

第3期末（2017年11月20日）

基準価額	11,255円
純資産総額	17億円
騰落率	13.4%
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:2016年11月22日～2017年11月20日

第3期(決算日 2017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3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。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 **0120-762-506** (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

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

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



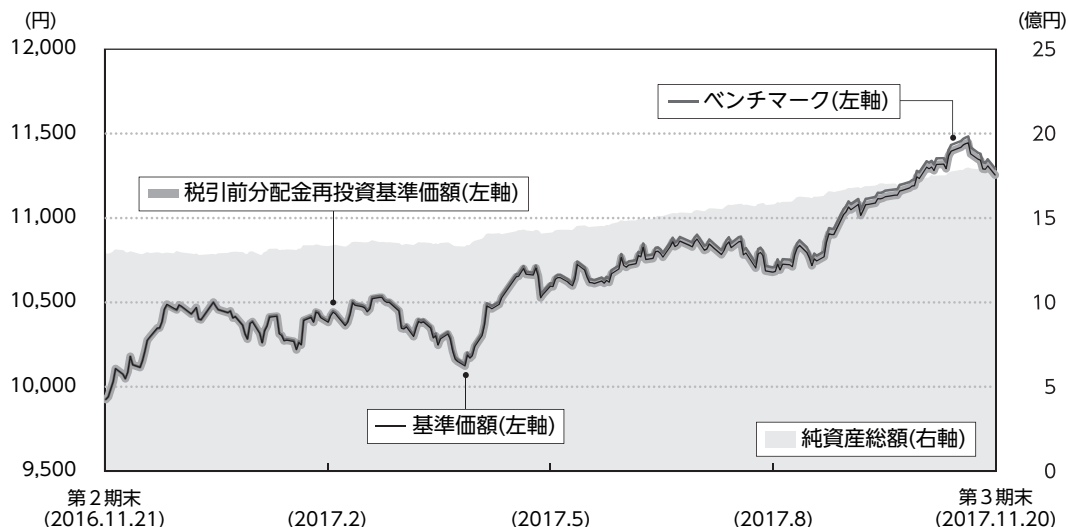
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2016年11月22日～2017年11月20日

基準価額等の推移



第3期首	9,925円	既払分配金	0円
第3期末	11,255円	騰落率（分配金再投資ベース）	13.4%

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

（注2）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

（注3）ベンチマークは、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）、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、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。TOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX（東証株価指数）の商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。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。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

当期の基準価額は、期初以降、米大統領選後のトランプ新政権に対する政策期待を背景に、株価が上昇したことや円安傾向となったことなどから上昇しました。年明け以降、トランプ政権の政策実現性への不透明感や北朝鮮問題などの地政学リスクへの警戒感を背景に、基準価額は下落しましたが、４月下旬に、フランスの欧州連合（ＥＵ）離脱リスクが低下したことや地政学リスクへの警戒感の後退などを受けて、内外の株価が上昇したことから上昇に転じました。その後は、地政学リスクが再燃する場面もありましたが、世界的に堅調な景気を背景として内外の株価がおおむね上昇したことから、基準価額は上昇基調となり、期初を上回る水準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%	25.3%	24.5%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	25.0	25.2	△ 0.2
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	25.0	24.7	23.6
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25.0	24.8	8.5

（注）組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

1 万口当たりの費用明細

項目	第 3 期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	39円	0.366%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は10,649円です。
(投信会社)	(17)	(0.164)	ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(17)	(0.164)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(4)	(0.038)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.002	
(株式)	(0)	(0.001)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.005	
(株式)	(0)	(0.005)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	0.039	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.028)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.010)	公募投資信託は、外部の監査法人等によるファンドの会計監査が義務付けられているため、当該監査にかかる監査法人等に支払う費用
(その他)	(0)	(0.002)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	44	0.412	

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

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

投資環境

■国内株式市況

期初以降、米大統領選の結果を受け、新政権の財政支出拡大や規制緩和に対する思惑、また、米連邦準備制度理事会（ＦＲＢ）の利上げ観測を背景に、米長期金利が上昇し円安が進行したことから、株価は上昇しました。2017年１月以降は、為替市場の変動を背景にもみ合い推移となりましたが、トランプ政権の政策実現性に対する不透明感が高まったことや、シリア情勢・北朝鮮問題等の地政学リスクへの警戒感が高まったことから、株価は徐々に下落しました。

４月下旬以降は、欧州の政治に対する不透明感が後退したことや、トランプ大統領が発表を予定していた税制改革案に対する期待感が高まったこと、さらに北朝鮮情勢への懸念がやや後退したことなどから、株価は上昇基調に転じました。８月に入り、北朝鮮が核弾頭の小型化に成功したとの報道を受け、再び地政学リスクが強く意識されたことなどから株価は下落しましたが、９月中旬に入ると、米朝の軍事衝突を回避できるとの見方が広がったことや、衆議院の解散総選挙をめぐる思惑などから株価は反発し、その後も堅調な企業業績に支えられ、上昇基調で推移しました。

■国内債券市況

期初の10年国債金利は0.03%でスタートし、米大統領選の結果を受け、米早期利上げ観測が高まったことなどを背景に上昇しました。その後、強力な金融緩和政策を継続する日銀の姿勢を背景に、一時低下しましたが、６月末にかけて欧州を中心に金融緩和縮小観測が高まり、海外の金利が上昇したことで国内金利にも圧力が加かったため、上昇する場面が見られました。

７月前半には、指値オペ（日銀が指定する利回りで国債を無制限に買い入れる公開市場操作）の実施や定例の中長期債買い入れ額の増額など、日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確にしたことなどから、金利は低下基調に転じ、８月の北朝鮮情勢緊迫化を受けて、さらに低下する展開となりました。しかし、９月に入り、北朝鮮情勢への警戒感が後退したことや、好調な米経済指標を背景に米利上げ継続の可能性が高まったことから金利は再び上昇し、結局、10年国債金利は0.04%と前期末から若干上昇した水準で当期末を迎えました。

■海外株式市況

当期は米国をはじめとする主な海外株式市場において、株価が上昇しました。

期初は、トランプ次期大統領（当時）の政策に対する期待を背景に、株式市場は上昇して始まりました。その後も、堅調なマクロ経済指標や企業業績、フランス大統領選等のイベントを無難に終了したことが支援材料となり株価は堅調に推移しました。北朝鮮やテロ等の地政学リスクや、米政治リスクに対する懸念で弱含む局面もありましたが、期末にかけては、原油価格の上昇や米税制改革に対する期待を背景に、上昇基調を継続しました。

■海外債券市況

米国10年国債金利は、昨年11月以降、米新政権の財政拡大に伴うインフレ期待の高まりや好調な経済指標などを受け、12月中旬に2.6%まで上昇し、その後2.3%～2.6%程度のレンジ圏で推移しました。4月以降は米政権の政策運営能力に対する懸念や地政学リスク、仏大統領選の動向などから金利は2.1%～2.4%程度のレンジ圏で推移しました。6月に入ると欧州中央銀行（ＥＣＢ）総裁やイングランド銀行（ＢＯＥ：中央銀行）総裁の発言を背景に欧州を中心に金融引き締め観測が高まり、7月上旬には2.4%近辺まで上昇しましたが、ＦＲＢの追加利上げに慎重な姿勢や、米政策運営への懸念、北朝鮮情勢の緊迫化から9月上旬には2.0%台まで低下しました。その後は、米税制改革への期待などを背景に、10月下旬に2.4%台まで上昇した後伸び悩み、2.3%台で当期末を迎えました。

ドイツ10年国債金利は、ＥＣＢの量的緩和縮小をめぐる見方の変化や仏大統領選の動向などから、6月までは0.1%～0.5%近辺で変動しました。その後、ＥＣＢ総裁の発言を背景に金融引き締め観測が高まり、7月中旬には0.6%台まで急上昇しましたが、ＥＣＢの金融緩和縮小に対する慎重姿勢や北朝鮮情勢の緊迫化、スペイン・カタルーニャ州の独立をめぐる混乱などから0.3%～0.5%程度で金利はもみ合いとなり、0.3%台で当期末を迎えました。

■為替市況

米ドル／円レートは、昨年11月以降の米金利上昇などから118円台に上昇した後、米政権への期待が徐々に後退するなかで上値が重くなり、地政学リスクや仏大統領選の動向などから4月中旬には108円台まで下落しました。その後、地政学リスクやトランプ米大統領のロシア疑惑などを材料に上下し、108～114円程度での変動となりました。6月以降は日米における金融政策の違いなどから114円台まで上昇しましたが、北朝鮮情勢緊迫化などから一時108円割れまで下落する場面も見られました。9月中旬以降は米税制改革への期待などを背景に114円台まで上昇した後、伸び悩み、112円台に下落して当期末を迎えました。

ユーロ／円レートは、昨年11月以降の欧州金利の上昇などから一時124円台まで上昇した後、もみ合いとなりました。3月中旬以降は、地政学リスクや仏大統領選の動向などから下落し、4月中旬には一時115円割れとなりましたが、これらのリスク後退とともに上昇し、ＥＣＢ総裁の発言を背景に金融引き締め観測が高まると、7月上旬には130円台をつけました。9月中旬以降は米税制改革への期待を背景に134円台に上昇した後、スペインの混乱やＥＣＢの金融緩和縮小に対する慎重姿勢がユーロの上値を重くし、132円近辺まで下落して当期末を迎えました。

ポートフォリオ

■当ファンド

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。

■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＞

東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

銘柄選択については、一部信用不安銘柄を投資ユニバースから除外した後、層化抽出法にて行いました（市場での組入比率が大きな銘柄については、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（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）。また資金の流入入などに対応するため、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）先物も一部利用しました。

＜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ツモデルを利用して、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比（短期・中期・長期・超長期別の構成比）等を調整し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

上記クオンツモデルに基づき、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比がＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合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。

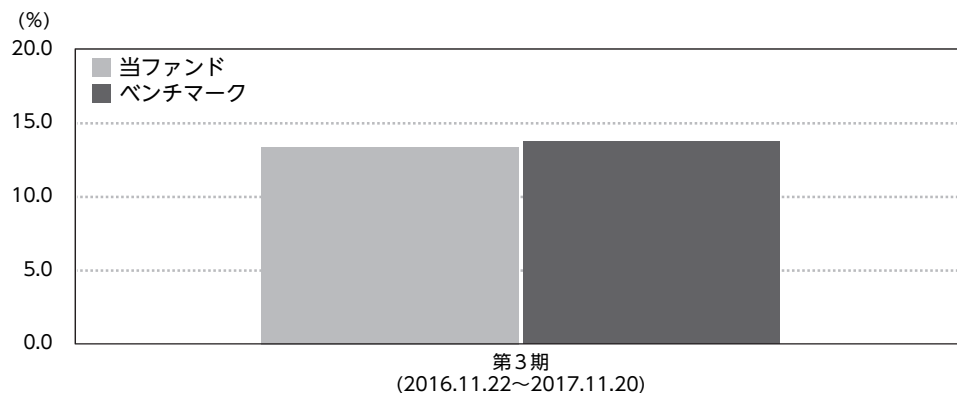
＜ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド＞

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、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。

＜ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド＞

日本を除く主要国の国債に投資することにより、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



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+13.4%となり、ベンチマーク騰落率（+13.8%）におおむね連動しました。

分配金

当期の分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。

なお、分配に充てずに信託財産に留保した収益につきましては、元本部分と同一の運用を行います。

【分配原資の内訳（１万口当たり）】

項目	当期 2016年11月22日～2017年11月20日
当期分配金(税引前)	—
対基準価額比率	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,347円

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

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

今後の運用方針

■当ファンド

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す。

■各マザーファンド

＜ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド＞

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

＜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、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

＜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、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。

＜ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド＞

日本を除く主要国の国債に投資することにより、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。

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配額)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考) 基準価額＋ 累計分配金	ベンチ マーク	期中 騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
(設定日)	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2015年8月27日	10,000	－	－	10,000	10,000	－	－	－	－	－	1
1期(2015年11月20日)	10,528	0	5.3	10,528	10,544	5.4	47.8	1.6	49.3	0.6	486
2期(2016年11月21日)	9,925	0	△ 5.7	9,925	10,029	△ 4.9	49.3	1.4	48.1	0.6	1,283
3期(2017年11月20日)	11,255	0	13.4	11,255	11,410	13.8	47.8	1.2	49.5	0.6	1,788

(注1) 設定日の基準価額は当初設定価額を記載しています。

(注2) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

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

(注4) ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、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。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX(東証株価指数)の商標または標準に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。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。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。

(注5) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

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

(注7) 設定日の純資産総額は当初設定元本を記載しています。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチ マーク	騰落率	株式 組入比率	株式 先物比率	債券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	%		%	%	%	%	%
(期首)2016年11月21日	9,925	－	10,029	－	49.3	1.4	48.1	0.6
11月末	10,086	1.6	10,191	1.6	48.4	1.2	48.8	0.6
12月末	10,397	4.8	10,505	4.7	48.0	1.0	49.9	0.6
2017年 1月末	10,313	3.9	10,427	4.0	48.6	0.9	49.2	0.6
2月末	10,381	4.6	10,497	4.7	48.0	1.2	49.7	0.6
3月末	10,385	4.6	10,506	4.8	47.7	1.7	49.4	0.6
4月末	10,462	5.4	10,588	5.6	48.7	1.3	48.6	0.6
5月末	10,598	6.8	10,726	6.9	48.3	1.1	49.5	0.6
6月末	10,754	8.4	10,891	8.6	48.2	1.2	49.2	0.6
7月末	10,783	8.6	10,922	8.9	48.3	1.0	49.7	0.6
8月末	10,821	9.0	10,965	9.3	47.6	1.7	49.3	0.6
9月末	11,080	11.6	11,231	12.0	48.1	1.2	48.1	0.6
10月末	11,293	13.8	11,448	14.1	48.1	1.4	49.4	0.6
(期末)2017年11月20日	11,255	13.4	11,410	13.8	47.8	1.2	49.5	0.6

(注) 期末基準価額は分配金(税引前)込み、騰落率は期首比です。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

2016年11月22日～2017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	159,240	256,253	135,219	215,680
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	242,805	326,852	136,734	184,097
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	164,991	252,336	145,028	218,201
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	203,465	266,611	129,275	168,573

(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	9,033,850千円	33,014,354千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	41,249,083千円	77,856,799千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.21	0.42

(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

2016年11月22日～2017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。

<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）

親投資信託残高		2017年11月20日現在	
種類	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	227,036	251,057	452,406
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	227,806	333,877	450,667
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	246,387	266,350	441,395
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	254,082	328,272	444,087

(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25,655,816千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが20,278,199千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが63,730,699千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが9,657,039千口です。

投資信託財産の構成		2017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	452,406	25.2	
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	450,667	25.1	
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	441,395	24.6	
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	444,087	24.7	
コール・ローン等、その他	9,154	0.5	
投資信託財産総額	1,797,710	100.0	

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル112.19円、1カナダ・ドル87.80円、1オーストラリア・ドル84.79円、1香港ドル14.36円、1シンガポール・ドル82.74円、1ニュージーランド・ドル76.38円、1イギリス・ポンド148.17円、1イスラエル・シェケル31.93円、1スイス・フラン113.31円、1デンマーク・クローネ17.71円、1ノルウェー・クローネ13.59円、1スウェーデン・クローナ13.30円、1メキシコ・ペソ5.93円、1マレーシア・リンギット26.98円、1南アフリカ・ランド7.99円、1ポーランド・ズロチ31.13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（103,836,680千円）の投資信託財産総額（106,065,520千円）に対する比率は97.9%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（12,927,834千円）の投資信託財産総額（13,247,276千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

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

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	1,797,710,989円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,886,076
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	452,406,272
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	450,667,335
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	441,395,616
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	444,087,280
未 収 入 金	6,268,410
(B)負債	9,210,039
未 払 解 約 金	6,213,116
未 払 信 託 報 酬	2,920,729
そ の 他 未 払 費 用	76,194
(C)純 資 産 総 額 (A－B)	1,788,500,950
元 本	1,589,089,003
次 期 繰 越 損 益 金	199,411,947
(D)受 益 権 総 口 数	1,589,089,003口
1万口当たり基準価額 (C／D)	11,255円

(注) 期首元本額 1,293,610,562円
 期中追加設定元本額 912,763,394円
 期中一部解約元本額 617,284,953円

損益の状況

当期 (2016年11月22日～2017年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	△ 643円
受 取 利 息	75
支 払 利 息	△ 718
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	157,460,764
売 買 益	184,978,073
売 買 損	△ 27,517,309
(C)信 託 報 酬 等	△ 5,493,669
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	151,966,452
(E)前 期 繰 越 損 益 金	3,817,033
(分 配 準 備 積 立 金)	(16,292,273)
(繰 越 欠 損 金)	(△ 12,475,240)
(F)追 加 信 託 差 損 益 金 *	43,628,462
(配 当 等 相 当 額)	(57,222,102)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 13,593,640)
(G)合 計 (D + E + F)	199,411,947
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	199,411,947
追 加 信 託 差 損 益 金	43,628,462
(配 当 等 相 当 額)	(58,395,842)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 14,767,380)
分 配 準 備 積 立 金	155,783,485

(注1) **(B)有価証券売買損益**は、期末の評価換えによる損益を含みます。
 (注2) **(C)信託報酬等**は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。
 (注3) **(E)前期繰越損益金**とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
 (注4) **(F)追加信託差損益金***とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	27,313,738円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	112,177,474円
(c) 信託約款に定める収益調整金	58,395,842円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	16,292,273円
(e) 分配対象額 (a + b + c + d)	214,179,327円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	1,347.81円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

お知らせ

■運用体制の変更について

新たに統括部長（運用部門）を任命し、チーフ・インベストメント・オフィサー（ＣＩＯ）を１名から２名体制にしました。あわせて、役職名称をＣｏ－ＣＩＯに変更しました。

（2017年３月25日）

■自社による当ファンドの設定解約状況

前期末 残高(元本)	当期 設定元本	当期 解約元本	当期末残高			取引の理由
			元本	評価額	比率	
百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	%	
1	－	1	－	－	－	当初設定時における取得分の処分

（注）元本の単位未満は切り捨てています。

■約款変更

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

（2017年８月18日）

■関連会社の実質保有比率

2017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19.4%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

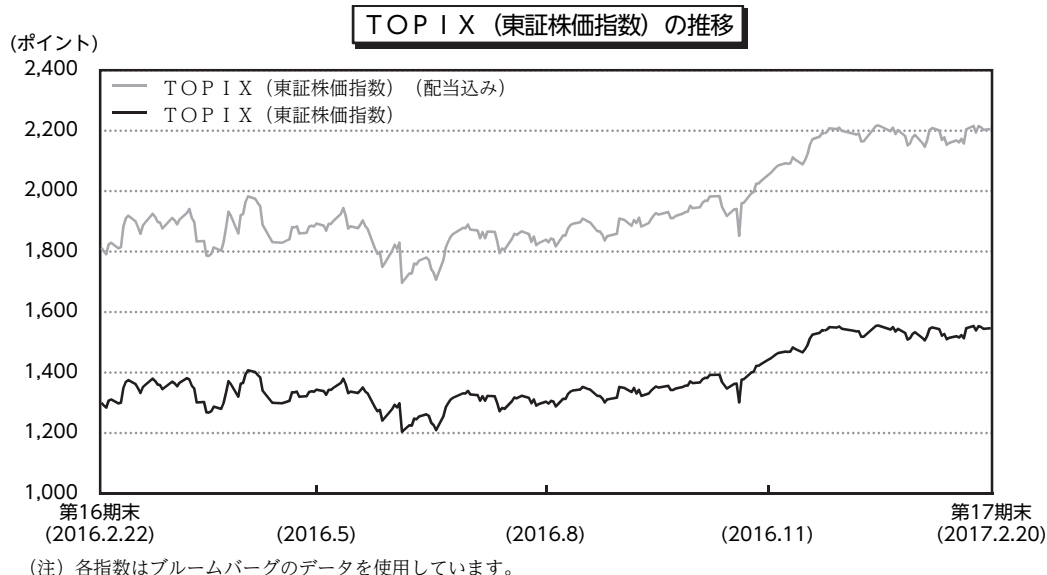
当ファンドの概要

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型	
信 託 期 間	無制限	
運 用 方 針	下記マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行います。	
主要運用対象	<購入・換金手数料なし> ニッセイ・インデックス バランスファンド(4資産均等型)	「ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド」「ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド」受益証券
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	国内の金融商品取引所上場株式等
	ニッセイ国内債券 インデックスマザーファンド	国内の公社債
	ニッセイ外国株式 インデックスマザーファンド	日本を除く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	日本を除く主要国の国債
運用方法	<購入・換金手数料なし> ニッセイ・インデックス バランスファンド(4資産均等型)	各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、それぞれ25%ずつとします。
	ニッセイ国内株式 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
	ニッセイ国内債券 インデックスマザーファンド	以下の様な投資制限のもと運用を行います。 ・投資対象資産は、国内の通貨建またはユーロ円建表示であるものに限りです。
	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。	

運用経過

2016年2月23日～2017年2月20日

国内株式市況



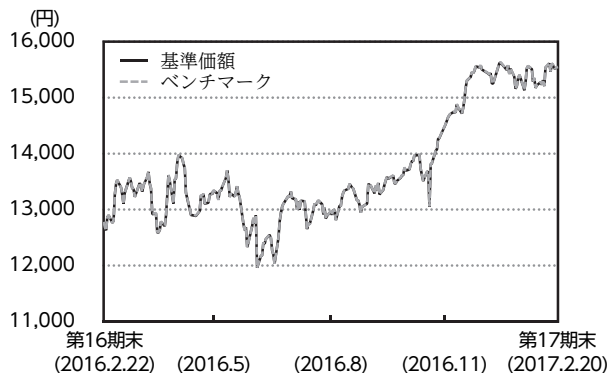
当期の国内株式市場は、期を通じて見ると上昇しました。

期初以降、投資家のリスク回避姿勢や、4月末に決定された日銀の追加緩和見送りなどを背景に株価は値動きの荒い展開となりましたが、その後は、徐々に落ち着きを取り戻しました。6月には、Brexitに関する国民投票結果を受けて円高が進行したことから株価は下落しましたが、その後は、主要中央銀行の市場安定化策や緩和姿勢が好感されて持ち直し、10月には、米国の年内利上げ観測を背景に円安となったことや、原油高等による影響から上昇しました。

11月には、米大統領選の結果を受けて株価は一時急落しましたが、米株式市場が上昇したことに加え、トランプ次期大統領の財政支出拡大や規制緩和に対する思惑、米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げ観測を受けて米長期金利が上昇し円安が進行したことから急反発しました。その後も、米国の利上げペースが加速するとの見方から上昇が続き、年明け以降は、為替市場の変動等を背景にもみ合う展開となりましたが、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初以降、投資家のリスク回避姿勢や為替市場の動向を背景に、株価が値動きの荒い展開となったことから一進一退の動きとなりました。6月には、Brexit（イギリスの欧州連合（EU）離脱）に関する国民投票結果を受けて円高が進行したことにより、株価が急落し基準価額は下落しましたが、その後は、主要中央銀行の市場安定化策や緩和姿勢が好感されて持ち直し、11月の米大統領選後には、

米国の早期利上げ観測等を背景に株価が上昇したことから基準価額も上昇しました。年明け以降は、為替市場の変動等を背景に株価がもみ合う展開となったことから基準価額も同様の推移となりましたが、期初を大きく上回る水準で当期末を迎えました。

（注）ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）（配当込み）としており、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおTOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、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1,700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（市場での組入比率が大きな銘柄については、ベンチマークとの連動性を高めるために、信用不安銘柄であっても組み入れを行いました）。

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+21.6%となり、ベンチマーク騰落率（+21.7%）に連動しました。

今後の運用方針

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

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

◆最近5期の運用実績

決 算 期	基準価額	期 中 騰落率	ベンチマーク	期 中 騰落率	株 式 組入比率	株 式 先物比率	純資産 総 額
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2016年2月22日)	12,782	△11.7	12,904	△11.7	98.3	1.7	34,137
17期(2017年2月20日)	15,544	21.6	15,699	21.7	97.7	2.3	40,998

(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	%		%	%	%
2016年 2月22日	12,782	—	12,904	—	98.3	1.7
2 月末	12,763	△ 0.1	12,886	△ 0.1	97.8	2.1
3 月末	13,373	4.6	13,508	4.7	93.8	2.5
4 月末	13,304	4.1	13,442	4.2	97.7	2.3
5 月末	13,701	7.2	13,836	7.2	97.2	2.8
6 月末	12,390	△ 3.1	12,510	△ 3.1	97.4	3.7
7 月末	13,157	2.9	13,283	2.9	98.4	1.6
8 月末	13,229	3.5	13,356	3.5	98.2	1.8
9 月末	13,269	3.8	13,402	3.9	97.9	2.2
10月末	13,973	9.3	14,114	9.4	97.5	2.7
11月末	14,743	15.3	14,889	15.4	97.8	1.9
12月末	15,254	19.3	15,406	19.4	99.2	0.9
2017年 1 月末	15,286	19.6	15,439	19.6	98.1	1.7
(期 末)						
2017年 2月20日	15,544	21.6	15,699	21.7	97.7	2.3

(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

◆ 1 万口当たりの費用明細

(2016年2月23日～2017年2月20日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.002% (0.000) (0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 ・信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	0	0.002	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は、「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（13,729円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

◆ 売買および取引の状況

(2016年2月23日～2017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 3,526 (△2,072)	千円 3,801,023	千株 3,608	千円 3,950,574

(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 7,842	百万円 7,603	百万円 －	百万円 －

(注) 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

◆主要な売買銘柄

(2016年2月23日～2017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	18	103,889	5,526	ソフトバンクグループ	27	176,408	6,533
日本電信電話	17	83,967	4,798	トヨタ自動車	25	161,389	6,327
三菱UFJフィナンシャル・グループ	117	55,401	471	三菱UFJフィナンシャル・グループ	171	97,945	570
ソフトバンクグループ	8	50,192	6,047	日本たばこ産業	15	64,702	4,174
東日本旅客鉄道	4	45,106	9,397	日産自動車	52	55,171	1,044
日本たばこ産業	10	42,375	4,195	みずほフィナンシャルグループ	299	53,763	179
九州旅客鉄道	13	40,581	3,006	アステラス製薬	31	50,371	1,584
本田技研工業	14	40,145	2,787	日本電信電話	10	48,644	4,864
みずほフィナンシャルグループ	252	39,770	157	武田薬品工業	9	45,117	4,851
三井住友フィナンシャルグループ	12	39,747	3,129	東京エレクトロン	5	43,407	8,511

(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。

◆組入有効証券明細表

(2017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	0.800	2,280
日本水産	22	25	14,499
マルハニチロ	4	3	12,483
カネコ種苗	—	0.800	1,148
サカタのタネ	2	2	9,236
ホクト	2	2	4,272
鉱業(0.3%)			
住石ホールディングス	6	2	287
日鉄鉱業	5	0.600	3,618
三井松島産業	13	1	1,812
国際石油開発帝石	103	104	117,218
日本海洋掘削	0.600	0.700	1,689
石油資源開発	3	3	8,656
K&Qエナジーグループ	1	1	2,295

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
建設業(2.9%)			
ショーボンドホールディングス	2	2	10,500
ミライト・ホールディングス	6	6	6,528
サンヨーホームズ	—	1	1,261
ダイセキ環境ソリューション	—	0.800	1,272
安藤・間	13	14	12,155
東急建設	6	7	5,928
コムシスホールディングス	8	7	15,795
ミサワホーム	2	2	2,529
高松コンストラクショングループ	1	1	3,972
東建コーポレーション	0.800	0.800	6,416
ヤマウラ	—	2	1,276
大成建設	102	101	81,406
大林組	58	59	63,580
清水建設	60	61	63,562

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
飛鳥建設	14	19	3,360
長谷工コーポレーション	22	23	29,881
松井建設	2	2	2,336
銭高組	3	3	1,284
鹿島建設	92	87	64,467
不動テトラ	13	16	3,268
鉄建建設	12	12	4,044
西松建設	23	23	13,455
三井住友建設	75	76	9,384
大豊建設	8	7	3,682
前田建設工業	12	12	12,024
佐田建設	2	2	1,184
ナカノフドー建設	1	—	—
奥村組	19	16	11,296
東鉄工業	2	2	7,548
イチケン	3	—	—
浅沼組	6	7	2,513
戸田建設	23	23	15,364
熊谷組	29	31	9,889
青木あすなろ建設	1	1	1,230
北野建設	4	4	1,280
植木組	4	5	1,315
三井ホーム	3	3	1,728
矢作建設工業	2	2	2,837
ピーエス三菱	2	3	1,292
日本ハウスホールディングス	4	4	2,119
大東建託	7	7	115,157
新日本建設	2	2	2,229
N I P P O	5	5	10,880
東亜道路工業	4	4	1,380
前田道路	6	6	12,072
日本道路	6	6	2,886
東亜建設工業	17	1	3,126
若築建設	11	11	1,672
東洋建設	6	5	2,416
五洋建設	21	22	11,403
大林道路	2	2	1,440
世紀東急工業	3	2	1,496
福田組	3	3	3,132
住友林業	13	13	22,015
日本基礎技術	2	3	1,270
日成ビルド工業	5	6	3,306
ヤマダ・エスバイエルホーム	15	—	—
巴コーポレーション	—	3	1,217

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
パナホーム	7	7	7,399
大和ハウス工業	57	58	182,809
ライト工業	3	3	4,392
積水ハウス	65	62	112,554
日特建設	2	2	1,149
北陸電気工事	1	1	1,150
ユアテック	3	3	2,412
西部電気工業	—	0.500	1,147
四電工	—	3	1,275
中電工	2	2	5,917
関電工	8	8	7,400
きんでん	11	13	19,602
東京エネシス	2	2	1,902
トーエネック	3	3	1,677
住友電設	1	1	1,789
日本電設工業	3	3	6,371
協和エクシオ	7	7	12,417
新日本空調	1	1	2,062
ND S	3	0.400	1,168
九電工	4	3	11,497
三機工業	4	4	4,408
日揮	20	18	38,185
中外炉工業	6	6	1,440
太平電業	3	3	3,156
高砂熱学工業	5	5	9,069
朝日工業社	2	0.500	1,517
明星工業	3	3	2,206
大気社	2	2	7,516
ダイダシ	3	3	2,883
日比谷総合設備	2	2	3,786
東芝プラントシステム	3	3	5,155
OS J Bホールディングス	3	6	1,531
東洋エンジニアリング	10	12	3,240
千代田化工建設	14	14	10,080
新興プランテック	4	4	3,817
食料品(4.4%)			
日本製粉	13	5	10,000
日清製粉グループ本社	21	21	36,733
昭和産業	8	8	4,872
鳥越製粉	1	1	1,294
中部飼料	1	2	2,538
フィード・ワン	11	12	2,160
東洋精糖	10	—	—
日本甜菜製糖	10	1	2,461

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
三井製糖	8	1	3,721
塩水港精糖	4	4	1,228
日新製糖	0.300	0.800	1,468
森永製菓	18	3	18,369
中村屋	5	0.500	2,565
江崎グリコ	4	5	26,500
名糖産業	0.900	—	—
不二家	11	11	2,453
山崎製パン	14	14	32,470
モロゾフ	3	3	1,524
亀田製菓	1	1	5,461
寿スビリッツ	0.500	1	3,631
カルビー	7	8	30,375
森永乳業	18	18	13,320
六甲バター	0.900	0.900	2,205
ヤクルト本社	10	10	67,089
明治ホールディングス	11	11	102,306
雪印メグミルク	4	4	12,672
プリマハム	12	13	5,837
日本ハム	14	14	42,910
伊藤ハム	9	—	—
林兼産業	11	1	1,227
丸大食品	10	10	4,970
米久	0.600	—	—
S F o o d s	1	1	3,564
伊藤ハム米久ホールディングス	—	11	12,581
サッポロホールディングス	30	6	18,531
アサヒグループホールディングス	36	37	153,303
キリンホールディングス	79	85	163,558
宝ホールディングス	14	14	15,969
オエノンホールディングス	5	5	1,325
養命酒製造	0.600	0.600	1,122
コカ・コーラウエスト	6	6	21,205
コカ・コーライーストジャパン	6	7	18,148
サントリー食品インターナショナル	13	13	63,240
ダイドーグループホールディングス	1	0.900	5,076
伊藤園	5	5	21,859
キーコーヒー	1	1	3,954
ユニカフェ	0.600	1	1,268
日清オイリオグループ	10	11	6,380
不二製油グループ本社	5	5	12,820
Jーオイルミルズ	8	0.900	3,690
キッコーマン	15	14	47,530
味の素	42	41	95,099

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
キュービー	10	10	29,714
ハウス食品グループ本社	6	7	17,700
カゴメ	7	7	20,433
焼津水産化学工業	1	—	—
アリアケジャパン	1	1	9,984
ピエトロ	—	0.700	1,158
エバラ食品工業	0.500	0.600	1,259
ニチレイ	21	9	25,137
東洋水産	9	9	39,004
日清食品ホールディングス	8	7	47,892
永谷園ホールディングス	2	2	2,850
一正蒲鉾	1	1	1,300
フジッコ	1	1	4,655
ロック・フィールド	1	2	3,549
日本たばこ産業	115	110	416,272
ケンコーマヨネーズ	0.600	0.700	1,897
わらべや日洋ホールディングス	1	1	3,063
なとり	1	1	1,865
ユウグレナ	6	6	7,936
ミヨシ油脂	8	8	1,136
理研ビタミン	0.600	0.600	2,604
繊維製品(0.7%)			
片倉工業	2	2	3,475
グンゼ	15	14	5,908
東洋紡	72	74	14,578
ユニチカ	53	51	4,590
富士紡ホールディングス	9	0.900	3,028
倉敷紡績	19	19	4,503
シキボウ	11	10	1,530
日本毛織	6	5	4,706
ダイドーリミテッド	2	—	—
帝国繊維	1	1	3,228
帝人	75	15	32,816
東レ	133	135	131,287
住江織物	5	5	1,455
日本フェルト	2	2	1,257
イチカワ	—	4	1,204
アツギ	14	15	1,905
セーレン	4	4	7,263
ソトー	—	1	1,282
東海染工	3	9	1,323
小松精練	2	2	1,911
ワコールホールディングス	11	11	15,620
ホギメディカル	1	1	8,124

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
レナウン	9	10	1,219
T S Iホールディングス	8	7	6,360
三陽商会	10	10	1,720
オンワードホールディングス	12	12	10,296
ゴールドウイン	0.800	0.800	4,600
デサント	4	4	5,237
キング	2	2	1,037
ヤマトインターナショナル	2	3	1,239
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	11	1	4,625
王子ホールディングス	75	73	37,960
日本製紙	9	8	16,442
三菱製紙	28	2	1,976
北越紀州製紙	11	10	7,810
中越パルプ工業	8	7	1,694
大王製紙	8	7	9,583
阿波製紙	—	1	848
レンゴー	16	17	11,652
トーモク	6	6	2,010
ザ・パックス	1	1	3,997
化学(6.7%)			
クラレ	28	31	53,742
旭化成	114	116	127,020
共和レザー	1	1	1,296
昭和電工	122	12	24,576
住友化学	135	137	87,406
日本化成	9	—	—
住友精化	4	0.800	3,780
日産化学工業	11	10	39,933
ラサ工業	10	9	1,323
クレハ	14	1	6,804
テイカ	3	3	2,175
石原産業	33	3	3,696
日本曹達	12	11	7,370
東ソー	49	54	54,216
トクヤマ	30	29	16,617
セントラル硝子	20	19	10,393
東亜合成	11	11	14,755
大阪ソーダ	8	8	3,960
関東電化工業	4	4	4,636
デンカ	38	39	23,790
信越化学工業	32	33	329,491
日本カーバイド工業	8	8	1,296
堺化学工業	7	7	2,877

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
エア・ウォーター	15	15	33,078
大陽日酸	14	14	20,391
日本化学工業	7	7	1,687
日本パーカライジング	9	9	13,376
高圧ガス工業	3	2	2,142
四国化成工業	3	3	3,555
戸田工業	4	4	1,140
ステラ ケミファ	0.900	0.900	3,087
保土谷化学工業	6	0.600	2,190
日本触媒	2	2	21,663
大日精化工業	7	8	5,792
カネカ	25	25	22,500
三菱瓦斯化学	31	17	40,222
三井化学	78	85	47,005
J S R	17	18	37,755
東京応化工業	3	3	13,247
大阪有機化学工業	—	1	1,263
三菱ケミカルホールディングス	122	125	107,670
K Hネオケム	—	2	3,082
日本合成化学工業	4	—	—
ダイセル	25	25	35,165
住友ベークライト	17	16	10,640
積水化学工業	41	42	79,125
日本ゼオン	16	16	20,768
アイカ工業	5	6	17,388
宇部興産	98	94	26,790
積水樹脂	2	2	5,457
タキロン	4	4	2,176
旭有機材	6	6	1,452
日立化成	9	10	33,217
ニチバン	2	2	1,860
リケンテクノス	3	4	2,188
大倉工業	4	4	2,256
積水化成品工業	5	2	2,158
群栄化学工業	5	0.400	1,514
タイガースポリマー	—	1	1,203
ミライアル	1	1	1,128
ダイキアクシス	—	1	1,476
ダイキョーニシカワ	2	3	4,798
日本化薬	12	12	18,972
カーリットホールディングス	2	2	1,306
日本精化	1	1	1,420
扶桑化学工業	1	1	4,082
A D E K A	9	8	12,496

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
日油	14	15	18,960
新日本理化	6	7	1,147
ハリマ化成グループ	1	1	1,259
花王	49	47	270,887
第一工業製薬	4	4	1,816
三洋化成工業	6	1	5,652
大日本塗料	10	11	2,563
日本ペイントホールディングス	14	14	51,768
関西ペイント	20	19	42,900
中国塗料	5	5	4,526
日本特殊塗料	1	1	2,278
藤倉化成	2	2	1,705
太陽ホールディングス	1	1	7,162
D I C	73	7	28,835
サカタインクス	3	3	6,133
東洋インキSCホールディングス	18	18	9,990
T & K T O K A	1	1	1,406
富士フイルムホールディングス	41	36	160,884
資生堂	34	35	101,416
ライオン	21	23	43,102
高砂香料工業	1	1	4,326
マンダム	1	1	9,880
ミルボン	1	1	5,290
ファンケル	4	4	6,456
コーセー	3	3	27,570
シーズ・ホールディングス	2	2	7,476
シーボン	0.400	0.200	511
ポーラ・オルビスホールディングス	1	1	20,748
ノエビアホールディングス	1	1	5,136
アジュバンコスメジャパン	1	1	1,266
エステー	1	1	2,251
アグロ カネショウ	0.900	1	1,310
コニシ	1	2	3,944
長谷川香料	2	2	4,696
星光PMC	1	1	1,132
小林製薬	2	5	27,092
荒川化学工業	1	1	3,267
メック	1	1	1,733
日本高純度化学	0.500	0.500	1,240
タカラバイオ	—	4	6,176
J C U	0.500	0.600	4,500
デクセリアルズ	4	4	6,311
アース製薬	1	1	6,643
イハラケミカル工業	2	2	2,743

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
北興化学工業	3	—	—
大成ラミック	0.500	0.500	1,572
クミアイ化学工業	3	3	2,557
日本農薬	4	4	2,940
アキレス	15	1	2,739
有沢製作所	2	3	2,445
日東電工	14	13	127,675
レック	0.800	0.600	2,721
きもと	5	5	1,245
藤森工業	1	1	4,228
前澤化成工業	1	1	1,450
J S P	1	0.900	2,325
エフピコ	1	1	8,240
天馬	1	1	2,574
信越ポリマー	3	3	3,006
東リ	5	4	1,817
ニフコ	3	3	18,843
日本バルカー工業	7	1	2,580
ユニ・チャーム	37	37	92,157
医薬品(4.7%)			
協和発酵キリン	21	22	36,549
武田薬品工業	72	69	365,367
アステラス製薬	204	190	287,470
大日本住友製薬	12	13	25,964
塩野義製薬	26	25	138,348
田辺三菱製薬	21	21	49,801
わかもと製薬	4	—	—
あすか製薬	2	2	3,440
日本新薬	4	4	26,273
ビオフェルミン製薬	0.300	0.400	1,234
中外製薬	18	18	71,040
科研製薬	3	3	20,615
エーザイ	22	22	140,010
ロート製薬	9	9	19,965
小野薬品工業	8	42	106,470
久光製薬	5	5	31,876
持田製薬	1	1	10,959
参天製薬	33	34	55,668
扶桑薬品工業	6	0.600	1,721
日本ケミファ	3	0.300	1,662
ツムラ	5	6	21,018
日医工	4	4	7,413
キッセイ薬品工業	3	3	9,451
生化学工業	3	3	5,871

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
栄研化学	1	1	4,864
日水製薬	—	0.300	410
鳥居薬品	1	1	3,781
J C R ファーマ	1	1	3,998
東和薬品	0.800	0.900	4,734
富士製薬工業	0.500	0.600	1,851
沢井製薬	3	3	19,616
ゼリア新薬工業	3	3	6,482
第一三共	61	54	140,223
キョーリン製薬ホールディングス	4	4	10,615
大幸薬品	0.900	0.900	1,617
ダイト	0.800	1	2,275
大塚ホールディングス	39	40	206,200
大正製薬ホールディングス	4	4	36,920
ペプチドリーム	2	3	17,056
石油・石炭製品(0.5%)			
日本コークス工業	14	15	1,560
昭和シェル石油	18	16	18,102
ニチレキ	2	2	2,104
東燃ゼネラル石油	28	30	39,510
ユシロ化学工業	1	1	1,452
ピーピー・カストロール	0.800	0.900	1,485
富士石油	4	4	1,694
MORE S C O	0.300	0.700	1,226
出光興産	9	8	31,284
J Xホールディングス	216	206	108,825
コスモエネルギーホールディングス	5	5	10,824
ゴム製品(1.0%)			
横浜ゴム	11	11	24,595
東洋ゴム工業	8	9	16,728
ブリヂストン	61	62	285,677
住友ゴム工業	17	17	31,511
藤倉ゴム工業	2	—	—
オカモト	6	6	6,174
フコク	0.300	0.800	751
ニッタ	2	1	5,083
住友理工	3	3	3,940
三ツ星ベルト	4	5	5,025
バンドー化学	7	3	3,610
ガラス・土石製品(1.0%)			
日東紡績	12	15	7,590
旭硝子	97	92	84,456
日本板硝子	89	8	7,267
日本山村硝子	7	8	1,632

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
日本電気硝子	38	38	26,790
住友大阪セメント	36	35	16,135
太平洋セメント	114	112	45,808
日本ヒューム	1	1	1,278
日本コンクリート工業	4	4	1,440
三谷セキサン	0.900	0.900	2,297
アジアパイルホールディングス	2	2	1,331
東海カーボン	16	17	8,143
日本カーボン	9	9	2,691
東洋炭素	1	1	1,953
ノリタケカンパニーリミテド	10	1	2,925
T O T O	13	13	57,814
日本碍子	23	23	57,692
日本特殊陶業	15	16	41,344
M A R U W A	0.700	0.700	2,600
品川リフラクトリーズ	5	5	1,510
黒崎播磨	4	4	1,856
東京窯業	6	6	1,337
ニッカトー	2	3	1,275
フジミインコーポレーテッド	1	1	4,142
エーアンドエーマテリアル	14	—	—
ニチアス	9	10	10,990
ニチハ	2	2	7,887
鉄鋼(1.4%)			
新日鐵住金	82	83	236,430
神戸製鋼所	336	32	36,675
中山製鋼所	21	2	1,640
合同製鐵	10	1	1,885
ジェイ エフ イー ホールディングス	50	50	108,813
日新製鋼	8	8	13,370
東京製鐵	10	9	9,804
共英製鋼	1	2	4,292
大和工業	4	3	12,284
東京鐵鋼	4	4	1,896
大阪製鐵	1	1	2,632
淀川製鋼所	2	2	8,736
東洋鋼鈑	4	4	2,037
丸一鋼管	6	6	22,289
モリ工業	—	0.600	1,391
大同特殊鋼	31	31	17,670
日本冶金工業	13	15	3,572
山陽特殊製鋼	11	11	6,754
愛知製鋼	11	1	5,357
日立金属	20	18	31,695

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
日本金属	10	1	1,306
大太平洋金属	13	12	5,004
新日本電工	10	10	3,538
栗本鐵工所	9	0.900	2,145
日本鑄鉄管	7	—	—
三菱製鋼	13	13	3,393
日亜鋼業	3	4	1,311
日本精線	2	2	1,222
シンニッタン	0.600	0.200	142
新家工業	7	8	1,432
非鉄金属(1.0%)			
大紀アルミニウム工業所	4	3	1,593
日本軽金属ホールディングス	41	42	12,040
三井金属鉱業	47	51	19,431
東邦亜鉛	10	10	6,350
三菱マテリアル	114	11	44,544
住友金属鉱山	50	48	77,688
DOWAホールディングス	24	21	19,824
古河機械金属	29	29	6,902
大阪チタニウムテクノロジーズ	1	2	4,128
東邦チタニウム	3	3	3,081
UACJ	26	24	7,704
古河電気工業	57	6	25,451
住友電気工業	73	70	131,788
フジクラ	25	24	20,898
昭和電線ホールディングス	22	22	2,002
東京特殊電線	1	—	—
タツタ電線	3	3	1,613
カナレ電気	0.600	0.600	1,354
平河ヒューテック	—	1	1,119
リョービ	11	11	5,621
アーレスティ	2	2	2,596
アサヒホールディングス	2	2	5,544
金属製品(0.7%)			
稲葉製作所	1	1	1,331
トーカロ	1	1	3,266
SUMCO	14	19	34,473
川田テクノロジーズ	0.300	0.400	3,132
東洋製罐グループホールディングス	13	13	27,324
ホッカンホールディングス	5	5	2,725
コロナ	1	1	1,280
横河ブリッジホールディングス	3	3	4,633
駒井ハルテック	4	—	—
高田機工	5	5	1,215

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
三和ホールディングス	18	18	20,072
文化シャッター	5	5	4,477
三協立山	2	2	4,240
アルインコ	1	1	1,365
LIXILグループ	25	25	71,743
日本フィルコン	2	2	1,229
ノーリツ	3	3	7,837
長府製作所	2	2	5,448
リンナイ	3	3	27,936
ダイニチ工業	0.900	1	1,244
日東精工	3	2	1,241
岡部	3	3	3,884
ジーテクト	1	1	4,086
東プレ	3	3	10,519
高周波熱錬	3	3	3,213
東京製鋼	12	1	2,364
サンコール	2	2	1,218
モリテックスチール	4	4	1,260
パイオラックス	0.900	0.900	7,011
日本発条	17	17	22,575
中央発條	4	—	—
アドバネクス	—	0.700	1,329
三益半導体工業	1	1	2,464
機械(5.1%)			
日本ドライケミカル	0.500	0.500	1,155
日本製鋼所	30	6	12,358
三浦工業	8	7	13,125
タクマ	7	6	6,132
ツガミ	5	5	3,460
オークマ	12	12	14,580
東芝機械	10	11	5,401
アマダホールディングス	26	25	31,600
アイダエンジニアリング	4	5	5,368
滝澤鉄工所	8	8	1,496
富士機械製造	6	5	8,738
牧野フライス製作所	9	9	9,594
オーエスジー	8	8	20,374
ダイジェット工業	8	7	1,281
旭ダイヤモンド工業	5	5	4,918
DMG森精機	10	11	18,887
ソディック	3	4	5,099
ディスコ	2	2	37,576
日東工器	1	1	2,803
豊和工業	1	2	1,334

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
〇 K K	9	10	1,260
石川製作所	14	1	1,375
東洋機械金属	—	2	1,489
津田駒工業	10	8	1,424
島精機製作所	2	2	9,204
N C ホールディングス	—	1	1,218
フリーュー	—	0.400	1,864
日阪製作所	2	2	2,302
やまびこ	3	3	4,930
ベガサスミシン製造	2	1	1,522
ナプテスコ	9	9	31,185
三井海洋開発	2	1	4,636
レオン自動車	1	1	1,737
S M C	5	5	177,520
新川	2	1	1,231
ホソカワミクロン	3	3	2,466
ユニオンツール	0.800	0.800	2,876
オイレス工業	2	2	4,941
日精エー・エス・ピー機械	0.700	0.600	1,442
サトーホールディングス	2	2	5,747
日本エアーテック	1	1	1,242
日精樹脂工業	1	1	1,687
小松製作所	89	85	240,325
住友重機械工業	53	54	44,442
日立建機	8	8	22,102
日工	3	—	—
巴工業	0.700	0.800	1,501
井関農機	19	19	4,902
T O W A	1	1	3,120
丸山製作所	6	7	1,365
北川鉄工所	8	0.900	2,214
ローツェ	—	0.700	1,774
クボタ	87	89	165,205
荏原実業	0.800	0.900	1,233
三菱化工機	6	6	1,344
月島機械	3	3	4,536
帝国電機製作所	1	1	1,465
新東工業	4	4	4,355
澁谷工業	1	1	4,660
アイチコーポレーション	2	2	2,303
小森コーポレーション	4	4	6,849
鶴見製作所	1	1	2,156
住友精密工業	3	3	1,104
荏原製作所	40	8	27,593

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
石井鐵工所	7	0.200	357
西島製作所	1	1	2,061
北越工業	2	2	1,950
ダイキン工業	25	24	259,424
オルガノ	3	4	1,992
トーヨーカネツ	10	9	2,862
栗田工業	11	10	28,717
椿本チエイン	10	11	10,857
アネスト岩田	2	3	3,500
ダイフク	9	8	24,083
加藤製作所	4	1	3,065
タダノ	8	9	13,578
フジテック	5	5	6,812
C K D	4	5	7,928
キトー	2	2	2,752
平和	5	5	16,153
理想科学工業	1	1	3,819
S A N K Y O	4	4	19,428
日本金銭機械	1	1	2,406
マースエンジニアリング	1	1	2,297
福島工業	1	1	4,086
オーイズミ	2	—	—
ダイコク電機	0.800	0.700	1,306
竹内製作所	2	3	7,443
アマノ	5	5	12,529
J U K I	2	2	3,592
サンデンホールディングス	11	11	4,257
蛇の目ミシン工業	1	1	1,353
マックス	3	3	4,581
グローリー	6	5	21,717
新晃工業	1	1	1,753
大和冷機工業	2	2	2,975
セガサミーホールディングス	18	17	29,532
日本ピストンリング	0.700	0.700	1,652
リケン	8	0.800	3,428
T P R	2	2	7,320
ツバキ・ナカシマ	1	2	3,888
ホシザキ	3	3	33,969
大豊工業	1	1	2,156
日本精工	35	36	58,984
N T N	43	41	22,386
ジェイテクト	18	18	35,645
不二越	16	18	11,052
日本トムソン	6	5	3,192

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
THK	11	12	37,275
ユーシン精機	0.700	0.800	2,339
前澤給装工業	0.700	0.800	1,223
イーグル工業	2	1	3,057
日本ピラー工業	1	1	2,824
キッツ	8	8	6,324
日立工機	4	4	4,161
マキタ	11	11	89,784
日立造船	13	14	9,094
三菱重工業	311	298	132,639
I H I	134	136	46,104
スター精密	3	3	5,180
電気機器(12.6%)			
日清紡ホールディングス	9	9	11,444
イビデン	10	12	23,795
コニカミノルタ	43	41	45,968
ブラザー工業	22	23	47,242
ミネベアミツミ	28	32	45,434
日立製作所	445	426	266,974
東芝	368	397	73,961
三菱電機	186	189	318,549
富士電機	53	54	33,966
東洋電機製造	3	0.800	1,387
安川電機	21	20	44,187
シンフォニア テクノロジー	11	11	3,366
明電舎	16	16	6,096
オリジン電気	4	4	1,268
山洋電気	5	5	4,420
デンヨー	1	1	2,856
東芝テック	12	11	6,611
芝浦メカトロニクス	5	5	1,410
マブチモーター	5	5	31,150
日本電産	21	23	245,870
東光高岳	1	0.900	1,977
ダブル・スコープ	0.500	1	3,131
ダイヘン	10	10	7,210
田淵電機	2	3	1,107
ヤーマン	—	0.200	1,232
JVCケンウッド	12	13	3,952
ミマキエンジニアリング	1	—	—
第一精工	0.700	—	—
日新電機	4	3	4,942
大崎電気工業	3	4	4,364
オムロン	20	18	91,759

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
日東工業	2	2	4,121
I D E C	2	2	2,730
ジーエス・ユアサ コーポレーション	34	34	17,034
サクサホールディングス	5	5	1,155
メルコホールディングス	1	1	3,355
テクノメディカ	0.400	—	—
日本電気	240	244	67,344
富士通	168	171	112,825
沖電気工業	76	7	12,258
岩崎通信機	14	14	1,274
電気興業	5	5	2,810
サンケン電気	10	10	5,140
ナカヨ	—	3	1,260
アイホン	1	1	1,858
ルネサスエレクトロニクス	9	9	9,374
セイコーエプソン	26	26	67,584
ワコム	13	13	5,644
アルバック	3	3	16,863
アクセル	1	—	—
E I Z O	1	1	5,877
ジャパンディスプレイ	32	33	9,362
日本信号	4	4	5,208
京三製作所	4	4	1,636
能美防災	2	2	2,984
ホーチキ	1	1	1,840
エレコム	1	1	3,039
日本無線	4	1	1,555
パナソニック	199	202	253,016
シャープ	148	—	—
アンリツ	10	12	11,223
富士通ゼネラル	5	6	12,960
日立国際電気	4	4	10,971
ソニー	123	125	439,903
T D K	10	10	78,400
帝国通信工業	—	7	1,316
ミツミ電機	6	—	—
タムラ製作所	7	7	3,185
アルプス電気	14	16	56,826
池上通信機	—	3	462
パイオニア	28	26	6,114
日本電波工業	1	1	1,438
鈴木	—	2	1,380
日本トリム	0.500	0.400	1,616
ローランド ディー. ジー.	0.900	0.900	3,195

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
フォスター電機	2	2	4,029
クラリオン	9	9	3,924
SMK	5	5	2,110
ヨコオ	—	1	1,716
東光	4	—	—
ティアック	23	26	1,170
ホシデン	5	5	5,427
ヒロセ電機	2	2	42,920
日本航空電子工業	5	6	9,234
T O A	2	2	2,118
日立マクセル	2	2	5,842
古野電気	2	2	1,771
ユニデンホールディングス	9	7	1,176
アルパイン	4	4	7,051
スミダコーポレーション	1	1	1,948
アイコム	1	1	2,379
リオン	0.700	0.800	1,259
船井電機	1	2	1,900
横河電機	17	19	33,331
新電元工業	6	7	3,360
アズビル	5	5	19,197
日本光電工業	7	7	18,374
チノー	1	1	1,340
共和電業	—	3	1,391
日本電子材料	2	2	1,268
堀場製作所	3	3	21,840
アドバンテスト	11	12	23,921
小野測器	—	1	1,227
エスベック	1	1	2,056
パナソニック デバイスSUNX	1	1	1,348
キーエンス	4	8	354,000
日置電機	0.900	0.900	2,005
シスメックス	13	13	88,182
日本マイクロニクス	2	3	2,973
メガチップス	1	1	4,664
OBARA GROUP	1	1	4,995
澤藤電機	5	6	1,500
コーセル	2	2	3,490
イリソ電子工業	—	0.600	4,284
オプテックスグループ	1	1	4,088
千代田インテグレ	0.900	0.900	2,166
レーザーテック	2	2	6,066
スタンレー電気	12	12	40,132
岩崎電気	6	6	1,044

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ウシオ電機	10	10	15,724
岡谷電機産業	2	3	1,260
ヘリオス テクノ ホールディング	2	2	1,403
日本セラミック	1	1	3,643
遠藤照明	—	1	1,309
日本デジタル研究所	1	—	—
古河電池	—	2	1,518
双信電機	3	4	1,285
山一電機	1	1	2,623
図研	1	1	1,551
日本電子	7	6	3,222
カシオ計算機	17	14	22,207
ファナック	17	18	402,210
日本シイエムケイ	3	3	2,492
エンプラス	0.900	0.800	2,820
ローム	8	8	63,984
浜松ホトニクス	13	13	46,982
三井ハイテック	2	2	2,047
新光電気工業	6	6	5,252
京セラ	28	29	181,857
太陽誘電	8	8	13,158
村田製作所	18	18	304,854
ユーシン	2	2	1,927
双葉電子工業	3	2	5,852
北陸電気工業	8	—	—
ニチコン	5	5	5,952
日本ケミコン	14	15	4,785
K O A	2	2	3,327
市光工業	5	4	2,076
小糸製作所	10	10	61,692
ミツバ	3	3	7,421
SCREENホールディングス	18	3	27,504
キャノン電子	1	1	2,857
キャノン	94	95	314,428
リコー	56	53	53,506
MUTOHホールディングス	—	5	1,340
東京エレクトロン	15	11	131,924
輸送用機器(9.3%)			
トヨタ紡織	6	6	15,202
芦森工業	7	—	—
鬼怒川ゴム工業	4	—	—
ユニプレス	3	3	7,942
豊田自動織機	15	16	89,910
モリタホールディングス	3	3	4,774

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
三機工業	2	2	1,987
デンソー	43	43	222,723
東海理化電機製作所	5	4	10,490
三井造船	68	64	11,392
川崎重工業	136	138	48,990
名村造船所	5	5	4,202
サノヤスホールディングス	4	4	1,341
日本車輛製造	7	6	1,824
ニチユ三菱フォークリフト	2	2	1,434
近畿車輛	3	—	—
日産自動車	245	212	237,367
いすゞ自動車	50	51	79,335
トヨタ自動車	217	215	1,388,668
日野自動車	24	25	33,421
三菱自動車工業	69	65	44,333
エフテック	—	0.900	1,205
レシップホールディングス	1	0.300	256
GMB	1	1	1,560
ファルテック	0.700	0.900	1,268
武蔵精密工業	1	2	5,913
日産車体	8	7	8,494
新明和工業	8	7	8,246
極東開発工業	3	3	6,247
日信工業	3	4	7,940
トピー工業	14	1	4,882
ティラド	7	7	2,177
曙ブレーキ工業	8	8	2,328
タチエス	2	3	6,303
NOK	8	8	21,973
フタバ産業	5	5	4,282
KYB	20	20	12,560
シロキ工業	4	—	—
大同メタル工業	2	2	2,268
プレス工業	9	9	5,282
ミクニ	—	3	1,299
カルソニックカンセイ	13	12	15,420
太平洋工業	3	3	5,212
ケーヒン	4	4	8,081
河西工業	2	2	3,326
アイシン精機	17	16	92,258
マツダ	55	56	89,273
ダイハツ工業	20	—	—
今仙電機製作所	1	1	1,612
本田技研工業	157	159	571,125

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
スズキ	36	35	155,020
富士重工業	55	55	235,938
安永	—	0.700	1,160
ヤマハ発動機	24	25	64,933
ショーワ	4	4	4,448
T B K	2	2	1,269
エクセディ	2	2	7,656
豊田合成	6	5	16,199
愛三工業	3	3	3,028
ヨロズ	1	1	2,985
エフ・シー・シー	2	2	6,536
シマノ	7	7	119,304
タカタ	3	3	1,753
テイ・エス テック	4	4	11,963
ジャムコ	0.800	1	2,624
精密機器(1.5%)			
テルモ	26	27	105,944
クリエートメディック	1	—	—
日機装	6	6	7,417
島津製作所	22	22	43,029
J M S	—	4	1,300
モリテックス	3	—	—
長野計器	1	1	1,198
ブイ・テクノロジ	0.400	0.400	6,936
東京計器	6	6	1,440
オーバル	4	3	1,033
東京精密	3	3	13,039
マニー	1	2	6,525
ニコン	32	31	52,917
トプコン	5	8	18,004
オリンパス	26	28	111,502
理研計器	1	1	2,617
タムロン	1	1	3,384
H O Y A	40	36	184,690
ノーリツ鋼機	1	1	1,747
エー・アンド・デイ	2	2	1,216
シチズン時計	21	19	14,317
リズム時計工業	8	7	1,309
大研医器	1	1	1,280
メニコン	0.900	1	4,224
松風	0.900	0.900	1,232
セイコーホールディングス	11	13	6,032
ニプロ	13	12	16,961

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
その他製品(1.7%)			
スノーピーク	0.300	0.400	1,136
パラマウントベッドホールディングス	1	1	7,063
SHO-BI	2	2	1,273
ニホンフラッシュ	1	0.900	1,154
前田工織	1	1	2,386
アートネイチャー	1	1	1,421
ダンロップスポーツ	1	1	1,142
パンダイナムコホールディングス	18	19	60,956
共立印刷	3	3	1,280
SHOEI	0.800	0.800	2,044
フランスベッドホールディングス	2	2	2,068
パイロットコーポレーション	3	3	14,229
萩原工業	0.500	0.500	1,308
トッパン・フォームズ	3	3	3,424
フジシルインターナショナル	2	4	9,084
タカラトミー	5	6	8,266
廣済堂	3	3	1,173
As-me エステール	—	1	1,176
アーク	—	9	1,058
タカノ	—	1	1,398
プロネックス	1	1	2,099
ホクシン	9	5	1,298
ウッドワン	4	—	—
大建工業	7	1	2,611
凸版印刷	49	50	56,450
大日本印刷	52	51	60,486
図書印刷	3	3	1,446
共同印刷	6	5	1,920
日本写真印刷	2	3	9,975
光村印刷	5	5	1,335
宝印刷	0.800	0.900	1,421
アシックス	16	17	34,425
ツツミ	0.900	0.700	1,481
小松ウオール工業	0.600	0.600	1,165
ヤマハ	12	12	35,184
河合楽器製作所	0.600	0.700	1,610
クリナップ	2	2	1,751
ピジョン	9	10	33,437
キングジム	1	1	1,285
リンテック	4	4	10,395
イトーキ	3	3	2,693
任天堂	10	10	251,735
三菱鉛筆	1	1	8,460

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
タカラスタンダード	7	3	7,081
コクヨ	9	9	14,324
グローブライド	0.800	0.900	1,620
岡村製作所	6	6	6,330
美津濃	9	10	6,050
アデランス	3	—	—
電気・ガス業(1.8%)			
東京電力ホールディングス	148	150	65,253
中部電力	53	58	86,784
関西電力	71	72	90,117
中国電力	24	24	30,085
北陸電力	17	17	19,435
東北電力	43	44	63,936
四国電力	15	16	17,488
九州電力	38	39	48,725
北海道電力	16	16	13,396
沖縄電力	1	2	6,796
電源開発	14	14	37,929
エフオン	—	1	1,201
イーレックス	0.300	0.700	2,569
東京瓦斯	195	190	98,078
大阪瓦斯	181	172	74,218
東邦瓦斯	44	45	35,730
北海道瓦斯	4	4	1,112
広島ガス	3	3	1,339
西部瓦斯	20	20	5,240
静岡ガス	5	5	3,965
メタウォーター	1	1	2,945
陸運業(4.1%)			
SBSホールディングス	1	1	1,499
東武鉄道	93	95	54,435
相鉄ホールディングス	30	28	15,904
東京急行電鉄	102	96	79,296
京浜急行電鉄	48	49	59,829
小田急電鉄	56	28	63,612
京王電鉄	49	50	44,150
京成電鉄	26	13	35,298
富士急行	5	5	5,055
新京成電鉄	2	1	420
東日本旅客鉄道	31	34	353,460
西日本旅客鉄道	16	17	125,685
東海旅客鉄道	15	14	275,576
西武ホールディングス	13	24	48,142
鴻池運輸	2	2	3,562

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
西日本鉄道	23	21	10,269
ハマキョウレックス	1	1	2,499
サカイ引越センター	0.700	0.600	1,860
近鉄グループホールディングス	176	179	75,180
阪急阪神ホールディングス	117	22	84,224
南海電気鉄道	39	38	20,976
京阪ホールディングス	39	40	28,680
神戸電鉄	4	4	1,524
名古屋鉄道	64	65	33,930
山陽電気鉄道	6	6	3,642
日本通運	68	69	39,261
ヤマトホールディングス	32	31	71,502
山九	23	23	16,468
丸全昭和運輸	6	6	2,694
センコー	8	8	5,760
トナミホールディングス	4	4	1,408
ニッコンホールディングス	5	6	14,460
日本石油輸送	4	—	—
福山通運	11	11	7,139
セイノーホールディングス	12	12	15,600
神奈川中央交通	2	2	1,444
日立物流	3	3	8,680
丸和運輸機関	—	0.400	1,028
C&Fロジホールディングス	1	1	2,838
九州旅客鉄道	—	13	44,682
海運業(0.2%)			
日本郵船	157	151	37,297
商船三井	86	94	34,216
川崎汽船	77	68	20,128
N Sユナイテッド海運	8	8	1,840
飯野海運	9	9	4,692
乾汽船	1	1	1,290
空運業(0.6%)			
日本航空	33	32	117,120
ANAホールディングス	324	330	108,042
パスコ	2	1	412
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	0.500	0.500	2,750
日新	7	7	2,548
三菱倉庫	12	12	18,984
三井倉庫ホールディングス	10	10	3,350
住友倉庫	13	13	8,242
滋澤倉庫	5	5	1,755
日本トランスシティ	4	4	1,844

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ケイヒン	7	8	1,256
中央倉庫	1	1	1,205
安田倉庫	1	1	1,251
東洋埠頭	7	2	378
宇徳	3	2	1,187
上組	21	21	22,155
キユーソー流通システム	0.500	0.600	1,586
郵船ロジスティクス	1	1	1,883
近鉄エクスプレス	3	3	5,446
エアロティイー	1	1	1,314
内外トランスライン	0.700	1	1,314
情報・通信業(7.8%)			
NECネットエスアイ	2	1	4,035
システナ	1	1	2,282
デジタルアーツ	0.800	0.800	2,648
新日鉄住金ソリューションズ	2	2	6,626
コア	0.800	1	1,385
T I S	5	5	15,636
電算システム	0.700	—	—
グリー	10	10	7,211
コエーテックホールディングス	4	4	9,156
三菱総合研究所	0.700	0.700	2,229
ボルテージ	—	1	1,206
電算	0.400	0.500	1,216
A G S	1	0.900	1,724
ファインデックス	1	1	1,251
ヒト・コミュニケーションズ	0.600	0.800	1,340
K L a b	2	3	2,666
ポルトウイン・ビクトルホールディングス	1	1	1,426
ネクソン	16	19	36,960
アイスタイル	2	2	2,643
エムアップ	2	2	1,802
エイチーム	0.700	1	2,136
テクノスジャパン	—	1	1,736
コロプラ	4	4	5,022
ブロードリーフ	1	4	2,721
ハーツユナイテッドグループ	0.500	0.900	1,353
メディアドゥ	—	0.500	858
ブイキューブ	0.800	1	1,119
サイバーリンクス	—	1	1,254
オプティム	—	0.200	1,052
ティーガイア	1	1	3,172
豆蔵ホールディングス	—	1	1,150
テクマトリックス	0.700	0.600	1,543

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
カホー・オンライン・エンターテイメント	30	36	9,420
GMOペイメントゲートウェイ	1	1	9,072
ザッパラス	2	2	1,279
インターネットイニシアティブ	2	2	5,267
さくらインターネット	0.800	1	1,479
S R Aホールディングス	1	0.900	2,515
朝日ネット	—	2	1,312
コムチュア	—	0.400	1,408
g u m i	1	1	2,257
パイプドHD	0.900	1	1,219
L I N E	—	2	10,266
AOI TYO HOLDINGS	—	1	1,178
フェイス	0.800	—	—
野村総合研究所	12	13	51,024
サイバネットシステム	1	1	1,563
C Eホールディングス	—	1	1,248
インテージホールディングス	0.900	1	2,172
東邦システムサイエンス	1	1	1,164
フォーカスシステムズ	—	2	1,293
クレスコ	0.600	0.500	1,246
フジ・メディア・ホールディングス	17	18	28,127
オービック	5	6	32,100
ジャストシステム	3	2	3,402
TDCソフトウェアエンジニアリング	0.900	1	1,370
ヤフー	123	125	66,191
トレンドマイクロ	8	9	45,012
インフォメーション・ディベロプメント	1	—	—
日本オラクル	2	2	18,480
アルファシステムズ	0.600	0.600	1,185
フューチャー	2	2	2,157
CAC Holdings	1	1	1,519
ソフトバンク・テクノロジー	0.800	0.400	1,650
トーセ	1	1	1,243
オービックビジネスコンサルタント	0.900	0.900	5,004
伊藤忠テクノソリューションズ	3	4	12,600
アイティフォー	2	2	1,506
東計電算	0.500	—	—
大塚商会	4	4	27,683
サイボウズ	3	2	1,196
電通国際情報サービス	1	1	2,440
デジタルガレージ	—	2	5,567
イーエムシステムズ	0.400	0.700	1,138
ウェザーニューズ	0.600	0.600	2,139
C I J	2	2	1,223

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
東洋ビジネスエンジニアリング	0.700	0.800	1,236
日本エンタープライズ	3	4	1,208
WOWOW	0.800	0.800	2,936
スカラ	—	1	1,285
イマジカ・ロボット ホールディングス	2	1	1,429
ネットワンシステムズ	7	7	6,710
アルゴグラフィックス	0.800	0.800	1,970
マーベラス	2	3	2,892
エイベックス・グループ・ホールディングス	3	3	5,152
日本ユニシス	4	4	7,296
兼松エレクトロニクス	1	1	2,834
東京放送ホールディングス	10	11	23,710
日本テレビホールディングス	15	16	32,320
朝日放送	1	1	1,326
テレビ朝日ホールディングス	4	4	11,102
スカパー-J SATホールディングス	13	11	5,700
テレビ東京ホールディングス	1	1	3,603
U-NEXT	—	1	1,864
ワイヤレスゲート	—	0.700	1,078
コネクシオ	1	1	2,353
日本通信	9	14	2,646
日本電信電話	133	140	671,279
KDD I	175	173	509,015
光通信	2	2	23,037
NTTドコモ	132	131	352,521
エムティーアイ	2	2	1,852
GMOインターネット	6	6	9,740
カドカワ	5	5	8,262
学研ホールディングス	6	6	1,848
ゼンリン	2	2	5,046
昭文社	1	1	1,278
インプレスホールディングス	7	8	1,205
アイネット	1	1	1,350
松竹	11	12	15,828
東宝	12	11	37,490
東映	6	7	7,028
AOI Pro.	1	—	—
エヌ・ティ・ティ・データ	10	10	57,888
D T S	1	1	4,656
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7	6	22,813
シーイーシー	1	1	1,839
カプコン	4	4	9,803
ジャステック	1	1	1,138
S C S K	4	4	19,992

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
日本システムウエア	—	0.800	1,291
アイネス	2	2	2,516
T K C	1	1	5,472
富士ソフト	2	2	7,342
N S D	3	3	6,478
コナミホールディングス	7	7	36,379
福井コンピュータホールディングス	1	0.500	1,415
J B C Cホールディングス	1	1	1,289
ミロク情報サービス	1	1	2,325
ソフトバンクグループ	97	78	693,452
卸売業(4.6%)			
高千穂交易	1	1	1,264
伊藤忠食品	0.500	0.400	1,806
エレマテック	0.800	0.700	1,373
J A L U X	0.600	0.600	1,330
あらた	0.800	0.800	2,271
トーメンデバイス	0.600	0.600	1,296
東京エレクトロン デバイス	0.600	0.800	1,279
フィールズ	1	1	1,625
双日	108	103	30,222
アルフレッサ ホールディングス	21	20	41,379
横浜冷凍	4	4	4,536
山下医科器械	0.600	—	—
ラサ商事	1	2	1,392
アルコニックス	1	1	1,779
神戸物産	1	0.900	3,379
あい ホールディングス	3	3	6,971
ダイワボウホールディングス	16	15	4,425
マクニカ・富士エレホールディングス	3	3	5,392
バイタルケ-エスケー-ホールディングス	3	3	3,346
八洲電機	—	1	1,223
U K Cホールディングス	1	1	2,461
O C H Iホールディングス	1	0.900	1,222
T O K A Iホールディングス	7	7	6,452
三洋貿易	0.900	1	1,817
ウイン・パートナーズ	—	1	1,284
シップヘルスケアホールディングス	3	3	10,125
コメダホールディングス	—	2	4,620
富士興産	—	2	1,287
協栄産業	8	8	1,376
小野建	1	1	2,131
佐鳥電機	1	1	1,276
エコートレーディング	1	1	1,267
伯東	1	1	1,292

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
コンドーテック	1	1	1,223
ナガイレーベン	2	2	6,177
三菱食品	1	1	6,593
松田産業	1	1	2,074
第一興商	3	2	13,731
メディアパルホールディングス	17	17	32,165
萩原電気	—	0.600	1,306
アズワン	1	1	7,014
尾家産業	1	1	1,280
シモジマ	1	1	1,318
ドウシシャ	2	2	4,473
小津産業	0.500	—	—
高速	1	1	1,226
黒田電気	3	2	5,484
丸文	1	1	1,323
ハピネット	1	1	2,187
橋本総業ホールディングス	0.600	0.800	1,201
日本ライフライン	—	1	3,060
エクセル	0.800	0.800	1,199
マルカキカイ	0.700	—	—
I D O M	4	4	3,525
日本エム・ディ・エム	—	1	1,071
進和	1	1	1,783
エスケイジャパン	2	4	1,228
シークス	1	1	5,512
田中商事	1	1	1,230
オーハシテクニカ	1	1	1,439
白銅	1	0.800	1,428
伊藤忠商事	135	128	209,163
丸紅	169	172	125,994
長瀬産業	10	10	17,314
蝶理	1	1	2,197
豊田通商	19	19	65,032
三共生興	2	2	1,200
兼松	37	37	7,215
ツカモトコーポレーション	9	—	—
三井物産	155	158	269,925
日本紙パルプ商事	9	9	3,348
日立ハイテクノロジーズ	6	6	29,371
カメイ	2	2	3,116
東都水産	6	0.300	589
スターゼン	0.600	0.700	3,419
山善	6	6	7,128
椿本興業	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
住友商事	108	110	164,992
内田洋行	4	0.900	2,300
三菱商事	129	131	343,149
第一実業	4	4	3,132
キャノンマーケティングジャパン	4	5	11,400
西華産業	6	6	2,184
佐藤商事	1	1	1,408
菱洋エレクトロ	2	1	2,696
東京産業	2	2	1,232
ユアサ商事	1	1	5,576
神鋼商事	5	0.500	1,233
小林産業	5	4	1,301
阪和興業	17	18	14,022
カナデン	1	1	1,781
菱電商事	3	3	2,205
フルサト工業	0.900	1	1,737
岩谷産業	20	19	12,635
すてきナイスグループ	7	8	1,216
昭光通商	13	12	1,212
イワキ	5	—	—
三愛石油	4	4	4,201
稲畑産業	4	4	6,346
明和産業	—	3	1,317
ワキタ	3	3	3,966
東邦ホールディングス	5	5	13,882
サンゲツ	6	6	11,574
ミツウロコグループホールディングス	2	2	2,083
シナネンホールディングス	4	0.800	1,838
伊藤忠エネクス	4	3	3,681
サンリオ	5	5	11,826
サンワ テクノス	1	1	1,405
リョーサン	2	2	9,555
新光商事	2	1	2,565
トーホー	0.800	0.800	2,028
三信電気	2	1	2,565
東陽テクニカ	2	2	2,343
モスフードサービス	2	2	7,659
加賀電子	1	1	3,267
ソーダニッカ	2	2	1,248
立花エレテック	1	1	1,586
PAL TAC	2	2	8,778
三谷産業	3	3	1,250
ヤマタネ	8	0.900	1,465
日鉄住金物産	11	1	7,335

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
トラスコ中山	2	4	10,272
オートバックスセブン	6	6	11,713
加藤産業	2	2	7,916
イノテック	2	2	1,461
イエローハット	1	1	4,741
J Kホールディングス	2	2	1,344
日伝	0.700	0.700	2,450
北沢産業	6	6	1,335
杉本商事	1	1	1,558
因幡電機産業	2	2	10,000
パイテックホールディングス	1	1	1,375
ミスミグループ本社	19	19	40,877
タキヒヨー	3	3	1,449
スズケン	7	8	30,680
ジェコス	1	1	1,356
ルネサスイーストン	2	2	1,353
小売業(4.6%)			
ローソン	6	6	48,861
サンエー	1	1	6,721
カワチ薬品	1	1	4,195
エービーシー・マート	2	3	21,472
ハードオフコーポレーション	0.800	—	—
アスクル	2	2	6,961
ゲオホールディングス	3	2	3,958
アダストリア	1	2	7,981
シー・ヴィ・エス・バイエリア	12	—	—
くらコーポレーション	1	1	5,104
キャンドウ	0.900	0.900	1,632
パルグループホールディングス	1	0.900	2,501
エディオン	7	6	7,004
サーラコーポレーション	—	2	1,375
ワッツ	1	1	1,426
ハローズ	0.500	0.600	1,415
あみやき亭	0.300	0.400	1,628
ひらまつ	2	2	1,584
ゲンキー	0.400	0.400	2,576
大黒天物産	0.400	0.400	2,012
ハニーズ	1	1	1,669
ファーマライズホールディングス	2	2	1,236
アルペン	1	1	3,142
クオール	1	2	3,068
ジェイアイエヌ	1	1	7,164
ビックカメラ	8	10	10,847
DCMホールディングス	8	10	10,525

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
MonotaRO	6	6	20,057
ダイヤモンドダイニング	—	0.900	1,509
きちり	0.100	1	1,254
アーグランドサービスホールディングス	0.500	0.500	1,602
J. フロント リテイリング	21	22	38,184
ドトール・日レスホールディングス	3	3	6,940
マツモトキヨシホールディングス	3	3	17,424
ブロンコビリー	0.700	0.900	2,523
スタートトゥデイ	5	16	39,792
物語コーポレーション	0.500	0.500	2,230
ココカラファイン	1	1	8,424
三越伊勢丹ホールディングス	34	34	48,266
ウエルシアホールディングス	1	1	10,693
クリエイトSDホールディングス	2	2	6,687
チムニー	0.400	0.500	1,429
ジョイフル本田	2	2	9,702
鳥貴族	—	0.500	1,213
キリン堂ホールディングス	1	1	1,194
ホットランド	—	1	1,135
すかいらーく	5	7	12,030
綿半ホールディングス	—	0.800	1,296
ヨシックス	—	0.900	1,188
マイトッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5	5	5,858
ブックオフコーポレーション	1	1	1,285
あさひ	1	1	1,704
日本調剤	0.400	0.600	2,238
コスモス薬品	0.900	0.900	19,089
一六堂	2	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	72	73	323,033
薬王堂	0.400	0.900	2,185
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1	4	4,845
ツルハホールディングス	4	4	41,920
サンマルクホールディングス	1	1	3,839
トリドールホールディングス	2	2	5,205
クスリのアオキ	1	—	—
パロックジャパンリミテッド	—	1	1,405
クスリのアオキホールディングス	—	1	7,640
メディカルシステムネットワーク	2	2	1,271
総合メディカル	0.800	0.800	3,196
はるやまホールディングス	1	1	1,374
ノジマ	—	2	2,812
カッパ・クリエイト	2	2	3,197
ライトオン	1	1	1,277
ジーンズメイト	—	4	1,087

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
良品計画	2	2	51,589
三城ホールディングス	2	2	1,237
アドヴァン	1	1	2,086
アルビス	—	0.500	1,627
コナカ	2	2	1,320
ハウス オブ ローゼ	0.700	0.800	1,240
イオン北海道	1	2	1,234
コジマ	4	—	—
ヒマラヤ	1	1	1,199
コーナン商事	2	2	5,455
エコス	0.800	1	1,210
ワタミ	2	2	2,402
マルシェ	1	1	1,260
ドンキホーテホールディングス	11	11	44,465
西松屋チェーン	3	3	4,030
ゼンショーホールディングス	8	9	17,235
幸楽苑ホールディングス	1	1	1,844
サイゼリヤ	2	2	7,656
VTホールディングス	5	5	3,091
魚力	—	0.900	1,170
ユナイテッドアローズ	2	2	8,038
ハイデイ日高	1	1	4,624
京都きもの友禅	1	1	1,194
コロワイド	5	5	10,822
ピーシーデポコーポレーション	1	2	1,285
壱番屋	0.800	1	6,040
トップカルチャー	2	2	1,205
P L A N T	0.800	1	1,198
スギホールディングス	3	3	20,330
スクロール	2	3	1,267
ヨンドシーホールディングス	1	1	3,324
エニ・ファミリーマートホールディングス	5	7	54,285
木曽路	2	2	4,974
サトレストランシシステムズ	2	2	1,816
千趣会	3	3	2,540
ケーヨー	2	3	1,755
上新電機	4	4	4,356
日本瓦斯	2	3	10,704
ベスト電器	8	—	—
ロイヤルホールディングス	2	2	5,834
東天紅	7	7	1,183
いなげや	1	1	2,977
島忠	4	4	12,798
チヨダ	2	2	5,768

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
ライフコーポレーション	1	1	4,309
リンガーハット	1	2	4,586
MR MAX	3	—	—
テンアライド	2	3	1,260
AOKIホールディングス	3	3	4,973
オークワ	3	2	2,236
コメリ	2	2	7,398
青山商事	3	3	15,355
しまむら	2	2	29,040
はせがわ	—	2	1,206
高島屋	25	29	29,000
松屋	3	3	3,826
エイチ・ツー・オー リテイリング	8	9	16,830
近鉄百貨店	7	7	2,499
ニッセンホールディングス	6	—	—
パルコ	1	1	1,934
丸井グループ	21	18	28,722
アクシアル リテイリング	1	1	6,300
イオン	70	72	122,786
ユニグループ・ホールディングス	16	—	—
イズミ	3	3	17,167
平和堂	3	3	9,648
フジ	1	1	4,561
ヤオコー	2	2	9,120
ゼビオホールディングス	2	2	4,308
ケーズホールディングス	3	8	16,912
Olympicグループ	1	1	1,210
アインホールディングス	2	2	17,913
元気寿司	0.500	0.600	1,361
ヤマダ電機	52	58	33,812
アークランドサカモト	2	3	4,269
ニトリホールディングス	7	7	93,100
グルメ杵屋	1	1	1,041
愛眼	4	6	1,221
ケユーホールディングス	—	1	1,371
吉野家ホールディングス	6	6	10,162
松屋フーズ	0.800	0.800	3,336
サガミチェーン	2	2	3,027
関西スーパーマーケット	1	1	2,147
王将フードサービス	1	1	5,518
プレナス	1	2	4,990
ミニストップ	1	1	2,815
アークス	3	3	8,530
パローホールディングス	3	3	10,541

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
藤久	0.600	0.700	1,221
ベルク	0.800	0.800	3,624
大 庄	0.800	0.900	1,435
ファーストリテイリング	3	2	101,471
サンドラッグ	3	3	24,552
サックスパー ホールディングス	1	1	2,008
やまや	0.100	0.700	1,204
ペルーナ	4	4	3,735
銀行業(8.7%)			
島根銀行	0.800	0.900	1,269
じもとホールディングス	12	12	2,469
めぶきフィナンシャルグループ	12	84	41,236
東京TYフィナンシャルグループ	2	2	10,000
九州フィナンシャルグループ	26	28	22,787
ゆうちょ銀行	33	49	70,680
富山第一銀行	—	4	2,479
コンコディア・フィナンシャルグループ	—	114	70,475
西日本フィナンシャルホールディングス	—	11	14,982
新生銀行	149	167	34,903
あおぞら銀行	109	111	46,287
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,382	1,328	1,019,945
りそなホールディングス	201	205	129,089
三井住友トラスト・ホールディングス	360	36	154,635
三井住友フィナンシャルグループ	138	140	638,679
第四銀行	22	21	11,277
北越銀行	19	1	5,213
西日本シティ銀行	56	—	—
千葉銀行	66	68	53,584
横浜銀行	116	—	—
常陽銀行	62	—	—
群馬銀行	38	39	26,130
武蔵野銀行	2	2	10,388
千葉興業銀行	4	4	3,024
筑波銀行	7	7	2,576
七十七銀行	27	27	14,526
青森銀行	13	14	5,516
秋田銀行	11	11	4,048
山形銀行	10	10	4,950
岩手銀行	1	1	5,263
東邦銀行	15	16	7,056
東北銀行	9	9	1,440
みちのく銀行	9	9	1,719
ふくおかフィナンシャルグループ	75	71	35,855
静岡銀行	51	48	48,864

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
十六銀行	22	24	9,912
スルガ銀行	16	17	45,859
八十二銀行	31	33	24,437
山梨中央銀行	11	11	6,127
大垣共立銀行	23	23	10,419
福井銀行	15	15	4,260
北國銀行	19	19	9,101
清水銀行	0.600	0.600	2,268
富山銀行	0.300	0.300	1,254
滋賀銀行	16	16	10,144
南都銀行	17	1	8,041
百五銀行	15	16	8,320
京都銀行	33	31	29,884
紀陽銀行	6	6	12,691
三重銀行	8	0.800	2,024
ほくほくフィナンシャルグループ	117	11	24,020
広島銀行	51	52	28,600
山陰合同銀行	10	10	10,804
中国銀行	12	12	22,481
鳥取銀行	6	0.600	1,161
伊予銀行	18	18	15,745
百十四銀行	19	19	7,619
四国銀行	13	14	4,410
阿波銀行	14	15	11,400
大分銀行	10	10	4,500
宮崎銀行	11	12	4,536
佐賀銀行	10	11	3,443
十八銀行	11	11	4,004
沖縄銀行	1	1	7,191
琉球銀行	3	3	5,986
セブン銀行	64	65	21,746
みずほフィナンシャルグループ	2,427	2,380	500,773
山口フィナンシャルグループ	16	17	22,457
長野銀行	6	0.700	1,415
名古屋銀行	14	1	6,547
北洋銀行	26	28	13,699
愛知銀行	0.600	0.600	4,272
第三銀行	10	1	1,757
中京銀行	7	0.700	1,613
東日本銀行	8	—	—
大光銀行	6	6	1,512
愛媛銀行	10	2	2,979
トマト銀行	7	—	—
みなと銀行	16	1	3,900

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
京葉銀行	14	14	7,672
関西アーバン銀行	2	2	3,789
栃木銀行	9	9	5,752
北日本銀行	0.500	0.500	1,585
東和銀行	24	33	4,191
福島銀行	21	19	1,843
大東銀行	10	9	1,548
トモニホールディングス	13	14	9,417
フィデアホールディングス	10	17	3,689
池田泉州ホールディングス	18	18	9,690
証券、商品先物取引業(1.3%)			
F P G	5	6	7,011
S B Iホールディングス	20	19	30,630
ジャフコ	2	2	11,426
大和証券グループ本社	161	164	116,604
野村ホールディングス	331	358	268,800
岡三証券グループ	15	15	11,370
丸三証券	5	5	5,387
東洋証券	7	6	1,632
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19	20	13,004
光世証券	4	7	1,337
水戸証券	5	5	1,684
いちよし証券	3	3	3,510
松井証券	8	10	9,330
だいこう証券ビジネス	—	2	1,278
マネックスグループ	20	18	5,527
カブドットコム証券	15	13	5,122
極東証券	2	2	4,034
岩井コスモホールディングス	1	1	1,881
藍澤証券	2	3	2,135
マネースクウェアHD	1	—	—
マネーパートナーズグループ	3	1	902
保険業(2.8%)			
かんば生命保険	5	6	18,348
SOMPOホールディングス	38	36	156,684
アニコム ホールディングス	1	1	2,712
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	51	52	201,478
ソニーフィナンシャルホールディングス	16	16	33,885
第一生命ホールディングス	110	105	233,227
東京海上ホールディングス	69	71	361,319
T & Dホールディングス	62	63	115,531
アドバンスクリエイト	—	0.500	1,041
その他金融業(1.3%)			
全国保証	4	4	17,738

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
クレディセゾン	13	13	28,927
アクリーティブ	—	2	995
芙蓉総合リース	2	2	10,600
興銀リース	3	3	8,256
東京センチュリー	4	3	13,650
日本証券金融	7	7	4,866
アイフル	28	29	10,437
ポケットカード	2	1	728
リコーリース	1	1	5,110
イオンフィナンシャルサービス	11	11	23,788
アコム	34	35	17,388
ジャックス	10	10	5,080
オリエントコーポレーション	74	37	8,148
日立キャピタル	4	4	12,074
アプラスフィナンシャル	11	10	1,249
オリックス	122	124	218,664
三菱ＵＦＪリース	43	44	27,590
日本取引所グループ	50	54	87,309
イー・ギャランティ	0.600	0.500	1,306
NECキャピタルソリューション	0.700	0.700	1,276
不動産業(2.5%)			
いちご	14	16	6,112
日本駐車場開発	18	21	3,228
ビューリック	35	36	39,820
野村不動産ホールディングス	11	11	22,330
三重交通グループホールディングス	3	3	1,209
サムティ	—	1	1,673
日本商業開発	0.600	1	1,942
プレサンスコーポレーション	0.600	2	3,939
ユニゾホールディングス	1	1	4,333
THEグローバル社	—	2	1,225
日本管理センター	1	1	1,803
サンセイランディック	1	1	1,288
フージャースホールディングス	2	2	1,409
オープンハウス	2	2	6,790
東急不動産ホールディングス	41	42	27,772
飯田グループホールディングス	16	14	26,557
シーアールイー	—	0.800	1,346
パーク24	8	8	27,545
パラカ	0.800	0.600	1,194
三井不動産	91	93	243,892
三菱地所	128	130	293,605
平和不動産	3	3	5,319
東京建物	18	20	32,256

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ダイビル	4	4	4,801
京阪神ビルディング	2	2	1,899
住友不動産	41	42	136,332
大京	33	33	7,656
テーオーシー	6	6	6,555
東京楽天地	3	3	1,584
レオパレス21	20	22	13,392
スターツコーポレーション	2	1	4,379
フジ住宅	2	2	1,641
空港施設	2	2	1,245
明和地所	1	1	1,210
住友不動産販売	1	1	4,555
ゴールドクレスト	1	1	3,419
日本エスリード	0.900	0.900	1,372
日神不動産	2	2	1,267
タカラレーベン	7	7	4,567
サンヨーハウジング名古屋	1	1	1,213
イオンモール	11	11	19,571
ファースト住建	0.800	0.800	1,146
トーセイ	2	2	1,862
穴吹興産	4	0.500	1,334
エヌ・ティ・ティ都市開発	10	10	11,477
サンフロンティア不動産	2	1	1,949
エフ・ジェー・ネクスト	2	—	—
ランドビジネス	3	4	1,271
グランディハウス	2	2	1,212
日本空港ビルデング	5	5	22,148
サービス業(3.6%)			
日本工営	6	1	3,280
ネクスト	5	4	3,394
ジェイエイシーリクルートメント	—	1	1,701
日本M&Aセンター	2	5	18,549
ノバレーゼ	1	—	—
アコーディア・ゴルフ	7	—	—
タケエイ	1	1	1,640
トラスト・テック	0.400	0.800	1,376
コシダカホールディングス	—	0.600	1,489
パソナグループ	1	1	1,299
リンクアンドモチベーション	8	4	1,918
GCA	1	1	1,528
エス・エム・エス	2	2	6,671
テンプホールディングス	12	14	27,699
リニカル	1	1	1,587
クックパッド	4	4	3,997

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
アイ・ケイ・ケイ	1	1	1,292
学情	1	1	1,204
スタジオアリス	0.800	0.800	1,799
シミックホールディングス	0.800	0.900	1,338
N J S	0.800	0.900	1,258
総合警備保障	6	6	29,444
カカクコム	13	13	21,291
ルネサンス	0.900	0.900	1,533
ディップ	2	2	5,570
オプトホールディング	1	1	1,582
新日本科学	2	2	1,180
ツクイ	2	4	3,005
キャリアデザインセンター	1	0.900	1,046
エムスリー	15	16	45,804
ツカダ・グローバルホールディング	1	1	1,121
アウトソーシング	0.800	1	4,108
ウェルネット	0.700	1	1,810
ディー・エヌ・エー	8	8	20,442
博報堂DYホールディングス	25	25	34,360
ぐるなび	2	2	5,985
エスアールジータカミヤ	3	2	1,170
ジャパンベストレスキューシステム	4	5	1,265
ファンコミュニケーションズ	4	4	3,642
WDBホールディングス	1	1	1,368
ティア	1	1	1,322
バリューコマース	2	—	—
インフォマート	2	7	4,684
J Pホールディングス	4	5	1,367
E P Sホールディングス	2	2	3,507
プレステージ・インターナショナル	1	2	2,314
アミューズ	0.500	1	2,023
ドリームインキュベータ	0.600	0.600	1,272
T A C	5	5	1,236
ケネディクス	24	24	10,980
電通	20	20	123,579
テイクアンドギヴ・ニーズ	2	1	1,531
ぴあ	0.500	0.600	1,753
イオンファンタジー	0.600	0.500	1,560
シーティーエス	—	0.900	1,399
みらかホールディングス	4	4	23,829
アルプス技研	0.700	0.700	2,138
ダイオーズ	1	1	1,181
日本空調サービス	0.900	2	1,332
オリエンタルランド	19	20	126,971

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ダスキン	5	4	11,716
明光ネットワークジャパン	2	2	2,780
ファルコホールディングス	0.800	0.900	1,345
秀英予備校	1	2	1,346
ラウンドワン	5	5	5,104
リゾートトラスト	7	7	15,847
ビー・エム・エル	1	2	5,944
ワタベウェディング	—	2	1,661
りらいあコミュニケーションズ	3	3	3,379
リソー教育	3	3	2,003
ユー・エス・エス	22	22	43,492
サイバーエージェント	4	9	29,498
楽天	85	94	97,454
セントラルスポーツ	0.600	0.600	2,148
フルキャストホールディングス	1	1	2,040
テクノプロ・ホールディングス	3	3	11,565
K e e P e r 技研	—	0.700	1,508
リブセンス	0.700	2	1,190
ジャパンマテリアル	0.800	1	2,132
ベクトル	0.600	1	1,872
ウチヤマホールディングス	—	2	1,229
キャリアリンク	—	1	1,176
I B J	—	1	1,140
アサンテ	0.700	0.700	1,215
N・フィールド	—	0.900	1,323
アビスト	0.500	0.300	1,188
ウィルグループ	1	1	1,205
日本ビューホテル	—	0.900	1,215
リクルートホールディングス	36	40	215,865
日本郵政	40	48	71,341
ベルシステム24ホールディングス	2	2	2,800
リログループ	0.700	0.700	11,060
東祥	0.500	0.400	2,060
エイチ・アイ・エス	3	3	8,781
ラックランド	—	0.600	1,198
共立メンテナンス	1	1	10,395
イチネンホールディングス	1	1	2,272
建設技術研究所	1	1	1,312
スペース	1	1	1,285
東京テアトル	8	8	1,216
ナガワ	0.300	0.300	1,365
よみうりランド	4	4	1,848
東京都競馬	12	13	3,354
常磐興産	7	0.800	1,291

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
カナモト	2	2	7,501
東京ドーム	15	7	8,095
西尾レントオール	1	1	4,950
トランス・コスモス	2	2	5,757
乃村工藝社	3	4	7,648
藤田観光	7	6	2,220
KNT-CTホールディングス	9	10	1,380
日本管財	1	1	2,862
トーカイ	0.800	0.800	3,280
白洋舎	－	0.500	1,350
セコム	19	19	158,144
セントラル警備保障	0.800	0.800	1,518
丹青社	3	3	2,774
メイテック	2	2	9,570
アサツー ディ・ケイ	3	3	8,673
応用地質	1	1	2,638
船井総研ホールディングス	2	2	4,699
進学会	1	2	1,256
学究社	－	0.800	1,301
ベネッセホールディングス	6	6	20,708
イオンディライト	1	2	7,287

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
ナック	1	1	1,189
ニチイ学館	3	3	2,822
ダイセキ	3	3	7,414
ステップ	－	0.900	1,261
合 計	株数・金額	28,896	26,741
	銘柄数<比率>	1,672	1,711
			<97.7%>

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

(注2) 合計欄の< >内は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国 内	百万円	百万円
T O P I X	928	－

(注) 単位未満は切り捨てています。

◆投資信託財産の構成

(2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 40,065,445	% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,048,159	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	41,113,604	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

(2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末
(A)資 産	41,104,725,800円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	938,060,227
株 式 (評価額)	40,065,445,160
未 収 入 金	10,077,600
未 収 配 当 金	66,042,813
差 入 委 託 証 拠 金	25,100,000
(B)負 債	106,718,372
未 払 解 約 金	106,717,303
そ の 他 未 払 費 用	1,069
(C)純 資 産 総 額 (A－B)	40,998,007,428
元 本	26,374,834,259
次 期 繰 越 損 益 金	14,623,173,169
(D)受 益 権 総 口 数	26,374,834,259口
1万口当たり基準価額 (C/D)	15,544円

- (注1) 期首元本額 26,708,202,183円
 期中追加設定元本額 10,006,231,236円
 期中一部解約元本額 10,339,599,160円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。
- | | |
|---|----------------|
| ニッセイTOPIXオープン | 7,816,865,155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) | 6,332,736,059円 |
| ニッセイ日本バランス (標準型) SA (適格機関投資家限定) | 14,519,282円 |
| ニッセイ日本バランス (成長型) SA (適格機関投資家限定) | 6,437,271円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型) | 555,106,395円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) | 2,800,563,440円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) | 2,128,386,619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) | 46,174,999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) | 225,366,268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) | 217,749,600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) | 1,897,634,169円 |
| DCニッセイ国内株式インデックス | 33,239,884円 |
| ＜購入・換金手数料なし＞ニッセイTOPIXインデックスファンド | 4,083,558,090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) | 216,164,160円 |
| DCニッセイターゲットデットファンド2055 | 332,868円 |

◆損益の状況

当期 (2016年2月23日～2017年2月20日)

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	779,010,841円
受 取 配 当 金	778,889,457
受 取 利 息	11,057
そ の 他 収 益 金	525,339
支 払 利 息	△ 415,012
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	6,645,935,503
売 買 益	7,431,372,298
売 買 損	△ 785,436,795
(C)先 物 取 引 等 損 益	118,811,960
取 引 益	206,500,660
取 引 損	△ 87,688,700
(D)信 託 報 酬 等	△ 29,665
(E)当期損益金 (A + B + C + D)	7,543,728,639
(F)前 期 繰 越 損 益 金	7,429,245,557
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	3,681,764,874
(H)解 約 差 損 益 金	△ 4,031,565,901
(I)合 計 (E + F + G + H)	14,623,173,169
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	14,623,173,169

- (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。

運用経過

2016年2月23日～2017年2月20日

国内債券市況

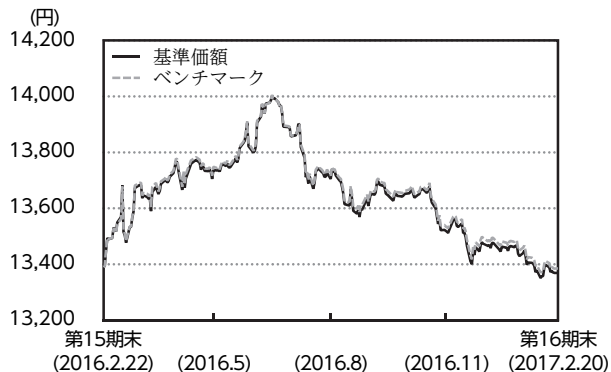


(注) 10年国債金利は、ブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は、日銀によるマイナス金利導入などを背景に期初は低下傾向となりました。その後も金利は低下基調で推移し、6月に実施されたイギリスの国民投票においてEU離脱派が勝利したことなどから、さらに低下しました。

しかし、7月末の日銀金融政策決定会合でマイナス金利の深堀りが見送られると、その反動から金利は上昇に転じました。その後も金利は上昇傾向となり、11月の米大統領選後には、米早期利上げ観測が高まったことなどを背景にさらに上昇しました。年明け以降も、為替市場や株式市場の変動をにらんで上下しつつも、おおむね上昇傾向となり、結局、当期の10年国債金利は期初を上回る水準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

当期の基準価額は、国内金利が上昇（債券価格は下落）したことから低下しました。

期初以降、日銀のマイナス金利導入などを背景に10年国債金利が低下（債券価格は上昇）傾向となったことを受けて、基準価額は上昇が続きましました。6月に実施されたイギリスの国民投票において、欧州連合（EU）離脱派が勝利したことなどから金利はさらに低下し、基準価額は上昇しました。しかし、7月末の日銀金融政策決定会合でマイナス金利の深堀りが見送ら

れると、その反動から金利が上昇したため、基準価額は下落する展開となりました。その後も、金利の上昇が続いたことから基準価額は下落基調となり、11月の米大統領選後には、米早期利上げ観測が高まったことなどを背景にさらに下落しました。年明け以降も金利は上昇傾向となったことから、基準価額は期初を下回る水準で当期末を迎えました。

(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公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、残存期間別構成比等を調整し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

当期も上記クオ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-0.1%となり、おおむねベンチマーク騰落率（-0.0%）に連動しました。

今後の運用方針

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。

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

◆最近5期の運用実績

決 算 期	基準価額	期 中 騰落率	ベンチマーク	期 中 騰落率	債 券 組入比率	純資産 総 額
	円	%		%	%	百万円
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
15期(2016年2月22日)	13,389	4.4	13,376	4.2	99.0	25,320
16期(2017年2月20日)	13,369	△0.1	13,372	△0.0	99.3	28,941

(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、設定時を10,000として指数化しています。NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

◆当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率	債 券 組入比率
(期 首) 2016年2月22日	円 13,389	% —	13,376	% —	% 99.0
2月末	13,494	0.8	13,481	0.8	98.9
3月末	13,590	1.5	13,591	1.6	90.7
4月末	13,708	2.4	13,709	2.5	99.0
5月末	13,761	2.8	13,757	2.9	99.0
6月末	13,939	4.1	13,926	4.1	98.8
7月末	13,820	3.2	13,815	3.3	99.4
8月末	13,676	2.1	13,673	2.2	98.6
9月末	13,685	2.2	13,683	2.3	99.0
10月末	13,649	1.9	13,645	2.0	99.1
11月末	13,557	1.3	13,557	1.4	98.1
12月末	13,477	0.7	13,481	0.8	99.3
2017年1月末	13,403	0.1	13,407	0.2	98.9
(期 末) 2017年2月20日	13,369	△0.1	13,372	△0.0	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

◆ 1 万口当たりの費用明細

(2016年2月23日～2017年2月20日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用 (その他)	0円 (0)	0.000% (0.000)	$\text{その他費用} = \text{期中のその他費用} / \text{期中の平均受益権口数}$ ・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	0	0.000	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は、「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（13,644円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

ニッセイ国内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

(2016年2月23日～2017年2月20日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 32,248,713	千円 28,112,842

(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

(2016年2月23日～2017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140回 利付国債(20年)	2,306,865	第125回 利付国債(20年)	2,011,114
第312回 利付国債(10年)	2,253,982	第88回 利付国債(20年)	1,450,878
第113回 利付国債(5年)	1,882,900	第117回 利付国債(5年)	1,316,316
第122回 利付国債(5年)	1,762,963	第116回 利付国債(5年)	1,288,166
第332回 利付国債(10年)	1,649,614	第133回 利付国債(20年)	1,200,330
第329回 利付国債(10年)	1,642,664	第328回 利付国債(10年)	1,185,021
第133回 利付国債(20年)	1,494,025	第83回 利付国債(20年)	1,182,776
第94回 利付国債(20年)	1,381,971	第103回 利付国債(5年)	1,097,877
第95回 利付国債(20年)	1,255,771	第303回 利付国債(10年)	1,070,192
第334回 利付国債(10年)	1,221,347	第117回 利付国債(20年)	1,027,749

(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

(2017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BBB格以下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	25,682,000	28,742,282	99.3	—	60.2	27.8	11.3
合 計	25,682,000	28,742,282	99.3	—	60.2	27.8	11.3

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

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

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

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

(国内公社債の内訳)

債 券 種 別	銘 柄 名	利 率	償還年月日	額面金額	評 価 額
国債証券		%		千円	千円
	第365回 利付国債 (2年)	0.1000	2018/6/15	819,000	822,923
	第113回 利付国債 (5年)	0.3000	2018/6/20	1,483,000	1,494,211
	第115回 利付国債 (5年)	0.2000	2018/9/20	277,000	278,991
	第122回 利付国債 (5年)	0.1000	2019/12/20	1,195,000	1,204,153
	第124回 利付国債 (5年)	0.1000	2020/6/20	780,000	786,380
	第128回 利付国債 (5年)	0.1000	2021/6/20	621,000	626,800
	第 4 回 利付国債 (40年)	2.2000	2051/3/20	512,000	701,096
	第291回 利付国債 (10年)	1.3000	2018/3/20	227,000	230,852
	第292回 利付国債 (10年)	1.7000	2018/3/20	354,000	361,529
	第298回 利付国債 (10年)	1.3000	2018/12/20	88,000	90,491
	第299回 利付国債 (10年)	1.3000	2019/3/20	29,000	29,916
	第303回 利付国債 (10年)	1.4000	2019/9/20	1,289,000	1,342,029
	第306回 利付国債 (10年)	1.4000	2020/3/20	468,000	490,529
	第310回 利付国債 (10年)	1.0000	2020/9/20	487,000	506,767
	第312回 利付国債 (10年)	1.2000	2020/12/20	2,089,000	2,195,371
	第313回 利付国債 (10年)	1.3000	2021/3/20	158,000	167,143
	第318回 利付国債 (10年)	1.0000	2021/9/20	670,000	703,875
	第325回 利付国債 (10年)	0.8000	2022/9/20	60,000	62,904
	第327回 利付国債 (10年)	0.8000	2022/12/20	161,000	169,043
	第328回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/3/20	311,000	323,309
	第329回 利付国債 (10年)	0.8000	2023/6/20	1,048,000	1,104,151
	第332回 利付国債 (10年)	0.6000	2023/12/20	1,034,000	1,078,544
	第334回 利付国債 (10年)	0.6000	2024/6/20	1,138,000	1,187,127
	第 26 回 利付国債 (30年)	2.4000	2037/3/20	1,794,000	2,357,692
	第 28 回 利付国債 (30年)	2.5000	2038/3/20	955,000	1,282,421
	第 36 回 利付国債 (30年)	2.0000	2042/3/20	40,000	50,765
	第 38 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/3/20	62,000	76,196
	第 46 回 利付国債 (30年)	1.5000	2045/3/20	112,000	129,673
	第 47 回 利付国債 (30年)	1.6000	2045/6/20	165,000	195,254
	第 68 回 利付国債 (20年)	2.2000	2024/3/20	94,000	108,699
	第 70 回 利付国債 (20年)	2.4000	2024/6/20	371,000	435,884
	第 88 回 利付国債 (20年)	2.3000	2026/6/20	1,261,000	1,521,472
	第 94 回 利付国債 (20年)	2.1000	2027/3/20	604,000	724,806
	第 95 回 利付国債 (20年)	2.3000	2027/6/20	991,000	1,212,528
	第133回 利付国債 (20年)	1.8000	2031/12/20	227,000	273,194
	第140回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/9/20	1,789,000	2,129,983
	第141回 利付国債 (20年)	1.7000	2032/12/20	128,000	152,537
	第146回 利付国債 (20年)	1.7000	2033/9/20	1,791,000	2,133,027
合 計		—	—	—	28,742,282

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

(2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	28,742,282	98.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	337,160	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	29,079,442	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

(2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末
(A)資 産	29,079,442,568円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	228,558,153
公 社 債 (評価額)	28,742,282,410
未 収 利 息	103,643,076
前 払 費 用	4,958,929
(B)負 債	138,391,039
未 払 解 約 金	138,390,692
そ の 他 未 払 費 用	347
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	28,941,051,529
元 本	21,647,591,197
次 期 繰 越 損 益 金	7,293,460,332
(D)受 益 権 総 口 数	21,647,591,197口
1万口当たり基準価額 (C/D)	13,369円

- (注1) 期首元本額 18,912,024,491円
 期中追加設定元本額 11,683,569,421円
 期中一部解約元本額 8,948,002,715円
- (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるベビーファンド別内訳は、次の通りです。
- | | |
|---|----------------|
| ニッセイ国内債券インデックスSA (適格機関投資家限定) | 1,431,604,693円 |
| DCニッセイ国内債券インデックス | 7,216,483,633円 |
| ニッセイ日本バランス (標準型) SA (適格機関投資家限定) | 16,344,224円 |
| ニッセイ日本バランス (成長型) SA (適格機関投資家限定) | 3,900,496円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (債券重視型) | 1,455,745,040円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) | 3,257,122,801円 |
| DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) | 926,234,578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) | 143,573,990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) | 297,207,979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) | 132,962,893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) | 2,923,997,739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 | 3,597,636,794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) | 244,776,337円 |

◆損益の状況

当期 (2016年2月23日～2017年2月20日)

項 目	当 期
(A)配 当 等 収 益	301,096,883円
受 取 利 息	301,275,228
支 払 利 息	△ 178,345
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△ 460,859,231
売 買 益	134,159,596
売 買 損	△ 595,018,827
(C)信 託 報 酬 等	△ 13,420
(D)当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 159,775,768
(E)前 期 繰 越 損 益 金	6,408,559,672
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	4,292,301,944
(G)解 約 差 損 益 金	△ 3,247,625,516
(H)合 計 (D + E + F + G)	7,293,460,332
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	7,293,460,332

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

ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 20 期

(計算期間：2017年5月23日～2017年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く世界主要先進国の株式

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

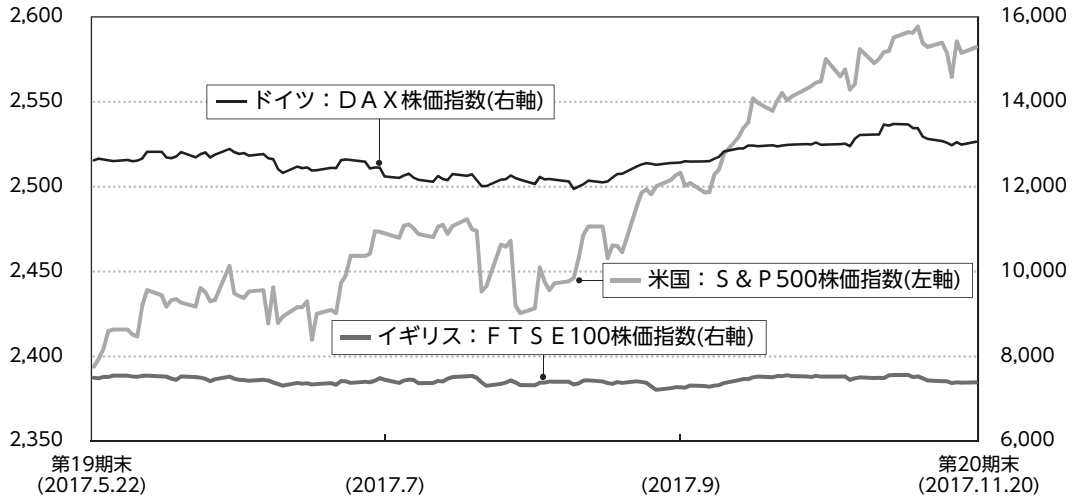
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2017年5月23日～2017年11月20日

海外株式市況

【海外主要株価指数の推移】

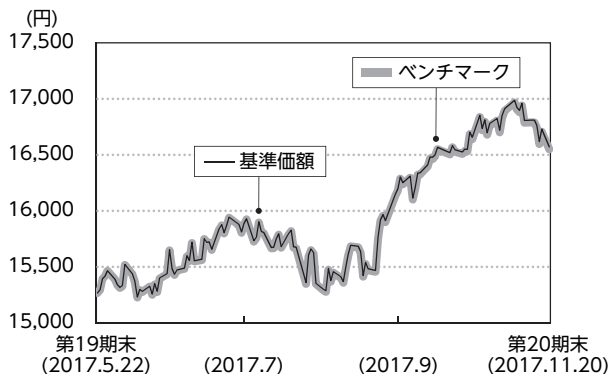


(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期は、米国をはじめとする主な海外株式市場が上昇しました。

期前半は、堅調な企業業績や米連邦準備制度理事会（F R B）による金融引き締め懸念が後退したことから株式市場は上昇しましたが、北朝鮮等の地政学リスクや米政治リスクに対する懸念の高まりから下落する場面もあり、変動の大きな展開となりました。期後半以降は、地政学リスクに対する懸念が後退する一方で、原油価格の上昇や米税制改革に対する期待の高まり、加えて堅調なマクロ経済指標や企業業績を背景に株式市場は上昇しました。

基準価額等の推移



■基準価額の主な変動要因

当期は主な海外株式市場が上昇したことから、基準価額も同様の動きとなりました。期前半は、堅調な企業業績やF R Bによる金融引き締め懸念の後退から、株式市場は上昇しましたが、地政学リスクや米政治リスクに対する懸念の高まりから下落する場面もあり、変動の大きな展開となりました。期後半は、原油価格の上昇や米税制改革に対する期待の高まり、加えて堅調なマクロ経済指標や企業業績を背景に株式市場が上昇したため、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MSCI Inc.が公表するMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）で、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。以下同じです。

ポートフォリオ

日本を除く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+8.5%となり、ベンチマーク騰落率（+8.4%）におおむね連動しました。

■ 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。

■ お知らせ

■ 約款変更

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

(2017年8月18日)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	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
16期(2015年11月20日)	14,534	△ 3.3	14,349	△ 3.5	93.7	3.6	2.4	50,880
17期(2016年 5 月20日)	12,674	△12.8	12,494	△12.9	93.9	3.3	2.6	50,956
18期(2016年11月21日)	13,411	5.8	13,235	5.9	94.1	3.5	2.4	62,415
19期(2017年 5 月22日)	15,268	13.8	15,052	13.7	94.6	2.8	2.4	82,206
20期(2017年11月20日)	16,572	8.5	16,316	8.4	94.3	2.1	2.4	105,613

(注1) ベンチマークはMSCI Inc.が公表するMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）で、設定時を10,000として、指数化しています。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。以下同じです。

(注2) 先物比率は買建比率－売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	%		%	%	%	%
(期首)2017年 5 月22日	15,268	—	15,052	—	94.6	2.8	2.4
5 月末	15,317	0.3	15,097	0.3	95.5	1.9	2.5
6 月末	15,555	1.9	15,330	1.8	95.1	2.2	2.5
7 月末	15,674	2.7	15,445	2.6	95.3	2.1	2.5
8 月末	15,616	2.3	15,383	2.2	93.9	3.3	2.4
9 月末	16,341	7.0	16,096	6.9	95.5	1.9	2.4
10月末	16,720	9.5	16,466	9.4	94.4	3.0	2.3
(期末)2017年11月20日	16,572	8.5	16,316	8.4	94.3	2.1	2.4

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2017年5月23日～2017年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料	0円	0.003%	
(株式)	(0)	(0.002)	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	2	0.011	
(株式)	(2)	(0.010)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	0.026	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(4)	(0.024)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.002)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	6	0.040	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は、「1 万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（15,934円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2017年5月23日～2017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 14,210 (24)	千米ドル 99,883 (△ 799)	百株 2,783	千米ドル 13,026
	カナダ	2,105 (△ 17)	千カナダ・ドル 8,882	227	千カナダ・ドル 552
	オーストラリア	3,553	千オーストラリア・ドル 5,445	253	千オーストラリア・ドル 329
	香港	4,505 (890)	千香港ドル 15,700	922	千香港ドル 2,163
	シンガポール	2,335	千シンガポール・ドル 1,077	82	千シンガポール・ドル 57
	ニュージーランド	326	千ニュージーランド・ドル 160	—	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス	16,189 (19,079)	千イギリス・ポンド 9,573 (△ 9)	28,820	千イギリス・ポンド 644
	イスラエル	275	千イスラエル・シェケル 641	—	千イスラエル・シェケル —
	スイス	857 (459)	千スイス・フラン 5,418 (△ 3)	566	千スイス・フラン 1,905
	デンマーク	280	千デンマーク・クローネ 8,704	31	千デンマーク・クローネ 1,006
	ノルウェー	315	千ノルウェー・クローネ 3,873 (△ 93)	8	千ノルウェー・クローネ 131
	スウェーデン	1,077 (177)	千スウェーデン・クローナ 15,535	239	千スウェーデン・クローナ 1,707

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	アイルランド	百株 678 (△5,955)	千ユーロ 250	百株 3	千ユーロ 13
		オランダ	993	2,374 (△0.000)	46	145
		ベルギー	86 (23)	647	4	36
		ルクセンブルグ	68	131	0.33	0.747
		フランス	1,367 (9)	5,817 (△ 2)	105	804
		ドイツ	1,257 (38)	5,644 (△ 46)	100	381
		ポルトガル	170	103	3	0.984
		スペイン	2,723 (8,296)	2,290 (44)	9,829	295
		イタリア	2,360 (△1,058)	1,292	198	76
		フィンランド	412	588	24	28
		オーストリア	43	163 (△ 6)	—	—
		その他	9	76	0.74	6

(注1) 金額は受渡代金です。以下同じです。

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

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

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

(2) 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
BOSTON PROPERTIES INC	0.672	82	0.053	6
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2	283	0.124	12
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.663	79	—	—
PROLOGIS INC	2	145	0.181	10
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	5	69	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.619	115	0.047	9
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.607	53	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.844	34	—	—
DUKE REALTY CORP	1	42	0.007	0.208
EQUITY RESIDENTIAL	1	109	0.126	8
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.288	74	0.023	6
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.298	38	0.006	0.762
GGP INC	3	78	0.213	4
HCP INC	2	61	0.161	4
WELLTOWER INC	1	121	0.125	9
HOST HOTELS AND RESORTS INC	3	56	—	—
外国 KIMCO REALTY CORP	1	32	0.062	1
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.832	34	—	—
MACERICH CO/THE	0.664	37	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.466	48	—	—
PUBLIC STORAGE	0.883	184	0.054	11
REGENCY CENTERS CORP	0.628	40	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	223	0.180	27
SL GREEN REALTY CORP	0.406	41	0.006	0.607
UDR INC	1	42	—	—
VENTAS INC	1	105	0.122	8
VORNADO REALTY TRUST	0.768	60	0.059	5
REALTY INCOME CORP	1	86	0.090	4
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.524	41	0.008	0.621
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.725	85	0.055	6
IRON MOUNTAIN INC	1	47	—	—
AGNC INVESTMENT CORP	2	53	0.028	0.603
AMERICAN TOWER REIT INC	1	256	0.147	19
EQUINIX INC	0.482	217	0.026	11
VEREIT	5	47	0.173	1

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
(アメリカ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1	29	—	—
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	3	40	0.055	0.721
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.523	76	0.136	18
JBG SMITH PROPERTIES	—	—	1	64
	(1)			
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.336	10	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	0.735	16	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.763	18	—	—
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
DEXUS	7	69	—	—
GPT GROUP	12	61	—	—
GOODMAN GROUP	7	62	0.051	0.430
STOCKLAND	11	50	0.138	0.608
WESTFIELD CORP	8	68	0.265	1
MIRVAC GROUP	24	55	—	—
VICINITY CENTRES	22	59	0.942	2
SCENTRE GROUP	24	98	1	8
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	10	635	1	62
(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	15	39	—	—
		(△0.282)		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	10	17	—	—
CAPITALAND MALL TRUST	11	22	—	—
SUNTEC REIT	14	26	—	—
		(△0.352)		
CAPITALAND COMMERCIAL-RIGHTS	—	—	8	2
	(8)			
(イギリス)		千イギリス・ポンド		千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	5	33	0.055	0.336
HAMMERSON PLC	4	24	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	3	31	0.044	0.450
	(△ 1)	(△ 11)		
SEGRO PLC	9	48	—	—
INTU PROPERTIES PLC	2	6	—	—

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
(ユーロ／フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.444	96	0.034	7
KLEPIERRE	1	38	0.010	0.338
外国 GECINA SA	0.416	55	—	—
FONCIERE DES REGIONS	0.153	12	—	—
ICADE	0.100	7	—	—
GECINA SA-RTS	—	—	0.912	2
	(0.912)			

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

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
	20,633	20,952	—	—

(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

2017年5月23日～2017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	21	374,180	17,541	YAHOO! INC	19	115,387	5,827
MICROSOFT CORP	30	259,276	8,379	SYNGENTA AG	2	97,942	48,703
AMAZON.COM INC	1	206,340	112,939	BRITISH AMERICAN TOB-SP ADR	10	70,873	7,002
FACEBOOK INC-A	10	203,605	18,765	ACTELION LTD-REG	2	67,434	31,823
EXXON MOBIL CORP	20	183,915	8,977	ENBRIDGE INC	13	58,322	4,287
JOHNSON & JOHNSON	11	168,540	15,033	APPLE INC	2	50,169	17,240
JPMORGAN CHASE & CO	14	155,949	10,401	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	4	40,558	10,079
ALPHABET INC-CL C	1	150,350	107,163	CHRISTIAN DIOR SE	1	37,220	31,094
ALPHABET INC-CL A	1	145,769	109,190	WHOLE FOODS MARKET INC	7	35,464	4,637
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	19	142,468	7,381	MOBILEYE NV	4	32,705	7,004

(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

2017年11月20日現在

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
3M CO	130	153	3,525	395,525	資本財
ABBOTT LABORATORIES	373	446	2,480	278,240	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	352	409	3,836	430,439	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCENTURE PLC	134	159	2,319	260,207	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	129	184	1,181	132,529	ソフトウェア・サービス
ACUITY BRANDS INC	9	11	183	20,550	資本財
ADOBE SYSTEMS INC	108	127	2,322	260,557	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	15	18	168	18,928	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	170	206	235	26,375	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	30	37	187	21,028	資本財
AES CORP	132	171	181	20,409	公益事業
AETNA INC	76	85	1,479	165,982	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	11	14	269	30,188	各種金融
AFLAC INC	88	101	852	95,670	保険
AGCO CORP	12	15	102	11,449	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	70	82	570	64,009	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	44	55	904	101,442	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	37	44	246	27,609	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	24	28	387	43,460	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	48	57	640	71,857	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	14	19	497	55,856	ヘルスケア機器・サービス
ALKERMES PLC	31	39	190	21,361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGHANY CORP	3	3	223	25,108	保険
ALLEGION PLC	－	24	205	23,060	資本財
ALLERGAN PLC	81	86	1,512	169,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	11	12	290	32,569	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	50	59	265	29,757	公益事業
ALLSTATE CORP	79	93	939	105,401	保険
ALLY FINANCIAL INC	87	117	313	35,220	各種金融
ALPHABET INC-CL A	64	76	7,936	890,450	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	67	80	8,195	919,455	ソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	423	496	3,300	370,332	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	87	104	11,819	1,326,049	小売
AMERCO	1	1	65	7,345	運輸
AMEREN CORPORATION	53	63	399	44,818	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	25	32	152	17,066	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	
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	107	126	969	108,767	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	168	195	1,830	205,418	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	－	18	192	21,628	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	222	236	1,421	159,444	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	39	46	413	46,430	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	34	39	618	69,413	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	35	42	331	37,228	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	56	67	329	36,970	各種金融
AMETEK INC	50	59	415	46,609	資本財
AMGEN INC	161	189	3,216	360,905	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	67	78	705	79,110	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	121	143	692	77,690	エネルギー
ANALOG DEVICES INC	78	94	852	95,680	半導体・半導体製造装置
ANDEAVOR	25	39	412	46,279	エネルギー
ANSYS INC	18	21	330	37,078	ソフトウェア・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	31	53	105	11,882	エネルギー
ANTHEM INC	57	68	1,504	168,816	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	57	67	954	107,119	保険
APACHE CORP	82	97	400	44,970	エネルギー
APPLE INC	1,158	1,342	22,838	2,562,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	234	276	1,562	175,273	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	46	62	255	28,718	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26	33	321	36,065	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	124	145	574	64,405	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	95	101	243	27,287	資本財
ARISTA NETWORKS INC	－	12	283	31,819	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	17	22	176	19,813	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	38	46	305	34,223	保険
ASSURANT INC	11	13	135	15,180	保険
AT&T INC	1,335	1,586	5,474	614,210	電気通信サービス
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	－	26	131	14,744	保険
ATMOS ENERGY CORP	21	27	245	27,570	公益事業
AUTODESK INC	43	51	650	73,003	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	19	22	275	30,958	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	97	115	1,278	143,400	ソフトウェア・サービス
AUTONATION INC	13	15	80	9,069	小売
AUTOZONE INC	6	7	455	51,125	小売
AVERY DENNISON CORP	17	22	247	27,809	素材
AVNET INC	25	30	119	13,439	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	43	55	185	20,769	素材
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	17	19	102	11,550	保険
BAKER HUGHES A GE CO	－	103	320	35,922	エネルギー
BAKER HUGHES INC	86	－	－	－	エネルギー
BALL CORP	72	86	344	38,695	素材
BANK OF AMERICA CORP	2,193	2,560	6,816	764,716	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	229	267	1,401	157,243	各種金融
BARD (C.R.) INC	15	18	622	69,829	ヘルスケア機器・サービス
BAXTER INTERNATIONAL INC	106	126	804	90,300	ヘルスケア機器・サービス
BB&T CORPORATION	175	208	974	109,277	銀行
BECTON DICKINSON & CO	46	58	1,290	144,740	ヘルスケア機器・サービス
BED BATH & BEYOND INC	29	34	71	8,036	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	265	321	5,814	652,294	各種金融
BEST BUY CO INC	61	71	396	44,496	小売
BIOGEN INC	47	54	1,725	193,557	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	37	44	372	41,814	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	26	31	1,474	165,433	各種金融
BOEING CO	127	147	3,871	434,371	資本財
BORGWARNER INC	45	54	282	31,746	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	295	352	996	111,788	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	－	21	120	13,528	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	362	424	2,600	291,697	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM LTD	87	103	2,808	315,034	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	24	30	271	30,509	ソフトウェア・サービス
BROWN-FORMAN CORP -CL B	45	52	307	34,531	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	30	35	235	26,425	食品・飲料・タバコ
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	32	37	297	33,361	運輸
CA Inc	67	79	259	29,134	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	101	119	352	39,530	エネルギー
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	62	72	321	36,085	ソフトウェア・サービス
CALPINE CORP	68	－	－	－	公益事業
CAMPBELL SOUP CO	43	46	233	26,166	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	104	124	1,089	122,185	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	69	81	466	52,280	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	41	47	332	37,274	小売
CARNIVAL CORP	75	89	589	66,172	消費者サービス
CATERPILLAR INC	127	151	2,065	231,697	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	－	25	301	33,858	各種金融
CBRE GROUP INC	65	77	333	37,412	不動産

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CBS CORP-CL B	85	95	542	60,881	メディア
CDK GLOBAL INC	25	33	226	25,417	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	29	40	268	30,105	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	30	35	374	42,035	素材
CELGENE CORP	168	201	2,092	234,782	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	37	44	421	47,295	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	90	106	309	34,708	公益事業
CENTURYLINK INC	119	257	380	42,709	電気通信サービス
CERNER CORP	66	76	500	56,115	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	46	60	213	23,930	素材
CHARLES SCHWAB CORP	258	309	1,381	155,021	各種金融
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	47	55	1,901	213,351	メディア
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	28	33	341	38,368	ソフトウェア・サービス
CHENIERE ENERGY INC	43	52	255	28,629	エネルギー
CHEVRON CORP	409	487	5,594	627,597	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	6	191	21,461	消費者サービス
CHUBB LTD	100	119	1,783	200,047	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	56	64	286	32,171	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	55	65	1,304	146,343	ヘルスケア機器・サービス
CIMAREX ENERGY CO	20	24	284	31,936	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	33	40	293	32,974	保険
CINTAS CORP	18	23	343	38,493	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	1,090	1,287	4,622	518,628	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIT GROUP INC	40	37	178	20,075	銀行
CITIGROUP INC	618	708	5,052	566,785	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	110	129	495	55,588	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	33	38	335	37,647	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	28	33	445	50,013	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	73	87	1,217	136,556	各種金融
CMS ENERGY CORP	62	73	364	40,947	公益事業
COCA-COLA CO	889	1,044	4,775	535,774	食品・飲料・タバコ
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	131	151	1,104	123,923	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	183	216	1,554	174,356	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	1,036	1,220	4,414	495,317	メディア
COMERICA INC	37	45	358	40,242	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	－	48	165	18,620	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONAGRA BRANDS INC	90	109	390	43,812	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	31	38	527	59,202	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	268	317	1,592	178,682	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CONSOLIDATED EDISON INC	66	79	684	76,827	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	38	44	955	107,229	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	18	22	101	11,442	エネルギー
COOPER COS INC/THE	10	12	300	33,735	ヘルスケア機器・サービス
CORE LABORATORIES N.V.	8	10	106	11,952	エネルギー
CORNING INC	206	236	748	83,941	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTAR GROUP INC	6	8	258	28,992	ソフトウェア・サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	94	112	1,927	216,279	食品・生活必需品小売り
COTY INC-CL A	105	124	211	23,732	家庭用品・パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	28	35	208	23,382	素材
CSX CORP	204	239	1,193	133,891	運輸
CUMMINS INC	34	40	652	73,253	資本財
CVS HEALTH CORP	231	261	1,851	207,739	食品・生活必需品小売り
D&B CORP	7	—	—	—	商業・専門サービス
DANAHER CORP	135	160	1,498	168,115	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	23	31	261	29,367	消費者サービス
DAVITA INC	35	40	220	24,758	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	58	69	948	106,380	資本財
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	48	52	428	48,070	ソフトウェア・サービス
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	58	68	680	76,382	自動車・自動車部品
DELTA AIR LINES INC	40	48	242	27,152	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	50	58	396	44,508	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	102	127	494	55,445	エネルギー
DEXCOM INC	16	20	112	12,585	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	18	22	243	27,290	エネルギー
DICK'S SPORTING GOODS INC	17	20	59	6,678	小売
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	85	97	636	71,385	各種金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	30	36	63	7,170	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	44	53	87	9,857	メディア
DISH NETWORK CORP	49	59	299	33,606	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	61	70	602	67,625	小売
DOLLAR TREE INC	51	60	576	64,662	小売
DOMINION ENERGY INC	136	162	1,321	148,289	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	10	12	220	24,792	消費者サービス
DOVER CORP	33	39	376	42,250	資本財
DOW CHEMICAL CO	243	—	—	—	素材
DOWDUPONT INC	—	588	4,160	466,814	素材
DR HORTON INC	76	91	442	49,596	耐久消費財・アパレル
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	39	47	414	46,461	食品・飲料・タバコ

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	
DTE ENERGY COMPANY	39	46	525	58,997	公益事業
DUKE ENERGY CORP	150	180	1,598	179,364	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	61	72	706	79,251	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL	59	70	310	34,884	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	－	36	212	23,833	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	31	37	336	37,724	素材
EATON CORP PLC	97	114	868	97,428	資本財
EATON VANCE CORP	22	28	148	16,646	各種金融
EBAY INC	230	264	941	105,656	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	57	67	885	99,294	素材
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	11	－	－	－	家庭用品・パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	71	84	681	76,475	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	46	54	578	64,889	ヘルスケア機器・サービス
EI DU PONT DE NEMOURS & CO	188	－	－	－	素材
ELECTRONIC ARTS INC	65	79	868	97,387	ソフトウェア・サービス
ELI LILLY & CO	215	255	2,119	237,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	139	165	990	111,132	資本財
ENBRIDGE INC	136	－	－	－	エネルギー
ENTERGY CORP	39	46	403	45,257	公益事業
ENVISION HEALTHCARE CORP	23	28	82	9,220	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	124	148	1,505	168,958	エネルギー
EQT CORP	37	44	262	29,477	エネルギー
EQUIFAX INC	25	30	345	38,708	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC	48	57	716	80,408	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	8	10	235	26,381	保険
EVERSOURCE ENERGY	69	82	527	59,171	公益事業
EXELON CORP	201	238	985	110,534	公益事業
EXPEDIA INC	26	32	396	44,526	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	41	49	293	32,916	運輸
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	133	152	944	105,993	ヘルスケア機器・サービス
EXXON MOBIL CORP	900	1,090	8,753	982,050	エネルギー
F5 NETWORKS INC	14	16	207	23,250	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	508	608	10,900	1,222,893	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	62	74	359	40,343	資本財
FEDEX CORP	55	66	1,425	159,962	運輸
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	67	85	785	88,099	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	162	192	546	61,336	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	64	89	150	16,860	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	33	40	373	41,870	銀行

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FIRSTENERGY CORP	93	114	397	44,623	公益事業
FISERV INC	47	54	704	79,078	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	20	23	423	47,511	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	117	136	253	28,425	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLIR SYSTEMS INC	27	34	160	17,988	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWSERVE CORP	25	32	128	14,380	資本財
FLUOR CORP	27	34	162	18,222	資本財
FMC CORP	27	34	320	35,920	素材
FNF GROUP	53	66	264	29,708	保険
FOOT LOCKER INC	28	31	127	14,279	小売
FORD MOTOR CO	805	955	1,147	128,756	自動車・自動車部品
FORTINET INC	29	37	151	16,990	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	67	80	580	65,097	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	33	39	256	28,756	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	79	85	345	38,774	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	280	353	489	54,900	素材
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	236	—	—	—	電気通信サービス
GAP INC	46	60	178	20,008	小売
GARMIN LTD	23	30	188	21,109	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	18	23	275	30,872	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	56	65	1,303	146,217	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,921	2,234	4,069	456,567	資本財
GENERAL MILLS INC	128	148	795	89,221	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	297	348	1,531	171,784	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	32	37	325	36,477	小売
GILEAD SCIENCES INC	285	336	2,434	273,125	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	33	39	393	44,160	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	77	91	2,170	243,482	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	56	64	193	21,692	自動車・自動車部品
H&R BLOCK INC	43	51	135	15,203	消費者サービス
HALLIBURTON CO	187	223	933	104,736	エネルギー
HANESBRANDS INC	76	93	183	20,560	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	38	45	213	23,971	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	27	31	446	50,046	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	81	94	528	59,248	保険
HASBRO INC	24	29	278	31,197	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	65	75	570	63,975	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	51	181	20,316	資本財
HELMERICH & PAYNE	21	26	150	16,834	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HENRY SCHEIN INC	17	40	281	31,630	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	31	37	406	45,618	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	61	73	326	36,605	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	360	421	577	64,765	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	42	50	376	42,262	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	32	41	186	20,871	エネルギー
HOLOGIC INC	54	72	288	32,403	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	264	307	5,165	579,485	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	157	186	2,729	306,195	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	259	307	216	24,316	不動産
HORMEL FOODS CORP	62	74	246	27,667	食品・飲料・タバコ
HP INC	371	432	941	105,652	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	32	37	866	97,250	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	234	278	376	42,237	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	10	11	274	30,802	資本財
IDEX CORP	－	19	251	28,199	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	19	22	353	39,634	ヘルスケア機器・サービス
IHS MARKIT LTD	77	104	456	51,217	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	68	80	1,257	141,053	資本財
ILLUMINA INC	31	37	785	88,171	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	36	44	472	53,034	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND PLC	55	65	559	62,817	資本財
INGREDION INC	14	18	245	27,528	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	1,028	1,211	5,406	606,607	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	129	152	1,014	113,771	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	196	229	3,419	383,662	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	17	20	302	33,960	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	84	100	547	61,383	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	87	102	196	21,996	メディア
INTUIT INC	52	62	980	109,999	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	8	28	1,116	125,316	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	88	104	363	40,829	各種金融
IQVIA HOLDINGS INC	32	36	378	42,506	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	－	20	224	25,236	ソフトウェア・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	23	30	179	20,108	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	54	56	363	40,805	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	46	58	248	27,837	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12	15	206	23,204	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	19	23	240	27,006	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	
JM SMUCKER CO	25	29	340	38,253	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	590	693	9,570	1,073,691	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	203	241	878	98,517	資本財
JONES LANG LASALLE INC	8	11	170	19,126	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	776	914	8,972	1,006,608	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	74	98	259	29,116	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	23	28	289	32,424	運輸
KELLOGG CO	57	67	442	49,679	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	233	280	514	57,696	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	77	91	1,046	117,366	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	412	516	879	98,640	エネルギー
KLA-TENCOR CORP	34	40	410	46,106	半導体・半導体製造装置
KOHL'S CORP	35	44	192	21,625	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	132	156	1,245	139,731	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	194	234	548	61,533	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	52	62	314	35,231	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	16	19	368	41,352	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	22	26	395	44,398	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	35	41	874	98,086	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	94	101	675	75,755	消費者サービス
LEAR CORP	15	17	309	34,707	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	26	33	155	17,410	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	－	36	225	25,255	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP - B SHS	－	1	5	568	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	44	52	308	34,639	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	－	10	195	21,880	資本財
LEUCADIA NATIONAL CORP	64	82	208	23,366	各種金融
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	67	－	－	－	電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND-C	23	28	255	28,655	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	50	54	164	18,509	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	132	150	436	49,000	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP A	84	108	269	30,180	小売
LIBERTY LILAC GROUP-C	21	－	－	－	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	21	22	92	10,391	メディア
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	37	46	192	21,614	メディア
LINCOLN NATIONAL CORP	49	57	424	47,650	保険
LKQ CORP	67	79	300	33,695	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	57	67	2,080	233,418	資本財
LOEWS CORP	61	73	362	40,625	保険

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LOWE'S COS INC	188	219	1,761	197,646	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	21	25	171	19,223	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	74	87	911	102,297	素材
M&T BANK CORP	30	35	568	63,752	銀行
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	16	20	134	15,112	運輸
MACY'S INC	64	77	158	17,789	小売
MALLINCKRODT PLC	20	23	53	5,970	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MANPOWER GROUP	13	17	216	24,235	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	183	217	326	36,663	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	114	133	830	93,124	エネルギー
MARKEL CORP	3	3	384	43,175	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	71	82	1,037	116,393	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	111	132	1,092	122,581	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	13	16	335	37,589	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	85	102	208	23,432	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	71	82	326	36,620	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	208	244	3,639	408,300	ソフトウェア・サービス
MATTEL INC	67	84	157	17,658	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	61	72	389	43,667	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	24	29	288	32,406	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	180	209	3,496	392,304	消費者サービス
MCKESSON CORP	49	54	770	86,393	ヘルスケア機器・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	40	－	－	－	食品・飲料・タバコ
MEDNAX INC	18	22	110	12,436	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	302	352	2,799	314,046	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	37	62	157	17,711	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	8	10	292	32,802	ソフトウェア・サービス
MERCK & CO INC	598	704	3,886	435,991	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	201	234	1,210	135,802	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	5	6	421	47,282	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	99	117	389	43,657	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	32	39	224	25,184	耐久消費財・アパレル
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	46	59	539	60,505	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	225	270	1,246	139,871	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	1,603	1,887	15,556	1,745,316	ソフトウェア・サービス
MIDDLEBY CORP	11	14	167	18,762	資本財
MOBILEYE NV	38	－	－	－	ソフトウェア・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	13	16	442	49,654	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	40	48	386	43,373	食品・飲料・タバコ

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	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	335	390	1,650	185,155	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	95	113	1,338	150,185	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	86	102	635	71,345	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	37	44	651	73,037	各種金融
MORGAN STANLEY	304	357	1,738	195,074	各種金融
MOSAIC CO/THE	71	85	195	21,966	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	33	42	388	43,620	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	18	23	297	33,429	各種金融
MURPHY OIL CORP	32	38	107	12,061	エネルギー
MYLAN NV	98	117	440	49,392	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	22	29	225	25,323	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	81	97	311	34,938	エネルギー
NAVIENT CORP	59	68	85	9,548	各種金融
NETAPP INC	60	69	368	41,315	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	93	110	2,143	240,506	小売
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	96	122	155	17,446	銀行
NEWELL BRANDS INC	94	124	355	39,872	耐久消費財・アパレル
NEWFIELD EXPLORATION CO	39	49	151	16,986	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	114	136	493	55,411	素材
NEWS CORP - CLASS A	76	97	154	17,353	メディア
NEXTERA ENERGY INC	101	120	1,884	211,474	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	77	91	334	37,533	商業・専門サービス
NIKE INC	290	340	2,013	225,864	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	65	85	230	25,848	公益事業
NOBLE ENERGY INC	93	119	310	34,862	エネルギー
NORDSTROM INC	25	30	124	14,013	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	63	75	962	107,973	運輸
NORTHERN TRUST CORP	46	55	525	58,963	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	36	42	1,268	142,306	資本財
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	31	46	255	28,719	消費者サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	54	68	99	11,149	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	69	81	448	50,272	素材
NVIDIA CORP	116	153	3,236	363,085	半導体・半導体製造装置
NVR INC	—	0.92	299	33,632	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	63	89	1,029	115,481	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	165	196	1,342	150,567	エネルギー
OGE ENERGY CORP	39	51	182	20,456	公益事業
OMNICOM GROUP	51	61	423	47,537	メディア
ONEOK INC	45	97	495	55,601	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ORACLE CORP	668	793	3,885	435,908	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	20	23	515	57,884	小売
PACCAR INC	75	90	601	67,434	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	19	24	273	30,636	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	20	23	338	37,979	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PARKER HANNIFIN CORP	28	34	623	69,961	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	42	55	142	15,937	エネルギー
PATTERSON COS INC	16	19	71	7,969	ヘルスケア機器・サービス
PAYCHEX INC	70	82	538	60,437	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	235	293	2,243	251,647	ソフトウェア・サービス
PENTAIR PLC	37	44	303	34,099	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	59	85	155	17,394	銀行
PEPSICO INC	311	367	4,218	473,261	食品・飲料・タバコ
PERRIGO CO PLC	31	33	285	32,020	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	1,317	1,535	5,432	609,469	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	110	131	712	79,914	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	336	400	4,106	460,653	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	101	112	1,040	116,770	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	24	29	262	29,439	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	36	43	665	74,628	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	27	34	72	8,092	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	105	124	1,651	185,247	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	12	15	182	20,476	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	57	65	749	84,119	素材
PPL CORPORATION	148	176	641	71,922	公益事業
PRAXAIR INC	62	73	1,109	124,521	素材
PRICELINE GROUP INC/THE	10	12	2,211	248,162	小売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	61	73	504	56,623	保険
PROCTER & GAMBLE CO	554	658	5,820	652,948	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	125	149	771	86,560	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	92	109	1,211	135,872	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	110	130	671	75,388	公益事業
PULTE GROUP INC	58	73	236	26,520	耐久消費財・アパレル
PVH CORP	16	20	267	30,018	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	27	32	252	28,282	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	320	380	2,536	284,539	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	29	35	327	36,721	ヘルスケア機器・サービス
RALPH LAUREN CORP	11	13	117	13,146	耐久消費財・アパレル
RANGE RESOURCES CORP	36	59	106	11,974	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	27	33	277	31,139	各種金融
RAYTHEON CO	63	74	1,369	153,669	資本財
RED HAT INC	39	45	576	64,674	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	16	20	788	88,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	265	307	485	54,503	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	12	16	247	27,734	保険
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8	10	138	15,559	保険
REPUBLIC SERVICES INC	51	61	382	42,955	商業・専門サービス
RESMED INC	30	36	308	34,664	ヘルスケア機器・サービス
REYNOLDS AMERICAN INC	185	－	－	－	食品・飲料・タバコ
RITE AID CORP	209	－	－	－	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	25	31	173	19,512	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	27	33	642	72,131	資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	34	41	551	61,880	資本財
ROLLINS INC	－	23	106	11,922	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	22	26	674	75,693	資本財
ROSS STORES INC	85	100	727	81,624	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	37	44	548	61,547	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	56	66	1,067	119,810	各種金融
SABRE CORP	42	50	98	11,058	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	140	174	1,875	210,405	ソフトウェア・サービス
SCANA CORP	30	35	153	17,212	公益事業
SCHLUMBERGER LTD	301	358	2,218	248,856	エネルギー
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	16	22	180	20,287	メディア
SEAGATE TECHNOLOGY	63	76	300	33,730	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	40	50	231	26,015	素材
SEATTLE GENETICS INC	19	25	149	16,789	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEI INVESTMENTS COMPANY	26	34	231	25,971	各種金融
SEMPRA ENERGY	51	61	736	82,619	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	33	43	209	23,541	資本財
SERVICENOW INC	36	43	558	62,686	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17	21	835	93,690	素材
SIGNATURE BANK	10	14	182	20,435	銀行
SIGNET JEWELERS LTD	11	14	112	12,612	小売
SIRIUS XM HOLDINGS INC	382	434	237	26,616	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	40	47	521	58,495	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	29	37	221	24,861	資本財
SNAP-ON INC	12	14	233	26,142	資本財
SOUTHERN CO	213	256	1,309	146,955	公益事業

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
SOUTHWEST AIRLINES CO	31	40	219	24,576	運輸
SOUTHWESTERN ENERGY CO	98	－	－	－	エネルギー
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	5	6	71	8,069	家庭用品・パーソナル用品
SPLUNK INC	27	35	290	32,630	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	158	203	126	14,225	電気通信サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	－	44	178	20,033	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	32	39	642	72,041	資本財
STAPLES INC	127	－	－	－	小売
STARBUCKS CORP	315	372	2,117	237,601	消費者サービス
STATE STREET CORP	83	96	892	100,093	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	－	61	227	25,536	素材
STERICYCLE INC	16	21	134	15,124	商業・専門サービス
STRYKER CORP	73	86	1,345	150,946	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	105	123	714	80,146	銀行
SVB FINANCIAL GROUP	－	13	287	32,306	銀行
SYMANTEC CORP	134	156	439	49,335	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	179	208	705	79,147	各種金融
SYNOPSIS INC	32	38	340	38,234	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	112	130	718	80,621	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	52	61	592	66,417	各種金融
TAPESTRY INC	60	72	301	33,810	耐久消費財・アパレル
TARGA RESOURCES CORP	39	55	232	26,058	エネルギー
TARGET CORP	115	134	782	87,782	小売
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	2	2	32	3,593	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TE CONNECTIVITY LTD	77	91	866	97,231	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TECHNIPFMC PLC	95	112	300	33,666	エネルギー
TEGNA INC	40	－	－	－	メディア
TELEFLEX INC	9	11	308	34,614	ヘルスケア機器・サービス
TESARO INC	－	9	77	8,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TESLA, INC.	28	33	1,066	119,644	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	198	234	324	36,359	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	216	256	2,505	281,044	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	58	68	363	40,808	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	85	100	1,915	214,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	26	32	303	34,066	小売
TIME WARNER INC	167	200	1,776	199,298	メディア
TJX COS INC	141	165	1,175	131,842	小売
T-MOBILE US INC	63	76	458	51,411	電気通信サービス
TOLL BROTHERS INC	30	39	183	20,574	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	
TORCHMARK CORP	23	28	242	27,184	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	35	42	315	35,418	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	27	32	212	23,821	小売
TRANSDIGM GROUP INC	11	13	353	39,697	資本財
TRAVELERS COS INC/THE	61	71	930	104,376	保険
TRIMBLE INC	50	65	269	30,223	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	23	27	84	9,489	小売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	96	116	354	39,731	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	229	269	839	94,168	メディア
TWITTER INC	118	159	331	37,183	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	63	74	577	64,766	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	35	45	216	24,309	公益事業
ULTA BEAUTY INC	12	15	326	36,632	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	36	45	58	6,612	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	36	44	52	5,842	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	179	209	2,419	271,463	運輸
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	15	19	116	13,045	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	151	179	2,029	227,705	運輸
UNITED RENTALS INC	18	21	325	36,573	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	169	195	2,281	255,913	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	8	11	137	15,457	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	206	248	5,206	584,101	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	19	22	223	25,064	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	49	58	310	34,822	保険
US BANCORP	368	432	2,246	251,989	銀行
VAIL RESORTS INC	－	10	235	26,470	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	97	114	952	106,874	エネルギー
VALSPAR CORP	15	－	－	－	素材
VALVOLINE INC	33	－	－	－	素材
VANTIV INC - CL A	35	41	293	32,963	ソフトウェア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	18	23	257	28,892	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	－	26	164	18,510	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	19	23	271	30,410	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	34	40	373	41,862	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	887	1,052	4,781	536,405	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	53	64	944	106,008	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	71	87	620	69,614	耐久消費財・アパレル
VIACOM INC-CLASS B	75	91	238	26,703	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	405	475	5,221	585,775	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	
VMWARE INC-CLASS A	13	18	223	25,029	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	38	47	199	22,404	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	28	34	419	47,029	素材
WABCO HOLDINGS INC	10	13	190	21,419	資本財
WABTEC CORP	17	21	160	17,974	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	199	236	1,683	188,831	食品・生活必需品小売り
WAL-MART STORES INC	335	389	3,799	426,274	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	328	403	4,174	468,293	メディア
WASTE CONNECTIONS INC	38	68	473	53,146	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	96	114	920	103,257	商業・専門サービス
WATERS CORP	17	20	409	45,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	184	224	76	8,632	エネルギー
WEC ENERGY GROUP INC	69	81	558	62,678	公益事業
WELLS FARGO & CO	1,035	1,221	6,614	742,132	銀行
WESTAR ENERGY INC	28	37	206	23,135	公益事業
WESTERN DIGITAL CORP	61	74	683	76,729	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	104	120	238	26,702	ソフトウェア・サービス
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	54	64	382	42,888	素材
WEYERHAEUSER CO	162	192	699	78,527	不動産
WHIRLPOOL CORP	16	19	314	35,312	耐久消費財・アパレル
WHOLE FOODS MARKET INC	69	－	－	－	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS INC	177	212	579	65,034	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	28	32	527	59,172	保険
WORKDAY INC-CLASS A	26	33	377	42,311	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	19	24	162	18,178	保険
WR GRACE & CO	14	17	128	14,410	素材
WW GRAINGER INC	12	14	280	31,514	資本財
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	23	26	291	32,712	消費者サービス
WYNN RESORTS LTD	17	21	320	35,945	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	111	131	670	75,203	公益事業
XEROX CORP	169	55	156	17,531	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XILINX INC	54	63	458	51,383	半導体・半導体製造装置
XL GROUP LTD	58	67	260	29,188	保険
XYLEM INC	36	46	308	34,635	資本財
YAHOO! INC	196	－	－	－	ソフトウェア・サービス
YUM! BRANDS INC	75	85	669	75,095	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	32	48	170	19,114	電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C W/I	22	25	102	11,528	ソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	43	51	579	64,961	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	
ZIONS BANCORPORATION		－	51	238	26,792	銀行
ZOETIS INC		102	126	897	100,648	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	67,556	79,008	579,465	65,010,249	
	銘柄数<比率>	598	602	－	<61.6%>	
(カナダ)				千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD		48	59	337	29,665	素材
AGRIUM INC		28	35	487	42,802	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		91	108	689	60,498	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD		33	41	120	10,578	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		69	86	138	12,189	エネルギー
ATCO LTD -CL 'I'		16	19	89	7,858	公益事業
BANK OF MONTREAL		139	167	1,659	145,672	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA		261	309	2,615	229,605	銀行
BARRICK GOLD CORP		253	299	537	47,199	素材
BCE INC		32	44	272	23,946	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD		100	126	166	14,647	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BOMBARDIER INC		385	467	144	12,729	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC		194	230	1,219	107,097	各種金融
CAE INC		54	68	154	13,584	資本財
CAMECO CORP		78	95	114	10,058	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE		85	110	1,271	111,618	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO		168	197	2,007	176,282	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		240	287	1,278	112,221	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		30	38	832	73,102	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A		13	17	276	24,284	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A		26	32	123	10,809	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B		5	36	217	19,132	素材
CENOVUS ENERGY INC		181	267	347	30,469	エネルギー
CGI GROUP INC		47	54	373	32,792	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP		48	67	191	16,796	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC		4	5	387	34,057	ソフトウェア・サービス
CRESCENT POINT ENERGY CORP		106	128	123	10,806	エネルギー
DOLLARAMA INC		23	28	425	37,398	小売
ELDORADO GOLD CORP		140	－	－	－	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP		78	94	91	8,067	各種金融
EMERA INC		12	15	75	6,661	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'		32	42	102	9,019	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC		203	422	1,896	166,504	エネルギー
ENCANA CORP		210	249	377	33,151	エネルギー

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	5	7	493	43,368	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	33	40	126	11,143	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	27	41	85	7,545	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	135	176	263	23,106	素材
FORTIS INC	89	109	520	45,707	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	38	46	499	43,899	素材
GEORGE WESTON LTD	10	12	141	12,446	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	44	58	229	20,120	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	184	222	380	33,378	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	58	69	245	21,528	保険
HUSKY ENERGY INC	70	83	131	11,589	エネルギー
HYDRO ONE LTD	39	79	179	15,717	公益事業
IGM FINANCIAL INC	19	21	95	8,352	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	64	77	306	26,937	エネルギー
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	20	26	157	13,805	保険
INTACT FINANCIAL CORP	28	34	366	32,191	保険
INTER PIPELINE LTD	71	96	253	22,245	エネルギー
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	16	19	47	4,152	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	37	47	173	15,229	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	245	311	172	15,107	素材
LINAMAR CORP	9	11	78	6,908	自動車・自動車部品
LOBLAW COS LTD	48	56	392	34,457	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	83	93	637	55,965	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	427	508	1,368	120,133	保険
METHANEX CORP	17	21	135	11,934	素材
METRO INC	46	59	243	21,357	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	73	87	556	48,865	銀行
ONEX CORPORATION	17	22	204	17,974	各種金融
OPEN TEXT CORP	57	68	290	25,549	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	86	138	614	53,917	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	32	39	64	5,699	エネルギー
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	182	215	526	46,227	素材
POWER CORP OF CANADA	81	91	301	26,470	保険
POWER FINANCIAL CORP	49	55	196	17,238	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	40	53	175	15,433	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	48	57	480	42,194	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	81	96	662	58,179	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	322	374	3,781	332,029	銀行
SAPUTO INC	51	55	241	21,222	食品・飲料・タバコ

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	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		47	59	100	8,848	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		94	113	320	28,171	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A		－	20	278	24,450	ソフトウェア・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC		30	45	255	22,408	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC		133	157	793	69,672	保険
SUNCOR ENERGY INC		362	430	1,944	170,729	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B		122	146	408	35,898	素材
THOMSON REUTERS CORP		72	75	421	36,971	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK		403	474	3,490	306,501	銀行
TOURMALINE OIL CORP		45	54	131	11,555	エネルギー
TRANSCANADA CORP		188	225	1,410	123,805	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		198	241	94	8,282	素材
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC		64	79	149	13,129	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERESEN INC		61	－	－	－	エネルギー
VERMILION ENERGY INC		23	27	123	10,867	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD		12	16	135	11,866	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		93	112	301	26,498	素材
YAMANA GOLD INC		185	225	79	6,940	素材
小計	株数・金額	8,591	10,451	45,412	3,987,245	
	銘柄数<比率>	90	89	－	<3.8%>	
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル		
AGL ENERGY LTD		157	179	447	37,954	公益事業
ALUMINA LTD		512	619	138	11,708	素材
AMCOR LTD		264	314	473	40,122	素材
AMP LTD		679	798	409	34,750	各種金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		116	146	341	28,914	消費者サービス
ASX LTD		42	55	307	26,082	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD		488	589	303	25,708	運輸
AUSNET SERVICES		512	619	114	9,688	公益事業
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP		644	763	2,248	190,653	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD		87	104	133	11,358	銀行
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED		102	123	137	11,636	銀行
BHP BILLITON LTD		702	832	2,258	191,528	素材
BLUESCOPE STEEL LTD		－	149	200	16,987	素材
BORAL LTD		244	320	242	20,594	素材
BRAMBLES LTD		361	426	417	35,358	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		55	72	244	20,738	エネルギー
CHALLENGER LTD		125	160	220	18,681	各種金融
CIMIC GROUP LIMITED		21	26	130	11,066	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	128	155	123	10,492	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	12	16	297	25,233	ヘルスケア機器・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	378	449	3,640	308,665	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED	100	127	208	17,698	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD	78	104	127	10,790	消費者サービス
CSL LIMITED	100	118	1,680	142,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	13	16	77	6,529	消費者サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	12	14	70	5,940	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	313	400	188	15,978	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	134	154	60	5,164	小売
HEALTHSCOPE LTD	380	476	89	7,588	ヘルスケア機器・サービス
INCITEC PIVOT LTD	354	455	180	15,284	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	552	653	468	39,743	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	94	123	260	22,065	素材
MACQUARIE GROUP LTD	68	85	849	72,011	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	585	762	245	20,816	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	585	697	2,096	177,786	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	169	201	478	40,530	素材
OIL SEARCH LTD	283	373	268	22,760	エネルギー
ORICA LTD	79	101	177	15,072	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED	390	460	376	31,944	エネルギー
QANTAS AIRWAYS LTD	131	145	85	7,222	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	308	366	408	34,633	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	30	39	265	22,530	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	13	16	125	10,655	ソフトウェア・サービス
RIO TINTO LTD	94	111	790	67,044	素材
SANTOS LTD	370	483	242	20,555	エネルギー
SEEK LTD	73	93	178	15,097	商業・専門サービス
SONIC HEALTHCARE LTD	84	112	243	20,671	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	1,170	1,377	454	38,533	素材
SUNCORP GROUP LTD	299	354	497	42,201	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	191	232	116	9,849	消費者サービス
TATTS GROUP LTD	315	349	153	13,010	消費者サービス
TELSTRA CORP LTD	993	1,152	397	33,700	電気通信サービス
TPG TELECOM LTD	80	107	62	5,302	電気通信サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	154	201	318	27,045	食品・飲料・タバコ
VOCUS GROUP LTD	115	-	-	-	電気通信サービス
WESFARMERS LIMITED	251	297	1,259	106,773	食品・生活必需品小売り
WESTPAC BANKING CORP	735	872	2,778	235,594	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		
WOODSIDE PETROLEUM LTD		169	201	620	52,601	エネルギー	
WOOLWORTHS LTD		285	340	878	74,503	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額	15,807	19,107	30,612	2,595,667		
	銘柄数<比率>	58	58	－	<2.5%>		
(香港)				千香港ドル			
AIA GROUP LTD		2,624	3,112	20,513	294,567	保険	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		50	67	840	12,074	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA		246	304	992	14,253	銀行	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		810	955	3,549	50,967	銀行	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD		270	－	－	－	運輸	
CK ASSET HOLDINGS LTD		594	679	4,420	63,483	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		599	699	6,868	98,632	資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED		140	180	1,227	17,628	公益事業	
CLP HOLDINGS LTD		371	436	3,463	49,729	公益事業	
FIRST PACIFIC CO		460	560	336	4,824	各種金融	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD		508	598	3,331	47,839	消費者サービス	
HANG LUNG GROUP LTD		180	240	652	9,374	不動産	
HANG LUNG PROPERTIES LTD		451	491	857	12,310	不動産	
HANG SENG BANK LTD		169	198	3,681	52,860	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		257	322	1,675	24,057	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS		1,724	2,233	3,305	47,467	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		254	301	7,039	101,093	各種金融	
HYSAN DEVELOPMENT CO		130	160	630	9,052	不動産	
KERRY PROPERTIES LTD		130	160	540	7,754	不動産	
LI & FUNG LTD		1,212	1,472	539	7,740	耐久消費財・アパレル	
MGM CHINA HOLDINGS LTD		192	232	433	6,223	消費者サービス	
MTR CORP		362	427	1,938	27,843	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,136	1,526	1,740	24,992	不動産	
NWS HOLDINGS LTD		320	390	625	8,983	資本財	
PCCW LTD		970	1,230	532	7,647	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		300	370	2,466	35,415	公益事業	
SANDS CHINA LTD		529	621	2,254	32,367	消費者サービス	
SHANGRI-LA ASIA LTD		260	320	574	8,243	消費者サービス	
SINO LAND CO		620	820	1,131	16,249	不動産	
SJM HOLDINGS LTD		390	470	292	4,204	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD		330	380	4,790	68,797	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD		128	138	1,035	14,863	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD		238	290	778	11,181	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		280	360	1,697	24,374	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	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
WH GROUP LTD		1,620	2,100	1,617	23,220	食品・飲料・タバコ
WHARF HOLDINGS LTD		307	327	834	11,986	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		－	327	1,508	21,669	不動産
WHEELOCK & CO LTD		160	200	1,080	15,508	不動産
WYNN MACAU LTD		313	381	824	11,845	消費者サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		155	185	526	7,558	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額	19,797	24,269	91,148	1,308,889	
	銘柄数<比率>	39	39	－	<1.2%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND LTD		516	665	234	19,422	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		80	98	118	9,819	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		470	566	114	9,506	運輸
DBS GROUP HOLDINGS LTD		386	457	1,102	91,240	銀行
GENTING SINGAPORE PLC		1,191	1,516	206	17,059	消費者サービス
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD		530	671	222	18,432	不動産
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		1,383	1,692	65	5,389	食品・飲料・タバコ
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		19	26	102	8,443	小売
KEPPEL CORP LTD		287	374	276	22,837	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		681	808	941	77,884	銀行
SATS LTD		159	202	103	8,540	運輸
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		198	243	74	6,192	資本財
SINGAPORE AIRLINES LTD		116	145	152	12,645	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		161	194	144	11,990	各種金融
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		339	411	111	9,249	メディア
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD		313	379	125	10,348	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,813	2,160	794	65,768	電気通信サービス
STARHUB LTD		150	184	52	4,308	電気通信サービス
UNITED OVERSEAS BANK LTD		285	339	849	70,290	銀行
UOL Group Limited		94	116	100	8,282	不動産
WILMAR INTERNATIONAL LTD		380	382	120	9,987	食品・飲料・タバコ
YANGZIJANG SHIPBUILDING		368	544	93	7,696	資本財
小計	株数・金額	9,919	12,172	6,107	505,337	
	銘柄数<比率>	22	22	－	<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		199	249	153	11,727	運輸
CONTACT ENERGY LTD		146	174	97	7,413	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD		136	165	115	8,807	素材
MERCURY NZ LTD		149	181	62	4,772	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		257	312	90	6,915	公益事業

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランドドル	千円		
RYMAN HEALTHCARE LTD		75	98	90	6,907	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD		376	485	175	13,442	電気通信サービス	
小計	株数・金額	1,341	1,667	785	59,985		
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>		
(イギリス)				千イギリス・ポンド			
3I GROUP PLC		195	246	227	33,762	各種金融	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC		178	—	—	—	各種金融	
ADMIRAL GROUP PLC		42	49	93	13,784	保険	
ANGLO AMERICAN PLC		303	342	490	72,690	素材	
ANTOFAGASTA PLC		76	97	92	13,744	素材	
ASHTAD GROUP PLC		108	128	245	36,421	資本財	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		77	91	282	41,861	食品・飲料・タバコ	
ASTRAZENECA PLC		274	325	1,620	240,117	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AUTO TRADER GROUP PLC-WI		199	241	77	11,439	ソフトウェア・サービス	
AVIVA PLC		878	1,043	522	77,387	保険	
BABCOCK INTL GROUP PLC		50	60	45	6,775	商業・専門サービス	
BAE SYSTEMS PLC		689	820	439	65,071	資本財	
BARCLAYS PLC		3,678	4,381	810	120,103	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		198	258	162	24,047	耐久消費財・アパレル	
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT		26	32	123	18,322	耐久消費財・アパレル	
BHP BILLITON PLC		457	542	739	109,639	素材	
BP PLC		4,105	5,065	2,498	370,131	エネルギー	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		405	591	2,948	436,943	食品・飲料・タバコ	
BT GROUP PLC		1,843	2,191	537	79,681	電気通信サービス	
BUNZL PLC		73	87	188	27,891	資本財	
BURBERRY GROUP PLC		95	112	197	29,234	耐久消費財・アパレル	
CAPITA PLC		132	160	76	11,360	商業・専門サービス	
CARNIVAL PLC		41	48	237	35,229	消費者サービス	
CENTRICA PLC		1,199	1,416	231	34,259	公益事業	
COBHAM PLC		338	577	73	10,929	資本財	
COCA-COLA HBC AG-CDI		35	45	112	16,658	食品・飲料・タバコ	
COMPASS GROUP PLC		355	406	649	96,239	消費者サービス	
CONVATEC GROUP PLC		—	333	68	10,156	ヘルスケア機器・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC		26	34	145	21,606	素材	
DCC PLC		18	23	164	24,443	資本財	
DIAGEO PLC		546	648	1,668	247,278	食品・飲料・タバコ	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		269	353	125	18,601	保険	
DIXONS CARPHONE PLC		191	228	34	5,183	小売	
EASYJET PLC		32	40	51	7,696	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
EXPERIAN PLC	206	242	378	56,084	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	54	65	342	50,793	資本財
FRESNILLO PLC	43	52	68	10,156	素材
G4S PLC	309	393	101	15,023	商業・専門サービス
GKN PLC	339	441	133	19,806	自動車・自動車部品
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,060	1,267	1,657	245,643	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	2,653	3,144	1,111	164,652	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	51	65	102	15,209	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	28	34	36	5,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	4,293	5,159	3,774	559,306	銀行
IMI PLC	53	65	80	11,983	資本財
IMPERIAL BRANDS PLC	208	246	752	111,555	食品・飲料・タバコ
INMARSAT PLC	92	113	56	8,337	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	38	46	198	29,360	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	33	41	222	32,942	商業・専門サービス
INVESTEC PLC	130	158	78	11,635	各種金融
ITV PLC	793	946	142	21,101	メディア
JOHNSON MATTHEY PLC	38	49	161	23,951	素材
KINGFISHER PLC	484	567	174	25,831	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,289	1,526	410	60,823	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	13,949	18,463	1,216	180,289	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	68	80	310	45,976	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	319	416	125	18,605	小売
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	73	89	49	7,349	ヘルスケア機器・サービス
MEGGITT PLC	153	195	93	13,854	資本財
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	140	169	63	9,473	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	－	55	150	22,238	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC/WI	75	94	164	24,343	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	437	568	118	17,628	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	823	889	785	116,379	公益事業
NEXT PLC	27	37	162	24,080	小売
OLD MUTUAL PLC	1,066	1,263	240	35,694	保険
PEARSON PLC	162	212	148	21,983	メディア
PERSIMMON PLC	63	79	212	31,502	耐久消費財・アパレル
PETROFAC LTD	51	－	－	－	エネルギー
PROVIDENT FINANCIAL PLC	29	35	32	4,831	各種金融
PRUDENTIAL PLC	559	664	1,256	186,133	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	19	23	169	25,138	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	136	171	1,097	162,690	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		237	278	485	71,891	商業・専門サービス	
RIO TINTO PLC		267	316	1,122	166,324	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS- ENTITL		－	19,210	1	284	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		399	426	379	56,239	資本財	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		27,690	－	－	－	資本財	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC		768	915	251	37,223	銀行	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		947	1,150	2,688	398,358	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		813	965	2,292	339,614	エネルギー	
ROYAL MAIL PLC		188	238	94	13,962	運輸	
RSA INSURANCE GROUP PLC		206	262	160	23,707	保険	
SAGE GROUP PLC		224	279	211	31,391	ソフトウェア・サービス	
SAINSBURY (J) PLC		320	407	92	13,734	食品・生活必需品小売り	
SCHRODERS PLC		26	30	107	15,891	各種金融	
SEVERN TRENT PLC		48	62	131	19,422	公益事業	
SHIRE PLC		196	233	859	127,305	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SKY PLC		225	269	253	37,499	メディア	
SMITH & NEPHEW PLC		190	225	298	44,243	ヘルスケア機器・サービス	
SMITHS GROUP PLC		79	101	151	22,490	資本財	
SSE PLC		222	262	353	52,330	公益事業	
ST JAMES'S PLACE PLC		103	136	157	23,385	各種金融	
STANDARD CHARTERED PLC		712	847	615	91,157	銀行	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		426	687	290	43,039	各種金融	
TATE & LYLE PLC		92	111	75	11,239	食品・飲料・タバコ	
TAYLOR WIMPEY PLC		659	840	165	24,481	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC		1,778	2,107	389	57,678	食品・生活必需品小売り	
TRAVIS PERKINS PLC		49	61	89	13,303	資本財	
TUI AG-DI		97	112	148	22,012	消費者サービス	
UNILEVER PLC		278	329	1,368	202,808	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC		150	180	144	21,371	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC		5,812	6,898	1,577	233,780	電気通信サービス	
WEIR GROUP PLC/THE		42	54	108	16,100	資本財	
WHITBREAD PLC		38	46	166	24,668	消費者サービス	
WILLIAM HILL PLC		167	－	－	－	消費者サービス	
WORLDPAY GROUP PLC-W/I		368	516	210	31,204	ソフトウェア・サービス	
WPP PLC		280	331	419	62,182	メディア	
小計	株数・金額	91,622	98,071	48,233	7,146,774		
	銘柄数<比率>	105	104	－	<6.8%>		

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・シケル	千円	
AZRIELI GROUP		7	9	189	6,055	不動産
BANK HAPOALIM BM		207	273	642	20,499	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		280	364	682	21,796	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		424	517	275	8,789	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		4	5	272	8,694	資本財
FRUTAROM		7	9	252	8,052	素材
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		101	121	166	5,319	素材
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		27	32	203	6,495	銀行
NICE LTD		11	14	435	13,893	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	1,073	1,348	3,119	99,597	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<0.1%>	
(スイス)				千スイス・フラン		
ABB LTD		408	512	1,275	144,542	資本財
ACTELION LTD-REG		21	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG		35	41	307	34,866	商業・専門サービス
ARYZTA AG		17	—	—	—	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG		9	12	197	22,392	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.44	0.54	91	10,389	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.19	0.27	149	16,994	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.02	0.02	134	15,273	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		113	134	1,164	131,987	耐久消費財・アパレル
CREDIT SUISSE GROUP AG		431	623	990	112,211	各種金融
DUFREY AG-REG		9	8	127	14,455	小売
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		1	2	136	15,431	素材
GEBERIT AG-REG		8	9	406	46,099	資本財
GIVAUDAN-REG		2	2	540	61,189	素材
JULIUS BAER GROUP LTD		48	57	340	38,607	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		11	15	257	29,147	運輸
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		99	116	645	73,130	素材
LONZA GROUP AG		12	19	499	56,601	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA		675	800	6,759	765,948	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG		484	572	4,768	540,319	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARGESA HOLDING SA-BR		7	9	80	9,114	各種金融
PARTNERS GROUP HOLDING AG		3	4	297	33,678	各種金融
ROCHE HOLDING AG		152	180	4,161	471,549	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		3	4	105	11,987	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		8	10	230	26,141	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE		1	1	340	38,616	商業・専門サービス
SIKA AG-BEARER		0.46	0.55	408	46,241	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		
SONOVA HOLDING AG-REG		10	13	222	25,229	ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG		－	2	170	19,372	ヘルスケア機器・サービス	
SWATCH GROUP AG		6	8	292	33,105	耐久消費財・アパレル	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		6	8	277	31,457	保険	
SWISS PRIME SITE-REG		14	18	157	17,878	不動産	
SWISS RE AG		69	82	768	87,028	保険	
SWISSCOM AG		5	6	352	39,980	電気通信サービス	
SYNGENTA AG		20	－	－	－	素材	
THE SWATCH GROUP AG-REG		9	12	87	9,916	耐久消費財・アパレル	
UBS GROUP AG		793	941	1,599	181,223	各種金融	
VIFOR PHARMA AG		0.78	12	157	17,799	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG		32	38	1,163	131,872	保険	
小計	株数・金額	3,538	4,289	29,668	3,361,783		
	銘柄数<比率>	38	36	－	<3.2%>		
(デンマーク)				千デンマーク・クローネ			
A P MOLLER - MAERSK A/S		1	1	1,828	32,374	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S		0.70	0.90	900	15,939	運輸	
CARLSBERG AS-B		23	27	2,024	35,850	食品・飲料・タバコ	
CHR HANSEN HOLDING A/S		19	25	1,474	26,105	素材	
COLOPLAST-B		25	30	1,538	27,242	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S		149	193	4,522	80,091	銀行	
DSV A/S		43	51	2,483	43,986	運輸	
GENMAB A/S		12	14	1,827	32,368	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
H LUNDBECK A/S		－	16	597	10,581	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ISS A/S		33	43	1,041	18,453	商業・専門サービス	
NOVO-NORDISK A/S		415	479	15,383	272,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S		50	57	2,007	35,544	素材	
ORSTED A/S		29	43	1,501	26,588	公益事業	
PANDORA A/S		24	27	1,575	27,906	耐久消費財・アパレル	
TDC A/S		165	211	797	14,123	電気通信サービス	
TRYGVESTA AS		21	25	400	7,084	保険	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		48	55	2,306	40,842	資本財	
WILLIAM DEMANT HOLDING		23	27	495	8,768	ヘルスケア機器・サービス	
小計	株数・金額	1,086	1,334	42,704	756,302		
	銘柄数<比率>	17	18	－	<0.7%>		
(ノルウェー)				千ノルウェー・クローネ			
DNB ASA		212	251	3,835	52,118	銀行	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		40	48	730	9,923	保険	
MARINE HARVEST		75	106	1,599	21,734	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO ASA		261	342	2,046	27,806	素材	
ORKLA ASA		160	210	1,713	23,292	食品・飲料・タバコ	

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
(ノルウェー)		百株	百株	千ルウェー・クローネ	千円		
SCHIBSTED ASA		15	18	439	5,973	メディア	
SCHIBSTED ASA-B SHS		18	22	512	6,968	メディア	
STATOIL ASA		245	294	4,827	65,605	エネルギー	
TELENOR ASA		166	195	3,516	47,783	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA		34	45	1,708	23,220	素材	
小計	株数・金額	1,231	1,537	20,929	284,426		
	銘柄数<比率>	10	10	－	<0.3%>		
(スウェーデン)				千スウェーデン・クローナ			
ALFA LAVAL AB		58	76	1,588	21,132	資本財	
ASSA ABLOY AB		218	259	4,412	58,679	資本財	
ATLAS COPCO AB		84	100	3,290	43,758	資本財	
ATLAS COPCO AB-A SHS		146	173	6,341	84,343	資本財	
BOLIDEN AB		53	69	1,941	25,824	素材	
ELECTROLUX AB		48	62	1,779	23,672	耐久消費財・アパレル	
ESSITY AKTIEBOLAG-B		－	157	3,887	51,700	家庭用品・パーソナル用品	
GETINGE AB-B SHS		40	55	854	11,368	ヘルスケア機器・サービス	
HENNES & MAURITZ AB		206	244	4,820	64,113	小売	
HEXAGON AB-B SHS		57	67	2,840	37,776	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUSQVARNA AB-B SHS		84	103	803	10,680	耐久消費財・アパレル	
ICA GRUPPEN AB		16	19	584	7,777	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		33	38	794	10,570	各種金融	
INVESTOR AB		98	117	4,707	62,607	各種金融	
KINNEVIK AB - B		46	59	1,610	21,422	各種金融	
LUNDBERGS AB-B SHS		7	9	607	8,077	各種金融	
LUNDIN PETROLEUM AB		38	47	975	12,973	エネルギー	
NORDEA BANK AB		662	785	7,696	102,357	銀行	
SANDVIK AB		232	291	4,291	57,076	資本財	
SECURITAS AB		63	80	1,135	15,096	商業・専門サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		333	395	3,935	52,336	銀行	
SKANSKA AB-B SHS		67	87	1,590	21,159	資本財	
SKF AB		81	97	1,805	24,016	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB		132	－	－	－	家庭用品・パーソナル用品	
SVENSKA HANDELSBANKEN		334	397	4,551	60,534	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES		198	235	4,604	61,238	銀行	
SWEDISH MATCH AB		38	47	1,526	20,302	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB		77	97	1,044	13,892	電気通信サービス	
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON		668	794	4,093	54,448	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB		589	697	2,614	34,776	電気通信サービス	
VOLVO AB		337	401	6,361	84,601	資本財	
小計	株数・金額	5,058	6,074	87,091	1,158,319		
	銘柄数<比率>	30	30	－	<1.1%>		

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ／アイルランド)		百株	百株	千ユーロ	千円		
BANK OF IRELAND		5,569	－	－	－	銀行	
BANK OF IRELAND GROUP PLC		－	242	153	20,193	銀行	
CRH PLC		183	218	663	87,445	素材	
KERRY GROUP PLC-A		35	42	373	49,183	食品・飲料・タバコ	
PADDY POWER BETFAIR PLC		17	21	208	27,487	消費者サービス	
小計	株数・金額	5,805	524	1,398	184,310		
	銘柄数<比率>	4	4	－	<0.2%>		
(ユーロ／オランダ)							
ABN AMRO GROUP NV-CVA		55	96	240	31,745	銀行	
AEGON NV		370	449	232	30,569	保険	
AIRBUS SE		126	149	1,272	167,633	資本財	
AKZO NOBEL NV		54	64	503	66,328	素材	
ALTICE NV - A-W/I		74	121	98	12,974	メディア	
ALTICE NV - B -W/I		22	24	19	2,576	メディア	
ASML HOLDING NV		81	96	1,469	193,681	半導体・半導体製造装置	
BOSKALIS WESTMINSTER		18	21	65	8,606	資本財	
CNH INDUSTRIAL NV		222	264	280	36,915	資本財	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		44	56	182	24,039	食品・飲料・タバコ	
EXOR NV		21	28	149	19,633	各種金融	
FERRARI NV		26	31	294	38,769	自動車・自動車部品	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		195	275	405	53,453	自動車・自動車部品	
GEMALTO		16	19	62	8,259	ソフトウェア・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV		20	26	207	27,349	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN NV		50	59	497	65,507	食品・飲料・タバコ	
ING GROEP NV-CVA		841	998	1,525	201,029	銀行	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		277	328	558	73,632	食品・生活必需品小売り	
KONINKLIJKE DSM NV		39	46	358	47,236	素材	
KONINKLIJKE PHILIPS NV		206	238	791	104,304	ヘルスケア機器・サービス	
NN GROUP NV		67	79	286	37,738	保険	
QIAGEN NV		43	55	144	19,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RANDSTAD HOLDINGS NV		23	30	150	19,819	商業・専門サービス	
RELX NV		217	249	479	63,161	商業・専門サービス	
ROYAL KPN NV		763	907	268	35,396	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV		138	164	334	44,134	半導体・半導体製造装置	
UNILEVER NV		353	419	1,994	262,842	家庭用品・パーソナル用品	
VOPAK		13	16	57	7,582	エネルギー	
WOLTERS KLUWER NV		65	77	328	43,313	商業・専門サービス	
小計	株数・金額	4,451	5,398	13,260	1,747,261		
	銘柄数<比率>	29	29	－	<1.7%>		

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等	
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ／ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円		
AGEAS		37	48	195	25,701	保険	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		165	196	1,911	251,881	食品・飲料・タバコ	
COLRUYT NV		12	13	62	8,223	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		15	20	182	24,020	各種金融	
KBC GROEP NV		54	64	433	57,156	銀行	
PROXIMUS		32	40	115	15,280	電気通信サービス	
SOLVAY SA		16	19	229	30,304	素材	
TELENET GROUP HOLDING NV		11	14	82	10,828	メディア	
UCB SA		27	32	199	26,313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UMICORE		18	48	187	24,770	素材	
小計	株数・金額	392	498	3,601	474,481		
	銘柄数<比率>	10	10	－	<0.4%>		
(ユーロ／ルクセンブルグ)							
ARCELORMITTAL		132	170	403	53,099	素材	
RTL GROUP		7	9	62	8,202	メディア	
TENARIS SA		92	121	147	19,441	エネルギー	
小計	株数・金額	233	301	612	80,743		
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.1%>		
(ユーロ／フランス)							
ACCOR		33	47	197	25,969	消費者サービス	
ADP		7	8	134	17,676	運輸	
AIR LIQUIDE		84	110	1,161	153,075	素材	
ALSTOM RGPT		30	39	133	17,653	資本財	
ARKEMA		13	17	183	24,186	素材	
ATOS SE		19	24	307	40,513	ソフトウェア・サービス	
AXA		419	498	1,252	165,039	保険	
BNP PARIBAS		229	288	1,822	240,175	銀行	
BOLLORE		190	235	98	13,002	運輸	
BOUYGUES		42	55	234	30,907	資本財	
BUREAU VERITAS SA		54	70	155	20,437	商業・専門サービス	
CAPGEMINI SA		35	41	413	54,543	ソフトウェア・サービス	
CARREFOUR SA		123	145	241	31,790	食品・生活必需品小売り	
CASINO GUICHARD PERRACHON		11	13	62	8,277	食品・生活必需品小売り	
CHRISTIAN DIOR SE		11	－	－	－	耐久消費財・アパレル	
CIE DE SAINT-GOBAIN		108	128	615	81,124	資本財	
CNP ASSURANCES		33	41	77	10,266	保険	
CREDIT AGRICOLE SA		243	293	412	54,344	銀行	
DANONE		128	152	1,050	138,456	食品・飲料・タバコ	
DASSAULT AVIATION SA		0.46	0.61	79	10,464	資本財	
DASSAULT SYSTEMES SA		28	33	301	39,745	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／フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
EDENRED	41	56	133	17,612	商業・専門サービス
EDF	55	140	143	18,898	公益事業
EIFFAGE	12	19	176	23,313	資本財
ENGIE	345	439	628	82,785	公益事業
ESSILOR INTERNATIONA	45	53	570	75,228	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO	8	10	79	10,458	各種金融
EUROFINS SCIENTIFIC	2	2	148	19,505	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	35	43	89	11,745	メディア
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	101	128	140	18,544	運輸
HERMES INTERNATIONAL	5	8	364	48,042	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	5	7	143	18,952	電気通信サービス
IMERYS SA	7	8	66	8,778	素材
INGENICO GROUP	11	14	123	16,222	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPSEN	－	9	98	12,936	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JC DECAUX SA	15	19	62	8,300	メディア
KERING	16	19	754	99,442	耐久消費財・アパレル
LAGARDERE S.C.A.	24	30	81	10,705	メディア
LEGRAND SA	58	68	427	56,332	資本財
L'OREAL SA	54	64	1,200	158,173	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	60	71	1,774	233,812	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	39	44	519	68,493	自動車・自動車部品
NATIXIS	186	242	158	20,871	各種金融
ORANGE S.A.	438	521	735	96,862	電気通信サービス
PERNOD-RICARD	46	54	702	92,546	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	105	132	246	32,489	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	42	53	288	37,972	メディア
REMY COINTREAU	4	5	60	8,000	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	41	45	386	50,973	自動車・自動車部品
REXEL SA	60	76	114	15,062	資本財
SAFRAN SA	68	80	703	92,638	資本財
SANOFI	252	291	2,202	290,169	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	121	144	1,025	135,097	資本財
SCOR REGROUPE	31	44	153	20,179	保険
SEB SA	4	5	88	11,668	耐久消費財・アパレル
SFR GROUP SA	18	－	－	－	電気通信サービス
SOCIETE BIC SA	5	6	62	8,252	商業・専門サービス
SOCIETE GENERALE	166	197	853	112,450	銀行
SODEXO	19	23	249	32,885	消費者サービス
SUEZ	70	97	147	19,383	公益事業
THALES SA	23	27	242	31,978	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ／フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTAL SA		493	606	2,809	370,173	エネルギー
VALEO SA		52	61	359	47,367	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT		104	125	262	34,548	公益事業
VINCI SA		110	130	1,103	145,399	資本財
VIVENDI SA		226	268	606	79,866	メディア
WENDEL		6	7	102	13,558	各種金融
ZODIAC SA		40	51	128	16,898	資本財
小計	株数・金額	5,541	6,812	30,458	4,013,232	
	銘柄数<比率>	67	66	－	<3.8%>	
(ユーロ／ドイツ)						
ADIDAS AG		40	48	899	118,464	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE		98	117	2,308	304,143	保険
AXEL SPRINGER SE		9	12	79	10,433	メディア
BASF SE		199	235	2,166	285,408	素材
BAYER AG		179	212	2,286	301,250	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		71	85	721	95,020	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		10	13	96	12,776	自動車・自動車部品
BEIERSDORF AG		21	25	247	32,552	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG		33	39	208	27,420	資本財
CECONOMY AG		34	－	－	－	食品・生活必需品小売り
COMMERZBANK AG		228	273	330	43,589	銀行
CONTINENTAL AG		23	28	605	79,782	自動車・自動車部品
COVESTRO AG		13	28	232	30,598	素材
DAIMLER AG		208	247	1,706	224,834	自動車・自動車部品
DEUTSCHE BANK AG		299	496	805	106,114	各種金融
DEUTSCHE BOERSE AG		28	49	463	61,012	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG		47	61	172	22,758	運輸
DEUTSCHE POST AG		213	253	988	130,252	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG		716	849	1,275	168,110	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		76	91	342	45,088	不動産
E.ON SE		435	566	554	73,076	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG		31	40	127	16,736	素材
FRAPORT AG		9	11	90	11,972	運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA		89	106	678	89,439	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD		13	16	74	9,862	素材
GEA GROUP AG		36	46	186	24,520	資本財
HANNOVER RUECK SE		11	14	162	21,453	保険
HEIDELBERGCEMENT AG		32	38	354	46,662	素材
HENKEL AG & CO KGAA		22	26	272	35,922	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG		38	45	518	68,312	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	
(ユーロ／ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
HOCHTIEF AG		3	4	68	9,028	資本財
HUGO BOSS AG		13	15	108	14,277	耐久消費財・アパレル
INFINEON TECHNOLOGIES AG		245	291	708	93,409	半導体・半導体製造装置
INNOGY SE		27	35	140	18,504	公益事業
K+S AG		37	47	90	11,982	素材
KION GROUP AG		－	18	121	15,955	資本財
LANXESS		17	23	151	19,999	素材
LINDE AG		40	47	896	118,086	素材
MAN SE		6	8	80	10,652	資本財
MERCK KGAA		28	33	300	39,620	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METRO AG		－	42	68	9,001	食品・生活必需品小売り
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG		34	39	755	99,493	保険
OSRAM LICHT AG		17	21	143	18,956	資本財
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF		30	38	242	31,898	自動車・自動車部品
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG		51	61	154	20,354	メディア
RWE AG		99	133	259	34,150	公益事業
SAP SE		213	252	2,433	320,694	ソフトウェア・サービス
SCHAEFFLER AG		33	39	55	7,313	自動車・自動車部品
SIEMENS AG		165	196	2,257	297,467	資本財
SYMRISE AG		25	31	227	29,949	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		152	185	76	10,072	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG		78	94	208	27,429	素材
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		24	31	178	23,475	ソフトウェア・サービス
VOLKSWAGEN AG		6	7	128	16,882	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG		40	47	760	100,177	自動車・自動車部品
VONOVIA SE		101	121	478	63,039	不動産
ZALANDO SE		17	28	117	15,526	小売
小計	株数・金額	4,791	5,987	30,168	3,974,972	
	銘柄数<比率>	55	56	－	<3.8%>	
(ユーロ／ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		488	613	178	23,569	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		97	129	202	26,691	エネルギー
JERONIMO MARTINS		48	60	95	12,539	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	635	803	476	62,799	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.1%>	
(ユーロ／スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		146	189	349	46,049	運輸
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		37	61	200	26,437	資本財
AENA SME SA		15	18	295	38,926	運輸
AMADEUS IT GROUP SA		95	112	680	89,713	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／スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA		1,421	1,712	1,231	162,275	銀行	
BANCO DE SABADELL SA		1,153	1,367	224	29,570	銀行	
BANCO POPULAR ESPANOL		660	－	－	－	銀行	
BANCO SANTANDER SA		3,161	4,124	2,260	297,864	銀行	
BANKIA SA		893	239	93	12,316	銀行	
BANKINTER SA		132	168	131	17,311	銀行	
CAIXABANK		774	920	362	47,796	銀行	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		121	147	60	7,958	食品・生活必需品小売り	
ENAGAS SA		45	56	134	17,683	エネルギー	
ENDESA SA		62	80	150	19,821	公益事業	
FERROVIAL S.A.		105	124	226	29,811	資本財	
GAS NATURAL SDG SA		69	89	160	21,122	公益事業	
GRIFOLS SA		60	76	193	25,456	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA		1,201	1,474	953	125,690	公益事業	
INDITEX SA		235	280	819	108,036	小売	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI		169	163	109	14,415	運輸	
MAPFRE SA		200	247	68	8,975	保険	
RED ELECTRICA DE ESPANA		89	111	201	26,606	公益事業	
REPSOL SA		242	313	467	61,621	エネルギー	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY		－	55	57	7,613	資本財	
TELEFONICA SA		990	1,172	1,000	131,864	電気通信サービス	
ZARDOYA OTIS SA		35	－	－	－	資本財	
小計	株数・金額	12,120	13,310	10,435	1,374,940		
	銘柄数<比率>	25	24	－	<1.3%>		
(ユーロ／イタリア)							
ASSICURAZIONI GENERALI SPA		253	320	488	64,306	保険	
ATLANTIA SPA		95	122	332	43,837	運輸	
ENEL SPA		1,665	2,099	1,094	144,233	公益事業	
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA		551	653	896	118,168	エネルギー	
INTESA SANPAOLO		2,925	3,461	959	126,429	銀行	
LEONARDO SPA		80	104	105	13,883	資本財	
LUXOTTICA GROUP SPA		37	44	212	28,001	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA		112	144	143	18,852	銀行	
POSTE ITALIANE SPA		104	127	77	10,272	保険	
PRYSMIAN SPA		38	53	150	19,844	資本財	
RECORDATI SPA		－	26	102	13,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAIPEM SPA		1,189	144	49	6,540	エネルギー	
SNAM SPA		535	591	249	32,880	エネルギー	
TELECOM ITALIA SPA		3,371	3,994	271	35,736	電気通信サービス	
TERNA SPA		316	371	192	25,382	公益事業	

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ／イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNICREDIT SPA		410	515	857	112,980	銀行
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA		219	234	44	5,877	保険
小計	株数・金額	11,908	13,010	6,228	820,727	
	銘柄数<比率>	16	17	－	<0.8%>	
(ユーロ／フィンランド)						
ELISA OYJ		30	38	133	17,644	電気通信サービス
FORTUM OYJ		88	114	200	26,429	公益事業
KONE OYJ		72	86	383	50,587	資本財
METSO OYJ		22	27	80	10,571	資本財
NESTE OYJ		24	31	158	20,827	エネルギー
NOKIA OYJ		1,268	1,504	628	82,841	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ		22	29	107	14,228	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B		20	24	82	10,823	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		96	114	520	68,520	保険
STORA ENSO OYJ		107	141	185	24,470	素材
UPM-KYMMENE OYJ		114	136	347	45,742	素材
WARTSILA OYJ		29	37	208	27,516	資本財
小計	株数・金額	1,898	2,286	3,037	400,204	
	銘柄数<比率>	12	12	－	<0.4%>	
(ユーロ／オーストリア)						
ANDRITZ AG		14	17	80	10,584	資本財
ERSTE GROUP BANK AG		65	77	280	36,979	銀行
OMV AG		28	37	193	25,475	エネルギー
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING		23	36	107	14,174	銀行
VOESTALPINE AG		22	28	136	17,993	素材
小計	株数・金額	153	197	798	105,207	
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.1%>	
(ユーロ／その他)						
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		46	55	456	60,163	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	46	55	456	60,163	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額	47,979	49,186	100,933	13,299,045	
	銘柄数<比率>	230	230	－	<12.6%>	
合計	株数・金額	274,602	308,519	－	99,573,624	
	銘柄数<比率>	1,253	1,254	－	<94.3%>	

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

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

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

(注 4) 業種は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。

(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	3	3	495	55,593
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	7	10	1,142	128,183
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	2	296	33,232
PROLOGIS INC	11	13	903	101,315
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	21	27	315	35,389
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	3	655	73,574
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	2	217	24,383
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2	3	159	17,930
DUKE REALTY CORP	7	9	264	29,644
EQUITY RESIDENTIAL	7	9	646	72,486
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	423	47,561
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	246	27,664
GGP INC	12	15	376	42,191
HCP INC	10	12	323	36,242
WELLTOWER INC	7	9	640	71,852
HOST HOTELS AND RESORTS INC	16	19	378	42,502
KIMCO REALTY CORP	9	10	210	23,636
LIBERTY PROPERTY TRUST	2	3	165	18,533
MACERICH CO/THE	2	3	198	22,317
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	2	300	33,658
PUBLIC STORAGE	3	4	852	95,687
REGENCY CENTERS CORP	3	3	266	29,951
SIMON PROPERTY GROUP INC	6	8	1,303	146,225
SL GREEN REALTY CORP	2	2	263	29,615
UDR INC	5	6	272	30,620
VENTAS INC	7	9	588	66,029
VORNADO REALTY TRUST	3	4	337	37,881
REALTY INCOME CORP	5	7	397	44,602
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	3	283	31,804
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	4	489	54,924
IRON MOUNTAIN INC	5	6	264	29,657
AGNC INVESTMENT CORP	6	8	175	19,725
AMERICAN TOWER REIT INC	9	10	1,599	179,443
EQUINIX INC	1	2	948	106,458
VEREIT	19	24	200	22,459
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6	7	143	16,047
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	10	13	162	18,213
SBA COMMUNICATIONS CORP	2	3	519	58,273
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	241 38	17,430 38	1,955,518 <1.9%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		1	1	50	4,441
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		2	3	77	6,772
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		3	3	101	8,931
小計	口数・金額	7	9	229	20,145
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル	
DEXUS		21	28	279	23,710
GPT GROUP		39	51	272	23,078
GOODMAN GROUP		42	49	429	36,396
STOCKLAND		57	68	315	26,786
WESTFIELD CORP		45	53	441	37,413
MIRVAC GROUP		82	106	259	21,970
VICINITY CENTRES		73	95	259	21,998
SCENTRE GROUP		121	144	594	50,432
小計	口数・金額	484	599	2,851	241,786
	銘柄数<比率>	8	8	—	<0.2%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		48	57	4,004	57,507
小計	口数・金額	48	57	4,004	57,507
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		48	63	167	13,879
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		40	50	93	7,775
CAPITALAND MALL TRUST		49	60	125	10,380
SUNTEC REIT		48	62	123	10,187
小計	口数・金額	187	237	510	42,222
	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		19	25	156	23,178
HAMMERSON PLC		15	20	107	15,881
LAND SECURITIES GROUP PLC		17	19	177	26,261
SEGRO PLC		16	25	143	21,279
INTU PROPERTIES PLC		18	21	43	6,450
小計	口数・金額	88	111	628	93,051
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(ユーロ/フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO SE		2	2	562	74,060
KLEPIERRE		4	5	198	26,209
GECINA SA		0.813	1	169	22,379
FONCIERE DES REGIONS		0.701	0.854	74	9,843
ICADE		0.753	0.853	65	8,597
小計	口数・金額	9	11	1,070	141,090
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>
合計	口数・金額	1,066	1,323	—	2,551,322
	銘柄数<比率>	64	64	—	<2.4%>

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
外国		百万円	百万円
	S&P500EMINIFUTURE	1,647	—
	FTSE100	163	—
	DJEUROSTOXX50	406	—

(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

2017年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	99,573,624	93.9
投資信託証券	2,551,322	2.4
コール・ローン等、その他	3,940,573	3.7
投資信託財産総額	106,065,520	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル112.19円、1カナダ・ドル87.80円、1オーストラリア・ドル84.79円、1香港ドル14.36円、1シンガポール・ドル82.74円、1ニュージーランド・ドル76.38円、1イギリス・ポンド148.17円、1イスラエル・シェケル31.93円、1スイス・フラン113.31円、1デンマーク・クローネ17.71円、1ノルウェー・クローネ13.59円、1スウェーデン・クローナ13.30円、1ユーロ131.76円です。

(注2) 外貨建純資産（103,836,680千円）の投資信託財産総額（106,065,520千円）に対する比率は97.9%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	108,449,652,570円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,678,255,491
株 式 (評価額)	99,573,624,213
投 資 信 託 証 券 (評価額)	2,551,322,711
未 収 入 金	2,387,144,454
未 収 配 当 金	159,110,306
差 入 委 託 証 拠 金	1,100,195,395
(B)負債	2,836,031,782
未 払 金	2,410,021,624
未 払 解 約 金	426,007,429
そ の 他 未 払 費 用	2,729
(C)純 資 産 総 額 (A - B)	105,613,620,788
元 本	63,730,699,122
次 期 繰 越 損 益 金	41,882,921,666
(D)受 益 権 総 口 数	63,730,699,122口
1万口当たり基準価額 (C / D)	16,572円

- (注1) 期首元本額 53,841,195,227円
 期中追加設定元本額 17,919,016,939円
 期中一部解約元本額 8,029,513,044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) 310,923,879円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) 2,120,379,916円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) 1,784,916,437円
 ニッセイ外国株式インデックスファンドⅡ (適格機関投資家限定) 12,010,901,039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) 675,877,427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 41,334,797,667円
 DCニッセイ外国株式インデックス 5,220,728,386円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (4資産均等型) 266,350,239円
 DCニッセイターゲットデートファンド2055 419,398円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型) 244,177円
 DCニッセイターゲットデートファンド2045 204,051円
 DCニッセイターゲットデートファンド2035 189,566円
 DCニッセイターゲットデートファンド2025 90,538円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型) 4,295,310円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式) 200,574円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式／リート) 120,345円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式／リート／債券) 60,173円

損益の状況

当期 (2017年5月23日～2017年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	923,050,950円
受 取 配 当 金	921,295,345
受 取 利 息	984,372
そ の 他 収 益	1,297,089
支 払 利 息	△ 525,856
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	6,462,007,643
売 買 益 損	9,517,900,264
売 買 損	△ 3,055,892,621
(C)先 物 取 引 等 損 益	181,194,840
取 引 益 損	225,004,937
取 引 損	△ 43,810,097
(D)信 託 報 酬 等	△ 24,471,299
(E)当期損益金 (A + B + C + D)	7,541,782,134
(F)前 期 繰 越 損 益 金	28,365,649,942
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	10,716,739,609
(H)解 約 差 損 益 金	△ 4,741,250,019
(I)合 計 (E + F + G + H)	41,882,921,666
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	41,882,921,666

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

ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 22 期

(計算期間：2017年5月23日～2017年11月20日)

運用方針

主に日本を除く主要国の国債に投資することにより、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めざして運用を行います。

主要運用 対象

日本を除く主要国の国債

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

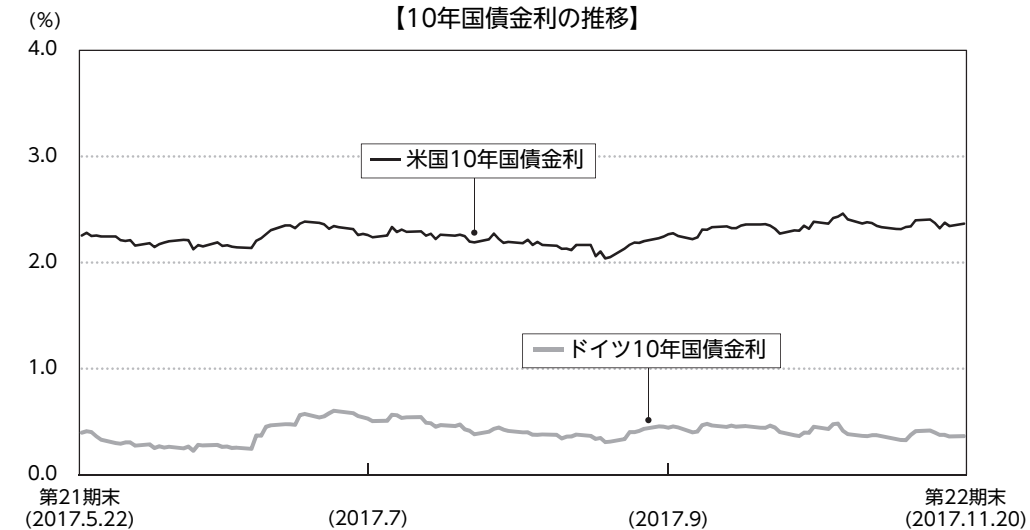
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2017年5月23日～2017年11月20日

投資環境

■海外債券市況

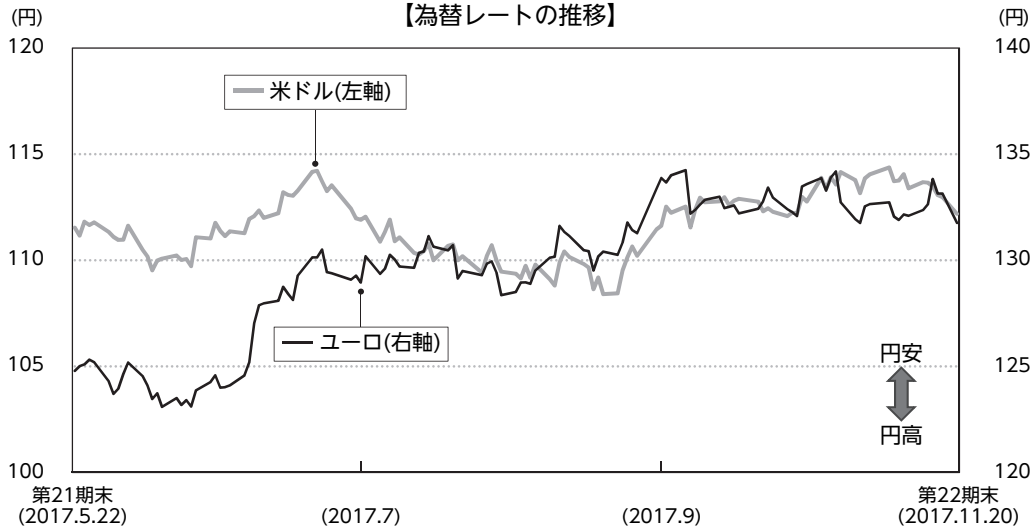


(注) 10年国債金利は、ブルームバーグのデータを使用しています。

米国10年国債金利は、欧州中央銀行（E C B）総裁やイングランド銀行（B O E：中央銀行）総裁の発言を背景に、欧州中心に金融引き締め観測が高まり、7月上旬には2.4%近辺まで上昇しました。その後、軟調な米物価指数や米連邦準備制度理事会（F R B）議長のインフレに対する慎重な発言、米政策運営に対する懸念、北朝鮮情勢の緊迫化から金利は低下し、9月上旬には2.0%台となりました。9月中旬以降は、F R Bの政策金利見通しを受けた年内利上げ観測の高まりや、米税制改革への期待などを背景に、10月下旬には2.4%台まで上昇しました。その後はもみ合い推移となり、2.3%台で当期末を迎えました。

ドイツ10年国債金利は、E C B総裁によるインフレ見通しへの楽観的な評価を背景に金融引き締め観測が高まり、7月中旬には0.6%台まで急上昇しました。その後は、E C Bの金融緩和縮小に慎重な姿勢や、北朝鮮情勢の緊迫化により、9月上旬には一時0.3%を割れる場面がありました。9月中旬以降はF R Bの年内利上げ観測が高まった一方で、スペイン・カタルーニャ州の独立をめぐる混乱やE C Bの慎重な姿勢で金利はもみ合いとなる中、0.3%台で当期末を迎えました。

■為替市況

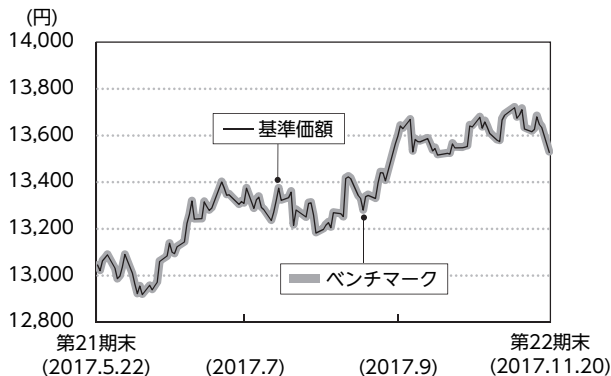


(注) 為替レートは、対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

米ドル／円レートは、F R Bがバランスシート縮小に前向きな一方で日銀が金利の安定化を図るなど、金融政策の違いが鮮明になり、7月上旬には114円台まで上昇しました。その後、軟調な米物価指数や米政策運営に対する懸念、北朝鮮情勢の緊迫化から一時108円割れまで下落する場面がありました。9月中旬以降はF R Bの年内利上げ観測の高まりや米税制改革への期待などを背景に114円台まで上昇しましたが、日本株の上昇が一服し小幅ながら調整に入ると、112円台に下落して当期末を迎えました。

ユーロ／円レートは、E C B総裁のインフレ見通しへの楽観的評価を受けて、金融引き締め観測が高まり、7月上旬には130円台に上昇しました。その後はF R B議長のインフレに対する慎重な発言を背景にユーロ／ドルレートが上昇する一方、北朝鮮情勢の緊迫化が円高要因となり、もみ合い推移となりました。9月中旬以降は、F R Bの年内利上げ観測の高まりや、米税制改革への期待などを背景に134円台まで上昇しましたが、スペインの混乱やE C Bの金融緩和縮小に慎重な姿勢がユーロの上値を重くし、132円近辺まで下落して当期末を迎えました。

基準価額等の推移



■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、期初にトランプ米大統領の機密情報漏えい疑惑などによる円高でやや弱含む場面もありましたが、金融政策の方向性の違いから円安が進み、7月上旬にかけて上昇しました。その後は、北朝鮮情勢の緊迫化などから円高となり、基準価額はゆるやかに下落しました。9月中旬以降は、F R Bの年内利上げ観測の高まりや米税制改革への期待などから円安が進行し、基準価額は上昇しましたが、当期末にかけては伸び悩み、もみ合い推移で当期末を迎えました。

（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。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。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。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。

ポートフォリオ

日本を除く主要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+3.7%となり、ベンチマーク騰落率（+3.7%）なみとなりました。

今後の運用方針

日本を除く主要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

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

（2017年8月18日）

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中騰落率	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
18期(2015年11月20日)	13,890	0.4	14,004	0.4	98.6	10,962
19期(2016年5月20日)	12,948	△6.8	13,060	△6.7	98.7	7,967
20期(2016年11月21日)	12,470	△3.7	12,576	△3.7	98.7	10,062
21期(2017年5月22日)	13,045	4.6	13,165	4.7	98.8	11,666
22期(2017年11月20日)	13,528	3.7	13,656	3.7	98.8	13,064

(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。なお円換算の際には、現地通貨ベースの指数を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。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。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
	円	%		%	%
(期首)2017年5月22日	13,045	—	13,165	—	98.8
5月末	12,998	△0.4	13,119	△0.3	99.0
6月末	13,242	1.5	13,365	1.5	98.3
7月末	13,236	1.5	13,359	1.5	99.0
8月末	13,423	2.9	13,550	2.9	98.5
9月末	13,573	4.0	13,702	4.1	96.6
10月末	13,574	4.1	13,705	4.1	99.1
(期末)2017年11月20日	13,528	3.7	13,656	3.7	98.8

(注) 騰落率は期首比です。

1 万口当たりの費用明細

2017年5月23日～2017年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
その他費用	3円	0.021%	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.021)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ 信託事務の諸費用：信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用 ・ 借入金の利息：受託会社等から一時的に資金を借り入れた場合（立替金も含む）に発生する利息
合計	3	0.021	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は、「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（13,356円）で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

売買および取引の状況

2017年5月23日～2017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 14,247	千米ドル 9,349
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 821	千カナダ・ドル 520
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 651	千オーストラリア・ドル 325
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 124	千シンガポール・ドル 92
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 1,341	千イギリス・ポンド 962
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 1,133	千デンマーク・クローネ 412
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 492	千ノルウェー・クローネ 191
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 882	千スウェーデン・クローナ 296
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 3,999	千メキシコ・ペソ 3,109
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 472	千マレーシア・リンギット 261
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 1,747	千南アフリカ・ランド 569
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 520	千ポーランド・ズロチ 532
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
		アイルランド	国債証券 153	130
		オランダ	国債証券 389	275
		ベルギー	国債証券 456	288
		フランス	国債証券 2,412	1,522
		ドイツ	国債証券 1,994	1,575
		スペイン	国債証券 1,394	881
		イタリア	国債証券 2,383	1,751
		フィンランド	国債証券 148	106
		オーストリア	国債証券 348	195

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子は含まれていません）。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2017年5月23日～2017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	89,265	US TREASURY	131,403
US TREASURY	63,008	US TREASURY	82,860
US TREASURY	62,944	US TREASURY	80,571
US TREASURY	53,876	US TREASURY	75,820
US TREASURY	50,679	US TREASURY	68,716
US TREASURY	50,100	US TREASURY	63,784
US TREASURY	46,995	US TREASURY	37,231
US TREASURY	43,809	UK TREASURY	30,236
US TREASURY	43,776	US TREASURY	30,235
US TREASURY	43,293	BUNDESobligation	29,515

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

組入有価証券明細表

2017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	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
	49,140	49,800	5,587,089	42.8	—	17.7	17.0	8.0
カナダ	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
	2,970	3,164	277,804	2.1	—	0.9	0.7	0.5
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						
	3,000	3,224	273,421	2.1	—	1.3	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
	560	589	48,759	0.4	—	0.2	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
	4,910	6,068	899,104	6.9	—	4.9	1.5	0.5
スイス	千スイス・フラン	千スイス・フラン						
	180	194	22,046	0.2	—	—	0.2	—

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
デンマーク	千デンマーク・クローネ 3,990	千デンマーク・クローネ 4,895	千円 86,694	% 0.7	% －	% 0.4	% 0.1	% 0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 2,600	千ノルウェー・クローネ 2,758	37,484	0.3	－	0.2	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 4,060	千スウェーデン・クローナ 4,587	61,007	0.5	－	0.2	0.2	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 17,780	千メキシコ・ペソ 18,282	108,415	0.8	－	0.5	0.3	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 2,100	千マレーシア・リンギット 2,079	56,096	0.4	－	0.2	0.2	0.0
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 9,270	千南アフリカ・ランド 8,140	65,042	0.5	－	0.4	0.0	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 2,430	千ポーランド・ズロチ 2,567	79,940	0.6	－	0.2	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
	アイルランド 690	784	103,376	0.8	－	0.4	0.2	0.1
	オランダ 1,850	2,165	285,302	2.2	－	1.4	0.6	0.2
	ベルギー 2,070	2,522	332,385	2.5	－	1.8	0.5	0.2
	フランス 8,630	10,136	1,335,544	10.2	－	6.4	2.9	1.0
	ドイツ 6,090	7,067	931,180	7.1	－	4.0	2.1	1.0
	スペイン 4,940	5,712	752,723	5.8	－	3.6	1.4	0.7
	イタリア 8,560	9,730	1,282,035	9.8	－	5.6	3.1	1.1
	フィンランド 560	619	81,561	0.6	－	0.4	0.2	0.0
	オーストリア 1,310	1,549	204,189	1.6	－	1.0	0.3	0.2
合計	－	－	12,911,205	98.8	－	51.8	32.6	14.4

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
アメリカ		%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/02/15	60	76	8,616
	US TREASURY	6.5000	2026/11/15	40	53	6,015
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	60	80	8,998
	US TREASURY	5.5000	2028/08/15	50	64	7,269
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	60	76	8,591
	US TREASURY	5.2500	2029/02/15	40	51	5,751
	US TREASURY	5.3750	2031/02/15	90	120	13,479
	US TREASURY	3.7500	2018/11/15	80	81	9,159
	US TREASURY	1.2500	2018/11/30	690	687	77,099
	US TREASURY	1.5000	2018/12/31	700	698	78,397
	US TREASURY	2.7500	2019/02/15	920	932	104,581
	US TREASURY	1.0000	2019/03/15	770	763	85,623
	US TREASURY	1.6250	2019/03/31	680	679	76,228
	US TREASURY	3.1250	2019/05/15	820	837	93,957
	US TREASURY	0.8750	2019/06/15	690	681	76,431
	US TREASURY	1.6250	2019/06/30	660	659	73,952
	US TREASURY	0.8750	2019/07/31	950	936	105,115
	US TREASURY	1.6250	2019/08/31	720	718	80,637
	US TREASURY	1.0000	2019/09/30	750	740	83,037
	US TREASURY	1.2500	2019/10/31	960	951	106,725
	US TREASURY	1.3750	2019/12/15	510	506	56,787
	US TREASURY	1.6250	2019/12/31	560	558	62,651
	US TREASURY	1.3750	2020/01/31	890	882	99,025
	US TREASURY	1.3750	2020/02/29	540	535	60,047
	US TREASURY	1.3750	2020/03/31	510	505	56,689
	US TREASURY	3.5000	2020/05/15	750	781	87,668
	US TREASURY	1.5000	2020/05/31	570	565	63,496
	US TREASURY	1.6250	2020/06/30	540	537	60,317
	US TREASURY	2.6250	2020/08/15	810	827	92,840
	US TREASURY	1.3750	2020/08/31	560	553	62,085
	US TREASURY	2.0000	2020/09/30	640	643	72,157
	US TREASURY	2.6250	2020/11/15	920	940	105,565
	US TREASURY	2.3750	2020/12/31	640	649	72,909
	US TREASURY	1.3750	2021/01/31	890	876	98,288
	US TREASURY	2.2500	2021/03/31	670	677	76,021
	US TREASURY	3.1250	2021/05/15	770	801	89,929
	US TREASURY	2.1250	2021/06/30	660	664	74,537

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
アメリカ		%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY	2.1250	2021/08/15	840	845	94,842
	US TREASURY	2.1250	2021/09/30	720	724	81,255
	US TREASURY	2.0000	2021/11/15	970	971	109,019
	US TREASURY	2.1250	2021/12/31	630	633	71,079
	US TREASURY	2.0000	2022/02/15	850	850	95,454
	US TREASURY	1.7500	2022/03/31	670	662	74,356
	US TREASURY	1.7500	2022/05/15	930	919	103,166
	US TREASURY	2.1250	2022/06/30	510	511	57,431
	US TREASURY	1.6250	2022/08/15	940	922	103,529
	US TREASURY	1.7500	2022/09/30	550	541	60,793
	US TREASURY	1.6250	2022/11/15	760	744	83,501
	US TREASURY	2.1250	2022/12/31	330	330	37,081
	US TREASURY	2.0000	2023/02/15	620	616	69,204
	US TREASURY	1.5000	2023/03/31	290	280	31,521
	US TREASURY	1.7500	2023/05/15	620	608	68,220
	US TREASURY	1.3750	2023/06/30	300	287	32,308
	US TREASURY	2.5000	2023/08/15	580	591	66,338
	US TREASURY	1.3750	2023/09/30	320	306	34,362
	US TREASURY	2.7500	2023/11/15	610	630	70,716
	US TREASURY	2.2500	2023/12/31	340	341	38,305
	US TREASURY	2.7500	2024/02/15	640	660	74,135
	US TREASURY	2.1250	2024/03/31	300	298	33,501
	US TREASURY	2.5000	2024/05/15	680	691	77,612
	US TREASURY	2.0000	2024/06/30	310	305	34,307
	US TREASURY	2.3750	2024/08/15	690	696	78,121
	US TREASURY	2.1250	2024/09/30	320	317	35,648
	US TREASURY	2.2500	2024/11/15	450	450	50,510
	US TREASURY	2.0000	2025/02/15	460	451	50,700
	US TREASURY	2.1250	2025/05/15	450	445	49,960
	US TREASURY	2.0000	2025/08/15	440	430	48,349
	US TREASURY	2.2500	2025/11/15	450	448	50,286
	US TREASURY	1.6250	2026/02/15	430	407	45,723
	US TREASURY	1.6250	2026/05/15	450	425	47,734
	US TREASURY	1.5000	2026/08/15	420	392	43,983
	US TREASURY	2.0000	2026/11/15	410	398	44,680
	US TREASURY	2.2500	2027/02/15	430	425	47,789
	US TREASURY	2.3750	2027/05/15	420	420	47,152
	US TREASURY	2.2500	2027/08/15	450	445	49,948

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	4.5000	2036/02/15	100	128	14,462
	US TREASURY	5.0000	2037/05/15	40	54	6,152
	US TREASURY	4.3750	2038/02/15	50	63	7,158
	US TREASURY	4.5000	2038/05/15	50	64	7,278
	US TREASURY	3.5000	2039/02/15	90	102	11,479
	US TREASURY	4.2500	2039/05/15	80	100	11,301
	US TREASURY	4.5000	2039/08/15	80	104	11,678
	US TREASURY	4.3750	2039/11/15	90	115	12,935
	US TREASURY	4.6250	2040/02/15	150	198	22,290
	US TREASURY	3.8750	2040/08/15	110	131	14,782
	US TREASURY	4.2500	2040/11/15	120	151	17,013
	US TREASURY	4.7500	2041/02/15	130	175	19,719
	US TREASURY	3.1250	2041/11/15	110	117	13,178
	US TREASURY	3.1250	2042/02/15	120	128	14,372
	US TREASURY	3.0000	2042/05/15	110	114	12,896
	US TREASURY	2.7500	2042/08/15	160	159	17,918
	US TREASURY	2.7500	2042/11/15	190	189	21,265
	US TREASURY	3.1250	2043/02/15	210	223	25,108
	US TREASURY	2.8750	2043/05/15	270	275	30,876
	US TREASURY	3.6250	2043/08/15	240	278	31,195
	US TREASURY	3.7500	2043/11/15	280	331	37,169
	US TREASURY	3.6250	2044/02/15	290	336	37,756
	US TREASURY	3.3750	2044/05/15	280	311	34,981
	US TREASURY	3.1250	2044/08/15	290	309	34,684
	US TREASURY	3.0000	2044/11/15	290	302	33,906
	US TREASURY	2.5000	2045/02/15	280	264	29,668
	US TREASURY	3.0000	2045/05/15	280	291	32,719
	US TREASURY	2.8750	2045/08/15	290	294	33,077
	US TREASURY	3.0000	2045/11/15	290	301	33,874
	US TREASURY	2.5000	2046/02/15	260	244	27,474
	US TREASURY	2.5000	2046/05/15	290	272	30,627
	US TREASURY	2.2500	2046/08/15	260	231	26,007
	US TREASURY	2.8750	2046/11/15	270	274	30,770
	US TREASURY	3.0000	2047/02/15	260	270	30,375
	US TREASURY	3.0000	2047/05/15	280	291	32,712
	US TREASURY	2.7500	2047/08/15	250	247	27,791
	US TREASURY	6.2500	2030/05/15	60	84	9,518
	US TREASURY	4.3750	2040/05/15	130	166	18,711

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			%		千円ドル	千円ドル	千円
国債証券	US TREASURY		4.3750	2041/05/15	90	115	13,009
	US TREASURY		3.7500	2041/08/15	120	141	15,866
小計			—	—	—	—	5,587,089
カナダ					千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
国債証券	CANADA GOVERNMENT		2.7500	2064/12/01	30	34	3,013
	CANADIAN GOVERNMENT		0.5000	2018/11/01	70	69	6,100
	CANADIAN GOVERNMENT		0.5000	2019/02/01	30	29	2,607
	CANADIAN GOVERNMENT		1.7500	2019/03/01	160	160	14,117
	CANADIAN GOVERNMENT		0.7500	2019/05/01	20	19	1,739
	CANADIAN GOVERNMENT		3.7500	2019/06/01	200	207	18,178
	CANADIAN GOVERNMENT		1.7500	2019/09/01	210	211	18,537
	CANADIAN GOVERNMENT		1.2500	2019/11/01	110	109	9,619
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5000	2020/03/01	160	160	14,052
	CANADIAN GOVERNMENT		3.5000	2020/06/01	90	94	8,293
	CANADIAN GOVERNMENT		0.7500	2020/09/01	170	166	14,617
	CANADIAN GOVERNMENT		0.7500	2021/03/01	120	116	10,263
	CANADIAN GOVERNMENT		3.2500	2021/06/01	90	95	8,353
	CANADIAN GOVERNMENT		0.7500	2021/09/01	90	87	7,661
	CANADIAN GOVERNMENT		0.5000	2022/03/01	100	95	8,371
	CANADIAN GOVERNMENT		2.7500	2022/06/01	90	94	8,285
	CANADIAN GOVERNMENT		1.0000	2022/09/01	120	116	10,214
	CANADIAN GOVERNMENT		1.7500	2023/03/01	30	30	2,638
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5000	2023/06/01	100	98	8,678
	CANADIAN GOVERNMENT		2.5000	2024/06/01	100	104	9,169
	CANADIAN GOVERNMENT		2.2500	2025/06/01	80	82	7,231
	CANADIAN GOVERNMENT		1.5000	2026/06/01	100	96	8,513
	CANADIAN GOVERNMENT		1.0000	2027/06/01	90	82	7,256
	CANADIAN GOVERNMENT		8.0000	2027/06/01	30	45	4,016
	CANADIAN GOVERNMENT		2.0000	2028/06/01	30	29	2,633
	CANADIAN GOVERNMENT		5.7500	2029/06/01	70	96	8,488
	CANADIAN GOVERNMENT		5.7500	2033/06/01	90	132	11,652
	CANADIAN GOVERNMENT		5.0000	2037/06/01	80	114	10,086
	CANADIAN GOVERNMENT		4.0000	2041/06/01	110	144	12,649
	CANADIAN GOVERNMENT		3.5000	2045/12/01	110	137	12,041
	CANADIAN GOVERNMENT		2.7500	2048/12/01	90	99	8,719
小計			—	—	—	—	277,804

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	5.2500	2019/03/15	140	146	12,411
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2019/10/21	160	162	13,812
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2020/04/15	190	201	17,109
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2020/11/21	180	179	15,182
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2021/05/15	300	337	28,655
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2022/07/15	190	220	18,687
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5000	2023/04/21	160	186	15,834
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/04/21	170	174	14,779
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/04/21	180	190	16,123
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/04/21	230	260	22,106
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	200	237	20,100
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	180	182	15,502
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	140	135	11,482
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	110	111	9,430
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	140	148	12,554
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	90	108	9,190
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	50	48	4,092
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.7500	2037/04/21	70	76	6,525
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	50	50	4,294
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	70	65	5,544
小計		—	—	—	—	273,421
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	2.5000	2019/06/01	60	61	5,048
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.6250	2019/10/01	30	30	2,490
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.2500	2020/09/01	50	52	4,328
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2021/06/01	60	61	5,070
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.1250	2022/09/01	60	63	5,281
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2023/07/01	30	31	2,602
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2024/09/01	50	53	4,407
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/06/01	20	20	1,695
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/06/01	20	20	1,663
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	50	55	4,619
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	10	10	879
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	20	21	1,754
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	50	56	4,652
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	10	9	807
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	20	20	1,722
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	20	20	1,734
小計		—	—	—	—	48,759

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千円	邦貨換算金額
イギリス		%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円
国債証券	UK TREASURY	3.7500	2019/09/07	100	105	15,695
	UK TREASURY	3.7500	2020/09/07	140	152	22,607
	UK TREASURY	3.7500	2021/09/07	100	111	16,565
	UK TREASURY	4.5000	2019/03/07	130	136	20,268
	UK TREASURY	4.5000	2034/09/07	150	210	31,217
	UK TREASURY	4.5000	2042/12/07	130	198	29,348
	UK TREASURY	4.2500	2036/03/07	150	207	30,817
	UK TREASURY	4.2500	2046/12/07	120	183	27,198
	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	90	114	17,032
	UK TREASURY	4.2500	2032/06/07	110	147	21,833
	UK TREASURY	4.2500	2039/09/07	100	142	21,168
	UK TREASURY	4.2500	2040/12/07	120	173	25,710
	UK TREASURY	4.2500	2055/12/07	120	203	30,224
	UK TREASURY	4.7500	2020/03/07	120	131	19,528
	UK TREASURY	4.7500	2030/12/07	90	124	18,421
	UK TREASURY	4.0000	2022/03/07	90	102	15,221
	UK TREASURY	4.0000	2060/01/22	100	168	25,036
	UK TREASURY	4.7500	2038/12/07	100	150	22,371
	UK TREASURY	5.0000	2025/03/07	110	140	20,840
	UK TREASURY	8.0000	2021/06/07	90	113	16,810
	UK TREASURY	6.0000	2028/12/07	70	103	15,315
	UK TREASURY	1.5000	2021/01/22	170	174	25,917
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	140	143	21,249
	UK TREASURY	1.5000	2047/07/22	120	110	16,337
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	120	119	17,641
	UK TREASURY	1.7500	2019/07/22	220	224	33,284
	UK TREASURY	1.7500	2022/09/07	160	167	24,809
	UK TREASURY	1.7500	2057/07/22	60	60	8,968
	UK TREASURY	2.2500	2023/09/07	120	129	19,146
	UK TREASURY	2.7500	2024/09/07	100	111	16,521
	UK TREASURY	2.0000	2020/07/22	180	187	27,712
	UK TREASURY	2.0000	2025/09/07	140	149	22,143
	UK TREASURY	3.5000	2068/07/22	120	195	28,900
	UK TREASURY	3.2500	2044/01/22	160	204	30,304
	UK TREASURY	3.7500	2052/07/22	110	165	24,589
	UK TREASURY	3.5000	2045/01/22	150	200	29,763
	UK TREASURY	4.2500	2049/12/07	100	158	23,533
	UK TREASURY	0.5000	2022/07/22	170	167	24,881

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名			利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						千円換算金額	
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	UK TREASURY		0.7500	2023/07/22	60	59	8,807
	UK TREASURY		1.7500	2037/09/07	60	59	8,750
	UK TREASURY		2.5000	2065/07/22	120	152	22,603
	小計		—	—	—	—	899,104
スイス					千スイス・フラン	千スイス・フラン	
国債証券	SWITZERLAND		2.2500	2020/07/06	180	194	22,046
小計			—	—	—	—	22,046
デンマーク					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	
国債証券	KINGDOM OF DENMARK		0.2500	2018/11/15	350	353	6,255
	KINGDOM OF DENMARK		4.0000	2019/11/15	570	623	11,035
	KINGDOM OF DENMARK		0.2500	2020/11/15	110	112	1,995
	KINGDOM OF DENMARK		3.0000	2021/11/15	660	750	13,297
	KINGDOM OF DENMARK		1.5000	2023/11/15	400	438	7,767
	KINGDOM OF DENMARK		1.7500	2025/11/15	660	743	13,168
	KINGDOM OF DENMARK		0.5000	2027/11/15	330	331	5,873
	KINGDOM OF DENMARK		4.5000	2039/11/15	910	1,541	27,301
小計			—	—	—	—	86,694
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		4.5000	2019/05/22	560	593	8,063
	NORWEGIAN GOVERNMENT		3.7500	2021/05/25	540	594	8,072
	NORWEGIAN GOVERNMENT		2.0000	2023/05/24	450	471	6,407
	NORWEGIAN GOVERNMENT		3.0000	2024/03/14	340	376	5,120
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.7500	2025/03/13	210	216	2,936
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.5000	2026/02/19	260	261	3,558
	NORWEGIAN GOVERNMENT		1.7500	2027/02/17	240	244	3,325
小計			—	—	—	—	37,484
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		4.2500	2019/03/12	670	715	9,515
	SWEDISH GOVERNMENT		5.0000	2020/12/01	620	724	9,636
	SWEDISH GOVERNMENT		3.5000	2022/06/01	770	900	11,980
	SWEDISH GOVERNMENT		1.5000	2023/11/13	560	607	8,080
	SWEDISH GOVERNMENT		2.5000	2025/05/12	420	488	6,501
	SWEDISH GOVERNMENT		1.0000	2026/11/12	390	407	5,413
	SWEDISH GOVERNMENT		0.7500	2028/05/12	330	330	4,400
	SWEDISH GOVERNMENT		3.5000	2039/03/30	300	411	5,479
小計			—	—	—	—	61,007

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千メキシコ・ペソ	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	2018/12/13	1,400	1,419	8,417
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0000	2019/12/11	1,430	1,373	8,143
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2020/06/11	1,860	1,900	11,270
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2021/06/10	2,150	2,110	12,514
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2022/06/09	1,350	1,318	7,819
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2023/12/07	710	740	4,393
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/05	1,690	1,958	11,610
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	990	901	5,344
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	1,060	1,077	6,386
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	690	752	4,464
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	850	874	5,187
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	640	656	3,895
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	500	623	3,695
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	780	856	5,076
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	1,280	1,301	7,716
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	400	418	2,479
小計		—	—	—	—	108,415
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	3.7590	2019/03/15	50	50	1,356
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3780	2019/11/29	200	203	5,499
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8890	2020/07/31	190	191	5,176
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1600	2021/07/15	200	203	5,481
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4180	2022/08/15	240	235	6,357
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4800	2023/03/15	140	136	3,689
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1810	2024/07/15	170	171	4,621
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/09/15	90	88	2,378
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/04/15	60	60	1,637
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9000	2026/11/30	60	58	1,574
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/03/15	100	97	2,620
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/06/15	80	75	2,047
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/04/15	70	69	1,878
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	120	115	3,119
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1270	2032/04/15	30	28	763
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	60	54	1,470
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/05/31	70	66	1,790
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	30	29	806
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	30	29	801
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	50	48	1,299
	MALAYSIA GOVERNMENT	5.2480	2028/09/15	60	63	1,725
小計		—	—	—	—	56,096

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	8.0000	2018/12/21	300	300	2,404	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.2500	2020/01/15	390	384	3,070	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.7500	2021/03/31	450	429	3,434	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.7500	2023/02/28	440	423	3,384	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5000	2026/12/21	1,310	1,402	11,209	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0000	2030/01/31	640	557	4,456	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0000	2031/02/28	820	647	5,172	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.2500	2032/03/31	480	416	3,329	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.8750	2035/02/28	420	374	2,989	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.2500	2036/03/31	540	366	2,931	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5000	2037/01/31	790	673	5,377	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0000	2040/01/31	260	228	1,825	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5000	2041/02/28	710	472	3,777	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2044/01/31	600	509	4,072	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.7500	2048/02/28	1,120	951	7,605	
小計			—	—	—	—	65,042
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	0.0000	2019/04/25	130	128	3,986	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.5000	2019/10/25	260	279	8,695	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.5000	2020/04/25	80	79	2,473	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.2500	2020/10/25	280	305	9,524	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2021/10/25	430	484	15,093	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2022/09/23	310	353	11,012	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2023/10/25	200	212	6,600	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	180	180	5,615	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	260	244	7,607	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	230	213	6,633	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/04/25	70	86	2,696	
	小計			—	—	—	—
ユーロ					千ユーロ	千ユーロ	
アイルランド							
国債証券	IRISH TREASURY	0.8000	2022/03/15	50	52	6,883	
	IRISH TREASURY	1.0000	2026/05/15	70	72	9,548	
	IRISH TREASURY	1.7000	2037/05/15	30	30	4,066	
	IRISH TREASURY	2.0000	2045/02/18	50	52	6,903	
	IRISH TREASURY	2.4000	2030/05/15	60	69	9,145	
	IRISH TREASURY	0.0000	2022/10/18	30	30	3,969	
	IRISH TREASURY	3.4000	2024/03/18	50	60	7,928	

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
アイルランド						
国債証券	IRISH TREASURY	3.9000	2023/03/20	40	48	6,373
	TREASURY 4 1/2% 2020	4.5000	2020/04/18	70	78	10,356
	TREASURY 4.4% 2019	4.4000	2019/06/18	30	32	4,267
	TREASURY 5% 2020	5.0000	2020/10/18	60	69	9,191
	TREASURY 5.4% 2025	5.4000	2025/03/13	80	109	14,364
	TREASURY 5.9% 2019	5.9000	2019/10/18	70	78	10,377
	小計	—	—	—	—	103,376
オランダ						
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.2500	2019/01/15	110	112	14,831
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2019/07/15	100	107	14,214
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2020/01/15	100	102	13,446
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5000	2020/07/15	100	111	14,643
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.2500	2021/07/15	110	125	16,511
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2022/01/15	100	101	13,401
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.2500	2022/07/15	100	112	14,784
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2023/01/15	100	120	15,929
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.7500	2023/07/15	110	122	16,076
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2024/01/15	40	40	5,291
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2024/07/15	110	124	16,437
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2025/07/15	100	100	13,275
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2026/07/15	100	101	13,403
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2027/07/15	100	102	13,539
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/01/15	90	135	17,836
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/01/15	90	111	14,687
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/01/15	100	153	20,233
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/01/15	100	155	20,553
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/01/15	90	122	16,204
	小計	—	—	—	—	285,302
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2019/03/28	80	85	11,209
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2019/09/28	90	96	12,663
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2020/09/28	130	146	19,266
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2021/09/28	120	142	18,713
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2022/03/28	90	107	14,137
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2022/09/28	110	134	17,711
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2023/06/22	90	102	13,457
	BELGIUM KINGDOM	0.2000	2023/10/22	40	40	5,347

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	2.6000	2024/06/22	110	128	16,921
	BELGIUM KINGDOM	0.5000	2024/10/22	50	51	6,753
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/06/22	110	114	15,096
	BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/03/28	70	94	12,438
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/06/22	100	105	13,836
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2027/06/22	90	91	12,102
	BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	130	194	25,682
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/06/22	70	70	9,256
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/03/28	60	84	11,146
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/06/22	50	64	8,445
	BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	130	209	27,626
	BELGIUM KINGDOM	1.4500	2037/06/22	20	20	2,692
	BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/06/22	50	54	7,230
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/03/28	120	187	24,753
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/06/22	70	104	13,711
	BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/06/22	50	49	6,457
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2057/06/22	20	22	2,920
	BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/06/22	20	21	2,806
小計		—	—	—	—	332,385
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2018/11/25	150	152	20,103
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2019/02/25	120	121	15,952
	FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2019/04/25	320	342	45,162
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2019/05/25	30	30	4,054
	FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2019/10/25	310	336	44,375
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2019/11/25	200	204	26,974
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2020/02/25	180	182	24,043
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2020/04/25	260	286	37,694
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2020/05/25	160	162	21,393
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2020/10/25	250	272	35,906
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2020/11/25	180	184	24,260
	FRANCE (GOVT OF)	3.7500	2021/04/25	260	298	39,272
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2021/05/25	160	162	21,408
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2021/10/25	270	309	40,733
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2022/04/25	350	402	52,976
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2022/05/25	130	131	17,351
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2022/10/25	220	247	32,555

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	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2023/03/25	50	50	6,634
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2023/05/25	340	375	49,487
	FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2023/10/25	300	377	49,791
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2024/05/25	230	263	34,723
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	240	267	35,254
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/05/25	220	225	29,646
	FRANCE (GOVT OF)	6.0000	2025/10/25	190	277	36,556
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	190	200	26,464
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/04/25	240	303	40,039
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/05/25	200	202	26,639
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	210	206	27,151
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2027/05/25	200	208	27,454
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	260	314	41,427
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/05/25	20	20	2,646
	FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/04/25	200	305	40,202
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/05/25	230	274	36,104
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/05/25	230	245	32,308
	FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	220	364	48,086
	FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/04/25	180	282	37,193
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/05/25	150	148	19,585
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	180	267	35,301
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2039/06/25	60	63	8,404
	FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/04/25	230	370	48,820
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/05/25	170	231	30,510
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2048/05/25	100	106	14,043
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/04/25	100	160	21,098
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/04/25	90	147	19,436
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/05/25	50	47	6,309
小計		—	—	—	—	1,335,544
ドイツ						
国債証券	BUNDES OBLIGATION	1.0000	2019/02/22	130	132	17,519
	BUNDES OBLIGATION	0.5000	2019/04/12	110	111	14,756
	BUNDES OBLIGATION	0.2500	2019/10/11	120	122	16,116
	BUNDES OBLIGATION	0.0000	2020/04/17	150	152	20,104
	BUNDES OBLIGATION	0.2500	2020/10/16	130	133	17,586
	BUNDES OBLIGATION	0.0000	2021/04/09	150	153	20,160
	BUNDES OBLIGATION	0.0000	2021/10/08	130	132	17,474

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
						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	BUNDESobligation	0.0000	2022/04/08	120	122	16,115
	BUNDESobligation	0.0000	2022/10/07	110	111	14,744
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.7500	2019/01/04	140	147	19,400
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5000	2019/07/04	160	171	22,557
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2020/01/04	140	152	20,031
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0000	2020/07/04	250	274	36,168
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2021/01/04	130	142	18,830
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2021/07/04	230	262	34,545
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2022/01/04	140	154	20,360
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2022/09/04	290	316	41,698
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/02/15	120	131	17,323
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/05/15	120	131	17,355
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2023/08/15	120	135	17,845
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2024/02/15	210	235	30,983
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2024/05/15	110	121	16,027
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2024/08/15	130	139	18,382
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/02/15	160	165	21,864
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	160	171	22,638
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	180	185	24,453
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	170	167	22,011
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	170	169	22,331
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2027/08/15	130	131	17,354
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/01/04	70	117	15,420
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/07/04	130	209	27,658
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	160	246	32,477
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	90	147	19,391
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	110	193	25,464
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	100	146	19,317
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	150	196	25,855
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	160	211	27,804
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	20	20	2,639
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2018/12/14	90	90	11,955
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2019/03/15	90	90	11,982
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2019/06/14	90	91	12,007
	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2019/09/13	50	50	6,679
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	80	127	16,763
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	100	152	20,088

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	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	70	101	13,375
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	120	193	25,556
小計		—	—	—	—	931,180
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.7500	2018/10/31	140	145	19,170
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.2500	2019/01/31	120	120	15,925
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2019/04/30	150	156	20,655
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6000	2019/07/30	140	151	19,996
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3000	2019/10/31	140	152	20,107
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2020/01/31	160	165	21,847
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0000	2020/04/30	160	176	23,254
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.1500	2020/07/30	130	134	17,730
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8500	2020/10/31	140	160	21,138
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0500	2021/01/31	40	40	5,283
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5000	2021/04/30	160	190	25,071
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7500	2021/07/30	160	164	21,646
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.8500	2022/01/31	150	185	24,482
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4000	2022/04/30	140	141	18,591
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4500	2022/10/31	30	30	3,966
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4000	2023/01/31	150	188	24,802
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4000	2023/10/31	140	170	22,517
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8000	2024/01/31	120	149	19,754
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8000	2024/04/30	150	178	23,513
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	160	180	23,717
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/04/30	130	135	17,863
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/07/30	160	202	26,688
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	150	161	21,261
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	130	137	18,067
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	130	179	23,635
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	150	149	19,714
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	120	120	15,885
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	90	89	11,747
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	120	161	21,291
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/01/31	170	244	32,241
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/07/30	140	140	18,546
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/07/30	140	206	27,174
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.3500	2033/07/30	50	50	6,712

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
スペイン						
国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/01/31	140	179	23,664
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/07/30	110	154	20,296
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7000	2041/07/30	110	150	19,871
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	90	130	17,245
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	90	91	12,008
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/07/30	40	42	5,634
	小計	—	—	—	—	752,723
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2018/12/01	130	135	17,817
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2019/02/01	210	221	29,200
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2019/03/01	50	53	6,995
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.1000	2019/04/15	160	160	21,210
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2019/05/01	130	135	17,827
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2019/08/01	100	103	13,579
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2019/09/01	170	183	24,208
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0500	2019/10/15	120	120	15,908
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0500	2019/12/01	110	112	14,876
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2020/02/01	110	121	15,998
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.2500	2020/03/01	230	253	33,381
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.7000	2020/05/01	220	224	29,584
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2020/09/01	200	222	29,320
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2020/11/01	100	101	13,427
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/03/01	160	179	23,605
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/05/01	120	134	17,769
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.4500	2021/06/01	130	131	17,308
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2021/08/01	360	406	53,607
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2021/12/15	220	236	31,102
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2022/04/15	390	404	53,348
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/09/01	130	160	21,115
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2022/09/15	190	197	26,056
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/11/01	140	173	22,808
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2023/03/15	120	121	15,977
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2023/05/01	140	167	22,092
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2023/08/01	170	207	27,309
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2023/10/15	90	88	11,680
	BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0000	2023/11/01	80	117	15,452
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2024/03/01	160	193	25,493

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8500	2024/05/15	100	104	13,784
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2024/09/01	150	174	23,049
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2024/12/01	170	184	24,276
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2025/03/01	170	213	28,134
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2025/06/01	140	141	18,586
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/01	120	124	16,401
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/03/01	140	172	22,696
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6000	2026/06/01	120	120	15,811
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2500	2026/12/01	120	115	15,273
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2000	2027/06/01	110	114	15,035
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0500	2027/08/01	100	102	13,442
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5000	2027/11/01	180	257	33,881
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/09/01	150	190	25,101
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/01	190	254	33,487
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/03/01	160	183	24,158
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/05/01	200	288	37,966
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/03/01	150	139	18,326
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/02/01	130	186	24,518
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2033/09/01	60	60	7,949
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/08/01	170	229	30,205
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/09/01	100	95	12,582
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/02/01	190	230	30,328
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/08/01	140	191	25,173
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/09/01	150	202	26,724
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/09/01	120	159	20,957
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/09/01	110	115	15,234
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/03/01	110	103	13,656
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2048/03/01	50	53	7,053
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/03/01	40	35	4,687
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/01	80	117	15,483
小計		—	—	—	—	1,282,035
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	4.3750	2019/07/04	30	32	4,281
	FINNISH GOVERNMENT	3.3750	2020/04/15	40	43	5,781
	FINNISH GOVERNMENT	0.3750	2020/09/15	40	41	5,414
	FINNISH GOVERNMENT	3.5000	2021/04/15	50	56	7,491
	FINNISH GOVERNMENT	1.6250	2022/09/15	70	76	10,073

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
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2023/04/15	50	54	7,178
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2023/09/15	30	30	3,967
	FINNISH GOVERNMENT	2.0000	2024/04/15	30	33	4,454
	FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/07/04	40	51	6,801
	FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/09/15	30	31	4,153
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/04/15	30	30	4,015
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2027/09/15	30	29	3,947
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/07/04	30	36	4,858
	FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/04/15	30	29	3,926
	FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/07/04	30	39	5,215
小計		—	—	—	—	81,561
オーストリア						
国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.3500	2019/03/15	70	74	9,838
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.9500	2019/06/18	50	52	6,862
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.2500	2019/10/18	50	50	6,702
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9000	2020/07/15	110	123	16,225
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5000	2021/09/15	100	115	15,194
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.6500	2022/04/20	60	70	9,314
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2022/09/20	30	30	4,004
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4000	2022/11/22	70	82	10,927
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.7500	2023/10/20	110	122	16,080
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.6500	2024/10/21	70	77	10,226
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2000	2025/10/20	70	75	9,924
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	60	82	10,928
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2026/10/20	70	72	9,494
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2027/04/20	50	50	6,589
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	60	93	12,310
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/05/23	50	60	7,950
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	90	137	18,084
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/06/20	50	69	9,166
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/02/20	20	20	2,635
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/01/26	30	50	6,636
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2086/11/02	20	17	2,303
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1000	2117/09/20	20	21	2,787
小計		—	—	—	—	204,189
ユーロ小計		—	—	—	—	5,308,299
合計		—	—	—	—	12,911,205

投資信託財産の構成

2017年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	12,911,205	97.5
コール・ローン等、その他	336,070	2.5
投資信託財産総額	13,247,276	100.0

(注1) 外貨建資産は、当期末の時価を国内の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお11月20日における邦貨換算レートは、1米ドル112.19円、1カナダ・ドル87.80円、1オーストラリア・ドル84.79円、1シンガポール・ドル82.74円、1イギリス・ポンド148.17円、1スイス・フラン113.31円、1デンマーク・クローネ17.71円、1ノルウェー・クローネ13.59円、1スウェーデン・クローナ13.30円、1メキシコ・ペソ5.93円、1マレーシア・リングgit26.98円、1南アフリカ・ランド7.99円、1ポーランド・ズロチ31.13円、1ユーロ131.76円です。

(注2) 外貨建純資産（12,927,834千円）の投資信託財産総額（13,247,276千円）に対する比率は97.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	13,388,500,151円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	246,645,617
公 社 債(評価額)	12,911,205,695
未 収 入 金	141,639,867
未 収 利 息	83,467,354
前 払 費 用	5,541,618
(B)負債	324,201,150
未 払 金	295,301,913
未 払 解 約 金	28,899,082
そ の 他 未 払 費 用	155
(C)純 資 産 総 額(A - B)	13,064,299,001
元 本	9,657,039,144
次 期 繰 越 損 益 金	3,407,259,857
(D)受 益 権 総 口 数	9,657,039,144口
1万口当たり基準価額(C / D)	13,528円

- (注1) 期首元本額 8,943,455,709円
 期中追加設定元本額 2,932,961,078円
 期中一部解約元本額 2,219,377,643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) 766,894,825円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (標準型) 1,961,140,396円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (株式重視型) 733,702,272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) 787,648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 5,591,490,537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) 328,272,679円
 DCニッセイ外国債券インデックス 267,367,609円
 DCニッセイターゲットデートファンド2055 180,503円
 DCニッセイワールドセレクトファンド (安定型) 1,503,499円
 DCニッセイターゲットデートファンド2045 87,875円
 DCニッセイターゲットデートファンド2035 82,605円
 DCニッセイターゲットデートファンド2025 45,818円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド (6資産均等型) 5,299,687円
 ニッセイ・インデックスパッケージ (内外・株式/リート/債券) 183,191円

損益の状況

当期 (2017年5月23日~2017年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	151,691,732円
受 取 利 息	151,726,391
支 払 利 息	△ 34,659
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	297,594,336
売 買 益	424,763,022
売 買 損	△ 127,168,686
(C)信 託 報 酬 等	△ 2,658,323
(D)当 期 損 益 金(A + B + C)	446,627,745
(E)前 期 繰 越 損 益 金	2,723,467,087
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	991,226,134
(G)解 約 差 損 益 金	△ 754,061,109
(H)合 計(D + E + F + G)	3,407,259,857
次 期 繰 越 損 益 金(H)	3,407,259,857

- (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。