

第1期末（2015年11月20日）	
基準価額	10,528円
純資産総額	486百万円
騰落率	5.3%
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：2015年8月27日～2015年11月20日

第1期（決算日 2015年11月20日）

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイ・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1期の決算を行いました。

当ファンドは、基本投資割合に従った4つのマザーファンド（ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、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。

今後とも是非ご継続頂き、いっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 **0120-762-506(コールセンター)**

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

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

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

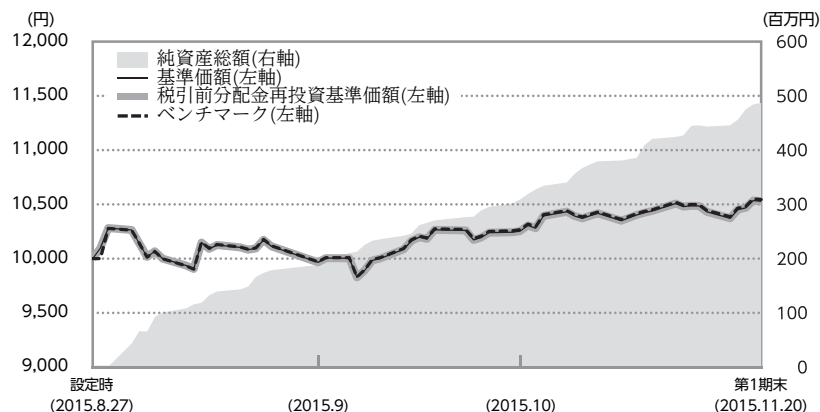
東京都千代田区丸の内1-6-6

<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)

運用経過

(2015年8月27日から2015年11月20日まで)

基準価額等の推移



設定時	10,000円
第1期末	10,528円
既払分配金	0円
騰落率 (分配金再投資ベース)	5.3%

- (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、設定時の基準価額にあわせて指数化しています。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかにについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) ベンチマークは、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)、シティ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は、株式会社東京証券取引所が有しています。NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社が、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負いません。MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。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。シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。以下同じです。

■基準価額の主な変動要因

設定時は、中国景気に対する懸念や米国の金融政策をめぐる不透明感等から、内外株式市場は不安定な動きが続きました。その後、中国市場の落ち着いた動き、早期の米利上げ観測の後退、欧州の金融緩和期待などから景気後退懸念が縮小するにつれ、内外株式市場が上昇基調となったことを受けて、基準価額も上昇傾向で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%	25.0%	9.3%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	25.0	24.9	0.5
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	25.0	25.0	11.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25.0	25.0	0.7

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)

1 万口当たりの費用明細

項目	第 1 期		項目の概要
	2015年8月27日～2015年11月20日		
	金額	比率	
信託報酬	9円	0.086%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,227円です。
(投信会社)	(4)	(0.039)	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 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
(販売会社)	(4)	(0.039)	
(受託銀行)	(1)	(0.009)	
売買委託手数料	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 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.002	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
(株式)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	2	0.019	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用 ・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
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(2)	(0.016)	
合計	11	0.108	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

<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)

最近5年間の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、設定時を10,000として指数化しています。

決算日		2015年8月27日	2015年11月20日
基準価額 (分配前)	(円)	10,000	10,528
期間分配金合計 (税引前)	(円)	—	0
税引前分配金再投資基準価額の騰落率	(%)	—	5.3
ベンチマーク騰落率	(%)	—	5.4
純資産総額	(百万円)	1	486

(注1) 当ファンドの設定日は2015年8月27日です。

(注2) 設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。

投資環境

■国内株式市況

設定時は、中国株式市場の変動や米利上げ時期に対する不透明感などを背景に、国内株式市場も乱高下する展開となりました。10月に入ると、日銀の追加金融緩和への期待や、欧州中央銀行（ECB）のドラギ総裁が追加金融緩和策の可能性を示唆したことなどから、投資家のリスク回避姿勢が後退したため堅調に推移しました。その後も米国において、好調な雇用統計を受けた利上げ観測により円安が進行したことなどから、上昇基調のまま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、軟調な株式市場や日銀の国債買い入れオペによる需給ひっ迫化などを受けて低下基調で始まりました。日銀の追加金融緩和見送りに伴う失望感から反発する場面もありましたが、需給の引き締まりが上昇を抑える要因となりました。10月以降も、米国における利上げ観測の後退を受けた長期金利の低下や、日銀の追加金融緩和観測から下落基調をたどりしました。その後は、早期の追加金融緩和観測が後退したものの、需給による下支え要因が根強く、もみ合い推移で当期末を迎えました。

■海外株式市況

設定時は、中国経済の成長に対する減速懸念が投資家のリスク回避姿勢を強め、海外株式市場は振れ幅の大きな展開となりました。10月初旬以降は、ECB総裁による金融緩和を示唆する発言や、中国人民銀行（中央銀行）による利下げ発表といった各国政策当局の金融緩和的な姿勢が好感されて市場は上昇基調で当期末を迎えました。

<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)

■海外債券市況

当期の米国10年国債金利は、設定時、米利上げに対する警戒感から上昇する場面もありましたが、9月の米連邦公開市場委員会（FOMC）において新興国経済への懸念が指摘されたことで低下しました。その後は、米国において雇用統計が軟調であったことを受けた年内利上げ観測の後退が金利の低下要因となる一方、投資家のリスク選好姿勢の強まりが上昇要因となり、横ばい圏で推移しました。10月下旬から期末にかけては、年内の利上げ検討を表明したFOMCや米連邦準備制度理事会（FRB）のイエレン議長の議会証言を受け、利上げ観測が高まったことから金利は上昇し、結局、2.2%台で当期末を迎えました。

ドイツ10年国債金利は、ECBの追加金融緩和観測の高まりなどから低下が進み、結局、0.4%台で当期末を迎えました。

■為替市況

当期の米・ドル／円レートは、前半は、米国において雇用統計が軟調であったことを受けた利上げ観測の後退が下落要因となる一方、中国の政策期待等による投資家のリスク選好姿勢の強まりが上昇要因となり、おおむね横ばい圏で推移しました。後半は、年内の利上げ検討を表明したFOMCやイエレンFRB議長の議会証言を受けた米利上げ観測の高まりなどから上昇し、結局、122円台後半で当期末を迎えました。

ユーロ／円レートは、前半は、ECBの追加金融緩和観測が下落要因となる一方、中国の政策期待等から投資家のリスク回避姿勢がいったん後退したことが上昇要因となり、上下する展開となりました。後半は、ドラギECB総裁の発言などから追加金融緩和観測が一段と強まったことで下落基調で推移し、結局、131円台後半で当期末を迎えました。

<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)

ポートフォリオ

■当ファンド

基本投資割合に従って4つのマザーファンド（ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、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>

当期も東証一部上場銘柄のうち1,600銘柄程度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（市場でのウェイト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先物も一部利用しました。

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

<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トツモデルを利用して、ポートフォリオのデュレーション（注）、残存期間別構成比（短期・中期・長期・超長期別の構成比）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。

当期も上記クオントツモデルに基づき、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。

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

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

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

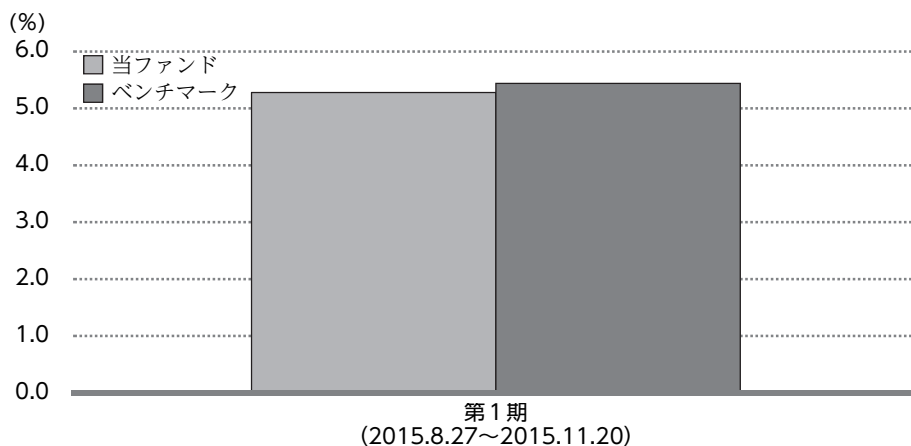
<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く世界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。

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

<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)

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+5.3%となり、ベンチマーク騰落率(+5.4%)にほぼ連動しました。

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
	2015年8月27日 ~2015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	527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。

<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)

今後の運用方針

■当ファンド

基本投資割合に従って4つのマザーファンド（ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド、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>

国内の証券取引所上場株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。

<ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

クオンツモデルに基づき、N O M U R A - B P I 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。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

<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)

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1期末 2015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	25.0%
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	24.9
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	25.0
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	25.0

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

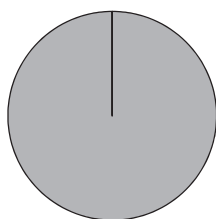
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

項目	第1期末 2015年11月20日
純資産総額	486,839,871円
受益権総口数	462,426,178口
1万口当たり基準価額	10,528円

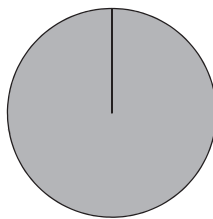
(注) 当期間中における追加設定元本額は490,620,345円、同解約元本額は29,194,167円です。

■資産別配分



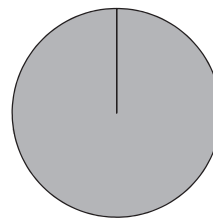
親投資信託受益証券
100.0%

■国別配分



日本
100.0%

■通貨別配分



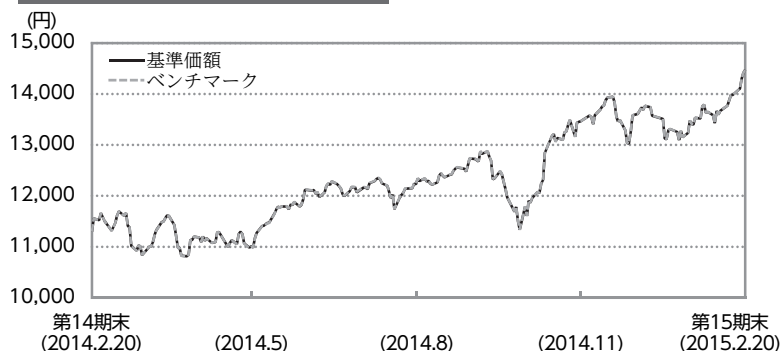
円
100.0%

(注) 資産別・国別・通貨別配分の比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

<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

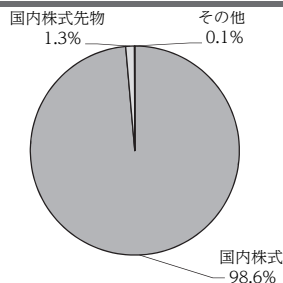
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	5.0%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	2.7
ソフトバンク	円	1.6
本田技研工業	円	1.6
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.6
みずほフィナンシャルグループ	円	1.3
日本電信電話	円	1.3
KDDI	円	1.2
ファナック	円	1.1
武田薬品工業	円	1.1
組入銘柄数	1,625	

■1万口当たりの費用明細

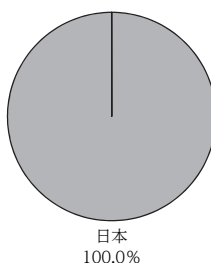
(2014.2.21~2015.2.20)

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

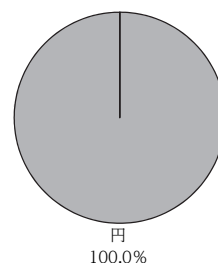
■資産別配分



■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す。費用項目については2ページの注記をご参照ください。

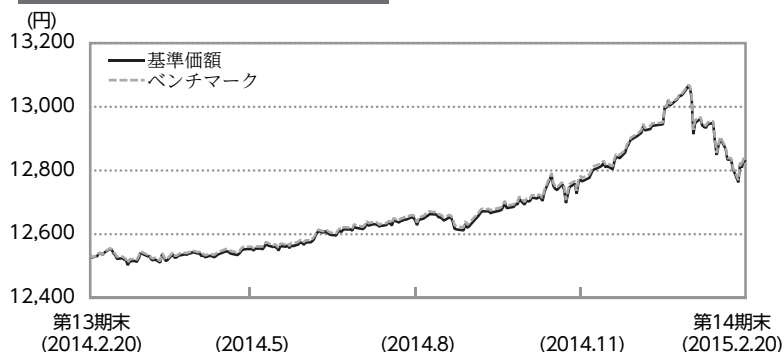
(注2) 上位銘柄・資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2015年2月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

<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。

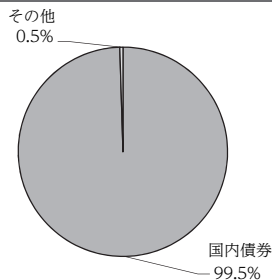
■上位銘柄

銘柄名	通貨	比率
第26回 利付国債(30年)	円	7.7%
第117回 利付国債(20年)	円	7.5
第125回 利付国債(20年)	円	7.5
第292回 利付国債(10年)	円	7.5
第72回 利付国債(20年)	円	7.4
第107回 利付国債(5年)	円	6.6
第291回 利付国債(10年)	円	6.3
第96回 利付国債(5年)	円	6.1
第321回 利付国債(10年)	円	5.3
第338回 利付国債(2年)	円	4.4
組入銘柄数	30	

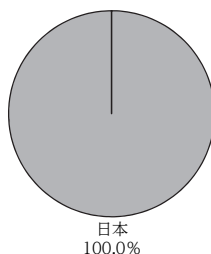
■1万口当たりの費用明細

当期(2014年2月21日～2015年2月20日)における費用はありません。

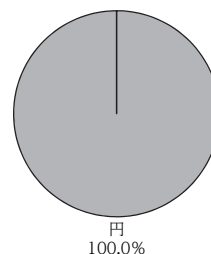
■資産別配分



■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す。費用項目については2ページの注記をご参照ください。

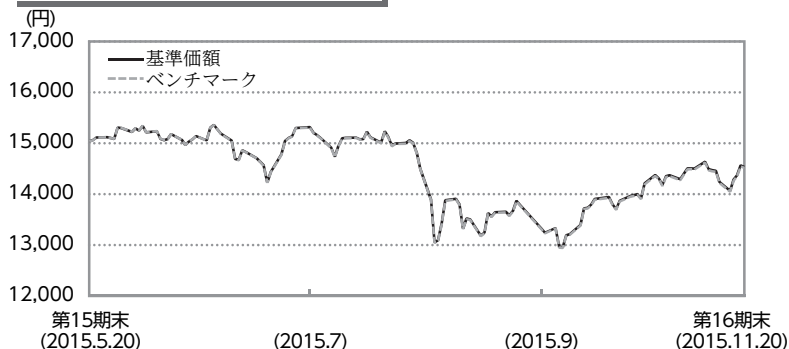
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2015年2月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

<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。なお円換算ベースの指数は、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有します。

■上位銘柄

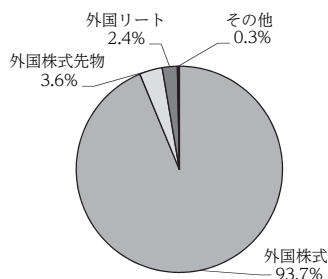
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米・ドル	2.2%
MICROSOFT CORP	米・ドル	1.3
EXXON MOBIL CORP	米・ドル	1.1
GENERAL ELECTRIC CO	米・ドル	1.0
JOHNSON & JOHNSON	米・ドル	0.9
WELLS FARGO & CO	米・ドル	0.9
AMAZON.COM INC	米・ドル	0.8
JPMORGAN CHASE & CO	米・ドル	0.8
NESTLE SA	スイス・フラン	0.8
ALPHABET INC-CL C	米・ドル	0.7
組入銘柄数	1,315	

■1万口当たりの費用明細

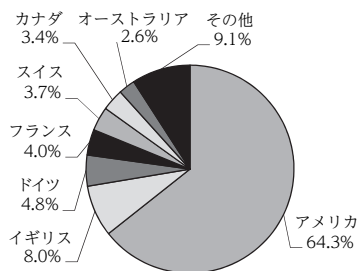
(2015.5.21~2015.11.20)

項目	金額
売買委託手数料	1円
(株式)	(0)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	1
(株式)	(1)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	8
(その他)	(8)
合計	10

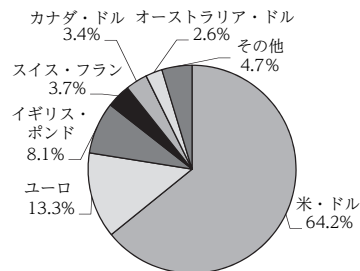
■資産別配分



■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す。費用項目については2ページの注記をご参照ください。

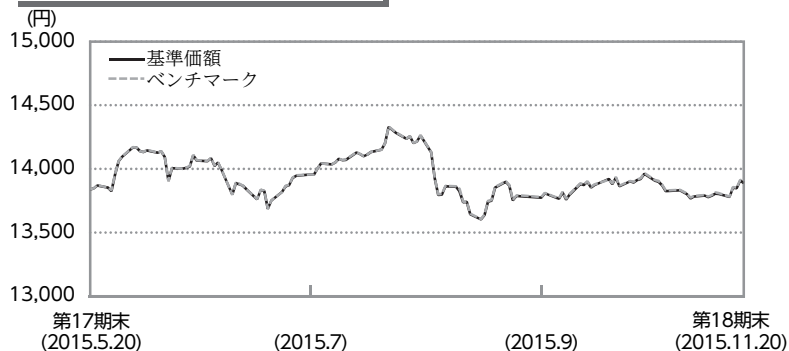
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2015年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

<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) ベンチマークはシティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なお円換算ベースの指数は、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。シティ世界国債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Citigroup Index LLCに帰属します。Citigroup Index LLC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

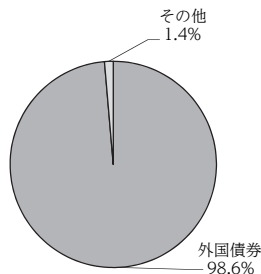
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY N/B 3.125% 2017/1/31	米・ドル	2.4%
US TREASURY N/B 1.25% 2019/10/31	米・ドル	1.1
US TREASURY N/B 0.875% 2017/10/15	米・ドル	0.9
US TREASURY N/B 0.625% 2017/8/31	米・ドル	0.8
US TREASURY N/B 2.375% 2017/7/31	米・ドル	0.8
US TREASURY N/B 3.5% 2018/2/15	米・ドル	0.8
US TREASURY N/B 4.5% 2017/5/15	米・ドル	0.7
US TREASURY N/B 1.625% 2019/12/31	米・ドル	0.7
US TREASURY N/B 0.75% 2017/3/15	米・ドル	0.7
US TREASURY N/B 2.625% 2020/11/15	米・ドル	0.7
組入銘柄数	521	

■1万口当たりの費用明細

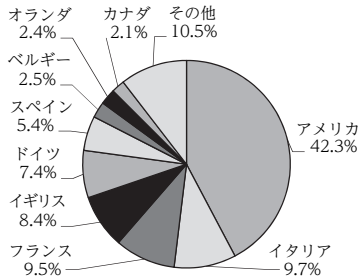
(2015.5.21～2015.11.20)

項目	金額
その他費用 (その他)	4円 (4)
合計	4

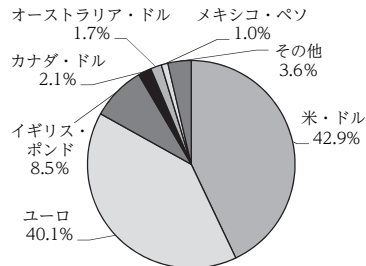
■資産別配分



■国別配分



■通貨別配分



(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものです。費用項目については2ページの注記をご参照ください。

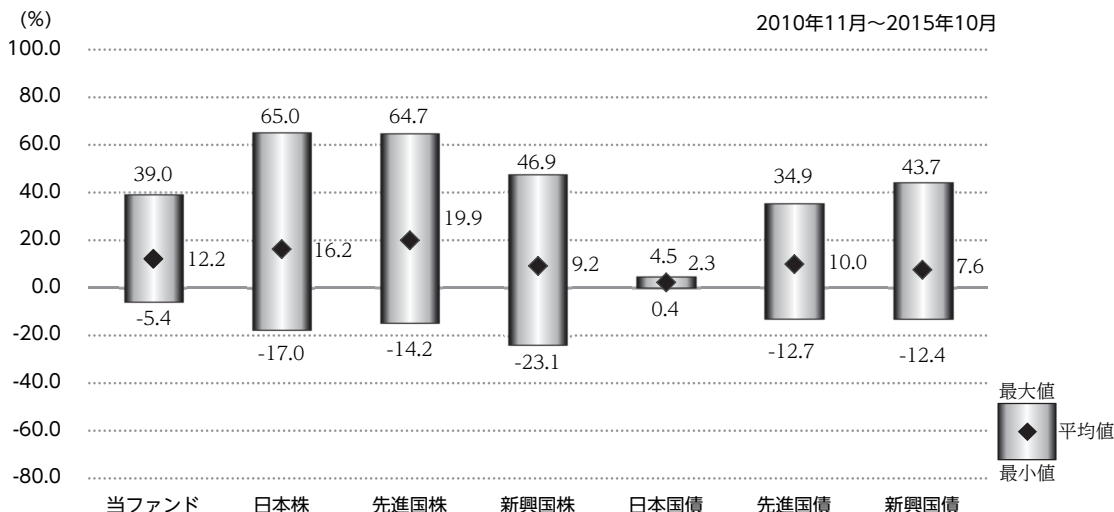
(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日(2015年11月20日現在)のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。

(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。

<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)

参考情報

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(注1) 上記は、当ファンドの騰落率(税引前分配金再投資基準価額騰落率)と代表的な資産クラスの騰落率を比較したものであり、各資産クラスは当ファンドの投資対象を表しているものではありません。

(注2) 2010年11月～2015年10月の5年間における1年リターンの平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものであり、決算日に対応した数値とは異なります。

(注3) 当ファンドについては設定日以降のデータが5年分に満たないため、設定日以前のデータはファンドのベンチマークを用いて騰落率を算出しています。したがって、すべてがファンドの実績ではありません。

<代表的な資産クラスにおける各資産クラスの指数>

- 日本株・・・TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
- 先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
- 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債・・・NOMURA-BPI 国債
- 先進国債・・・シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

- すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 海外の指数は、「為替ヘッジなし(対円)」の指数を採用しています。

- 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は、株式会社東京証券取引所が有しています。
- MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。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。
- MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表している指数です。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。
- NOMURA-BPI 国債とは、野村證券株式会社が公表している指数で、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、一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。
- JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイドは、JPモルガン社が算出する債券インデックスであり、その著作権および知的所有権は同社に帰属します。

◆設定以来の運用実績

決 算 期	基準価額			(ご参考)	ベンチマーク		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
	(分配落)	税引前 分配金	期 中 騰落率	基準価額+ 累計分配金	期 中 騰落率						
(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

(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。以下同じです。

(注 2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

(注 3) 「基準価額＋累計分配金」は、当該決算期の基準価額(分配落)に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

(注 4) ベンチマークは、T O P I X (東証株価指数) (配当込み)、N O M U R A - B P I 総合、M S C I コクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)、シティ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。T O P I X (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は、株式会社東京証券取引所が有しています。N O M U R A - B P I 総合とは、野村證券株式会社が公表している指数で、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、一切責任を負いません。M S C I コクサイ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。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。シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、著作権、商標権、知的財産権、その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。以下同じです。

(注 5) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「株式組入比率」「株式先物比率」「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 6) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		ベンチマーク		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
	騰 落 率	騰落率						
(設 定 日)	円	%		%	%	%	%	%
2015年 8 月 27 日	10, 000	—	10, 000	—	—	—	—	—
8 月 末	10, 264	2. 6	10, 262	2. 6	46. 8	3. 1	49. 4	0. 6
9 月 末	9, 893	△1. 1	9, 898	△1. 0	46. 5	1. 5	50. 6	0. 6
10月 末	10, 417	4. 2	10, 429	4. 3	48. 2	1. 9	48. 6	0. 6
(期 末)								
2015年11月20日	10, 528	5. 3	10, 544	5. 4	47. 8	1. 6	49. 3	0. 6

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は設定日比です。

◆親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2015年８月27日～2015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	85,312	125,992	7,868	11,970
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	99,079	128,498	5,843	7,589
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	90,732	125,803	6,869	9,662
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	93,239	128,897	5,499	7,589

(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	2,790,995千円	8,379,074千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	40,089,148千円	45,118,213千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.06	0.18

(注１) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注２) 外国株式の(a)は各月末(決算日の属する月については決算日)、(b)は各月末の国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注３) 単位未満は切り捨てています。

◆利害関係人との取引状況等

(2015年８月27日～2015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

(2015年11月20日現在)

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	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	77,444	121,944
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	93,236	121,141
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	83,863	121,887
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	87,740	121,871

(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28,430,212千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが25,037,806千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが35,008,790千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが7,892,091千口です。

◆投資信託財産の構成

(2015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	121,944	25.0
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	121,141	24.8
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	121,887	25.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	121,871	25.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,374	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	488,218	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122.96円、1カナダ・ドル92.42円、1オーストラリア・ドル88.42円、1香港・ドル15.87円、1シンガポール・ドル86.96円、1ニュージーランド・ドル80.65円、1イギリス・ポンド187.85円、1イスラエル・シェケル31.74円、1スイス・フラン121.18円、1デンマーク・クローネ17.66円、1ノルウェー・クローネ14.27円、1スウェーデン・クローナ14.15円、1メキシコ・ペソ7.38円、1マレーシア・リンギット28.32円、1南アフリカ・ランド8.77円、1ポーランド・ズロチ30.99円、1ユーロ131.76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(50,614,764千円)の投資信託財産総額(51,134,326千円)に対する比率は99.0%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(10,912,374千円)の投資信託財産総額(11,015,754千円)に対する比率は99.1%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

(2015年11月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	488,218,893円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	207,957
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	121,944,523
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	121,141,976
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	121,887,228
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	121,871,158
未 収 入 金	1,166,051
(B) 負 債	1,379,022
未 払 解 約 金	1,151,801
未 払 信 託 報 酬	220,772
そ の 他 未 払 費 用	6,449
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	486,839,871
元 本	462,426,178
次 期 繰 越 損 益 金	24,413,693
(D) 受 益 権 総 口 数	462,426,178口
1万口当たり基準価額 (C／D)	10,528円

(注) 設定元本額 1,000,000円
 期中追加設定元本額 490,620,345円
 期中一部解約元本額 29,194,167円

◆損益の状況

当期 (2015年 8 月 27 日～2015年11月20日)

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	14,016,081円
売 買 益	14,639,411
売 買 損	△ 623,330
(B) 信 託 報 酬 等	△ 227,221
(C) 当 期 損 益 金 (A＋B)	13,788,860
(D) 追 加 信 託 差 損 益 金 *	10,624,833
(売 買 損 益 相 当 額)	(10,624,833)
(E) 合 計 (C＋D)	24,413,693
次 期 繰 越 損 益 金 (E)	24,413,693
追 加 信 託 差 損 益 金	10,624,833
(配 当 等 相 当 額)	(927,306)
(売 買 損 益 相 当 額)	(9,697,527)
分 配 準 備 積 立 金	13,788,860

(注1) (A)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) (B)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) (D)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。設定時の金額に、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

計算期間末における信託報酬等控除後の配当等収益(1,626,347円)、信託報酬等控除後の有価証券売買等損益(12,162,513円)、追加信託差損益金(10,624,833円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は24,413,693円(1万口当たり527.95円)ですが、当期の収益分配は見送らせていただきました。

※当ファンドは、マザーファンドの配当等収益および追加信託差損益金相当額を分配対象収益に充当する方式を適用しており、上記の計算過程はこの方式による調整後の金額を記載しています。

<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)

お知らせ

■自社による当ファンドの設定解約状況

当 設 定 元 本	期 解 約 元 本	当期末残高			取引の理由
		元 本	評価額	比 率	
百万円 1	百万円 －	百万円 1	百万円 1	% 0.2	当初設定時における取得

(注) 元本および評価額の単位未満は切り捨てています。なお当社は自社による当ファンドの保有分を解約することがあります。

■関連会社の実質保有比率

2015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、委託会社の主要株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に32.2%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)

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	国内の証券取引所上場株式
	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	日本を除く世界主要先進国の株式
	ニッセイ外国債券 インデックスマザーファンド	日本を除く世界主要先進国の国債
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、本邦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

.....

(計算期間：2014年2月21日～2015年2月20日)

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	国内の証券取引所上場株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）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を維持する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	国内の証券取引所上場株式
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は行いません。



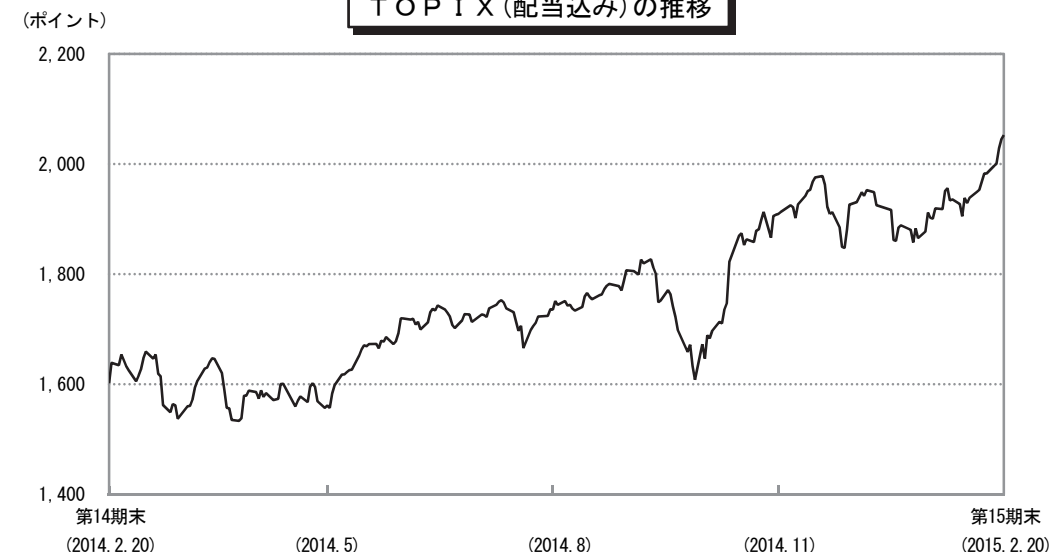
– 21 –

運用経過

(2014年2月21日から2015年2月20日まで)

国内株式市況

T O P I X (配当込み)の推移



(注) 指数はブルームバークのデータを使用しています。

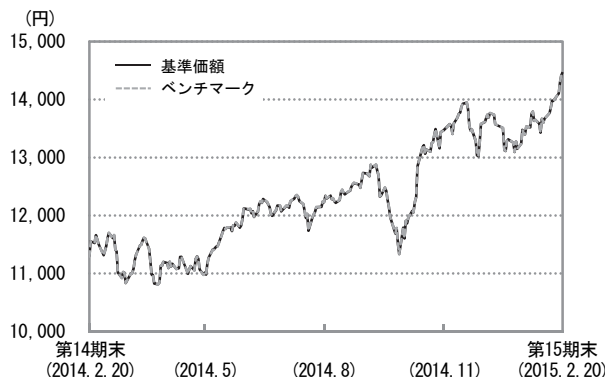
前期末を1,601.85ポイントでスタートしたT O P I X (東証株価指数) (配当込み)は、前期末から5月中旬にかけては、ウクライナ情勢の緊迫化や円高の進行などを背景に下落基調となりました。しかしその後は、米国・中国の景気回復期待や海外株高、日本政府の成長戦略への期待、円安の進行などを受けて堅調に推移しました。

10月に入ると、国際通貨基金(I M F)が世界経済の成長見通しを下方修正したことを受けて、世界経済の景気減速懸念が広がったことなどから、株価は大幅に下落しましたが、日銀が追加金融緩和の決定をしたことや年金積立金管理運用独立行政法人(G P I F)の運用資産における国内株式比率の引き上げなどを背景に急速に反発し、その後も、消費再増税の延期などを受けて堅調に推移しました。

12月には、原油安を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから株価は下落する場面もありましたが、米連邦準備制度理事会(F R B)議長が利上げに慎重なスタンスを表明したことなどを受けて上昇に転じました。

年明け以降は、ギリシャ情勢の不透明感などにより株価は下落して始まりましたが、その後は、欧州中央銀行(E C B)による量的緩和決定や国内企業の好決算発表等を背景に上昇し、結局、T O P I X (配当込み)は2,052.67ポイント(前期末比騰落率+28.1%)で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

当期は、国内株式市場が期後半に上昇基調を強めたことから、基準価額も同様の推移となりました。10月下旬に日銀が追加金融緩和の決定をしたことや、GPIFの運用資産における国内株式比率の引き上げ、年明け以降のECBによる量的緩和決定や国内企業の好決算発表等を背景に株価が上昇したことから、基準価額も上昇して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のうち1,600銘柄程度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(市場でのウェイトが大きな銘柄については、ベンチマークであるTOPIX(配当込み)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+28.2%となり、ベンチマーク騰落率(+28.1%)に連動しました。

今後の運用方針

今後も運用方針に基づき、ベンチマークであるＴＯＰＩＸ（配当込み）への連動をめざし、引き続き、きめ細やかな対応を進めます。

お知らせ

■約款変更

「投資信託及び投資法人に関する法律」ならびに一般社団法人投資信託協会規則の改正に伴い、関連条項に所要の変更を行いました。
(2014 年 12 月 1 日)

◆最近5期の運用実績

決 算 期	基準価額	期 中 騰落率	ベンチマーク	期 中 騰落率	株 式 組入比率	株 式 先物比率	純資産 総 額
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2011年2月21日)	8,630	9.2	8,701	9.2	99.4	0.5	33,480
12期(2012年2月20日)	7,427	△13.9	7,487	△14.0	98.2	1.3	29,035
13期(2013年2月20日)	9,039	21.7	9,115	21.8	98.4	1.1	35,007
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

(注1) ベンチマークはT O P I X (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T O P I X (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) 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
(期 首)	円	%		%	%	%
2014年2月20日	11,293	—	11,401	—	98.6	1.4
2月末	11,458	1.5	11,567	1.5	97.1	2.9
3月末	11,483	1.7	11,590	1.7	95.0	4.9
4月末	11,093	△ 1.8	11,201	△ 1.8	97.4	3.9
5月末	11,473	1.6	11,577	1.5	97.2	2.6
6月末	12,066	6.8	12,187	6.9	98.7	1.3
7月末	12,323	9.1	12,447	9.2	98.6	1.3
8月末	12,217	8.2	12,339	8.2	98.7	1.4
9月末	12,768	13.1	12,896	13.1	97.7	2.2
10月末	12,844	13.7	12,968	13.7	97.5	2.6
11月末	13,586	20.3	13,714	20.3	97.8	2.3
12月末	13,572	20.2	13,704	20.2	99.1	1.2
2015年1月末	13,647	20.8	13,779	20.9	98.6	1.3
(期 末)						
2015年2月20日	14,473	28.2	14,609	28.1	98.6	1.3

(注) 騰落率は期首比です。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

◆売買および取引の状況

(2014年2月21日～2015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 9,164 (△ 100)	千円 9,361,555	千株 6,892	千円 7,186,997

(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) 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 11,121	百万円 11,208	百万円 111	百万円 110

(注) 単位未満は切り捨てています。

◆主要な売買銘柄

(2014年2月21日～2015年2月20日)

株 式

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	59	381,969	6,387	トヨタ自動車	51	329,434	6,409
三菱UFJフィナンシャル・グループ	373	226,613	606	三菱UFJフィナンシャル・グループ	230	144,594	627
ソフトバンク	26	195,949	7,536	ソフトバンク	15	114,395	7,575
三井住友フィナンシャルグループ	32	146,316	4,543	本田技研工業	31	113,294	3,562
本田技研工業	38	141,783	3,654	三井住友フィナンシャルグループ	26	112,505	4,261
みずほフィナンシャルグループ	652	134,186	205	ファナック	5	97,548	18,759
KDDI	17	114,917	6,642	日本電信電話	14	91,338	6,477
三井不動産	32	104,611	3,269	日本たばこ産業	22	80,617	3,647
日本電信電話	16	99,841	5,942	みずほフィナンシャルグループ	382	76,957	201
リクルートホールディングス	23	91,213	3,914	三井物産	45	72,600	1,609

(注1) 金額は受渡代金です。

(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

(2015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
水産・農林業(0.1%)			
極洋	8	9	2,628
日本水産	25	26	9,868
マルハニチロ	—	4	7,236
マルハニチロホールディングス	40	—	—
サカタのタネ	3	3	6,874
ホクト	2	2	5,808
鉱業(0.4%)			
住石ホールディングス	4	6	755
日鉄鉱業	5	6	2,688
三井松島産業	14	14	1,890
国際石油開発帝石	100	113	162,761
日本海洋掘削	0.500	0.600	2,505
石油資源開発	3	3	12,415
K&Oエナジーグループ	1	1	2,361
建設業(2.6%)			
ショーボンドホールディングス	1	2	10,605
ミライト・ホールディングス	5	6	8,712
タマホーム	1	2	1,122
ダイセキ環境ソリューション	—	0.600	1,132
安藤・間	13	14	10,238
東急建設	7	7	5,828
コムシスホールディングス	10	9	14,246
ミサワホーム	2	2	2,620
高松コンストラクショングループ	1	1	4,259
東建コーポレーション	0.780	0.800	4,224
ヤマウラ	4	3	1,221
大成建設	105	109	76,300
大林組	62	65	49,660
清水建設	63	66	56,166
飛島建設	12	14	3,724
長谷工コーポレーション	27	27	30,078
松井建設	3	2	1,478
銭高組	—	3	1,194
鹿島建設	91	95	50,920
不動テトラ	14	16	4,286
鉄建建設	13	13	5,980
日鉄住金テックスエンジ	3	4	2,244
西松建設	27	23	10,603

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
三井住友建設	55	87	15,242
大豊建設	6	6	3,876
前田建設工業	13	14	13,286
佐田建設	9	8	1,176
ナカノフドー建設	4	2	1,183
奥村組	18	20	11,600
大和小田急建設	4	—	—
東鉄工業	2	2	6,955
イチケン	—	4	1,344
戸田建設	24	27	12,339
熊谷組	21	27	10,557
青木あすなろ建設	2	1	1,195
北野建設	4	4	1,460
植木組	6	4	1,108
三井ホーム	3	3	1,557
矢作建設工業	2	2	2,197
東日本ハウス	—	2	1,536
大東建託	7	8	109,470
新日本建設	3	2	1,182
N I P P O	5	5	8,810
東亜道路工業	4	4	1,712
前田道路	6	7	12,852
日本道路	6	6	3,630
東亜建設工業	18	16	3,536
若築建設	11	12	2,436
東洋建設	6	5	3,180
五洋建設	24	24	10,632
大林道路	2	3	2,091
世紀東急工業	11	3	1,729
福田組	3	3	2,415
住友林業	14	15	19,509
日本基礎技術	3	2	1,273
日成ビルド工業	5	6	1,770
ヤマダ・エスバイエルホーム	9	13	1,222
巴コーポレーション	2	2	1,223
パナホーム	8	8	6,240
大和ハウス工業	57	63	148,330
ライト工業	4	3	3,748
積水ハウス	54	66	106,904

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
日特建設	2	2	1,560
北陸電気工事	2	2	1,608
ユアテック	3	3	2,388
西部電気工業	2	2	958
四電工	3	3	1,383
中電工	3	3	6,339
関電工	9	10	7,040
きんでん	14	14	20,216
東京エネシス	2	2	1,742
トーエネック	3	3	1,776
住友電設	1	1	2,221
日本電設工業	3	3	6,510
協和エクシオ	8	9	10,727
新日本空調	1	1	1,755
NDS	4	4	1,228
九電工	4	4	5,800
三機工業	4	4	3,757
日揮	21	22	56,298
中外炉工業	6	7	2,030
太平電業	3	3	2,547
高砂熱学工業	5	6	8,886
三晃金属工業	4	5	1,305
朝日工業社	—	3	1,311
明星工業	3	3	2,679
大気社	2	3	8,469
ダイダン	3	3	2,190
日比谷総合設備	2	2	4,830
東芝プラントシステム	3	3	6,303
東洋エンジニアリング	11	10	3,560
千代田化工建設	16	16	15,824
新興プランテック	4	4	4,184
食料品(4.1%)			
日本製粉	13	13	7,566
日清製粉グループ本社	20	23	33,819
日東富士製粉	4	—	—
昭和産業	9	9	4,599
鳥越製粉	—	1	1,276
協同飼料	10	—	—
中部飼料	2	2	1,419
日本配合飼料	10	—	—
フィード・ワンホールディングス	—	13	1,534
東洋精糖	11	12	1,248
日本甜菜製糖	11	11	2,288

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
三井製糖	8	8	3,472
塩水港精糖	—	4	1,233
森永製菓	21	19	6,973
中村屋	5	5	2,570
江崎グリコ	7	5	25,450
名糖産業	1	1	1,163
不二家	12	12	2,388
山崎製パン	15	16	31,456
モロゾフ	4	3	1,131
亀田製菓	1	1	5,610
寿スピリッツ	—	0.500	1,302
カルビー	7	8	34,960
森永乳業	17	19	8,892
六甲バター	—	0.100	116
ヤクルト本社	12	11	83,520
明治ホールディングス	6	6	84,608
雪印メグミルク	4	5	8,185
プリマハム	10	12	3,336
日本ハム	14	16	43,904
伊藤ハム	11	12	7,404
林兼産業	14	—	—
丸大食品	10	11	4,532
米久	—	0.700	1,330
S F o o d s	1	1	3,012
サッポロホールディングス	34	35	16,450
アサヒグループホールディングス	41	43	162,728
麒麟ホールディングス	89	92	143,913
宝ホールディングス	16	16	13,486
オエノンホールディングス	5	6	1,332
養命酒製造	2	1	965
コカ・コーラウエスト	6	7	13,205
コカ・コーライーストジャパン	4	6	13,444
サントリー食品インターナショナル	10	12	55,341
ダイドードリンコ	1	1	5,329
伊藤園	5	6	15,788
キーコーヒー	2	1	3,418
ユニカフェ	1	1	1,260
ジャパンフーズ	0.900	1	1,252
日清オイリオグループ	9	10	4,340
不二製油	5	5	9,767
かどや製油	0.400	0.400	1,090
Jーオイルミルズ	9	9	3,780
キッコーマン	17	18	60,480

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
味の素	49	50	112,350
キュービー	10	11	30,976
ハウス食品グループ本社	7	8	19,856
カゴメ	8	8	15,089
焼津水産化学工業	—	1	1,244
アリアケジャパン	1	2	6,240
ニチレイ	22	23	13,754
東洋水産	10	11	48,307
日清食品ホールディングス	8	9	53,326
永谷園	2	2	2,376
フジッコ	2	2	3,740
ロック・フィールド	1	1	2,470
日本たばこ産業	114	119	444,015
ケンコーマヨネーズ	1	—	—
わらべや日洋	1	1	2,631
なとり	1	1	1,622
ユーグレナ	—	4	8,422
ミヨシ油脂	—	9	1,269
理研ビタミン	—	0.600	2,484
繊維製品(0.8%)			
片倉工業	2	2	2,937
ゲンゼ	16	16	5,168
東洋紡	82	80	13,120
ユニチカ	53	59	3,186
富士紡ホールディングス	10	10	3,110
日清紡ホールディングス	12	13	15,600
倉敷紡績	20	21	4,263
シキボウ	11	12	1,452
日本毛織	6	6	4,818
ダイドーリミテッド	2	2	1,281
帝国繊維	2	2	3,826
帝人	79	82	31,652
東レ	141	156	155,079
サカイオーベックス	6	2	374
住江織物	5	5	1,565
日本フェルト	2	2	1,276
日本バイリーン	2	3	1,800
芦森工業	9	7	1,141
アツギ	16	17	1,989
ダイニック	6	7	1,260
セーレン	5	5	5,375
東海染工	9	9	1,170
小松精練	3	3	1,961

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ワコールホールディングス	12	12	15,264
ホギメディカル	1	1	7,917
T S I ホールディングス	9	9	6,480
三陽商会	10	11	3,388
オンワードホールディングス	13	14	11,578
ルック	4	6	1,320
ゴールドウイン	4	5	4,145
デサント	4	4	6,371
キング	2	2	1,255
ヤマトインターナショナル	2	2	1,238
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	11	12	3,264
王子ホールディングス	86	83	41,168
日本製紙	10	9	19,797
三菱製紙	28	31	2,728
北越紀州製紙	13	12	7,219
中越パルプ工業	7	8	2,168
大王製紙	7	9	9,171
レンゴー	16	18	9,684
トーモク	6	7	2,037
ザ・パックス	1	1	3,393
化学(6.1%)			
クラレ	30	34	49,948
旭化成	121	126	151,893
共和レザー	2	1	1,262
コープケミカル	8	8	848
昭和電工	129	134	21,038
住友化学	143	149	82,099
日本化成	8	8	1,184
住友精化	4	4	3,496
日産化学工業	13	13	30,712
ラサ工業	7	9	1,269
クレハ	14	14	7,658
テイカ	—	3	1,356
石原産業	35	34	4,012
片倉チッカリン	4	—	—
日本曹達	12	13	9,113
東ソー	52	50	27,650
トクヤマ	30	31	8,246
セントラル硝子	19	21	10,689
東亜合成	23	25	13,525
ダイソー	8	8	3,576
関東電化工業	5	5	3,890

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
電気化学工業	39	42	19,068
信越化学工業	34	36	297,962
日本カーバイド工業	6	7	1,673
堺化学工業	8	8	3,160
エア・ウォーター	16	18	36,828
大陽日酸	25	26	46,852
日本化学工業	—	7	2,030
日本パーカライジング	5	4	13,819
高圧ガス工業	3	3	1,851
四国化成工業	3	3	3,117
戸田工業	—	4	2,056
ステラ ケミファ	1	1	1,353
保土谷化学工業	6	6	1,242
日本触媒	16	16	26,192
大日精化学工業	7	8	5,328
カネカ	24	27	21,195
三菱瓦斯化学	31	35	20,895
三井化学	88	92	32,200
J S R	17	19	42,964
東京応化工業	3	4	17,304
大阪有機化学工業	1	2	1,290
三菱ケミカルホールディングス	121	126	78,888
日本合成化学工業	4	5	3,670
ダイセル	25	28	45,809
住友ベークライト	15	19	9,804
積水化学工業	40	47	70,124
日本ゼオン	15	17	19,363
アイカ工業	5	6	16,659
宇部興産	98	102	19,482
積水樹脂	2	3	5,161
タキロン	5	4	2,128
旭有機材工業	7	7	2,023
日立化成	8	10	24,820
ニチパン	—	3	1,452
リケンテクノス	3	3	1,485
大倉工業	5	5	1,795
積水化成成品工業	6	6	2,724
群栄化学工業	5	5	1,725
タイガースポリマー	2	—	—
ミライアル	0.800	0.800	1,264
ダイキョーニシカワ	—	0.500	1,935
日本化薬	14	13	20,098
カーリットホールディングス	—	1	1,179

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
日本精化	1	1	1,479
A D E K A	8	9	13,829
日油	16	17	14,365
新日本理化学	4	5	1,210
ハリマ化成グループ	2	2	1,253
花王	50	54	279,645
第一工業製薬	4	4	1,624
三洋化成工業	6	6	5,652
大日本塗料	11	12	1,860
日本ペイントホールディングス	17	17	74,725
関西ペイント	23	24	49,560
中国塗料	6	6	5,886
日本特殊塗料	1	—	—
藤倉化成	2	2	1,560
太陽ホールディングス	1	1	6,792
D I C	69	81	26,163
サカタインクス	4	4	4,833
東洋インキSCホールディングス	17	20	11,500
T & K T O K A	0.700	0.700	1,730
富士フイルムホールディングス	44	46	184,915
資生堂	34	35	71,566
ライオン	22	23	15,203
高砂香料工業	7	7	4,088
マンダム	1	2	7,940
ミルボン	1	1	4,104
ファンケル	4	4	8,182
コーセー	3	3	18,942
ドクターシーラボ	1	1	5,775
シーボン	—	0.400	1,140
ポーラ・オルビスホールディングス	2	2	12,936
ノエビアホールディングス	1	1	2,931
エスター	1	1	1,458
アグロ カネショウ	—	1	1,254
コニシ	1	1	3,265
長谷川香料	2	2	4,573
星光PMC	1	—	—
小林製薬	3	3	26,400
荒川化学工業	1	1	2,317
メック	1	1	1,355
日本高純度化学	0.005	0.600	1,552
J C U	0.300	0.500	2,755
新田ゼラチン	1	1	1,368
アース製薬	1	1	5,523

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
イハラケミカル工業	3	3	4,271
北興化学工業	—	3	1,269
大成ラミック	0.500	0.600	1,736
クマイイ化学工業	4	4	3,592
日本農薬	4	4	6,311
アキレス	15	17	2,584
有沢製作所	3	3	3,304
日東電工	16	15	115,315
レック	0.900	0.900	1,269
きもと	1	4	1,268
藤森工業	1	1	6,426
前澤化成工業	1	1	1,883
J S P	1	1	3,604
エフピコ	1	1	7,443
天馬	1	1	2,828
信越ポリマー	3	4	2,300
東リ	—	5	1,290
ニフコ	4	4	18,450
日本バルカー工業	8	8	2,536
ユニ・チャーム	11	40	134,640
医薬品 (4.8%)			
協和発酵キリン	23	24	33,504
武田薬品工業	72	75	457,531
アステラス製薬	44	229	428,232
大日本住友製薬	13	14	18,218
塩野義製薬	30	31	105,367
田辺三菱製薬	16	23	47,141
わかもと製薬	4	—	—
あすか製薬	2	2	2,748
日本新薬	4	5	19,700
ビオフェルミン製薬	0.400	—	—
中外製薬	19	20	69,445
科研製薬	7	7	24,290
エーザイ	23	26	163,536
ロート製薬	8	9	14,112
小野薬品工業	8	9	106,996
久光製薬	6	5	24,994
持田製薬	1	1	9,982
参天製薬	7	7	58,386
扶桑薬品工業	7	7	2,247
日本ケミファ	3	3	1,719
ツムラ	5	6	18,755
日医工	4	4	11,101

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
キッセイ薬品工業	3	3	12,672
生化学工業	4	3	8,260
栄研化学	1	1	3,092
日水製薬	1	0.700	962
鳥居薬品	1	1	4,641
J C R ファーマ	1	1	3,616
東和薬品	1	1	6,540
富士製薬工業	0.600	0.600	1,386
沢井製薬	3	3	24,832
ゼリア新薬工業	3	4	7,949
第一三共	61	67	125,547
キョーリン製薬ホールディングス	5	5	14,779
大幸薬品	0.900	0.900	1,799
ダイト	0.700	0.800	2,083
大塚ホールディングス	38	40	146,200
大正製薬ホールディングス	4	4	39,543
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	15	18	2,153
昭和シェル石油	17	18	20,724
コスモ石油	54	56	9,968
ニチレキ	2	2	1,966
東燃ゼネラル石油	29	30	33,720
ユシロ化学工業	1	1	1,851
ビービー・カストロール	—	1	1,271
富士石油	5	4	1,828
MORESCO	0.700	0.600	1,303
出光興産	9	9	20,342
J Xホールディングス	215	223	104,494
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	22	23	26,910
東洋ゴム工業	16	9	22,922
ブリヂストン	60	63	294,448
住友ゴム工業	15	15	32,844
藤倉ゴム工業	1	1	1,356
オカモト	7	7	3,283
フコク	0.400	0.800	956
ニッタ	1	2	6,090
住友理工	3	3	3,700
三ツ星ベルト	5	5	4,890
バンドー化学	7	7	3,059
ガラス・土石製品 (0.9%)			
日東紡績	14	15	7,320
旭硝子	95	99	71,082

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
日本板硝子	93	97	11,252
石塚硝子	4	—	—
日本山村硝子	8	8	1,400
日本電気硝子	40	39	22,230
オハラ	1	—	—
住友大阪セメント	37	37	13,209
太平洋セメント	114	126	47,376
デイ・シイ	2	—	—
日本ヒューム	2	2	1,837
日本コンクリート工業	3	3	1,690
三谷セキサン	1	1	2,039
ジャパンパイル	1	2	1,892
東海カーボン	18	17	6,137
日本カーボン	10	11	3,146
東洋炭素	1	1	2,565
ノリタケカンパニーリミテド	11	11	3,223
TOTO	28	30	46,590
日本碍子	24	25	58,300
日本特殊陶業	17	17	57,768
MARUWA	0.500	0.600	1,638
品川リフラクトリーズ	5	5	1,435
黒崎播磨	—	5	1,225
ヨータイ	4	3	1,140
東京窯業	5	6	1,326
ニッカトー	2	3	1,239
フジミインコーポレーテッド	1	2	3,762
エーアンドエーマテリアル	—	11	1,309
ニチアス	9	9	6,165
ニチハ	2	2	3,636
鉄鋼(1.6%)			
新日鐵住金	818	853	268,524
神戸製鋼所	268	349	77,129
中山製鋼所	—	15	1,290
合同製鐵	10	10	1,890
ジェイ エフ イー ホールディングス	49	51	145,899
日新製鋼	8	8	13,472
東京製鐵	10	10	9,180
共英製鋼	1	2	4,349
大和工業	4	4	14,628
東京鐵鋼	4	4	2,208
大阪製鐵	1	1	2,753
淀川製鋼所	14	14	6,706

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
東洋鋼鈑	5	5	2,810
丸一鋼管	6	6	17,589
モリ工業	3	3	1,299
大同特殊鋼	32	34	17,612
日本高周波鋼業	11	—	—
日本冶金工業	15	15	3,886
山陽特殊製鋼	11	12	5,724
愛知製鋼	10	12	6,840
日立金属	17	21	39,921
日本金属	8	8	1,240
大平洋金属	13	13	4,576
新日本電工	8	12	3,886
栗本鐵工所	10	10	2,260
日本鑄鉄管	5	5	1,150
三菱製鋼	12	13	3,276
日亜鋼業	3	—	—
日本精線	—	2	1,346
シンニッタン	2	1	559
新家工業	8	7	1,337
非鉄金属(0.9%)			
大紀アルミニウム工業所	4	—	—
日本軽金属ホールディングス	43	49	8,771
三井金属鉱業	49	55	14,740
東邦亜鉛	11	11	4,125
三菱マテリアル	121	126	50,148
住友金属鉱山	50	56	101,360
DOWAホールディングス	21	24	22,992
古河機械金属	33	31	6,417
大阪チタニウムテクノロジーズ	2	2	4,950
東邦チタニウム	3	3	2,611
UACJ	25	23	7,659
古河電気工業	61	59	12,449
住友電気工業	72	76	117,572
フジクラ	31	28	13,972
昭和電線ホールディングス	25	23	2,323
東京特殊電線	—	0.800	1,237
タツタ電線	2	3	1,873
沖電線	6	4	1,348
カナレ電気	0.500	—	—
平河ヒューテック	—	0.900	1,261
リョービ	12	11	3,762
アーレスティ	—	1	1,238

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
アサヒホールディングス	2	3	5,901
金属製品 (0.7%)			
稲葉製作所	0.900	1	1,338
宮地エンジニアリンググループ	6	—	—
トーカロ	1	1	2,983
アルファ	1	1	1,320
SUMCO	11	13	30,913
川田テクノロジーズ	0.400	0.400	1,648
東洋製罐グループホールディングス	13	14	22,822
ホッカンホールディングス	5	5	1,410
コロナ	0.500	1	1,281
横河ブリッジホールディングス	4	3	5,000
駒井ハルテック	4	4	1,144
高田機工	5	5	1,235
三和ホールディングス	16	19	16,237
文化シャッター	5	6	5,874
三協立山	2	2	5,044
東洋シャッター	1	1	1,254
L I X I L グループ	27	30	82,890
日本ファイルコン	2	2	1,255
ノーリツ	3	3	7,897
長府製作所	2	2	6,710
リンナイ	3	3	31,006
ダイニチ工業	1	—	—
日東精工	—	3	1,095
岡部	3	4	4,240
ジーテクト	—	1	1,517
東プレ	3	3	6,719
高周波熱錬	2	3	3,101
東京製綱	13	14	2,982
サンコール	2	1	677
モリテックスチール	—	3	1,231
パイオラックス	0.900	1	5,380
日本発条	15	17	21,682
中央発条	—	4	1,392
三益半導体工業	1	1	2,065
機械 (5.0%)			
日本ドライケミカル	—	0.500	1,138
アタカ大機	3	—	—
日本製鋼所	28	29	14,036
三浦工業	2	9	12,870
タクマ	6	7	6,454
ツガミ	6	6	4,314

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
オークマ	13	13	14,885
東芝機械	11	11	5,038
アマダ	30	30	32,477
アイダエンジニアリング	4	4	5,944
滝澤鉄工所	—	6	1,320
富士機械製造	5	6	8,514
牧野フライス製作所	10	10	10,000
オーエスジー	8	9	21,123
ダイジェット工業	7	6	1,368
旭ダイヤモンド工業	5	5	6,963
DMG森精機	10	12	22,098
ディスコ	2	2	23,690
日東工器	1	1	2,617
豊和工業	1	1	1,190
大阪機工	8	8	1,280
石川製作所	—	12	1,236
東洋機械金属	1	—	—
津田駒工業	7	8	1,232
島精機製作所	2	2	5,801
日阪製作所	2	2	2,480
やまびこ	0.800	0.800	4,120
ベガサスミシン製造	3	2	1,285
ナブテスコ	8	12	38,437
三井海洋開発	1	2	3,994
レオン自動機	2	2	1,216
SMC	5	6	204,000
新川	2	—	—
ホソカワミクロン	3	3	1,902
ユニオンツール	0.800	1	3,375
オイレス工業	1	2	5,297
日精エー・エス・ビー機械	0.500	0.600	1,394
サトーホールディングス	2	2	6,112
日本エアータック	2	1	1,220
日精樹脂工業	2	1	2,070
ワイエイシイ	2	1	1,244
小松製作所	90	100	247,950
住友重機械工業	53	55	40,590
日立建機	9	9	20,259
日工	3	3	1,254
巴工業	0.700	0.800	1,368
井関農機	20	21	5,124
TOWA	2	1	1,131
丸山製作所	5	5	1,160

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
北川鉄工所	9	9	2,196
クボタ	101	97	184,979
荏原実業	0.800	0.900	1,261
三菱化工機	7	7	3,192
月島機械	3	3	4,690
帝国電機製作所	0.700	1	1,589
新東工業	4	4	3,995
澁谷工業	1	1	3,792
アイチコーポレーション	2	2	1,684
小森コーポレーション	4	4	6,487
鶴見製作所	1	1	3,006
住友精密工業	3	3	1,437
酒井重工業	4	4	1,188
荏原製作所	43	42	19,950
西島製作所	2	2	1,840
北越工業	—	1	1,593
ダイキン工業	25	28	218,084
オルガノ	3	4	1,932
トヨーカネツ	10	12	2,868
栗田工業	11	11	33,926
椿本チエイン	10	10	9,900
大同工業	4	—	—
日本コンベヤ	—	6	1,368
木村化工機	2	2	1,200
アネスト岩田	3	3	2,382
ダイフク	8	9	14,164
加藤製作所	4	4	3,140
油研工業	5	5	1,260
タダノ	8	9	12,762
フジテック	5	5	6,837
CKD	5	5	5,664
キトー	1	2	2,398
平和	4	4	10,416
理想科学工業	1	2	4,471
SANKYO	5	5	28,275
日本金銭機械	1	1	3,227
マースエンジニアリング	1	1	2,449
福島工業	1	1	1,851
オーイズミ	1	1	1,323
ダイコク電機	0.800	0.800	1,412
アマノ	5	6	9,132
JUKI	12	14	5,936
サンデン	10	12	7,212

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
蛇の目ミシン工業	18	19	2,888
マックス	3	3	4,155
グローリー	5	6	19,685
新晃工業	1	1	1,684
大和冷機工業	3	2	2,030
セガサミーホールディングス	19	20	37,218
日本ピストンリング	7	8	2,064
リケン	7	8	3,800
T P R	2	2	6,169
ホシザキ電機	4	4	27,132
大豊工業	1	1	2,222
日本精工	41	40	63,880
NTN	43	45	25,515
ジェイテクト	19	20	37,576
不二越	17	18	12,096
日本トムソン	6	7	4,228
THK	11	12	35,315
ユーション精機	0.800	0.900	1,939
前澤給装工業	0.900	0.900	1,307
イーグル工業	2	2	6,731
日本ピラー工業	2	2	1,965
キッツ	8	8	5,323
日立工機	4	5	4,799
マキタ	12	12	71,190
日立造船	13	15	10,373
三菱重工業	329	323	209,982
I H I	126	139	76,450
電気機器 (12.7%)			
イビデン	11	12	24,948
ユニカミノルタ	49	45	57,237
ブラザー工業	23	24	50,273
ミネベア	25	29	53,621
日立製作所	444	463	385,123
東芝	365	406	198,980
三菱電機	185	193	261,901
富士電機	51	54	29,268
東洋電機製造	4	4	1,728
安川電機	20	22	36,137
シンフォニア テクノロジー	11	13	2,795
明電舎	17	18	6,858
オリジン電気	4	3	1,566
山洋電気	3	4	3,268
デンヨー	1	1	3,281

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
東芝テック	12	14	10,374
芝浦メカトロニクス	5	4	1,164
マブチモーター	2	5	33,984
日本電産	10	20	170,268
東光高岳	1	1	1,799
ダイヘン	11	11	6,270
JVCケンウッド	12	14	5,301
第一精工	1	0.700	1,593
日新電機	4	5	3,525
大崎電気工業	3	3	2,448
オムロン	20	20	106,288
日東工業	2	3	6,764
I D E C	2	2	2,373
不二電機工業	—	0.800	1,216
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36	37	19,647
サクサホールディングス	7	6	1,338
メルコホールディングス	0.900	1	2,071
テクノメディア	0.500	—	—
日本電気	254	249	88,644
富士通	178	186	132,562
沖電気工業	72	67	17,018
岩崎通信機	—	13	1,183
電気興業	5	5	2,655
サンケン電気	10	10	8,330
ナカヨ	3	—	—
アイホン	1	1	2,018
ルネサスエレクトロニクス	9	10	8,860
セイコーエプソン	12	13	57,771
ワコム	14	15	9,408
アルバック	3	3	5,747
アクセル	0.900	0.900	1,526
E I Z O	1	1	4,689
ジャパンディスプレイ	—	29	14,493
日本信号	4	5	6,391
京三製作所	4	5	1,900
能美防災	2	2	3,672
ホーチキ	—	1	894
エレコム	0.800	0.600	1,434
日本無線	5	4	1,428
パナソニック	211	234	342,338
シャープ	133	163	39,935
アンリツ	10	12	10,236
富士通ゼネラル	4	6	7,596

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
日立国際電気	4	5	7,860
ソニー	101	124	398,844
T D K	11	11	91,872
帝国通信工業	6	5	1,205
ミツミ電機	7	6	6,072
タムラ製作所	7	7	2,933
アルプス電気	13	15	39,884
パイオニア	25	28	6,936
日本電波工業	1	1	1,638
日本トリム	0.400	0.500	1,717
ローランド ディー・ジー	0.800	0.800	2,616
フォスター電機	1	2	5,768
クラリオン	11	10	3,890
SMK	5	6	3,018
ヨコオ	2	2	1,310
東光	9	5	1,725
ティアック	14	21	1,218
ホシデン	5	6	3,958
ヒロセ電機	3	3	47,616
日本航空電子工業	5	6	16,656
T O A	2	2	2,488
日立マクセル	—	2	5,991
古野電気	1	2	2,704
ユニデン	6	5	1,120
アルパイン	4	4	9,223
スミダコーポレーション	2	1	1,231
アイコム	1	1	3,054
リオン	0.700	—	—
船井電機	1	1	2,555
横河電機	20	19	25,090
新電元工業	6	7	4,445
アズビル	5	6	19,656
日本光電工業	3	4	25,010
チノー	5	1	1,219
共和電業	3	1	714
堀場製作所	3	3	15,696
アドバンテス	12	13	19,807
小野測器	2	1	1,233
エスベック	1	2	2,566
パナソニック デバイスSUNX	2	1	1,577
キーエンス	4	4	265,320
日置電機	1	1	1,905
シスメックス	7	14	87,910

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	評価額
	千株	千株	千円
メガチップス	1	2	2,760
OBARA GROUP	1	1	7,776
日本電産コバル電子	1	—	—
澤藤電機	5	5	1,180
コーセル	2	2	3,763
オプテックス	1	1	2,736
千代田インテグレ	0.800	0.800	1,793
レーザーテック	1	2	2,942
スタンレー電気	13	13	39,412
岩崎電気	7	7	1,596
ウシオ電機	11	11	17,152
岡谷電機産業	2	—	—
ヘリオス テクノ ホールディング	3	2	1,249
日本セラミック	1	1	1,741
遠藤照明	0.800	—	—
日本デジタル研究所	1	1	2,568
古河電池	—	1	939
双信電機	2	2	1,206
山一電機	—	2	1,949
図研	1	1	1,519
日本電子	6	8	4,576
カシオ計算機	19	19	36,631
ファナック	20	20	468,028
日本シイエムケイ	4	4	1,577
エンブレラス	0.700	0.900	4,414
ローム	9	9	71,915
浜松ホトニクス	7	8	53,760
三井ハイテック	2	2	2,027
新光電気工業	6	7	6,628
京セラ	33	31	182,395
太陽誘電	9	10	13,988
村田製作所	19	20	275,730
ユーシン	2	2	1,981
双葉電子工業	3	3	6,388
北陸電気工業	8	8	1,576
ニチコン	5	6	6,368
日本ケミコン	13	16	6,192
KOA	2	2	3,167
市光工業	8	5	1,205
小糸製作所	10	11	43,067
ミツバ	3	3	7,854
スター精密	3	3	5,920
SCREENホールディングス	17	18	14,562

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
キャノン電子	1	1	4,219
キャノン	107	111	428,090
リコー	55	57	71,014
MUTOHホールディングス	3	—	—
東京エレクトロン	16	16	146,691
輸送用機器 (11.9%)			
トヨタ紡織	6	6	10,324
鬼怒川ゴム工業	3	4	2,096
ユニプレス	3	3	8,210
豊田自動織機	16	17	115,500
モリタホールディングス	3	3	4,328
三櫻工業	2	2	1,862
デンソー	45	47	263,704
東海理化電機製作所	4	5	12,959
三井造船	72	75	15,600
佐世保重工業	13	—	—
川崎重工業	144	141	79,242
名村造船所	2	5	6,269
サノヤスホールディングス	5	4	1,192
日本車輛製造	7	7	2,548
ニチユ三菱フォークリフト	2	2	1,531
近畿車輛	3	3	1,089
日産自動車	259	270	326,102
いすゞ自動車	107	60	102,951
トヨタ自動車	257	265	2,147,132
日野自動車	23	27	48,207
三菱自動車工業	57	70	76,601
エフテック	0.800	1	1,336
レシップホールディングス	—	1	1,220
GMB	0.500	—	—
武蔵精密工業	2	2	5,300
日産車体	9	8	13,379
新明和工業	7	8	9,920
極東開発工業	3	3	4,694
日信工業	3	3	6,510
トビー工業	15	16	4,544
ティラド	7	7	1,792
曙ブレーキ工業	8	8	3,628
タチエス	2	3	4,916
NOK	8	9	30,829
フタバ産業	5	5	3,416
カヤバ工業	17	22	10,010
シロキ工業	5	4	1,308

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
大同メタル工業	3	2	3,194
プレス工業	7	10	4,620
カルソニックカンセイ	13	15	10,440
太平洋工業	3	3	3,958
ケーヒン	4	4	8,267
河西工業	2	2	2,412
アイシン精機	16	17	78,584
マツダ	276	57	144,648
ダイハツ工業	19	23	39,698
今仙電機製作所	1	1	2,536
本田技研工業	166	173	687,444
スズキ	38	40	151,064
富士重工業	62	65	262,432
ヤマハ発動機	28	29	81,102
ショーワ	4	4	5,607
T B K	2	2	1,650
エクセディ	2	2	7,259
豊田合成	6	6	16,089
愛三工業	2	3	3,384
ヨロズ	1	1	4,266
エフ・シー・シー	3	2	5,488
シマノ	8	8	139,440
タカタ	3	3	4,788
テイ・エス テック	3	4	13,714
精密機器(1.5%)			
テルモ	14	29	91,450
クリエートメディック	—	1	1,243
日機装	6	6	6,107
島津製作所	24	23	28,750
J M S	—	4	1,188
ブイ・テクノロジー	—	0.500	1,164
東京計器	—	7	1,883
オーバル	—	3	1,231
東京精密	3	3	8,918
マニー	—	0.500	3,600
ニコン	34	36	55,008
トプコン	5	5	14,534
オリンパス	32	28	122,836
理研計器	—	1	2,189
タムロン	1	1	3,453
HOYA	45	45	221,099
ノーリツ鋼機	—	1	1,215
エー・アンド・デイ	—	2	1,248

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
シチズンホールディングス	22	23	22,088
リズム時計工業	—	8	1,288
大研医器	—	1	1,508
松風	—	0.900	1,232
セイコーホールディングス	12	14	9,002
ニプロ	9	12	13,345
その他製品(1.3%)			
バラムウントベッドホールディングス	1	2	6,290
S H O - B I	2	3	1,227
前田工織	1	1	1,981
永大産業	2	3	1,338
アートネイチャー	0.600	1	1,538
ダンロップスポーツ	1	1	1,549
バンダイナムコホールディングス	20	21	45,707
共立印刷	4	4	1,238
フランスベッドホールディングス	12	14	2,604
パイロットコーポレーション	1	1	11,798
トッパン・フォームズ	3	3	4,270
フジールインターナショナル	2	2	8,592
タカラトミー	6	6	4,588
廣済堂	—	2	1,270
アーク	5	—	—
タカノ	2	2	1,224
プロネクス	1	2	1,598
ホクシン	7	9	1,269
ウッドワン	—	4	1,104
大建工業	8	8	2,240
凸版印刷	52	54	45,738
大日本印刷	56	59	67,525
図書印刷	3	4	1,308
共同印刷	6	6	2,358
日本写真印刷	3	3	7,529
光村印刷	4	4	1,084
アシックス	18	19	56,345
ツツミ	0.900	1	2,789
ローランド	1	—	—
小松ウオール工業	0.600	0.600	1,541
ヤマハ	13	14	28,130
河合楽器製作所	6	0.700	1,591
クリナップ	1	1	1,661
ピジョン	3	3	28,584
キングジム	1	1	1,276
リンテック	4	4	12,765

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
イトーキ	3	4	2,833
任天堂	11	11	143,930
三菱鉛筆	1	1	6,400
タカスタンダード	8	8	7,912
コクヨ	9	10	10,180
ナカバヤシ	6	—	—
グローブライド	10	9	1,530
岡村製作所	7	7	6,430
美津濃	9	10	6,000
アデランス	2	2	2,413
電気・ガス業(2.0%)			
東京電力	156	163	78,268
中部電力	60	58	86,553
関西電力	75	78	84,730
中国電力	25	26	42,533
北陸電力	18	18	30,996
東北電力	46	48	67,917
四国電力	16	17	28,077
九州電力	40	42	44,540
北海道電力	17	18	16,848
沖縄電力	1	1	5,375
電源開発	11	13	55,055
東京瓦斯	217	234	171,498
大阪瓦斯	191	199	97,151
東邦瓦斯	47	49	33,565
北海道瓦斯	3	4	1,144
西部瓦斯	21	22	5,984
静岡瓦斯	4	5	4,658
メタウォーター	—	0.900	2,124
陸運業(4.3%)			
SBSホールディングス	0.700	1	1,351
東武鉄道	105	103	60,873
相鉄ホールディングス	32	33	18,546
東京急行電鉄	109	105	86,730
京浜急行電鉄	47	53	51,781
小田急電鉄	59	62	77,500
京王電鉄	52	54	53,352
京成電鉄	28	29	43,616
富士急行	5	5	6,210
新京成電鉄	3	—	—
東日本旅客鉄道	34	35	354,765
西日本旅客鉄道	16	18	124,468
東海旅客鉄道	16	17	388,731

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
西武ホールディングス	—	15	48,271
鴻池運輸	1	1	2,904
西日本鉄道	24	25	13,275
ハマキョウレックス	0.500	0.600	2,475
サカイ引越センター	0.300	0.300	1,123
近畿日本鉄道	186	194	89,628
阪急阪神ホールディングス	124	129	95,202
南海電気鉄道	39	43	21,156
京阪電気鉄道	39	43	31,003
神戸電鉄	5	5	1,935
名古屋鉄道	65	70	34,230
山陽電気鉄道	7	7	3,430
日本通運	73	76	49,324
ヤマトホールディングス	34	33	93,309
山九	22	23	11,753
丸全昭和運輸	6	6	2,442
センコー	7	8	5,544
トナミホールディングス	6	4	1,828
日本梱包運輸倉庫	5	6	11,812
日本石油輸送	5	5	1,215
福山通運	11	12	7,740
セイノーホールディングス	13	15	19,545
神奈川中央交通	—	2	1,196
日立物流	3	4	6,876
海運業(0.3%)			
日本郵船	157	163	56,561
商船三井	104	102	43,758
川崎汽船	81	85	28,730
N Sユニテッド海運	8	9	2,718
乾汽船	3	—	—
飯野海運	7	10	6,490
第一中央汽船	14	—	—
空運業(0.6%)			
日本航空	15	36	136,899
ANAホールディングス	363	379	121,317
スカイマーク	4	—	—
パスコ	2	1	340
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	0.500	0.600	3,096
日新	7	7	2,219
三菱倉庫	12	13	23,712
三井倉庫ホールディングス	9	11	4,510
住友倉庫	12	14	9,772

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
澁澤倉庫	4	5	1,810
東陽倉庫	4	—	—
乾汽船	—	1	1,272
日本トランスシティ	4	4	1,576
ケイヒン	7	6	1,200
安田倉庫	1	1	1,554
東洋埠頭	5	6	1,224
宇徳	3	1	1,233
上組	22	23	26,979
サンリツ	2	2	1,225
キューソー流通システム	1	0.900	1,247
郵船ロジスティクス	1	1	2,685
近鉄エクスプレス	1	1	8,015
エーアイティー	—	1	1,310
情報・通信業(6.7%)			
NECネットエスアイ	2	2	5,702
システナ	1	1	1,658
デジタルアーツ	1	—	—
新日鉄住金ソリューションズ	1	1	5,456
コア	1	1	1,198
ITホールディングス	6	6	13,255
電算システム	1	—	—
グリー	10	11	7,716
コーエーテクモホールディングス	3	4	7,353
三菱総合研究所	0.700	0.700	1,942
電算	—	0.500	1,148
AGS	—	1	1,092
ファインデックス	—	0.300	1,605
ヒト・コミュニケーションズ	0.600	—	—
KL a b	1	2	2,088
ホルタウイン・ビットクルーホールディングス	1	1	1,219
ネクソン	15	18	20,072
アイスタイル	2	—	—
エムアップ	1	1	1,219
エイチーム	0.200	0.200	1,022
e n i s h	—	0.900	1,261
コプロ	—	3	9,075
ブロードリーフ	1	1	2,912
ハーツユナイテッドグループ	—	0.700	1,222
ドワンゴ	1	—	—
ティーガイア	1	1	2,819
GMOペイメントゲートウェイ	0.700	1	4,217
ザッパラス	1	1	1,206

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
インターネットイニシアティブ	2	3	7,232
ビットアイル	1	2	1,279
SRAホールディングス	0.900	1	1,614
パイプドビッツ	—	0.600	1,180
g u m i	—	1	3,509
パソニック インフォメーションシステムズ	0.400	0.400	1,444
フェイス	1	0.900	1,196
野村総合研究所	10	10	44,712
サイバネットシステム	2	2	1,263
インタージホールディングス	1	1	2,172
東邦システムサイエンス	—	2	1,278
クレスコ	1	0.700	1,348
フジ・メディア・ホールディングス	17	19	32,788
オービック	6	6	29,040
ジャストシステム	—	2	1,807
TDCソフトウェアエンジニアリング	1	1	1,315
ヤフー	132	136	58,745
トレンドマイクロ	8	10	36,814
日本オラクル	2	3	15,600
アルファシステムズ	0.800	0.700	1,167
フューチャーアーキテクト	2	2	1,418
CAC Holdings	1	1	1,391
ソフトバンク・テクノロジー	0.800	1	1,211
トーセ	1	1	1,214
オービックビジネスコンサルタント	0.900	1	4,986
伊藤忠テクノソリューションズ	2	2	10,010
アイティフォー	2	2	1,266
東計電算	0.700	0.700	1,223
エックスネット	0.800	—	—
大塚商会	1	5	24,097
サイボウズ	3	3	1,228
アグレックス	1	—	—
電通国際情報サービス	1	1	1,372
イーエムシステムズ	0.500	0.700	1,217
ウェザーニューズ	0.500	0.600	1,866
C I J	2	2	1,211
東洋ビジネスエンジニアリング	—	0.900	1,222
日本エンタープライズ	—	3	1,228
WOWOW	0.600	0.500	3,060
イマジカ・ロボット ホールディングス	—	2	1,674
ネットワンシステムズ	7	7	6,075
アルゴグラフィックス	0.700	0.800	1,396
マーベラス	2	3	5,686

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
エイベックス・グループ・ホールディングス	3	3	7,436
日本ユニシス	4	5	5,772
兼松エレクトロニクス	1	1	2,124
東京放送ホールディングス	9	11	15,925
日本テレビホールディングス	18	17	33,129
朝日放送	—	1	1,833
テレビ朝日ホールディングス	4	5	9,219
スカパーJ SATホールディングス	13	14	10,612
テレビ東京ホールディングス	1	1	3,415
コネクシオ	1	1	1,409
日本電信電話	71	74	540,888
KDDI	56	64	524,538
光通信	1	1	13,311
NTTドコモ	150	156	329,148
GMOインターネット	6	6	7,320
KADOKAWA・DWANGO	—	4	9,193
学研ホールディングス	6	6	1,590
ゼンリン	2	2	3,847
昭文社	1	1	1,337
KADOKAWA	1	—	—
インプレスホールディングス	4	9	1,238
アイネット	1	1	1,198
松竹	12	13	15,223
東宝	13	13	39,562
東映	8	7	4,788
エヌ・ティ・ティ・データ	12	11	54,522
DTS	1	2	4,496
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6	6	16,125
シーイーシー	1	1	1,213
カプコン	4	4	10,226
SCSK	4	4	14,130
アイネス	2	2	2,236
TKC	1	1	3,598
富士ソフト	2	2	6,593
NSD	3	4	7,416
コナミ	8	7	17,864
福井コンピュータホールディングス	—	1	1,180
JBCホールディングス	1	1	1,243
ソフトバンク	89	100	705,409
卸売業(4.1%)			
高千穂交易	1	1	1,200
伊藤忠食品	0.400	0.500	2,032
エレマテック	0.900	0.900	2,498

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
JALUX	1	0.600	1,218
あらた	4	4	1,312
トーマンデバイス	0.600	0.700	1,318
東京エレクトロン デバイス	—	0.800	1,256
双日	122	127	22,786
アルフレッサ ホールディングス	5	22	36,990
横浜冷凍	4	4	3,915
山下医科器械	0.700	0.700	1,187
ラサ商事	2	2	1,236
アルコニックス	0.500	1	2,029
神戸物産	—	0.600	2,523
あい ホールディングス	2	3	6,750
ダイワボウホールディングス	17	17	3,383
バイタルケー・ホールディングス	3	3	3,528
UKCホールディングス	1	1	2,341
OCHIホールディングス	—	0.800	1,177
TOKAIホールディングス	8	9	5,208
三洋貿易	—	1	1,546
シップヘルスケアホールディングス	2	3	9,240
小野建	1	1	1,836
佐島電機	1	1	1,313
エコートレーディング	1	1	1,215
伯東	1	1	1,749
コンドーテック	1	1	1,273
ナガイレーベン	2	2	6,075
三菱食品	2	2	5,317
松田産業	1	1	2,011
メディバルホールディングス	18	19	28,310
アドヴァン	1	1	1,427
アズワン	1	1	4,977
尾家産業	1	1	1,209
シモジマ	1	1	1,311
ドウシシャ	1	2	5,032
小津産業	—	0.600	1,260
高速	1	1	1,262
黒田電気	2	3	5,657
丸文	1	1	1,349
ハピネット	1	1	1,608
トーマンエレクトロニクス	0.900	—	—
エクセル	—	0.900	1,229
マルカキカイ	—	0.600	1,013
ガリバーインターナショナル	6	5	5,388
日本エム・ディ・エム	3	2	1,236

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
進和	1	1	1,546
エスケイジャパン	3	5	1,256
ダイトエレクトロン	2	1	1,276
シークス	1	1	2,894
オーハシテクニカ	—	1	1,992
マクニカ	0.900	1	3,775
白銅	1	1	1,213
伊藤忠商事	145	159	207,864
丸紅	160	166	120,201
高島	5	5	1,295
長瀬産業	10	11	17,759
蝶理	1	1	2,354
豊田通商	20	21	66,144
三共生興	3	3	1,539
兼松	39	38	6,688
ツカモトコーポレーション	—	9	1,278
三井物産	168	161	260,096
日本紙パルプ商事	9	10	3,400
日立ハイテクノロジーズ	5	6	24,189
カメイ	2	2	2,085
東都水産	5	6	1,200
スターゼン	7	7	3,017
山善	7	7	6,555
椿本興業	4	4	1,208
住友商事	107	112	144,738
内田洋行	4	5	1,860
三菱商事	142	145	341,957
第一実業	4	5	2,995
キャノンマーケティングジャパン	5	5	11,939
西華産業	6	6	1,776
佐藤商事	1	1	1,360
菱洋エレクトロ	2	2	2,831
東京産業	2	2	1,205
ユアサ商事	19	1	4,158
神鋼商事	5	5	1,365
小林産業	3	4	1,233
阪和興業	18	19	8,854
カナデン	2	2	1,710
菱電商事	3	3	2,538
フルサト工業	1	1	1,718
岩谷産業	20	21	17,220
すてきなイスグループ	8	8	1,584
昭光通商	7	8	1,208

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
イワキ	6	5	1,125
三愛石油	4	5	4,375
稲畑産業	4	4	5,303
ワキタ	3	4	4,636
東邦ホールディングス	5	6	13,180
サンゲツ	3	3	11,900
ミツウロコグループホールディングス	2	3	1,832
シナネン	4	4	1,980
伊藤忠エネクス	4	4	4,166
サンリオ	4	5	18,020
サンワ テクノス	1	1	1,468
リョーサン	2	3	8,761
新光商事	2	2	2,508
トーホー	4	4	1,816
三信電気	2	2	2,488
東陽テクニカ	2	2	3,444
モスフードサービス	2	2	6,087
加賀電子	1	1	2,373
ソーダニッカ	3	2	1,074
立花エレテック	1	1	2,140
P a l t a c	2	3	5,073
ヤマタネ	9	9	1,737
日鉄住金物産	12	12	4,980
トラスコ中山	2	2	8,088
オートバックスセブン	6	7	12,999
加藤産業	2	2	6,431
イノテック	2	2	1,247
イエローハット	1	1	4,410
富士エレクトロニクス	0.900	1	1,547
J Kホールディングス	1	2	1,213
日伝	0.800	0.800	2,040
北沢産業	6	6	1,232
杉本商事	1	1	1,307
因幡電機産業	2	2	11,424
バイテック	—	1	1,227
ミスミグループ本社	7	7	30,920
江守グループホールディングス	0.600	1	1,234
タキヒヨー	3	3	1,305
スズケン	7	7	29,546
ジェコス	1	1	1,745
小売業(4.2%)			
ローソン	7	7	58,176
サンエー	1	1	5,978

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
ダイユーエイト	1	—	—
カワチ薬品	1	1	2,998
エービーシー・マート	2	2	16,821
ハードオフコーポレーション	1	—	—
アスクル	1	2	4,394
ゲオホールディングス	3	3	4,633
アダストリアホールディングス	1	1	4,708
くらコーポレーション	1	1	4,213
キャンドウ	0.900	0.900	1,432
パル	1	1	3,448
エディオン	8	8	7,986
サーラコーポレーション	2	2	1,255
ワッツ	—	1	1,243
あみやき亭	—	0.300	1,222
ひらまつ	1	2	1,674
ゲンキー	0.500	0.200	1,916
大黒天物産	0.400	0.500	2,065
ハニーズ	1	1	1,679
アルペン	1	1	3,163
クオール	1	1	1,780
ジェイアイエヌ	0.900	1	4,452
ビックカメラ	0.069	8	11,381
DCMホールディングス	9	9	8,068
Monotaro	2	3	14,356
アークランドサービス	—	0.300	1,357
J. フロント リテイリング	43	24	39,162
ドール・日レスホールディングス	3	3	5,880
マツモトキヨシホールディングス	3	4	16,842
ブロンコビリー	—	0.300	1,149
スタートトゥデイ	5	5	16,803
物語コーポレーション	0.400	0.500	1,805
ココカラファイン	1	2	6,650
三越伊勢丹ホールディングス	36	37	67,699
ウエルシアホールディングス	0.700	1	7,811
クリエイトSDホールディングス	0.800	0.900	3,766
ユー・ピーカンパニー	—	0.600	1,204
チムニー	—	0.500	1,175
ジョイフル本田	—	1	4,215
すかいらーく	—	7	9,450
ブックオフコーポレーション	1	1	1,275
あさひ	1	1	1,510
日本調剤	0.400	—	—
コスモス薬品	1	1	18,900

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
トーエル	—	1	1,147
セブン&アイ・ホールディングス	76	79	362,281
クリエイト・レストランツ・ホールディング	—	1	2,052
ツルハホールディングス	1	4	32,636
サンマルクホールディングス	0.600	0.700	5,453
フェリシモ	1	1	1,226
トリドール	1	2	3,274
クスリのアオキ	0.300	0.700	5,383
総合メディカル	0.400	0.500	3,190
はるやま商事	1	1	1,179
カップ・クリエイトホールディングス	1	3	3,441
ライトオン	1	—	—
ジーンズメイト	4	—	—
良品計画	1	2	35,064
三城ホールディングス	2	2	1,237
コナカ	2	2	1,526
ハウス オブ ローゼ	0.800	0.800	1,147
G-7ホールディングス	—	1	1,188
イオン北海道	1	1	1,190
ヒマラヤ	1	1	1,206
コーナン商事	2	2	4,173
ワタミ	2	2	2,519
マルシェ	1	1	1,185
ドンキホーテホールディングス	6	6	52,277
西松屋チェーン	3	3	3,640
ゼンショーホールディングス	7	9	10,437
幸楽苑	1	1	1,870
ハークスレイ	1	1	1,250
サイゼリヤ	2	2	5,639
ユナイテッドアローズ	2	2	9,125
ハイデイ日高	1	1	4,524
京都きもの友禅	1	1	1,213
コロワイド	6	6	10,067
壱番屋	0.700	0.900	4,608
トップカルチャー	2	2	1,207
P L A N T	—	0.900	1,188
スギホールディングス	3	3	20,026
スクロール	3	4	1,213
ヨンドシーホールディングス	1	1	2,829
ファミリーマート	6	6	34,880
木曽路	2	2	4,889
サトレストランシステムズ	1	1	2,005
千趣会	3	3	2,869

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
ケーヨー	3	3	2,066
上新電機	4	4	3,944
日本瓦斯	2	3	9,555
ベスト電器	7	7	1,177
マルエツ	4	5	2,485
ロイヤルホールディングス	3	3	5,888
東天紅	—	6	1,170
いなげや	2	2	3,099
島忠	4	4	14,168
チョダ	2	2	5,988
ライフコーポレーション	1	1	2,097
カスミ	3	3	3,794
リンガーハット	1	1	3,938
MR MAX	3	4	1,234
テンアライド	3	3	1,196
AOKIホールディングス	3	4	6,595
オークワ	3	3	2,931
コメリ	2	3	9,230
青山商事	4	4	19,008
しまむら	2	2	23,958
CFSコーポレーション	2	1	1,244
高島屋	25	28	30,352
松屋	3	3	6,881
エイ・ツー・オー リテイリング	11	9	19,485
近鉄百貨店	7	7	2,485
ニッセンホールディングス	3	4	1,193
パルコ	1	1	1,870
丸井グループ	23	22	31,212
アクシアル リテイリング	1	1	4,725
ダイエー	11	—	—
イズミヤ	7	—	—
イオン	72	78	101,920
ユニグループ・ホールディングス	17	18	13,049
イズミ	4	4	17,934
平和堂	3	3	10,085
フジ	2	2	4,638
ヤオコー	0.900	1	8,844
ゼビオ	2	2	5,720
ケーズホールディングス	3	4	15,356
Olympicグループ	—	1	1,255
アインファーマシーズ	1	2	10,062
元気寿司	0.700	0.600	1,659
ヤマダ電機	72	75	38,502

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
アー克蘭ドサカモト	1	1	3,467
ニトリホールディングス	7	8	62,320
グルメ杵屋	—	1	985
愛眼	4	4	1,220
吉野家ホールディングス	4	5	7,176
松屋フーズ	0.900	0.900	2,249
サガミチェーン	2	2	2,368
関西スーパーマーケット	1	1	1,201
王将フードサービス	0.900	1	6,328
ブレナス	2	2	4,922
ミニストップ	1	1	2,298
アークス	3	3	8,217
パロー	3	4	9,831
藤久	—	0.700	1,187
ベルク	0.900	0.800	2,652
大 庄	0.900	1	1,477
ファーストリテイリング	4	3	163,058
サンドラッグ	3	4	23,160
サックスパー ホールディングス	0.900	1	2,447
やまや	0.500	—	—
ベルーナ	4	4	2,538
銀行業(9.4%)			
島根銀行	0.800	0.800	1,182
じもとホールディングス	13	13	3,304
足利ホールディングス	7	12	6,072
東京TYフィナンシャルグループ	—	2	8,640
新生銀行	158	181	42,354
あおぞら銀行	95	128	55,040
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,382	1,525	1,167,770
りそなホールディングス	173	222	148,385
三井住友トラスト・ホールディングス	359	420	209,034
三井住友フィナンシャルグループ	138	143	671,905
第四銀行	24	24	10,992
北越銀行	20	21	5,166
西日本シティ銀行	64	67	26,599
千葉銀行	70	74	68,376
横浜銀行	120	131	99,586
常陽銀行	68	69	45,471
群馬銀行	41	45	38,610
武蔵野銀行	2	3	12,975
千葉興業銀行	3	3	3,342
筑波銀行	7	7	3,144
東京都市銀行	3	—	—

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
七十七銀行	29	32	23,520
青森銀行	13	15	5,715
秋田銀行	13	13	5,044
山形銀行	11	11	5,929
岩手銀行	1	1	6,994
東邦銀行	16	17	8,296
東北銀行	9	10	1,700
みちのく銀行	10	9	1,944
ふくおかフィナンシャルグループ	74	77	51,898
静岡銀行	53	56	68,712
十六銀行	23	24	11,232
スルガ銀行	18	20	49,928
八十二銀行	34	34	30,532
山梨中央銀行	12	12	6,300
大垣共立銀行	23	24	10,056
福井銀行	16	16	4,448
北國銀行	21	21	9,051
清水銀行	0.600	0.600	1,887
滋賀銀行	17	19	14,117
南都銀行	18	18	7,542
百五銀行	16	18	10,548
京都銀行	35	36	42,696
紀陽銀行	7	7	12,450
三重銀行	8	8	2,392
ほくほくフィナンシャルグループ	124	129	36,378
広島銀行	54	56	36,792
山陰合同銀行	11	12	12,432
中国銀行	13	13	25,687
鳥取銀行	6	6	1,566
伊予銀行	19	20	30,835
百十四銀行	20	21	9,114
四国銀行	13	15	3,900
阿波銀行	15	16	11,152
鹿児島銀行	13	13	10,777
大分銀行	11	12	5,424
宮崎銀行	12	13	6,318
肥後銀行	15	16	11,984
佐賀銀行	11	12	3,636
十八銀行	11	12	4,572
沖縄銀行	1	1	7,770
琉球銀行	3	3	7,187
八千代銀行	0.900	—	—
セブン銀行	68	64	38,716

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
みずほフィナンシャルグループ	2,363	2,632	571,274
山ロフィナンシャルグループ	18	19	26,068
長野銀行	6	6	1,272
名古屋銀行	16	17	8,024
北洋銀行	27	28	13,813
愛知銀行	0.700	0.700	4,235
第三銀行	10	11	2,288
中京銀行	7	8	1,744
東日本銀行	8	8	3,160
大光銀行	6	7	1,708
愛媛銀行	11	11	2,827
トマト銀行	7	8	1,520
みなと銀行	17	17	4,573
京葉銀行	15	16	11,488
関西アーバン銀行	25	2	3,452
栃木銀行	9	10	6,440
北日本銀行	0.600	0.600	1,833
東和銀行	22	26	2,730
福島銀行	22	23	2,185
大東銀行	12	12	1,824
トモニホールディングス	14	14	8,161
フィデアホールディングス	10	10	2,528
池田泉州ホールディングス	13	15	8,964
証券・商品先物取引業(1.4%)			
F P G	1	1	4,278
S B I ホールディングス	21	22	31,897
日本アジア投資	12	—	—
ジャフコ	2	2	12,168
大和証券グループ本社	181	178	168,441
野村ホールディングス	373	388	280,291
岡三証券グループ	14	16	14,960
丸三証券	5	6	5,262
東洋証券	7	8	3,016
麒麟フィナンシャル・ホールディングス	19	21	18,486
光世証券	4	5	1,205
水戸証券	6	5	2,631
いちよし証券	3	4	5,420
松井証券	9	9	10,621
だいこう証券ビジネス	—	1	1,138
マネックスグループ	19	22	6,406
カブドットコム証券	7	8	6,106
極東証券	2	2	4,632
岩井コスモホールディングス	1	1	2,785

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
マネースクウェアHD	—	0.900	1,259
マネーパートナーズグループ	4	3	1,305
保険業(2.5%)			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	40	42	149,319
アニコム ホールディングス	—	0.800	1,460
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	54	60	198,101
ソニーフィナンシャルホールディングス	17	18	32,942
第一生命保険	91	121	221,919
東京海上ホールディングス	70	78	333,366
T&Dホールディングス	62	69	109,979
その他金融業(1.2%)			
全国保証	2	4	19,257
クレディセゾン	14	15	35,665
芙蓉総合リース	1	2	8,640
興銀リース	3	3	8,949
東京センチュリーリース	4	4	13,770
日本証券金融	8	9	5,859
アイフル	33	31	14,755
ポケットカード	1	0.900	504
リコーリース	1	1	5,197
イオンフィナンシャルサービス	10	12	32,287
アコム	36	38	14,745
ジャックス	11	10	5,880
オリエントコーポレーション	40	43	8,823
日立キャピタル	3	3	9,401
アプラスフィナンシャル	1	9	1,264
オリックス	112	134	217,580
三菱UFJリース	46	48	27,907
日本取引所グループ	26	27	85,095
イー・ギャランティ	0.500	0.700	1,320
アサックス	0.800	0.700	1,173
NECキャピタルソリューション	0.600	0.800	1,556
不動産業(3.0%)			
日本駐車場開発	19	20	2,670
ヒューリック	30	32	42,628
東京建物不動産販売	2	—	—
野村不動産ホールディングス	12	11	23,962
プレサンスコーポレーション	0.400	0.600	2,262
常和ホールディングス	0.600	0.800	3,152
日本管理センター	—	1	1,343
フージャースホールディングス	2	2	1,489
オープンハウス	0.700	1	3,360
東急不動産ホールディングス	40	49	40,935

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
飯田グループホールディングス	8	12	20,245
パーク24	9	9	20,428
パラカ	1	—	—
三井不動産	86	101	340,875
三菱地所	128	141	382,533
平和不動産	3	3	6,123
東京建物	37	41	37,392
ダイビル	5	4	5,419
京阪神ビルディング	3	3	2,232
住友不動産	44	46	193,499
大京	31	30	5,310
テオーシー	6	6	4,972
東京楽天地	3	3	1,500
レオパレス21	21	20	14,601
スターツコーポレーション	—	2	3,704
フジ住宅	2	2	1,648
空港施設	2	2	1,626
明和地所	—	2	1,237
住友不動産販売	1	1	4,431
ゴールドクレスト	1	1	3,502
日本エスリード	—	1	1,214
日神不動産	2	2	1,237
タカラレーベン	6	8	4,838
サンヨーハウジング名古屋	1	1	1,447
イオンモール	11	12	29,335
トーセイ	2	2	1,983
穴吹興産	—	5	1,250
エヌ・ティ・ティ都市開発	11	11	14,537
サンフロンティア不動産	1	2	1,964
エフ・ジェー・ネクスト	—	2	1,239
ランドビジネス	2	3	1,258
グランディハウス	—	4	1,246
日本空港ビルデング	6	6	36,630
サービス業(3.0%)			
日本工営	6	7	3,535
ネクスト	1	2	2,280
日本M&Aセンター	1	3	11,935
ノバレーゼ	1	1	1,213
アコーディア・ゴルフ	7	7	9,234
タケエイ	1	2	1,954
パソナグループ	1	1	1,198
リンクアンドモチベーション	0.052	7	1,224
GCAサヴィアン	1	1	2,286

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
エス・エム・エス	1	2	3,095
デンプホールディングス	4	4	15,300
リニカル	1	1	1,231
クックパッド	0.900	1	6,324
スタジオアリス	0.800	0.900	1,874
シミックホールディングス	0.800	0.800	1,618
NECフィールディング	1	—	—
総合警備保障	7	6	23,550
カカコム	11	13	24,535
ルネサンス	1	1	1,230
ディップ	—	0.400	2,136
オプト	—	2	1,310
新日本科学	1	1	1,732
ツクイ	2	2	2,318
総合臨床ホールディングス	—	2	1,197
キャリアデザインセンター	—	1	1,242
エムスリー	0.064	17	44,474
ツカダ・グローバルホールディング	—	1	1,280
アウトソーシング	1	0.800	1,456
ウェルネット	—	0.500	1,133
ディー・エヌ・エー	10	9	13,662
博報堂DYホールディングス	26	27	35,823
ぐるなび	1	2	4,303
エスアールジータカミヤ	—	1	1,377
一休	0.014	1	2,764
ジャパンベストレスキューシステム	—	4	1,198
ファンコミュニケーションズ	—	3	3,969
ジェイコムホールディングス	1	1	1,221
PGMホールディングス	2	2	3,766
ティア	—	2	1,194
バリューコマース	1	2	1,214
J Pホールディングス	3	5	1,830
E P Sホールディングス	0.021	2	3,732
プレステージ・インターナショナル	1	1	1,560
アミューズ	0.600	0.600	1,746
ドリームインキュベータ	—	0.700	1,663
T A C	2	5	1,176
ケネディクス	22	28	15,329
電通	18	22	112,448
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.800	1	1,208
ぴあ	—	0.600	1,401
イオンファンタジー	0.800	0.800	1,260
みらかホールディングス	5	5	30,051

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
アルプス技研	1	0.800	1,428
サニックス	2	—	—
ダイオーズ	—	1	1,186
日本空調サービス	0.900	1	1,218
オリエンタルランド	5	5	160,488
ダスキン	5	5	11,223
明光ネットワークジャパン	1	2	2,498
ファルコホールディングス	1	1	1,376
秀英予備校	3	—	—
田谷	1	1	1,237
ラウンドワン	5	5	3,938
リゾートトラスト	6	7	20,971
ビー・エム・エル	1	1	4,074
もしもしホットライン	3	3	4,991
ユー・エス・エス	23	24	50,556
サイバーエージェント	—	3	21,238
楽天	62	87	171,609
セントラルスポーツ	0.700	0.700	1,514
リゾートソリューション	5	5	1,290
テクノプロ・ホールディング	—	2	5,088
リブセンス	1	1	1,218
ジャパンマテリアル	—	0.800	1,279
アサンテ	—	0.800	1,002
リクルートホールディングス	—	22	82,080
リロ・ホールディング	0.700	0.700	6,832
エイチ・アイ・エス	1	3	12,837
共立メンテナンス	1	1	6,710
イチネンホールディングス	2	2	2,160
建設技術研究所	1	1	1,630
スペース	1	1	1,362
燦ホールディングス	0.800	0.700	1,245
東京テアトル	7	8	1,144
よみうりランド	4	4	1,916
東京都競馬	15	14	4,438
常磐興産	7	8	1,216
カナモト	2	2	8,235
東京ドーム	14	14	7,784
西尾レントオール	1	1	5,040
トランス・コスモス	2	2	6,299
乃村工藝社	3	3	4,625
藤田観光	5	7	3,472
KNT-CTホールディングス	6	10	1,580
日本管財	0.800	1	2,659

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
トーカイ	0.900	0.900	3,447
白洋舎	5	5	1,235
セコム	20	19	142,272
セントラル警備保障	1	0.900	1,166
丹青社	2	2	1,890
メイテック	2	2	9,571
アサツー ディ・ケイ	3	3	12,464
応用地質	1	2	3,433
船井総研ホールディングス	2	2	2,145
進学会	2	2	1,235
ベネッセホールディングス	6	7	27,824
イオンディライト	1	1	5,363
ナック	1	1	1,353
ニチイ学館	4	3	4,461
ダイセキ	2	3	6,553
ステップ	1	1	1,264
合 計	株数・金額	29,670	31,843
	銘柄数 <比率>	1,552	1,625
			<98.6%>

- (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	T O P I X	百万円	百万円
		571	—

(注) 単位未満は切り捨てています。

◆投資信託財産の構成

(2015年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円	%
株	42,230,565	97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,147,950	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	43,378,516	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

(2015年2月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	43,351,296,074円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	217,931,717
株 式 (評価額)	42,230,565,930
未 収 入 金	857,860,280
未 収 配 当 金	48,893,147
差 入 委 託 証 拠 金	△ 3,955,000
(B) 負 債	524,368,868
未 払 金	66,641,500
未 払 解 約 金	457,727,368
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	42,826,927,206
元 本	29,591,687,886
次 期 繰 越 損 益 金	13,235,239,320
(D) 受 益 権 総 口 数	29,591,687,886口
1万口当たり基準価額 (C／D)	14,473円

- (注1) 期首元本額 28,167,947,954円
 期中追加設定元本額 14,613,818,469円
 期中一部解約元本額 13,190,078,537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 | 8,119,435,537 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) | 8,855,428,447 円 |
| ニッセイ日本バランス (標準型) SA (適格機関投資家限定) | 64,099,897 円 |
| ニッセイ日本バランス (成長型) SA (適格機関投資家限定) | 9,828,741 円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型) | 564,772,568 円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) | 2,854,782,666 円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) | 2,191,349,849 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) | 147,980,518 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) | 934,746,041 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) | 869,979,328 円 |
| ニッセイ厚生年金型バランス運用 (現物型) DB (適格機関投資家限定) | 4,978,508,098 円 |
| DCニッセイ国内株式インデックス | 776,196 円 |

◆損益の状況

当期(2014年2月21日～2015年2月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	750,733,920円
受 取 配 当 金	749,917,531
受 取 利 息	338,395
そ の 他 収 益 金	477,994
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,681,316,856
売 買 益	9,187,961,908
売 買 損	△ 506,645,052
(C) 先 物 取 引 等 損 益	205,442,472
取 引 益	302,690,332
取 引 損	△ 97,247,860
(D) 信 託 報 酬 等	△ 545,685
(E) 当期損益金 (A+B+C+D)	9,636,947,563
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	3,643,009,051
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,956,436,461
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 3,001,153,755
(I) 合 計 (E+F+G+H)	13,235,239,320
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	13,235,239,320

- (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。

.....

(計算期間：2014年2月21日～2015年2月20日)

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。



NISSAY
ASSET MANAGEMENT

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

(2014 年 2 月 21 日から 2015 年 2 月 20 日まで)

国内債券市況

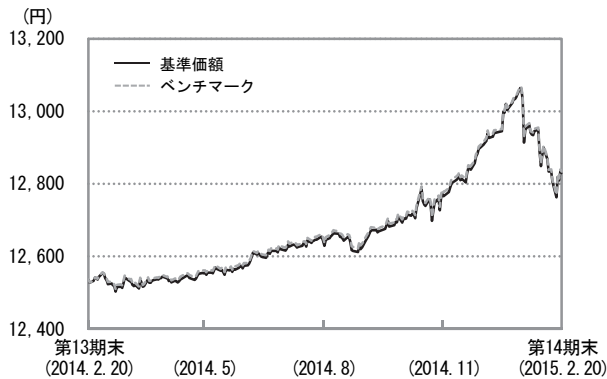


(注) 10年国債金利は、ブルームバーグのデータを使用しています。

前期末を 0.59% でスタートした 10 年国債金利は、期初以降、横ばい圏での推移となりましたが、6 月に欧州の景気減速懸念から欧州中央銀行 (E C B) が追加金融緩和を決定したことなどを受けて低下しました。9 月に入ると、米国の早期利上げ観測が高まり急速に円安が進行したため一時反発する場面もありましたが、世界経済をめぐる先行き不透明感の台頭や中東情勢悪化による地政学リスクの再燃から、再び金利は低下しました。11 月には、消費増税の延期などを好感した円安・株高の進行を受けて上昇したものの、その後は、日銀による国債大規模買い入れや原油価格の急落を受けた世界的な期待インフレ率の低下、新興国不安を背景とした投資家のリスク回避姿勢の高まりから急低下しました。

期末にかけては、金利急低下による債券価格の高値警戒感を受けた利益確定売りや、10 年国債の低調な入札結果等から反発し、結局、当期末の 10 年国債金利は 0.39% 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

期初以降、ウクライナ情勢悪化等の地政学リスクへの懸念や日銀による国債買い入れに加えて、原油価格の急落等を背景とした投資家のリスク回避姿勢の高まりから、金利が低下(債券価格は上昇)基調となったことから基準価額は上昇しました。期末にかけては、金利急低下による債券価格の高値警戒感を受けた利益確定売りや、10年国債の低調な入札結果等から金利が反発し、基準価額は下落したものの、期を通じて見ると上昇しました。

(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合指数で、前期末の基準価額にあわせて再指数化したものです。NOMURA-BPI総合指数とは、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。

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(注)、残存期間別構成比等を調整し、ベンチマーク(NOMURA-BPI総合指数)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+2.3%となり、おおむねベンチマーク騰落率(+2.4%)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

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」ならびに一般社団法人投資信託協会規則の改正に伴い、関連条項に所要の変更を行いました。
(2014年12月1日)
- ・信用リスク分散規制にかかる投資制限条項を追加するため、関連条項に所要の変更を行いました。
(2015年1月29日)

◆最近5期の運用実績

決 算 期	基準価額	期 中 騰落率	ベンチマーク	期 中 騰落率	債 券 組入比率	純資産 総 額
	円	%		%	%	百万円
10期(2011年2月21日)	11,601	1.4	11,616	1.5	98.9	30,081
11期(2012年2月20日)	12,025	3.7	12,003	3.3	100.0	13,816
12期(2013年2月20日)	12,243	1.8	12,242	2.0	99.5	15,223
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

(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合指数で、設定時を10,000として指数化したものです。NOMURA-BPI総合指数とは、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
(期 首)	円	%		%	%
2014年2月20日	12,536	—	12,542	—	99.0
2月末	12,543	0.1	12,551	0.1	99.1
3月末	12,511	△0.2	12,522	△0.2	99.3
4月末	12,528	△0.1	12,540	△0.0	104.0
5月末	12,565	0.2	12,578	0.3	98.9
6月末	12,605	0.6	12,615	0.6	99.2
7月末	12,624	0.7	12,636	0.8	99.2
8月末	12,663	1.0	12,676	1.1	99.0
9月末	12,673	1.1	12,686	1.1	99.3
10月末	12,732	1.6	12,745	1.6	99.3
11月末	12,804	2.1	12,820	2.2	99.2
12月末	12,940	3.2	12,954	3.3	99.4
2015年1月末	12,945	3.3	12,957	3.3	99.1
(期 末)					
2015年2月20日	12,827	2.3	12,839	2.4	99.5

(注) 騰落率は期首比です。

◆売買および取引の状況

(2014年2月21日～2015年2月20日)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円	千円
		41,249,348	30,808,618

(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

(2014年2月21日～2015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292回 利付国債(10年)	3,208,001	第103回 利付国債(5年)	1,988,766
第291回 利付国債(10年)	2,648,053	第105回 利付国債(5年)	1,811,016
第318回 利付国債(10年)	2,491,283	第271回 利付国債(10年)	1,776,375
第107回 利付国債(5年)	2,361,734	第92回 利付国債(20年)	1,689,430
第303回 利付国債(10年)	2,321,701	第312回 利付国債(10年)	1,593,705
第105回 利付国債(5年)	2,271,883	第303回 利付国債(10年)	1,515,312
第96回 利付国債(5年)	2,210,826	第330回 利付国債(2年)	1,349,860
第313回 利付国債(10年)	2,023,934	第329回 利付国債(2年)	1,326,939
第117回 利付国債(20年)	1,960,174	第313回 利付国債(10年)	1,147,511
第338回 利付国債(2年)	1,780,210	第318回 利付国債(10年)	1,130,433

(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

(2015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	
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	31,785,000	34,643,495	99.5	—	59.6	29.4	10.6
合計	31,785,000	34,643,495	99.5	—	59.6	29.4	10.6

(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
国債証券	第338回 利付国債(2年)	0.1000	2016/3/15	1,540,000	1,541,370
	第96回 利付国債(5年)	0.5000	2016/3/20	2,127,000	2,137,975
	第105回 利付国債(5年)	0.2000	2017/6/20	460,000	461,757
	第106回 利付国債(5年)	0.2000	2017/9/20	688,000	690,910
	第107回 利付国債(5年)	0.2000	2017/12/20	2,300,000	2,310,350
	第120回 利付国債(5年)	0.2000	2019/9/20	591,000	593,683
	第4回 利付国債(40年)	2.2000	2051/3/20	477,000	563,050
	第285回 利付国債(10年)	1.7000	2017/3/20	324,000	335,168
	第287回 利付国債(10年)	1.9000	2017/6/20	213,000	222,225
	第291回 利付国債(10年)	1.3000	2018/3/20	2,128,000	2,209,757
	第292回 利付国債(10年)	1.7000	2018/3/20	2,475,000	2,600,383
	第303回 利付国債(10年)	1.4000	2019/9/20	753,000	797,524
	第312回 利付国債(10年)	1.2000	2020/12/20	115,000	122,282
	第313回 利付国債(10年)	1.3000	2021/3/20	1,176,000	1,260,695
	第318回 利付国債(10年)	1.0000	2021/9/20	1,297,000	1,370,500
	第320回 利付国債(10年)	1.0000	2021/12/20	1,378,000	1,457,055
	第321回 利付国債(10年)	1.0000	2022/3/20	1,736,000	1,836,583
	第329回 利付国債(10年)	0.8000	2023/6/20	22,000	22,929
	第330回 利付国債(10年)	0.8000	2023/9/20	703,000	732,673
	第26回 利付国債(30年)	2.4000	2037/3/20	2,209,000	2,669,134
	第28回 利付国債(30年)	2.5000	2038/3/20	829,000	1,020,921
	第54回 利付国債(20年)	2.2000	2021/12/20	94,000	107,043
	第69回 利付国債(20年)	2.1000	2024/3/20	202,000	233,677
	第72回 利付国債(20年)	2.1000	2024/9/20	2,226,000	2,587,903
	第84回 利付国債(20年)	2.0000	2025/12/20	594,000	691,124
	第92回 利付国債(20年)	2.1000	2026/12/20	455,000	536,840
	第99回 利付国債(20年)	2.1000	2027/12/20	62,000	73,288
	第117回 利付国債(20年)	2.1000	2030/3/20	2,218,000	2,619,768
	第125回 利付国債(20年)	2.2000	2031/3/20	2,194,000	2,618,209
	第145回 利付国債(20年)	1.7000	2033/6/20	199,000	218,702
合 計		—	—	—	34,643,495

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

◆投資信託財産の構成

(2015年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	34,643,495	98.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	417,429	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	35,060,925	100.0

(注) 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

(2015年2月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	35,060,925,126円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	249,386,704
公 社 債 (評価額)	34,643,495,460
未 収 利 息	135,316,033
前 払 費 用	32,726,929
(B) 負 債	253,279,799
未 払 金	214,748,110
未 払 解 約 金	38,531,689
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	34,807,645,327
元 本	27,135,186,062
次 期 繰 越 損 益 金	7,672,459,265
(D) 受 益 権 総 口 数	27,135,186,062口
1万口当たり基準価額 (C/D)	12,827円

- (注1) 期首元本額 19,351,485,760円
 期中追加設定元本額 16,740,286,495円
 期中一部解約元本額 8,956,586,193円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーフンド別内訳は、次の通りです。
 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) 1,287,047,974円
 DCニッセイ国内債券インデックス 5,879,138,575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) 66,806,769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) 5,519,260円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型) 1,361,012,346円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) 3,028,531,579円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) 863,394,513円
 ニッセイ/バナゴラ・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) 425,212,773円
 ニッセイ/バナゴラ・インデックスバランス (標準型) S A (適格機関投資家限定) 1,139,100,678円
 ニッセイ/バナゴラ・インデックスバランス (成長型) S A (適格機関投資家限定) 490,808,822円
 ニッセイ厚生年金型バランス運用 (現物型) D B (適格機関投資家限定) 12,289,416,267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 299,196,506円

◆損益の状況

当期(2014年2月21日～2015年2月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	350,413,447円
受 取 利 息	350,413,447
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	192,450,460
売 買 益	373,733,016
売 買 損	△ 181,282,556
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	542,863,907
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	4,906,846,233
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,560,035,146
(F) 解 約 差 損 益 金	△2,337,286,021
(G) 合 計 (C+D+E+F)	7,672,459,265
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	7,672,459,265

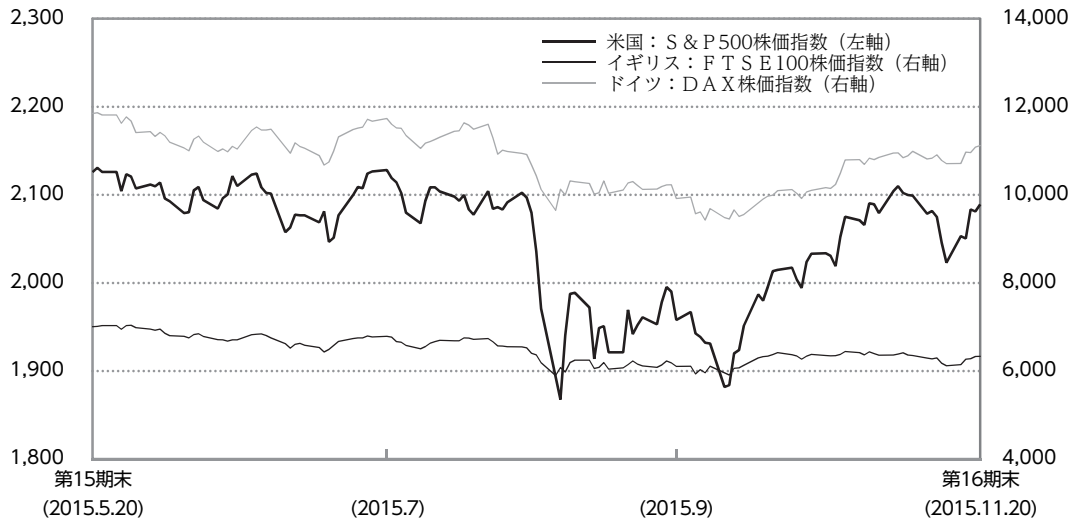
- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
- (注2) (E)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。
- (注3) (F)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

運用経過

(2015年5月21日から2015年11月20日まで)

海外株式市況

海外主要株価指数の推移



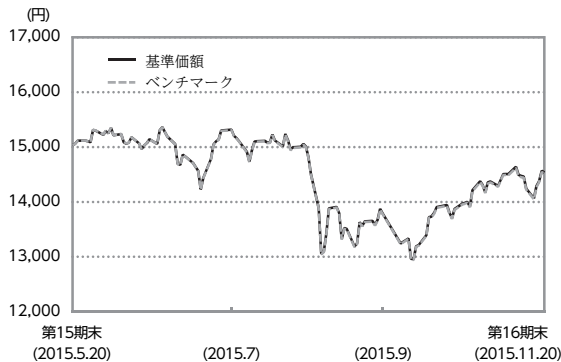
(注) 各指数はブルームバークのデータを使用しています。

期前半は、ギリシャにおいて債務問題が再燃したことから、ギリシャ政府とユーロ圏首脳間での交渉の進展状況に応じて株式市場も上下する展開となりました。7月上旬になると、ギリシャのユーロ圏離脱懸念が高まったことから市場は急落したものの、その後はギリシャ支援に関する合意が成立したことにより、反発しました。

期後半は、8月中旬にかけて中国経済の成長に対する懸念の高まりを発端として、世界的に株価が急落し、その後も投資家のリスク回避姿勢が強まり、市場は振れ幅の大きな展開となりました。

10月初旬以降は、欧州中央銀行（E C B）総裁による金融緩和を示唆する発言や、中国人民銀行（中央銀行）による利下げ発表といった各国政策当局の金融緩和的な姿勢が好感されて市場は上昇基調となりましたが、期を通じて見ると下落して当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは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。なお円換算ベースの指数は、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売相場場の仲値により邦貨換算しています。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有します。以下同じです。

■基準価額の主な変動要因

当期は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。ギリシャのユーロ圏離脱懸念や中国経済の成長減速などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、株式市場は急落しました。その後、ギリシャのユーロ圏残留が決定したことや、ECB総裁による金融緩和発言、中国人民銀行による利下げ発表といった各国政策当局の金融緩和的な姿勢が好感されて市場が上昇基調になったことを受けて基準価額も反転したものの、期を通じて見ると下落して当期末を迎えました。

ポートフォリオ

日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は-3.3%となり、ベンチマーク騰落率（-3.5%）にほぼ連動しました。

今後の運用方針

日本を除く世界主要先進国の株式に投資することにより、MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

◆最近5期の運用実績

決 算 期	基準価額	期 中 騰落率	ベンチマーク	期 中 騰落率	株 式 組入比率	株式先物 比 率	投資信託 証 券 組入比率	純資産 総 額
	円	%		%	%	%	%	百万円
12期(2013年11月20日)	10,799	5.9	10,689	5.7	96.2	1.7	1.7	23,323
13期(2014年5月20日)	11,673	8.1	11,539	8.0	94.9	2.7	2.0	35,874
14期(2014年11月20日)	13,982	19.8	13,847	20.0	92.0	6.3	2.0	43,928
15期(2015年5月20日)	15,035	7.5	14,862	7.3	93.9	3.6	2.2	52,091
16期(2015年11月20日)	14,534	△ 3.3	14,349	△ 3.5	93.7	3.6	2.4	50,880

(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。なお円換算ベースの指数は、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有します。以下同じです。

(注2) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率	株 式 組入比率	株式先物 比 率	投資信託 証 券 組入比率
(期 首) 2015年5月20日	円 15,035	% -	14,862	% -	% 93.9	% 3.6	% 2.2
5月末	15,298	1.7	15,126	1.8	94.7	2.9	2.3
6月末	14,693	△ 2.3	14,522	△ 2.3	94.0	3.5	2.2
7月末	15,107	0.5	14,925	0.4	92.8	4.9	2.2
8月末	13,909	△ 7.5	13,737	△ 7.6	90.9	7.4	2.2
9月末	12,956	△13.8	12,795	△13.9	94.3	2.9	2.5
10月末	14,371	△ 4.4	14,191	△ 4.5	92.6	4.9	2.4
(期 末) 2015年11月20日	14,534	△ 3.3	14,349	△ 3.5	93.7	3.6	2.4

(注) 騰落率は期首比です。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

◆売買および取引の状況

(2015年5月21日～2015年11月20日)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 7,613 (771)	千米・ドル 44,401 (△ 846)	百株 6,766	千米・ドル 39,629
	カ ナ ダ	978 (13)	千カナダ・ドル 3,349 (△ 0.060)	596	千カナダ・ドル 2,757
	オーストラリア	1,927 (218)	千オーストラリア・ドル 2,647 (△ 2)	1,187	千オーストラリア・ドル 1,981
	香 港	1,847 (380)	千香港・ドル 5,488	1,066	千香港・ドル 5,646
	シンガポール	1,024 (1)	千シンガポール・ドル 439	328	千シンガポール・ドル 268
	ニュージーランド	335	千ニュージーランド・ドル 114	160	千ニュージーランド・ドル 27
	イ ギ リ ス	7,468 (21,756)	千イギリス・ポンド 4,116 (△ 6)	41,174	千イギリス・ポンド 3,189
	イ ス ラ エ ル	124	千イスラエル・シェケル 781	18	千イスラエル・シェケル 434
	ス イ ス	406 (9)	千スイス・フラン 2,820 (△ 19)	351	千スイス・フラン 2,262
	デ ン マ ー ク	110	千デンマーク・クローネ 3,475	81	千デンマーク・クローネ 3,028
	ノ ル ウ ェ ー	109	千ノルウェー・クローネ 1,242	67	千ノルウェー・クローネ 938
	ス ウ ェ ー デ ン	504 (89)	千スウェーデン・クローナ 6,701	613	千スウェーデン・クローナ 5,762

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	462	102	456	80
		オランダ	423 (89)	860 (0.000)	364	689
		ベルギー	38	311	30	252
		ルクセンブルグ	24 (△ 11)	35 (△0.000)	10	18
		フランス	725 (△ 24)	2,647 (△0.599)	501	1,951
		ドイツ	528 (81)	2,429 (△ 34)	495	1,920
		ポルトガル	1,043	33	26	8
		スペイン	1,484 (5,430)	1,071 (45)	5,743	746
		イタリア	1,637 (26)	663 (△ 2)	1,149	525
		フィンランド	141	205	116	144
		オーストリア	14	42	120	51
		そ の 他	4 (21)	36	26	156

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

(注2) ()内は株式分割、合併などによる増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 地域は発行通貨によって区分しています。また、その他には国際機関等を含みます。以下同じです。

(注4) 株数および金額の単位未満は切り捨てています。ただし、株数および金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

(2) 投資信託証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	(アメリカ)	千口	千米・ドル	千口	千米・ドル
	BOSTON PROPERTIES INC	0.332	40	0.318	39
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	0.764	63	0.732	58
	PROLOGIS INC	1	49	1	44
	ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	1	15	1	10
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.288	48	0.294	49
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.139	10	0.057	4
	DUKE REALTY CORP	0.583	11	0.224	4

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
外 国	(アメリカ)	千口	千米・ドル	千口	千米・ドル
	EQUITY RESIDENTIAL	1	79	0.794	58
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.154	33	0.125	27
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.118	15	0.079	10
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	1	45	1	29
	HCP INC	1	38	0.946	35
	WELLTOWER INC	1	75	0.763	52
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	1	30	1	29
	KIMCO REALTY CORP	0.500	11	0.515	12
	LIBERTY PROPERTY TRUST	0.227	7	—	—
	MACERICH CO/THE	0.193	14	0.320	25
	PLUM CREEK TIMBER CO	0.288	11	0.114	4
	PUBLIC STORAGE	0.353	72	0.321	65
	RAYONIER INC	—	—	1	39
	REGENCY CENTERS CORP	0.161	9	0.062	3
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.745	137	0.683	124
	SL GREEN REALTY CORP	0.216	23	0.190	21
	UDR INC	0.458	14	0.296	10
	VENTAS INC	0.797	47	0.722	43
	VORNADO REALTY TRUST	0.363	34	0.351	33
	REALTY INCOME CORP	0.419	18	0.371	17
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1	111	0.072	5
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.236	15	0.154	10
	IRON MOUNTAIN INC	0.772	27	0.129	4
	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	0.539	10	0.225	4
	AMERICAN TOWER REIT INC	1	127	0.921	83
	EQUINIX INC	0.136 (0.020)	37 (5)	0.109	29
	VEREIT	1	9	0.585	4
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2	63	—	—
	COMMUNICATIONS SALES & LE	0.102	2	—	—
	CARE CAPITAL PROPERTIES INC	— (1)	—	1	35
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	— (0.510)	— (11)	0.510	10
	(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT—UTS	0.392	8	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.375	9	—	—

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
外	(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	DEXUS PROPERTY GROUP	2	20	0.706	5
	NOVION PROPERTY GROUP	—	—	31	79
	GPT GROUP	4	19	1	5
	GOODMAN GROUP	3	21	2	13
	STOCKLAND	4	19	2	11
	WESTFIELD CORP	4	41	3	38
	MIRVAC GROUP	7	14	2	4
	VICINITY CENTRES	31	89	2	6
	SCENTRE GROUP	11	45	10	42
国	(香港)		千香港・ドル		千香港・ドル
	LINK REIT	5	222	5	221
	(シンガポール)		千シンガポール・ドル		千シンガポール・ドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	4	9 (△0.011)	—	—
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	3	5	—	—
	CAPITALAND MALL TRUST	4	9	—	—
	SUNTEC REIT	4	7 (△0.140)	—	—
	(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
	BRITISH LAND CO PLC	1	16	1	16
	HAMMERSON PLC	1	8	0.508	3
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1	21	1	20
	SEGRO PLC	1	7	—	—
	INTU PROPERTIES PLC	1	5	—	—
	(ユーロ／フランス)		千ユーロ		千ユーロ
	UNIBAIL－RODAMCO SE	0.228	54	0.215	48
	KLEPIERRE	0.551	22	0.123	4
	GECINA SA	0.154	18	—	—
	FONCIERE DES REGIONS	0.093	7	—	—
	ICADE	0.031	2	—	—

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
株 式 先 物 取 引	13,259	13,262	—	—

(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

(2015年5月21日～2015年11月20日)

株 式

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC	12	174,496	14,536	APPLE INC	12	183,486	14,360
MICROSOFT CORP	15	89,588	5,688	MICROSOFT CORP	16	92,587	5,483
EXXON MOBIL CORP	9	88,344	9,697	EXXON MOBIL CORP	9	89,613	9,533
GENERAL ELECTRIC CO	23	75,540	3,212	JOHNSON & JOHNSON	6	71,036	11,590
FACEBOOK INC—A	6	73,170	11,153	WELLS FARGO & CO	10	69,635	6,439
WELLS FARGO & CO	10	72,885	6,734	GENERAL ELECTRIC CO	22	68,995	3,135
JOHNSON & JOHNSON	6	72,279	11,925	NESTLE SA	7	63,702	9,042
ALPHABET INC—CL C	0.922	67,886	73,629	JPMORGAN CHASE & CO	8	62,043	7,640
NESTLE SA	7	66,798	9,068	PFIZER INC	15	61,665	4,037
JPMORGAN CHASE & CO	8	66,067	8,104	NOVARTIS AG	4	57,445	11,505

(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

(2015年11月20日現在)

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期			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	79	83	1,322	162,611	資本財
ABBOTT LABORATORIES	196	195	896	110,193	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	208	226	1,372	168,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCENTURE PLC	82	82	884	108,813	ソフトウェア・サービス
ACE LTD	43	42	495	60,948	保険
ACTIVISION BLIZZARD INC	66	68	252	31,099	ソフトウェア・サービス
ACUITY BRANDS INC	—	5	133	16,407	資本財
ADOBE SYSTEMS INC	61	65	604	74,353	ソフトウェア・サービス
ADT CORP/THE	21	24	81	10,072	商業・専門サービス
ADVANCE AUTO PARTS	9	9	160	19,685	小売
AES CORP	88	92	88	10,868	公益事業
AETNA INC	45	46	459	56,511	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	7	7	129	15,883	各種金融
AFLAC INC	58	56	371	45,671	保険
AGCO CORP	10	11	54	6,645	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44	45	173	21,388	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	27	26	376	46,276	素材
AIRGAS INC	8	9	127	15,729	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	23	23	138	17,028	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	13	15	79	9,829	素材
ALCOA INC	157	174	152	18,799	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	25	29	515	63,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALKERMES PLC	19	20	146	18,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	2	2	110	13,558	保険
ALLERGAN PLC	48	51	1,562	192,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	8	8	239	29,476	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	14	15	94	11,573	公益事業
ALLSTATE CORP	55	53	340	41,881	保険
ALLY FINANCIAL INC	54	58	112	13,861	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	10	105	12,925	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	36	37	2,886	354,893	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	38	40	2,999	368,808	ソフトウェア・サービス
ALTERA CORP	40	40	214	26,316	半導体・半導体製造装置
ALTRIA GROUP INC	257	259	1,489	183,117	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	51	52	3,449	424,111	小売
AMEREN CORPORATION	33	33	144	17,780	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	23	23	100	12,306	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	63	64	365	44,930	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	121	120	874	107,526	各種金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	182	175	1,086	133,604	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24	24	138	16,971	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	24	23	273	33,659	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	28	27	273	33,576	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	35	36	134	16,493	各種金融
AMETEK INC	33	32	181	22,287	資本財
AMGEN INC	99	100	1,597	196,403	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	41	41	227	28,025	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	66	66	398	49,016	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	41	42	252	31,028	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	11	12	110	13,624	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	6	11	26	3,260	エネルギー
ANTHEM INC	35	34	445	54,821	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	35	36	347	42,672	保険
APACHE CORP	49	50	250	30,798	エネルギー
APPLE INC	766	759	9,018	1,108,898	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	159	161	294	36,249	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	—	30	99	12,188	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16	16	124	15,364	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	84	81	297	36,556	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	12	12	73	9,042	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	22	98	12,093	保険
ASHLAND INC	8	8	98	12,100	素材
ASSURANT INC	8	8	77	9,470	保険
AT&T INC	678	811	2,728	335,463	電気通信サービス
AUTODESK INC	30	30	190	23,397	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	12	11	149	18,418	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	62	61	534	65,689	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	8	10	65	8,069	小売
AUTOZONE INC	4	4	326	40,137	小売
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	33	34	428	52,730	半導体・半導体製造装置
AVERY DENNISON CORP	11	12	83	10,257	素材
AVNET INC	17	18	83	10,231	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AVON PRODUCTS INC	52	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	20	60	7,425	素材
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	11	13	76	9,357	保険
BAKER HUGHES INC	53	53	274	33,726	エネルギー
BALL CORP	16	17	122	15,090	素材
BANK OF AMERICA CORP	1,372	1,383	2,446	300,846	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	147	147	646	79,471	各種金融
BARD (C.R.) INC	10	9	181	22,351	ヘルスケア機器・サービス
BAXALTA INC -W/I	—	71	245	30,237	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAXTER INTERNATIONAL INC	70	71	270	33,245	ヘルスケア機器・サービス
BB&T CORPORATION	94	102	394	48,469	銀行
BE AEROSPACE INC	13	15	68	8,371	資本財
BECTON DICKINSON & CO	26	27	412	50,781	ヘルスケア機器・サービス
BED BATH & BEYOND INC	24	22	119	14,748	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	150	153	2,097	257,880	各種金融
BEST BUY CO INC	39	41	126	15,586	小売
BIOGEN INC	30	30	896	110,220	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20	21	217	26,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	17	16	581	71,529	各種金融
BOEING CO	88	86	1,292	158,879	資本財
BORGWARNER INC	30	30	128	15,825	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	173	176	310	38,211	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	217	219	1,470	180,817	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM CORP	70	72	384	47,289	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP -CL B	16	16	172	21,152	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	19	18	123	15,238	食品・飲料・タバコ
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	19	19	134	16,530	運輸
CA Inc	44	44	124	15,339	ソフトウェア・サービス
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	24	27	84	10,431	メディア
CABOT OIL & GAS CORP	55	56	115	14,171	エネルギー
CALPINE CORP	42	48	69	8,599	公益事業
CAMERON INTERNATIONAL CORP	25	25	175	21,639	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	26	25	125	15,401	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	72	71	571	70,276	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	43	43	380	46,758	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	28	28	158	19,497	小売
CARNIVAL CORP	51	54	281	34,570	消費者サービス
CATERPILLAR INC	75	75	528	64,977	資本財
CBRE GROUP INC	40	40	146	17,984	不動産
CBS CORP-CL B	63	60	312	38,420	メディア
CDK GLOBAL INC	—	18	89	11,039	ソフトウェア・サービス
CELANESE CORP-SERIES A	19	20	148	18,283	素材
CELGENE CORP	104	104	1,192	146,689	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	—	15	83	10,220	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	53	55	94	11,650	公益事業
CENTURYLINK INC	77	76	217	26,780	電気通信サービス
CERNER CORP	40	40	235	28,926	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6	31	147	18,169	素材
CHARLES SCHWAB CORP	153	155	513	63,193	各種金融
CHARTER COMMUNICATION-A	10	11	212	26,067	メディア
CHENIERE ENERGY INC	30	29	147	18,153	エネルギー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	66	83	45	5,564	エネルギー
CHEVRON CORP	247	247	2,247	276,341	エネルギー
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	11	13	58	7,184	資本財
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4	4	250	30,828	消費者サービス
CHUBB CORP	31	30	395	48,631	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	18	17	147	18,124	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	34	33	433	53,299	ヘルスケア機器・サービス
CIMAREX ENERGY CO	11	12	145	17,923	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19	21	127	15,701	保険
CINTAS CORP	12	13	120	14,842	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	668	670	1,836	225,768	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIT GROUP INC	22	23	99	12,216	銀行
CITIGROUP INC	395	399	2,201	270,637	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	57	150	18,541	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	21	21	156	19,260	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	17	17	220	27,118	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	41	42	410	50,485	各種金融
CMS ENERGY CORP	36	37	134	16,537	公益事業
COACH INC	36	37	109	13,497	耐久消費財・アパレル
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	34	40	31	3,905	エネルギー
COCA-COLA CO	514	545	2,350	289,074	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	30	28	146	18,010	食品・飲料・タバコ
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	79	80	524	64,488	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	118	113	751	92,443	家庭用品・パーソナル用品
COLUMBIA PIPELINE GROUP -W/I	—	42	82	10,141	エネルギー
COMCAST CORP	284	279	1,752	215,523	メディア
COMCAST CORP	52	53	333	41,008	メディア
COMERICA INC	22	23	110	13,532	銀行
COMPUTER SCIENCES CORP	18	18	131	16,130	ソフトウェア・サービス
CONAGRA FOODS INC	56	57	236	29,093	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	15	16	176	21,669	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	160	162	869	106,860	エネルギー
CONSOL ENERGY INC	28	31	24	3,063	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	39	38	245	30,201	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	22	22	310	38,215	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	11	12	44	5,515	エネルギー
COOPER COS INC/THE	6	6	94	11,597	ヘルスケア機器・サービス
CORE LABORATORIES N.V.	5	6	68	8,426	エネルギー
CORNING INC	167	165	313	38,558	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	57	57	943	115,984	食品・生活必需品小売り
CREE INC	14	—	—	—	半導体・半導体製造装置
CROWN HOLDINGS INC	17	19	97	12,025	素材
CSX CORP	131	131	385	47,370	運輸
CUMMINS INC	22	22	223	27,427	資本財
CVS HEALTH CORP	149	148	1,374	168,973	食品・生活必需品小売り
D&B CORP	4	5	54	6,733	商業・専門サービス
DANAHER CORP	82	80	783	96,381	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	17	15	83	10,251	消費者サービス
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	22	23	170	20,911	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	44	41	314	38,646	資本財
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	38	38	319	39,303	自動車・自動車部品
DELTA AIR LINES INC	27	28	136	16,743	運輸
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	17	18	114	14,114	ヘルスケア機器・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	
DEVON ENERGY CORPORATION	50	52	240	29,619	エネルギー
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	8	—	—	—	エネルギー
DICK’S SPORTING GOODS INC	11	13	49	6,113	小売
DIRECTV	57	—	—	—	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	59	58	335	41,206	各種金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	15	19	60	7,380	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	39	38	112	13,772	メディア
DISH NETWORK CORP	29	30	193	23,841	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	40	40	250	30,824	小売
DOLLAR TREE INC	27	30	201	24,798	小売
DOMINION RESOURCES INC/VA	76	78	538	66,275	公益事業
DOVER CORP	22	21	140	17,268	資本財
DOW CHEMICAL CO	153	155	827	101,746	素材
DR HORTON INC	41	44	142	17,514	耐久消費財・アパレル
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	26	25	231	28,423	食品・飲料・タバコ
DTE ENERGY COMPANY	23	24	196	24,171	公益事業
DUKE ENERGY CORP	92	91	625	76,922	公益事業
E*TRADE FINANCIAL	—	39	117	14,464	各種金融
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	19	20	142	17,488	素材
EATON CORP PLC	62	61	348	42,838	資本財
EATON VANCE CORP	14	16	61	7,610	各種金融
EBAY INC	146	144	415	51,029	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	35	35	417	51,309	素材
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	7	8	69	8,583	家庭用品・パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	41	43	259	31,941	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	14	14	226	27,801	ヘルスケア機器・サービス
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	118	119	798	98,136	素材
ELECTRONIC ARTS INC	41	41	294	36,262	ソフトウェア・サービス
ELI LILLY & CO	131	131	1,103	135,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMC CORP/MASSACHUSETTS	265	255	640	78,727	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EMERSON ELECTRIC CO	90	87	440	54,161	資本財
ENDO INTERNATIONAL PLC	22	27	162	19,928	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENERGEN CORP	9	11	63	7,839	エネルギー
ENSCO PLC	28	32	55	6,829	エネルギー
ENTERGY CORP	24	24	159	19,583	公益事業
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	25	64	7,919	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	71	72	597	73,465	エネルギー
EQT CORP	20	19	118	14,588	エネルギー
EQUIFAX INC	16	16	177	21,820	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC	30	30	256	31,508	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	5	6	111	13,726	保険
EVERSOURCE ENERGY	43	43	220	27,080	公益事業
EXELON CORP	112	113	320	39,372	公益事業
EXPEDIA INC	13	13	177	21,845	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	25	26	132	16,253	運輸

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	95	95	801	98,553	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	553	550	4,422	543,753	エネルギー
F5 NETWORKS INC	9	9	101	12,480	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	261	281	2,992	367,983	ソフトウェア・サービス
FAMILY DOLLAR STORES	13	—	—	—	小売
FASTENAL CO	37	36	144	17,719	資本財
FEDEX CORP	35	35	586	72,127	運輸
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	38	37	247	30,412	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	109	108	221	27,252	銀行
FIREEYE INC	10	15	35	4,359	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	16	19	128	15,828	銀行
FIRSTENERGY CORP	56	57	178	21,893	公益事業
FISERV INC	32	31	302	37,212	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10	10	154	19,009	ソフトウェア・サービス
FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD	72	76	84	10,418	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLIR SYSTEMS INC	17	19	58	7,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWERVE CORP	16	18	82	10,151	資本財
FLUOR CORP	20	19	95	11,795	資本財
FMC CORP	16	18	79	9,828	素材
FMC TECHNOLOGIES INC	30	31	103	12,755	エネルギー
FNF GROUP	—	34	120	14,844	保険
FOOT LOCKER INC	18	18	113	13,905	小売
FORD MOTOR CO	468	488	711	87,489	自動車・自動車部品
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	—	21	117	14,492	資本財
FOSSIL GROUP INC	5	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FRANKLIN RESOURCES INC	53	53	222	27,352	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	137	142	120	14,762	素材
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD	—	15	52	6,509	半導体・半導体製造装置
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	127	157	77	9,580	電気通信サービス
GAMESTOP CORP-CLASS A	13	15	58	7,140	小売
GAP INC	30	33	84	10,415	小売
GARMIN LTD	13	16	59	7,292	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	—	11	99	12,239	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	36	36	535	65,809	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,312	1,327	4,018	494,151	資本財
GENERAL MILLS INC	79	78	447	54,980	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	167	190	687	84,578	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	20	20	181	22,283	小売
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	61	—	—	—	保険
GILEAD SCIENCES INC	197	193	2,062	253,639	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	51	51	988	121,499	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	36	123	15,128	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	35	36	134	16,542	消費者サービス
HALLIBURTON CO	110	111	425	52,363	エネルギー
HANESBRANDS INC	53	54	166	20,485	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
(アメリカ)		百株	百株	千米・ドル	千円	
HARLEY-DAVIDSON INC		28	27	135	16,659	自動車・自動車部品
HARMAN INTERNATIONAL		—	9	96	11,866	耐久消費財・アパレル
HARRIS CORP		13	16	140	17,229	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC		57	54	252	31,099	保険
HASBRO INC		13	15	114	14,092	耐久消費財・アパレル
HCA HOLDINGS INC		39	43	286	35,176	ヘルスケア機器・サービス
HELMERICH & PAYNE		13	15	82	10,197	エネルギー
HENRY SCHEIN INC		11	11	173	21,276	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE		20	20	172	21,155	食品・飲料・タバコ
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC		60	52	88	10,903	運輸
HESS CORP		35	34	207	25,561	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS		—	239	329	40,516	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		52	66	155	19,146	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP		22	24	125	15,443	エネルギー
HOLOGIC INC		27	32	128	15,812	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC		172	171	2,171	267,003	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		96	97	1,027	126,380	資本財
HORMEL FOODS CORP		18	19	134	16,548	食品・飲料・タバコ
HOSPIRA INC		22	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HP INC		244	239	329	40,545	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUDSON CITY BANCORP INC		60	—	—	—	銀行
HUMANA INC		20	19	314	38,695	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC		105	108	127	15,705	銀行
IHS INC-CLASS A		8	9	112	13,800	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC		48	43	403	49,624	資本財
ILLUMINA INC		18	19	330	40,596	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP		20	21	247	30,407	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND PLC		35	35	209	25,710	資本財
INTEGRYS ENERGY GROUP INC		10	—	—	—	公益事業
INTEL CORP		632	624	2,143	263,561	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC		14	14	385	47,427	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP		122	123	1,684	207,159	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC		10	10	129	15,909	素材
INTERNATIONAL PAPER CO		54	54	224	27,634	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		55	56	132	16,273	メディア
INTUIT INC		35	34	336	41,386	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC		4	4	244	30,004	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD		57	57	191	23,506	各種金融
ISIS PHARMACEUTICALS INC		14	16	104	12,843	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		16	17	74	9,212	資本財
JARDEN CORP		23	25	115	14,252	耐久消費財・アパレル
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		8	8	119	14,713	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		12	13	103	12,766	運輸
JM SMUCKER CO		13	13	165	20,340	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON		366	365	3,744	460,420	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
JOHNSON CONTROLS INC	87	86	393	48,387	自動車・自動車部品
JONES LANG LASALLE INC	—	6	98	12,095	不動産
JOY GLOBAL INC	12	—	—	—	資本財
JPMORGAN CHASE & CO	488	488	3,307	406,664	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	50	48	146	17,980	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	14	14	137	16,961	運輸
KELLOGG CO	35	35	236	29,112	食品・飲料・タバコ
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	16	15	74	9,119	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	115	109	143	17,686	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	48	48	583	71,804	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	235	242	573	70,560	エネルギー
KLA-TENCOR CORP	22	21	144	17,743	半導体・半導体製造装置
KOHL'S CORP	27	27	123	15,143	小売
KRAFT FOODS GROUP INC	77	—	—	—	食品・飲料・タバコ
KRAFT HEINZ CO/THE	—	78	575	70,754	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	60	122	458	56,369	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	33	32	302	37,156	小売
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	11	11	139	17,125	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	13	13	161	19,878	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	21	22	171	21,078	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	53	53	246	30,317	消費者サービス
LEAR CORP	—	10	130	16,025	自動車・自動車部品
LEGG MASON INC	12	14	61	7,593	各種金融
LEGGETT & PLATT INC	17	18	84	10,390	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	22	23	118	14,580	耐久消費財・アパレル
LEUCADIA NATIONAL CORP	38	44	80	9,890	各種金融
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	38	41	208	25,627	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	28	31	132	16,272	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	88	83	338	41,627	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC A	55	59	157	19,339	小売
LIBERTY MEDIA CORP	8	11	47	5,827	メディア
LIBERTY MEDIA CORP - C	30	30	118	14,539	メディア
LINCOLN NATIONAL CORP	34	33	187	23,089	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP	31	32	147	18,153	半導体・半導体製造装置
LINKEDIN CORP - A	14	14	363	44,702	ソフトウェア・サービス
LKQ CORP	37	41	121	14,898	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	35	35	793	97,557	資本財
LOEWS CORP	45	38	144	17,769	保険
LORILLARD INC	40	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LOWE'S COS INC	129	124	915	112,628	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	13	15	72	8,927	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	55	52	493	60,662	素材
M&T BANK CORP	15	21	264	32,480	銀行
MACY'S INC	46	44	171	21,045	小売
MALLINCKRODT PLC	15	15	95	11,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
MANPOWER GROUP	9	10	95	11,730	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	89	90	159	19,571	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	36	71	399	49,134	エネルギー
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	30	29	214	26,385	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	70	70	393	48,440	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7	7	125	15,404	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	48	58	51	6,322	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	46	47	141	17,367	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	130	132	1,308	160,935	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	41	45	110	13,564	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	36	39	156	19,277	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	14	15	132	16,323	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	127	126	1,430	175,841	消費者サービス
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	35	36	347	42,691	各種金融
MCKESSON CORP	30	30	565	69,560	ヘルスケア機器・サービス
MDU RESOURCES GROUP INC	23	25	46	5,749	公益事業
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	27	27	225	27,730	食品・飲料・タバコ
MEADWESTVACO CORP	21	—	—	—	素材
MEDIVATION INC	9	21	87	10,803	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDTRONIC PLC	184	186	1,412	173,635	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO INC	372	372	2,020	248,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	125	124	631	77,659	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	3	3	129	15,886	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	50	60	135	16,704	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	27	26	108	13,370	耐久消費財・アパレル
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26	28	134	16,492	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	140	145	230	28,320	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	1,024	1,012	5,462	671,642	ソフトウェア・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	8	8	160	19,696	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	20	20	193	23,744	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	219	214	955	117,453	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	63	62	600	73,892	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	19	18	281	34,618	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	25	23	248	30,509	各種金融
MORGAN STANLEY	192	194	664	81,686	各種金融
MOSAIC CO/THE	42	43	139	17,122	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	30	27	197	24,266	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MURPHY OIL CORP	21	23	71	8,820	エネルギー
MYLAN NV	49	54	280	34,544	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NABORS INDUSTRIES LTD	32	40	36	4,480	エネルギー
NASDAQ INC	14	15	94	11,663	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	56	51	194	23,967	エネルギー
NAVIENT CORP	51	54	64	7,877	各種金融
NETAPP INC	41	41	129	15,898	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	7	53	638	78,508	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
NETSUITE INC	4	5	47	5,803	ソフトウェア・サービス
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	55	60	95	11,788	銀行
NEWELL RUBBERMAID INC	36	36	159	19,661	耐久消費財・アパレル
NEWMONT MINING CORP	66	70	127	15,680	素材
NEWS CORP - CLASS A	48	55	78	9,629	メディア
NEXTERA ENERGY INC	57	58	591	72,743	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	—	47	224	27,660	商業・専門サービス
NIELSEN NV	45	—	—	—	商業・専門サービス
NIKE INC	89	89	1,131	139,100	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	42	—	—	—	公益事業
NOBLE CORP PLC	30	—	—	—	エネルギー
NOBLE ENERGY INC	48	57	210	25,831	エネルギー
NORDSTROM INC	19	18	104	12,798	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	40	40	394	48,539	運輸
NORTHERN TRUST CORP	29	29	224	27,655	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	25	24	457	56,204	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	11	21	122	15,115	消費者サービス
NRG ENERGY INC	43	47	56	6,963	公益事業
NUANCE COMMUNICATIONS INC	31	35	72	8,887	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	42	43	179	22,106	素材
NVIDIA CORP	72	72	225	27,692	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	101	101	760	93,551	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	13	13	61	7,563	エネルギー
OGE ENERGY CORP	25	27	71	8,757	公益事業
OMNICARE INC	12	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OMNICOM GROUP	33	33	243	29,969	メディア
ONEOK INC	26	28	81	9,988	エネルギー
ORACLE CORP	463	460	1,795	220,732	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	13	13	358	44,117	小売
OWENS-ILLINOIS INC	20	—	—	—	素材
PACCAR INC	46	46	238	29,357	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	—	13	88	10,862	素材
PALL CORP	14	—	—	—	資本財
PALO ALTO NETWORKS INC	8	9	157	19,347	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PARKER HANNIFIN CORP	19	18	192	23,706	資本財
PARTNERRE LTD	5	6	84	10,422	保険
PATTERSON COS INC	9	12	59	7,266	ヘルスケア機器・サービス
PAYCHEX INC	43	44	238	29,268	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	—	143	519	63,843	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	24	24	137	16,920	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	36	43	71	8,798	銀行
PEPCO HOLDINGS INC	32	32	84	10,356	公益事業
PEPSICO INC	195	194	1,962	241,356	食品・飲料・タバコ
PERRIGO CO PLC	18	19	297	36,638	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	823	811	2,619	322,049	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
PG&E CORP	62	63	337	41,445	公益事業
PHARMACYCLICS INC	8	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	203	204	1,759	216,401	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	72	71	659	81,137	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	14	15	95	11,703	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19	19	276	34,040	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	68	68	647	79,644	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	8	8	89	10,978	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	17	35	371	45,706	素材
PPL CORPORATION	88	88	301	37,059	公益事業
PRAXAIR INC	38	37	438	53,952	素材
PRECISION CASTPARTS CORP	18	18	420	51,649	資本財
PRICELINE GROUP INC/THE	6	6	874	107,571	小売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	43	41	212	26,081	保険
PROCTER & GAMBLE CO	352	357	2,722	334,740	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	75	78	246	30,277	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	59	59	519	63,856	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	67	66	264	32,523	公益事業
PULTE GROUP INC	41	44	84	10,350	耐久消費財・アパレル
PUMA BIOTECHNOLOGY INC	—	4	27	3,337	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PVH CORP	10	11	98	12,145	耐久消費財・アパレル
QEP RESOURCES INC-W/I	20	—	—	—	エネルギー
QORVO INC	18	20	112	13,845	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	217	214	1,039	127,812	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA SERVICES INC	26	28	61	7,596	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	18	19	131	16,135	ヘルスケア機器・サービス
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	8	12	86	10,675	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RACKSPACE HOSTING INC	15	16	41	5,078	ソフトウェア・サービス
RALPH LAUREN CORP	7	8	99	12,176	耐久消費財・アパレル
RANGE RESOURCES CORP	21	22	72	8,887	エネルギー
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15	17	99	12,235	各種金融
RAYTHEON CO	40	40	506	62,312	資本財
REALOGY HOLDINGS CORP	18	19	82	10,117	不動産
RED HAT INC	25	24	201	24,727	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	10	10	581	71,482	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	182	179	181	22,321	銀行
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4	6	71	8,755	保険
REPUBLIC SERVICES INC	38	32	142	17,542	商業・専門サービス
RESMED INC	18	18	110	13,534	ヘルスケア機器・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	41	113	521	64,109	食品・飲料・タバコ
RITE AID CORP	—	133	102	12,585	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17	18	92	11,381	商業・専門サービス
ROCK TENN COMPANY -CL A	18	—	—	—	素材
ROCKWELL AUTOMATION INC	18	18	191	23,550	資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	16	17	159	19,636	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
				外貨建金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
ROPER TECHNOLOGIES INC	13	13	258	31,795	資本財
ROSS STORES INC	28	54	252	30,988	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22	23	222	27,402	消費者サービス
SALESFORCE.COM INC	78	82	661	81,366	ソフトウェア・サービス
SANDISK CORP	29	27	208	25,653	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SBA COMMUNICATIONS CORP	17	17	188	23,122	電気通信サービス
SCANA CORP	17	18	111	13,714	公益事業
SCHLUMBERGER LTD	168	167	1,303	160,338	エネルギー
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	9	11	62	7,699	メディア
SEAGATE TECHNOLOGY	43	42	145	17,918	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	25	28	130	16,096	素材
SEI INVESTMENTS COMPANY	17	19	103	12,760	各種金融
SEMPRA ENERGY	30	31	316	38,862	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	21	23	103	12,737	資本財
SERVICENOW INC	17	19	168	20,739	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10	10	286	35,189	素材
SIGMA-ALDRICH	15	—	—	—	素材
SIGNET JEWELERS LTD	9	9	139	17,161	小売
SIRIUS XM HOLDINGS INC	326	344	142	17,566	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25	25	201	24,754	半導体・半導体製造装置
SNAP-ON INC	7	7	134	16,564	資本財
SOUTHERN CO	117	119	542	66,658	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	21	23	108	13,381	運輸
SOUTHWESTERN ENERGY CO	48	54	52	6,498	エネルギー
SPECTRA ENERGY CORP	87	88	240	29,615	エネルギー
SPLUNK INC	—	16	105	13,018	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	98	113	45	5,642	電気通信サービス
SPX CORP	4	—	—	—	資本財
ST JUDE MEDICAL INC	38	36	230	28,328	ヘルスケア機器・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	19	20	223	27,439	資本財
STAPLES INC	85	86	103	12,764	小売
STARBUCKS CORP	195	197	1,214	149,358	消費者サービス
STARWOOD HOTELS & RESORTS WORLDWIDE INC	23	22	165	20,308	消費者サービス
STATE STREET CORP	54	54	392	48,272	各種金融
STERICYCLE INC	11	11	134	16,579	商業・専門サービス
STRYKER CORP	44	44	427	52,534	ヘルスケア機器・サービス
SUNEDISON INC	—	38	11	1,366	半導体・半導体製造装置
SUNTRUST BANKS INC	69	67	295	36,305	銀行
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	18	—	—	—	エネルギー
SYMANTEC CORP	92	91	182	22,466	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	20	22	71	8,814	各種金融
SYNOPSYS INC	19	21	110	13,638	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	78	77	322	39,690	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	34	34	265	32,701	各種金融
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	7	66	8,183	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	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米・ドル	千円	
TARGET CORP	79	79	563	69,285	小売
TE CONNECTIVITY LTD	53	53	359	44,208	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TEGNA INC	—	31	85	10,572	メディア
TERADATA CORP	19	20	58	7,240	ソフトウェア・サービス
TESLA MOTORS INC	11	12	276	34,036	自動車・自動車部品
TESORO CORP	16	16	192	23,729	エネルギー
TEXAS INSTRUMENTS INC	138	137	794	97,719	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	36	36	157	19,335	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	52	52	720	88,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	17	17	128	15,810	小売
TIME WARNER CABLE	36	37	685	84,322	メディア
TIME WARNER INC	109	109	773	95,149	メディア
TJX COS INC	90	89	606	74,619	小売
T-MOBILE US INC	30	37	142	17,536	電気通信サービス
TOLL BROTHERS INC	21	22	83	10,285	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	16	17	102	12,587	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	21	22	123	15,159	ソフトウェア・サービス
TOWERS WATSON & CO-CL A	9	9	122	15,122	商業・専門サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	18	18	163	20,102	小売
TRANSDIGM GROUP INC	6	7	171	21,058	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	43	41	481	59,173	保険
TRIMBLE NAVIGATION LTD	32	36	80	9,936	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	15	15	133	16,446	小売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	64	60	184	22,723	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	172	164	494	60,756	メディア
TWITTER INC	50	66	174	21,398	ソフトウェア・サービス
TYCO INTERNATIONAL PLC	55	56	202	24,874	商業・専門サービス
TYSON FOODS INC-CL A	40	40	182	22,397	食品・飲料・タバコ
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	7	8	131	16,201	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	22	23	211	25,986	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	116	116	1,013	124,576	運輸
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	11	13	77	9,473	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	92	93	971	119,399	運輸
UNITED RENTALS INC	12	13	98	12,096	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	113	111	1,093	134,467	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	6	93	11,438	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	125	125	1,387	170,596	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	12	12	142	17,570	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	32	33	122	15,059	保険
URBAN OUTFITTERS INC	13	14	32	4,023	小売
US BANCORP	232	233	1,029	126,602	銀行
VALERO ENERGY CORP	68	67	477	58,659	エネルギー
VANTIV INC - CL A	18	19	103	12,733	ソフトウェア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12	13	106	13,127	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	14	14	124	15,248	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		
VERISK ANALYTICS INC	20	20	153	18,874	商業・専門サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	543	538	2,465	303,130	電気通信サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	31	32	417	51,326	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VF CORP	44	44	284	34,989	耐久消費財・アパレル	
VIACOM INC-CLASS B	47	47	245	30,204	メディア	
VISA INC-CLASS A SHARES	257	257	2,067	254,176	ソフトウェア・サービス	
VMWARE INC-CLASS A	10	10	63	7,789	ソフトウェア・サービス	
VOYA FINANCIAL INC	26	30	127	15,677	各種金融	
VULCAN MATERIALS CO	17	18	189	23,287	素材	
WABCO HOLDINGS INC	—	7	79	9,762	資本財	
WABTEC CORP	12	13	102	12,552	資本財	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	114	114	951	117,043	食品・生活必需品小売り	
WAL-MART STORES INC	210	212	1,287	158,371	食品・生活必需品小売り	
WALT DISNEY CO	211	212	2,527	310,746	メディア	
WASTE MANAGEMENT INC	58	60	323	39,763	商業・専門サービス	
WATERS CORP	10	11	147	18,164	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	99	103	109	13,409	エネルギー	
WEC ENERGY GROUP INC	30	42	215	26,444	公益事業	
WELLS FARGO & CO	644	644	3,606	443,515	銀行	
WESTERN DIGITAL CORP	29	30	191	23,575	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WESTERN UNION CO	69	69	133	16,354	ソフトウェア・サービス	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5	6	38	4,725	素材	
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	—	35	176	21,718	素材	
WEYERHAEUSER CO	69	69	221	27,251	不動産	
WHIRLPOOL CORP	10	10	168	20,719	耐久消費財・アパレル	
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	—	23	94	11,588	食品・飲料・タバコ	
WHITING PETROLEUM CORP	20	28	48	5,996	エネルギー	
WHOLE FOODS MARKET INC	47	46	139	17,138	食品・生活必需品小売り	
WILLIAMS COS INC	92	93	353	43,444	エネルギー	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	20	21	99	12,193	保険	
WORKDAY INC-CLASS A	12	14	121	14,915	ソフトウェア・サービス	
WR BERKLEY CORP	14	13	73	9,085	保険	
WW GRAINGER INC	8	8	160	19,751	資本財	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	16	16	124	15,279	消費者サービス	
WYNN RESORTS LTD	10	11	70	8,629	消費者サービス	
XCEL ENERGY INC	68	68	246	30,252	公益事業	
XEROX CORP	144	135	141	17,372	ソフトウェア・サービス	
XILINX INC	35	34	170	20,926	半導体・半導体製造装置	
XL GROUP PLC	33	39	150	18,499	保険	
XYLEM INC	22	24	92	11,362	資本財	
YAHOO! INC	117	117	382	47,007	ソフトウェア・サービス	
YUM! BRANDS INC	57	56	408	50,185	消費者サービス	
ZILLOW GROUP INC - C W/I	—	13	35	4,336	ソフトウェア・サービス	
ZILLOW GROUP INC - CL A	6	6	18	2,260	ソフトウェア・サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22	23	240	29,610	ヘルスケア機器・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	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
ZOETIS INC		65	62	294	36,169
					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>	40,619	42,238	249,181	30,639,298
(カナダ)		591	601	—	<60.2%>
				千カナダ・ドル	
AGNICO EAGLE MINES LTD		26	29	104	9,694
AGRIUM INC		19	18	231	21,438
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		56	55	334	30,954
ALTAGAS LTD		16	19	62	5,755
ARC RESOURCES LTD		40	48	90	8,337
ATCO LTD -CL 'I'		9	11	42	3,962
BANK OF MONTREAL		83	85	653	60,361
BANK OF NOVA SCOTIA		158	160	973	89,955
BARRICK GOLD CORP		154	156	156	14,496
BAYTEX ENERGY CORP		20	28	15	1,460
BCE INC		19	21	124	11,501
BLACKBERRY LTD		62	70	72	6,703
BOMBARDIER INC		181	271	34	3,211
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC		111	114	519	48,039
CAE INC		33	39	59	5,473
CAMECO CORP		49	56	92	8,574
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE		51	52	526	48,641
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO		107	106	854	78,933
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		142	144	477	44,147
CANADIAN OIL SANDS LTD		60	67	59	5,509
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		22	20	410	37,947
CANADIAN TIRE CORP -CL A		9	10	124	11,547
CANADIAN UTILITIES LTD-A		16	18	63	5,850
CATAMARAN CORP		27	—	—	—
CENOVUS ENERGY INC		100	111	222	20,609
CGI GROUP INC		29	30	172	15,910
CI FINANCIAL CORP		28	32	103	9,570
CONSTELLATION SOFTWARE INC		2	2	145	13,483
CONSTELLATION SOFTWARE -RTS		2	—	—	—
CRESCENT POINT ENERGY CORP		54	66	115	10,704
DOLLARAMA INC		16	17	152	14,092
ELDORADO GOLD CORP		89	100	43	4,012
EMPIRE CO LTD 'A'		6	24	65	6,030
ENBRIDGE INC		111	113	561	51,865
ENCANA CORP		92	113	121	11,225
ENERPLUS CORP		25	28	19	1,818
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		2	2	199	18,405
FINNING INTERNATIONAL INC		21	24	47	4,390
FIRST CAPITAL REALTY INC		12	17	34	3,178
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		74	96	50	4,689
FORTIS INC		36	38	147	13,595
					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
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
FRANCO-NEVADA CORP		19	21	136	12,577	素材
GEORGE WESTON LTD		6	7	79	7,385	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC		29	31	126	11,646	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC		108	108	174	16,161	素材
GREAT-WEST LIFECO INC		40	41	147	13,637	保険
HUSKY ENERGY INC		43	46	87	8,066	エネルギー
IGM FINANCIAL INC		12	14	54	5,001	各種金融
IMPERIAL OIL LTD		39	40	170	15,734	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC		12	14	61	5,704	保険
INTACT FINANCIAL CORP		17	18	161	14,894	保険
INTER PIPELINE LTD		42	45	107	9,954	エネルギー
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A		10	11	24	2,268	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP		21	24	96	8,907	エネルギー
KINROSS GOLD CORP		139	159	39	3,667	素材
LOBLAW COS LTD		30	30	210	19,438	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC		55	54	325	30,049	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP		256	259	575	53,203	保険
MEG ENERGY CORP		19	22	25	2,358	エネルギー
METHANEX CORP		11	12	65	6,098	素材
METRO INC		32	34	131	12,139	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA		44	43	186	17,251	銀行
NEW GOLD INC		60	—	—	—	素材
ONEX CORPORATION		11	12	103	9,541	各種金融
OPEN TEXT CORP		15	16	105	9,717	ソフトウェア・サービス
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A		7	9	8	791	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		44	46	145	13,457	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP		18	21	59	5,473	エネルギー
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN		108	112	308	28,486	素材
POWER CORP OF CANADA		50	50	160	14,836	保険
POWER FINANCIAL CORP		32	34	116	10,752	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		16	20	52	4,852	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN		24	27	136	12,583	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC		49	50	260	24,075	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA		188	190	1,449	133,935	銀行
SAPUTO INC		32	34	112	10,398	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		53	56	154	14,239	メディア
SILVER WHEATON CORP		45	56	97	9,019	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC		19	21	91	8,495	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC		82	80	361	33,387	保険
SUNCOR ENERGY INC		189	190	707	65,342	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B		70	78	47	4,417	素材
THOMSON REUTERS CORP		49	48	258	23,847	メディア
TORONTO-DOMINION BANK		240	243	1,331	123,095	銀行
TOURMALINE OIL CORP		21	25	68	6,324	エネルギー
TRANSALTA CORP		34	40	21	1,987	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	株数	株数	期末		業種等
			評価額	外貨建金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
TRANSCANADA CORP	93	93	408	37,732	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	98	144	51	4,766	素材
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC	41	42	479	44,343	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERESEN INC	—	41	44	4,136	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	13	15	61	5,692	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8	9	50	4,676	素材
YAMANA GOLD INC	113	130	33	3,087	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,019 92	5,415 90	18,564 —	1,715,725 <3.4%>
(オーストラリア)			千オーストラリア・ドル		
AGL ENERGY LTD	92	99	168	14,866	公益事業
ALS LTD	51	—	—	—	商業・専門サービス
ALUMINA LTD	328	386	47	4,202	素材
AMCOR LTD	172	170	235	20,864	素材
AMP LTD	411	417	243	21,570	保険
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	85	82	7,291	消費者サービス
ASCIANO LTD	144	142	127	11,252	運輸
ASX LTD	28	30	126	11,170	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD	309	320	177	15,660	運輸
AUSNET SERVICES	—	345	54	4,802	公益事業
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	365	370	1,019	90,132	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	53	60	86	7,691	銀行
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	67	75	83	7,415	銀行
BHP BILLITON LTD	422	426	870	76,997	素材
BORAL LTD	111	130	73	6,459	素材
BRAMBLES LTD	222	225	244	21,586	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	18	38	125	11,092	エネルギー
CIMIC GROUP LIMITED	14	17	45	4,000	資本財
COCA-COLA AMATIL LIMITED	77	89	83	7,357	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	7	9	84	7,443	ヘルスケア機器・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	214	226	1,789	158,186	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED	65	77	89	7,948	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD	48	55	67	5,952	消費者サービス
CSL LIMITED	62	62	611	54,065	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7	8	32	2,888	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	196	227	49	4,370	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	77	94	37	3,319	小売
HEALTHSCOPE LTD	165	194	55	4,891	ヘルスケア機器・サービス
ILUKA RESOURCES LIMITED	54	63	39	3,480	素材
INCITEC PIVOT LTD	224	250	94	8,389	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	343	341	195	17,247	保険
MACQUARIE GROUP LTD	39	41	345	30,575	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	365	411	95	8,479	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	314	349	1,040	91,963	銀行
NATIONAL AUSTRALIA BANK-R	25	—	—	—	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
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
NEWCREST MINING LIMITED		97	106	124	10,996	素材
ORICA LTD		48	56	94	8,365	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED		153	166	90	8,019	エネルギー
PLATINUM ASSET MANAGEMENT		35	42	34	3,027	各種金融
QANTAS AIRWAYS LTD		76	88	34	3,008	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD		186	188	242	21,441	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED		18	20	142	12,580	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD		7	9	46	4,073	メディア
RIO TINTO LTD		59	58	285	25,257	素材
SANTOS LTD		126	150	65	5,772	エネルギー
SANTOS LTD - RTS		—	88	4	368	エネルギー
SEEK LTD		43	50	71	6,294	商業・専門サービス
SONIC HEALTHCARE LTD		52	56	115	10,213	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD		697	741	97	8,625	素材
SUNCORP GROUP LTD		186	185	248	21,952	保険
TABCORP HOLDINGS LTD		114	133	62	5,491	消費者サービス
TATTS GROUP LTD		203	236	98	8,682	消費者サービス
TELSTRA CORP LTD		607	608	330	29,226	電気通信サービス
TOLL HOLDINGS LIMITED		96	—	—	—	運輸
TPG TELECOM LTD		40	47	49	4,367	電気通信サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		85	99	75	6,647	食品・飲料・タバコ
WESFARMERS LIMITED		149	151	584	51,693	食品・生活必需品小売り
WESTPAC BANKING CORP		411	416	1,314	116,201	銀行
WOODSIDE PETROLEUM LTD		101	102	312	27,655	エネルギー
WOOLWORTHS LTD		168	169	401	35,528	食品・生活必需品小売り
WORLEYPARSONS LTD		27	32	20	1,800	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	8,898	9,857	13,468	1,190,916	
	銘 柄 数 <比 率>	58	58	—	<2.3%>	
(香港)				千香港・ドル		
AIA GROUP LTD		1,580	1,588	7,514	119,259	保険
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		30	35	224	3,554	半導体・半導体製造装置
BANK OF EAST ASIA		168	170	485	7,702	銀行
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		505	500	1,228	19,495	銀行
CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD		150	180	267	4,250	運輸
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE		80	90	615	9,769	公益事業
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING		—	359	1,904	30,231	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		179	354	3,675	58,329	資本財
CLP HOLDINGS LTD		266	251	1,668	26,474	公益事業
FIRST PACIFIC CO		300	320	163	2,595	各種金融
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD		318	328	797	12,652	消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD		291	311	592	9,404	不動産
HANG SENG BANK LTD		104	104	1,497	23,761	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		137	151	723	11,489	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		868	950	1,485	23,573	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		146	147	3,059	48,560	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
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円		
HUTCHISON WHAMPOA LTD		285	—	—	—	資本財	
HYSAN DEVELOPMENT CO		80	90	294	4,670	不動産	
KERRY PROPERTIES LTD		80	90	195	3,099	不動産	
LI & FUNG LTD		752	832	475	7,546	耐久消費財・アパレル	
MGM CHINA HOLDINGS LTD		116	128	136	2,169	消費者サービス	
MTR CORP		202	212	783	12,430	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT		656	726	598	9,491	不動産	
NWS HOLDINGS LTD		190	220	244	3,882	資本財	
PCCW LTD		560	640	283	4,499	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		190	185	1,358	21,562	公益事業	
SANDS CHINA LTD		313	321	870	13,814	消費者サービス	
SHANGRI-LA ASIA LTD		140	180	130	2,065	消費者サービス	
SINO LAND CO		400	420	491	7,798	不動産	
SJM HOLDINGS LTD		240	260	157	2,500	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD		240	220	2,131	33,832	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD		93	73	643	10,205	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD		144	168	372	5,905	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		175	185	581	9,233	耐久消費財・アパレル	
WH GROUP LTD		450	825	323	5,132	食品・飲料・タバコ	
WHARF HOLDINGS LTD		217	167	749	11,896	不動産	
WHELOCK & CO LTD		120	120	414	6,579	不動産	
WYNN MACAU LTD		197	213	226	3,590	消費者サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		95	105	300	4,765	耐久消費財・アパレル	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,065	12,226	37,667	597,778		
	銘 柄 数 <比 率>	38	38	—	<1.2%>		
(シンガポール)				千シンガポール・ドル			
CAPITALAND LTD		327	367	115	10,053	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD		50	57	43	3,747	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD		269	336	102	8,911	運輸	
DBS GROUP HOLDINGS LTD		230	231	392	34,149	銀行	
GENTING SINGAPORE PLC		765	839	62	5,471	消費者サービス	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD		400	445	94	8,203	不動産	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		856	988	35	3,092	食品・飲料・タバコ	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		14	16	52	4,549	小売	
KEPPEL CORP LTD		191	197	133	11,580	資本財	
NOBLE GROUP LTD		547	664	28	2,454	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		395	396	354	30,820	銀行	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		120	138	45	3,996	資本財	
SEMBCORP MARINE LTD		100	116	25	2,209	資本財	
SINGAPORE AIRLINES LTD		71	83	87	7,636	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD		100	114	87	7,613	各種金融	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		226	251	100	8,708	メディア	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD		195	228	66	5,809	資本財	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,078	1,078	417	36,278	電気通信サービス	
STARHUB LTD		97	113	40	3,517	電気通信サービス	

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
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
UNITED OVERSEAS BANK LTD		174	173	346	30,118	銀行	
UOL Group Limited		58	67	41	3,589	不動産	
WILMAR INTERNATIONAL LTD		251	274	80	7,005	食品・飲料・タバコ	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		240	280	31	2,702	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,754	7,451	2,785	242,219		
	銘 柄 数 <比 率>	23	23	—	<0.5%>		
(ニュージーランド)				千ニュージーランド・ドル			
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		127	154	80	6,489	運輸	
CONTACT ENERGY LTD		46	104	52	4,231	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD		84	98	69	5,603	素材	
MERIDIAN ENERGY LTD		—	184	40	3,267	公益事業	
MERIDIAN ENER-PARTLY PAID SH		160	—	—	—	公益事業	
MIGHTY RIVER POWER		87	102	28	2,323	公益事業	
RYMAN HEALTHCARE LTD		45	52	39	3,153	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD		241	270	87	7,089	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	792	967	398	32,159		
	銘 柄 数 <比 率>	7	7	—	<0.1%>		
(イギリス)				千イギリス・ポンド			
3I GROUP PLC		121	130	64	12,173	各種金融	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC		113	129	43	8,251	各種金融	
ADMIRAL GROUP PLC		23	29	48	9,075	保険	
AGGREKO PLC		31	35	35	6,695	商業・専門サービス	
AMEC FOSTER WHEELER PLC		47	55	26	4,954	エネルギー	
ANGLO AMERICAN PLC		181	187	84	15,845	素材	
ANTOFAGASTA PLC		47	54	27	5,094	素材	
ARM HOLDINGS PLC		183	186	202	37,962	半導体・半導体製造装置	
ASHTED GROUP PLC		64	68	71	13,461	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		47	47	167	31,555	食品・飲料・タバコ	
ASTRAZENECA PLC		165	166	737	138,501	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AVIVA PLC		518	531	267	50,284	保険	
BABCOCK INTL GROUP PLC		31	35	35	6,625	商業・専門サービス	
BAE SYSTEMS PLC		413	417	202	37,946	資本財	
BARCLAYS PLC		2,148	2,204	506	95,221	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		—	133	77	14,518	耐久消費財・アパレル	
BG GROUP PLC		445	449	467	87,779	エネルギー	
BHP BILLITON PLC		275	277	246	46,279	素材	
BP PLC		2,382	2,404	925	173,940	エネルギー	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		243	245	948	178,100	食品・飲料・タバコ	
BT GROUP PLC		1,070	1,108	544	102,251	電気通信サービス	
BUNZL PLC		44	45	86	16,286	資本財	
BURBERRY GROUP PLC		59	59	76	14,413	耐久消費財・アパレル	
CAPITA PLC		88	89	112	21,107	商業・専門サービス	
CARNIVAL PLC		23	24	85	16,073	消費者サービス	
CENTRICA PLC		664	670	143	26,910	公益事業	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千円	千円	
COBHAM PLC	144	160	46	8,772	資本財
COCA-COLA HBC AG-CDI	24	28	45	8,554	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	218	218	234	44,105	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	17	18	52	9,825	素材
DIAGEO PLC	328	331	630	118,362	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	185	185	75	14,173	保険
DIXONS CARPHONE PLC	121	133	61	11,484	小売
EASYJET PLC	19	23	39	7,485	運輸
EXPERIAN PLC	132	132	161	30,391	商業・専門サービス
FRESNILLO PLC	26	31	21	4,083	素材
G4S PLC	196	213	48	9,057	商業・専門サービス
GKN PLC	211	221	66	12,537	自動車・自動車部品
GLAXOSMITHKLINE PLC	635	641	863	162,268	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	1,374	1,457	137	25,744	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	28	36	54	10,262	各種金融
HSBC HOLDINGS PLC	2,501	2,568	1,348	253,359	銀行
ICAP PLC	67	77	39	7,436	各種金融
IMI PLC	34	38	35	6,616	資本財
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	125	126	440	82,783	食品・飲料・タバコ
INMARSAT PLC	55	63	67	12,749	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	30	31	79	14,969	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	20	21	57	10,890	商業・専門サービス
INVESTEC PLC	68	78	42	7,950	各種金融
ITV PLC	518	522	139	26,210	メディア
JOHNSON MATTHEY PLC	27	27	74	13,967	素材
KINGFISHER PLC	313	311	111	20,864	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	779	782	209	39,441	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,442	7,523	551	103,593	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29	41	108	20,385	各種金融
LONMIN PLC	14	—	—	—	素材
MARKS & SPENCER GROUP PLC	218	221	115	21,642	小売
MEGGITT PLC	101	106	41	7,736	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	121	140	39	7,378	資本財
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	62	101	41	7,868	消費者サービス
MONDI PLC/WI	—	49	74	14,012	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	260	297	45	8,640	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	491	494	464	87,277	公益事業
NEXT PLC	20	19	153	28,839	小売
OLD MUTUAL PLC	653	659	133	25,041	保険
PEARSON PLC	110	108	88	16,566	メディア
PERSIMMON PLC	37	41	76	14,309	耐久消費財・アパレル
PETROFAC LTD	32	36	28	5,418	エネルギー
PRUDENTIAL PLC	335	338	513	96,482	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	10	12	50	9,512	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	84	84	534	100,417	家庭用品・パーソナル用品

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等		
			株 数	株 数		評 価 額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
RELX PLC		154	149	177	33,400	メディア	
REXAM PLC		89	96	54	10,209	素材	
RIO TINTO PLC		166	166	380	71,439	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		246	241	130	24,567	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL		35,427	—	—	—	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL		—	21,772	2	408	資本財	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC		338	432	136	25,593	銀行	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		516	514	857	161,110	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		313	319	537	100,907	エネルギー	
ROYAL MAIL PLC		82	112	53	10,098	運輸	
RSA INSURANCE GROUP PLC		126	136	60	11,316	保険	
SABMILLER PLC		126	127	513	96,370	食品・飲料・タバコ	
SAGE GROUP PLC		135	146	82	15,422	ソフトウェア・サービス	
SAINSBURY (J) PLC		153	188	47	8,946	食品・生活必需品小売り	
SCHRODERS PLC		15	16	49	9,270	各種金融	
SEVERN TRENT PLC		30	32	72	13,620	公益事業	
SHIRE PLC		77	78	368	69,129	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SKY PLC		140	141	156	29,312	メディア	
SMITH & NEPHEW PLC		119	120	135	25,391	ヘルスケア機器・サービス	
SMITHS GROUP PLC		49	53	53	10,108	資本財	
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL		32	37	26	5,025	小売	
SSE PLC		129	131	193	36,336	公益事業	
ST JAMES'S PLACE PLC		—	70	67	12,757	保険	
STANDARD CHARTERED PLC		322	334	198	37,256	銀行	
STANDARD LIFE PLC		261	264	106	20,076	保険	
TATE & LYLE PLC		57	65	38	7,295	食品・飲料・タバコ	
TAYLOR WIMPEY PLC		—	439	81	15,287	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC		1,058	1,069	183	34,558	食品・生活必需品小売り	
TRAVIS PERKINS PLC		31	33	66	12,450	資本財	
TUI AG-DI		55	67	75	14,243	消費者サービス	
TULLOW OIL PLC		112	127	25	4,852	エネルギー	
UNILEVER PLC		167	169	476	89,589	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC		89	93	91	17,167	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC		3,474	3,501	775	145,712	電気通信サービス	
WEIR GROUP PLC/THE		26	29	33	6,356	資本財	
WHITBREAD PLC		24	24	110	20,728	消費者サービス	
WILLIAM HILL PLC		109	124	43	8,124	消費者サービス	
WOLSELEY PLC		34	35	130	24,557	資本財	
WPP PLC		173	173	262	49,237	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	72,140	60,191	21,341	4,009,025		
	銘 柄 数 <比 率>	105	108	—	<7.9%>		
(イスラエル)				千イスラエル・シェケル			
AZRIELI GROUP		—	4	75	2,410	不動産	
BANK HAPOALIM BM		132	146	297	9,431	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL		159	195	285	9,071	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
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円		
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		248	276	237	7,543	電気通信サービス	
DELEK GROUP LTD		0.57	0.65	58	1,843	エネルギー	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		53	70	138	4,396	素材	
ISRAEL CORP LIMITED/THE		0.32	0.42	36	1,153	素材	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		16	19	89	2,840	銀行	
NICE SYSTEMS LTD		7	8	201	6,410	ソフトウェア・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD		112	113	2,700	85,712	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	730	835	4,121	130,813		
	銘 柄 数 <比 率>	9	10	—	<0.3%>		
(スイス)				千スイス・フラン			
ABB LTD		287	289	551	66,874	資本財	
ACTELION LTD-REG		13	13	194	23,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO SA-REG		22	22	159	19,311	商業・専門サービス	
ARYZTA AG		10	12	57	7,015	食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDING AG		6	6	81	9,868	保険	
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.27	0.31	33	4,072	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.10	0.11	67	8,204	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.02	0.02	149	18,084	食品・飲料・タバコ	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		68	68	533	64,601	耐久消費財・アパレル	
CREDIT SUISSE GROUP AG		198	204	480	58,221	各種金融	
DUFREY AG-REG		—	5	69	8,399	小売	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		0.99	1	48	5,826	素材	
GEBERIT AG-REG		5	5	171	20,784	資本財	
GIVAUDAN-REG		1	1	229	27,750	素材	
JULIUS BAER GROUP LTD		29	30	144	17,481	各種金融	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		7	8	109	13,322	運輸	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		30	57	318	38,598	素材	
LONZA GROUP AG		6	7	113	13,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NESTLE SA		421	424	3,232	391,751	食品・飲料・タバコ	
NOVARTIS AG		300	299	2,698	327,044	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PARGESA HOLDING SA-BR		3	4	27	3,360	各種金融	
PARTNERS GROUP HOLDING AG		2	2	80	9,714	各種金融	
ROCHE HOLDING AG		91	92	2,520	305,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG		1	3	49	6,038	資本財	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		6	6	99	12,011	資本財	
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE		0.71	0.73	141	17,090	商業・専門サービス	
SIKA AG-BEARER		0.27	0.31	103	12,558	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG		6	7	93	11,277	ヘルスケア機器・サービス	
SULZER AG-REG		2	3	32	3,913	資本財	
SWATCH GROUP AG		4	4	149	18,059	耐久消費財・アパレル	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		4	4	104	12,660	保険	
SWISS PRIME SITE-REG		7	9	73	8,905	不動産	
SWISS RE AG		46	46	447	54,196	保険	
SWISSCOM AG		3	3	187	22,710	電気通信サービス	
SYNGENTA AG		12	12	460	55,858	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
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円	耐久消費財・アパレル エネルギー 各種金融 保険	
THE SWATCH GROUP AG-REG		5	7	48	5,907		
TRANSOCEAN LTD		44	50	74	9,068		
UBS GROUP AG		476	481	962	116,609		
ZURICH INSURANCE GROUP AG		19	19	534	64,727		
小 計	株 数 ・ 金 額	2,152	2,217	15,635	1,894,689		
	銘 柄 数 <比 率>	38	39	—	<3.7%>		
(デンマーク)				千デンマーク・クローネ		運輸 運輸 食品・飲料・タバコ ヘルスケア機器・サービス 銀行 運輸 商業・専門サービス 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス 素材 耐久消費財・アパレル 電気通信サービス 保険 資本財 ヘルスケア機器・サービス	
A P MOLLER - MAERSK A/S		0.86	0.93	943	16,670		
A P MOLLER - MAERSK A/S		0.63	0.57	568	10,041		
CARLSBERG AS-B		13	14	870	15,377		
COLOPLAST-B		14	14	815	14,398		
DANSKE BANK A/S		87	92	1,758	31,062		
DSV A/S		23	25	695	12,287		
ISS A/S		14	21	501	8,858		
NOVO-NORDISK A/S		262	258	9,791	172,914		
NOVOZYMES A/S		31	31	1,051	18,563		
PANDORA A/S		15	14	1,238	21,866		
TDC A/S		105	119	428	7,569		
TRYGVESTA AS		12	16	214	3,787		
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		28	30	1,300	22,965		
WILLIAM DEMANT HOLDING		2	3	218	3,863		
小 計	株 数 ・ 金 額	614	642	20,397	360,225		
	銘 柄 数 <比 率>	14	14	—	<0.7%>		
(ノルウェー)				千ノルウェー・クローネ		銀行 保険 素材 食品・飲料・タバコ エネルギー エネルギー エネルギー 電気通信サービス 素材	
DNB ASA		130	131	1,500	21,407		
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		24	28	389	5,552		
NORSK HYDRO ASA		169	189	615	8,786		
ORKLA ASA		102	111	791	11,300		
SEADRILL LTD		48	51	277	3,959		
STATOIL ASA		148	150	2,022	28,855		
SUBSEA 7 SA		34	37	260	3,722		
TELENOR ASA		101	102	1,585	22,619		
YARA INTERNATIONAL ASA		23	24	986	14,083		
小 計	株 数 ・ 金 額	784	826	8,429	120,286		
	銘 柄 数 <比 率>	9	9	—	<0.2%>		
(スウェーデン)				千スウェーデン・クローナ		資本財 資本財 資本財 資本財 資本財 資本財 素材 耐久消費財・アパレル	
ALFA LAVAL AB		40	42	653	9,253		
ASSA ABLOY AB		45	133	2,401	33,980		
ATLAS COPCO AB		53	53	1,112	15,741		
ATLAS COPCO AB- B REDEMPTION		53	—	—	—		
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION		87	—	—	—		
ATLAS COPCO AB-A SHS		87	90	2,061	29,171		
BOLIDEN AB		34	39	595	8,423		
ELECTROLUX AB		30	32	807	11,419		

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
ELEKTA AB-B SHS		44	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
GETINGE AB-B SHS		25	28	622	8,807	ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB		124	125	4,027	56,986	小売
HEXAGON AB-B SHS		33	35	1,115	15,781	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUSQVARNA AB-B SHS		51	59	335	4,751	耐久消費財・アパレル
ICA GRUPPEN AB		9	11	356	5,046	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		19	23	369	5,223	各種金融
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS		29	31	852	12,060	各種金融
INVESTOR AB		61	61	2,017	28,551	各種金融
LUNDIN PETROLEUM AB		27	32	427	6,045	エネルギー
NORDEA BANK AB		398	401	3,890	55,052	銀行
SANDVIK AB		143	145	1,230	17,408	資本財
SECURITAS AB		39	45	592	8,389	商業・専門サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		205	206	1,888	26,725	銀行
SKANSKA AB-B SHS		50	52	872	12,345	資本財
SKF AB		52	54	835	11,826	資本財
SVENSKA CELLULOSEA AB		79	79	1,990	28,160	家庭用品・パーソナル用品
SVENSKA HANDELSBANKEN		198	198	2,364	33,455	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES		121	120	2,339	33,106	銀行
SWEDISH MATCH AB		25	27	782	11,077	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB		44	48	419	5,930	電気通信サービス
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON		400	403	3,306	46,780	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIASONERA AB		352	361	1,554	21,995	電気通信サービス
VOLVO AB		205	207	1,832	25,923	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	3,173	3,153	41,655	589,422	
	銘 柄 数 <比 率>	32	29	—	<1.2%>	
(ユーロ／アイルランド)				千ユーロ		
BANK OF IRELAND		3,672	3,673	119	15,731	銀行
CRH PLC		106	110	295	38,897	素材
KERRY GROUP PLC-A		21	22	164	21,671	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額	3,800	3,806	579	76,300	
	銘 柄 数 <比 率>	3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ／オランダ)						
AEGON NV		243	233	128	16,940	保険
AIRBUS GROUP SE		77	77	513	67,635	資本財
AKZO NOBEL NV		32	33	215	28,449	素材
ALTICE NV - A-W/I		—	37	52	6,877	メディア
ALTICE NV - B -W/I		—	12	18	2,419	メディア
ASML HOLDING NV		45	45	396	52,211	半導体・半導体製造装置
BOSKALIS WESTMINSTER		11	12	51	6,783	資本財
CNH INDUSTRIAL NV		118	128	81	10,672	資本財
DELTA LLOYD NV		25	29	21	2,842	保険
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		120	121	155	20,460	自動車・自動車部品
GEMALTO		9	11	65	8,613	ソフトウェア・サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ／オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
HEINEKEN HOLDING NV		12	13	102	13,479	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN NV		30	30	258	34,037	食品・飲料・タバコ
ING GROEP NV		504	508	676	89,076	銀行
KONINKLIJKE AHOLD NV		119	119	240	31,714	食品・生活必需品小売り
KONINKLIJKE DSM NV		22	24	118	15,597	素材
KONINKLIJKE PHILIPS NV		122	123	309	40,774	資本財
NN GROUP NV		19	25	81	10,750	保険
OCI NV		—	12	28	3,794	素材
QIAGEN NV		29	29	74	9,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD HOLDINGS NV		15	17	98	13,017	商業・専門サービス
RELX NV		95	139	225	29,659	メディア
ROYAL KPN NV		433	424	151	19,969	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV		80	91	60	8,001	半導体・半導体製造装置
TNT EXPRESS NV - W/I		57	72	55	7,357	運輸
UNILEVER NV		213	214	885	116,726	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		8	9	39	5,269	エネルギー
WOLTERS KLUWER NV		41	41	134	17,736	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	2,492	2,641	5,241	690,673	
	銘 柄 数 <比 率>	25	28	—	<1.4%>	
(ユーロ／ベルギー)						
AGEAS		27	27	110	14,541	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV		105	105	1,232	162,439	食品・飲料・タバコ
COLRUYT NV		8	9	44	5,892	食品・生活必需品小売り
DELHAIZE GROUP		13	13	128	16,865	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		10	10	84	11,194	各種金融
KBC GROUP SA		33	33	185	24,461	銀行
PROXIMUS		19	21	68	9,084	電気通信サービス
SOLVAY SA		7	8	83	10,952	素材
TELENET GROUP HOLDING NV		6	8	42	5,606	メディア
UCB SA		16	16	135	17,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE		12	13	53	6,995	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	261	269	2,169	285,896	
	銘 柄 数 <比 率>	11	11	—	<0.6%>	
(ユーロ／ルクセンブルグ)						
ALTICE SA		11	—	—	—	メディア
ARCELORMITTAL		133	141	69	9,215	素材
RTL GROUP		4	5	47	6,222	メディア
TENARIS SA		59	63	75	9,972	エネルギー
小 計	株 数 ・ 金 額	208	210	192	25,409	
	銘 柄 数 <比 率>	4	3	—	<0.0%>	
(ユーロ／フランス)						
ACCOR		22	28	114	15,068	消費者サービス
ADP		4	5	54	7,220	運輸
AIR LIQUIDE		45	45	523	68,913	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	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	
ALCATEL-LUCENT	377	394	147 19,416	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALSTOM RGPT	27	29	86 11,355	資本財
ARKEMA	8	9	61 8,165	素材
ATOS SE	10	11	89 11,857	ソフトウェア・サービス
AXA	238	258	638 84,179	保険
BNP PARIBAS	138	139	788 103,854	銀行
BOLLORE	73	132	56 7,483	運輸
BOUYGUES	21	27	97 12,858	資本財
BUREAU VERITAS SA	28	36	71 9,375	商業・専門サービス
CAP GEMINI SA	19	21	177 23,433	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	83	74	217 28,629	食品・生活必需品小売り
CASINO GUICHARD PERRACHON	7	7	43 5,735	食品・生活必需品小売り
CHRISTIAN DIOR SE	7	7	127 16,734	耐久消費財・アパレル
CIE DE SAINT-GOBAIN	60	62	257 33,943	資本財
CNP ASSURANCES	20	24	32 4,220	保険
CREDIT AGRICOLE SA	137	139	160 21,145	銀行
DANONE	76	76	493 65,031	食品・飲料・タバコ
DASSAULT SYSTEMES SA	16	17	130 17,218	ソフトウェア・サービス
EDENRED	26	29	55 7,269	商業・専門サービス
EDF	30	34	52 6,907	公益事業
ENGIE	190	192	319 42,160	公益事業
ESSILOR INTERNATIONAL	26	27	327 43,114	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO	5	5	36 4,815	各種金融
EUTELSAT COMMUNICATIONS	20	24	72 9,548	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	62	69	84 11,134	運輸
HERMES INTERNATIONAL	3	3	119 15,755	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	3	3	78 10,348	電気通信サービス
IMERYS SA	4	5	35 4,644	素材
INGENICO GROUP	—	7	81 10,725	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JC DECAUX SA	8	11	41 5,462	メディア
KERING	10	10	171 22,547	耐久消費財・アパレル
LAFARGE SA	25	—	—	素材
LAGARDERE S.C.A.	15	17	50 6,628	メディア
LEGRAND SA	35	36	192 25,374	資本財
L'OREAL SA	33	33	557 73,470	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	36	36	598 78,915	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	24	25	238 31,399	自動車・自動車部品
NATIXIS	119	128	74 9,790	銀行
NUMERICABLE GROUP- W/I	12	14	58 7,708	メディア
ORANGE S.A.	244	263	443 58,431	電気通信サービス
PERNOD-RICARD	27	28	303 39,973	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	49	58	94 12,488	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	25	25	151 19,899	メディア
REMY COINTREAU	3	3	24 3,164	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	25	25	240 31,663	自動車・自動車部品

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等		
			株 数	株 数		評 価 額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ／フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円		
REXEL SA		35	41	54	7,174	資本財	
SAFRAN SA		36	38	258	34,044	資本財	
SANOFI		156	155	1,278	168,520	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE		68	73	427	56,285	資本財	
SCOR REGROUPE		19	21	78	10,358	保険	
SOCIETE BIC SA		3	4	63	8,309	商業・専門サービス	
SOCIETE GENERALE		94	95	427	56,371	銀行	
SODEXO		12	12	113	14,956	消費者サービス	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA		38	41	74	9,839	公益事業	
TECHNIP SA		12	14	74	9,821	エネルギー	
THALES SA		12	14	99	13,046	資本財	
TOTAL SA		280	284	1,323	174,425	エネルギー	
VALEO SA		10	10	155	20,434	自動車・自動車部品	
VALLOUREC		13	—	—	—	資本財	
VEOLIA ENVIRONNEMENT		53	60	134	17,669	公益事業	
VINCI SA		61	63	391	51,572	資本財	
VIVENDI SA		161	154	312	41,176	メディア	
WENDEL		3	4	45	5,980	各種金融	
ZODIAC SA		23	28	72	9,526	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,594	3,794	14,258	1,878,694		
	銘 柄 数 <比 率>	66	65	—	<3.7%>		
(ユーロ／ドイツ)							
ADIDAS AG		27	28	246	32,422	耐久消費財・アパレル	
ALLIANZ SE		59	59	963	126,949	保険	
AXEL SPRINGER SE		5	6	34	4,609	メディア	
BASF SE		119	120	932	122,925	素材	
BAYER AG		108	108	1,367	180,134	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		43	43	429	56,600	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		6	7	57	7,539	自動車・自動車部品	
BEIERSDORF AG		13	13	119	15,727	家庭用品・パーソナル用品	
BRENNTAG AG		20	20	106	14,012	資本財	
CELESIO AG		6	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
COMMERZBANK AG		128	142	150	19,781	銀行	
CONTINENTAL AG		14	14	319	42,034	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG		125	126	995	131,152	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE BANK AG		179	181	445	58,710	各種金融	
DEUTSCHE BOERSE AG		25	25	211	27,834	各種金融	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG		27	33	45	6,049	運輸	
DEUTSCHE POST AG		128	129	346	45,695	運輸	
DEUTSCHE TELEKOM AG		417	420	719	94,854	電気通信サービス	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR		36	45	111	14,728	不動産	
E.ON SE		261	268	245	32,328	公益事業	
EVONIK INDUSTRIES AG		—	19	65	8,654	素材	
FRAPORT AG		5	6	40	5,275	運輸	
FRESENIUS SE & CO KGAA		50	50	339	44,729	ヘルスケア機器・サービス	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等		
			株 数	株 数		評 価 額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ／ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円		
FUCHS PETROLUB AG -PFD		8	9	42	5,648	素材	
GEA GROUP AG		23	24	93	12,380	資本財	
HANNOVER RUECK SE		7	8	87	11,545	保険	
HEIDELBERGCEMENT AG		18	19	141	18,600	素材	
HENKEL AG & CO KGAA		16	14	125	16,586	家庭用品・パーソナル用品	
HENKEL KGAA-VORZUG		22	23	252	33,292	家庭用品・パーソナル用品	
HUGO BOSS AG		6	9	78	10,278	耐久消費財・アパレル	
INFINEON TECHNOLOGIES AG		150	151	178	23,462	半導体・半導体製造装置	
K+S AG		21	25	62	8,268	素材	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG		3	3	40	5,389	メディア	
LANXESS		11	12	60	8,008	素材	
LINDE AG		24	24	406	53,546	素材	
MAN SE		4	5	47	6,292	資本財	
MERCK KGAA		17	17	165	21,809	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
METRO AG		19	24	73	9,677	食品・生活必需品小売り	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG		22	21	400	52,706	保険	
OSRAM LICHT AG		10	12	48	6,438	資本財	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF		20	20	85	11,267	自動車・自動車部品	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG		29	29	147	19,453	メディア	
RWE AG		65	65	75	9,960	公益事業	
SAP SE		120	129	964	127,045	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS AG		103	104	996	131,330	資本財	
SYMRISE AG		15	16	105	13,916	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		76	88	47	6,228	電気通信サービス	
THYSSENKRUPP AG		60	50	98	13,026	素材	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		15	16	80	10,664	ソフトウェア・サービス	
VOLKSWAGEN AG		4	5	65	8,673	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG		20	21	223	29,464	自動車・自動車部品	
VONOVIA SE		45	62	184	24,284	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,780	2,893	13,676	1,801,998		
	銘 柄 数 <比 率>	51	51	—	<3.5%>		
(ユーロ／ポルトガル)							
BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA		4,314	5,306	26	3,496	銀行	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		301	314	103	13,646	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA		48	54	54	7,232	エネルギー	
JERONIMO MARTINS		30	35	45	6,047	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,695	5,711	230	30,423		
	銘 柄 数 <比 率>	4	4	—	<0.1%>		
(ユーロ／スペイン)							
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		55	67	99	13,059	運輸	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		22	25	80	10,599	資本財	
AENA SA		7	9	98	12,950	運輸	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS		59	58	225	29,724	ソフトウェア・サービス	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA		809	827	646	85,177	銀行	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
			株 数	株 数		評 価 額
外貨建金額	邦貨換算金額					
(ユーロ／スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BANCO DE SABADELL SA		426	663	118	15,586	銀行
BANCO POPULAR ESPANOL		222	227	78	10,336	銀行
BANCO SANTANDER SA		1,833	1,881	979	129,025	銀行
BANKIA SA		570	613	71	9,469	銀行
BANKINTER SA		84	95	63	8,429	銀行
CAIXABANK		300	348	123	16,295	銀行
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		74	85	51	6,786	食品・生活必需品小売り
ENAGAS SA		26	29	81	10,760	公益事業
ENDESA SA		39	43	86	11,452	公益事業
FERROVIAL S.A.		54	57	129	17,109	資本財
GAS NATURAL SDG SA		43	47	94	12,417	公益事業
GRIFOLS SA		18	20	87	11,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA		672	712	466	61,444	公益事業
INDITEX SA		142	143	469	61,809	小売
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		102	112	93	12,378	運輸
MAPFRE SA		105	142	36	4,763	保険
RED ELECTRICA DE ESPANA		14	14	120	15,837	公益事業
REPSOL SA		138	141	172	22,769	エネルギー
TELEFONICA SA		553	588	694	91,460	電気通信サービス
TELEFONICA SA-RTS		—	588	20	2,689	電気通信サービス
ZARDOYA OTIS SA		20	25	27	3,623	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	6,398	7,569	5,217	687,486	
	銘 柄 数 <比 率>	25	26	—	<1.4%>	
(ユーロ／イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI SPA		156	153	271	35,743	保険
ATLANTIA SPA		56	56	139	18,342	運輸
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA		26	355	51	6,838	銀行
BANCO POPOLARE SC		44	48	65	8,611	銀行
ENEL GREEN POWER SPA		215	251	49	6,480	公益事業
ENEL SPA		862	929	381	50,231	公益事業
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA		332	334	499	65,859	エネルギー
EXOR SPA		12	14	57	7,517	各種金融
FINMECCANICA SPA		50	57	76	10,103	資本財
INTESA SANPAOLO		1,744	1,757	554	73,049	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA		22	22	139	18,381	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA		75	75	71	9,356	各種金融
PIRELLI & C.		29	—	—	—	自動車・自動車部品
PRYSMIAN SPA		25	27	54	7,162	資本財
SAIPEM SPA		32	37	30	3,983	エネルギー
SNAM SPA		284	277	132	17,448	公益事業
TELECOM ITALIA SPA		1,982	1,939	225	29,699	電気通信サービス
TERNA SPA		194	208	96	12,747	公益事業
UNICREDIT SPA		573	628	347	45,783	銀行
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA		107	122	79	10,433	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	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	
(ユーロ/イタリア)		百株	百株	千ユーロ 千円	
UNIPOLSAI SPA		109	152	35 4,718	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	6,939	7,454	3,358 442,492	
	銘 柄 数 <比 率>	21	20	— <0.9%>	
(ユーロ/フィンランド)					
ELISA OYJ		18	21	75 9,970	電気通信サービス
FORTUM OYJ		57	60	84 11,090	公益事業
KONE OYJ		41	45	180 23,789	資本財
METSO OYJ		13	15	36 4,827	資本財
NESTE OYJ		15	18	45 6,033	エネルギー
NOKIA OYJ		490	485	331 43,683	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ		13	15	53 7,017	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B		12	14	48 6,363	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		59	58	270 35,620	保険
STORA ENSO OYJ		69	78	72 9,600	素材
UPM-KYMMENE OYJ		69	72	129 17,063	素材
WARTSILA OYJ		18	20	81 10,762	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	881	905	1,410 185,823	
	銘 柄 数 <比 率>	12	12	— <0.4%>	
(ユーロ/オーストリア)					
ANDRITZ AG		9	11	54 7,195	資本財
ERSTE GROUP BANK AG		34	37	107 14,162	銀行
IMMOFINANZ AG		113	—	— —	不動産
OMV AG		18	20	54 7,148	エネルギー
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING		13	15	24 3,171	銀行
VOESTALPINE AG		14	16	48 6,375	素材
WIENER STAEDTISCHE VERSICHERUNG		4	—	— —	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	206	100	288 38,052	
	銘 柄 数 <比 率>	7	5	— <0.1%>	
(ユーロ/その他)					
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		29	29	232 30,644	ヘルスケア機器・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	29	29	232 30,644	
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	— <0.1%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	32,286	35,387	46,857 6,173,896	
	銘 柄 数 <比 率>	230	229	— <12.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	185,032	181,413	— 47,696,457	
	銘 柄 数 <比 率>	1,246	1,255	— <93.7%>	

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千米・ドル	千円
BOSTON PROPERTIES INC		2	2	257	31,663
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP		4	4	380	46,725
PROLOGIS INC		6	6	288	35,526
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT		12	12	121	14,942
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1	1	310	38,238
CAMDEN PROPERTY TRUST		1	1	89	11,060
DUKE REALTY CORP		4	4	92	11,327
EQUITY RESIDENTIAL		4	4	379	46,605
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.860	0.889	200	24,701	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.895	0.934	136	16,840	
GENERAL GROWTH PROPERTIES		7	7	197	24,277
HCP INC		6	6	215	26,450
WELLTOWER INC		4	4	279	34,374
HOST HOTELS AND RESORTS INC		10	10	164	20,286
KIMCO REALTY CORP		5	5	145	17,884
LIBERTY PROPERTY TRUST		1	2	69	8,586
MACERICH CO/THE		1	1	140	17,277
PLUM CREEK TIMBER CO		2	2	118	14,604
PUBLIC STORAGE		1	1	452	55,691
RAYONIER INC		1	—	—	—
REGENCY CENTERS CORP		1	1	86	10,654
SIMON PROPERTY GROUP INC		4	4	784	96,404
SL GREEN REALTY CORP		1	1	157	19,374
UDR INC		3	3	126	15,516
VENTAS INC		4	4	224	27,619
VORNADO REALTY TRUST		2	2	219	26,954
REALTY INCOME CORP		2	3	149	18,430
EXTRA SPACE STORAGE INC		—	1	121	14,983
DIGITAL REALTY TRUST INC		1	1	130	16,083
IRON MOUNTAIN INC		2	2	77	9,549
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP		4	4	84	10,425
AMERICAN TOWER REIT INC		5	5	555	68,308
EQUINIX INC	0.738	0.785	224	27,616	
VEREIT		11	12	99	12,220
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		—	2	64	7,911
COMMUNICATIONS SALES & LE		1	1	30	3,784
小 計	口 数 ・ 金 額	128	136	7,180	882,902
	銘 柄 数 < 比 率 >	34	35	—	<1.7%>
(カナダ)				千カナダ・ドル	
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		1	2	42	3,926
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1	2	56	5,212
小 計	口 数 ・ 金 額	3	4	98	9,139
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.0%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
				外貨建金額 邦貨換算金額
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル 千円
DEXUS PROPERTY GROUP		12	14	113 10,029
NOVION PROPERTY GROUP		31	—	—
GPT GROUP		24	27	127 11,301
GOODMAN GROUP		24	26	160 14,230
STOCKLAND		33	35	140 12,410
WESTFIELD CORP		27	27	276 24,476
MIRVAC GROUP		52	57	107 9,516
VICINITY CENTRES		21	50	142 12,577
SCENTRE GROUP		74	75	306 27,076
小 計	口 数 ・ 金 額	303	314	1,375 121,617
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	8	— <0.2%>
(香港)				千香港・ドル
LINK REIT		30	30	1,483 23,540
小 計	口 数 ・ 金 額	30	30	1,483 23,540
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	— <0.0%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		25	29	66 5,764
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		25	29	38 3,336
CAPITALAND MALL TRUST		29	34	65 5,655
SUNTEC REIT		29	34	52 4,576
小 計	口 数 ・ 金 額	110	127	222 19,332
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	— <0.0%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC		12	12	109 20,511
HAMMERSON PLC		9	10	64 12,194
LAND SECURITIES GROUP PLC		10	10	133 25,005
SEGRO PLC		8	10	46 8,741
INTU PROPERTIES PLC		11	13	42 8,063
小 計	口 数 ・ 金 額	53	58	396 74,516
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	— <0.1%>
(ユーロ/フランス)				千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO SE		1	1	326 43,044
KLEPIERRE		2	2	109 14,393
GECINA SA		0.352	0.506	57 7,637
FONCIERE DES REGIONS		0.350	0.443	37 4,884
ICADE		0.449	0.480	31 4,162
小 計	口 数 ・ 金 額	4	5	562 74,122
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	— <0.1%>
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	4	5	562 74,122
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	— <0.1%>
合 計	口 数 ・ 金 額	634	676	— 1,205,171
	銘 柄 数 < 比 率 >	60	60	— <2.4%>

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外 国		百万円	百万円
	S&P 500 EMINI FUTURE	1,214	—
	DJ EURO STOXX 50	604	—

(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

(2015年11月20日現在)

項 目		当 期 末	
		評 価 額	比 率
株 式		千円	%
		47,696,457	93.3
投 資 信 託 証 券		1,205,171	2.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		2,232,697	4.3
投 資 信 託 財 産 総 額		51,134,326	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122.96円、1カナダ・ドル92.42円、1オーストラリア・ドル88.42円、1香港・ドル15.87円、1シンガポール・ドル86.96円、1ニュージーランド・ドル80.65円、1イギリス・ポンド187.85円、1イスラエル・シェケル31.74円、1スイス・フラン121.18円、1デンマーク・クローネ17.66円、1ノルウェー・クローネ14.27円、1スウェーデン・クローナ14.15円、1ユーロ131.76円です。

(注2) 外貨建純資産 (50,614,764千円) の投資信託財産総額 (51,134,326千円) に対する比率は99.0%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

(2015年11月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	51,133,382,221円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,088,402,269
株 式 (評価額)	47,696,457,467
投資信託証券 (評価額)	1,205,171,823
未 収 入 金	42,331,582
未 収 配 当 金	89,473,109
差 入 委 託 証 拠 金	1,011,545,971
(B) 負 債	253,194,043
未 払 金	1,236,509
未 払 解 約 金	251,957,534
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	50,880,188,178
元 本	35,008,790,381
次 期 繰 越 損 益 金	15,871,397,797
(D) 受 益 権 総 口 数	35,008,790,381口
1万口当たり基準価額 (C／D)	14,534円

- (注1) 期首元本額 34,647,225,091円
 期中追加設定元本額 10,252,542,992円
 期中一部解約元本額 9,890,977,702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) 278,615,081円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) 1,896,276,758円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) 1,651,202,428円
 ニッセイ外国株式インデックスファンドII (適格機関投資家限定) 11,034,706,520円
 ニッセイ厚生年金型バランス運用DB (適格機関投資家限定) 6,967,231,514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 13,093,548,146円
 DCニッセイ外国株式インデックス 2,911,000円
 ニッセイターゲットデートファンドI (適格機関投資家限定) 239,362円
 ニッセイターゲットデートファンドII (適格機関投資家限定) 196,060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) 83,863,512円

◆損益の状況

当期 (2015年5月21日～2015年11月20日)

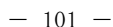
項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	507,761,618円
受 取 配 当 金	506,754,323
受 取 利 息	237,505
そ の 他 収 益 金	769,790
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 2,428,708,172
売 買 益	2,415,441,812
売 買 損	△ 4,844,149,984
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 15,434,836
取 引 益	250,320,234
取 引 損	△ 265,755,070
(D) 信 託 報 酬 等	△ 28,435,727
(E) 当期損益金 (A＋B＋C＋D)	△ 1,964,817,117
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	17,444,758,199
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,455,983,458
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 4,064,526,743
(I) 合 計 (E＋F＋G＋H)	15,871,397,797
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	15,871,397,797

- (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) (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。

[illegible]

法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの当期運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	主に日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界主要先進国の国債
組 入 制 限	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資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。



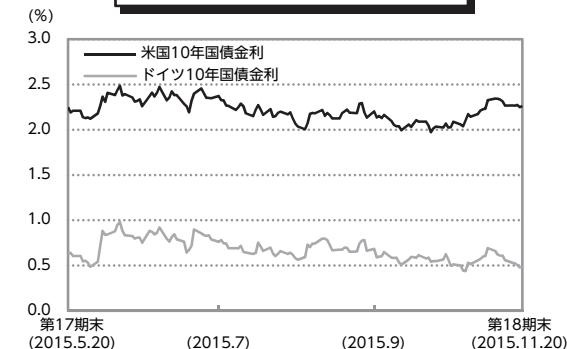
運用経過

(2015年5月21日から2015年11月20日まで)

投資環境

■海外債券市況

10年国債金利の推移



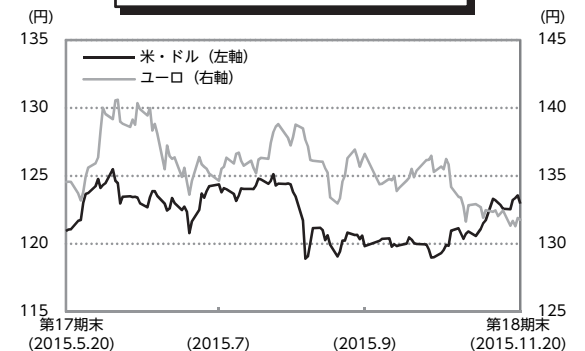
(注) 10年国債金利は、ブルームバーグのデータを使用しています。

米国10年国債金利は、期初以降、良好な米経済指標や金利上昇を容認するドラギ欧州中央銀行（E C B）総裁の発言を受けた欧州金利の上昇などから、6月初旬に2.5%近辺まで上昇しました。その後は、原油安を背景としたインフレ期待の後退や中国をはじめとする新興国経済に対する不安、加えて株式市場の急落などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、一時1.9%近辺まで低下しました。その後、期末にかけては、米連邦準備制度理事会（F R B）の年内利上げ観測の高まりから金利は上昇に転じ、結局、2.2%台で当期末を迎えました。

ドイツ10年国債金利は、E C Bによる大幅な追加金融緩和期待を背景に低下が進み、結局、0.4%台で当期末を迎えました。

■為替市況

為替レートの推移

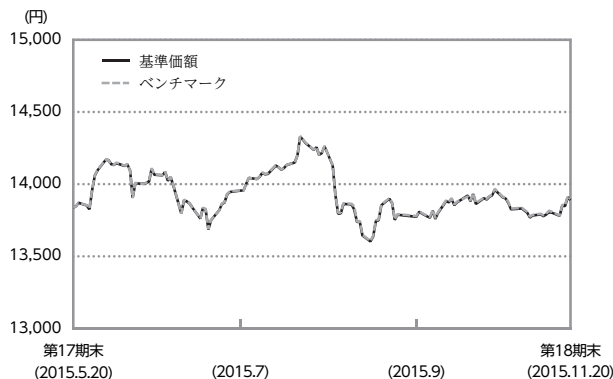


(注) 為替レートは、対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

米・ドル／円レートは、中国をはじめとした新興国経済に対する不安の高まりなどから投資家のリスク回避姿勢が強まり、一時118円台まで円高に振れる場面がありましたが、期末にかけては投資家の過度なリスク回避姿勢の後退やF R Bの年内利上げ観測の高まりから上昇し、結局、122円台後半で当期末を迎えました。

ユーロ／円レートは、日銀による追加金融緩和期待等がユーロ高円安要因となったものの、8月以降は中国をはじめとした新興国経済に対する懸念の高まりや、E C Bの大幅な追加金融緩和期待が円高ユーロ安要因となり、結局、131円台後半で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークはシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なお円換算ベースの指数は、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。シティ世界国債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Citigroup Index LLCに帰属します。Citigroup Index LLC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。

■基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、欧州金利の上昇を受けたユーロの対円での上昇から上昇して始まりました。その後、7月上旬にかけては、中国をはじめとした新興国経済に対する不安を背景に株式市場が急落したことなどから投資家のリスク回避姿勢が強まり、為替が円高となったことを受けて、基準価額は下落する展開となりました。8月中旬にかけては、ギリシャ支援合意を背景とした投資家のリスク回避姿勢の後退から円安となり、基準価額は上昇に転じました。9月上旬にかけては、世界経済の減速懸念により円高となったことから再び下落し、期末にかけては、米利上げ観測の高まりによる米・ドルの対円での上昇と、ECBの追加金融緩和観測を受けたユーロの対円での下落からおおむね横ばい推移となり、当期末を迎えました。

ポートフォリオ

日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+0.4%となり、ベンチマーク騰落率（+0.4%）に連動しました。

今後の運用方針

日本を除く世界主要先進国の国債に投資することにより、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

お知らせ

■約款変更

信用リスク分散規制にかかる投資制限条項を追加するため、関連条項に所要の変更を行いました。
(2015年8月27日)

◆最近5期の運用実績

決 算 期	基準価額	期 中 騰落率	ベンチマーク	期 中 騰落率	債 券 組入比率	純資産 総 額
	円	%		%	%	百万円
14期(2013年11月20日)	11,636	△ 1.0	11,699	△ 1.0	98.4	1,877
15期(2014年5月20日)	12,256	5.3	12,334	5.4	98.3	6,278
16期(2014年11月20日)	14,032	14.5	14,131	14.6	98.2	7,582
17期(2015年5月20日)	13,837	△ 1.4	13,943	△ 1.3	98.6	9,551
18期(2015年11月20日)	13,890	0.4	14,004	0.4	98.6	10,962

(注) ベンチマークはシティ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。なお円換算ベースの指数は、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。シティ世界国債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Citigroup Index LLCに帰属します。Citigroup Index LLC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
(期 首) 2015年5月20日	円 13,837	% —	13,943	% —	% 98.6
5月末	14,096	1.9	14,207	1.9	98.8
6月末	13,887	0.4	13,999	0.4	98.5
7月末	14,071	1.7	14,184	1.7	98.5
8月末	13,860	0.2	13,970	0.2	98.7
9月末	13,815	△0.2	13,927	△0.1	98.4
10月末	13,827	△0.1	13,938	△0.0	98.5
(期 末) 2015年11月20日	13,890	0.4	14,004	0.4	98.6

(注) 騰落率は期首比です。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

◆売買および取引の状況

(2015年5月21日～2015年11月20日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米・ドル 25,315	千米・ドル 20,009
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 2,391	千カナダ・ドル 2,154
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 1,947	千オーストラリア・ドル 1,544
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 461	千シンガポール・ドル 438
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 3,231	千イギリス・ポンド 2,591
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 2,326	千デンマーク・クローネ 2,201
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 1,693	千ノルウェー・クローネ 1,363
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 3,143	千スウェーデン・クローナ 2,801
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 13,357	千メキシコ・ペソ 10,878
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 1,711	千マレーシア・リンギット 1,471
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカ・ランド 5,630	千南アフリカ・ランド 4,318
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 1,230	千ポーランド・ズロチ 1,118
	ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 600	千ユーロ 496
		オ ラ ン ダ	1,855	1,586
		ベルギー	1,571	1,283
		フ ラ ン ス	4,743	3,588
		ド イ ツ	4,708	3,881
		ス ペ イ ン	3,512	2,846
		イ タ リ ア	5,180	4,192
		フィンランド	443	371
		オーストリア	784	641

(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。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

◆主要な売買銘柄

(2015年5月21日～2015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 N/B	99, 916	US TREASURY N/B	266, 519
US TREASURY N/B	84, 368	US TREASURY N/B	207, 009
US TREASURY N/B	81, 728	US TREASURY N/B	144, 306
US TREASURY N/B	78, 859	US TREASURY N/B	127, 563
US TREASURY N/B	78, 532	US TREASURY N/B	124, 800
US TREASURY N/B	77, 775	US TREASURY N/B	108, 676
US TREASURY N/B	75, 326	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	93, 076
US TREASURY N/B	74, 019	US TREASURY N/B	91, 414
US TREASURY N/B	72, 736	US TREASURY N/B	90, 820
US TREASURY N/B	70, 553	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	88, 191

(注1) 金額は受渡金(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

(2015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
ア メ リ カ	千米・ドル 36, 650	千米・ドル 37, 673	千円 4, 632, 368	% 42. 3	% —	% 16. 2	% 16. 4	% 9. 6
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 2, 200	千カナダ・ドル 2, 439	225, 462	2. 1	—	0. 9	0. 6	0. 5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 1, 950	千オーストラリア・ドル 2, 118	187, 327	1. 7	—	1. 0	0. 5	0. 2
シンガポール	千シンガポール・ドル 440	千シンガポール・ドル 453	39, 450	0. 4	—	0. 2	0. 1	0. 0
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 4, 160	千イギリス・ポンド 4, 902	920, 910	8. 4	—	5. 9	2. 0	0. 5
ス イ ス	千スイス・フラン 250	千スイス・フラン 287	34, 892	0. 3	—	—	0. 3	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 3, 070	千デンマーク・クローネ 3, 919	69, 227	0. 6	—	0. 5	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・クロネ 1,940	千/ルウェー・クロネ 2,122	千円 30,286	% 0.3	% —	% 0.2	% 0.1	% 0.0
ス ウ ェ ー デ ン		千/スウェーデン・クロナ 3,030	千/スウェーデン・クロナ 3,517	49,769	0.5	—	0.3	0.1	0.0
メ キ シ コ		千/メキシコ・ペソ 13,840	千/メキシコ・ペソ 15,175	111,993	1.0	—	0.6	0.4	—
マ レ ー シ ア		千/マレーシア・リンギット 1,670	千/マレーシア・リンギット 1,660	47,035	0.4	—	0.2	0.2	0.1
南 ア フ リ カ		千/南アフリカ・ランド 6,290	千/南アフリカ・ランド 6,000	52,626	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポ ー ラ ン ド		千/ポーランド・ズロチ 1,640	千/ポーランド・ズロチ 1,815	56,275	0.5	—	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ		千ユーロ	千ユーロ						
	アイルランド	550	654	86,181	0.8	—	0.4	0.4	0.0
	オランダ	1,750	2,036	268,273	2.4	—	1.4	0.7	0.4
	ベルギー	1,690	2,086	274,909	2.5	—	1.7	0.5	0.2
	フランス	6,560	7,868	1,036,800	9.5	—	5.8	2.7	1.0
	ド イ ツ	5,210	6,123	806,788	7.4	—	4.2	2.2	1.0
	ス ペ イ ン	3,820	4,480	590,335	5.4	—	2.9	1.7	0.7
	イ タ リ ア	6,720	8,041	1,059,489	9.7	—	6.0	2.8	0.9
	フィンランド	440	495	65,344	0.6	—	0.4	0.2	0.1
	オーストリア	1,030	1,255	165,401	1.5	—	0.9	0.4	0.2
合 計		—	—	10,811,148	98.6	—	50.2	32.6	15.8

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

(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	邦貨換算金額
アメリカ			%		千米・ドル	千米・ドル	千円
国債証券	U S TREASURY BONDS		6.0000	2026/ 2 /15	40	53	6,597
	U S TREASURY BONDS 5		5.5000	2028/ 8 /15	40	53	6,560

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	邦貨換算金額
アメリカ			%		千米・ドル	千米・ドル	千円
	国債証券	U S TREASURY BONDS 6	6. 1250	2027/11/15	50	69	8, 546
		US TREASURY BONDS	6. 2500	2030/ 5 /15	40	58	7, 149
		US TREASURY N/B	1. 0000	2016/10/31	160	160	19, 742
		US TREASURY N/B	0. 8750	2016/12/31	50	50	6, 160
		US TREASURY N/B	3. 1250	2017/ 1 /31	2, 110	2, 170	266, 855
		US TREASURY N/B	0. 6250	2017/ 2 /15	140	139	17, 193
		US TREASURY N/B	0. 7500	2017/ 3 /15	650	650	79, 933
		US TREASURY N/B	0. 8750	2017/ 4 /15	640	640	78, 817
		US TREASURY N/B	0. 8750	2017/ 5 /15	70	70	8, 618
		US TREASURY N/B	4. 5000	2017/ 5 /15	630	664	81, 735
		US TREASURY N/B	0. 8750	2017/ 6 /15	620	620	76, 324
		US TREASURY N/B	0. 7500	2017/ 6 /30	600	599	73, 695
		US TREASURY N/B	2. 3750	2017/ 7 /31	670	687	84, 519
		US TREASURY N/B	0. 6250	2017/ 8 /31	700	697	85, 710
		US TREASURY N/B	0. 8750	2017/10/15	820	819	100, 806
		US TREASURY N/B	1. 8750	2017/10/31	600	611	75, 164
		US TREASURY N/B	1. 0000	2017/12/15	490	490	60, 294
		US TREASURY N/B	0. 7500	2017/12/31	420	418	51, 405
		US TREASURY N/B	3. 5000	2018/ 2 /15	640	675	83, 011
		US TREASURY N/B	1. 0000	2018/ 3 /15	370	369	45, 461
		US TREASURY N/B	0. 7500	2018/ 3 /31	380	377	46, 415
		US TREASURY N/B	2. 6250	2018/ 4 /30	420	436	53, 623
		US TREASURY N/B	1. 1250	2018/ 6 /15	390	390	47, 977
		US TREASURY N/B	1. 3750	2018/ 6 /30	380	382	47, 049
		US TREASURY N/B	4. 0000	2018/ 8 /15	390	420	51, 726
		US TREASURY N/B	1. 0000	2018/ 9 /15	400	397	48, 937
		US TREASURY N/B	1. 3750	2018/ 9 /30	400	402	49, 454
		US TREASURY N/B	3. 7500	2018/11/15	600	644	79, 295
		US TREASURY N/B	1. 2500	2018/11/30	270	270	33, 215
		US TREASURY N/B	1. 5000	2018/12/31	450	453	55, 730
		US TREASURY N/B	2. 7500	2019/ 2 /15	570	596	73, 347
		US TREASURY N/B	1. 6250	2019/ 3 /31	600	605	74, 468
		US TREASURY N/B	3. 1250	2019/ 5 /15	420	445	54, 739
		US TREASURY N/B	1. 6250	2019/ 6 /30	260	262	32, 230
		US TREASURY N/B	0. 8750	2019/ 7 /31	490	480	59, 068
US TREASURY N/B	1. 6250	2019/ 8 /31	280	281	34, 671		

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	邦貨換算金額
アメリカ		%		千米・ドル	千米・ドル	千円
国債証券	US TREASURY N/B	1.0000	2019/ 9 /30	360	353	43,493
	US TREASURY N/B	1.2500	2019/10/31	1,010	1,001	123,150
	US TREASURY N/B	1.6250	2019/12/31	650	652	80,230
	US TREASURY N/B	1.3750	2020/ 1 /31	510	506	62,227
	US TREASURY N/B	3.6250	2020/ 2 /15	90	97	11,995
	US TREASURY N/B	1.3750	2020/ 3 /31	550	544	66,995
	US TREASURY N/B	3.5000	2020/ 5 /15	560	605	74,404
	US TREASURY N/B	1.6250	2020/ 6 /30	540	539	66,341
	US TREASURY N/B	2.6250	2020/ 8 /15	530	552	67,976
	US TREASURY N/B	2.0000	2020/ 9 /30	320	324	39,925
	US TREASURY N/B	2.6250	2020/11/15	620	646	79,472
	US TREASURY N/B	2.3750	2020/12/31	100	103	12,677
	US TREASURY N/B	3.6250	2021/ 2 /15	550	600	73,832
	US TREASURY N/B	2.2500	2021/ 3 /31	140	143	17,615
	US TREASURY N/B	3.1250	2021/ 5 /15	500	533	65,632
	US TREASURY N/B	2.1250	2021/ 6 /30	300	304	37,475
	US TREASURY N/B	2.2500	2021/ 7 /31	330	337	41,463
	US TREASURY N/B	2.1250	2021/ 8 /15	160	162	19,969
	US TREASURY N/B	2.1250	2021/ 9 /30	320	324	39,881
	US TREASURY N/B	2.0000	2021/11/15	610	613	75,463
	US TREASURY N/B	2.1250	2021/12/31	300	303	37,331
	US TREASURY N/B	2.0000	2022/ 2 /15	240	241	29,646
	US TREASURY N/B	1.7500	2022/ 3 /31	250	246	30,354
	US TREASURY N/B	1.7500	2022/ 5 /15	380	374	46,064
	US TREASURY N/B	2.1250	2022/ 6 /30	280	282	34,725
	US TREASURY N/B	1.6250	2022/ 8 /15	380	370	45,579
	US TREASURY N/B	1.6250	2022/11/15	450	438	53,924
	US TREASURY N/B	2.0000	2023/ 2 /15	280	279	34,361
	US TREASURY N/B	1.7500	2023/ 5 /15	220	214	26,426
	US TREASURY N/B	2.5000	2023/ 8 /15	290	298	36,715
	US TREASURY N/B	2.7500	2023/11/15	310	324	39,930
	US TREASURY N/B	2.7500	2024/ 2 /15	180	188	23,152
	US TREASURY N/B	2.5000	2024/ 5 /15	530	543	66,803
	US TREASURY N/B	2.3750	2024/ 8 /15	370	375	46,114
	US TREASURY N/B	2.2500	2024/11/15	430	430	52,966
	US TREASURY N/B	2.0000	2025/ 2 /15	360	352	43,340

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	邦貨換算金額
アメリカ			%		千米・ドル	千米・ドル	千円
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.1250	2025/ 5 /15	400	395	48,630
		US TREASURY N/B	2.0000	2025/ 8 /15	370	361	44,458
		US TREASURY N/B	5.3750	2031/ 2 /15	90	122	15,041
		US TREASURY N/B	4.5000	2036/ 2 /15	80	102	12,624
		US TREASURY N/B	5.0000	2037/ 5 /15	30	41	5,060
		US TREASURY N/B	4.3750	2038/ 2 /15	50	63	7,762
		US TREASURY N/B	4.5000	2038/ 5 /15	40	51	6,318
		US TREASURY N/B	3.5000	2039/ 2 /15	70	77	9,531
		US TREASURY N/B	4.2500	2039/ 5 /15	80	98	12,156
		US TREASURY N/B	4.5000	2039/ 8 /15	70	89	11,021
		US TREASURY N/B	4.3750	2039/11/15	70	88	10,827
		US TREASURY N/B	4.6250	2040/ 2 /15	140	182	22,435
		US TREASURY N/B	3.8750	2040/ 8 /15	100	116	14,361
		US TREASURY N/B	4.2500	2040/11/15	110	135	16,715
		US TREASURY N/B	4.7500	2041/ 2 /15	110	146	17,965
		US TREASURY N/B	3.1250	2041/11/15	80	82	10,161
		US TREASURY N/B	3.1250	2042/ 2 /15	100	103	12,695
		US TREASURY N/B	3.0000	2042/ 5 /15	100	100	12,371
		US TREASURY N/B	2.7500	2042/ 8 /15	130	124	15,268
		US TREASURY N/B	2.7500	2042/11/15	180	171	21,086
		US TREASURY N/B	3.1250	2043/ 2 /15	160	163	20,164
		US TREASURY N/B	2.8750	2043/ 5 /15	250	243	29,965
		US TREASURY N/B	3.6250	2043/ 8 /15	200	225	27,711
		US TREASURY N/B	3.7500	2043/11/15	250	288	35,426
		US TREASURY N/B	3.6250	2044/ 2 /15	250	281	34,612
		US TREASURY N/B	3.3750	2044/ 5 /15	260	279	34,318
		US TREASURY N/B	3.1250	2044/ 8 /15	240	245	30,180
		US TREASURY N/B	3.0000	2044/11/15	240	239	29,420
		US TREASURY N/B	2.5000	2045/ 2 /15	260	233	28,698
		US TREASURY N/B	3.0000	2045/ 5 /15	220	219	26,956
		US TREASURY N/B	2.8750	2045/ 8 /15	260	252	31,106
		UST BOND 5 1/4 02/15	5.2500	2029/ 2 /15	50	65	8,072
		UST BOND 5 1/4 11/15	5.2500	2028/11/15	40	52	6,439
		UST BOND 6.50 26/11/	6.5000	2026/11/15	30	42	5,185
		WI TREASURY SEC.	4.3750	2040/ 5 /15	100	125	15,470
		WI TREASURY SEC.	4.3750	2041/ 5 /15	100	126	15,517

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	邦貨換算金額		
アメリカ			%		千米・ドル	千米・ドル	千円		
	国債証券	WI TREASURY SEC.	3.7500	2041/ 8 /15	90	103	12, 711		
小 計			—	—	—	—	4, 632, 368		
カナダ					千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			
	国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.7500	2064/12/ 1	20	22	2, 088		
		CANADA-GOV 5 3/4 06	5.7500	2029/ 6 / 1	70	101	9, 339		
		CANADA-GOVT	4.2500	2018/ 6 / 1	60	65	6, 043		
		CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2017/ 5 / 1	30	29	2, 758		
		CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2017/ 8 / 1	510	515	47, 638		
		CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2017/11/ 1	60	59	5, 506		
		CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2018/ 3 / 1	110	111	10, 309		
		CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2018/ 9 / 1	70	71	6, 572		
		CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2019/ 3 / 1	50	51	4, 775		
		CANADIAN GOVERNMENT	3.7500	2019/ 6 / 1	110	121	11, 231		
		CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2019/ 9 / 1	50	51	4, 788		
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2020/ 3 / 1	60	61	5, 702		
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2020/ 6 / 1	70	78	7, 223		
		CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2020/ 9 / 1	100	99	9, 160		
		CANADIAN GOVERNMENT	0.7500	2021/ 3 / 1	30	29	2, 727		
		CANADIAN GOVERNMENT	3.2500	2021/ 6 / 1	60	66	6, 190		
		CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2022/ 6 / 1	70	76	7, 074		
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2023/ 6 / 1	80	80	7, 439		
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2024/ 6 / 1	80	86	7, 967		
		CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2025/ 6 / 1	90	94	8, 774		
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/ 6 / 1	20	19	1, 802		
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0000	2027/ 6 / 1	20	32	3, 026		
		CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/ 6 / 1	70	106	9, 799		
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/ 6 / 1	80	116	10, 746		
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/ 6 / 1	100	131	12, 170		
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/ 1	100	125	11, 580		
		CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/ 1	30	32	3, 025		
		小 計			—	—	—	—	225, 462
		オーストラリア					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	
	国債証券	Australia Government Bond	4.7500	2027/ 4 /21	120	139	12, 337		
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2017/ 7 /21	230	238	21, 069		
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2018/10/21	240	247	21, 892		
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.2500	2019/ 3 /15	200	219	19, 429		

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	邦貨換算金額
オーストラリア			%		千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2020/ 4 /15	150	163	14,497	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2021/ 5 /15	70	81	7,240	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2022/ 7 /15	220	262	23,183	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5000	2023/ 4 /21	120	142	12,596	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/ 4 /21	130	129	11,424	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/ 4 /21	150	154	13,628	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/ 4 /21	120	133	11,810	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/ 4 /21	60	60	5,323	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/ 4 /21	50	57	5,072	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/ 6 /21	20	17	1,580	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/ 4 /21	50	51	4,566	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/ 6 /21	20	18	1,673	
小 計			—	—	—	—	187,327
シンガポール					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2017/ 4 / 1	40	40	3,538	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4.0000	2018/ 9 / 1	60	64	5,575	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.5000	2019/ 6 / 1	50	51	4,469	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.2500	2020/ 9 / 1	40	42	3,680	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2021/ 6 / 1	30	30	2,619	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.1250	2022/ 9 / 1	30	31	2,739	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2023/ 7 / 1	30	30	2,667	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2024/ 9 / 1	30	31	2,715	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/ 6 / 1	20	19	1,712	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/ 3 / 1	30	32	2,818	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/ 7 / 1	10	10	880	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/ 9 / 1	20	20	1,746	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/ 9 / 1	10	10	928	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/ 4 / 1	40	38	3,358	
小 計			—	—	—	—	39,450
イギリス					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	
国債証券	TSY 3 3/4% 2019	3.7500	2019/ 9 / 7	90	99	18,615	
	TSY 3 3/4% 2020	3.7500	2020/ 9 / 7	110	122	23,096	
	TSY 3 3/4% 2021	3.7500	2021/ 9 / 7	130	147	27,633	
	TSY 4 1/2% 2019	4.5000	2019/ 3 / 7	110	122	23,101	
	TSY 4 1/2% 2034	4.5000	2034/ 9 / 7	120	156	29,445	
	TSY 4 1/2% 2042	4.5000	2042/12/ 7	100	137	25,770	

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	邦貨換算金額
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	TSY 4 1/4% 2036		4.2500	2036/ 3 / 7	140	178	33,508
	TSY 4 1/4% 2046		4.2500	2046/12/ 7	90	121	22,880
	TSY 4 1/4% 2027		4.2500	2027/12/ 7	70	86	16,259
	TSY 4 1/4% 2032		4.2500	2032/ 6 / 7	120	150	28,344
	TSY 4 1/4% 2039		4.2500	2039/ 9 / 7	80	103	19,428
	TSY 4 1/4% 2040		4.2500	2040/12/ 7	100	130	24,537
	TSY 4 1/4% 2055		4.2500	2055/12/ 7	90	129	24,380
	TSY 4 3/4% 2020		4.7500	2020/ 3 / 7	100	115	21,645
	TSY 4 3/4% 2030		4.7500	2030/12/ 7	130	171	32,195
	TSY 4% 2022		4.0000	2022/ 3 / 7	90	103	19,519
	TSY 4% 2060		4.0000	2060/ 1 /22	80	112	21,129
	TSY 4.75% 2038		4.7500	2038/12/ 7	90	124	23,294
	TSY 5 2025		5.0000	2025/ 3 / 7	90	114	21,568
	TSY 5% 2018		5.0000	2018/ 3 / 7	110	121	22,731
	TSY 8% 2021		8.0000	2021/ 6 / 7	50	67	12,726
	UK TREASURY		8.7500	2017/ 8 /25	120	137	25,829
	UK TREASURY		6.0000	2028/12/ 7	60	87	16,383
	UK TSY 1 1/2% 2021		1.5000	2021/ 1 /22	70	70	13,229
	UK TSY 1 3/4% 2019		1.7500	2019/ 7 /22	180	184	34,647
	UK TSY 1% 2017		1.0000	2017/ 9 / 7	180	181	34,038
	UK TSY 1.25% 2018		1.2500	2018/ 7 /22	190	192	36,105
	UK TSY 1.75% 2022		1.7500	2022/ 9 / 7	140	141	26,621
	UK TSY 2 1/4% 2023		2.2500	2023/ 9 / 7	130	135	25,423
	UK TSY 2 3/4% 2024		2.7500	2024/ 9 / 7	130	140	26,310
	UK TSY 2% 2020		2.0000	2020/ 7 /22	180	186	34,949
	UK TSY 2% 2025		2.0000	2025/ 9 / 7	90	90	17,080
	UK TSY 3 1/2% 2068		3.5000	2068/ 7 /22	110	142	26,781
	UK TSY 3 1/4% 2044		3.2500	2044/ 1 /22	150	169	31,751
	UK TSY 3 3/4% 2052		3.7500	2052/ 7 /22	80	103	19,426
	UK TSY 3.5% 2045		3.5000	2045/ 1 /22	130	153	28,822
	UK TSY 4 1/4% 2049		4.2500	2049/12/ 7	100	138	26,051
	UNITED KINGDOM GILT		2.5000	2065/ 7 /22	30	30	5,643
小 計			—	—	—	—	920,910
スイス					千スイス・フラン	千スイス・フラン	
国債証券	Switzerland Government Bond		2.2500	2020/ 7 / 6	250	287	34,892
小 計			—	—	—	—	34,892

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	邦貨換算金額
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	千円
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	4. 0000	2017/11/15	430	468	8, 274	
	KINGDOM OF DENMARK	4. 0000	2019/11/15	530	618	10, 914	
	KINGDOM OF DENMARK	3. 0000	2021/11/15	600	701	12, 380	
	KINGDOM OF DENMARK	1. 5000	2023/11/15	360	389	6, 880	
	KINGDOM OF DENMARK	7. 0000	2024/11/10	130	204	3, 615	
	KINGDOM OF DENMARK	1. 7500	2025/11/15	260	285	5, 037	
	KINGDOM OF DENMARK	4. 5000	2039/11/15	760	1, 252	22, 124	
小 計			—	—	—	—	69, 227
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	4. 2500	2017/ 5 /19	350	368	5, 262	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4. 5000	2019/ 5 /22	360	407	5, 809	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3. 7500	2021/ 5 /25	480	549	7, 839	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2. 0000	2023/ 5 /24	270	282	4, 037	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3. 0000	2024/ 3 /14	240	269	3, 845	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1. 7500	2025/ 3 /13	240	244	3, 492	
小 計			—	—	—	—	30, 286
スウェーデン					千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	3. 7500	2017/ 8 /12	350	375	5, 312	
	SWEDISH GOVERNMENT	4. 2500	2019/ 3 /12	570	654	9, 257	
	SWEDISH GOVERNMENT	5. 0000	2020/12/ 1	460	571	8, 081	
	SWEDISH GOVERNMENT	3. 5000	2022/ 6 / 1	570	682	9, 654	
	SWEDISH GOVERNMENT	1. 5000	2023/11/13	450	478	6, 776	
	SWEDISH GOVERNMENT	2. 5000	2025/ 5 /12	390	448	6, 341	
	SWEDISH GOVERNMENT	3. 5000	2039/ 3 /30	240	307	4, 345	
小 計			—	—	—	—	49, 769
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	7. 7500	2017/12/14	2, 050	2, 203	16, 261	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4. 7500	2018/ 6 /14	2, 900	2, 920	21, 550	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5. 0000	2019/12/11	540	535	3, 955	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8. 0000	2020/ 6 /11	660	734	5, 421	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6. 5000	2021/ 6 /10	800	839	6, 192	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6. 5000	2022/ 6 / 9	700	728	5, 373	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8. 0000	2023/12/ 7	510	576	4, 253	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10. 0000	2024/12/ 5	1, 300	1, 654	12, 208	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5. 7500	2026/ 3 / 5	350	338	2, 500	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7. 5000	2027/ 6 / 3	570	624	4, 608	

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	邦貨換算金額
メキシコ			%		千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/ 5 /31	540	639	4,716	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/ 5 /29	750	834	6,158	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	440	488	3,607	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	340	464	3,424	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	570	682	5,036	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	820	911	6,725	
小 計			—	—	—	—	111,993
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	3.3140	2017/10/31	280	281	7,969	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.5800	2018/ 9 /28	190	190	5,404	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8890	2020/ 7 /31	140	140	3,964	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4180	2022/ 8 /15	100	95	2,708	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4800	2023/ 3 /15	60	57	1,622	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1810	2024/ 7 /15	60	59	1,680	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/ 9 /15	80	77	2,200	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/ 4 /15	60	59	1,694	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/ 3 /15	60	57	1,619	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/ 6 /15	50	46	1,314	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/ 4 /15	100	100	2,847	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1270	2032/ 4 /15	30	28	803	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/ 4 /15	20	18	511	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/ 9 /30	30	30	876	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.3780	2019/11/29	280	286	8,117	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.1600	2021/ 7 /15	130	130	3,699	
小 計			—	—	—	—	47,035
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	8.2500	2017/ 9 /15	340	345	3,032	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0000	2018/12/21	300	303	2,657	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.2500	2020/ 1 /15	380	371	3,262	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.7500	2021/ 3 /31	350	331	2,904	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.7500	2023/ 2 /28	290	282	2,474	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5000	2026/12/21	1,040	1,192	10,459	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0000	2030/ 1 /31	540	503	4,414	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0000	2031/ 2 /28	570	480	4,215	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.2500	2032/ 3 /31	280	262	2,301	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.8750	2035/ 2 /28	100	98	862	

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	邦貨換算金額
南アフリカ			%		千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6. 2500	2036/ 3 /31	430	320	2, 809	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 5000	2037/ 1 /31	440	416	3, 650	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6. 5000	2041/ 2 /28	410	306	2, 683	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 7500	2044/ 1 /31	200	192	1, 683	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 7500	2048/ 2 /28	620	594	5, 215	
小 計			—	—	—	—	52, 626
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	5. 2500	2017/10/25	260	277	8, 610	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2. 5000	2018/ 7 /25	260	265	8, 222	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5. 5000	2019/10/25	240	272	8, 437	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5. 2500	2020/10/25	240	274	8, 520	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5. 7500	2021/10/25	90	107	3, 319	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5. 7500	2022/ 9 /23	160	192	5, 968	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4. 0000	2023/10/25	160	175	5, 443	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3. 2500	2025/ 7 /25	190	198	6, 141	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5. 7500	2029/ 4 /25	40	51	1, 609	
小 計			—	—	—	—	56, 275
ユーロ					千ユーロ	千ユーロ	
アイルランド	国債証券	IRISH TSY 0.8% 2022	0. 8000	2022/ 3 /15	30	30	4, 053
		IRISH TSY 2% 2045	2. 0000	2045/ 2 /18	30	29	3, 838
		IRISH TSY 2.4% 2030	2. 4000	2030/ 5 /15	50	55	7, 291
		IRISH TSY 3.4% 2024	3. 4000	2024/ 3 /18	40	48	6, 346
		IRISH TSY 3.9% 2023	3. 9000	2023/ 3 /20	30	36	4, 874
		IRISH TSY 5.5% 2017	5. 5000	2017/10/18	30	33	4, 382
		TREASURY 4 1/2% 2018	4. 5000	2018/10/18	90	102	13, 455
		TREASURY 4 1/2% 2020	4. 5000	2020/ 4 /18	60	71	9, 441
		TREASURY 5% 2020	5. 0000	2020/10/18	70	86	11, 395
		TREASURY 5.4% 2025	5. 4000	2025/ 3 /13	80	110	14, 622
		TREASURY 5.9% 2019	5. 9000	2019/10/18	40	49	6, 479
小 計			—	—	—	—	86, 181
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 5000	2017/ 4 /15	180	182	23, 999
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4. 5000	2017/ 7 /15	110	118	15, 653
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1. 2500	2018/ 1 /15	80	82	10, 899
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 0000	2018/ 4 /15	50	50	6, 635
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4. 0000	2018/ 7 /15	80	89	11, 744
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1. 2500	2019/ 1 /15	90	94	12, 427

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	邦貨換算金額
ユーロ			%		千ユーロ	千ユーロ	千円
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2019/ 7 /15	90	103	13,691
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2020/ 1 /15	90	91	12,065
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5000	2020/ 7 /15	80	93	12,315
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.2500	2021/ 7 /15	90	106	14,031
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2023/ 1 /15	80	100	13,185
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.7500	2023/ 7 /15	90	99	13,151
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2024/ 7 /15	100	112	14,880
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2025/ 7 /15	80	77	10,153
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/ 1 /15	70	107	14,196
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/ 1 /15	60	72	9,589
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/ 1 /15	80	120	15,934
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/ 1 /15	90	138	18,230
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/ 1 /15	60	79	10,479
		Netherlands Government Bond	2.2500	2022/ 7 /15	100	113	15,006
小 計			—	—	—	—	268,273
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2017/ 3 /28	60	63	8,365
		BELGIUM KINGDOM	3.5000	2017/ 6 /28	70	74	9,784
		BELGIUM KINGDOM	5.5000	2017/ 9 /28	60	66	8,757
		BELGIUM KINGDOM	4.0000	2018/ 3 /28	80	88	11,611
		BELGIUM KINGDOM	1.2500	2018/ 6 /22	80	83	10,963
		BELGIUM KINGDOM	4.0000	2019/ 3 /28	60	68	9,029
		BELGIUM KINGDOM	3.0000	2019/ 9 /28	70	78	10,348
		BELGIUM KINGDOM	3.7500	2020/ 9 /28	110	130	17,156
		BELGIUM KINGDOM	4.2500	2021/ 9 /28	90	111	14,728
		BELGIUM KINGDOM	4.0000	2022/ 3 /28	80	99	13,078
		BELGIUM KINGDOM	4.2500	2022/ 9 /28	100	127	16,742
		BELGIUM KINGDOM	2.2500	2023/ 6 /22	80	91	11,993
		BELGIUM KINGDOM	2.6000	2024/ 6 /22	100	116	15,390
		BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/ 6 /22	100	100	13,196
		BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/ 3 /28	50	68	8,985
		BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/ 3 /28	100	151	19,906
		BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/ 6 /22	20	18	2,486
		BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/ 3 /28	60	82	10,898
		BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/ 6 /22	30	37	4,890
		BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/ 3 /28	110	173	22,863
		BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/ 6 /22	30	30	4,083

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	邦貨換算金額
ユーロ			%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/ 3 /28	110	167	22,056
		BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/ 6 /22	40	57	7,591
小計			—	—	—	—	274,909
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2017/ 4 /25	430	454	59,944
		FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2017/10/25	220	239	31,538
		FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2018/ 2 /25	110	110	14,586
		FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2018/ 4 /25	320	353	46,566
		FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2018/11/25	300	311	41,010
		FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2019/ 4 /25	310	357	47,103
		FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2019/10/25	400	461	60,782
		FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2020/ 4 /25	330	382	50,378
		FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2020/10/25	230	258	34,044
		FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2020/11/25	60	60	7,998
		FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2021/ 4 /25	230	276	36,396
		FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2021/10/25	230	272	35,900
		FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2022/ 4 /25	220	259	34,162
		FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2022/10/25	140	158	20,938
		FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2023/ 5 /25	290	319	42,068
		FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2023/10/25	240	311	41,066
		FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2024/ 5 /25	170	194	25,604
		FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	180	197	26,062
		FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/ 5 /25	190	186	24,523
		FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	90	91	12,082
		FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/ 4 /25	170	215	28,387
		FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	200	238	31,461
		FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/ 5 /25	180	209	27,659
		FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/ 5 /25	40	40	5,392
		FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/ 4 /25	140	216	28,588
		FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	140	203	26,792
		FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/ 4 /25	150	237	31,254
		FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/ 5 /25	100	133	17,531
		FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/ 4 /25	80	125	16,513
		FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/ 4 /25	70	111	14,661
		FRANCE O.A.T.	5.7500	2032/10/25	160	266	35,141
		FRENCH OAT	5.5000	2029/ 4 /25	190	293	38,661
		FRENCH OAT	6.0000	2025/10/25	130	196	25,832

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	邦貨換算金額
ユーロ			%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス	国債証券	FRENCH TREASURY NOTE	1.0000	2017/ 7 /25	120	122	16,160
小 計			—	—	—	—	1,036,800
ドイツ	国債証券	BUNDES OBLIGATION	0.5000	2017/10/13	90	91	12,056
		BUNDES OBLIGATION	0.2500	2018/ 4 /13	120	121	16,049
		BUNDES OBLIGATION	1.0000	2018/10/12	90	93	12,320
		BUNDES OBLIGATION	1.0000	2019/ 2 /22	260	271	35,735
		BUNDES OBLIGATION	0.5000	2019/ 4 /12	90	92	12,186
		BUNDES OBLIGATION	0.2500	2019/10/11	90	91	12,099
		BUNDES OBLIGATION	0.0000	2020/ 4 /17	110	110	14,622
		BUNDES OBLIGATION	0.2500	2020/10/16	110	112	14,773
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.7500	2017/ 1 / 4	370	387	51,013
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2018/ 1 / 4	200	218	28,813
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2018/ 7 / 4	120	134	17,731
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5000	2019/ 7 / 4	130	147	19,488
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2020/ 1 / 4	120	137	18,096
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0000	2020/ 7 / 4	240	275	36,304
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2021/ 1 / 4	100	113	14,961
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2021/ 7 / 4	200	237	31,300
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2022/ 1 / 4	110	123	16,303
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2022/ 9 / 4	260	285	37,656
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/ 2 /15	100	110	14,506
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/ 5 /15	130	143	18,853
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2023/ 8 /15	100	114	15,021
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2024/ 2 /15	200	224	29,579
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2024/ 5 /15	100	110	14,521
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2024/ 8 /15	100	105	13,938
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/ 2 /15	120	120	15,934
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/ 8 /15	110	115	15,208
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/ 1 / 4	50	86	11,423
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/ 7 / 4	110	178	23,567
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/ 1 / 4	140	214	28,236
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/ 7 / 4	80	130	17,130
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/ 7 / 4	90	157	20,788
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/ 7 / 4	90	131	17,266
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/ 7 / 4	90	116	15,395
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/ 8 /15	80	104	13,721

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	邦貨換算金額
ユーロ			%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ	国債証券	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2017/ 6 /16	170	170	22,530
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2017/ 9 /15	210	211	27,860
		DEUTSCHE REP 5.5 01/	5.5000	2031/ 1 / 4	100	165	21,768
		DEUTSCHE REP 5.625 1	5.6250	2028/ 1 / 4	80	126	16,674
		DEUTSCHE REP 6.50 7/	6.5000	2027/ 7 / 4	80	133	17,581
		DEUTSCHLAND REP 4.75	4.7500	2028/ 7 / 4	70	104	13,762
小 計			—	—	—	—	806,788
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8000	2017/ 1 /31	230	240	31,691
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1000	2017/ 4 /30	120	123	16,291
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5000	2017/ 7 /30	110	120	15,836
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2017/10/31	120	121	15,953
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.5000	2018/ 1 /31	110	120	15,885
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.2500	2018/ 4 /30	100	100	13,209
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.1000	2018/ 7 /30	120	132	17,476
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.7500	2018/10/31	140	154	20,375
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2019/ 4 /30	130	140	18,571
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6000	2019/ 7 /30	110	127	16,753
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3000	2019/10/31	130	149	19,747
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2020/ 1 /31	120	124	16,419
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0000	2020/ 4 /30	130	149	19,722
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.1500	2020/ 7 /30	80	82	10,813
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5000	2021/ 4 /30	130	162	21,422
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.8500	2022/ 1 /31	130	168	22,163
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4000	2023/ 1 /31	100	128	16,975
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4000	2023/10/31	100	122	16,178
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8000	2024/ 1 /31	100	125	16,591
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8000	2024/ 4 /30	130	153	20,218
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	140	153	20,233
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/ 4 /30	110	109	14,474
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/ 7 /30	120	152	20,027
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	110	114	15,112
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/ 7 /30	80	111	14,703
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	70	94	12,424
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/ 7 /30	70	67	8,938
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/ 1 /31	90	112	14,862
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/ 7 /30	90	124	16,462

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	邦貨換算金額
ユーロ			%		千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/ 7 /30	70	94	12,495
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	70	101	13,429
		Spain Government Bond	4.8500	2020/10/31	130	156	20,621
		SPANISH GOVT 6.00 01	6.0000	2029/ 1 /31	130	188	24,844
		SPANISH GVOT 5.75 07	5.7500	2032/ 7 /30	100	147	19,406
小 計			—	—	—	—	590,335
イタリア	国債証券	BTPS 6.5 11/01/27	6.5000	2027/11/ 1	160	240	31,738
		BUONI POLIENNALI DEL	9.0000	2023/11/ 1	70	111	14,671
		BUONI POLIENNALI DEL	6.0000	2031/ 5 / 1	180	274	36,168
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2016/12/15	30	30	4,017
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2017/ 2 / 1	540	566	74,580
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.1500	2017/ 5 /15	100	101	13,401
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2017/ 8 / 1	40	43	5,737
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.7500	2018/ 1 /15	200	203	26,750
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2018/ 2 / 1	170	186	24,572
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.2500	2018/ 5 /15	200	200	26,445
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2018/ 8 / 1	160	178	23,558
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2018/12/ 1	130	143	18,848
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2019/ 2 / 1	280	315	41,627
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2019/ 5 / 1	100	107	14,192
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2019/ 9 / 1	240	275	36,290
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0500	2019/12/ 1	70	71	9,474
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2020/ 3 / 1	160	186	24,532
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2020/ 9 / 1	370	431	56,814
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/ 3 / 1	150	174	22,967
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/ 5 / 1	110	128	16,879
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/ 8 / 1	290	338	44,611
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2021/12/15	100	107	14,196
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2022/ 4 /15	270	277	36,564
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/ 9 / 1	160	207	27,324
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/11/ 1	120	155	20,541
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2023/ 5 / 1	120	148	19,628
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2023/ 8 / 1	140	177	23,349
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2024/ 3 / 1	160	200	26,400
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2024/ 9 / 1	110	131	17,352
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2024/12/ 1	110	120	15,851

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	邦貨換算金額
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/ 3 / 1	140	183	24,193
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2025/ 6 / 1	110	111	14,626
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/ 1	40	41	5,516
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/ 3 / 1	140	179	23,654
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/ 9 / 1	100	133	17,529
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/ 1	150	211	27,813
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/ 3 / 1	120	143	18,889
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/ 3 / 1	70	67	8,831
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/ 2 / 1	90	136	18,011
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/ 8 / 1	120	170	22,466
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/ 2 / 1	150	190	25,071
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/ 8 / 1	120	174	22,971
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/ 9 / 1	110	159	21,051
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/ 9 / 1	100	143	18,967
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/ 9 / 1	70	79	10,490
		ITALIAN GOVT	7.2500	2026/11/ 1	50	78	10,312
小計			—	—	—	—	1,059,489
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.8750	2017/ 4 /15	30	30	4,076
		FINNISH GOVERNMENT	3.8750	2017/ 9 /15	30	32	4,256
		FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2018/ 9 /15	30	31	4,110
		FINNISH GOVERNMENT	4.3750	2019/ 7 / 4	30	34	4,609
		FINNISH GOVERNMENT	3.3750	2020/ 4 /15	60	69	9,119
		FINNISH GOVERNMENT	3.5000	2021/ 4 /15	40	47	6,264
		FINNISH GOVERNMENT	1.6250	2022/ 9 /15	30	32	4,331
		FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2023/ 4 /15	30	32	4,287
		FINNISH GOVERNMENT	2.0000	2024/ 4 /15	30	33	4,441
		FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/ 7 / 4	30	39	5,184
		FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/ 9 /15	30	30	4,005
		FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/ 7 / 4	30	36	4,805
		FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/ 4 /15	20	18	2,483
		FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/ 7 / 4	20	25	3,369
小計			—	—	—	—	65,344
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.3000	2017/ 9 /15	120	130	17,142
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.1500	2018/10/19	40	41	5,494
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.3500	2019/ 3 /15	210	242	31,908
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9000	2020/ 7 /15	70	83	10,953

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	邦貨換算金額
ユーロ			%		千ユーロ	千ユーロ	千円
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5000	2021/ 9 /15	80	96	12,658
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.6500	2022/ 4 /20	60	73	9,671
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4000	2022/11/22	70	85	11,249
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.7500	2023/10/20	50	55	7,290
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.6500	2024/10/21	60	65	8,656
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2000	2025/10/20	30	31	4,131
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/ 3 /15	50	70	9,264
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/ 7 /15	40	63	8,399
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/ 5 /23	20	23	3,097
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/ 3 /15	70	105	13,839
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/ 6 /20	40	54	7,210
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/ 1 /26	20	33	4,432
小 計			—	—	—	—	165,401
ユーロ小計			—	—	—	—	4,353,523
合 計			—	—	—	—	10,811,148

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

◆投資信託財産の構成

(2015年11月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	10,811,148	98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	204,606	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	11,015,754	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122.96円、1カナダ・ドル92.42円、1オーストラリア・ドル88.42円、1シンガポール・ドル86.96円、1イギリス・ポンド187.85円、1スイス・フラン121.18円、1デンマーク・クローネ17.66円、1ノルウェー・クローネ14.27円、1スウェーデン・クローナ14.15円、1メキシコ・ペソ7.38円、1マレーシア・リンギット28.32円、1南アフリカ・ランド8.77円、1ポーランド・ズロチ30.99円、1ユーロ131.76円です。

(注2) 外貨建純資産 (10,912,374千円) の投資信託財産総額 (11,015,754千円) に対する比率は99.1%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

(2015年11月20日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	11,062,671,503円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	118,593,894
公 社 債 (評価額)	10,811,148,481
未 収 入 金	48,333,441
未 収 利 息	64,464,513
前 払 費 用	20,131,174
(B) 負 債	100,608,119
未 払 金	71,346,286
未 払 解 約 金	29,261,833
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	10,962,063,384
元 本	7,892,091,236
次 期 繰 越 損 益 金	3,069,972,148
(D) 受 益 権 総 口 数	7,892,091,236口
1万口当たり基準価額 (C/D)	13,890円

(注1) 期首元本額 6,902,711,215円
期中追加設定元本額 2,448,666,495円
期中一部解約元本額 1,459,286,474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) 586,264,857円
DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) 1,496,045,837円
DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) 578,848,876円
ニッセイ外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定) 793,992円
ニッセイ厚生年金型バランス運用 (現物型) DB (適格機関投資家限定) 3,046,373,615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 2,095,123,049円
ニッセイターゲットデートファンドI (適格機関投資家限定) 87,652円
ニッセイターゲットデートファンドII (適格機関投資家限定) 87,006円
＜購入・換金手数料なし＞ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産等型) 87,740,215円
DCニッセイ外国債券インデックス 726,137円

◆損益の状況

当期 (2015年5月21日～2015年11月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	149,579,699円
受 取 利 息	149,579,699
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 95,280,976
売 買 益	191,879,301
売 買 損	△ 287,160,277
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,028,974
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	51,269,749
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,648,459,042
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	958,820,269
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 588,576,912
(H) 合 計 (D+E+F+G)	3,069,972,148
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	3,069,972,148

(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。