48,881	公益事業
VINCI SA		159	187	1,440	185,800	資本財
VIVENDI SA		326	386	836	107,904	メディア
WENDEL		9	11	123	15,877	各種金融
小計	株数・金額	8,478	10,086	42,674	5,504,213	
	銘柄数<比率>	70	69	－	<3.7%>	

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	
1 AND 1 DRILLISCH AG	17	20	89	11,519	電気通信サービス
ADIDAS AG	59	69	1,385	178,730	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE	139	161	3,038	391,913	保険
AXEL SPRINGER SE	15	18	108	14,004	メディア
BASF SE	287	336	2,320	299,291	素材
BAYER AG	259	333	2,080	268,295	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	103	121	901	116,276	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	17	19	129	16,689	自動車・自動車部品
BEIERSDORF AG	31	36	336	43,415	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG	48	56	237	30,625	資本財
COMMERZBANK AG	333	367	298	38,497	銀行
CONTINENTAL AG	34	40	546	70,454	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	50	70	392	50,578	素材
DAIMLER AG	302	333	1,680	216,762	自動車・自動車部品
DELIVERY HERO SE	－	33	109	14,148	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BANK AG	530	719	616	79,510	各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG	60	70	788	101,759	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	75	88	179	23,109	運輸
DEUTSCHE POST AG	309	367	1,033	133,256	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,055	1,236	1,875	241,897	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	111	133	544	70,268	不動産
E.ON SE	692	810	746	96,253	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	50	59	152	19,713	素材
FRAPORT AG	14	17	112	14,461	運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA	130	152	785	101,311	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD	21	25	100	12,980	素材
GEA GROUP AG	57	63	163	21,108	資本財
HANNOVER RUECK SE	18	21	264	34,052	保険
HEIDELBERGCEMENT AG	46	54	322	41,628	素材
HENKEL AG & CO KGAA	32	37	336	43,426	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG	55	65	641	82,716	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	5	6	86	11,192	資本財
HUGO BOSS AG	19	23	141	18,229	耐久消費財・アパレル
INFINEON TECHNOLOGIES AG	355	415	710	91,595	半導体・半導体製造装置
INNOGY SE	43	51	206	26,659	公益事業
K+S AG	60	70	115	14,905	素材
KION GROUP AG	22	25	131	17,004	資本財
LANXESS	28	31	162	20,995	素材
LINDE AG - TENDER	58	－	－	－	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	
(ユーロ／ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
MAN SE		10	－	－	－	資本財
MERCK KGAA		40	47	458	59,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METRO AG		54	64	92	11,936	食品・生活必需品小売り
MTU AERO ENGINES HOLDING AG		16	18	342	44,169	資本財
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG		48	54	1,041	134,285	保険
OSRAM LICHT AG		31	36	117	15,096	資本財
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF		47	55	320	41,294	自動車・自動車部品
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG		73	87	151	19,520	メディア
PUMA AG		1	3	133	17,195	耐久消費財・アパレル
RWE AG		163	190	368	47,498	公益事業
SAP SE		308	359	3,201	412,905	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		－	13	148	19,205	ヘルスケア機器・サービス
SCHAEFFLER AG		50	60	47	6,152	自動車・自動車部品
SIEMENS AG		239	280	2,800	361,242	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG		－	54	201	25,989	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG		38	45	322	41,572	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		245	291	100	12,936	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG		137	159	257	33,196	素材
UNIPER SE		61	73	190	24,620	公益事業
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		38	44	172	22,313	ソフトウェア・サービス
VOLKSWAGEN AG		10	11	158	20,419	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG		58	68	1,006	129,761	自動車・自動車部品
VONOVIA SE		152	181	766	98,837	不動産
WIRECARD AG		36	42	591	76,297	ソフトウェア・サービス
ZALANDO SE		34	40	111	14,382	小売
小計	株数・金額	7,457	8,853	36,975	4,769,157	
	銘柄数<比率>	61	62	－	<3.2%>	
(ユーロ／ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		748	949	292	37,722	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		156	182	265	34,255	エネルギー
JERONIMO MARTINS		78	91	97	12,525	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	983	1,223	655	84,502	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.1%>	
(ユーロ／スペイン)						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		74	93	309	39,922	資本財
AENA SME SA		22	26	351	45,321	運輸
AMADEUS IT GROUP SA		137	160	1,057	136,432	ソフトウェア・サービス
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA		2,087	2,438	1,197	154,409	銀行
BANCO DE SABADELL SA		1,670	2,046	235	30,351	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	
BANCO SANTANDER SA		5,058	5,907	2,483 320,265	銀行
BANKIA SA		384	447	129 16,697	銀行
BANKINTER SA		209	243	185 23,950	銀行
CAIXABANK		1,123	1,310	486 62,724	銀行
ENAGAS SA		70	82	201 25,972	エネルギー
ENDESA SA		98	117	237 30,661	公益事業
FERROVIAL S.A.		152	177	312 40,327	資本財
FERROVIAL SA - RTS		—	173	7 918	資本財
FERROVIAL SA-RTS		152	—	— —	資本財
GRIFOLS SA		93	109	285 36,814	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA		1,822	2,193	1,468 189,420	公益事業
INDITEX SA		341	399	1,006 129,771	小売
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		200	233	166 21,539	運輸
MAPFRE SA		313	374	94 12,227	保険
NATURGY ENERGY GROUP SA		109	130	300 38,766	公益事業
RED ELECTRICA DE ESPANA		136	161	306 39,472	公益事業
REPSOL SA		385	493	769 99,313	エネルギー
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY		73	86	101 13,065	資本財
TELEFONICA SA		1,478	1,738	1,297 167,406	電気通信サービス
小計	株数・金額	16,197	19,145	12,992 1,675,754	
	銘柄数<比率>	23	23	— <1.1%>	
(ユーロ／イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI SPA		390	429	620 80,027	保険
ATLANTIA SPA		148	190	343 44,319	運輸
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		183	214	164 21,210	食品・飲料・タバコ
ENEL SPA		2,557	2,999	1,368 176,507	公益事業
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA		795	932	1,372 177,048	エネルギー
INTESA SANPAOLO		4,504	5,462	1,052 135,709	銀行
LEONARDO SPA		126	148	123 15,935	資本財
LUXOTTICA GROUP SPA		53	62	330 42,655	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA		194	228	169 21,804	銀行
MONCLER SPA		—	65	197 25,432	耐久消費財・アパレル
PIRELLI & C SPA		—	148	93 12,045	自動車・自動車部品
POSTE ITALIANE SPA		164	188	123 15,969	保険
PRYSMIAN SPA		64	88	141 18,238	資本財
RECORDATI SPA		33	38	110 14,233	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAM SPA		717	830	322 41,619	エネルギー
TELECOM ITALIA SPA		5,099	6,056	331 42,729	電気通信サービス
TERNA SPA		452	535	261 33,721	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	
(ユーロ／イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNICREDIT SPA		629	735	796	102,699	銀行
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		300	－	－	－	保険
小計	株数・金額	16,415	19,355	7,922	1,021,907	
	銘柄数<比率>	17	18	－	<0.7%>	
(ユーロ／フィンランド)						
ELISA OYJ		47	55	206	26,595	電気通信サービス
FORTUM OYJ		139	164	310	40,089	公益事業
KONE OYJ		105	123	530	68,470	資本財
METSO OYJ		35	38	100	13,006	資本財
NESTE OYJ		39	46	328	42,398	エネルギー
NOKIA OYJ		1,834	2,067	1,043	134,535	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ		36	42	116	15,061	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B		32	38	113	14,614	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		139	161	646	83,429	保険
STORA ENSO OYJ		172	201	245	31,666	素材
UPM-KYMMENE OYJ		166	194	507	65,442	素材
WARTSILA OYJ		138	162	235	30,317	資本財
小計	株数・金額	2,888	3,298	4,385	565,628	
	銘柄数<比率>	12	12	－	<0.4%>	
(ユーロ／オーストリア)						
ANDRITZ AG		22	26	111	14,421	資本財
ERSTE GROUP BANK AG		94	110	391	50,520	銀行
OMV AG		45	53	243	31,445	エネルギー
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING		46	53	142	18,340	銀行
VOESTALPINE AG		35	41	124	16,068	素材
小計	株数・金額	245	285	1,014	130,795	
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.1%>	
(ユーロ／その他)						
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		67	79	541	69,794	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	67	79	541	69,794	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>	
ユーロ計	株数・金額	61,132	71,655	131,599	16,973,711	
	銘柄数<比率>	236	235	－	<11.3%>	
合計	株数・金額	390,489	440,051	－	140,969,194	
	銘柄数<比率>	1,250	1,241	－	<94.2%>	

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

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

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

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

(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	4	5	724	81,630
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	12	15	1,719	193,726
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3	3	473	53,317
PROLOGIS INC	16	23	1,572	177,139
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	35	41	417	47,029
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4	5	968	109,111
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	3	325	36,694
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4	5	289	32,586
DUKE REALTY CORP	11	13	383	43,173
EQUITY RESIDENTIAL	11	13	952	107,296
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2	2	636	71,689
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2	2	359	40,475
GGP INC	18	—	—	—
HCP INC	14	17	503	56,687
WELLTOWER INC	11	13	969	109,273
HOST HOTELS AND RESORTS INC	23	27	529	59,626
KIMCO REALTY CORP	13	15	247	27,898
LIBERTY PROPERTY TRUST	4	5	248	28,024
MACERICH CO/THE	3	4	199	22,487
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	4	433	48,876
PUBLIC STORAGE	4	5	1,233	138,936
REGENCY CENTERS CORP	4	5	365	41,184
SIMON PROPERTY GROUP INC	9	11	2,138	240,969
SL GREEN REALTY CORP	3	3	311	35,088
UDR INC	8	10	422	47,638
VENTAS INC	11	13	817	92,119
VORNADO REALTY TRUST	5	6	460	51,859
REALTY INCOME CORP	8	10	682	76,925
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	4	452	50,927
DIGITAL REALTY TRUST INC	6	7	854	96,245
IRON MOUNTAIN INC	8	10	341	38,521
AGNC INVESTMENT CORP	11	16	294	33,163
AMERICAN TOWER REIT INC	13	16	2,706	304,929
EQUINIX INC	2	2	1,127	127,024
VEREIT	30	36	277	31,232
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	9	—	—	—
COLONY CAPITAL INC	15	—	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	3	4	743	83,746
INVITATION HOMES INC	9	11	250	28,183
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	—	8	160	18,129
小計	口数・金額	口数	金額	換算金額
	銘柄数<比率>			
	378	413	25,593	2,883,569
	39	37	—	<1.9%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		2	3	103	8,839
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		4	6	136	11,670
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		5	6	168	14,446
小計	口数・金額	11	16	408	34,956
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル	
DEXUS		35	43	440	36,234
GPT GROUP		63	79	419	34,533
GOODMAN GROUP		61	65	680	55,963
STOCKLAND		85	103	374	30,834
WESTFIELD CORP		64	—	—	—
MIRVAC GROUP		130	159	350	28,861
VICINITY CENTRES		116	142	381	31,335
SCENTRE GROUP		176	214	828	68,168
小計	口数・金額	733	808	3,477	285,930
	銘柄数<比率>	8	7	—	<0.2%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		69	80	5,895	84,773
小計	口数・金額	69	80	5,895	84,773
	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		79	98	250	20,614
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		77	102	174	14,373
CAPITALAND MALL TRUST		78	98	216	17,779
SUNTEC REIT		80	85	152	12,490
小計	口数・金額	315	385	794	65,258
	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		29	35	210	30,496
HAMMERSON PLC		25	29	125	18,200
LAND SECURITIES GROUP PLC		23	28	240	34,824
SEGRO PLC		31	38	238	34,546
小計	口数・金額	109	133	815	118,068
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.1%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ/フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE		3	—	—	—
KLEPIERRE		6	8	243	31,468
GECINA SA		1	1	238	30,809
COVIVIO		1	1	153	19,850
ICADE		1	1	114	14,768
小計	口数・金額	13	13	751	96,897
	銘柄数<比率>	5	4	—	<0.1%>
合計	口数・金額	1,631	1,850	—	3,569,453
	銘柄数<比率>	64	60	—	<2.4%>

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

(注2) 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。

(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		百万円	百万円
	S&P 500 EMINI FUTURE	3,691	—
	FTSE 100	374	—
	DJ EURO STOXX 50	934	—

(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

2018年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	140,969,194	93.9
投資信託証券	3,569,453	2.4
コール・ローン等、その他	5,650,604	3.8
投資信託財産総額	150,189,252	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112.67円、1カナダ・ドル85.52円、1オーストラリア・ドル82.23円、1香港ドル14.38円、1シンガポール・ドル82.17円、1ニュージーランド・ドル77.08円、1イギリス・ポンド144.81円、1イスラエル・シェケル30.43円、1スイス・フラン113.42円、1デンマーク・クローネ17.28円、1ノルウェー・クローネ13.28円、1スウェーデン・クローナ12.51円、1ユーロ128.98円です。

(注2) 外貨建純資産（146,483,125千円）の投資信託財産総額（150,189,252千円）に対する比率は97.5%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

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	153,273,493,759円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,993,301,687
株 式 (評価額)	140,969,194,066
投 資 信 託 証 券 (評価額)	3,569,453,040
未 収 入 金	3,228,451,575
未 収 配 当 金	227,585,194
差 入 委 託 証 拠 金	1,285,508,197
(B)負債	3,555,232,007
未 払 金	3,242,016,970
未 払 解 約 金	313,161,773
そ の 他 未 払 費 用	53,264
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	149,718,261,752
元 本	88,596,175,879
次 期 繰 越 損 益 金	61,122,085,873
(D)受 益 権 総 口 数	88,596,175,879口
1万口当たり基準価額 (C / D)	16,899円

(注1) 期首元本額 76,045,712,874円
 期中追加設定元本額 19,369,725,952円
 期中一部解約元本額 6,819,262,947円

(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。

DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型) 562,227,597円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) 2,650,340,512円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) 2,084,617,874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) 11,709,845,155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 60,295,944,002円
 DCニッセイ外国株式インデックス 10,792,141,547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) 406,450,400円
 DCニッセイターゲットデートファンド2055 13,254,832円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型) 9,183,684円
 DCニッセイターゲットデートファンド2045 7,256,656円
 DCニッセイターゲットデートファンド2035 10,766,461円
 DCニッセイターゲットデートファンド2025 5,134,713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) 14,090,128円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式) 23,703,740円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート) 1,668,453円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート/債券) 602,496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) 8,947,629円

損益の状況

当期 (2018年5月22日~2018年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	1,434,148,695円
受 取 配 当 金	1,432,218,552
受 取 利 息	2,799,914
そ の 他 収 益	237,046
支 払 利 息	△ 1,106,817
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 5,232,112,285
売 買 益	7,659,015,136
売 買 損	△ 12,891,127,421
(C)先 物 取 引 等 損 益	△ 81,466,139
取 引 益	269,623,448
取 引 損	△ 351,089,587
(D)信 託 報 酬 等	△ 41,537,027
(E)当期損益金 (A + B + C + D)	△ 3,920,966,756
(F)前 期 繰 越 損 益 金	55,641,079,258
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	14,601,931,938
(H)解 約 差 損 益 金	△ 5,199,958,567
(I)合 計 (E + F + G + H)	61,122,085,873
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	61,122,085,873

(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。