

## 第4期末 (2018年11月20日)

基準価額	11,081円
純資産総額	27億円
騰落率	△1.5%
分配金	0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)

追加型投信／内外／資産複合／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4期(決算日 2018年11月20日)

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

## 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・インデックスバランスファンド(4資産均等型)」は、このたび第4期の決算を行いました。

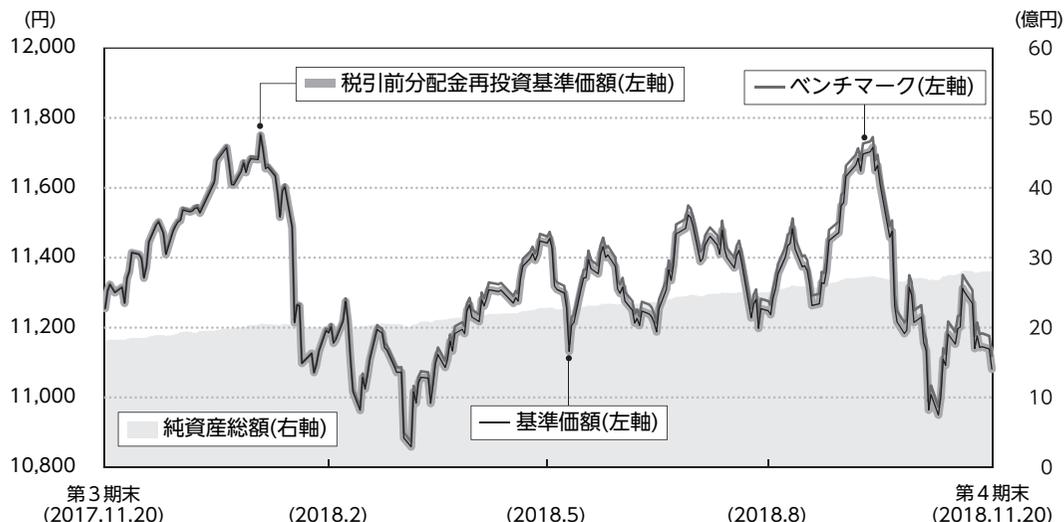
当ファンドは、投資対象の異なる4つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

# 運用経過

2017年11月21日～2018年11月20日

## 基準価額等の推移



第4期首	11,255円	既払分配金	0円
第4期末	11,081円	騰落率(分配金再投資ベース)	△1.5%

(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、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)を25%ずつ組み合わせて合成したもので、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。なお、当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。NOMURA-BPI総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同インデックスの内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。なお、「円換算ベース」とは、委託会社が独自に円換算したものです。以下同じです。

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、主要な外国株式市場の上昇がプラス要因となりましたが、為替市場においてユーロが対円で下落したことや国内株式市場が下落したことがマイナス要因となり、前期末より下落して当期末を迎えました。

組入マザーファンド	基本投資割合	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	25.0%	24.9%	△5.6%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	25.0	25.2	△0.1
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	25.0	24.7	2.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25.0	25.1	△2.2

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

## 1万口当たりの費用明細

項目	第4期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	25円	0.220%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は11,328円です。
(投信会社)	(11)	(0.099)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(11)	(0.100)	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)	(2)	(0.021)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.001)	売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 / 期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.005	
(株式)	(1)	(0.005)	有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 / 期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	0.036	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.024)	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)	(0.009)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.002)	<ul style="list-style-type: none"> <li>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</li> <li>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</li> </ul>
合計	30	0.262	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## 投資環境

### ■国内株式市況

当期の国内株式市場は下落しました。

期初以降、企業の好決算、海外株式市場の堅調な推移、日米の堅調な経済指標や米税制改革法案成立への期待などを背景に株価は上昇しました。2月になると、米長期金利の上昇を受けた投資家のリスク回避姿勢の高まりなどから株価は下落に転じ、その後も米国の政権運営や保護主義政策に対する先行き不透明感の高まりなどから下落が続きました。

4月には米中貿易摩擦への警戒感が和らぎ、シリアや北朝鮮の地政学リスクに対する懸念の後退もあり国内株式市場は上昇しましたが、5月になると米国の保護主義的な政策やイタリアの政局混迷などを背景に下落しました。その後、米中貿易摩擦懸念や新興国への不安などの高まりと落ち着きに応じて、国内株式市場は上下して推移しました。

9月に入ると米中貿易摩擦への警戒感が一服し、円安の進行も追い風となり国内株式市場は上昇しましたが、10月には米株急落を受けた世界同時株安や消費増税への懸念など、景気の先行き不透明感などから下落して当期末を迎えました。

### ■国内債券市況

当期の10年国債金利は、期初以降、米金利の先高観などを背景に上昇する場面もありましたが、米国の保護主義的な政策や米中貿易摩擦懸念が強まったことなどから低下しました。

7月になると、日銀が長期金利の変動幅拡大を容認したことなどから金利は上昇し、その後も、円安・株高の進行などを背景に上昇傾向となりました。

10月以降は、日米の株価が大きく下落したことなどから金利は低下しましたが、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

### ■海外株式市況

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。

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。

## ■海外債券市況

当期の米国10年国債金利は上昇しました。期初より米税制改革の進展期待などから金利はおおむね上昇し、1月以降も日欧の金融政策正常化に対する懸念などから上昇しました。3月には、米保護主義政策への懸念等により金利は低下し、その後も米中貿易摩擦や新興国不安などから低下傾向となりました。9月になると、米雇用統計における賃金の上振れや、新興国不安の一服などから金利は上昇しました。その後は、株価の大幅下落を受けて低下する場面もありましたが、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は低下しました。期初より米税制改革の進展期待や欧州中央銀行（ECB）の金融緩和解除への慎重姿勢、加えて1月には日銀による金融政策正常化への警戒もあり、金利は上昇する展開となりました。しかし2月以降は、欧州景気の減速や米保護主義政策への懸念を背景に金利は低下傾向となり、その後も、イタリア政局の不透明感の高まりや米中貿易摩擦への懸念などを受けて上下する中、徐々に低下して当期末を迎えました。

## ■為替市況

当期の米ドル／円レートは、期を通じて見るとおおむね横ばいとなりました。期初よりもみあい圏で推移した後、1月には日銀による金融政策正常化への懸念や米保護主義政策への警戒などから下落しました。その後は、世界的な株価の大幅下落等もあり、米ドルは下落を続けましたが、4月になると、政治・地政学リスクに対する懸念が緩和したことなどから上昇に転じました。以降、米金利の上昇などを背景に米ドルは上下する中、徐々に上昇傾向となりました。

当期のユーロ／円レートは下落しました。期初以降、ECBによる金融緩和解除への慎重姿勢や、イギリスの欧州連合（EU）離脱交渉の進展期待などを背景に上昇しましたが、2月には、世界的な株価下落や欧州景況感悪化などを受けて下落しました。その後は、イタリアの財政や米中貿易摩擦への懸念が下落要因となる一方、それら懸念の緩和局面やEU離脱交渉の進展期待が高まる場面では上昇しましたが、結局、当期末にかけては下落傾向となりました。

## ポートフォリオ

### ■当ファンド

投資対象の異なる4つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

### ■各マザーファンド

#### <ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等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。

#### <ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

国内の公社債に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

#### <ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

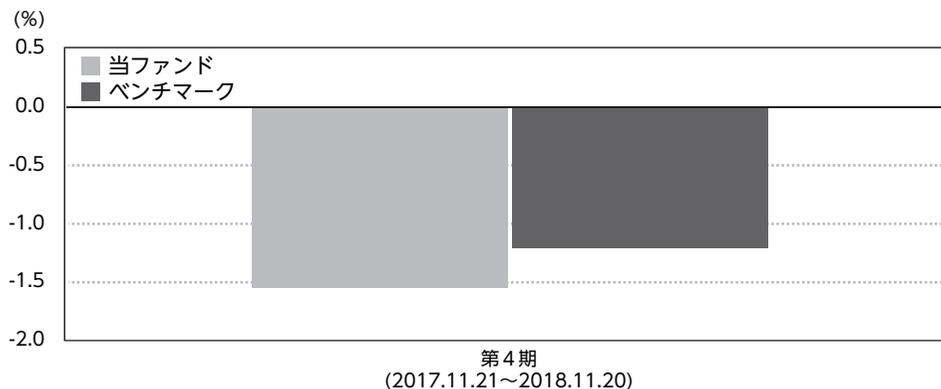
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

#### <ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く主要国の国債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、後掲の各マザーファンドの概要をご参照ください。以下同じです。

## 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-1.5%となり、ベンチマーク騰落率（-1.2%）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	1,514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

投資対象の異なる4つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

## ■各マザーファンド

### <ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、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。

### <ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

国内の公社債に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

### <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。

### <ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く主要国の国債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4期末 2018年11月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	24.9%
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	25.2
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	24.7
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	25.1

(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

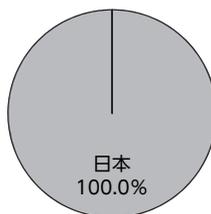
項目	第4期末 2018年11月20日
純資産総額	2,780,458,545円
受益権総口数	2,509,252,665口
1万口当たり基準価額	11,081円

(注) 当期間中における追加設定元本額は1,327,646,170円、同解約元本額は407,482,508円です。

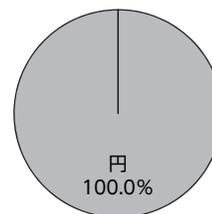
### ■資産別配分



### ■国別配分



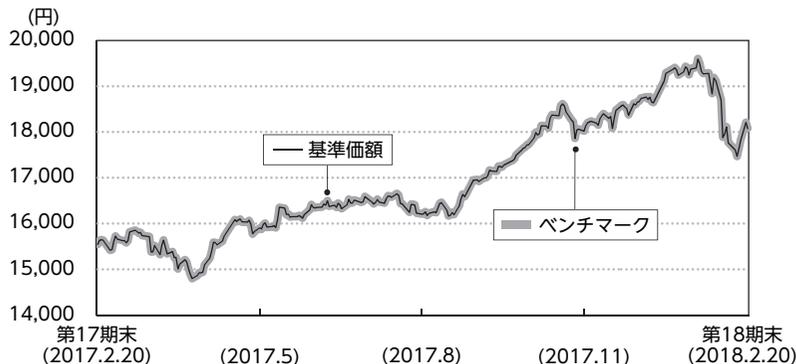
### ■通貨別配分



(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。

## ニッセイ国内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TOPIX（東証株価指数）（配当込み）としており、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおTOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX（東証株価指数）の商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。

### ■ 上位銘柄

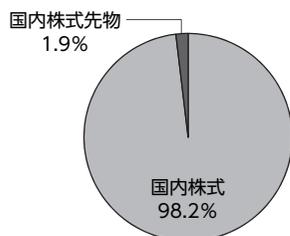
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.5%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	2.1
ソフトバンクグループ	円	1.5
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.4
ソニー	円	1.4
本田技研工業	円	1.3
日本電信電話	円	1.3
キーエンス	円	1.2
任天堂	円	1.1
みずほフィナンシャルグループ	円	1.1
組入銘柄数		1,820

### ■ 1万口当たりの費用明細

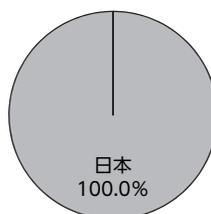
2017.2.21～2018.2.20

項目	金額
売買委託手数料	0円
(株式)	(0)
(先物・オプション)	(0)
その他費用	0
(その他)	(0)
合計	1

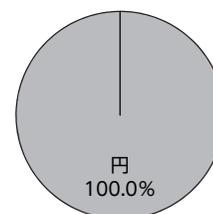
### ■ 資産別配分



### ■ 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2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。

## ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドの概要

### ■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村証券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村証券株式会社の知的財産です。野村証券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。

### ■ 上位銘柄

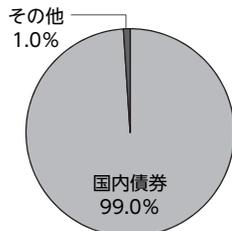
銘柄名	通貨	比率
第152回 利付国債（20年）	円	7.5%
第321回 利付国債（10年）	円	7.4
第303回 利付国債（10年）	円	7.4
第310回 利付国債（10年）	円	7.1
第125回 利付国債（20年）	円	6.9
第333回 利付国債（10年）	円	5.7
第342回 利付国債（10年）	円	5.2
第 38 回 利付国債（30年）	円	5.1
第100回 利付国債（20年）	円	4.7
第 55 回 利付国債（20年）	円	4.0
組入銘柄数		41

### ■ 1万口当たりの費用明細

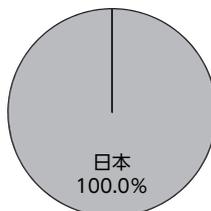
2017.2.21～2018.2.20

項目	金額
その他費用 （その他）	0円 (0)
合計	0

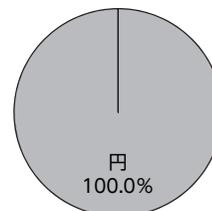
### ■ 資産別配分



### ■ 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2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。

## 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

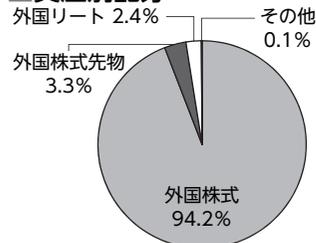
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	2.5%
MICROSOFT CORP	米ドル	2.1%
AMAZON.COM INC	米ドル	1.7%
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	1.1%
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	1.0%
EXXON MOBIL CORP	米ドル	0.9%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	0.9%
FACEBOOK INC-A	米ドル	0.9%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	0.8%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	米ドル	0.8%
組入銘柄数		1,301

### ■ 1万口当たりの費用明細

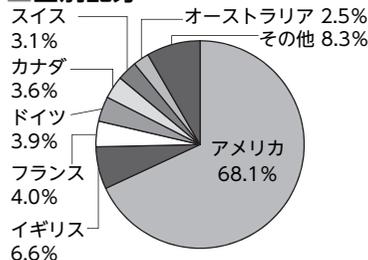
2018.5.22~2018.11.20

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

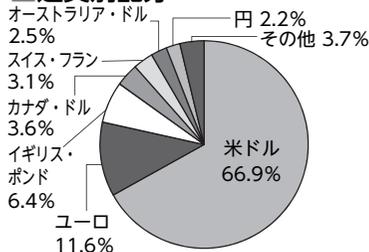
### ■ 資産別配分



### ■ 国別配分



### ■ 通貨別配分



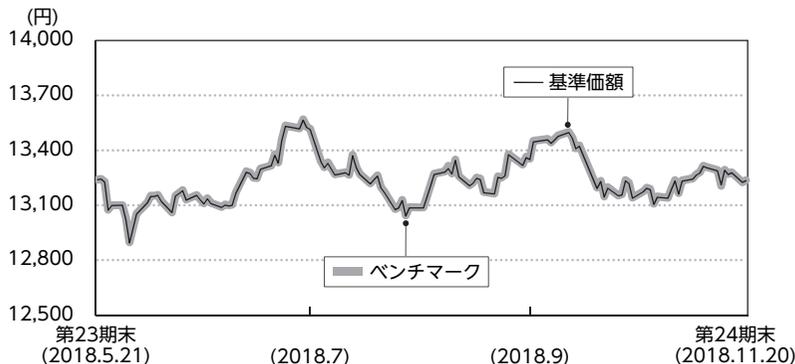
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(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。

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

### ■ 基準価額の推移



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

### ■ 上位銘柄

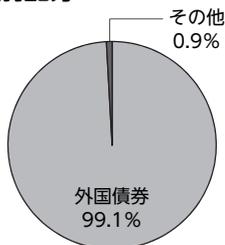
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.625% 2020/11/15	米ドル	1.0%
US TREASURY 2.5% 2023/8/15	米ドル	0.9
US TREASURY 1.75% 2023/5/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.625% 2020/8/15	米ドル	0.9
US TREASURY 2.0% 2023/2/15	米ドル	0.9
US TREASURY 1.375% 2020/1/31	米ドル	0.9
US TREASURY 3.5% 2020/5/15	米ドル	0.8
US TREASURY 2.0% 2021/11/15	米ドル	0.8
US TREASURY 2.125% 2021/8/15	米ドル	0.8
US TREASURY 1.625% 2022/11/15	米ドル	0.8
組入銘柄数		590

### ■ 1万口当たりの費用明細

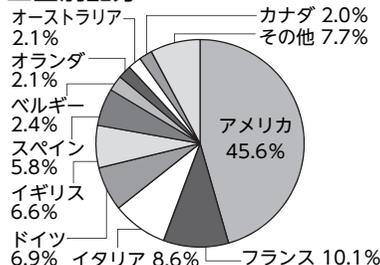
2018.5.22~2018.11.20

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

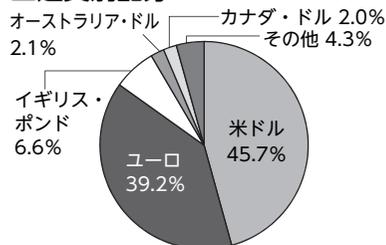
### ■ 資産別配分



### ■ 国別配分



### ■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（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 (分配前)	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	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2015年8月27日	10,000	-	-	10,000	10,000	-	-	-	-	-	1
1期(2015年11月20日)	10,528	0	5.3	10,528	10,544	5.4	47.8	1.6	49.3	0.6	486
2期(2016年11月21日)	9,925	0	△ 5.7	9,925	10,029	△ 4.9	49.3	1.4	48.1	0.6	1,283
3期(2017年11月20日)	11,255	0	13.4	11,255	11,410	13.8	47.8	1.2	49.5	0.6	1,788
4期(2018年11月20日)	11,081	0	△ 1.5	11,081	11,272	△ 1.2	47.5	1.4	50.0	0.6	2,780

(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(分配前)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、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)を25%ずつ組み合わせて合成したもので、設定時を10,000として指数化しています。TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標または標準に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。なお、当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。NOMURA-BPI総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同インデックスの内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。なお、「円換算ベース」とは、委託会社が独自に円換算したものです。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」、「債券組入比率」、「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	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2017年11月20日	11,255	-	11,410	-	47.8	1.2	49.5	0.6
11月末	11,361	0.9	11,521	1.0	48.2	1.4	49.2	0.6
12月末	11,528	2.4	11,693	2.5	48.6	1.0	49.1	0.6
2018年1月末	11,516	2.3	11,681	2.4	47.6	1.2	50.0	0.5
2月末	11,216	△0.3	11,381	△0.3	48.1	1.4	49.3	0.5
3月末	11,058	△1.8	11,228	△1.6	48.0	1.4	49.6	0.6
4月末	11,308	0.5	11,485	0.7	48.8	1.3	48.8	0.6
5月末	11,206	△0.4	11,384	△0.2	48.1	1.4	49.4	0.6
6月末	11,247	△0.1	11,430	0.2	47.7	1.3	50.2	0.6
7月末	11,410	1.4	11,596	1.6	49.5	0.9	48.7	0.6
8月末	11,425	1.5	11,614	1.8	48.1	1.4	49.3	0.5
9月末	11,697	3.9	11,889	4.2	49.5	0.9	48.5	0.5
10月末	11,109	△1.3	11,294	△1.0	45.8	1.6	51.4	0.6
(期末)2018年11月20日	11,081	△1.5	11,272	△1.2	47.5	1.4	50.0	0.6

(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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	260,340	470,153	104,145	190,400
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	331,688	447,703	145,532	196,477
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	246,074	424,140	105,974	184,573
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	322,804	429,756	122,689	163,655

(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	
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	16,869,153千円	48,258,907千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	51,935,156千円	123,952,182千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.32	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
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	251,057	407,253	692,819
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	333,877	520,033	701,524
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	266,350	406,450	686,860
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	328,272	528,387	699,267

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるマザーファンド全体の口数はニッセイ国内株式インデックスマザーファンドが33,015,590千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが23,967,357千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが88,596,175千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが13,426,526千口です。

**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	%
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	692,819	24.9
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	701,524	25.2
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	686,860	24.7
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	699,267	25.1
コール・ローン等、その他	3,315	0.1
投資信託財産総額	2,783,787	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メキシコ・ペソ5.54円、1マレーシア・リンギット26.90円、1南アフリカ・ランド8.02円、1ポーランド・ズロチ29.79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。  
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（17,731,935千円）の投資信託財産総額（17,866,645千円）に対する比率は99.2%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>2,783,787,635円</b>
コール・ローン等	2,578,642
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	692,819,482
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	701,524,846
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	686,860,530
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	699,267,461
未収入金	736,674
<b>(B)負債</b>	<b>3,329,090</b>
未払解約金	667,979
未払信託報酬	2,549,534
その他未払費用	111,577
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>2,780,458,545</b>
元本	2,509,252,665
次期繰越損益金	271,205,880
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>2,509,252,665口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	<b>11,081円</b>

(注) 期首元本額	1,589,089,003円
期中追加設定元本額	1,327,646,170円
期中一部解約元本額	407,482,508円

### 損益の状況

当期(2017年11月21日~2018年11月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>△ 746円</b>
受取利息	37
支払利息	△ 783
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>△ 49,334,153</b>
売買益	13,325,028
売買損	△ 62,659,181
<b>(C)信託報酬等</b>	<b>△ 5,126,553</b>
<b>(D)当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 54,461,452</b>
<b>(E)前期繰越損益金</b>	<b>126,373,351</b>
(分配準備積立金)	(126,373,351)
<b>(F)追加信託差損益金*</b>	<b>199,293,981</b>
(配当等相当額)	(211,826,536)
(売買損益相当額)	(△ 12,532,555)
<b>(G)合計(D+E+F)</b>	<b>271,205,880</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>271,205,880</b>
追加信託差損益金	199,293,981
(配当等相当額)	(213,858,673)
(売買損益相当額)	(△ 14,564,692)
分配準備積立金	166,143,217
繰越欠損金	△ 94,231,318

- (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	39,769,866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	213,858,673円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	126,373,351円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	380,001,890円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	1,514.40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

・信託報酬率の上限引き下げに伴い、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）

・インデックス名称の変更に伴い、関連条項に所要の変更を行いました。

（2018年1月23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ニッセイ外国株式インデックス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／内外／資産複合／インデックス型	
信 託 期 間	無制限	
運 用 方 針	下記マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場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・インデックス バランスファンド(4資産均等型)	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	国内の金融商品取引所上場株式等
	ニッセイ国内債券 インデックスマザーファンド	国内の公社債
	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
	ニッセイ外国債券 インデックスマザーファンド	日本を除く主要国の国債
運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイ・インデックス バランスファンド(4資産均等型)	各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、それぞれ25%ずつとします。
	ニッセイ国内株式 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は行いません。
	ニッセイ国内債券 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに 限ります。
	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。
	ニッセイ外国債券 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得 に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とし ます。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の配当等収益および売買益等の全額を対象として、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。	

# ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 18 期

(計算期間：2017年2月21日～2018年2月20日)

#### 運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

#### 主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

#### 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は行いません。



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

2017年2月21日～2018年2月20日

## 国内株式市況



(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の国内株式市場はおおむね上昇しました。

期初以降、株価は為替市場の変動を背景にもみ合いとなりましたが、トランプ米政権の政策実現性に対する不透明感や、シリア・北朝鮮情勢の緊迫化などの地政学リスクに対する警戒感から、徐々に下落しました。

4月下旬には欧州政治に対する不透明感が薄らいだことや、トランプ米大統領が予告した税制改革案への期待、さらに北朝鮮情勢に対する懸念がやや後退したことなどを受け、株価は上昇基調に転じました。8月に北朝鮮が核弾頭の小型化に成功したとする報道から地政学リスクが強く意識され株価は下落しましたが、9月中旬には米国と北朝鮮の軍事衝突を回避できるとの見方が広がり、解散総選挙をめぐる思惑なども相まって株価は上昇しました。

11月中旬以降は米税制改革への思惑などから上下しつつもおおむね上昇基調で推移しましたが、2月に入ると米金利上昇などを受けた米国株の急落と円高を受けて大きく下落しました。結局、期を通じて見ると上昇して当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



### ■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、国内株式市場が上昇したことから同様の動きとなりました。期初以降、トランプ米政権の政策実現性に対する不透明感や、北朝鮮情勢の緊迫化などの地政学リスクに対する警戒感などから株価が下落したため、基準価額も下落しましたが、4月下旬には地政学リスクに対する警戒感の後退などから上昇に転じました。その後、上下しましたが、9月以降は堅調な企業業績などからおおむね上昇しました。

11月中旬以降は米税制改革への思惑などを受けた株価変動により、基準価額は上下しつつも、おおむね上昇しました。2月に入ると米金利上昇などを起因とする米国株の急落や、円高を受けて大きく下落しましたが、期を通じて見ると上昇し、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

(注) ベンチマークはTOPIX (東証株価指数) (配当込み) としており、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおTOPIX (東証株価指数) は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX (東証株価指数) の商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。以下同じです。

## ポートフォリオ

当期も東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

銘柄選択については、一部信用不安銘柄を投資ユニバースから除外した後、層化抽出法にて行いました (市場での組入比率が大きな銘柄については、ベンチマークとの連動性を高めるために、信用不安銘柄であっても組み入れを行いました)。

また資金の流出入などに対応するため、TOPIX (東証株価指数) 先物も一部利用しました。

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+16.3%となり、ベンチマーク騰落率 (+16.3%) に連動しました。

## ■ 今後の運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する成果を目標として運用を行います。

## ■ お知らせ

### ■ 約款変更

デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、関連条項に所要の変更を行いました。

(2017年8月18日)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
14期(2014年 2月20日)	11,293	24.9	11,401	25.1	98.6	1.4	31,810
15期(2015年 2月20日)	14,473	28.2	14,609	28.1	98.6	1.3	42,826
16期(2016年 2月22日)	12,782	△11.7	12,904	△11.7	98.3	1.7	34,137
17期(2017年 2月20日)	15,544	21.6	15,699	21.7	97.7	2.3	40,998
18期(2018年 2月20日)	18,076	16.3	18,261	16.3	98.2	1.9	50,868

(注1) ベンチマークはTOPIX(東証株価指数)(配当込み)としており、設定時を10,000として指数化しています。なおTOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。以下同じです。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率
		%		%		
	円	%		%	%	%
(期首)2017年 2月20日	15,544	-	15,699	-	97.7	2.3
2月末	15,431	△ 0.7	15,584	△ 0.7	97.5	2.6
3月末	15,338	△ 1.3	15,493	△ 1.3	95.2	4.7
4月末	15,535	△ 0.1	15,690	△ 0.1	97.5	2.4
5月末	15,914	2.4	16,065	2.3	97.4	2.7
6月末	16,373	5.3	16,541	5.4	97.6	2.5
7月末	16,441	5.8	16,611	5.8	98.3	1.8
8月末	16,435	5.7	16,603	5.8	96.3	3.6
9月末	17,148	10.3	17,324	10.4	95.9	2.9
10月末	18,081	16.3	18,268	16.4	97.5	2.6
11月末	18,353	18.1	18,539	18.1	96.4	3.6
12月末	18,636	19.9	18,830	19.9	98.1	2.1
2018年 1月末	18,834	21.2	19,030	21.2	97.8	2.1
(期末)2018年 2月20日	18,076	16.3	18,261	16.3	98.2	1.9

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2017年2月21日～2018年2月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.002% (0.000) (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 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
その他費用 (その他)	0 (0)	0.002 (0.002)	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	1	0.004	

(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（16,939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

2017年2月21日～2018年2月20日

(1) 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		4,833	8,639,552	3,087	4,302,187
		(△4,545)			

(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) 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) 新株予約権証券

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
国内		証券	千円	証券	千円
		—	—	2,400	630
		(2,400)			

(注1) ( )内は割当、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注2) 証券数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、証券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。

## ニッセイ国内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
国内 株式先物取引	百万円 14,508	百万円 14,632	百万円 -	百万円 -

(注) 単位未満は切り捨てています。

### 主要な売買銘柄

2017年2月21日～2018年2月20日

#### (1) 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
トヨタ自動車	38	264,789	6,931	日本電信電話	22	118,822	5,376
三菱UFJフィナンシャル・グループ	203	157,126	772	三菱UFJフィナンシャル・グループ	151	113,549	750
キーエンス	2	131,795	59,907	東芝	410	101,490	247
ソフトバンクグループ	13	123,528	8,886	トヨタ自動車	13	83,348	6,266
日本電信電話	20	107,113	5,125	KDDI	22	67,116	3,036
本田技研工業	28	103,003	3,639	三井住友フィナンシャルグループ	14	62,677	4,413
三井住友フィナンシャルグループ	21	99,723	4,595	ソニー	12	52,734	4,218
ソニー	19	92,724	4,779	ファナック	2	48,494	24,247
みずほフィナンシャルグループ	420	85,404	203	野村ホールディングス	68	46,518	678
日本郵政	64	83,888	1,310	武田薬品工業	7	45,131	6,098

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

(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。

#### (2) 新株予約権証券

銘柄	買付			銘柄	売付		
	証券数	金額	平均単価		証券数	金額	平均単価
	証券	千円	円		証券	千円	円
-	-	-	-	フージャースホールディングス	2,400	630	263

(注) 証券数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、証券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2月20日現在

(1) 国内株式  
上場株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
極洋	0.800	0.900	3,505
日本水産	25	25	13,450
マルハニチロ	3	4	14,049
カネコ種苗	0.800	0.900	1,434
サカタのタネ	2	3	12,144
ホクト	2	2	4,749
<b>鉱業(0.3%)</b>			
住石ホールディングス	2	7	1,106
日鉄鉱業	0.600	0.600	4,248
三井松島産業	1	1	1,652
国際石油開発帝石	104	107	143,075
日本海洋掘削	0.700	0.800	1,744
石油資源開発	3	3	9,110
K&Oエナジーグループ	1	1	2,216
<b>建設業(3.1%)</b>			
ショーボンドホールディングス	2	2	15,498
ミライト・ホールディングス	6	6	11,186
タマホーム	-	1	1,997
サンヨーホームズ	1	-	-
ベステラ	-	0.800	1,477
インベスターズクラウド	-	1	3,826
ダイセキ環境ソリューション	0.800	1	1,399
安藤・間	14	17	13,491
東急建設	7	8	10,225
コムシスホールディングス	7	7	21,801
ミサワホーム	2	1	1,672
高松コンストラクショングループ	1	1	4,117
東建コーポレーション	0.800	0.800	9,544
ソネック	-	1	1,404
ヤマウラ	2	1	1,384
大成建設	101	22	119,340
大林組	59	66	79,520
清水建設	61	67	68,782
飛鳥建設	19	20	3,737
長谷工コーポレーション	23	25	40,507
松井建設	2	2	2,018

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
銭高組	3	0.300	1,710
鹿島建設	87	98	98,784
不動テトラ	16	16	3,276
大末建設	-	0.700	749
鉄建建設	12	1	4,004
西松建設	23	5	14,030
三井住友建設	76	16	10,032
大豊建設	7	8	4,976
前田建設工業	12	15	20,066
佐田建設	2	2	1,412
ナカノフドー建設	-	2	1,401
奥村組	16	3	17,353
東鉄工業	2	2	8,842
浅沼組	7	8	3,680
戸田建設	23	26	21,138
熊谷組	31	3	11,235
青木あすなろ建設	1	1	1,525
北野建設	4	5	2,305
植木組	5	0.500	1,359
三井ホーム	3	3	2,109
矢作建設工業	2	3	2,556
ピーエス三菱	3	2	2,249
日本ハウスホールディングス	4	4	2,658
大東建託	7	8	148,040
新日本建設	2	2	2,659
NIPPPO	5	5	13,101
東亜道路工業	4	0.400	1,688
前田道路	6	7	16,233
日本道路	6	0.600	3,516
東亜建設工業	1	1	3,972
若築建設	11	1	2,020
東洋建設	5	7	3,815
五洋建設	22	26	20,750
大林道路	2	-	-
世紀東急工業	2	3	2,121
福田組	3	0.700	4,641
住友林業	13	14	26,554

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日本基礎技術	3	3	3	1,397
日成ビルド工業	6	3	3	4,072
巴コーポレーション	3	2	2	1,629
パナホーム	7	-	-	-
大和ハウス工業	58	65	260,563	
ライト工業	3	4	5,061	
積水ハウス	62	72	137,468	
日特建設	2	2	1,449	
北陸電気工事	1	1	1,374	
ユアテック	3	3	3,038	
西部電気工業	0.500	-	-	
四電工	3	0.500	1,387	
中電工	2	2	8,581	
関電工	8	8	10,700	
きんでん	13	14	25,988	
東京エネシス	2	2	3,005	
トーエネック	3	0.600	1,881	
住友電設	1	1	4,105	
日本電設工業	3	3	7,398	
協和エクシオ	7	8	22,736	
新日本空調	1	1	2,754	
N D S	0.400	0.300	1,371	
九電工	3	4	22,044	
三機工業	4	4	5,499	
日揮	18	19	46,107	
中外炉工業	6	0.700	1,656	
ヤマト	-	1	1,510	
太平電業	3	1	3,946	
高砂熱学工業	5	6	12,108	
三晃金属工業	-	0.300	1,242	
朝日工業社	0.500	0.500	1,812	
明星工業	3	4	3,080	
大気社	2	2	10,846	
ダイダン	3	1	3,499	
日比谷総合設備	2	2	5,065	
東芝プラントシステム	3	4	10,286	
OSJBホールディングス	6	9	3,028	
東洋エンジニアリング	12	2	2,613	
千代田化工建設	14	14	15,494	
新興プランテック	4	4	4,373	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
<b>食料品(4.2%)</b>				
日本製粉	5	6	10,850	
日清製粉グループ本社	21	24	51,200	
昭和産業	8	1	5,043	
鳥越製粉	1	1	1,767	
中部飼料	2	2	4,860	
フィード・ワン	12	13	3,229	
東洋精糖	-	1	1,353	
日本甜菜製糖	1	1	2,626	
三井製糖	1	1	6,824	
塩水港精糖	4	5	1,438	
日新製糖	0.800	0.900	1,978	
森永製菓	3	4	23,876	
中村屋	0.500	0.500	2,400	
江崎グリコ	5	5	29,792	
名糖産業	-	1	1,568	
井村屋グループ	-	0.800	3,376	
不二家	11	1	3,291	
山崎製パン	14	16	34,572	
モロゾフ	3	0.300	2,037	
亀田製菓	1	1	6,204	
寿スピリッツ	1	1	11,647	
カルビー	8	9	33,260	
森永乳業	18	4	17,520	
六甲バター	0.900	1	2,305	
ヤクルト本社	10	11	91,273	
明治ホールディングス	11	13	105,193	
雪印メグミルク	4	4	13,392	
プリマハム	13	14	9,254	
日本ハム	14	17	40,698	
林兼産業	1	-	-	
丸大食品	10	11	5,522	
S Foods	1	1	5,999	
伊藤ハム米久ホールディングス	11	12	11,968	
サッポロホールディングス	6	7	23,396	
アサヒグループホールディングス	37	41	231,088	
キリンホールディングス	85	95	266,819	
宝ホールディングス	14	14	19,697	
オエノンホールディングス	5	5	2,262	
養命酒製造	0.600	0.600	1,387	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
コカ・コーラ ホトラーズジャパンホールディングス	6	14	14	52,710
コカ・コーライーストジャパン	7	-	-	-
サントリー食品インターナショナル	13	15	15	75,772
ダイドーグループホールディングス	0.900	1	1	6,470
伊藤園	5	6	6	29,700
キーコーヒー	1	2	2	4,312
ユニカフェ	1	-	-	-
日清オイリオグループ	11	2	2	6,840
不二製油グループ本社	5	5	5	17,037
かどや製油	-	0.200	0.200	1,312
J-オイルミルズ	0.900	1	1	3,700
キッコーマン	14	15	15	65,875
味の素	41	45	45	90,371
キューピー	10	11	11	33,211
ハウス食品グループ本社	7	7	7	28,272
カゴメ	7	8	8	29,800
焼津水産化学工業	-	1	1	1,429
アリアケジャパン	1	1	1	14,490
ピエトロ	0.700	0.800	0.800	1,341
エバラ食品工業	0.600	0.700	0.700	1,509
ニチレイ	9	9	9	25,241
東洋水産	9	10	10	45,834
日清食品ホールディングス	7	8	8	64,641
永谷園ホールディングス	2	2	2	3,120
一正蒲鉾	1	1	1	1,495
フジッコ	1	2	2	5,145
ロック・フィールド	2	2	2	4,489
日本たばこ産業	110	123	123	386,534
ケンコーマヨネーズ	0.700	1	1	4,797
わらべや日洋ホールディングス	1	1	1	3,396
なとり	1	1	1	2,142
ピクルスコーポレーション	-	0.800	0.800	1,452
北の達人コーポレーション	-	5	5	4,195
ユーグレナ	6	7	7	7,499
ミヨシ油脂	8	1	1	1,409
理研ビタミン	0.600	0.800	0.800	3,224
<b>繊維製品(0.7%)</b>				
片倉工業	2	2	2	3,316
グンゼ	14	1	1	8,790
東洋紡	74	7	7	16,016
ユニチカ	51	6	6	4,272

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
富士紡ホールディングス	0.900	1	1	5,046
倉敷紡績	19	21	21	7,182
シキボウ	10	1	1	1,400
日本毛織	5	5	5	6,425
ダイドーリミテッド	-	3	3	1,416
帝国繊維	1	2	2	4,481
帝人	15	17	17	37,060
東レ	135	150	150	164,797
サカイオーベックス	-	0.500	0.500	1,383
住江織物	5	0.500	0.500	1,483
日本フェルト	2	2	2	1,425
イチカワ	4	4	4	1,500
アツギ	15	1	1	1,698
セーレン	4	4	4	9,782
ソトー	1	1	1	1,387
東海染工	9	0.900	0.900	1,391
小松精練	2	3	3	2,969
ワコールホールディングス	11	5	5	18,069
ホギメディカル	1	1	1	11,037
レナウン	10	-	-	-
クラウドディアホールディングス	-	2	2	1,400
T S Iホールディングス	7	7	7	5,912
マツオカコーポレーション	-	0.400	0.400	1,470
三陽商会	10	1	1	2,574
オンワードホールディングス	12	12	12	11,271
ゴールドウイン	0.800	0.600	0.600	7,164
デサント	4	4	4	8,187
キング	2	0.100	0.100	65
ヤマトインターナショナル	3	2	2	1,392
<b>パルプ・紙(0.3%)</b>				
特種東海製紙	1	1	1	4,631
王子ホールディングス	73	87	87	61,770
日本製紙	8	9	9	20,041
三菱製紙	2	3	3	2,115
北越紀州製紙	10	11	11	8,085
中越パルプ工業	7	0.800	0.800	1,574
大王製紙	7	8	8	12,665
阿波製紙	1	2	2	1,454
レンゴー	17	20	20	18,210
トーモク	6	1	1	2,522
ザ・バック	1	1	1	5,385

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
<b>化学(7.2%)</b>				
クラレ	31	34	66,065	
旭化成	116	129	173,525	
共和レザー	1	1	1,383	
昭和電工	12	13	70,104	
住友化学	137	153	102,816	
住友精化	0.800	0.900	4,950	
日産化学工業	10	12	48,158	
ラサ工業	9	0.700	1,700	
クレハ	1	1	13,572	
多木化学	-	0.300	1,315	
テイカ	3	1	4,385	
石原産業	3	3	5,387	
片倉コープアグリ	-	1	1,377	
日東エフシー	-	0.100	79	
日本曹達	11	14	9,142	
東ソー	54	30	68,250	
トクヤマ	29	6	18,690	
セントラル硝子	19	4	10,248	
東亜合成	11	12	14,762	
大阪ソーダ	8	1	5,268	
関東電化工業	4	5	6,150	
デンカ	39	7	29,260	
信越化学工業	33	34	391,672	
日本カーバイド工業	8	0.700	1,576	
堺化学工業	7	1	4,361	
エア・ウォーター	15	17	36,405	
大陽日酸	14	16	25,200	
日本化学工業	7	0.800	2,536	
日本パーカライズン	9	10	20,171	
高圧ガス工業	2	3	2,706	
四国化成工業	3	3	4,539	
戸田工業	4	0.400	1,486	
ステラ ケミファ	0.900	1	2,967	
保土谷化学工業	0.600	0.700	3,353	
日本触媒	2	3	24,717	
大日精化工業	8	1	7,424	
カネカ	25	28	30,044	
三菱瓦斯化学	17	17	44,665	
三井化学	85	18	62,181	
J S R	18	20	49,742	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
東京応化工業	3	3	14,706	
大阪有機化学工業	1	1	2,035	
三菱ケミカルホールディングス	125	139	151,440	
K H ネオケム	2	3	9,904	
ダイセル	25	28	33,432	
住友ベークライト	16	17	15,181	
積水化学工業	42	43	85,036	
日本ゼオン	16	17	27,195	
アイカ工業	6	5	23,751	
宇部興産	94	10	36,172	
積水樹脂	2	3	7,948	
タキロンシーアイ	4	4	3,011	
旭有機材	6	1	2,583	
日立化成	10	10	24,833	
ニチバン	2	1	3,250	
リケンテクノス	4	4	2,407	
大倉工業	4	5	2,885	
積水化成成品工業	2	2	3,023	
群栄化学工業	0.400	0.500	1,757	
タイガースポリマー	1	-	-	
ミライアル	1	0.700	1,418	
ダイキアクシス	1	-	-	
ダイキョーニシカワ	3	4	7,564	
森六ホールディングス	-	0.800	2,476	
日本化薬	12	13	18,630	
カーリットホールディングス	2	1	2,213	
日本精化	1	1	2,102	
扶桑化学工業	1	1	4,297	
A D E K A	8	8	17,568	
日油	15	8	23,488	
新日本理化	7	5	1,459	
ハリマ化成グループ	1	1	1,419	
花王	47	48	384,194	
第一工業製薬	4	4	3,156	
ニイタカ	-	0.500	924	
三洋化成工業	1	1	6,799	
有機合成薬品工業	-	4	1,406	
大日本塗料	11	2	3,772	
日本ペイントホールディングス	14	16	59,280	
関西ペイント	19	21	57,770	
中国塗料	5	5	6,436	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日本特殊塗料	1	1	2,619	
藤倉化成	2	2	1,747	
太陽ホールディングス	1	1	7,864	
D I C	7	8	31,406	
サカタインクス	3	4	5,817	
東洋インキSCホールディングス	18	21	13,650	
T & K T O K A	1	1	1,919	
富士フィルムホールディングス	36	41	179,838	
資生堂	35	36	234,315	
ライオン	23	27	58,926	
高砂香料工業	1	1	3,840	
マンダム	1	3	14,898	
ミルボン	1	2	10,959	
ファンケル	4	4	16,392	
コーセー	3	3	70,210	
コタ	-	0.900	1,740	
シーズ・ホールディングス	2	2	16,254	
シーボン	0.200	0.400	1,372	
ポーラ・オルビスホールディングス	1	8	39,355	
ノエビアホールディングス	1	1	10,582	
アジュバンコスメジヤパン	1	1	1,410	
エステー	1	1	3,106	
アグロ カネシヨウ	1	0.800	1,892	
コニシ	2	3	6,141	
長谷川香料	2	2	5,317	
星光PMC	1	1	1,404	
小林製薬	5	5	39,368	
荒川化学工業	1	1	3,448	
メック	1	1	2,489	
日本高純度化学	0.500	0.600	1,540	
タカラバイオ	4	5	10,389	
J C U	0.600	1	5,760	
デクセリアルズ	4	5	6,981	
アース製薬	1	1	7,875	
イハラケミカル工業	2	-	-	
北興化学工業	-	2	1,508	
大成ラミック	0.500	0.600	1,896	
クミアイ化学工業	3	9	5,868	
日本農薬	4	5	3,120	
アキレス	1	1	3,199	
有沢製作所	3	3	3,121	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日東電工	13	15	125,715	
レック	0.600	1	3,762	
きもと	5	-	-	
藤森工業	1	1	6,205	
前澤化成工業	1	1	1,633	
J S P	0.900	1	3,954	
エフピコ	1	1	9,504	
天馬	1	1	3,307	
信越ポリマー	3	4	5,088	
東リ	4	4	1,896	
ニフコ	3	3	27,036	
日本バルカー工業	1	1	5,088	
ユニ・チャーム	37	42	126,798	
<b>医薬品(4.6%)</b>				
協和発酵キリン	22	24	57,734	
武田薬品工業	69	73	431,430	
アステラス製薬	190	203	310,897	
大日本住友製薬	13	14	25,269	
塩野義製薬	25	28	157,829	
田辺三菱製薬	21	24	55,563	
わかもと製薬	-	5	1,410	
あすか製薬	2	2	4,972	
日本新薬	4	5	32,708	
ビオフェルミン製薬	0.400	0.500	1,461	
中外製薬	18	20	115,920	
科研製薬	3	3	22,248	
エーザイ	22	23	132,933	
ロート製薬	9	10	33,027	
小野薬品工業	42	46	142,038	
久光製薬	5	5	43,365	
持田製薬	1	1	10,906	
参天製薬	34	37	65,100	
扶桑薬品工業	0.600	0.700	1,974	
日本ケミファ	0.300	-	-	
ツムラ	6	7	24,885	
日医工	4	5	8,964	
キッセイ薬品工業	3	3	10,792	
生化学工業	3	3	7,987	
栄研化学	1	1	7,928	
日水製薬	0.300	-	-	
鳥居薬品	1	1	3,301	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
JCRファーマ	1	1	1	7,462
東和薬品	0.900	1	1	6,890
富士製薬工業	0.600	0.700	0.700	3,206
沢井製薬	3	4	4	20,360
ゼリア新薬工業	3	4	4	9,021
第一三共	54	56	56	219,882
キョーリン製薬ホールディングス	4	5	5	11,434
大幸薬品	0.900	1	1	2,098
ダイト	1	1	1	4,182
大塚ホールディングス	40	41	41	208,554
大正製薬ホールディングス	4	4	4	43,164
ペプチドリーム	3	8	8	41,607
<b>石油・石炭製品(0.7%)</b>				
日本コークス工業	15	16	16	1,898
昭和シェル石油	16	18	18	25,585
ニチレキ	2	2	2	3,410
東燃ゼネラル石油	30	-	-	-
ユシロ化学工業	1	1	1	2,101
ビーピー・カストロール	0.900	0.800	0.800	1,420
富士石油	4	4	4	2,209
MORESCO	0.700	0.700	0.700	1,359
出光興産	8	16	16	66,566
JXTGホールディングス	206	316	316	207,680
コスモエネルギーホールディングス	5	5	5	22,794
<b>ゴム製品(0.9%)</b>				
横浜ゴム	11	11	11	30,751
東洋ゴム工業	9	11	11	22,885
ブリヂストン	62	70	70	336,770
住友ゴム工業	17	20	20	43,329
藤倉ゴム工業	-	1	1	1,404
オカモト	6	7	7	7,735
フコク	0.800	0.900	0.900	943
ニッタ	1	2	2	8,270
住友理工	3	3	3	4,104
三ツ星ベルト	5	5	5	5,870
バンダー化学	3	3	3	4,666
<b>ガラス・土石製品(1.0%)</b>				
日東紡績	15	2	2	7,441
旭硝子	92	20	20	92,060
日本板硝子	8	10	10	8,970
日本山村硝子	8	8	8	1,472

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日本電気硝子	38	8	8	29,326
オハラ	-	0.800	0.800	2,424
住友大阪セメント	35	39	39	18,759
太平洋セメント	112	12	12	50,125
日本ヒューム	1	2	2	1,610
日本コンクリート工業	4	4	4	1,956
三谷セキサン	0.900	1	1	2,516
アジアパイルホールディングス	2	2	2	1,700
東海カーボン	17	18	18	33,876
日本カーボン	9	1	1	5,810
東洋炭素	1	1	1	4,634
ノリタケカンパニーリミテド	1	1	1	6,432
TOTO	13	15	15	86,184
日本碍子	23	24	24	49,005
日本特殊陶業	16	17	17	46,172
MARUWA	0.700	0.700	0.700	5,936
品川リフラクトリーズ	5	0.500	0.500	1,547
黒崎播磨	4	0.400	0.400	2,012
ヨータイ	-	0.500	0.500	426
東京窯業	6	3	3	1,357
ニッカトー	3	1	1	1,458
フジミインコーポレーテッド	1	1	1	4,730
エーアンドエーマテリアル	-	1	1	1,379
ニチアス	10	11	11	14,916
ニチハ	2	3	3	13,065
<b>鉄鋼(1.1%)</b>				
新日鐵住金	83	87	87	224,731
神戸製鋼所	32	35	35	43,439
中山製鋼所	2	2	2	1,911
合同製鐵	1	1	1	2,244
ジェイエフイーホールディングス	50	52	52	133,995
日新製鋼	8	5	5	8,445
東京製鐵	9	10	10	9,072
共英製鋼	2	2	2	4,342
大和工業	3	4	4	13,503
東京鐵鋼	4	0.800	0.800	1,420
大阪製鐵	1	1	1	2,757
淀川製鋼所	2	2	2	9,091
東洋鋼鈑	4	5	5	3,565
丸一鋼管	6	6	6	23,460
モリ工業	0.600	0.600	0.600	2,403

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大同特殊鋼	31	3	20,440
日本高周波鋼業	—	1	1,378
日本冶金工業	15	16	5,394
山陽特殊製鋼	11	2	5,605
愛知製鋼	1	1	5,186
日立金属	18	21	30,236
日本金属	1	0.500	1,373
大太平洋金属	12	1	3,858
新日本電工	10	11	4,586
栗本鐵工所	0.900	1	2,115
三菱製鋼	13	1	3,728
日亜鋼業	4	3	1,415
日本精線	2	0.300	1,486
シンニッタン	0.200	0.700	584
新家工業	8	0.600	1,479
<b>非鉄金属(1.0%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	3	3	2,630
日本軽金属ホールディングス	42	57	16,645
三井金属鉱業	51	5	27,295
東邦亜鉛	10	1	6,523
三菱マテリアル	11	12	43,344
住友金属鉱山	48	25	128,275
DOWAホールディングス	21	5	19,950
古河機械金属	29	3	7,372
大阪チタニウムテクノロジーズ	2	2	5,852
東邦チタニウム	3	3	5,369
UACJ	24	3	7,839
古河電気工業	6	6	37,115
住友電気工業	70	73	123,730
フジクラ	24	23	18,272
昭和電線ホールディングス	22	2	2,455
東京特殊電線	—	0.300	958
タツタ電線	3	3	2,792
カナレ電気	0.600	0.600	1,324
平河ヒューテック	1	1	1,436
リョービ	11	2	6,840
アーレスティ	2	2	2,316
アサヒホールディングス	2	3	6,973
<b>金属製品(0.7%)</b>			
稲葉製作所	1	1	1,485
宮地エンジニアリンググループ	—	0.600	1,440

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トーカロ	1	1	7,756
アルファ	—	0.700	1,321
SUMCO	19	18	50,976
川田テクノロジーズ	0.400	0.400	2,476
RS Technologies	—	0.300	2,049
東洋製罐グループホールディングス	13	13	20,890
ホッカンホールディングス	5	5	1,950
コロナ	1	1	1,482
横河ブリッジホールディングス	3	3	8,913
高田機工	5	0.300	1,332
三和ホールディングス	18	18	27,824
文化シャッター	5	5	5,747
三協立山	2	2	4,141
アルインコ	1	1	1,604
LIXILグループ	25	28	77,076
日本ファイルコン	2	2	1,445
ノーリツ	3	4	8,681
長府製作所	2	2	5,431
リンナイ	3	3	34,335
ダイニチ工業	1	1	1,403
日東精工	2	2	1,714
三洋工業	—	0.500	1,074
岡部	3	4	3,968
ジーテクト	1	2	4,642
東プレ	3	3	11,488
高周波熱錬	3	3	4,180
東京製網	1	1	2,788
サンコール	2	1	1,427
モリテックスチール	4	1	1,479
パイオラックス	0.900	2	8,499
エイチワン	—	1	1,978
日本発条	17	19	20,767
アドバネクス	0.700	—	—
立川ブラインド工業	—	1	1,436
三益半導体工業	1	1	2,937
<b>機械(5.6%)</b>			
日本ドライケミカル	0.500	0.600	1,522
日本製鋼所	6	6	21,792
三浦工業	7	8	25,457
タクマ	6	6	8,679
ツガミ	5	5	7,470

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
オークマ	12	2	15,088	
東芝機械	11	11	8,426	
アマダホールディングス	25	30	43,065	
アイダエンジニアリング	5	5	7,025	
滝澤鉄工所	8	0.600	1,300	
富士機械製造	5	5	12,708	
牧野フライス製作所	9	10	10,750	
オーエスジー	8	9	22,509	
ダイジェット工業	7	0.700	1,509	
旭ダイヤモンド工業	5	5	7,418	
DMG森精機	11	10	23,209	
ソディック	4	4	6,054	
ディスコ	2	2	64,260	
日東工器	1	1	3,474	
日進工具	-	0.500	1,720	
パンチ工業	-	1	2,027	
豊和工業	2	1	1,689	
OKK	10	1	1,405	
石川製作所	1	0.500	1,485	
東洋機械金属	2	1	1,425	
津田駒工業	8	5	1,325	
島精機製作所	2	2	16,575	
オプトラン	-	1	5,446	
NCホールディングス	1	1	1,395	
フリュー	0.400	1	1,520	
ヤマシンフィルタ	-	2	3,277	
日阪製作所	2	2	3,068	
やまびこ	3	3	6,380	
平田機工	-	0.500	4,890	
ペガサスミシン製造	1	1	1,417	
ナプテスコ	9	10	47,952	
三井海洋開発	1	2	5,716	
レオン自動機	1	1	3,904	
SMC	5	6	283,836	
新川	1	1	1,798	
ホソカワミクロン	3	0.700	5,418	
ユニオンツール	0.800	0.900	3,676	
オイレス工業	2	2	5,967	
日精エー・エス・ビー機械	0.600	0.700	5,229	
サトーホールディングス	2	2	9,204	
技研製作所	-	1	2,837	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日本エアーテック	1	1	1,391	
日精樹脂工業	1	1	2,700	
オカダアイオン	-	0.800	1,328	
小松製作所	85	95	383,374	
住友重機械工業	54	11	49,155	
日立建機	8	9	41,896	
日工	-	0.500	1,248	
巴工業	0.800	0.800	1,556	
井関農機	19	2	4,486	
TOWA	1	1	2,397	
丸山製作所	7	0.800	1,445	
北川鉄工所	0.900	0.900	2,521	
ローツェ	0.700	1	2,337	
タカキタ	-	1	1,342	
クボタ	89	106	210,367	
荏原実業	0.900	0.700	1,467	
三菱化工機	6	0.700	1,562	
月島機械	3	3	5,573	
帝国電機製作所	1	1	2,350	
新東工業	4	4	5,757	
澁谷工業	1	1	7,429	
アイチコーポレーション	2	3	2,478	
小森コーポレーション	4	5	6,870	
鶴見製作所	1	1	3,333	
住友精密工業	3	-	-	
酒井重工業	-	0.400	1,654	
荏原製作所	8	8	32,157	
石井鐵工所	0.200	0.700	1,410	
西島製作所	1	2	2,000	
北越工業	2	2	2,554	
ダイキン工業	24	27	342,630	
オルガノ	4	0.700	2,327	
トーヨーカネツ	9	0.800	2,852	
栗田工業	10	10	34,186	
椿本チエイン	11	12	10,836	
木村化工機	-	2	1,238	
アネスト岩田	3	3	3,636	
ダイフク	8	10	66,458	
サムコ	-	1	1,390	
加藤製作所	1	0.900	2,388	
油研工業	-	0.500	1,507	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
タダノ	9	9	16,310	
フジテック	5	6	8,895	
CKD	5	5	13,909	
キトー	2	1	3,112	
平和	5	6	13,139	
理想科学工業	1	2	4,290	
SANKYO	4	5	19,600	
日本金銭機械	1	1	2,271	
マースエンジニアリング	1	1	3,190	
福島工業	1	1	5,826	
ダイコク電機	0.700	0.900	1,565	
竹内製作所	3	3	8,124	
アマノ	5	6	17,537	
JUKI	2	2	4,721	
サンデンホールディングス	11	2	3,964	
蛇の目マシン工業	1	1	1,380	
マックス	3	3	4,467	
グローリー	5	5	23,718	
新晃工業	1	2	3,924	
大和冷機工業	2	3	3,942	
セガサミーホールディングス	17	19	30,810	
日本ピストンリング	0.700	0.700	1,677	
リケン	0.800	0.900	5,445	
TPR	2	2	6,655	
ツバキ・ナカシマ	2	2	6,170	
ホシザキ	3	6	60,884	
大豊工業	1	1	2,505	
日本精工	36	40	65,242	
NTN	41	45	21,986	
ジェイテクト	18	21	35,701	
不二越	18	18	12,222	
日本トムソン	5	6	4,863	
THK	12	12	56,978	
ユーシン精機	0.800	0.900	3,100	
前澤給装工業	0.800	0.800	1,500	
イーグル工業	1	2	4,687	
日本ピラー工業	1	2	3,432	
キッツ	8	8	7,744	
日立工機	4	-	-	
マキタ	11	25	130,806	
日立造船	14	15	8,792	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
三菱重工業	298	33	145,017	
IHI	136	15	52,744	
スター精密	3	3	6,768	
<b>電気機器(13.8%)</b>				
日清紡ホールディングス	9	12	19,360	
イビデン	12	12	21,465	
コニカミノルタ	41	46	45,147	
ブラザー工業	23	24	62,581	
ミネベアミツミ	32	36	89,350	
日立製作所	426	476	395,175	
東芝	397	-	-	
三菱電機	189	198	362,423	
富士電機	54	60	48,960	
東洋電機製造	0.800	0.800	1,346	
安川電機	20	23	111,780	
シンフォニアテクノロジー	11	13	4,836	
明電舎	16	17	7,021	
オリジン電気	4	0.800	1,521	
山洋電気	5	1	8,310	
デンヨー	1	1	3,292	
東芝テック	11	14	9,156	
芝浦メカトロニクス	5	3	1,446	
マブチモーター	5	5	29,535	
日本電産	23	23	386,869	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	-	0.700	1,901	
東光高岳	0.900	1	1,600	
ダブル・スコープ	1	2	4,448	
ダイヘン	10	11	9,097	
田淵電機	3	-	-	
ヤーマン	0.200	2	4,956	
JVCケンウッド	13	14	5,278	
ミマキエンジニアリング	-	1	1,648	
第一精工	-	0.900	2,571	
日新電機	3	4	4,972	
大崎電気工業	4	4	3,326	
オムロン	18	21	129,343	
日東工業	2	3	5,836	
IDEC	2	2	7,002	
ジーエス・ユアサコーポレーション	34	36	21,276	
サクサホールディングス	5	-	-	
メルコホールディングス	1	1	3,560	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
日本電気	244	25	82,304	
富士通	171	204	130,539	
沖電気工業	7	8	11,616	
岩崎通信機	14	1	1,398	
電気興業	5	1	3,564	
サンケン電気	10	12	10,116	
ナカヨ	3	-	-	
アイホン	1	1	1,888	
ルネサスエレクトロニクス	9	10	11,814	
セイコーエプソン	26	29	61,035	
ワコム	13	15	8,531	
アルバック	3	4	28,474	
E I Z O	1	1	9,126	
ジャパンディスプレイ	33	40	8,791	
日本信号	4	5	5,890	
京三製作所	4	5	3,850	
能美防災	2	2	6,112	
ホーチキ	1	1	2,781	
エレコム	1	1	3,981	
日本無線	1	-	-	
パナソニック	202	226	373,734	
シャープ	-	13	48,369	
アンリツ	12	14	19,008	
富士通ゼネラル	6	6	12,408	
日立国際電気	4	-	-	
ソニー	125	132	700,660	
T D K	10	10	95,992	
帝国通信工業	7	1	1,352	
タムラ製作所	7	7	6,004	
アルプス電気	16	17	47,845	
池上通信機	3	9	1,494	
パイオニア	26	33	6,752	
日本電波工業	1	2	1,416	
鈴木	2	1	1,480	
日本トリム	0.400	0.400	2,336	
ローランド ディー. ジー.	0.900	1	2,675	
フォスター電機	2	2	6,702	
クラリオン	9	10	3,470	
S M K	5	6	2,658	
ヨコオ	1	1	2,888	
ティアック	26	-	-	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
ホシデン	5	5	7,465	
ヒロセ電機	2	3	49,184	
日本航空電子工業	6	5	7,870	
T O A	2	2	3,057	
マクセルホールディングス	2	3	8,307	
古野電気	2	2	1,783	
ユニデンホールディングス	7	5	1,490	
アルパイン	4	4	10,264	
スミダコーポレーション	1	2	3,168	
アイコム	1	1	3,038	
リオン	0.800	0.800	2,316	
本多通信工業	-	1	1,837	
船井電機	2	2	1,536	
横河電機	19	19	43,956	
新元元工業	7	0.700	5,887	
アズビル	5	5	27,818	
東亜ディーケーケー	-	1	1,446	
日本光電工業	7	8	23,845	
チノー	1	0.800	1,326	
共和電業	3	3	1,398	
日本電子材料	2	2	1,420	
堀場製作所	3	3	30,615	
アドバンテスト	12	11	24,002	
小野測器	1	1	1,363	
エスベック	1	1	4,627	
パナソニック デバイスSUNX	1	-	-	
キーエンス	8	9	609,936	
日置電機	0.900	1	3,535	
シスメックス	13	15	134,134	
日本マイクロニクス	3	3	3,753	
メガチップス	1	1	5,920	
O B A R A G R O U P	1	1	7,992	
澤藤電機	6	0.700	1,537	
コーセル	2	2	4,455	
イリソ電子工業	0.600	1	11,560	
新日本無線	-	1	1,398	
オプテックスグループ	1	1	9,104	
千代田インテグレ	0.900	1	2,428	
アイ・オー・データ機器	-	1	1,445	
レーザーテック	2	4	17,507	
スタンレー電気	12	15	62,624	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
岩崎電気	6	0,900	1,486
ウシオ電機	10	12	17,472
岡谷電機産業	3	-	-
ヘリオス テクノ ホールディング	2	1	1,691
日本セラミック	1	2	5,870
遠藤照明	1	1	1,456
古河電池	2	1	1,456
双信電機	4	-	-
山一電機	1	1	2,595
図研	1	1	2,323
日本電子	6	7	5,712
カシオ計算機	14	15	24,168
ファナック	18	18	516,342
日本シイエムケイ	3	3	3,272
エンプラス	0.800	0.900	3,303
大真空	-	1	1,427
ローム	8	8	98,167
浜松ホトニクス	13	14	61,128
三井ハイテック	2	2	5,272
新光電気工業	6	7	6,765
京セラ	29	32	201,630
太陽誘電	8	8	15,744
村田製作所	18	20	313,456
ユーシン	2	3	2,256
双葉電子工業	2	3	7,084
北陸電気工業	-	0.800	1,334
ニチコン	5	6	8,208
日本ケミコン	15	1	4,473
KOA	2	2	6,280
市光工業	4	3	3,453
小糸製作所	10	11	88,060
ミツバ	3	3	4,856
SCREENホールディングス	3	3	35,446
キャノン電子	1	1	4,671
キャノン	95	106	421,785
リコー	53	59	70,387
MUTOHホールディングス	5	0.600	1,506
東京エレクトロン	11	13	267,432
<b>輸送用機器(9.0%)</b>			
トヨタ紡織	6	5	13,403
芦森工業	-	0.600	1,429

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユニプレス	3	3	9,842
豊田自動織機	16	16	108,800
モリタホールディングス	3	3	6,380
三櫻工業	2	2	1,947
デンソー	43	44	274,164
東海理化電機製作所	4	5	11,996
三井造船	64	7	14,256
川崎重工業	138	15	61,677
名村造船所	5	5	3,722
サノヤスホールディングス	4	-	-
日本車輛製造	6	7	2,177
三菱ロジスネクスト	2	2	2,188
近畿車輛	-	0.500	1,372
日産自動車	212	233	261,042
いすゞ自動車	51	57	99,962
トヨタ自動車	215	240	1,755,672
日野自動車	25	28	41,148
三菱自動車工業	65	73	61,205
エフテック	0.900	1	1,697
レシップホールディングス	0.300	0.900	802
GMB	1	-	-
ファルテック	0.900	-	-
武蔵精密工業	2	2	7,927
日産車体	7	7	7,861
新明和工業	7	8	8,135
極東開発工業	3	3	6,175
日信工業	4	4	7,552
トピー工業	1	1	5,136
ティラド	7	0.700	2,772
曙ブレーキ工業	8	9	2,925
タチエス	3	3	6,395
NOK	8	10	24,051
フタバ産業	5	6	5,770
KYB	20	2	11,529
大同メタル工業	2	2	3,302
プレス工業	9	10	6,919
ミクニ	3	2	1,727
カルソニックカンセイ	12	-	-
太平洋工業	3	4	6,002
ケーヒン	4	4	9,793
河西工業	2	2	3,489

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
アイシン精機	16	16	100,734	
マツダ	56	62	93,362	
今仙電機製作所	1	1	2,176	
本田技研工業	159	178	674,865	
スズキ	35	39	234,070	
S U B A R U	55	61	229,887	
安永	0.700	1	2,541	
ヤマハ発動機	25	28	96,040	
ショーワ	4	5	7,527	
T B K	2	2	1,406	
エクセディ	2	2	8,184	
豊田合成	5	7	18,684	
愛三工業	3	3	4,343	
盟和産業	-	1	1,362	
ヨロズ	1	2	3,730	
エフ・シー・シー	2	3	9,680	
シマノ	7	8	124,400	
タカタ	3	-	-	
テイ・エス テック	4	4	19,274	
ジャムコ	1	1	2,393	
<b>精密機器(1.6%)</b>				
テルモ	27	30	167,200	
クリエートメディック	-	1	1,389	
日機装	6	6	8,445	
島津製作所	22	23	63,279	
J M S	4	0.100	62	
長野計器	1	1	1,960	
ブイ・テクノロジー	0.400	0.500	11,895	
東京計器	6	1	1,558	
オーバル	3	4	1,430	
東京精密	3	3	15,786	
マニー	2	2	9,468	
ニコン	31	34	73,968	
トプコン	8	10	25,143	
オリンパス	28	29	124,342	
理研計器	1	1	4,235	
タムロン	1	1	3,963	
H O Y A	36	40	222,818	
シード	-	0.300	1,411	
ノーリツ鋼機	1	2	4,408	
エー・アンド・デイ	2	2	1,383	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
シチズン時計	19	23	19,753	
リズム時計工業	7	0.800	1,788	
大研医器	1	1	1,421	
メニコン	1	2	6,893	
松風	0.900	1	1,441	
セイコーホールディングス	13	3	8,962	
ニプロ	12	13	21,577	
<b>その他製品(2.2%)</b>				
スノーピーク	0.400	1	1,432	
パラマウントベッドホールディングス	1	2	12,096	
S H O - B I	2	3	1,490	
ニホンフラッシュ	0.900	0.900	2,331	
前田工織	1	2	4,010	
永大産業	-	3	1,710	
アートネイチャー	1	2	1,581	
ダンロップスポーツ	1	-	-	
バンダイナムコホールディングス	19	20	73,185	
共立印刷	3	-	-	
S H O E I	0.800	0.900	4,104	
フランスベッドホールディングス	2	2	2,389	
パイロットコーポレーション	3	3	19,320	
萩原工業	0.500	1	1,962	
トッパン・フォームズ	3	4	5,132	
フジシールインターナショナル	4	4	15,576	
タカラトミー	6	8	9,271	
廣済堂	3	2	1,406	
A s - m e エステール	1	-	-	
アーク	9	11	1,423	
タカノ	1	1	1,452	
プロネクサス	1	1	2,500	
ホクシン	5	7	1,401	
ウッドワン	-	1	1,458	
大建工業	1	1	3,963	
凸版印刷	50	56	52,696	
大日本印刷	51	25	59,259	
図書印刷	3	1	1,440	
共同印刷	5	0.600	1,908	
N I S S H A	3	4	11,713	
光村印刷	5	-	-	
宝印刷	0.900	1	1,848	
アシックス	17	19	33,233	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ツツミ	0.700	0.700	1,493
小松ウオール工業	0.600	0.700	1,760
ヤマハ	12	13	62,842
河合楽器製作所	0.700	0.700	2,723
フリナップ	2	1	1,515
ピジョン	10	12	52,860
キングジム	1	1	1,595
リンテック	4	4	14,382
イトーキ	3	4	2,952
任天堂	10	12	572,912
三菱鉛筆	1	3	8,200
タカラスタンダード	3	4	7,531
コクヨ	9	9	18,306
グローブライド	0.900	0.900	2,093
岡村製作所	6	6	10,018
美津濃	10	2	6,390
<b>電気・ガス業(1.5%)</b>			
東京電力ホールディングス	150	158	65,969
中部電力	58	60	85,597
関西電力	72	80	106,494
中国電力	24	27	34,140
北陸電力	17	19	16,334
東北電力	44	46	64,681
四国電力	16	17	21,787
九州電力	39	43	53,917
北海道電力	16	19	13,134
沖縄電力	2	3	9,225
電源開発	14	15	43,718
エフオン	1	1	1,282
イーレックス	0.700	3	2,501
東京瓦斯	190	42	115,077
大阪瓦斯	172	38	83,808
東邦瓦斯	45	9	32,389
北海道瓦斯	4	5	1,495
広島ガス	3	4	1,619
西部瓦斯	20	2	6,739
静岡ガス	5	5	5,084
メタウォーター	1	1	3,410
<b>陸運業(4.0%)</b>			
SBSホールディングス	1	2	2,538
東武鉄道	95	21	70,914

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
相鉄ホールディングス	28	6	18,144
東京急行電鉄	96	53	93,558
京浜急行電鉄	49	27	53,901
小田急電鉄	28	29	66,493
京王電鉄	50	11	54,001
京成電鉄	13	13	48,921
富士急行	5	2	7,603
新京成電鉄	1	0.300	674
東日本旅客鉄道	34	35	369,350
西日本旅客鉄道	17	17	136,057
東海旅客鉄道	14	17	355,947
西武ホールディングス	24	25	47,918
鴻池運輸	2	2	5,320
西日本鉄道	21	5	16,065
ハマキョウレックス	1	1	4,627
サカイ引越センター	0.600	1	5,320
近鉄グループホールディングス	179	18	79,054
阪急阪神ホールディングス	22	25	100,000
南海電気鉄道	38	8	24,804
京阪ホールディングス	40	8	28,602
神戸電鉄	4	0.400	1,582
名古屋鉄道	65	14	40,515
山陽電気鉄道	6	1	3,906
日本通運	69	7	53,354
ヤマトホールディングス	31	32	90,096
山九	23	4	25,008
丸運	-	4	1,432
丸全昭和運輸	6	7	3,577
センコーグループホールディングス	8	11	8,158
トナミホールディングス	4	0.500	2,555
ニッコンホールディングス	6	7	19,091
福山通運	11	2	12,312
セイノーホールディングス	12	14	25,069
神奈川中央交通	2	0.500	1,857
日立物流	3	4	10,639
丸和運輸機関	0.400	1	3,645
C&Fロジホールディングス	1	2	3,160
九州旅客鉄道	13	15	52,438
SGホールディングス	-	13	30,590
<b>海運業(0.2%)</b>			
日本郵船	151	15	36,910

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
商船三井	94	11	40,222	
川崎汽船	68	8	23,142	
N S ユナイテッド海運	8	0.900	2,037	
飯野海運	9	9	5,395	
乾汽船	1	1	1,405	
<b>空運業(0.6%)</b>				
日本航空	32	34	139,930	
ANAホールディングス	330	36	158,350	
パスコ	1	2	680	
<b>倉庫・運輸関連業(0.2%)</b>				
トランコム	0.500	0.500	3,490	
日新	7	1	4,467	
三菱倉庫	12	6	16,614	
三井倉庫ホールディングス	10	11	3,894	
住友倉庫	13	13	9,555	
澁澤倉庫	5	1	1,914	
東陽倉庫	—	4	1,440	
日本トランスシティ	4	5	2,200	
ケイヒン	8	0.800	1,384	
中央倉庫	1	1	1,439	
安田倉庫	1	1	1,625	
東洋埠頭	2	0.800	1,408	
宇徳	2	3	1,449	
上組	21	11	28,001	
キムラユニティー	—	1	1,465	
キューソー流通システム	0.600	0.500	1,279	
郵船ロジスティクス	1	—	—	
近鉄エクスプレス	3	3	7,311	
エーアイティー	1	1	1,504	
内外トランスライン	1	—	—	
日本コンセプト	—	0.300	461	
<b>情報・通信業(7.2%)</b>				
N E C ネットズエスアイ	1	2	5,722	
システナ	1	1	7,088	
デジタルアーツ	0.800	1	3,705	
新日鉄住金ソリューションズ	2	3	9,045	
コア	1	1	1,319	
ソフトクリエイトホールディングス	—	0.900	1,358	
T I S	5	6	24,927	
電算システム	—	0.700	1,347	
グリー	10	10	6,916	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
コーエーテックホールディングス	4	3	7,385	
三菱総合研究所	0.700	0.800	2,748	
ボルテージ	1	1	1,513	
電算	0.500	0.600	1,532	
A G S	0.900	—	—	
ファインデックス	1	2	1,442	
ヒト・コミュニケーションズ	0.800	0.700	1,320	
K L a b	3	3	6,099	
ポルトワイン・ビートルホールディングス	1	1	3,246	
ネクソン	19	21	82,568	
アイスタイル	2	4	7,350	
エムアップ	2	1	1,474	
エイチーム	1	1	3,437	
テクノスジャパン	1	1	1,699	
コロプラ	4	6	6,249	
モバイルクリエイト	—	3	1,423	
ブロードリーフ	4	4	6,134	
ハーツユナイテッドグループ	0.900	1	1,562	
メディアドゥホールディングス	0.500	0.700	1,391	
ブイキューブ	1	—	—	
サイバーリンクス	1	1	1,458	
フィックスターズ	—	0.400	2,892	
VOYAGE GROUP	—	1	1,376	
オプティム	0.200	0.600	1,436	
ティーガイア	1	1	5,646	
豆蔵ホールディングス	1	1	1,702	
テクマトリックス	0.600	1	2,043	
ガホー・オンライン・エンターテイメント	36	52	19,235	
GMOペイメントゲートウェイ	1	1	12,810	
ザップパラス	2	3	1,404	
インターネットイニシアティブ	2	3	7,478	
さくらインターネット	1	2	1,757	
GMOクラウド	—	0.600	1,404	
S R Aホールディングス	0.900	1	3,360	
朝日ネット	2	2	1,406	
フリービット	—	1	1,368	
コムチュア	0.400	1	3,470	
サイバーコム	—	1	1,450	
メディカル・データ・ビジョン	—	0.700	1,907	
g u m i	1	2	2,393	
モバイルファクトリー	—	1	1,400	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
P C Iホールディングス	－	0.400	1,280	
パイプドHD	1	1	1,380	
オープンドア	－	0.800	1,707	
アカツキ	－	0.400	2,492	
L I N E	2	5	26,196	
シンクロ・フード	－	0.300	1,434	
AOI TYO HOLDINGS	1	1	2,033	
マクロミル	－	1	5,292	
野村総合研究所	13	13	60,775	
サイバネットシステム	1	1	1,436	
C Eホールディングス	1	1	1,424	
インテジホールディングス	1	2	2,637	
東邦システムサイエンス	1	1	1,375	
ソースネクスト	－	2	1,863	
フォーカスシステムズ	2	1	1,398	
クレスコ	0.500	0.400	1,512	
フジ・メディア・ホールディングス	18	20	37,740	
オービック	6	6	52,277	
ジャストシステム	2	3	7,737	
TDCソフト	1	1	1,381	
ヤフー	125	140	73,464	
トレンドマイクロ	9	9	57,095	
日本オラクル	2	3	26,133	
アルファシステムズ	0.600	0.600	1,433	
フューチャー	2	2	3,281	
CAC Holdings	1	1	1,677	
ソフトバンク・テクノロジー	0.400	0.800	1,556	
トーセ	1	0.700	1,383	
オービックビジネスコンサルタント	0.900	1	6,350	
伊藤忠テクノソリューションズ	4	4	18,458	
アイティフォー	2	2	1,780	
東計電算	－	0.400	1,330	
エックスネット	－	1	1,417	
大塚商会	4	5	55,970	
サイボウズ	2	2	1,411	
電通国際情報サービス	1	1	3,330	
デジタルガレージ	2	3	11,130	
イーエムシステムズ	0.700	0.700	1,740	
ウェザーニューズ	0.600	0.700	2,292	
C I J	2	2	1,402	
東洋ビジネスエンジニアリング	0.800	0.800	1,392	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
日本エンタープライズ	4	6	1,401	
WOWOW	0.800	0.900	3,100	
スカラ	1	1	1,451	
イマジカ・ロボット ホールディングス	1	1	1,843	
ネットワンシステムズ	7	7	12,513	
アルゴグラフィックス	0.800	0.900	3,123	
マーベラス	3	3	3,055	
エイベックス	3	3	5,914	
日本ユニシス	4	5	11,853	
兼松エレクトロニクス	1	1	3,732	
東京放送ホールディングス	11	11	27,506	
日本テレビホールディングス	16	17	36,569	
朝日放送	1	1	1,704	
テレビ朝日ホールディングス	4	5	11,829	
スカパーJSATホールディングス	11	14	7,266	
テレビ東京ホールディングス	1	1	4,283	
日本BS放送	－	1	1,356	
ビジョン	－	0.500	1,408	
USEN-NEXT HOLDINGS	1	1	1,384	
ワイヤレスゲート	0.700	1	1,454	
コネクシオ	1	1	3,274	
日本通信	14	17	2,030	
日本電信電話	140	139	668,902	
KDDI	173	175	462,176	
光通信	2	2	35,719	
NTTドコモ	131	143	393,278	
エムティーアイ	2	2	1,638	
GMOインターネット	6	7	13,724	
カドカワ	5	5	6,805	
学研ホールディングス	6	0.700	3,640	
ゼンリン	2	2	7,866	
昭文社	1	1	1,389	
インプレスホールディングス	8	6	1,464	
アイネット	1	1	1,740	
松竹	12	1	19,799	
東宝	11	12	45,312	
東映	7	0.700	7,777	
エヌ・ティ・ティ・データ	10	60	66,802	
ビジネスブレイン太田昭和	－	0.800	1,530	
D T S	1	2	7,590	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6	9	39,375	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	千株	千円
		千株	千株	千円
シーイーシー	1	1	1	3,804
カプコン	4	4	4	18,270
アイ・エス・ビー	-	1	1	1,483
ジャステック	1	1	1	1,382
S C S K	4	4	4	19,237
日本システムウエア	0.800	0.600	0.600	1,549
アイネス	2	2	2	2,705
T K C	1	1	1	8,154
富士ソフト	2	2	2	10,570
N S D	3	3	3	6,870
コナミホールディングス	7	7	7	44,477
福井コンピュータホールディングス	0.500	0.600	0.600	1,468
J B C Cホールディングス	1	1	1	1,603
ミロク情報サービス	1	1	1	5,355
ソフトバンクグループ	78	88	88	785,136
<b>卸売業(4.8%)</b>				
高千穂交易	1	1	1	1,466
伊藤忠食品	0.400	0.500	0.500	2,965
エレマテック	0.700	0.900	0.900	2,101
J A L U X	0.600	0.600	0.600	1,851
あらた	0.800	1	1	4,955
トーメンデバイス	0.600	0.500	0.500	1,424
東京エレクトロン デバイス	0.800	0.700	0.700	1,491
フィールズ	1	1	1	1,792
双日	103	115	115	39,963
アルフレッサ ホールディングス	20	21	21	51,472
横浜冷凍	4	4	4	5,231
ラサ商事	2	1	1	1,414
アルコニックス	1	2	2	5,170
神戸物産	0.900	1	1	5,596
ペッパーフードサービス	-	1	1	4,630
あい ホールディングス	3	3	3	9,346
ディーブイエックス	-	1	1	1,369
ダイワボウホールディングス	15	1	1	7,378
マクニカ・富士エレホールディングス	3	3	3	10,490
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3	3	3	3,781
八洲電機	1	1	1	1,380
U K Cホールディングス	1	1	1	2,984
ジュテックホールディングス	-	1	1	1,410
大光	-	1	1	1,378
O C H Iホールディングス	0.900	1	1	1,432

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	千株	千円
		千株	千株	千円
TOKAIホールディングス	7	10	10	11,783
三洋貿易	1	1	1	2,611
ビューティガレージ	-	0.600	0.600	1,330
ウイン・パートナーズ	1	1	1	2,326
シップヘルスケアホールディングス	3	4	4	15,231
コメダホールディングス	2	3	3	7,840
富士興産	2	2	2	1,372
協栄産業	8	0.700	0.700	1,395
小野建	1	1	1	3,330
佐鳥電機	1	1	1	1,540
エコートレーディング	1	1	1	1,409
伯東	1	1	1	1,942
コンドーテック	1	1	1	1,483
ナガイレーベン	2	2	2	7,207
三菱食品	1	2	2	6,604
松田産業	1	1	1	2,718
第一興商	2	2	2	16,008
メディバルホールディングス	17	19	19	42,061
萩原電気	0.600	0.700	0.700	2,387
アズワン	1	1	1	10,440
尾家産業	1	1	1	1,419
シモジマ	1	1	1	1,362
ドウシシャ	2	2	2	5,040
小津産業	-	0.600	0.600	1,342
高速	1	1	1	1,454
黒田電気	2	-	-	-
丸文	1	1	1	1,762
ハピネット	1	1	1	2,207
橋本総業ホールディングス	0.800	0.800	0.800	1,492
日本ライフライン	1	5	5	19,656
エクセル	0.800	0.800	0.800	2,215
マルカキカイ	-	0.700	0.700	1,491
I DOM	4	5	5	4,248
日本エム・ディ・エム	1	1	1	1,337
進和	1	1	1	2,748
エスケイジャパン	4	-	-	-
ダイトロン	-	0.900	0.900	2,145
シークス	1	1	1	5,652
田中商事	1	1	1	1,425
オーハシテクニカ	1	1	1	2,024
白銅	0.800	0.700	0.700	1,687

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
伊藤忠商事	128	143	295,421	
丸紅	172	160	130,004	
長瀬産業	10	11	22,007	
蝶理	1	1	2,287	
豊田通商	19	21	88,399	
三共生興	2	3	1,706	
兼松	37	8	11,835	
三井物産	158	165	323,558	
日本紙パルプ商事	9	1	4,330	
日立ハイテクノロジーズ	6	6	34,816	
カメイ	2	2	4,097	
東都水産	0.300	0.700	1,390	
OUGホールディングス	-	0.500	1,339	
スターゼン	0.700	0.800	4,184	
山善	6	7	9,180	
椿本興業	-	0.400	1,322	
住友商事	110	123	224,288	
内田洋行	0.900	0.900	2,862	
三菱商事	131	136	418,092	
第一実業	4	0.900	2,929	
キャノンマーケティングジャパン	5	5	16,447	
西華産業	6	1	3,174	
佐藤商事	1	1	1,961	
菱洋エレクトロ	1	1	3,384	
東京産業	2	2	1,425	
ユアサ商事	1	1	7,172	
神鋼商事	0.500	0.400	1,468	
小林産業	4	4	1,408	
阪和興業	18	3	18,036	
正栄食品工業	-	1	4,411	
カナデン	1	1	2,591	
菱電商事	3	1	2,588	
フルサト工業	1	1	1,967	
岩谷産業	19	4	17,522	
すてきなイスグループ	8	1	1,450	
昭光通商	12	12	1,488	
極東貿易	-	3	1,374	
イワキ	-	3	1,251	
三愛石油	4	5	7,815	
稲畑産業	4	4	7,364	
明和産業	3	2	1,405	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
ワキタ	3	4	5,254	
東邦ホールディングス	5	5	14,610	
サンゲツ	6	6	14,869	
ミツウロコグループホールディングス	2	2	2,144	
シナネンホールディングス	0.800	0.900	2,416	
伊藤忠エネクス	3	4	4,360	
サンリオ	5	5	10,802	
サンワ テクノス	1	1	2,613	
リョーサン	2	2	9,812	
新光商事	1	2	4,046	
トーホー	0.800	0.900	2,239	
三信電気	1	1	3,421	
東陽テクニカ	2	2	2,136	
モスフードサービス	2	2	8,398	
加賀電子	1	1	4,953	
ソーダニッカ	2	2	1,386	
立花エレテック	1	1	2,852	
PALTA C	2	2	13,959	
三谷産業	3	3	1,411	
西本Wismettacホールディングス	-	0.400	1,672	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	-	0.900	1,350	
ヤマタネ	0.900	1	1,987	
丸紅建材リース	-	6	1,404	
日鉄住金物産	1	1	9,165	
泉州電業	-	0.600	1,717	
トラスコ中山	4	4	11,652	
オートバックスセブン	6	7	16,325	
モリト	-	1	1,544	
加藤産業	2	3	11,625	
イノテック	2	1	2,177	
イエローハット	1	1	5,976	
J Kホールディングス	2	2	1,788	
日伝	0.700	1	3,464	
北沢産業	6	5	1,430	
杉本商事	1	1	2,032	
因幡電機産業	2	2	13,000	
パイテックホールディングス	1	0.900	1,519	
東テク	-	0.600	1,441	
ミスミグループ本社	19	22	71,505	
タキヒヨー	3	0.600	1,384	
蔵王産業	-	0.800	1,492	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	千株	千円
		千株	千株	千円
スズケン	8		8	38,492
ジェコス	1		1	1,609
ルネサスイーストン	2		1	1,404
<b>小売業(4.7%)</b>				
ローソン	6		4	35,868
サンエー	1		1	8,340
カワチ薬品	1		1	3,870
エービーシー・マート	3		3	24,804
ハードオフコーポレーション	-		1	1,392
アスクル	2		1	6,749
ゲオホールディングス	2		3	7,200
アダストリア	2		3	6,705
ジーフット	-		1	1,438
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	-		1	1,390
くらコーポレーション	1		1	6,941
キャンドゥ	0.900		0.900	1,580
パルグループホールディングス	0.900		1	3,105
エディオン	6		7	10,092
サーラコーポレーション	2		3	2,308
ワッツ	1		-	-
ハローズ	0.600		0.700	1,772
あみやき亭	0.400		0.400	2,116
ひらまつ	2		2	1,522
ゲンキー	0.400		-	-
大黒天物産	0.400		0.500	2,650
ハニーズホールディングス	1		1	1,926
ファーマライズホールディングス	2		2	1,428
アルペン	1		1	3,748
クオール	2		2	5,066
ジンズ	1		1	6,968
ビックカメラ	10		11	18,678
DCMホールディングス	10		10	11,340
Monotaro	6		6	24,771
DDホールディングス	0.900		0.400	1,432
きちり	1		1	1,417
アークランドサービスホールディングス	0.500		1	3,595
J.フロント リテイリング	22		23	45,691
ドトール・日レスホールディングス	3		3	8,707
マツモトキョシホールディングス	3		8	35,964
ブロンコビリー	0.900		1	3,300
スタートトゥデイ	16		19	58,368

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	千株	千円
		千株	千株	千円
物語コーポレーション	0.500		0.600	5,736
ココカラファイン	1		2	14,120
三越伊勢丹ホールディングス	34		36	46,172
Hamee	-		0.700	1,355
ウエルシアホールディングス	1		5	24,726
クリエイトSDホールディングス	2		2	7,882
チムニー	0.500		0.600	1,735
シュッピン	-		1	1,482
ネクステージ	-		2	2,284
ジョイフル本田	2		2	10,077
鳥貴族	0.500		0.700	2,058
キリン堂ホールディングス	1		0.700	1,312
ホットランド	1		1	1,453
すかいらく	7		12	17,980
綿半ホールディングス	0.800		0.700	2,716
ヨシックス	0.900		-	-
11イテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5		6	7,286
ブックオフコーポレーション	1		1	1,433
あさひ	1		1	1,981
日本調剤	0.600		0.700	2,422
コスモス薬品	0.900		1	19,950
セブン&アイ・ホールディングス	73		81	368,100
薬王堂	0.900		0.800	2,784
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4		5	6,526
ツルハホールディングス	4		4	65,142
サンマルクホールディングス	1		1	4,438
フェリシモ	-		1	1,393
トリドールホールディングス	2		2	8,436
TOKYO BASE	-		0.400	1,706
サツドラホールディングス	-		0.700	1,390
パロックジャパンリミテッド	1		1	1,448
スリのアオキホールディングス	1		1	9,105
スノーグローバルホールディングス	-		1	8,683
LIXILビバ	-		1	4,062
メディカルシステムネットワーク	2		2	1,396
総合メディカル	0.800		0.800	4,800
はるやまホールディングス	1		-	-
ノジマ	2		3	8,683
カップパ・クリエイト	2		2	3,060
ライトオン	1		1	1,473
ジーンズメイト	4		-	-

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
良品計画	2	2	2	93,080
三城ホールディングス	2	0.800	0.800	420
アドヴァン	1	2	2	2,202
アルビス	0.500	0.400	0.400	1,206
コナカ	2	2	2	1,490
ハウス オブ ローゼ	0.800	0.800	0.800	1,412
G-7ホールディングス	-	0.600	0.600	1,445
イオン北海道	2	2	2	1,646
コジマ	-	4	4	1,412
ヒマラヤ	1	1	1	1,398
コーナン商事	2	2	2	7,159
エコス	1	1	1	1,432
ワタミ	2	2	2	3,003
マルシェ	1	1	1	1,388
ドンキホーテホールディングス	11	12	12	74,466
西松屋チェーン	3	4	4	5,353
ゼンショーホールディングス	9	10	10	22,603
幸楽苑ホールディングス	1	1	1	2,241
サイゼリヤ	2	2	2	9,019
V Tホールディングス	5	6	6	3,656
魚力	0.900	1	1	1,417
ユナイテッドアローズ	2	2	2	10,044
ハイデイ日高	1	2	2	6,940
京都きもの友禅	1	1	1	1,418
コロナイド	5	6	6	15,931
ピーシーデポコーポレーション	2	2	2	2,169
壱番屋	1	1	1	6,342
トップカルチャー	2	2	2	1,415
P L A N T	1	1	1	1,383
スギホールディングス	3	4	4	24,897
スクロール	3	3	3	1,401
ヨンドシーホールディングス	1	2	2	5,386
エニ・ファミリーマートホールディングス	7	6	6	48,732
木曽路	2	2	2	6,561
S R Sホールディングス	2	2	2	2,187
千趣会	3	3	3	2,142
タカキュー	-	6	6	1,419
ケーヨー	3	3	3	2,253
上新電機	4	2	2	8,763
日本瓦斯	3	3	3	16,218
ロイヤルホールディングス	2	3	3	9,887

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
東天紅	7	0.700	0.700	1,320
いなげや	1	2	2	3,975
島忠	4	4	4	16,497
チヨダ	2	2	2	6,366
ライフコーポレーション	1	1	1	4,353
リンガーハット	2	2	2	5,889
MrMa x HD	-	2	2	1,843
テンアライド	3	2	2	1,392
AOKIホールディングス	3	3	3	6,532
オークワ	2	3	3	3,264
コメリ	2	3	3	9,060
青山商事	3	3	3	16,391
しまむら	2	2	2	30,176
はせがわ	2	2	2	1,415
高島屋	29	31	31	34,348
松屋	3	3	3	6,048
イチ・ツー・オー リテイリング	9	9	9	19,439
近鉄百貨店	7	0.700	0.700	2,772
パルコ	1	1	1	2,812
丸井グループ	18	18	18	37,736
アクシアル リテイリング	1	1	1	6,856
イオン	72	75	75	141,375
イズミ	3	3	3	25,200
平和堂	3	4	4	9,616
フジ	1	2	2	5,188
ヤオコー	2	2	2	13,134
ゼビオホールディングス	2	2	2	5,848
ケーズホールディングス	8	8	8	24,775
Olympicグループ	1	2	2	1,428
Genky DrugStores	-	0.800	0.800	2,704
アインホールディングス	2	2	2	17,108
元気寿司	0.600	0.500	0.500	1,384
ヤマダ電機	58	65	65	44,472
アーケランドサカモト	3	3	3	5,933
ニトリホールディングス	7	7	7	135,712
グルメ杵屋	1	1	1	1,158
愛眼	6	2	2	1,415
ケーヨーホールディングス	1	-	-	-
吉野家ホールディングス	6	6	6	12,550
松屋フーズ	0.800	0.900	0.900	3,487
サガミチェーン	2	2	2	3,624

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
関西スーパーマーケット	1	1	1,713	
王将フードサービス	1	1	7,042	
プレナス	2	2	4,686	
ミニストップ	1	1	3,074	
アークス	3	3	9,849	
パローホールディングス	3	4	13,500	
藤久	0.700	0.800	1,341	
ベルク	0.800	0.900	5,571	
大 庄	0.900	1	1,728	
ファーストリテイリング	2	3	140,943	
サンドラッグ	3	8	40,711	
サックスパー ホールディングス	1	1	2,077	
やまや	0.700	-	-	
ベルーナ	4	4	6,168	
<b>銀行業(7.4%)</b>				
島根銀行	0.900	1	1,412	
じもとホールディングス	12	13	2,468	
めぶきフィナンシャルグループ	84	101	45,269	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	2	2	7,308	
九州フィナンシャルグループ	28	32	19,902	
ゆうちょ銀行	49	55	81,271	
富山第一銀行	4	5	2,540	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	114	118	73,299	
西日本フィナンシャルホールディングス	11	13	17,768	
新生銀行	167	16	29,422	
あおぞら銀行	111	11	52,026	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,328	1,380	1,083,140	
りそなホールディングス	205	214	134,192	
三井住友トラスト・ホールディングス	36	38	169,420	
三井住友フィナンシャルグループ	140	147	705,926	
第四銀行	21	2	11,856	
北越銀行	1	2	4,830	
千葉銀行	68	70	62,930	
群馬銀行	39	39	26,321	
武蔵野銀行	2	3	11,129	
千葉興業銀行	4	5	2,700	
筑波銀行	7	8	3,013	
七十七銀行	27	6	16,585	
青森銀行	14	1	5,115	
秋田銀行	11	1	3,799	
山形銀行	10	2	5,297	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
岩手銀行	1	1	6,013	
東邦銀行	16	17	6,965	
東北銀行	9	1	1,478	
みちのく銀行	9	1	2,349	
ふくおかフィナンシャルグループ	71	79	45,267	
静岡銀行	48	52	57,512	
十六銀行	24	2	7,638	
スルガ銀行	17	20	38,760	
八十二銀行	33	35	22,797	
山梨中央銀行	11	12	5,256	
大垣共立銀行	23	3	8,735	
福井銀行	15	1	4,464	
北國銀行	19	2	9,515	
清水銀行	0.600	0.700	2,103	
富山銀行	0.300	0.400	1,596	
滋賀銀行	16	18	10,116	
南都銀行	1	2	6,980	
百五銀行	16	18	9,964	
京都銀行	31	7	45,225	
紀陽銀行	6	7	13,179	
三重銀行	0.800	0.900	2,139	
ほくほくフィナンシャルグループ	11	13	20,371	
広島銀行	52	28	24,508	
山陰合同銀行	10	11	11,982	
中国銀行	12	13	18,360	
鳥取銀行	0.600	0.800	1,406	
伊予銀行	18	27	24,356	
百十四銀行	19	21	7,476	
四国銀行	14	3	4,644	
阿波銀行	15	16	10,608	
大分銀行	10	1	4,576	
宮崎銀行	12	1	4,569	
佐賀銀行	11	1	3,055	
十八銀行	11	12	3,396	
沖縄銀行	1	1	8,360	
琉球銀行	3	3	6,194	
セブン銀行	65	73	27,634	
みずほフィナンシャルグループ	2,380	2,655	535,248	
山口フィナンシャルグループ	17	19	24,415	
長野銀行	0.700	0.700	1,324	
名古屋銀行	1	1	6,456	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
北洋銀行	28	29	10,944	
愛知銀行	0.600	0.700	3,794	
第三銀行	1	1	1,837	
中京銀行	0.700	0.900	2,093	
大光銀行	6	0.700	1,677	
愛媛銀行	2	2	3,472	
みなと銀行	1	1	3,769	
京葉銀行	14	17	8,432	
関西アーバン銀行	2	2	3,836	
栃木銀行	9	10	4,312	
北日本銀行	0.500	0.600	1,830	
東和銀行	33	3	4,678	
福島銀行	19	1	1,452	
大東銀行	9	-	-	
トモニホールディングス	14	16	7,824	
フィデアホールディングス	17	19	3,781	
池田泉州ホールディングス	18	20	8,756	
<b>証券、商品先物取引業(1.0%)</b>				
F P G	6	6	9,737	
S B Iホールディングス	19	22	55,669	
ジャフコ	2	2	15,204	
大和証券グループ本社	164	167	121,041	
野村ホールディングス	358	336	223,741	
岡三証券グループ	15	17	11,849	
丸三証券	5	6	6,479	
東洋証券	6	7	2,177	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20	21	16,999	
光世証券	7	1	1,429	
水戸証券	5	6	2,391	
いちよし証券	3	4	5,301	
松井証券	10	9	10,416	
だいちこう証券ビジネス	2	2	1,402	
マネックスグループ	18	20	8,031	
カブドットコム証券	13	12	4,762	
極東証券	2	2	4,074	
岩井コスモホールディングス	1	2	2,768	
藍澤証券	3	3	2,963	
マネーパートナーズグループ	1	1	700	
<b>保険業(2.2%)</b>				
かんぽ生命保険	6	7	20,623	
S O M P Oホールディングス	36	38	159,059	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
アニコム ホールディングス	1	1	4,942	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	52	51	173,586	
ソニーフィナンシャルホールディングス	16	16	31,781	
第一生命ホールディングス	105	110	242,437	
東京海上ホールディングス	71	73	370,796	
T & Dホールディングス	63	60	109,112	
アドバンスクリエイト	0.500	0.700	1,382	
<b>その他金融業(1.2%)</b>				
全国保証	4	5	26,880	
アルヒ	-	1	2,470	
クレディセゾン	13	14	27,764	
アクリーティブ	2	4	1,396	
芙蓉総合リース	2	2	15,950	
興銀リース	3	3	10,308	
東京センチュリー	3	3	23,946	
日本証券金融	7	8	5,328	
アイフル	29	32	12,332	
ポケットカード	1	-	-	
リコーリース	1	1	5,377	
イオンフィナンシャルサービス	11	13	34,736	
アコム	35	39	18,706	
ジャックス	10	2	6,105	
オリエントコーポレーション	37	42	7,317	
日立キャピタル	4	5	15,400	
アプラスフィナンシャル	10	13	1,412	
オリックス	124	130	249,394	
三菱UFJリース	44	49	33,579	
日本取引所グループ	54	57	107,567	
イー・ギャランティ	0.500	0.500	1,902	
NECキャピタルソリューション	0.700	0.800	1,712	
<b>不動産業(2.4%)</b>				
いちご	16	27	12,778	
日本駐車場開発	21	23	4,347	
ヒューリック	36	40	49,939	
三栄建築設計	-	0.800	1,733	
スター・マイカ	-	0.700	1,318	
野村不動産ホールディングス	11	13	34,060	
三重交通グループホールディングス	3	4	2,080	
サムティ	1	1	3,204	
日本商業開発	1	1	2,097	
プレサンスコーポレーション	2	2	4,473	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユニゾホールディングス	1	2	6,900
THEグローバル社	2	1	1,410
日本管理センター	1	1	2,298
サンセイランディック	1	1	1,432
フージャースホールディングス	2	4	3,647
オープンハウス	2	3	21,440
東急不動産ホールディングス	42	47	38,265
飯田グループホールディングス	14	16	32,534
ムゲンエステート	-	1	1,586
ハウスドゥ	-	0.500	1,387
シーアールイー	0.800	0.900	1,484
ケイアイスター不動産	-	0.700	1,943
パーク24	8	10	28,101
パラカ	0.600	0.600	1,455
三井不動産	93	97	253,320
三菱地所	130	145	276,696
平和不動産	3	3	6,834
東京建物	20	21	37,171
ダイビル	4	5	6,725
京阪神ビルディング	2	3	2,790
住友不動産	42	47	185,180
大京	33	3	6,925
テーオーシー	6	6	5,695
東京楽天地	3	0.300	1,548
レオパレス21	22	23	19,106
スターツコーポレーション	1	2	7,765
フジ住宅	2	2	2,202
空港施設	2	2	1,397
明和地所	1	1	1,400
住友不動産販売	1	-	-
ゴールドクレスト	1	1	3,352
日本エスリード	0.900	0.800	1,760
日神不動産	2	2	2,106
日本エスコン	-	3	3,402
タカラレーベン	7	9	4,397
サンヨーハウジング名古屋	1	1	1,361
イオンモール	11	12	28,009
ファースト住建	0.800	0.800	1,408
カチタス	-	2	6,400
トーセイ	2	2	3,208
穴吹興産	0.500	-	-

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エヌ・ティ・ティ都市開発	10	12	15,972
サンフロンティア不動産	1	2	2,954
エフ・ジェー・ネクスト	-	1	1,417
ランドビジネス	4	4	1,423
グランディハウス	2	2	1,403
日本空港ビルデング	5	5	23,028
<b>サービス業(4.3%)</b>			
日本工営	1	1	3,809
LIFULL	4	6	6,982
ジェイエイシーリクルートメント	1	1	3,241
日本M&Aセンター	5	6	43,550
メンバーズ	-	1	1,433
タケエイ	1	2	2,554
トラスト・テック	0.800	0.800	2,520
コシダカホールディングス	0.600	1	6,690
パソナグループ	1	1	4,267
CDS	-	1	1,464
リングアンドモチベーション	4	3	3,650
GCA	1	2	2,125
エス・エム・エス	2	3	16,335
パーソルホールディングス	14	17	48,562
リニカル	1	1	1,683
クックパッド	4	5	3,599
アイ・ケイ・ケイ	1	1	1,404
学情	1	0.900	1,440
スタジオアリス	0.800	1	2,713
シミックホールディングス	0.900	1	2,718
NJS	0.900	0.900	1,470
総合警備保障	6	7	39,225
カカクコム	13	14	28,710
アイロムグループ	-	0.600	1,752
セントケア・ホールディング	-	1	1,392
ルネサンス	0.900	0.900	1,594
ディップ	2	2	9,099
オプトホールディング	1	1	1,498
新日本科学	2	2	1,404
ツクイ	4	4	3,789
キャリアデザインセンター	0.900	-	-
エムスリー	16	19	87,759
ツカダ・グローバルホールディング	1	2	1,409
アウトソーシング	1	5	11,323

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
ウェルネット	1	1	2,207	
ワールドホールディングス	—	0.600	2,382	
ディー・エヌ・エー	8	10	19,747	
博報堂DYホールディングス	25	26	42,001	
ぐるなび	2	3	4,272	
エスアールジータカミヤ	2	2	1,502	
ジャパンベストレスキューシステム	5	2	1,863	
ファンコミュニケーションズ	4	5	4,001	
ライク	—	0.700	1,454	
ビジネス・ブレイクスルー	—	3	1,449	
WDBホールディングス	1	0.900	3,753	
ティア	1	—	—	
バリューコマース	—	1	2,317	
インフォマート	7	9	8,553	
J Pホールディングス	5	5	1,846	
E P Sホールディングス	2	2	6,563	
プレスステージ・インターナショナル	2	3	5,413	
アミューズ	1	1	4,881	
ドリームインキュベータ	0.600	0.600	1,646	
クイック	—	1	2,488	
T A C	5	4	1,394	
ケネディクス	24	25	17,846	
電通	20	23	115,153	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1	1	1,419	
びあ	0.600	0.600	3,300	
イオンファンタジー	0.500	0.600	2,997	
シーティーエス	0.900	1	1,495	
ネクシーズグループ	—	0.800	1,379	
みらかホールディングス	4	5	23,940	
アルプス技研	0.700	1	3,836	
ダイオーズ	1	—	—	
日本空調サービス	2	2	1,558	
オリエンタルランド	20	22	238,896	
ダスキン	4	5	13,525	
明光ネットワークジャパン	2	2	3,088	
ファルコホールディングス	0.900	1	1,765	
秀英予備校	2	2	1,435	
ラウンドワン	5	5	10,596	
リゾートトラスト	7	8	19,352	
ビー・エム・エル	2	2	6,345	
ワタベウエディング	2	2	1,391	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
りらいあコミュニケーションズ	3	3	3,948	
リソー教育	3	3	2,620	
早稲田アカデミー	—	0.800	1,389	
ユー・エス・エス	22	23	51,258	
サイバーエージェント	9	12	55,924	
楽天	94	97	91,167	
クリーク・アンド・リバー社	—	1	1,383	
テー・オー・ダブリュー	—	1	1,657	
セントラルスポーツ	0.600	0.700	2,786	
フルキャストホールディングス	1	1	4,312	
テクノプロ・ホールディングス	3	3	20,978	
インターワークス	—	1	1,440	
Keeper 技研	0.700	1	1,403	
ファーストロジック	—	1	1,399	
Gunosy	—	0.900	2,344	
イー・ガーディアン	—	1	3,130	
リブセンス	2	2	1,424	
ジャパンマテリアル	1	1	6,851	
ベクトル	1	2	5,004	
ウチヤマホールディングス	2	2	1,435	
キャリアリンク	1	2	1,377	
I B J	1	1	1,654	
アサンテ	0.700	0.500	940	
N・フィールド	0.900	1	2,425	
M&Aキャピタルパートナーズ	—	0.400	3,112	
ERIホールディングス	—	1	1,453	
アビスト	0.300	0.300	1,500	
ウィルグループ	1	0.900	1,485	
エスコロー・エージェント・ジャパン	—	2	1,394	
日本ビューホテル	0.900	0.900	1,351	
リクルートホールディングス	40	146	387,119	
土木管理総合試験所	—	2	1,396	
日本郵政	48	107	140,801	
ベルシステム24ホールディングス	2	3	4,777	
一蔵	—	1	1,398	
ソラスト	—	1	2,968	
リログループ	0.700	10	30,364	
東祥	0.400	1	4,572	
エイチ・アイ・エス	3	3	11,910	
ラックランド	0.600	0.700	1,491	
共立メンテナンス	1	3	15,453	

## ニッセイ国内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	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イチネンホールディングス	1	2	3,229
建設技術研究所	1	1	1,726
スペース	1	1	1,644
燦ホールディングス	-	0.500	1,311
東京テアトル	8	1	1,463
ナガワ	0.300	0.400	1,712
よみうりランド	4	0.400	1,906
東京都競馬	13	1	5,243
常磐興産	0.800	0.800	1,530
カナモト	2	2	9,802
東京ドーム	7	7	7,584
西尾レントオール	1	1	5,933
トランス・コスモス	2	2	6,043
乃村工藝社	4	4	9,565
藤田観光	6	0.800	2,612
KNT-CTホールディングス	10	1	2,178
日本管財	1	2	4,184
トーカイ	0.800	1	4,712
白洋舎	0.500	0.400	1,354
セコム	19	20	160,036
セントラル警備保障	0.800	0.900	2,259
丹青社	3	3	4,110
メイテック	2	2	13,420
アサツー ディ・ケイ	3	-	-
応用地質	1	2	3,063

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
船井総研ホールディングス	2	3	8,525
進学会ホールディングス	2	2	1,432
いであ	-	1	1,452
学究社	0.800	0.900	1,463
ベネッセホールディングス	6	6	27,462
イオンディライト	2	2	8,912
ナック	1	1	1,428
ニチイ学館	3	3	4,518
ダイセキ	3	3	9,760
ステップ	0.900	0.800	1,471
合計	株数・金額	26,741	23,939 49,937,126
	銘柄数<比率>	1,711	1,820 <98.2%>

(注1) 銘柄欄の( )内は、当期末における国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(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。

### (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
TOPIX	952	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

## 投資信託財産の構成

2018年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	49,937,126	95.4
コール・ローン等、その他	2,398,236	4.6
投資信託財産総額	52,335,363	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ国内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2月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>52,332,830,131円</b>
コーポレート債	2,156,463,306
株式(評価額)	49,937,126,110
未収入金	47,536,850
未収配当金	66,273,865
差入委託証拠金	125,430,000
<b>(B)負債</b>	<b>1,464,779,204</b>
未払金	1,381,421,890
未払解約金	83,353,318
その他未払費用	3,996
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>50,868,050,927</b>
元本	28,140,482,546
次期繰越損益金	22,727,568,381
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>28,140,482,546口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>18,076円</b>

(注1) 期首元本額	26,374,834,259円
期中追加設定元本額	12,504,825,643円
期中一部解約元本額	10,739,177,356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。	
ニッセイTOPIXオープン	7,165,337,530円
ニッセイ国内株式インデックスSA(適格機関投資家限定)	5,432,863,472円
ニッセイ日本バランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	3,464,218円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,117,101円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	902,320,051円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,416,092,276円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	2,424,354,525円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(債券重視型)SA(適格機関投資家限定)	15,429,588円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	52,436,377円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	65,705,940円
DCニッセイ国内株式インデックス	69,476,894円
<購入・換金手数料なし>ニッセイTOPIXインデックスファンド	8,300,321,337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)	269,194,698円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	3,727,590円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	753,106円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	273,304円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	417,233円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	647,897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)	6,943,435円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	3,535,518円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	543,300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)	587,589円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	247,609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)	1,691,958円

### 損益の状況

当期(2017年2月21日~2018年2月20日)

項目	当期
<b>(A)配当等収益</b>	<b>876,392,637円</b>
受取配当金	876,797,933
受取利息	20,551
その他収益金	498,842
支払利息	△ 924,689
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>5,534,946,124</b>
売買益	6,560,403,856
売買損	△ 1,025,457,732
<b>(C)先物取引等損益</b>	<b>147,800,640</b>
取引益	273,087,760
取引損	△ 125,287,120
<b>(D)信託報酬等</b>	<b>△ 752,420</b>
<b>(E)当期損益金(A+B+C+D)</b>	<b>6,558,386,981</b>
<b>(F)前期繰越損益金</b>	<b>14,623,173,169</b>
<b>(G)追加信託差損益金</b>	<b>9,026,071,431</b>
<b>(H)解約差損益金</b>	<b>△ 7,480,063,200</b>
<b>(I)合計(E+F+G+H)</b>	<b>22,727,568,381</b>
<b>次期繰越損益金(I)</b>	<b>22,727,568,381</b>

- (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。

# ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 17 期

(計算期間：2017年2月21日～2018年2月20日)

#### 運用方針

- ① 国内の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。
- ② 原則として、ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用し、ポートフォリオを構築します。

#### 主要運用 対象

国内の公社債

#### 運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。  
・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りま



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2月21日～2018年2月20日

## 国内債券市況

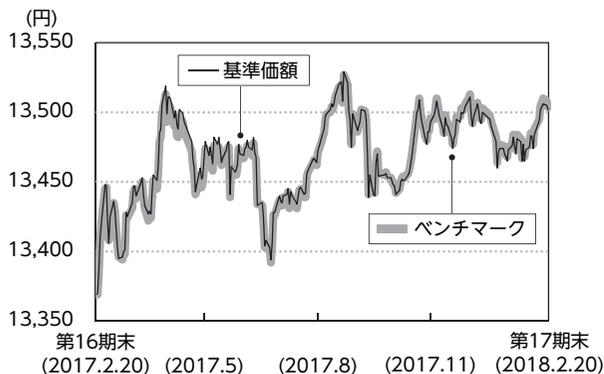


(注) 10年国債金利は、ブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は、日銀の金融緩和政策を背景に、期初以降、低下基調となりましたが、その後6月末にかけては、欧州を中心に金融緩和縮小観測が高まり、海外金利が上昇したことで国内金利にも上昇圧力がかかり、大きく上昇する場面が見られました。

7月前半には、日銀による指値オペ（日銀が指定する利回りで国債を無制限に買い入れる公開市場操作）の実施や定例の中長期債の買い入れ額の増額など、金利上昇を抑制するスタンスを明確にしたことなどから、金利は低下基調に転じ、8月には北朝鮮情勢の緊迫化を受けて、さらに低下する展開となりました。9月に入ると、北朝鮮情勢への警戒感が後退したことや、好調な米経済指標を背景に米国において利上げ継続の可能性が高まったことから金利は再び上昇に転じました。その後、米税制改革への思惑などから金利は上下しましたが、2月には世界的な同時株安を受けた投資家のリスク回避姿勢などから低下し、結局、10年国債金利は期初を下回る水準で当期末を迎えました。

## 基準価額等の推移



当期の基準価額は、期初以降、日銀の金融緩和政策を背景とした金利の低下（債券価格は上昇）を受けておおむね上昇しましたが、6月末にかけて、海外金利の上昇を背景に国内金利も上昇したことから基準価額は下落基調で推移しました。その後は、日銀の金利上昇を抑制するスタンスや北朝鮮情勢の緊迫化を受けて、金利が低下したことにより基準価額は上昇基調となりました。9月に入ると、北朝鮮情勢への警戒感が後退したことや米国における利上げ継続の見通しが高まったことから、金利が再び上昇し基準価額は下落しました。その後、米税制改革への思惑などから基準価額は上下しましたが、2月には世界的な同時株安を受けた投資家のリスク回避姿勢などから金利が低下したことで基準価額は上昇し、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公債券流通市場全体の動向を表すために、野村証券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村証券株式会社の知的財産です。野村証券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

## ポートフォリオ

ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用して、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比等を調整し、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。

当期も上記クオンツモデルに基づき、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比（短期・中期・長期・超長期別の構成比）がベンチマークに対しおおむね中立となるよう、適宜売買を実施しました。

(注) デュレーションとは、債券投資におけるリスク度合いを表す主要な指標の一つで、金利変動に対する債券価格の反応の大きさ（リスクの大きさ）を表します。デュレーションが長いほど、金利変動に対する債券価格の反応は大きくなります。

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+1.0%となり、ベンチマーク騰落率（+1.0%）に連動しました。

## ■ 今後の運用方針

引き続き、クオンツモデルに基づき、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。

## ■ お知らせ

### ■ 約款変更

デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、関連条項に所要の変更を行いました。

(2017年8月18日)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
13期(2014年 2月20日)	12,536	2.4	12,542	2.4	99.0	24,258
14期(2015年 2月20日)	12,827	2.3	12,839	2.4	99.5	34,807
15期(2016年 2月22日)	13,389	4.4	13,376	4.2	99.0	25,320
16期(2017年 2月20日)	13,369	△0.1	13,372	△0.0	99.3	28,941
17期(2018年 2月20日)	13,502	1.0	13,506	1.0	99.0	29,566

(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、設定時を10,000として指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。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	債券 組入比率
	円	%		%	%
(期首)2017年 2月20日	13,369	-	13,372	-	99.3
2月末	13,447	0.6	13,448	0.6	98.9
3月末	13,433	0.5	13,434	0.5	99.4
4月末	13,502	1.0	13,499	1.0	98.9
5月末	13,474	0.8	13,471	0.7	99.3
6月末	13,433	0.5	13,437	0.5	98.8
7月末	13,436	0.5	13,436	0.5	99.0
8月末	13,506	1.0	13,508	1.0	99.0
9月末	13,455	0.6	13,461	0.7	97.1
10月末	13,457	0.7	13,461	0.7	99.3
11月末	13,491	0.9	13,497	0.9	99.3
12月末	13,500	1.0	13,506	1.0	99.1
2018年 1月末	13,477	0.8	13,482	0.8	99.1
(期末)2018年 2月20日	13,502	1.0	13,506	1.0	99.0

(注) 騰落率は期首比です。

## 1万口当たりの費用明細

2017年2月21日～2018年2月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	0円	0.000%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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</li> <li>・ 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</li> </ul>
合計	0	0.000	

(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（13,468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

2017年2月21日～2018年2月20日

## 公社債

		買付額	売付額
国		千円	千円
内	国債証券	42,321,705	41,774,426

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

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

## 主要な売買銘柄

2017年2月21日～2018年2月20日

## 公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
第321回 利付国債 (10年)	2,963,865	第26回 利付国債 (30年)	2,395,392
第152回 利付国債 (20年)	2,457,354	第312回 利付国債 (10年)	2,225,246
第100回 利付国債 (20年)	2,346,913	第140回 利付国債 (20年)	2,213,609
第125回 利付国債 (20年)	2,326,337	第373回 利付国債 (2年)	2,155,276
第373回 利付国債 (2年)	2,312,627	第146回 利付国債 (20年)	1,872,148
第328回 利付国債 (10年)	2,033,982	第328回 利付国債 (10年)	1,596,668
第310回 利付国債 (10年)	1,984,812	第338回 利付国債 (10年)	1,589,653
第38回 利付国債 (30年)	1,880,764	第113回 利付国債 (5年)	1,525,805
第322回 利付国債 (10年)	1,789,008	第127回 利付国債 (5年)	1,476,337
第333回 利付国債 (10年)	1,784,465	第322回 利付国債 (10年)	1,389,488

(注1) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれていません)。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

## 組入有価証券明細表

2018年2月20日現在

## 国内 (邦貨建) 公社債

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	26,519,000	29,264,437	99.0	-	61.7	26.0	11.3
合計	26,519,000	29,264,437	99.0	-	61.7	26.0	11.3

(注1) 評価については、原則として証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。ただし、残存期間1年以内の公社債については、償却原価法により評価しています。以下同じです。

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 額面金額および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、額面金額および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。以下同じです。

## ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

(国内公社債の内訳)

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第373回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/ 2 /15	152,000	152,385
	第378回 利付国債 (2年)	0.1000	2019/ 7 /15	713,000	715,531
	第121回 利付国債 (5年)	0.1000	2019/ 9 /20	271,000	272,024
	第123回 利付国債 (5年)	0.1000	2020/ 3 /20	253,000	254,181
	第125回 利付国債 (5年)	0.1000	2020/ 9 /20	64,000	64,355
	第131回 利付国債 (5年)	0.1000	2022/ 3 /20	433,000	436,628
	第 4 回 利付国債 (40年)	2.2000	2051/ 3 /20	118,000	164,647
	第 8 回 利付国債 (40年)	1.4000	2055/ 3 /20	376,000	436,754
	第303回 利付国債 (10年)	1.4000	2019/ 9 /20	2,148,000	2,200,217
	第306回 利付国債 (10年)	1.4000	2020/ 3 /20	473,000	487,975
	第310回 利付国債 (10年)	1.0000	2020/ 9 /20	2,052,000	2,111,364
	第321回 利付国債 (10年)	1.0000	2022/ 3 /20	2,107,000	2,202,636
	第322回 利付国債 (10年)	0.9000	2022/ 3 /20	378,000	393,611
	第328回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/ 3 /20	729,000	754,813
	第333回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/ 3 /20	1,611,000	1,675,778
	第334回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/ 6 /20	646,000	672,847
	第338回 利付国債 (10年)	0.4000	2025/ 3 /20	138,000	142,305
	第342回 利付国債 (10年)	0.1000	2026/ 3 /20	1,523,000	1,535,290
	第346回 利付国債 (10年)	0.1000	2027/ 3 /20	126,000	126,682
	第 18 回 利付国債 (30年)	2.3000	2035/ 3 /20	260,000	340,028
	第 26 回 利付国債 (30年)	2.4000	2037/ 3 /20	47,000	62,876
	第 30 回 利付国債 (30年)	2.3000	2039/ 3 /20	717,000	956,635
	第 33 回 利付国債 (30年)	2.0000	2040/ 9 /20	171,000	219,688
	第 38 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 3 /20	1,214,000	1,521,530
	第 54 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 3 /20	724,000	729,154
	第 49 回 利付国債 (20年)	2.1000	2021/ 3 /22	507,000	541,754
	第 55 回 利付国債 (20年)	2.0000	2022/ 3 /21	1,101,000	1,196,060
	第 68 回 利付国債 (20年)	2.2000	2024/ 3 /20	97,000	110,357
	第 76 回 利付国債 (20年)	1.9000	2025/ 3 /20	122,000	138,733
	第 85 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/ 3 /20	746,000	872,439
第 88 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/ 6 /20	512,000	609,505	
第 94 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/ 3 /20	78,000	92,564	
第100回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 3 /20	1,153,000	1,398,600	
第108回 利付国債 (20年)	1.9000	2028/12/20	181,000	215,887	

## ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第110回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 3 /20	14,000	17,047
	第125回 利付国債 (20年)	2.2000	2031/ 3 /20	1,632,000	2,049,073
	第126回 利付国債 (20年)	2.0000	2031/ 3 /20	377,000	463,736
	第133回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/12/20	228,000	275,959
	第143回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/ 3 /20	6,000	7,129
	第146回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/ 9 /20	359,000	432,817
	第152回 利付国債 (20年)	1.2000	2035/ 3 /20	1,962,000	2,212,822
	合計	-	-	-	29,264,437

### 投資信託財産の構成

2018年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	29,264,437	98.7
コール・ローン等、その他	371,792	1.3
投資信託財産総額	29,636,229	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年2月20日現在)

項目		当期末
<b>(A)資産</b>	<b>産</b>	<b>29,636,229,669円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等		235,859,398
公 社 債 (評 価 額)		29,264,437,265
未 収 利 息		115,317,402
前 払 費 用		20,615,604
<b>(B)負債</b>	<b>債</b>	<b>69,382,600</b>
未 払 解 約 金		69,382,148
そ の 他 未 払 費 用		452
<b>(C)純 資 産 総 額 (A - B)</b>		<b>29,566,847,069</b>
元 本		21,897,583,332
次 期 繰 越 損 益 金		7,669,263,737
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>		<b>21,897,583,332口</b>
<b>1万口当たり基準価額 (C / D)</b>		<b>13,502円</b>

(注1) 期首元本額	21,647,591,197円
期中追加設定元本額	8,163,631,400円
期中一部解約元本額	7,913,639,265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。	
ニッセイ国内債券インデックス S A (適格機関投資家限定)	1,455,124,630円
DCニッセイ国内債券インデックス	7,181,305,255円
ニッセイ日本バランス (標準型) S A (適格機関投資家限定)	4,590,031円
ニッセイ日本バランス (成長型) S A (適格機関投資家限定)	2,937,649円
DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	2,680,758,029円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	4,480,188,361円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	1,191,507,110円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (債券重視型) S A (適格機関投資家限定)	56,493,000円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (標準型) S A (適格機関投資家限定)	82,211,051円
ニッセイ/パナゴラ・インデックスバランス (成長型) S A (適格機関投資家限定)	46,271,108円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ国内債券インデックスファンド	4,325,570,095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)	390,627,013円

### 損益の状況

当期 (2017年2月21日~2018年2月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>307,456,689円</b>
受 取 利 息	307,652,259
支 払 利 息	△ 195,570
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>△ 25,124,535</b>
売 買 益	193,662,700
売 買 損	△ 218,787,235
<b>(C)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 12,936</b>
<b>(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)</b>	<b>282,319,218</b>
<b>(E)前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>7,293,460,332</b>
<b>(F)追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>2,835,369,711</b>
<b>(G)解 約 差 損 益 金</b>	<b>△ 2,741,885,524</b>
<b>(H)合 計 (D + E + F + G)</b>	<b>7,669,263,737</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金 (H)</b>	<b>7,669,263,737</b>

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

# 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

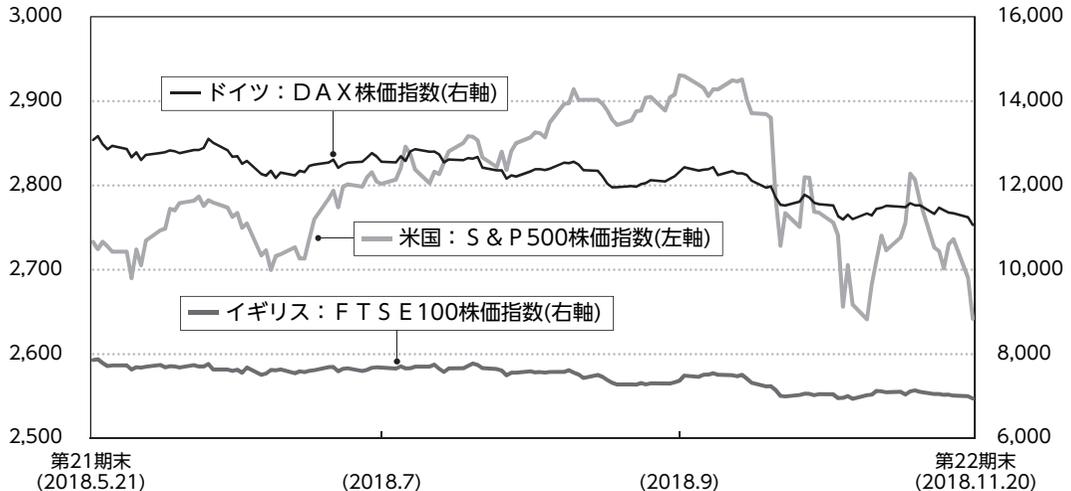
東京都千代田区丸の内1-6-6

# 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		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	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		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
	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 (株式)	0円	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 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
	(0)	(0.000)	
有価証券取引税 (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 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用 (保管費用)	5 (4)	0.029 (0.023)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(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
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・シケル 797 (△ 347)	4	千イスラエル・シケル 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。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	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
<b>(アメリカ)</b>		千□	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)		
<b>(カナダ)</b>		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	—	—
<b>(オーストラリア)</b>		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	—	—
<b>(香港)</b>		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	11	820	0.500	34
<b>(シンガポール)</b>		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)		
<b>(イギリス)</b>		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	
<b>(アメリカ)</b>	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	
<b>(アメリカ)</b>	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	
<b>(アメリカ)</b>	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
ENERGY 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
FLOWSERVE 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	
<b>(アメリカ)</b>	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	
<b>(アメリカ)</b>	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	
<b>(アメリカ)</b>	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	
<b>(アメリカ)</b>	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	
<b>(アメリカ)</b>	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	
<b>(アメリカ)</b>	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
SYNOPSIS 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	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	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 銘柄数<比率>	96,098 601	112,261 595	850,286 —	95,801,747 <64.0%>
<b>(カナダ)</b>			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	
<b>(カナダ)</b>	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	
<b>(カナダ)</b>	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
<b>(カナダ)</b>		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		12,669	15,178	61,805	5,285,617	
	株数・金額 銘柄数<比率>	86	87	-	<3.5%>	
<b>(オーストラリア)</b>				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		
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	千ドル	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 銘柄数<比率>	23,350 56	27,167 56	41,670 -	3,426,540 <2.3%>	
<b>(香港)</b>			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		
<b>(香港)</b>	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%>	
<b>(シンガポール)</b>			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	
<b>(シンガポール)</b>		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
SENBCORP 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
YANGZHIJIANG SHIPBUILDING		703	811	102	8,463	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,426 21	16,343 21	7,792 -	640,280 <0.4%>	
<b>(ニュージーランド)</b>				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 銘柄数<比率>	2,065 7	2,510 7	1,623 -	125,139 <0.1%>	
<b>(イギリス)</b>				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	
<b>(イギリス)</b>		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 銘柄数<比率>	130,936 97	138,280 97	64,786 -	9,381,730 <6.3%>	
<b>(イスラエル)</b>				千イスラエル・シケル		
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 銘柄数<比率>	1,728 9	2,040 8	5,147 -	156,631 <0.1%>	
<b>(スイス)</b>				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
DUFREY 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	
<b>(スイス)</b>	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 銘柄数<比率>	5,256 37	6,307 38	41,037 -	4,654,480 <3.1%>
<b>(デンマーク)</b>			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	邦貨換算金額	
<b>(デンマーク)</b>		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 銘柄数<比率>	1,383 17	1,566 17	53,610 -	926,384 <0.6%>	
<b>(ノルウェー)</b>				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 銘柄数<比率>	1,860 9	2,219 10	31,173 -	413,985 <0.3%>	
<b>(スウェーデン)</b>				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		
<b>(スウェーデン)</b>	百株	百株	千ユーロ	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 銘柄数<比率>	7,931 33	9,088 31	113,770 -	1,423,266 <1.0%>	
<b>(ユーロ/アイルランド)</b>			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 銘柄数<比率>	895 5	1,146 6	2,076 -	267,817 <0.2%>	
<b>(ユーロ/オランダ)</b>						
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	
<b>(ユーロ/オランダ)</b>		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 銘柄数<比率>	6,518 26	7,028 23	17,242 -	2,223,972 <1.5%>	
<b>(ユーロ/ベルギー)</b>						
	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 銘柄数<比率>	616 10	720 10	4,302 -	554,924 <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	
<b>(ユーロ/ルクセンブルグ)</b>		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%>	
<b>(ユーロ/フランス)</b>						
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 銘柄数<比率>	8,478 70	10,086 69	42,674 -	5,504,213 <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
<b>(ユーロ/ドイツ)</b>		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 銘柄数<比率>	7,457 61	8,853 62	36,975 -	4,769,157 <3.2%>	
<b>(ユーロ/ポルトガル)</b>						
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 銘柄数<比率>	983 3	1,223 3	655 -	84,502 <0.1%>	
<b>(ユーロ/スペイン)</b>						
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		
<b>(ユーロ/スペイン)</b>	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%>	
<b>(ユーロ/イタリア)</b>						
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	
<b>(ユーロ/イタリア)</b>		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 銘柄数<比率>	16,415 17	19,355 18	7,922 -	1,021,907 <0.7%>
<b>(ユーロ/フィンランド)</b>						
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 銘柄数<比率>	2,888 12	3,298 12	4,385 -	565,628 <0.4%>
<b>(ユーロ/オーストリア)</b>						
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 銘柄数<比率>	245 5	285 5	1,014 -	130,795 <0.1%>
<b>(ユーロ/その他)</b>						
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 銘柄数<比率>	67 1	79 1	541 -	69,794 <0.0%>
ユーロ計		株数・金額 銘柄数<比率>	61,132 236	71,655 235	131,599 -	16,973,711 <11.3%>
合計		株数・金額 銘柄数<比率>	390,489 1,250	440,051 1,241	- -	140,969,194 <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。

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	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 銘柄数<比率>	378 39	413 37	25,593 —	2,883,569 <1.9%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
<b>(カナダ)</b>		千□	千□	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	□数・金額	11	16	408	34,956
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>
<b>(オーストラリア)</b>				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	□数・金額	733	808	3,477	285,930
	銘柄数<比率>	8	7	—	<0.2%>
<b>(香港)</b>				千香港ドル	
LINK REIT		69	80	5,895	84,773
小計	□数・金額	69	80	5,895	84,773
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>
<b>(シンガポール)</b>				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	□数・金額	315	385	794	65,258
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.0%>
<b>(イギリス)</b>				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	□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
		百万円	百万円
外 国	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
<b>(A)資産</b>	<b>153,273,493,759円</b>
コーポレート債	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>(B)負債</b>	<b>3,555,232,007</b>
未払金	3,242,016,970
未払解約金	313,161,773
その他未払費用	53,264
<b>(C)純資産総額(A-B)</b>	<b>149,718,261,752</b>
元本	88,596,175,879
次期繰越損益金	61,122,085,873
<b>(D)受益権総口数</b>	<b>88,596,175,879口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>16,899円</b>

(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マザーファンド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
<b>(A)配当等収益</b>	<b>1,434,148,695円</b>
受取配当金	1,432,218,552
受取利息	2,799,914
その他の収益	237,046
支払利息	△ 1,106,817
<b>(B)有価証券売買損益</b>	<b>△ 5,232,112,285</b>
売却益	7,659,015,136
買入損	△ 12,891,127,421
<b>(C)先物取引等損益</b>	<b>△ 81,466,139</b>
取引益	269,623,448
取引損	△ 351,089,587
<b>(D)信託報酬等</b>	<b>△ 41,537,027</b>
<b>(E)当期損益金(A+B+C+D)</b>	<b>△ 3,920,966,756</b>
<b>(F)前期繰越損益金</b>	<b>55,641,079,258</b>
<b>(G)追加信託差損益金</b>	<b>14,601,931,938</b>
<b>(H)解約差損益金</b>	<b>△ 5,199,958,567</b>
<b>(I)合計(E+F+G+H)</b>	<b>61,122,085,873</b>
<b>次期繰越損益金(I)</b>	<b>61,122,085,873</b>

- (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。

# ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

### 第 24 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国の国債に投資することにより、F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

#### 主要運用 対象

日本を除く主要国の国債

#### 運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

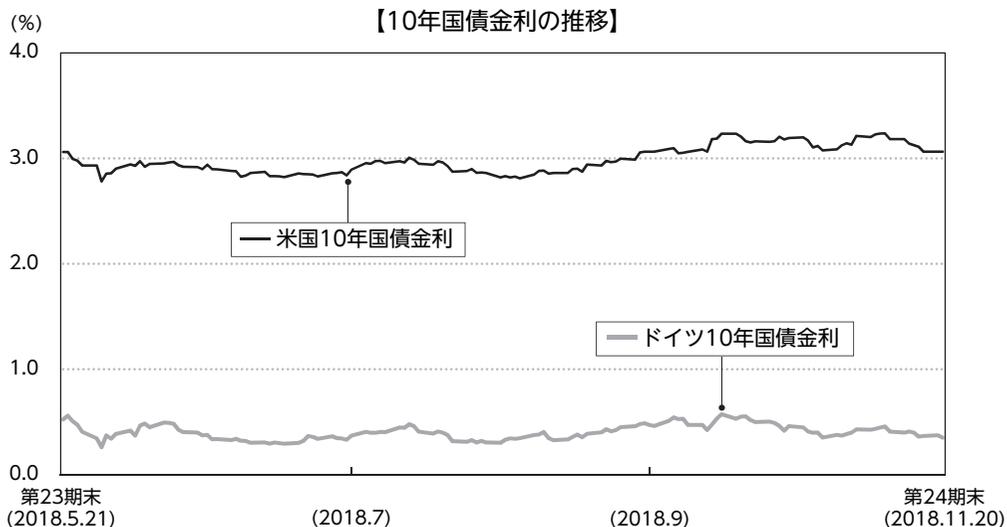
東京都千代田区丸の内1-6-6

# 運用経過

2018年5月22日～2018年11月20日

## 投資環境

### ■ 海外債券市況

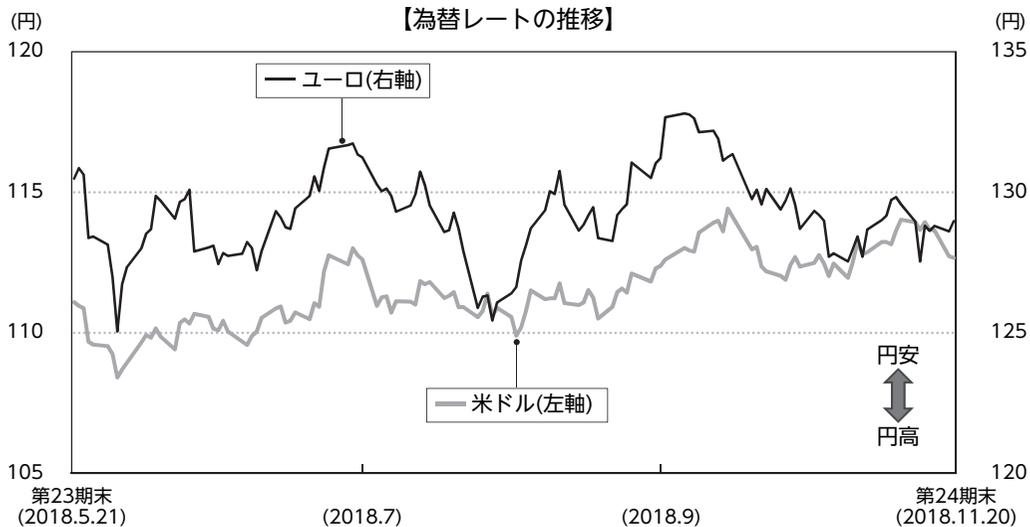


(注) 10年国債金利は、ブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は小幅に上昇しました。期初以降、米中貿易摩擦懸念や地政学リスクへの警戒感を背景に、金利は低下傾向となりました。9月になると、同懸念が弱まり新興国不安も一服し、金利は上昇する展開となりました。その後は、株価の大幅下落により低下する場面などもありましたが、結局、期初を若干上回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は低下しました。期初以降、日銀による金融政策正常化への警戒感等からの上昇圧力もありましたが、欧州景気の減速懸念や米保護主義政策などを背景に、金利は低下傾向となりました。9月になると、米金利上昇などを受けて上昇する場面もありましたが、その後は、世界的に株価が大幅下落したことやイタリアの財政問題等から低下し、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

## ■為替市況

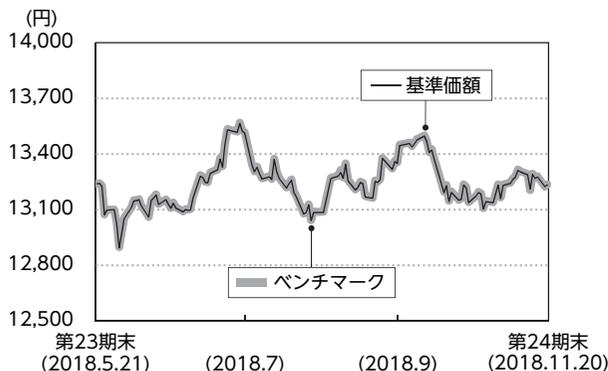


(注) 為替レートは、対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル／円レートは上昇しました。米中貿易摩擦に対する懸念や世界的な株価下落などを受けて下落する場面もありましたが、堅調な米経済指標等を背景に、米ドルは上昇基調となりました。

当期のユーロ／円レートは下落しました。期初以降、イタリアの財政や米中貿易摩擦への懸念が下落要因となる一方、それら懸念の緩和局面やイギリスの欧州連合（EU）離脱交渉の進展期待の高まりが上昇要因となりましたが、ユーロはおおむね下落傾向で推移しました。

## 基準価額等の推移



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

### ■ 基準価額の主な変動要因

当期は、米中貿易摩擦やイタリア財政への懸念等からユーロが対円で下落したことなどが基準価額の下落要因となりました。一方で、欧州の景況感悪化などから欧州長期金利が低下（債券価格は上昇）したことや、堅調な米経済指標等を背景とした米ドルの対円での上昇は、基準価額の上昇要因となりましたが、期を通じて見ると若干下落して当期末を迎えました。

## ポートフォリオ

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

## ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-0.0%となり、ベンチマーク騰落率（-0.0%）に連動しました。

## 今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
20期(2016年11月21日)	12,470	△3.7	12,576	△3.7	98.7	10,062
21期(2017年5月22日)	13,045	4.6	13,165	4.7	98.8	11,666
22期(2017年11月20日)	13,528	3.7	13,656	3.7	98.8	13,064
23期(2018年5月21日)	13,240	△2.1	13,369	△2.1	99.1	16,026
24期(2018年11月20日)	13,234	△0.0	13,366	△0.0	99.1	17,768

(注) ベンチマークはFTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)で、設定時を10,000として、指数化しています。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。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	債券 組入比率
		%		%	
(期首)2018年5月21日	13,240	—	13,369	—	99.1
5月末	12,972	△2.0	13,103	△2.0	98.9
6月末	13,164	△0.6	13,297	△0.5	99.4
7月末	13,263	0.2	13,396	0.2	99.3
8月末	13,255	0.1	13,388	0.1	98.8
9月末	13,476	1.8	13,613	1.8	99.0
10月末	13,232	△0.1	13,366	△0.0	98.8
(期末)2018年11月20日	13,234	△0.0	13,366	△0.0	99.1

(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	
その他費用	3円	0.021%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.021)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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</li> <li>・ 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</li> </ul>
合計	3	0.021	

(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（13,235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

## 公社債

		買付額	売付額	
外国	アメリカ	千米ドル 17,419	千米ドル 7,408	
	カナダ	千カナダ・ドル 867	千カナダ・ドル 644	
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 667	千オーストラリア・ドル 233	
	シンガポール	千シンガポール・ドル 190	千シンガポール・ドル 130	
	イギリス	千イギリス・ポンド 1,428	千イギリス・ポンド 720	
	スイス	千スイス・フラン -	千スイス・フラン 244	
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 858	千デンマーク・クローネ -	
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 501	千ノルウェー・クローネ 857	
	スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 403	千スウェーデン・クローナ -	
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 4,151	千メキシコ・ペソ 228	
	マレーシア	千マレーシア・リングgit 393	千マレーシア・リングgit 51	
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 1,800	千南アフリカ・ランド 131	
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 673	千ポーランド・ズロチ 433	
	ユーロ	アイルランド	千ユーロ 191	千ユーロ 159
		オランダ	191	191
		ベルギー	478	189
		フランス	2,409	909
		ドイツ	1,704	871
		スペイン	1,394	603
イタリア		1,865	902	
フィンランド		117	41	
オーストリア	268	174		

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

## 主要な売買銘柄

2018年5月22日～2018年11月20日

## 公社債

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
US TREASURY	111,525	US TREASURY	130,876
US TREASURY	98,331	US TREASURY	120,319
US TREASURY	92,556	US TREASURY	115,432
US TREASURY	74,936	US TREASURY	102,124
US TREASURY	72,063	US TREASURY	97,022
US TREASURY	71,012	US TREASURY	87,574
US TREASURY	67,901	FRANCE (GOVT OF)	52,419
US TREASURY	66,494	UK TSY 1 3/4% 2019	51,132
US TREASURY	54,405	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,165
US TREASURY	51,691	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	28,236

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

## 組入有価証券明細表

2018年11月20日現在

## 外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	73,750	71,862	8,096,694	45.6	—	18.4	17.6	9.6
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	4,070	4,223	361,158	2.0	—	0.9	0.6	0.5
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア	4,290	4,514	371,210	2.1	—	1.3	0.6	0.1
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	830	848	69,712	0.4	—	0.2	0.1	0.0
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	6,740	8,091	1,171,742	6.6	—	4.8	1.3	0.5
	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ						
デンマーク	5,190	6,293	108,751	0.6	—	0.4	0.1	0.1

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

区分	当期末								
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ノルウェー	千ルウェー・クローネ 3,040	千ルウェー・クローネ 3,123	千円 41,482	% 0.2	% -	% 0.1	% 0.1	% -	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 4,710	千スウェーデン・クローナ 5,269	65,923	0.4	-	0.2	0.2	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 26,020	千メキシコ・ペソ 24,522	135,853	0.8	-	0.5	0.2	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 3,200	千マレーシア・リンギット 3,167	85,214	0.5	-	0.3	0.1	0.1	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 14,090	千南アフリカ・ランド 12,694	101,812	0.6	-	0.5	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 3,360	千ポーランド・ズロチ 3,532	105,223	0.6	-	0.2	0.3	0.1	
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ							
	アイルランド	980	1,063	137,112	0.8	-	0.5	0.1	0.1
	オランダ	2,480	2,880	371,548	2.1	-	1.3	0.6	0.2
	ベルギー	2,850	3,334	430,031	2.4	-	1.7	0.5	0.1
	フランス	12,180	13,965	1,801,301	10.1	-	6.3	2.8	1.0
	ドイツ	8,230	9,502	1,225,689	6.9	-	3.9	2.0	1.0
	スペイン	7,100	8,029	1,035,642	5.8	-	3.7	1.4	0.7
	イタリア	11,690	11,850	1,528,414	8.6	-	4.8	2.8	1.1
	フィンランド	780	845	109,044	0.6	-	0.3	0.2	0.1
オーストリア	1,730	2,012	259,576	1.5	-	0.9	0.4	0.1	
合計	-	-	17,613,140	99.1	-	51.3	32.1	15.7	

(注1) 外貨建金額は、原則として証券会社、価格情報会社等より入手した時価により評価したものです。また邦貨換算金額は、当期末の時価を国内の対顧客電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) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する邦貨換算金額（評価額）の比率です。

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

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

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/02/15	80	95	10,789
	US TREASURY	6.5000	2026/11/15	60	74	8,439
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	90	111	12,584
	US TREASURY	5.5000	2028/08/15	60	72	8,138
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	80	94	10,694
	US TREASURY	5.2500	2029/02/15	50	59	6,701
	US TREASURY	5.3750	2031/02/15	120	147	16,634
	US TREASURY	1.2500	2019/10/31	1,160	1,144	128,960
	US TREASURY	1.3750	2019/12/15	1,020	1,005	113,297
	US TREASURY	1.6250	2019/12/31	1,080	1,066	120,200
	US TREASURY	1.3750	2020/01/31	1,390	1,367	154,083
	US TREASURY	1.3750	2020/02/29	1,010	992	111,826
	US TREASURY	1.3750	2020/03/31	970	952	107,278
	US TREASURY	3.5000	2020/05/15	1,320	1,333	150,291
	US TREASURY	1.5000	2020/05/31	1,090	1,069	120,468
	US TREASURY	1.6250	2020/06/30	1,000	981	110,636
	US TREASURY	2.6250	2020/08/15	1,440	1,435	161,787
	US TREASURY	1.3750	2020/08/31	1,120	1,092	123,103
	US TREASURY	2.0000	2020/09/30	1,070	1,054	118,847
	US TREASURY	2.6250	2020/11/15	1,660	1,654	186,373
	US TREASURY	1.8750	2020/12/15	780	765	86,282
	US TREASURY	2.3750	2020/12/31	790	783	88,240
	US TREASURY	1.3750	2021/01/31	1,230	1,192	134,387
	US TREASURY	2.0000	2021/02/28	790	775	87,430
	US TREASURY	2.2500	2021/03/31	820	809	91,219
	US TREASURY	3.1250	2021/05/15	1,090	1,098	123,735
	US TREASURY	2.0000	2021/05/31	850	833	93,872
	US TREASURY	2.1250	2021/06/30	870	854	96,322
	US TREASURY	2.1250	2021/08/15	1,280	1,256	141,575
	US TREASURY	2.0000	2021/08/31	890	870	98,070
	US TREASURY	2.1250	2021/09/30	920	902	101,664
	US TREASURY	2.0000	2021/11/15	1,320	1,289	145,250
	US TREASURY	2.1250	2021/12/31	890	871	98,168
	US TREASURY	2.0000	2022/02/15	1,220	1,188	133,928
	US TREASURY	1.7500	2022/03/31	800	772	86,987
	US TREASURY	1.7500	2022/05/15	1,210	1,166	131,392
	US TREASURY	2.1250	2022/06/30	730	711	80,205

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	千円
アメリカ		%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY	1.6250	2022/08/15	1,240	1,185	133,624
	US TREASURY	1.7500	2022/09/30	770	738	83,237
	US TREASURY	1.6250	2022/11/15	1,270	1,211	136,450
	US TREASURY	2.1250	2022/12/31	800	777	87,550
	US TREASURY	2.0000	2023/02/15	1,460	1,409	158,804
	US TREASURY	1.5000	2023/03/31	790	745	84,008
	US TREASURY	1.7500	2023/05/15	1,520	1,448	163,190
	US TREASURY	1.3750	2023/06/30	800	748	84,333
	US TREASURY	2.5000	2023/08/15	1,480	1,455	163,988
	US TREASURY	1.3750	2023/09/30	810	755	85,065
	US TREASURY	2.7500	2023/11/15	1,140	1,133	127,660
	US TREASURY	2.2500	2023/12/31	440	426	48,077
	US TREASURY	2.7500	2024/02/15	950	943	106,282
	US TREASURY	2.1250	2024/03/31	350	336	37,921
	US TREASURY	2.5000	2024/05/15	1,000	979	110,345
	US TREASURY	2.0000	2024/06/30	380	362	40,802
	US TREASURY	2.3750	2024/08/15	1,010	980	110,497
	US TREASURY	2.1250	2024/09/30	380	363	40,968
	US TREASURY	2.2500	2024/11/15	1,040	1,000	112,768
	US TREASURY	2.2500	2024/12/31	380	365	41,168
	US TREASURY	2.0000	2025/02/15	1,020	965	108,749
	US TREASURY	2.6250	2025/03/31	380	372	42,006
	US TREASURY	2.1250	2025/05/15	1,100	1,046	117,855
	US TREASURY	2.7500	2025/06/30	350	345	38,944
	US TREASURY	2.0000	2025/08/15	1,070	1,006	113,430
	US TREASURY	3.0000	2025/09/30	390	390	44,037
	US TREASURY	2.2500	2025/11/15	900	858	96,756
	US TREASURY	1.6250	2026/02/15	580	528	59,578
	US TREASURY	1.6250	2026/05/15	590	535	60,385
	US TREASURY	1.5000	2026/08/15	580	519	58,581
	US TREASURY	2.0000	2026/11/15	590	547	61,689
	US TREASURY	2.2500	2027/02/15	590	556	62,712
	US TREASURY	2.3750	2027/05/15	580	551	62,164
	US TREASURY	2.2500	2027/08/15	580	544	61,386
	US TREASURY	2.2500	2027/11/15	580	543	61,248
	US TREASURY	2.7500	2028/02/15	600	585	65,924
	US TREASURY	2.8750	2028/05/15	650	640	72,125
	US TREASURY	2.8750	2028/08/15	670	659	74,291

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千円	千円
アメリカ	%		千円	千円	千円
国債証券					
US TREASURY	4.5000	2036/02/15	140	164	18,571
US TREASURY	5.0000	2037/05/15	60	75	8,474
US TREASURY	4.3750	2038/02/15	60	70	7,897
US TREASURY	4.5000	2038/05/15	70	83	9,364
US TREASURY	3.5000	2039/02/15	110	114	12,898
US TREASURY	4.2500	2039/05/15	120	138	15,569
US TREASURY	4.5000	2039/08/15	110	130	14,737
US TREASURY	4.3750	2039/11/15	130	152	17,141
US TREASURY	4.6250	2040/02/15	200	241	27,250
US TREASURY	3.8750	2040/08/15	160	174	19,713
US TREASURY	4.2500	2040/11/15	160	184	20,773
US TREASURY	4.7500	2041/02/15	170	209	23,605
US TREASURY	3.1250	2041/11/15	130	126	14,252
US TREASURY	3.1250	2042/02/15	170	165	18,618
US TREASURY	3.0000	2042/05/15	150	142	16,061
US TREASURY	2.7500	2042/08/15	220	199	22,500
US TREASURY	2.7500	2042/11/15	270	244	27,584
US TREASURY	3.1250	2043/02/15	280	271	30,561
US TREASURY	2.8750	2043/05/15	370	342	38,606
US TREASURY	3.6250	2043/08/15	330	347	39,133
US TREASURY	3.7500	2043/11/15	380	408	45,985
US TREASURY	3.6250	2044/02/15	390	410	46,273
US TREASURY	3.3750	2044/05/15	390	394	44,416
US TREASURY	3.1250	2044/08/15	400	386	43,601
US TREASURY	3.0000	2044/11/15	380	359	40,482
US TREASURY	2.5000	2045/02/15	400	342	38,598
US TREASURY	3.0000	2045/05/15	390	368	41,505
US TREASURY	2.8750	2045/08/15	400	368	41,522
US TREASURY	3.0000	2045/11/15	390	368	41,467
US TREASURY	2.5000	2046/02/15	360	306	34,589
US TREASURY	2.5000	2046/05/15	370	315	35,517
US TREASURY	2.2500	2046/08/15	350	281	31,767
US TREASURY	2.8750	2046/11/15	370	340	38,317
US TREASURY	3.0000	2047/02/15	360	339	38,204
US TREASURY	3.0000	2047/05/15	360	338	38,178
US TREASURY	2.7500	2047/08/15	360	321	36,278
US TREASURY	2.7500	2047/11/15	360	321	36,249
US TREASURY	3.0000	2048/02/15	380	357	40,232

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
<b>アメリカ</b>		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	3.1250	2048/05/15	430	414	46,652
	US TREASURY	3.0000	2048/08/15	430	404	45,527
	US TREASURY	6.2500	2030/05/15	80	104	11,752
	US TREASURY	4.3750	2040/05/15	160	187	21,111
	US TREASURY	4.3750	2041/05/15	140	164	18,508
	US TREASURY	3.7500	2041/08/15	150	161	18,148
小計		-	-	-	-	8,096,694
<b>カナダ</b>				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.7500	2064/12/01	40	44	3,764
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2019/11/01	130	129	11,034
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2020/02/01	130	128	11,005
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2020/03/01	210	208	17,816
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/05/01	110	109	9,352
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2020/06/01	120	122	10,467
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/08/01	100	99	8,488
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2020/09/01	250	243	20,842
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2020/11/01	100	99	8,517
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2021/03/01	230	222	19,026
	CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2021/06/01	120	122	10,515
	CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2021/09/01	190	182	15,599
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2022/03/01	140	132	11,309
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2022/06/01	130	132	11,296
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2022/09/01	140	133	11,424
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2023/03/01	140	137	11,716
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2023/06/01	120	116	9,921
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2023/09/01	120	118	10,131
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2024/03/01	30	29	2,559
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2024/06/01	130	131	11,230
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2025/06/01	110	109	9,364
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/06/01	120	113	9,669
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2027/06/01	150	134	11,496
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0000	2027/06/01	40	57	4,906
CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/06/01	120	116	9,950	
CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/06/01	50	49	4,229	
CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2029/06/01	100	131	11,222	
CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/06/01	110	155	13,257	

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千カナダ・ドル	千円
<b>カナダ</b>		%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/06/01	120	165	14,179
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/06/01	140	177	15,187
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/01	160	193	16,552
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/01	140	149	12,798
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2051/12/01	30	27	2,321
小計		-	-	-	-	361,158
<b>オーストラリア</b>				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2020/04/15	230	237	19,558
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/11/21	250	248	20,440
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2021/05/15	280	304	25,066
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0000	2021/12/21	160	159	13,107
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2022/07/15	230	258	21,283
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2022/11/21	130	130	10,702
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5000	2023/04/21	230	261	21,481
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/04/21	250	254	20,952
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/04/21	250	261	21,516
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/04/21	300	334	27,525
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	280	325	26,763
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	260	262	21,574
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	250	241	19,853
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	240	241	19,882
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	200	210	17,310
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2029/11/21	150	150	12,407
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5000	2030/05/21	80	78	6,443
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	130	155	12,802
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	60	58	4,802
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/04/21	110	121	9,993
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	70	71	5,913	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2041/05/21	40	37	3,092	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	110	106	8,735	
小計		-	-	-	-	371,210
<b>シンガポール</b>				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.2500	2020/09/01	100	102	8,387
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2021/06/01	80	80	6,601
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.1250	2022/09/01	80	82	6,806
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2023/07/01	110	112	9,258
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2024/09/01	50	51	4,268
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/06/01	30	30	2,472

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千シンガポールドル	千円
シンガポール		%		千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/06/01	50	49	4,041
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	70	75	6,232
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2028/05/01	40	40	3,344
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	10	10	848
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	40	41	3,383
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	50	54	4,447
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	30	28	2,302
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	40	39	3,264
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	50	49	4,053
小計		-	-	-	-	69,712
イギリス				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	
国債証券	UK TREASURY	3.7500	2020/09/07	170	179	25,961
	UK TREASURY	3.7500	2021/09/07	140	151	21,960
	UK TREASURY	4.5000	2034/09/07	180	249	36,098
	UK TREASURY	4.5000	2042/12/07	180	269	38,963
	UK TREASURY	4.2500	2036/03/07	200	273	39,592
	UK TREASURY	4.2500	2046/12/07	160	239	34,616
	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	130	163	23,674
	UK TREASURY	4.2500	2032/06/07	150	198	28,721
	UK TREASURY	4.2500	2039/09/07	140	196	28,518
	UK TREASURY	4.2500	2040/12/07	160	227	32,968
	UK TREASURY	4.2500	2055/12/07	160	260	37,667
	UK TREASURY	4.7500	2020/03/07	170	178	25,904
	UK TREASURY	4.7500	2030/12/07	130	176	25,597
	UK TREASURY	4.0000	2022/03/07	120	132	19,209
	UK TREASURY	4.0000	2060/01/22	140	225	32,653
	UK TREASURY	4.7500	2038/12/07	140	208	30,122
	UK TREASURY	5.0000	2025/03/07	150	186	26,962
	UK TREASURY	8.0000	2021/06/07	120	142	20,580
	UK TREASURY	6.0000	2028/12/07	100	144	20,856
	UK TREASURY	1.5000	2021/01/22	240	244	35,356
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	170	174	25,237
	UK TREASURY	1.5000	2047/07/22	210	189	27,454
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	220	219	31,791
	UK TREASURY	1.6250	2028/10/22	150	153	22,221
	UK TREASURY	1.6250	2071/10/22	100	92	13,340
	UK TREASURY	1.0000	2024/04/22	80	80	11,589
	UK TREASURY	1.7500	2022/09/07	220	227	32,976

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						千円	千円
イギリス		%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
国債証券	UK TREASURY	1.7500	2049/01/22	30	28	4,151	
	UK TREASURY	1.7500	2057/07/22	150	144	20,952	
	UK TREASURY	2.2500	2023/09/07	160	170	24,643	
	UK TREASURY	2.7500	2024/09/07	120	131	19,101	
	UK TREASURY	2.0000	2020/07/22	240	245	35,514	
	UK TREASURY	2.0000	2025/09/07	160	169	24,588	
	UK TREASURY	3.5000	2068/07/22	160	244	35,338	
	UK TREASURY	3.2500	2044/01/22	220	276	40,023	
	UK TREASURY	3.7500	2052/07/22	140	204	29,545	
	UK TREASURY	3.5000	2045/01/22	210	275	39,939	
	UK TREASURY	4.2500	2049/12/07	130	200	28,998	
	UK TREASURY	0.5000	2022/07/22	240	237	34,400	
	UK TREASURY	0.7500	2023/07/22	250	248	35,940	
	UK TREASURY	1.7500	2037/09/07	130	127	18,495	
	UK TREASURY	2.5000	2065/07/22	170	203	29,510	
小計		-	-	-	-	1,171,742	
デンマーク				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	4.0000	2019/11/15	720	753	13,018	
	KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2020/11/15	410	417	7,206	
	KINGDOM OF DENMARK	3.0000	2021/11/15	830	916	15,844	
	KINGDOM OF DENMARK	1.5000	2023/11/15	490	531	9,176	
	KINGDOM OF DENMARK	1.7500	2025/11/15	720	803	13,880	
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2027/11/15	830	842	14,552	
	KINGDOM OF DENMARK	4.5000	2039/11/15	1,190	2,029	35,072	
小計		-	-	-	-	108,751	
ノルウェー				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.7500	2021/05/25	790	838	11,136	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2023/05/24	650	663	8,806	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0000	2024/03/14	420	449	5,965	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2025/03/13	310	310	4,123	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/02/19	320	313	4,166	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2027/02/17	340	337	4,476	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/04/26	210	211	2,806	
小計		-	-	-	-	41,482	
スウェーデン				千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ		
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	5.0000	2020/12/01	880	977	12,229	
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2022/06/01	940	1,062	13,290	
	SWEDISH GOVERNMENT	1.5000	2023/11/13	760	815	10,202	

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ
スウェーデン		%				千円
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	2.5000	2025/05/12	520	595	7,450
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0000	2026/11/12	620	648	8,114
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2028/05/12	560	568	7,115
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	430	601	7,519
小計		-	-	-	-	65,923
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0000	2019/12/11	1,980	1,910	10,582
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2020/06/11	2,570	2,551	14,134
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2021/06/10	3,300	3,141	17,404
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2022/06/09	2,550	2,380	13,185
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2023/12/07	1,670	1,619	8,970
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/05	2,490	2,625	14,547
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	1,490	1,239	6,865
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	2,400	2,186	12,115
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	840	806	4,466
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	1,450	1,291	7,154
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	720	628	3,480
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	900	954	5,290
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	1,230	1,132	6,272
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	1,830	1,539	8,528
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	600	515	2,856
小計		-	-	-	-	135,853
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3780	2019/11/29	260	262	7,058
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8890	2020/07/31	270	271	7,304
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1600	2021/07/15	310	314	8,447
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4180	2022/08/15	280	276	7,437
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4800	2023/03/15	280	275	7,418
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1810	2024/07/15	210	211	5,687
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/09/15	200	198	5,330
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/04/15	120	121	3,277
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9000	2026/11/30	60	58	1,581
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/03/15	250	244	6,574
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/06/15	80	77	2,080
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/04/15	110	110	2,960
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	120	117	3,148
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1270	2032/04/15	30	28	773
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	200	184	4,953

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
マレーシア		%		千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/05/31	70	65	1,769
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	110	109	2,933
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	100	99	2,676
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	80	76	2,063
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5.2480	2028/09/15	60	64	1,734
小計		-	-	-	-	85,214
南アフリカ				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.2500	2020/01/15	260	262	2,106
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.7500	2021/03/31	450	443	3,557
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.7500	2023/02/28	840	820	6,580
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5000	2026/12/21	2,030	2,186	17,537
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0000	2030/01/31	1,240	1,109	8,901
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0000	2031/02/28	1,020	831	6,666
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.2500	2032/03/31	830	741	5,943
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.8750	2035/02/28	810	746	5,988
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.2500	2036/03/31	890	630	5,056
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5000	2037/01/31	1,140	1,007	8,078
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0000	2040/01/31	730	668	5,361
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5000	2041/02/28	860	596	4,780
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2044/01/31	1,260	1,118	8,967
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2048/02/28	1,730	1,531	12,285
小計		-	-	-	-	101,812
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2020/04/25	280	280	8,342
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.2500	2020/10/25	330	353	10,516
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2021/10/25	590	655	19,517
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2022/09/23	420	473	14,120
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2023/10/25	550	588	17,543
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	330	337	10,059
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	350	337	10,051
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	300	285	8,502
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	140	134	4,016
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/04/25	70	85	2,552
小計		-	-	-	-	105,223
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ	
アイルランド						
国債証券	IRISH TREASURY	0.8000	2022/03/15	70	72	9,301
	IRISH TREASURY	1.0000	2026/05/15	100	102	13,165
	IRISH TREASURY	1.3000	2033/05/15	40	38	5,016

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ						
%						
千ユーロ						
千ユーロ						
千円						
<b>アイルランド</b>						
<b>国債証券</b>	IRISH TREASURY	1.3500	2031/03/18	30	30	3,870
	IRISH TREASURY	1.7000	2037/05/15	50	50	6,468
	IRISH TREASURY	2.0000	2045/02/18	80	82	10,595
	IRISH TREASURY	2.4000	2030/05/15	90	101	13,040
	IRISH TREASURY	0.0000	2022/10/18	50	50	6,451
	IRISH TREASURY	0.9000	2028/05/15	80	79	10,210
	IRISH TREASURY	3.4000	2024/03/18	70	81	10,511
	IRISH TREASURY	3.9000	2023/03/20	60	69	9,024
	TREASURY 4 1/2% 2020	4.5000	2020/04/18	90	96	12,431
	TREASURY 5% 2020	5.0000	2020/10/18	60	66	8,550
	TREASURY 5.4% 2025	5.4000	2025/03/13	110	143	18,473
小計		-	-	-	-	137,112
<b>オランダ</b>						
<b>国債証券</b>	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2020/01/15	140	141	18,260
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5000	2020/07/15	130	139	17,928
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.2500	2021/07/15	160	176	22,720
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2022/01/15	140	141	18,290
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.2500	2022/07/15	140	153	19,784
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2023/01/15	140	163	21,108
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.7500	2023/07/15	140	152	19,690
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2024/01/15	130	130	16,820
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2024/07/15	150	167	21,547
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2025/07/15	140	141	18,193
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2026/07/15	150	152	19,699
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2027/07/15	140	144	18,586
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/01/15	120	175	22,590
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2028/07/15	110	112	14,507
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/01/15	130	159	20,599
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/01/15	150	228	29,443
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/01/15	140	219	28,333
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/01/15	130	181	23,441
小計		-	-	-	-	371,548
<b>ベルギー</b>						
<b>国債証券</b>	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2020/09/28	180	194	25,082
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2021/09/28	150	170	21,935
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2022/03/28	130	148	19,210
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2022/09/28	150	176	22,713

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2023/06/22	130	144	18,578
	BELGIUM KINGDOM	0.2000	2023/10/22	90	90	11,711
	BELGIUM KINGDOM	2.6000	2024/06/22	140	159	20,517
	BELGIUM KINGDOM	0.5000	2024/10/22	70	71	9,169
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/06/22	150	154	19,912
	BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/03/28	100	129	16,663
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/06/22	130	134	17,350
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2027/06/22	130	131	16,913
	BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	170	242	31,341
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2028/06/22	130	129	16,714
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/06/22	100	98	12,722
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/03/28	80	108	13,980
	BELGIUM KINGDOM	1.2500	2033/04/22	40	39	5,154
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/06/22	70	86	11,147
	BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	180	276	35,618
	BELGIUM KINGDOM	1.4500	2037/06/22	40	39	5,096
	BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/06/22	60	63	8,193
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/03/28	160	238	30,788
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/06/22	90	128	16,560
	BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/06/22	100	95	12,285
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2057/06/22	40	42	5,451
	BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/06/22	40	40	5,216
小計						430,031
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2019/11/25	200	202	26,083
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2020/02/25	240	241	31,193
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2020/04/25	350	370	47,787
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2020/05/25	210	211	27,331
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2020/10/25	350	370	47,807
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2020/11/25	230	233	30,126
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2021/02/25	260	262	33,882
	FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2021/04/25	360	397	51,206
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2021/05/25	280	283	36,519
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2021/10/25	370	409	52,834
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2022/04/25	430	478	61,759
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2022/05/25	230	232	29,939
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2022/10/25	310	339	43,853

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス					
国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2023/03/25	250	251	32,381
FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2023/05/25	450	487	62,896
FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2023/10/25	430	521	67,238
FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2024/03/25	160	159	20,534
FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2024/05/25	320	358	46,215
FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	340	372	48,025
FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/05/25	340	345	44,555
FRANCE (GOVT OF)	6.0000	2025/10/25	270	375	48,466
FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	280	293	37,800
FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/04/25	330	406	52,418
FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/05/25	310	311	40,241
FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	280	274	35,430
FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2027/05/25	290	300	38,726
FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	350	415	53,593
FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/05/25	310	310	40,110
FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/11/25	160	159	20,578
FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/04/25	330	487	62,841
FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/05/25	310	364	46,952
FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/05/25	430	454	58,673
FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	300	483	62,364
FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2034/05/25	90	90	11,681
FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/04/25	250	383	49,433
FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/05/25	270	266	34,408
FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	240	350	45,261
FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2039/06/25	140	147	19,064
FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/04/25	310	490	63,227
FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/05/25	230	311	40,148
FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2048/05/25	230	245	31,653
FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/04/25	140	222	28,659
FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/04/25	120	194	25,143
FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/05/25	100	94	12,248
小計	-	-	-	-	1,801,301
ドイツ					
国債証券					
BUNDESobligation	0.0000	2020/04/17	170	171	22,132
BUNDESobligation	0.2500	2020/10/16	170	172	22,295
BUNDESobligation	0.0000	2021/04/09	200	202	26,154
BUNDESobligation	0.0000	2021/10/08	180	182	23,567

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ					
国債証券					
BUNDESobligation	0.0000	2022/04/08	170	172	22,264
BUNDESobligation	0.0000	2022/10/07	150	152	19,634
BUNDESobligation	0.0000	2023/10/13	120	121	15,647
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2020/01/04	210	219	28,304
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0000	2020/07/04	200	211	27,333
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.2500	2020/09/04	230	242	31,217
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2021/01/04	170	181	23,393
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2021/07/04	330	363	46,846
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2022/01/04	190	204	26,430
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2022/09/04	380	407	52,574
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/02/15	180	194	25,040
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/05/15	310	335	43,245
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2023/08/15	160	177	22,869
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2024/02/15	270	297	38,376
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2024/05/15	170	185	23,922
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2024/08/15	180	191	24,712
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/02/15	200	206	26,688
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	220	234	30,285
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	240	247	31,922
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	240	237	30,647
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	250	251	32,412
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2027/08/15	240	245	31,636
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2028/02/15	200	203	26,244
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2028/08/15	140	138	17,846
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/01/04	90	147	18,994
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/07/04	190	304	39,323
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	210	324	41,869
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	130	213	27,589
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	150	265	34,240
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	140	209	26,992
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	250	335	43,331
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	230	312	40,333
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	100	105	13,568
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2019/12/13	120	120	15,588
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2020/03/13	130	131	16,913
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2020/06/12	120	121	15,638
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	100	154	19,871

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ						
国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	140	207	26,819
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	110	156	20,167
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	150	238	30,798
小計		-	-	-	-	1,225,689
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3000	2019/10/31	170	177	22,899
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2020/01/31	210	214	27,660
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0000	2020/04/30	230	244	31,500
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.1500	2020/07/30	180	184	23,753
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8500	2020/10/31	170	186	24,049
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0500	2021/01/31	190	190	24,557
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5000	2021/04/30	230	260	33,656
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7500	2021/07/30	200	203	26,305
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0500	2021/10/31	30	29	3,857
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.8500	2022/01/31	210	247	31,973
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4000	2022/04/30	190	191	24,643
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4500	2022/10/31	170	170	21,988
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4000	2023/01/31	200	241	31,086
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.3500	2023/07/30	90	88	11,469
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4000	2023/10/31	200	236	30,448
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8000	2024/01/31	160	192	24,878
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8000	2024/04/30	190	219	28,371
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	230	254	32,815
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/04/30	200	207	26,742
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/07/30	210	258	33,322
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	210	224	28,909
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	180	188	24,358
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	190	253	32,742
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	200	199	25,722
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	170	170	22,005
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	210	208	26,947
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/04/30	190	186	24,117
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/07/30	150	146	18,923
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	170	224	28,941
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/01/31	240	337	43,523
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/07/30	200	201	25,991
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/07/30	200	289	37,374

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ			%	千ユーロ	千円	
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.3500	2033/07/30	140	143	18,480
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/01/31	180	230	29,756
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/07/30	170	238	30,816
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/07/30	190	261	33,708
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	130	190	24,613
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	160	165	21,350
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7000	2048/10/31	80	78	10,121
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/07/30	80	87	11,256
小計			-	-	-	1,035,642
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0500	2019/12/01	140	140	18,133
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2020/02/01	210	218	28,232
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2020/03/01	220	229	29,542
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.7000	2020/05/01	200	198	25,658
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.3500	2020/06/15	120	118	15,297
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2020/09/01	240	250	32,357
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.2000	2020/10/15	140	136	17,660
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2020/11/01	170	167	21,612
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/03/01	220	229	29,657
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0500	2021/04/15	150	144	18,575
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/05/01	160	167	21,550
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.4500	2021/06/01	170	164	21,206
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/08/01	490	511	65,941
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2021/12/15	300	300	38,725
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2022/04/15	530	512	66,161
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/09/01	180	199	25,674
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2022/09/15	330	317	40,962
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/11/01	200	221	28,541
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2023/03/15	320	298	38,470
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2023/05/01	180	193	24,915
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2023/08/01	230	249	32,229
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2023/10/15	180	162	21,022
	BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0000	2023/11/01	110	140	18,183
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2024/03/01	220	235	30,432
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8500	2024/05/15	150	141	18,254
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2024/09/01	180	186	24,037
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2024/12/01	320	310	40,097

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2025/03/01	230	254	32,784
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2025/06/01	320	289	37,338
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/01	240	222	28,642
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/03/01	200	215	27,838
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6000	2026/06/01	170	151	19,586
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2500	2026/12/01	160	138	17,836
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2000	2027/06/01	160	146	18,851
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0500	2027/08/01	190	170	22,034
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5000	2027/11/01	250	307	39,598
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2028/02/01	170	151	19,564
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/09/01	220	243	31,359
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2028/12/01	90	84	10,879
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/01	260	297	38,388
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/03/01	210	207	26,765
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/05/01	280	342	44,197
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/03/01	200	159	20,571
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/02/01	190	229	29,587
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2033/09/01	150	128	16,573
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/08/01	230	261	33,693
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/09/01	140	113	14,586
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/02/01	260	264	34,083
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.9500	2038/09/01	110	94	12,244
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/08/01	210	237	30,595
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/09/01	210	236	30,470
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/09/01	160	175	22,676
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/09/01	150	132	17,077
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/03/01	150	120	15,514
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2048/03/01	140	125	16,234
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/03/01	60	46	6,045
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/01	120	152	19,657
小計		-	-	-	-	1,528,414
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	3.3750	2020/04/15	60	63	8,171
	FINNISH GOVERNMENT	0.3750	2020/09/15	50	50	6,559
	FINNISH GOVERNMENT	3.5000	2021/04/15	60	65	8,479
	FINNISH GOVERNMENT	1.6250	2022/09/15	90	96	12,435
	FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2023/04/15	50	53	6,914

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>フィンランド</b>						
<b>国債証券</b>						
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2023/09/15	50	50	6,470
	FINNISH GOVERNMENT	2.0000	2024/04/15	40	44	5,710
	FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/07/04	50	62	8,056
	FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/09/15	40	41	5,379
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/04/15	50	50	6,523
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2027/09/15	50	49	6,434
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/07/04	70	84	10,845
	FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/04/15	40	39	5,098
	FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2034/04/15	40	40	5,246
	FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/07/04	40	52	6,720
小計		-	-	-	-	109,044
<b>オーストリア</b>						
<b>国債証券</b>						
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9000	2020/07/15	130	139	18,015
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5000	2021/09/15	150	166	21,522
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.6500	2022/04/20	80	90	11,733
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2022/09/20	70	70	9,113
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4000	2022/11/22	100	114	14,797
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.7500	2023/10/20	160	174	22,511
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.6500	2024/10/21	90	98	12,684
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2000	2025/10/20	100	106	13,730
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	80	106	13,719
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2026/10/20	110	112	14,552
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2027/04/20	80	79	10,313
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	80	119	15,357
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2028/02/20	90	91	11,755
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/05/23	70	83	10,731
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	130	193	25,013
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/06/20	60	83	10,743
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/02/20	50	50	6,513
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/01/26	40	67	8,767
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2086/11/02	20	18	2,329
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1000	2117/09/20	40	43	5,672
小計		-	-	-	-	259,576
ユーロ小計		-	-	-	-	6,898,363
合計		-	-	-	-	17,613,140

## 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	%
公社債	17,613,140	98.6
コール・ローン等、その他	253,504	1.4
投資信託財産総額	17,866,645	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シンガポール・ドル82.17円、1イギリス・ポンド144.81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メキシコ・ペソ5.54円、1マレーシア・リングgit26.90円、1南アフリカ・ランド8.02円、1ポーランド・ズロチ29.79円、1ユーロ128.98円です。

(注2) 外貨建純資産（17,731,935千円）の投資信託財産総額（17,866,645千円）に対する比率は99.2%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

## ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

### 資産、負債、元本および基準価額の状況

(2018年11月20日現在)

項目	当期末
<b>(A)資産</b>	<b>17,915,615,404円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	132,034,626
公 社 債(評価額)	17,613,140,774
未 収 入 金	49,636,345
未 収 利 息	113,252,488
前 払 費 用	7,551,171
<b>(B)負債</b>	<b>146,922,591</b>
未 払 金	128,197,594
未 払 解 約 金	18,722,533
そ の 他 未 払 費 用	2,464
<b>(C)純 資 産 総 額(A - B)</b>	<b>17,768,692,813</b>
元 本	13,426,526,479
次 期 繰 越 損 益 金	4,342,166,334
<b>(D)受 益 権 総 口 数</b>	<b>13,426,526,479口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C / D)</b>	<b>13,234円</b>

(注1)	期首元本額	12,105,288,821円
	期中追加設定元本額	2,723,768,228円
	期中一部解約元本額	1,402,530,570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。	
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型)	1,461,969,133円
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (標準型)	2,584,015,447円
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型)	903,148,588円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ外国債券インデックスファンド	7,278,919,564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)	528,387,080円
	D Cニッセイ外国債券インデックス	561,411,674円
	D Cニッセイターゲットデートファンド2055	5,967,897円
	D Cニッセイワールドセレクトファンド (安定型)	59,712,782円
	D Cニッセイターゲットデートファンド2045	3,292,189円
	D Cニッセイターゲットデートファンド2035	4,935,002円
	D Cニッセイターゲットデートファンド2025	2,849,336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)	18,318,542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)	1,959,566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)	11,639,679円

### 損益の状況

当期 (2018年5月22日~2018年11月20日)

項目	当期
<b>(A)配 当 等 収 益</b>	<b>205,719,770円</b>
受 取 利 息	205,757,393
支 払 利 息	△ 37,623
<b>(B)有 価 証 券 売 買 損 益</b>	<b>△ 200,798,492</b>
売 買 益	180,386,988
売 買 損	△ 381,185,480
<b>(C)信 託 報 酬 等</b>	<b>△ 3,607,130</b>
<b>(D)当 期 損 益 金(A + B + C)</b>	<b>1,314,148</b>
<b>(E)前 期 繰 越 損 益 金</b>	<b>3,921,668,054</b>
<b>(F)追 加 信 託 差 損 益 金</b>	<b>879,729,378</b>
<b>(G)解 約 差 損 益 金</b>	<b>△ 460,545,246</b>
<b>(H)合 計(D + E + F + G)</b>	<b>4,342,166,334</b>
<b>次 期 繰 越 損 益 金(H)</b>	<b>4,342,166,334</b>

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