

第6期末(2020年11月20日)

基準価額	12,499円
純資産総額	79億円
騰落率	5.7%
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:2019年11月21日~2020年11月20日

第6期(決算日 2020年11月20日)

商品内容、運用状況などについてのお問い合わせ先

 **0120-762-506** (コールセンター)

受付時間は営業日の午前9時から午後5時までです。

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

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて「<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(4資産均等型)」は、このたび第6期の決算を行いました。

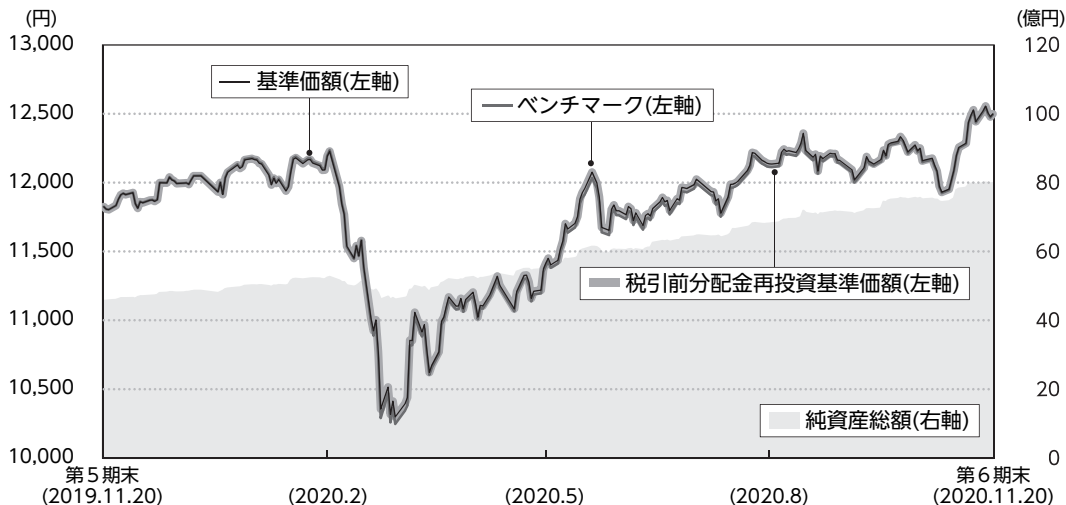
当ファンドは、投資対象の異なる4つのマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式市場および債券市場の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ここに運用状況をご報告申し上げます。

今後ともいっそうのご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

運用経過

2019年11月21日～2020年11月20日

基準価額等の推移



第6期首	11,825円	既払分配金	0円
第6期末	12,499円	騰落率(分配金再投資ベース)	5.7%

- (注1) 税引前分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)、NOMURA-BPI総合、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)を25%ずつ組み合わせて合成したもので、前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。なおベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

■ 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は為替市場における米ドルの対円での下落や、2020年3月下旬にかけて新型コロナウイルスの感染拡大への警戒懸念から国内株式市場が大きく下落したことなどを受けて下落しました。しかし、その後は国内株式市場や主要な海外株式市場が上昇したこと等が上昇要因となり、結局、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

組入マザーファンド	基本投資割合	組入比率	騰落率
ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド	25.0%	25.6%	4.6%
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	25.0	24.4	△1.1
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	25.0	25.6	9.0
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	25.0	24.4	4.7

(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6期		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	18円	0.154%	$\text{信託報酬} = \text{期中の平均基準価額} \times \text{信託報酬率} \times \frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ 期中の平均基準価額は11,814円です。
(投信会社)	(8)	(0.066)	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)	(8)	(0.066)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等の対価
売買委託手数料	0	0.001	$\text{売買委託手数料} = \text{期中の売買委託手数料} / \text{期中の平均受益権口数}$ 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	0	0.003	$\text{有価証券取引税} = \text{期中の有価証券取引税} / \text{期中の平均受益権口数}$ 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.003)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	2	0.019	その他費用 = 期中のその他費用 / 期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.015)	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)	(0)	(0.001)	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	21	0.177	

(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。

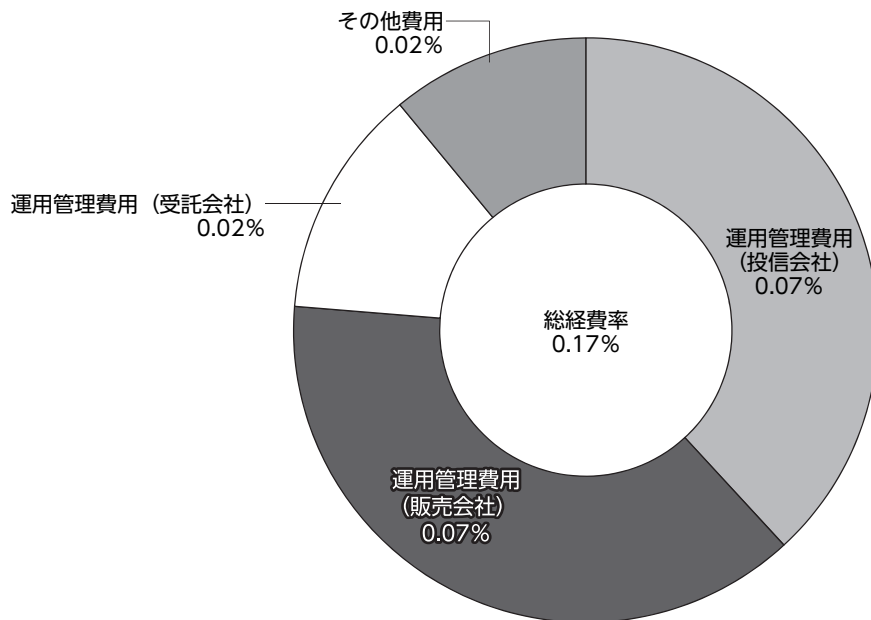
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(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。

（参考情報）

■ 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.17%**です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

投資環境

国内株式市況

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初以降、株価はおおむね上昇基調となりましたが、米国とイランの対立激化懸念などから2020年1月になると下落しました。さらに、中国で発生した新型コロナウイルスの感染拡大懸念から市場心理が大幅に悪化すると、3月下旬にかけて株価は大幅に下落しました。

その後、各国における緊急経済対策の発表や各国中銀による金融支援策の決定などから株価は反発し、同ウイルスの感染拡大に落ち着きが見られたことによる経済活動の再開期待の高まりなどから6月上旬まで上昇基調となりました。

その後は新型コロナウイルスの感染拡大第2波や「香港国家安全維持法案」をめぐる米中対立懸念から株価は下落し、7月には同ウイルスの治療薬開発に対する期待などを背景に上昇する場面もありましたが、感染拡大に歯止めがかからず、米中対立の激化や円高進行、企業業績の悪化も懸念されたことにより株価は下落しました。

8月以降は米株高、国内企業の第1四半期決算の内容や通期予想の下方修正が想定内であったことに加えて、新型コロナウイルスのワクチン開発期待などを背景に株価はおおむね上昇し、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

国内債券市況

当期の10年国債金利は上昇しました。

期初以降、米中両国の良好な経済指標などを受けて国内金利はおおむね上昇基調となりましたが、1月下旬から3月上旬にかけては、中国で発生した新型コロナウイルスの世界的な感染拡大懸念を背景に、大きく低下しました。その後、3月中旬にかけては同ウイルスのさらなる世界的な感染拡大に伴う市場の流動性低下懸念などから金利は急上昇しましたが、下旬になると日銀が臨時の買い入れオペ（公開市場操作）を発表したことなどから低下しました。4月以降も同ウイルスの感染拡大に対する先行き不透明感などから金利は低下傾向で推移しましたが、経済活動再開への期待感などから上昇する場面もありました。

5月以降は同ウイルスの感染再拡大懸念や米中対立懸念などが金利の低下要因となる一方、経済対策への期待感や8月以降の株式市場がおおむね堅調であったことなどが上昇要因となり、国内金利は上下しつつは横ばいでの動きとなり、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

海外株式市況

当期の海外株式市場は、期初以降、堅調な経済指標や米中貿易摩擦懸念の後退を背景に、2019年12月にかけて上昇基調で推移しました。2020年1月下旬に入ると、米国によるイラン空爆を受けて中東の地政学リスクが高まったことや新型コロナウイルスの感染拡大を背景とした世界景気への懸念などから下落し、その後も中国外での新規感染者数増加や企業業績への影響懸念からセンチメント（市場心理）が悪化して、3月下旬にかけて大幅に下落しました。4月以降は同ウイルスのワクチン開発への期待感や経済活動の再開に加え、堅調な経済指標を背景に海外株式市場は上昇する展開となりました。結局、前期末と比較すると米国は上昇しましたが、欧州については新型コロナウイルスの感染再拡大に加え、イギリスと欧州連合（EU）の離脱協定を巡る対立の問題もあり、ドイツは横ばい、イギリスは下落して当期末を迎えました。

■海外債券市況

当期の米国10年国債金利は、期初以降、米中貿易協議への進展期待などから上昇しましたが、年明け以降は中東情勢の緊迫化などから低下し、その後も新型コロナウイルスの感染拡大懸念などを受けて低下を続けました。3月中旬には財政支出の増大懸念などから金利は上昇しましたが、その後は各国中央銀行の大規模緩和策などが低下圧力となり、徐々に低下しました。4月以降は同ウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感などが上昇要因となる一方、同ウイルスの感染再拡大への警戒感などから金利は上下する展開となり、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初以降、イギリスの欧州連合（EU）離脱を巡る不透明要因の低下などから上昇しましたが、年明け以降は中東情勢の緊迫化などを受けて低下し、新型コロナウイルスの感染拡大懸念等からさらに低下しました。3月中旬には財政支出の増大懸念などから金利は上昇しましたが、各国中央銀行の大規模緩和策等が低下圧力となり、徐々に低下しました。4月以降は同ウイルスの治療薬開発やEUの復興基金への期待感などが上昇要因となる一方、同ウイルスの感染再拡大への警戒感から金利は低下基調となり、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

■為替市況

当期の米ドル／円レートは下落しました。期初以降、対円でおおむね横ばいで推移した後、2020年1月には中東情勢や新型コロナウイルスの感染拡大懸念等から上下しました。2月に入り堅調な株式市場などを背景に上昇しましたが、同ウイルスの感染拡大懸念が強まったことから、3月上旬にかけて大きく下落しました。その後は企業や機関投資家による流動性確保の動きから米ドル需要が旺盛となり急反発しましたが、各国中央銀行の流動性供給策を受けて、5月上旬まで下落しました。以降は同ウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感などから上昇する場面もありましたが、米中对立懸念や感染再拡大への懸念などもあり、米ドルはおおむね下落基調となりました。

当期のユーロ／円レートは上昇しました。期初以降、対円で横ばい推移した後、新型コロナウイルスの感染拡大懸念等を背景に5月上旬まで下落基調となりました。その後は欧米における同ウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感などからユーロは上昇しましたが、6月に入ると感染拡大第2波への警戒感などから下落しました。7月以降は欧州復興基金への期待感などもあり上昇基調となりましたが、9月から当期末にかけてはイギリス・EU間の通商交渉への観測などを背景に、ユーロは上下しつつおおむね横ばいとなりました。

ポートフォリオ

■当ファンド

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

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークであるT O P I X（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

国内の公社債に投資することにより、ベンチマークであるN O M U R A - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

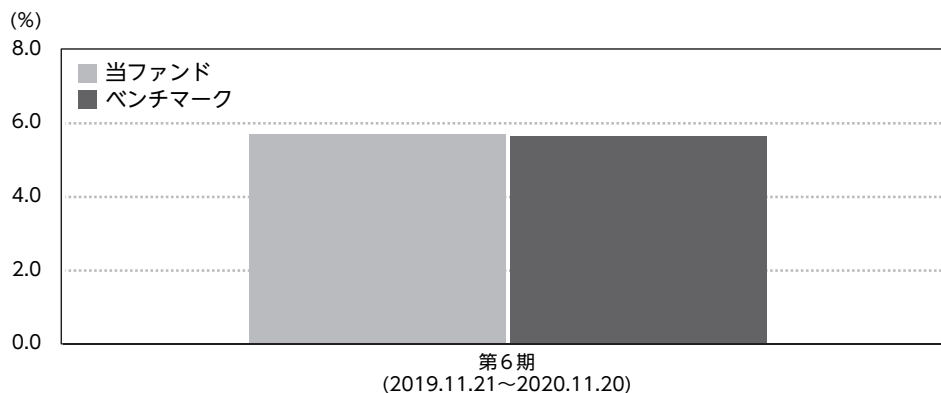
日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、ベンチマークであるM S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

日本を除く主要国の国債に投資することにより、ベンチマークであるF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

* ベンチマークの詳細につきましては、後掲の「指数に関して」をご参照ください。

ベンチマークとの差異



当期の税引前分配金再投資基準価額騰落率は+5.7%となり、ベンチマーク騰落率（+5.6%）にはほぼ連動しました。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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 2019年11月21日~2020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	2,646円

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

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■各マザーファンド

<ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド>

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

<ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド>

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

ファンドデータ

当ファンドの組入資産の内容

■組入ファンド

	第6期末 2020年11月20日
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド	25.6%
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド	24.4
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド	25.6
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド	24.4

(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

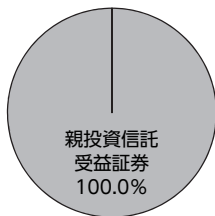
(注2) 組入全ファンドを記載しています。

■純資産等

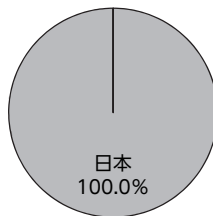
項目	第6期末 2020年11月20日
純資産総額	7,982,868,015円
受益権総口数	6,386,621,435口
1万口当たり基準価額	12,499円

(注) 当期間中における追加設定元本額は3,477,266,489円、同解約元本額は946,384,774円です。

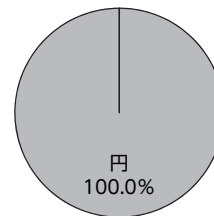
■資産別配分



■国別配分



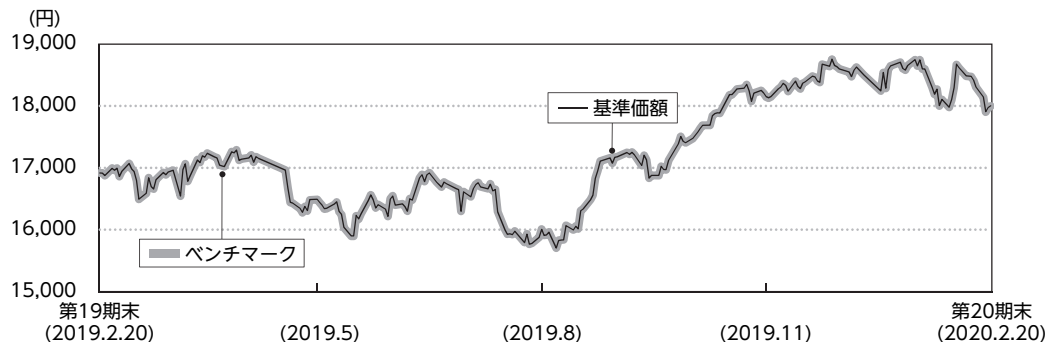
■通貨別配分



(注) 資産別・国別・通貨別配分は、2020年11月20日現在のものであり、比率は純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

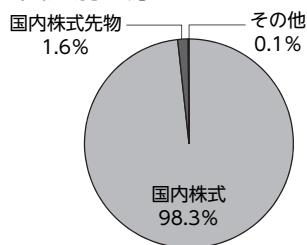
銘柄名	通貨	比率
トヨタ自動車	円	3.6%
ソニー	円	2.0
ソフトバンクグループ	円	1.8
三菱UFJフィナンシャル・グループ	円	1.6
日本電信電話	円	1.5
キーエンス	円	1.4
武田薬品工業	円	1.4
リクルートホールディングス	円	1.3
三井住友フィナンシャルグループ	円	1.1
KDDI	円	1.0
組入銘柄数		1,860

■ 1万口当たりの費用明細

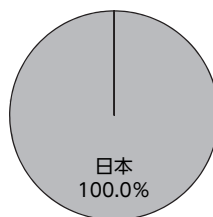
2019.2.21～2020.2.20

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

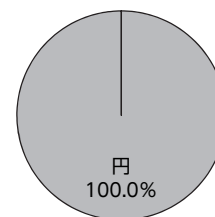
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



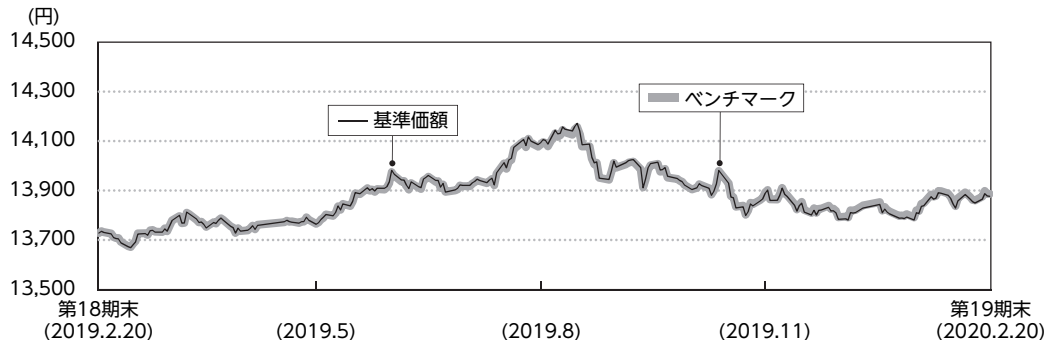
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2020年2月20日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書（全体版）の組入有価証券明細表をご参照ください。

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

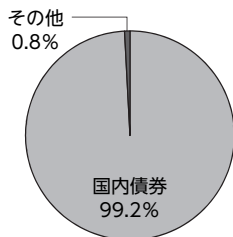
銘柄名	通貨	比率
第342回 利付国債（10年）	円	7.5%
第143回 利付国債（20年）	円	7.4
第160回 利付国債（20年）	円	6.9
第133回 利付国債（5年）	円	6.2
第117回 利付国債（20年）	円	6.1
第100回 利付国債（20年）	円	5.7
第333回 利付国債（10年）	円	5.7
第350回 利付国債（10年）	円	4.8
第54回 利付国債（30年）	円	4.7
第403回 利付国債（2年）	円	4.5
組入銘柄数		34

■ 1万口当たりの費用明細

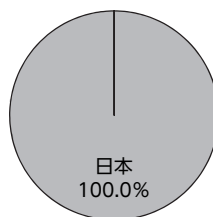
2019.2.21~2020.2.20

項目	金額
その他費用 （その他）	0円 (0)
合計	0

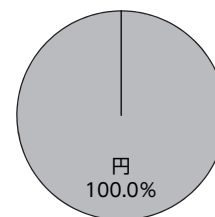
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



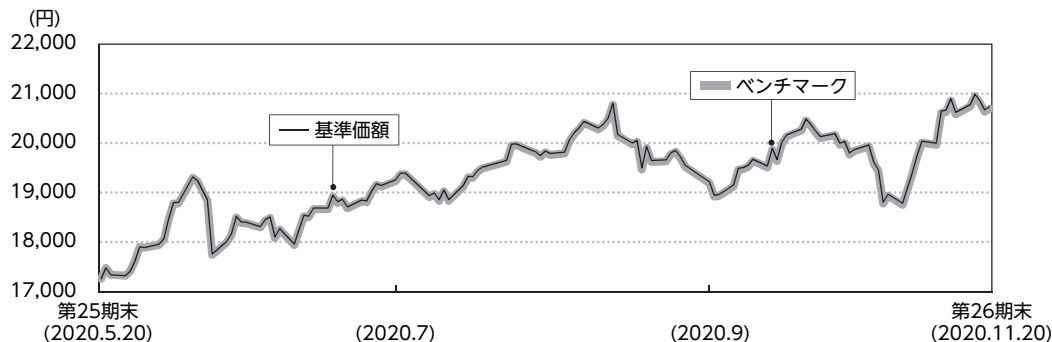
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2020年2月20日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書（全体版）の組入有価証券明細表をご参照ください。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

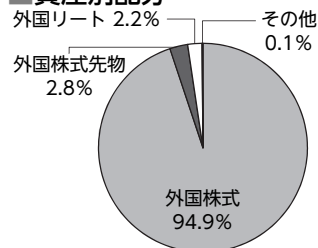
銘柄名	通貨	比率
APPLE INC	米ドル	4.5%
MICROSOFT CORP	米ドル	3.3%
AMAZON.COM INC	米ドル	2.9%
FACEBOOK INC-A	米ドル	1.4%
ALPHABET INC-CL C	米ドル	1.2%
ALPHABET INC-CL A	米ドル	1.1%
JOHNSON & JOHNSON	米ドル	0.8%
TESLA, INC.	米ドル	0.8%
JPMORGAN CHASE & CO	米ドル	0.8%
VISA INC-CLASS A SHARES	米ドル	0.8%
組入銘柄数		1,275

■ 1万口当たりの費用明細

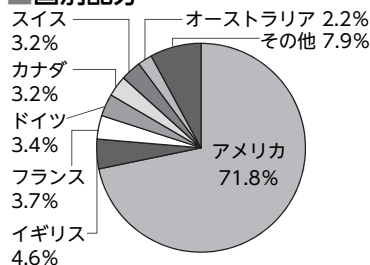
2020.5.21~2020.11.20

項目	金額
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)
(新株予約権証券)	(0)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	1 (1)
(新株予約権証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	4 (3)
(その他)	(1)
合計	5

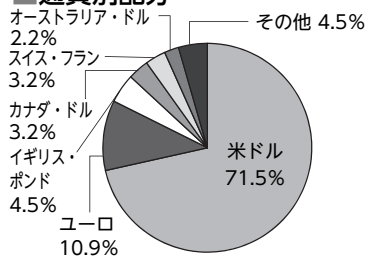
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



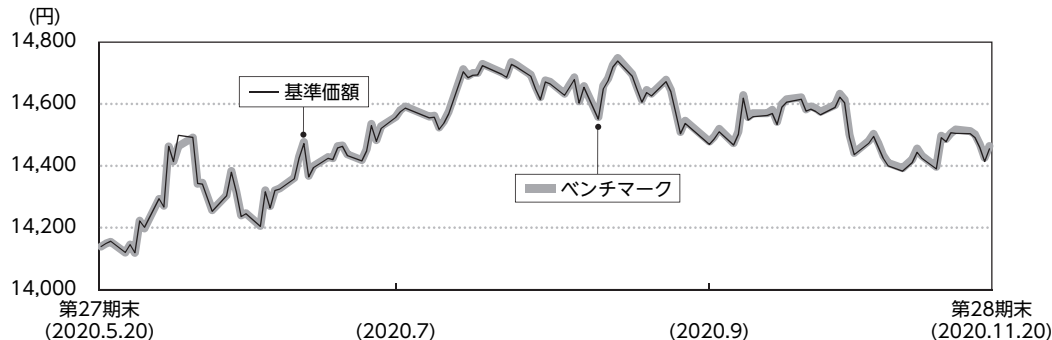
(注1) 基準価額の推移および1万口当たりの費用明細は、マザーファンドの直近の決算期のものであり、費用項目の金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。項目の詳細につきましては、前掲の費用項目の概要をご参照ください。

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2020年11月20日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書（全体版）の組入有価証券明細表をご参照ください。

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドの概要

■ 基準価額の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 上位銘柄

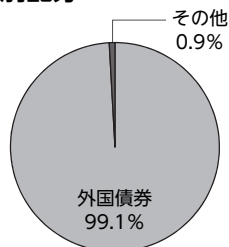
銘柄名	通貨	比率
US TREASURY 2.0% 2025/8/15	米ドル	0.9%
US TREASURY 2.375% 2024/8/15	米ドル	0.8
US TREASURY 1.625% 2022/8/15	米ドル	0.8
US TREASURY 2.25% 2024/11/15	米ドル	0.8
US TREASURY 2.0% 2025/2/15	米ドル	0.8
US TREASURY 1.75% 2022/5/15	米ドル	0.7
US TREASURY 2.5% 2024/5/15	米ドル	0.7
US TREASURY 2.5% 2023/8/15	米ドル	0.7
US TREASURY 2.125% 2025/5/15	米ドル	0.7
US TREASURY 1.75% 2023/5/15	米ドル	0.7
組入銘柄数		642

■ 1万口当たりの費用明細

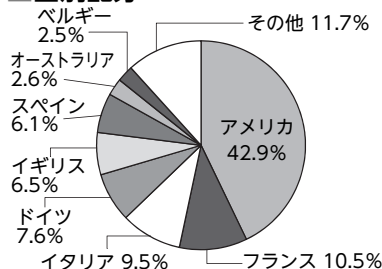
2020.5.21～2020.11.20

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

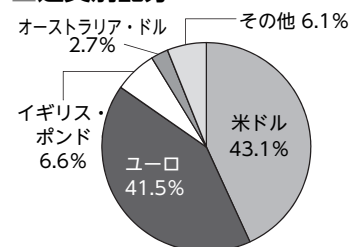
■ 資産別配分



■ 国別配分



■ 通貨別配分



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

(注2) 上位銘柄、資産別・国別・通貨別配分は、マザーファンド決算日（2020年11月20日現在）のものであり、比率はマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合です。なお、国別配分はニッセイアセットマネジメントの分類によるものです。

(注3) 全銘柄に関する詳細な情報につきましては、運用報告書（全体版）の組入有価証券明細表をご参照ください。

最近５期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率	(ご参考)	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
				基準価額＋ 累計分配金							
	円	円	%	円		%	%	%	%	%	百万円
2期(2016年11月21日)	9,925	0	△ 5.7	9,925	10,029	△ 4.9	49.3	1.4	48.1	0.6	1,283
3期(2017年11月20日)	11,255	0	13.4	11,255	11,410	13.8	47.8	1.2	49.5	0.6	1,788
4期(2018年11月20日)	11,081	0	△ 1.5	11,081	11,272	△ 1.2	47.5	1.4	50.0	0.6	2,780
5期(2019年11月20日)	11,825	0	6.7	11,825	12,050	6.9	48.2	1.3	49.3	0.7	4,559
6期(2020年11月20日)	12,499	0	5.7	12,499	12,731	5.6	49.0	1.6	48.4	0.6	7,982

(注1) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

(注2) 「基準価額＋累計分配金」は、当該決算期の基準価額（分配落）に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

(注3) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注4) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注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。

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
(期首)2019年11月20日	11,825	－	12,050	－	48.2	1.3	49.3	0.7
11月末	11,913	0.7	12,140	0.7	48.6	1.1	49.2	0.7
12月末	12,049	1.9	12,280	1.9	48.4	1.5	49.0	0.7
2020年1月末	12,022	1.7	12,258	1.7	47.5	1.3	49.9	0.7
2月末	11,538	△2.4	11,753	△2.5	45.0	1.4	52.3	0.6
3月末	10,968	△7.2	11,147	△7.5	49.9	1.8	47.4	0.7
4月末	11,320	△4.3	11,508	△4.5	50.5	1.8	46.7	0.7
5月末	11,663	△1.4	11,858	△1.6	49.3	2.3	48.8	0.6
6月末	11,762	△0.5	11,956	△0.8	47.6	1.1	50.4	0.6
7月末	11,778	△0.4	11,976	△0.6	47.5	1.2	50.1	0.6
8月末	12,218	3.3	12,426	3.1	48.9	1.7	48.4	0.6
9月末	12,154	2.8	12,371	2.7	47.6	1.6	49.8	0.5
10月末	11,930	0.9	12,150	0.8	47.2	1.5	50.3	0.6
(期末)2020年11月20日	12,499	5.7	12,731	5.6	49.0	1.6	48.4	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

2019年11月21日～2020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	783,975	1,309,362	336,204	575,445
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	954,741	1,313,994	354,544	489,088
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	743,946	1,325,551	362,917	663,899
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	873,062	1,246,711	346,154	490,503

(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	68,545,864千円	69,235,887千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	108,773,464千円	228,143,016千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.63	0.30

(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

2019年11月21日～2020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

2020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	626,761	1,074,533	2,040,108
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	818,446	1,418,643	1,948,932
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	605,358	986,387	2,044,681
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	821,539	1,348,446	1,949,179

(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80,797,703千口、ニッセイ国内債券インデックスマザーファンドが32,682,425千口、ニッセイ外国株式インデックスマザーファンドが145,169,780千口、ニッセイ外国債券インデックスマザーファンドが22,593,334千口です。

投資信託財産の構成

2020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	2,040,108	25.4
ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド	1,948,932	24.3
ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド	2,044,681	25.5
ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド	1,949,179	24.3
コール・ローン等、その他	39,403	0.5
投資信託財産総額	8,022,305	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103.88円、1カナダ・ドル79.43円、1オーストラリア・ドル75.60円、1香港ドル13.40円、1シンガポール・ドル77.26円、1ニュージーランド・ドル71.77円、1イギリス・ポンド137.68円、1イスラエル・シェケル31.04円、1スイス・フラン114.09円、1デンマーク・クローネ16.55円、1ノルウェー・クローネ11.53円、1スウェーデン・クローナ12.08円、1メキシコ・ペソ5.14円、1マレーシア・リングギット25.38円、1ポーランド・ズロチ27.59円、1ユーロ123.34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(298,461,197千円)の投資信託財産総額(302,611,037千円)に対する比率は98.6%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(32,615,187千円)の投資信託財産総額(32,748,830千円)に対する比率は99.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	8,022,305,516円
コール・ローン等	5,154,627
ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,040,108,549
ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,948,932,225
ニッセイ外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,044,681,670
ニッセイ外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,949,179,339
未収入金	34,249,106
(B)負債	39,437,501
未払解約金	34,147,574
未払信託報酬	5,252,491
その他未払費用	37,436
(C)純資産総額(A-B)	7,982,868,015
元本	6,386,621,435
次期繰越損益金	1,596,246,580
(D)受益権総口数	6,386,621,435口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,499円
(注) 期首元本額	3,855,739,720円
期中追加設定元本額	3,477,266,489円
期中一部解約元本額	946,384,774円

損益の状況

当期(2019年11月21日～2020年11月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	△ 1,061円
受取利息	84
支払利息	△ 1,145
(B)有価証券売買損益	439,539,791
売買益	523,711,244
売買損	△ 84,171,453
(C)信託報酬等	△ 9,138,067
(D)当期損益金(A+B+C)	430,400,663
(E)前期繰越損益金	255,474,947
(分配準備積立金)	(255,474,947)
(F)追加信託差損益金*	910,370,970
(配当等相当額)	(999,527,680)
(売買損益相当額)	(△ 89,156,710)
(G)合計(D+E+F)	1,596,246,580
次期繰越損益金(G)	1,596,246,580
追加信託差損益金	910,370,970
(配当等相当額)	(1,004,432,305)
(売買損益相当額)	(△ 94,061,335)
分配準備積立金	685,875,610

- (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	102,297,872円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	328,102,791円
(c) 信託約款に定める収益調整金	1,004,432,305円
(d) 信託約款に定める分配準備積立金	255,474,947円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	1,690,307,915円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	2,646.64円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

お知らせ

■運用体制の変更について

代表取締役社長に大関洋が就任いたしました。

（2020年3月25日）

■関連会社の実質保有比率

2020年10月末現在、当ファンドの主要投資対象であるニッセイ外国株式インデックスマザーファンドの信託財産において、委託会社の株主である日本生命保険相互会社は、当該マザーファンド受益証券を他のベビーファンドを通じて実質的に7.7%保有しています。当該実質保有分は、日本生命保険相互会社により他のベビーファンドを通じて解約されることがあります。

当ファンドの概要

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

ニッセイ国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第 20 期

(計算期間：2019年2月21日～2020年2月20日)

運用方針

国内の金融商品取引所上場株式等に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する成果を目標として運用を行います。
株式の実質組入比率の維持のために、株価指数先物等を活用することがあります。

主要運用 対象

国内の金融商品取引所上場株式等

運用方法

以下の様な投資制限のもと運用を行います。
・ 株式への投資割合には、制限を設けません。
・ 外貨建資産への投資は行いません。



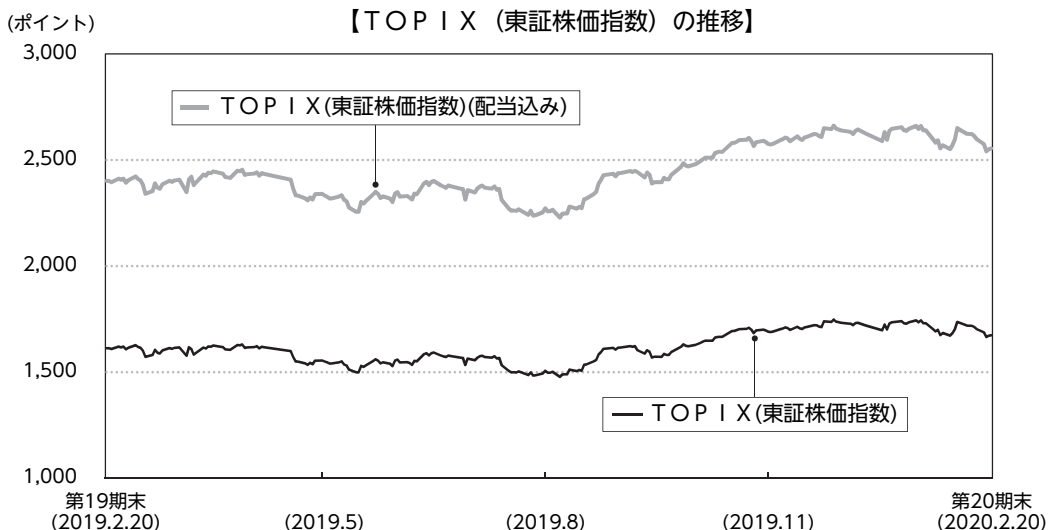
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2019年2月21日～2020年2月20日

国内株式市況



(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初以降、米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げを急がないとの観測が広がったことや中国が景気対策を表明したことなどから、4月末にかけて株価は底堅く推移しました。

5月に入ると米国が中国に対し制裁関税の引き上げを発表したことで米中貿易摩擦再燃への懸念が高まり、株価は下落に転じました。さらに米国による中国通信機器最大手の華為技術（ファーウェイ）への制裁措置やメキシコに追加関税を課す方針が示され、貿易摩擦の長期化や拡大が世界の景気減速につながるなどの懸念を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、株価は弱含みました。

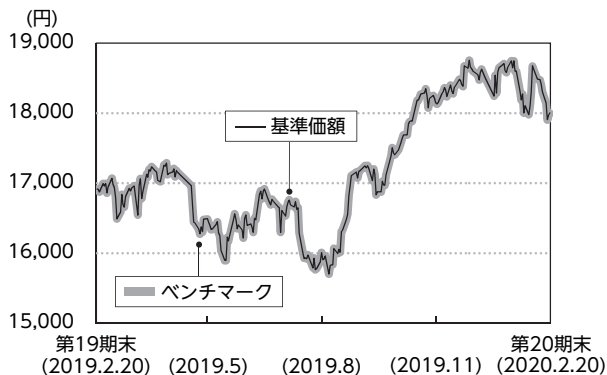
6月末の20カ国・地域首脳会議（G20サミット）で米中貿易摩擦の解決が期待されたことや金融緩和観測などから株価は上昇傾向となりましたが、8月初旬には米中貿易摩擦再燃への懸念から下落しました。

9月に入ると米中貿易協議の進展期待が高まったことに加えて、香港情勢やイギリスの政治混乱を巡る懸念が後退したことなどを受けて株価は上昇しました。

2020年1月には米軍によるイラン革命防衛隊の司令官殺害を巡り米国とイランの対立が激化すると懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり株価は下落する場面もありましたが、トランプ米大統領の演説が報復には言及せず抑制的であったことから両国対立激化への懸念が後退しました。

期末にかけては中国で発生した新型コロナウイルスによる肺炎の感染拡大が警戒され、投資家の市場心理が悪化し株価は下落する場面がありましたが、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



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

国内の金融商品取引所上場株式等に投資することにより、ベンチマークの動きに連動する成果を目標に運用を行った結果、当期の基準価額は上昇しました。詳しくは前掲の「国内株式市況」をご参照ください。

ポートフォリオ

当期も東証一部上場銘柄に分散投資を行いました。

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

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+6.4%となり、ベンチマーク騰落率（+6.4%）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。

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	%		%	%			
16期(2016年2月22日)	12,782	△11.7	12,904	△11.7	98.3	1.7	34,137		
17期(2017年2月20日)	15,544	21.6	15,699	21.7	97.7	2.3	40,998		
18期(2018年2月20日)	18,076	16.3	18,261	16.3	98.2	1.9	50,868		
19期(2019年2月20日)	16,916	△6.4	17,088	△6.4	98.4	1.5	58,316		
20期(2020年2月20日)	18,004	6.4	18,182	6.4	98.3	1.6	68,225		

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(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
		円	%		%	%		
(期首)2019年2月20日	16,916	—	17,088	—	98.4	1.5		
2月末	16,861	△0.3	17,032	△0.3	98.2	1.7		
3月末	16,874	△0.2	17,047	△0.2	97.1	3.1		
4月末	17,153	1.4	17,329	1.4	97.4	2.7		
5月末	16,039	△5.2	16,198	△5.2	95.0	4.9		
6月末	16,478	△2.6	16,646	△2.6	96.1	3.9		
7月末	16,626	△1.7	16,798	△1.7	97.5	2.5		
8月末	16,065	△5.0	16,231	△5.0	97.4	2.5		
9月末	17,038	0.7	17,211	0.7	97.3	2.7		
10月末	17,891	5.8	18,071	5.7	98.0	2.0		
11月末	18,239	7.8	18,422	7.8	97.9	2.3		
12月末	18,502	9.4	18,689	9.4	97.9	2.1		
2020年1月末	18,107	7.0	18,289	7.0	96.4	3.5		
(期末)2020年2月20日	18,004	6.4	18,182	6.4	98.3	1.6		

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2019年2月21日～2020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（17,210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

2019年2月21日～2020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 6,147 (663)	千円 10,595,452	千株 2,150	千円 3,633,027

(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 16,730	百万円 16,589	百万円 -	百万円 -

(注) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2019年2月21日～2020年2月20日

株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
武田薬品工業	90	383,095	4,219	KDDI	37	107,867	2,891
トヨタ自動車	46	323,925	7,026	ソフトバンクグループ	15	83,624	5,538
ソフトバンクグループ	29	164,865	5,607	ソニー	12	77,542	6,355
NTTドコモ	55	155,069	2,819	キーエンス	1	75,307	68,461
ソニー	24	150,016	6,024	田辺三菱製薬	34	68,702	1,997
三菱UFJフィナンシャル・グループ	279	148,690	531	ソフトバンク	42	64,079	1,497
ソフトバンク	102	140,517	1,377	NTTドコモ	24	63,025	2,583
任天堂	3	133,473	39,256	オリエンタルランド	3	53,199	16,121
日本電信電話	30	128,193	4,273	本田技研工業	17	52,565	3,038
キーエンス	2	116,852	55,643	トヨタ自動車	6	52,152	7,666

(注1) 金額は受渡代金です。

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

組入有価証券明細表

2020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	1	1	3,920
日本水産	33	38	23,546
マルハニチロ	4	5	14,364
カネコ種苗	1	1	1,855
サカタのタネ	4	4	15,341
ホクト	2	2	5,724
鉱業(0.3%)			
住石ホールディングス	6	12	1,801
日鉄鉱業	0.800	0.900	3,807
三井松島ホールディングス	1	0.900	1,008
国際石油開発帝石	135	154	165,945
石油資源開発	4	5	13,990
K&Oエナジーグループ	1	1	3,127
建設業(2.8%)			
ヒノキヤグループ	0.800	1	2,038

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ショーボンドホールディングス	2	6	25,410
ミライト・ホールディングス	9	11	17,365
タマホーム	1	2	2,971
ファーストコーポレーション	2	3	1,844
ベステラ	-	1	1,443
スペースバリューホールディングス	4	4	2,505
ダイセキ環境ソリューション	0.500	1	1,684
安藤・間	21	23	19,688
東急建設	9	11	8,463
コムシスホールディングス	12	13	39,990
ミサワホーム	2	-	-
ピーアールホールディングス	-	4	2,066
高松コンストラクショングループ	2	2	6,225
東建コーポレーション	1	1	9,840
ソネック	2	-	-
ヤマウラ	1	1	1,784

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
大成建設	27	29	120,879	
大林組	83	89	109,503	
清水建設	85	90	97,812	
飛鳥建設	2	2	3,517	
長谷工コーポレーション	34	34	48,852	
松井建設	3	3	2,499	
銭高組	0.300	0.400	1,584	
鹿島建設	65	70	89,460	
不動テトラ	1	2	3,774	
大木建設	1	1	1,808	
鉄建建設	1	1	5,044	
西松建設	6	6	16,732	
三井住友建設	20	21	13,115	
大豊建設	1	2	5,254	
前田建設工業	19	22	23,794	
佐田建設	3	4	1,764	
ナカノフドー建設	3	3	1,717	
奥村組	4	4	13,579	
東鉄工業	3	3	11,666	
浅沼組	1	1	5,150	
戸田建設	32	37	26,344	
熊谷組	4	4	13,079	
青木あすなろ建設	1	-	-	
北野建設	0.600	0.700	1,757	
植木組	0.700	0.700	1,745	
矢作建設工業	3	3	3,256	
ピーエス三菱	2	2	1,902	
日本ハウスホールディングス	5	6	2,696	
大東建託	9	10	132,894	
新日本建設	3	3	3,268	
N I P P O	7	7	19,832	
東亜道路工業	0.500	0.600	2,016	
前田道路	8	9	31,960	
日本道路	0.800	0.900	6,444	
東亜建設工業	2	2	4,942	
日本国土開発	-	6	3,841	
若築建設	1	1	2,558	
東洋建設	10	10	5,020	
五洋建設	33	35	23,227	
世紀東急工業	4	4	3,796	
福田組	0.900	1	4,415	

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
住友林業	19	22	38,872	
日本基礎技術	4	4	1,633	
巴コーポレーション	3	4	1,715	
大和ハウス工業	77	88	291,060	
ライト工業	5	5	7,471	
積水ハウス	85	97	225,956	
日特建設	2	2	1,941	
北陸電気工事	1	-	-	
ユアテック	4	5	3,248	
四電工	0.600	0.700	1,806	
中電工	3	3	8,787	
関電工	12	12	12,738	
きんでん	18	21	38,011	
東京エネシス	2	3	2,508	
トーエネック	0.800	0.900	3,267	
住友電設	1	2	6,152	
日本電設工業	4	4	10,897	
協和エクシオ	10	13	35,491	
新日本空調	2	2	4,749	
九電工	5	6	19,719	
三機工業	6	6	8,761	
日揮ホールディングス	24	27	42,497	
中外炉工業	0.800	1	1,700	
ヤマト	3	2	2,105	
太平電業	1	2	5,572	
高砂熱学工業	7	7	14,322	
三晃金属工業	0.500	0.700	1,824	
朝日工業社	0.600	0.600	1,881	
明星工業	5	5	4,564	
大気社	3	4	14,792	
ダイダン	1	2	5,743	
日比谷総合設備	2	2	5,550	
東芝プラントシステム	6	-	-	
OSJBホールディングス	12	14	3,722	
東洋エンジニアリング	3	3	2,127	
千代田化工建設	20	-	-	
レイズネクスト	5	4	6,172	
食料品(3.8%)				
日本製粉	8	8	13,686	
日清製粉グループ本社	28	32	62,983	
昭和産業	2	2	7,891	

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
鳥越製粉	2	2	2,065
中部飼料	3	3	5,701
フィード・ワン	16	19	3,360
東洋精糖	1	1	1,782
日本甜菜製糖	1	1	2,770
三井製糖	2	2	5,205
塩水港精糖	6	7	1,762
日新製糖	1	1	2,811
森永製菓	6	6	31,423
中村屋	0.600	0.700	2,810
江崎グリコ	7	8	40,035
名糖産業	1	1	1,946
井村屋グループ	1	1	2,280
不二家	1	1	3,705
山崎製パン	20	21	42,949
モロゾフ	0.400	0.500	2,460
亀田製菓	1	1	7,640
寿スピリッツ	2	2	16,983
カルビー	11	13	39,650
森永乳業	5	5	21,571
六甲バター	1	1	2,935
ヤクルト本社	18	19	105,644
明治ホールディングス	17	18	133,623
雪印メグミルク	6	6	17,043
プリマハム	3	4	11,191
日本ハム	10	10	50,794
丸大食品	2	3	6,003
S Foods	2	2	6,060
柿安本店	-	1	3,105
伊藤ハム米久ホールディングス	16	18	12,180
サッポロホールディングス	9	9	23,988
アサヒグループホールディングス	52	59	287,992
キリンホールディングス	113	120	274,019
宝ホールディングス	18	21	20,372
オエノンホールディングス	7	7	2,910
養命酒製造	0.800	0.900	1,737
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	19	20	58,740
サントリー食品インターナショナル	16	19	88,910
ガイドグループホールディングス	1	1	5,902
伊藤園	7	8	47,589
キーコーヒー	2	2	6,300

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日清オイリオグループ	3	3	13,727
不二製油グループ本社	6	7	19,236
かどや製油	0.300	0.500	1,900
J-オイルミルズ	1	1	6,375
キッコーマン	16	20	120,540
味の素	55	63	125,181
キューピー	13	15	34,216
ハウス食品グループ本社	9	10	36,808
カゴメ	10	10	28,771
アリアケジャパン	2	2	19,500
ピエトロ	0.900	1	1,805
エバラ食品工業	0.700	0.800	1,744
ニチレイ	13	13	38,012
東洋水産	12	14	66,958
イートアンド	0.900	1	1,839
大冷	0.900	0.900	1,756
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3	1	1,828
日清食品ホールディングス	10	12	107,690
永谷園ホールディングス	1	1	2,969
一正蒲鉾	-	1	1,806
フジッコ	2	3	5,840
ロック・フィールド	2	3	4,251
日本たばこ産業	144	164	373,374
ケンコーマヨネーズ	1	1	3,539
わらべや日洋ホールディングス	1	1	3,486
なとり	1	1	2,710
ピッグルスコーポレーション	0.700	-	-
北の達人コーポレーション	9	10	6,280
ユーグレナ	10	12	10,052
ミヨシ油脂	1	1	1,608
理研ビタミン	1	1	5,154
繊維製品(0.6%)			
片倉工業	3	4	5,328
グンゼ	1	2	8,270
東洋紡	10	11	16,500
ユニチカ	7	8	2,861
富士紡ホールディングス	1	1	4,446
倉敷紡績	2	2	6,445
シキボウ	1	1	1,512
日本毛織	8	9	9,310
帝国繊維	2	3	6,764

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
帝人	19	22	45,649
東レ	189	201	141,050
サカイオーベックス	0.800	1	1,903
住江織物	0.700	0.800	1,865
日本フェルト	3	3	1,794
イチカワ	1	1	1,860
アツギ	2	2	1,888
セーレン	6	6	10,778
ソトー	1	1	1,841
東海染工	1	1	1,796
小松マテーレ	4	4	3,634
ワコールホールディングス	7	7	20,440
ホギメディカル	3	3	10,576
クラウドシアホールディングス	3	3	1,744
T S Iホールディングス	9	9	4,603
マツオカコーポレーション	0.800	0.900	1,844
ワールド	2	3	9,063
三陽商会	1	1	2,132
オンワードホールディングス	14	16	10,220
ゴールドウイン	2	5	35,850
デサント	5	5	8,818
ヤマトインターナショナル	3	4	1,782
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	1	1	7,191
王子ホールディングス	109	116	69,431
日本製紙	11	12	21,168
三菱製紙	4	4	1,760
北越コーポレーション	16	18	9,083
中越パルプ工業	-	1	1,773
大王製紙	11	12	17,580
阿波製紙	3	1	569
レンゴー	25	26	21,539
トーモク	1	1	2,900
ザ・パック	1	2	8,746
化学(7.1%)			
クラレ	41	43	55,275
旭化成	173	184	188,928
共和レザー	1	-	-
昭和電工	16	19	52,569
住友化学	191	204	90,389
住友精化	1	1	3,798

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日産化学	15	15	78,780
ラサ工業	1	-	-
クレハ	2	2	14,280
多木化学	0.700	0.800	3,540
テイカ	2	2	3,262
石原産業	4	5	4,115
片倉コープアグリ	1	1	1,846
日東エフシー	2	-	-
日本曹達	3	4	13,017
東ソー	37	43	70,563
トクヤマ	7	8	21,720
セントラル硝子	5	5	12,967
東亜合成	15	17	21,437
大阪ソーダ	2	2	7,644
関東電化工業	5	6	6,600
デンカ	9	10	30,018
信越化学工業	43	47	657,011
日本カーバイド工業	0.900	1	1,779
堺化学工業	1	1	3,934
第一稀元素化学工業	2	3	2,553
エア・ウォーター	20	25	39,601
大陽日酸	20	26	58,579
日本化学工業	0.800	0.900	2,390
日本パーカラライジング	13	14	15,428
高圧ガス工業	3	4	3,308
四国化成工業	4	4	5,211
戸田工業	0.700	-	-
ステラ ケミファ	1	1	4,845
保土谷化学工業	0.800	1	4,345
日本触媒	4	4	26,015
大日精化工業	2	2	6,572
カネカ	6	7	23,832
三菱瓦斯化学	25	26	47,892
三井化学	22	25	64,287
J S R	24	25	54,959
東京応化工業	4	4	21,216
大阪有機化学工業	2	2	4,459
三菱ケミカルホールディングス	163	186	146,437
K H ネオケム	3	4	11,926
ダイセル	37	38	38,214
住友ベークライト	4	4	15,818

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
積水化学工業	53	59	108,058
日本ゼオン	22	25	30,345
アイカ工業	7	8	28,842
宇部興産	12	14	30,540
積水樹脂	4	5	11,865
タキロンシーアイ	5	6	3,750
旭有機材	1	1	2,566
日立化成	11	12	59,404
ニチバン	1	1	2,520
リケンテクノス	6	7	3,248
大倉工業	1	1	2,119
積水化成成品工業	3	3	2,504
群栄化学工業	0.600	0.700	1,714
タイガースポリマー	2	3	1,772
ミライアル	1	-	-
ダイキョーニシカワ	5	5	4,277
竹本容器	1	2	1,795
森六ホールディングス	1	1	3,223
日本化薬	15	17	22,119
カーリットホールディングス	2	3	1,720
日本精化	2	2	2,996
扶桑化学工業	2	2	9,576
トリケミカル研究所	0.500	0.600	5,730
ADEKA	12	12	19,801
日油	9	10	38,955
新日本理化	7	8	1,702
ハリマ化成グループ	2	2	2,417
花王	60	68	579,700
第一工業製薬	0.900	1	4,290
石原ケミカル	0.900	-	-
日華化学	0.900	2	1,631
ニイタカ	1	0.800	2,084
三洋化成工業	1	1	8,219
有機合成薬品工業	6	6	2,884
大日本塗料	2	3	3,320
日本ペイントホールディングス	20	23	115,230
関西ペイント	27	31	79,220
中国塗料	8	7	7,370
日本特殊塗料	1	2	2,496
藤倉化成	3	3	2,014
太陽ホールディングス	2	2	9,500

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
DIC	11	11	34,538
サカティンクス	5	6	7,051
東洋インキSCホールディングス	5	5	14,112
T&K TOKA	1	2	2,024
富士フイルムホールディングス	51	54	292,338
資生堂	49	56	394,652
ライオン	34	36	73,763
高砂香料工業	1	1	4,156
マンダム	5	6	16,326
ミルボン	3	3	22,344
ファンケル	11	11	35,305
コーサー	4	5	75,684
コタ	1	1	2,218
シーボン	0.600	0.700	1,718
ポーラ・オルビスホールディングス	10	12	27,382
ノエビアホールディングス	1	2	13,743
アジupanコスメジャパン	1	1	1,776
エステー	1	1	2,881
アグロ カネシヨウ	1	1	1,690
コニシ	4	4	7,186
長谷川香料	3	3	8,272
星光PMC	1	2	1,768
小林製薬	7	8	68,560
荒川化学工業	2	2	3,876
メック	1	2	3,084
日本高純度化学	0.700	0.800	2,128
タカラバイオ	6	7	16,642
JCU	3	3	10,070
新田ゼラチン	2	2	1,728
デクセリアルズ	6	7	6,679
アース製薬	1	2	12,726
北興化学工業	2	2	1,812
大成ラミック	0.800	0.900	2,523
クミアイ化学工業	10	11	9,746
日本農薬	6	5	2,815
アキレス	1	2	3,898
有沢製作所	3	4	4,095
日東電工	18	19	117,600
レック	2	3	3,495
三光合成	-	5	1,742
藤森工業	2	2	8,212

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
前澤化成工業	1	1	2,019
未来工業	1	1	3,043
J S P	1	1	3,032
エフピコ	2	3	22,048
天馬	1	1	3,638
信越ポリマー	4	5	4,845
東リ	6	7	2,073
ニフコ	10	10	29,660
バルカー	2	2	5,331
ユニ・チャーム	52	54	216,186
医薬品(6.2%)			
協和キリン	31	28	77,506
武田薬品工業	157	236	984,133
アステラス製薬	229	249	478,058
大日本住友製薬	18	21	36,334
塩野義製薬	32	36	234,461
田辺三菱製薬	26	-	-
わかもと製薬	5	7	1,953
あすか製薬	3	3	3,555
日本新薬	6	7	68,228
ビオフェルミン製薬	-	0.800	1,899
中外製薬	26	29	357,716
科研製薬	4	4	28,518
エーザイ	29	34	304,912
ロート製薬	12	14	47,742
小野薬品工業	58	65	165,927
久光製薬	7	7	42,028
持田製薬	1	3	16,614
参天製薬	47	52	103,366
扶桑薬品工業	0.900	1	1,955
ツムラ	7	8	24,666
日医工	6	8	10,528
キッセイ薬品工業	4	5	14,290
生化学工業	4	5	6,704
栄研化学	4	5	10,855
日水製薬	1	1	1,846
鳥居薬品	1	1	6,489
J C R ファーマ	1	2	22,060
東和薬品	1	3	8,596
富士製薬工業	1	1	2,354
沢井製薬	5	5	40,832

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゼリア新薬工業	4	5	10,140
第一三共	71	81	627,229
キョーリン製薬ホールディングス	5	6	13,412
大幸薬品	1	1	5,753
ダイト	1	1	5,780
大塚ホールディングス	47	54	242,963
大正製薬ホールディングス	5	6	43,440
ペプチドリーム	12	14	74,736
石油・石炭製品(0.5%)			
日本コークス工業	21	24	1,824
昭和シェル石油	23	-	-
ニチレキ	3	3	4,736
ユシロ化学工業	1	1	2,136
ビーピー・カストロール	1	1	1,783
富士石油	6	3	835
M O R E S C O	0.700	1	1,736
出光興産	19	32	92,896
J X T Gホールディングス	418	427	200,198
コスモエネルギーホールディングス	7	8	16,400
ゴム製品(0.7%)			
横浜ゴム	14	16	33,280
T O Y O T I R E	12	16	26,406
ブリヂストン	76	87	347,715
住友ゴム工業	22	25	31,897
藤倉コンポジット	1	-	-
オカモト	1	1	6,588
フコク	1	2	1,788
ニッタ	2	3	9,219
住友理工	4	5	4,576
三ツ星ベルト	3	3	6,389
バンドー化学	4	5	4,085
ガラス・土石製品(0.8%)			
日東紡績	3	4	21,210
A G C	24	28	97,788
日本板硝子	11	13	7,711
石塚硝子	0.700	-	-
日本山村硝子	1	1	1,785
日本電気硝子	10	11	23,472
オハラ	1	1	1,783
住友大阪セメント	5	5	22,518
太平洋セメント	15	17	52,733

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
日本ヒューム	2	2	2,133
日本コンクリート工業	5	6	1,872
三谷セキサン	1	1	4,927
アジアパイルホールディングス	3	4	2,164
東海カーボン	22	29	30,276
日本カーボン	1	1	6,000
東洋炭素	1	1	3,422
ノリタケカンパニーリミテド	1	1	6,672
TOTO	19	20	93,380
日本碍子	30	34	65,305
日本特殊陶業	21	22	42,719
MARUWA	0.900	1	8,536
品川リフラクトリーズ	0.700	0.700	2,048
黒崎播磨	0.500	0.600	3,792
ヨータイ	2	2	1,817
イソライト工業	-	3	1,723
ニッカトー	1	2	1,817
フジインコーポレーテッド	2	2	7,637
クニミネ工業	-	1	1,446
エーアンドエーマテリアル	1	-	-
ニチアス	6	7	19,858
ニチハ	3	4	10,116
鉄鋼(0.7%)			
日本製鉄	114	125	170,836
神戸製鋼所	45	51	23,387
中山製鋼所	3	3	1,762
合同製鐵	1	1	4,131
ジェイエフイーホールディングス	66	75	84,097
東京製鐵	13	13	10,946
共英製鋼	2	3	6,012
大和工業	5	6	14,994
東京鐵鋼	1	1	1,669
大阪製鐵	1	1	2,380
淀川製鋼所	3	3	7,512
丸一鋼管	8	9	26,016
モリ工業	0.700	0.800	2,096
大同特殊鋼	4	4	19,573
日本高周波鋼業	2	4	1,741
日本冶金工業	20	2	4,634
山陽特殊製鋼	3	1	2,753
愛知製鋼	1	1	5,360

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日立金属	26	30	51,358
日本金属	0.600	2	1,771
大洋洋金属	1	1	4,533
新日本電工	14	18	3,095
栗本鐵工所	1	1	2,955
三菱製鋼	1	2	2,058
日亜鋼業	5	5	1,761
日本精線	0.400	0.300	1,077
シンニッタン	4	4	1,724
非鉄金属(0.7%)			
大紀アルミニウム工業所	4	4	3,040
日本軽金属ホールディングス	67	71	15,286
三井金属鋅業	6	7	22,199
東邦亜鉛	1	1	2,574
三菱マテリアル	16	18	51,391
住友金属鉱山	33	35	109,961
DOWAホールディングス	5	7	27,974
古河機械金属	4	5	6,680
大阪チタニウムテクノロジーズ	2	2	3,749
東邦チタニウム	4	5	4,225
UACJ	3	4	9,094
CKサンエツ	0.600	0.600	2,013
古河電気工業	7	8	22,376
住友電気工業	92	105	153,288
フジクラ	29	33	13,051
昭和電線ホールディングス	2	3	4,296
東京特殊電線	-	0.100	257
タツタ電線	4	5	3,242
カナレ電気	0.800	1	1,785
平河ヒューテック	1	1	1,712
リョービ	3	3	5,827
アーレスティ	3	3	1,850
アサヒホールディングス	4	4	13,244
金属製品(0.6%)			
稲葉製作所	1	1	2,134
宮地エンジニアリンググループ	0.700	0.900	1,838
トーカロ	6	7	8,775
アルファ	1	1	1,645
SUMCO	27	33	62,798
川田テクノロジーズ	0.500	0.600	3,714
RS Technologies	0.600	0.800	2,229

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東洋製鐵グループホールディングス	15	17	35,567
ホッカインホールディングス	1	1	2,721
コロナ	1	1	1,783
横河ブリッジホールディングス	4	5	11,533
三和ホールディングス	25	27	29,862
文化シャッター	7	8	6,938
三協立山	3	3	4,708
アルインコ	2	2	2,182
L I X I L グループ	36	41	79,140
日本ファイルコン	2	3	1,785
ノーリツ	5	5	7,574
長府製作所	2	2	6,498
リンナイ	4	5	44,935
ダイニチ工業	2	2	1,726
日東精工	3	3	2,051
三洋工業	—	0.900	1,779
岡部	5	5	4,856
ジーテクト	2	3	5,110
東プレ	4	5	8,346
高周波熱錬	4	5	4,395
東京製綱	1	2	1,892
サンコール	1	1	767
モリテックスチール	3	5	1,698
パイオラックス	3	4	7,589
エイチワン	2	2	1,867
日本発条	24	30	27,391
アドバネクス	1	—	—
立川ブラインド工業	1	1	1,698
三益半導体工業	2	2	4,897
機械(5.0%)			
日本製鋼所	7	8	15,470
三浦工業	10	12	46,848
タクマ	9	9	11,780
ツガミ	5	5	5,672
オークマ	3	3	16,500
東芝機械	2	3	10,176
アマダホールディングス	38	35	38,770
アイダエンジニアリング	6	7	6,497
滝澤鉄工所	1	1	1,799
F U J I	7	12	23,098
牧野フライス製作所	2	3	13,414

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オーエスジー	12	13	23,127
ダイジェット工業	—	1	1,792
旭ダイヤモンド工業	6	7	4,225
DMG森精機	15	17	27,198
ソディック	5	6	5,392
ディスコ	3	3	94,012
日東工器	1	1	3,660
日進工具	0.700	0.800	2,254
パンチ工業	2	4	1,676
豊和工業	1	2	1,768
〇 K K	1	2	1,740
石川製作所	1	—	—
東洋機械金属	2	3	1,753
エンシュウ	—	1	1,112
島精機製作所	3	4	8,676
オプトラン	2	3	10,121
NCホールディングス	1	2	1,684
イワキ	—	1	1,603
フリーユー	2	2	3,126
ヤマシンフィルタ	4	6	4,221
日阪製作所	3	3	3,276
やまびこ	4	5	5,421
平田機工	1	1	7,579
ペガサスミシン製造	2	3	1,778
ナプテスコ	13	16	53,867
三井海洋開発	2	3	5,970
レオン自動機	2	2	3,752
S M C	7	8	438,147
ヤマモーターロボティクスホールディングス	3	2	2,169
ホソカワミクロン	0.900	1	5,380
ユニオンツール	1	1	2,986
オイレス工業	3	3	5,558
日精イー・エス・ビー機械	0.700	0.900	3,699
サトーホールディングス	3	4	10,976
技研製作所	1	2	11,037
日本エアータック	2	1	1,958
カワタ	1	1	1,807
日精樹脂工業	2	2	2,229
オカダアイオン	1	1	1,620
小松製作所	112	128	296,010
住友重機械工業	14	16	43,455

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
日立建機	10	11	33,652
日工	0.700	3	3,026
巴工業	1	1	2,550
井関農機	2	2	3,805
TOWA	-	2	3,221
丸山製作所	1	1	1,775
北川鉄工所	1	1	2,575
ローツェ	1	1	4,758
タカキタ	2	3	1,795
クボタ	133	150	242,335
荏原実業	0.700	0.900	1,801
三菱化工機	1	1	1,913
月島機械	4	5	7,004
帝国電機製作所	1	2	3,362
新東工業	5	6	6,030
澁谷工業	2	2	6,837
アイチコーポレーション	4	4	3,405
小森コーポレーション	6	7	6,645
鶴見製作所	1	2	4,133
荏原製作所	11	11	33,111
石井鐵工所	0.800	-	-
西島製作所	2	2	2,438
北越工業	2	2	3,761
ダイキン工業	34	36	559,109
オルガノ	0.900	1	6,890
トーヨーカネツ	0.900	1	2,944
栗田工業	13	15	49,819
椿本チエイン	3	4	13,202
木村化工機	4	3	1,782
アネスト岩田	3	4	4,505
ダイフク	13	14	101,065
サムコ	1	0.900	1,728
加藤製作所	1	1	2,328
油研工業	0.800	1	1,843
タダノ	12	13	13,891
フジテック	9	10	17,510
CKD	6	7	15,531
キトー	1	2	3,532
平和	6	7	17,775
理想科学工業	2	2	4,820
SANKYO	6	6	24,538

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本金銭機械	2	3	2,418
マースグループホールディングス	1	1	3,585
フクシマガリレイ	1	1	7,245
ダイコク電機	1	1	1,797
竹内製作所	4	4	9,172
アマノ	7	7	21,319
JUKI	3	4	3,208
サンデンホールディングス	3	3	2,308
蛇の目ミシン工業	3	4	1,794
マックス	3	4	8,630
グローリー	6	7	23,068
新晃工業	2	2	4,326
大和冷機工業	3	4	4,391
セガサミーホールディングス	24	28	46,812
日本ピストンリング	0.900	1	1,861
リケン	1	1	4,426
T P R	3	3	6,266
ツバキ・ナカシマ	3	5	6,948
ホシザキ	7	8	86,984
大豊工業	2	2	1,762
日本精工	51	53	48,578
NTN	53	65	19,345
ジェイテクト	23	27	31,640
不二越	2	2	10,452
日本トムソン	7	8	3,603
THK	15	16	45,573
ユーシン精機	1	2	1,977
前澤給装工業	1	1	2,198
イーグル工業	3	3	3,269
日本ピラー工業	2	2	4,376
キッツ	10	11	8,188
マキタ	30	37	153,223
日立造船	19	22	9,540
三菱重工業	41	47	179,071
IHI	19	20	56,108
スター精密	4	4	5,843
電気機器(14.6%)			
日清紡ホールディングス	13	18	19,618
イビデン	15	17	47,606
コニカミノルタ	54	62	40,613
ブラザー工業	32	34	74,327

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
ミネベアミツミ	46	52	114,464
日立製作所	112	136	571,798
三菱電機	248	284	445,042
富士電機	16	17	57,883
東洋電機製造	1	1	1,671
安川電機	28	30	114,291
シンフォニア テクノロジー	3	3	4,384
明電舎	4	5	10,301
オリジン	-	1	1,783
山洋電気	1	1	7,196
デンヨー	2	2	4,898
東芝テック	3	3	14,976
芝浦メカトロニクス	0.400	0.500	1,695
マブチモーター	6	7	32,864
日本電産	30	34	481,365
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1	-	-
トレックス・セミコンダクター	1	1	2,379
東光高岳	1	1	1,827
ダブル・スコープ	3	4	3,352
ダイヘン	2	3	10,245
ヤーマン	3	4	2,884
JVCケンウッド	19	23	5,821
ミマキエンジニアリング	2	3	1,796
第一精工	1	1	2,922
日新電機	5	6	7,510
大崎電気工業	5	5	3,431
オムロン	26	25	171,360
日東工業	4	4	9,013
I D E C	3	4	7,597
不二電機工業	-	1	1,807
ジー・エス・ユアサ コーポレーション	9	9	20,301
サクサホールディングス	0.800	1	1,839
メルコホールディングス	1	1	2,537
日本電気	32	34	165,427
富士通	24	27	346,062
沖電気工業	10	11	15,295
電気興業	1	1	4,613
サンケン電気	2	3	8,999
アイホン	1	1	2,681
ルネサスエレクトロニクス	25	135	105,788
セイコーエプソン	30	35	59,692

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ワコム	18	19	7,410
アルバック	5	5	18,798
E I Z O	2	2	8,206
ジャパンディスプレイ	58	82	5,829
日本信号	6	7	9,777
京三製作所	5	6	3,718
能美防災	3	3	8,869
ホーチキ	1	2	2,887
星和電機	3	-	-
エレコム	2	3	12,245
パナソニック	284	324	385,949
シャープ	24	32	49,053
アンリツ	16	18	37,020
富士通ゼネラル	7	7	18,741
ソニー	167	179	1,351,703
T D K	13	13	156,865
帝国通信工業	1	1	1,845
タムラ製作所	9	9	5,453
アルプスアルパイン	25	25	46,083
池上通信機	1	1	1,725
パイオニア	41	-	-
日本電波工業	3	3	1,776
鈴木	2	2	1,833
日本トリム	0.500	0.400	1,546
ローランド ディー・ジー	1	1	2,936
フォスター電機	2	3	4,635
クラリオン	2	-	-
S M K	0.700	0.700	1,982
ヨコオ	1	1	5,317
ホシデン	7	7	8,533
ヒロセ電機	3	4	56,716
日本航空電子工業	5	6	12,486
T O A	2	3	3,075
マクセルホールディングス	5	6	8,619
古野電気	3	3	3,918
ユニデンホールディングス	0.700	0.900	1,845
スミダコーポレーション	2	2	2,450
アイコム	1	1	4,126
リオン	1	1	3,385
船井電機	2	2	2,050
横河電機	24	26	50,607

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
新電元工業	0.900	1	3,420
アズビル	16	17	52,572
東亜ディーケーケー	2	1	1,758
日本光電工業	11	11	41,067
共和電業	4	4	1,732
日本電子材料	2	1	1,598
堀場製作所	4	5	38,304
アドバンテスト	17	21	118,371
小野測器	2	3	1,749
エスパック	2	2	5,460
キーエンス	12	25	985,595
日置電機	1	1	5,542
シスメックス	19	20	151,113
日本マイクロニクス	4	4	5,326
メガチップス	2	2	4,680
OBARA GROUP	1	1	4,635
澤藤電機	0.500	0.900	1,755
原田工業	-	1	1,818
コーセル	3	3	4,343
イリソ電子工業	2	2	9,744
オプテックスグループ	4	4	7,111
千代田インテグレ	1	1	2,753
アイ・オー・データ機器	1	1	1,727
レーザーテック	5	12	70,375
スタンレー電気	17	20	58,400
岩崎電気	-	1	1,797
ウシオ電機	15	16	24,337
岡谷電機産業	4	4	1,778
ヘリオス テクノ ホールディング	2	4	1,698
エノモト	-	1	1,692
日本セラミック	2	2	7,142
遠藤照明	2	2	1,783
古河電池	2	2	1,680
双信電機	4	-	-
山一電機	1	2	3,941
図研	1	1	4,366
日本電子	4	5	18,844
カシオ計算機	22	25	52,710
ファナック	23	27	552,690
日本シイエムケイ	6	6	3,752
エンプラス	1	1	4,190

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ローム	12	12	103,698
浜松ホトニクス	17	20	94,146
三井ハイテック	2	3	4,994
新光電気工業	8	9	12,929
京セラ	37	40	298,880
太陽誘電	11	12	43,911
村田製作所	26	83	525,131
ユーシン	3	-	-
双葉電子工業	4	4	5,332
北陸電気工業	1	1	1,665
ニチコン	7	9	8,419
日本ケミコン	1	2	3,929
KOA	3	4	5,095
市光工業	3	4	3,007
小糸製作所	14	17	79,135
ミツバ	4	5	3,775
SCREENホールディングス	4	4	30,429
キャノン電子	2	3	6,081
キャノン	134	153	426,487
リコー	74	72	80,325
象印マホービン	4	8	15,902
MUTOHホールディングス	0.800	1	1,688
東京エレクトロン	16	18	475,618
輸送用機器(7.7%)			
トヨタ紡織	8	8	13,479
芦森工業	1	1	1,652
ユニプレス	4	5	7,128
豊田自動織機	20	23	145,820
モリタホールディングス	4	5	8,830
三櫻工業	3	3	3,650
デンソー	54	62	279,634
東海理化電機製作所	6	7	13,635
三井E&Sホールディングス	9	10	9,043
川崎重工業	19	22	49,039
名村造船所	7	9	2,235
日本車輛製造	0.900	1	2,870
三菱ロジスネクスト	3	3	6,380
近畿車輛	0.700	1	1,764
日産自動車	293	335	169,024
いすゞ自動車	78	82	93,575
トヨタ自動車	277	317	2,458,159

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
日野自動車	31	35	35,855
三菱自動車工業	92	105	42,606
エフテック	1	0.900	664
武蔵精密工業	6	6	8,460
日産車体	4	5	5,901
新明和工業	11	7	9,902
極東開発工業	5	5	7,340
日信工業	4	5	12,992
トピー工業	2	2	3,956
ティラド	0.900	1	1,770
曙ブレーキ工業	13	15	3,712
タチエス	4	4	5,884
NOK	13	15	23,929
フタバ産業	6	7	4,898
K Y B	2	3	8,720
大同メタル工業	4	5	3,607
プレス工業	12	14	4,963
ミクニ	3	5	1,760
太平洋工業	5	5	7,628
ケーヒン	5	6	16,815
河西工業	3	3	2,812
アイシン精機	20	23	91,377
マツダ	78	83	75,072
今仙電機製作所	2	2	2,220
本田技研工業	210	223	680,271
スズキ	45	56	273,055
S U B A R U	77	88	257,764
安永	1	1	1,713
ヤマハ発動機	35	37	72,196
ショーワ	5	6	15,316
T B K	3	4	1,708
エクセディ	3	3	8,685
豊田合成	8	9	23,009
愛三工業	3	4	3,049
盟和産業	1	-	-
日本プラスト	2	2	1,771
ヨロズ	2	2	3,904
エフ・シー・シー	4	4	9,816
シマノ	10	10	164,830
ティ・エス テック	5	6	20,394
ジャムコ	1	1	1,815

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
精密機器(2.4%)			
テルモ	35	80	309,057
クリエートメディック	1	1	1,766
日機装	7	8	9,426
日本エム・ディ・エム	1	1	3,068
島津製作所	32	34	97,818
J M S	-	2	2,016
長野計器	2	2	2,049
ブイ・テクノロジ	0.600	1	5,798
東京計器	1	1	1,706
インターアクション	1	1	4,141
オーバル	6	7	1,732
東京精密	4	5	19,762
マニー	3	11	28,792
ニコン	43	46	54,970
トプコン	13	14	17,546
オリンパス	37	157	331,692
理研計器	2	2	5,575
タムロン	2	2	6,205
HOYA	50	56	578,056
シード	1	1	1,729
ノーリツ鋼機	2	1	2,869
エー・アンド・デイ	2	2	2,620
朝日インテック	10	24	68,203
シチズン時計	27	33	16,217
リズム時計工業	0.800	2	1,760
大研医器	2	1	678
メニコン	3	3	19,617
シンシア	3	-	-
松風	1	1	2,546
セイコーホールディングス	3	4	9,148
ニプロ	17	19	24,428
その他製品(2.2%)			
スノーピーク	1	1	1,446
パラマウントベッドホールディングス	2	3	13,710
トランザクシオン	2	1	1,931
粧美堂	4	4	1,798
ニホンフラッシュ	1	1	3,313
前田工織	2	3	6,606
永大産業	3	5	1,793
アートネイチャー	2	3	2,199

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
バンダイナムコホールディングス	25	29	173,754
共立印刷	7	11	1,837
S H O E I	1	1	7,518
フランスベッドホールディングス	3	4	3,668
パイロットコーポレーション	4	4	19,716
萩原工業	1	1	2,627
トッパン・フォームズ	5	6	7,045
フジシールインターナショナル	5	6	13,491
タカラトミー	10	12	13,449
廣濟堂	2	2	1,738
アーク	16	19	1,782
プロネクサス	2	2	2,716
ホクシン	10	11	1,725
大建工業	1	1	3,600
凸版印刷	35	40	81,723
大日本印刷	35	37	109,219
図書印刷	2	-	-
共同印刷	0.800	0.900	2,573
N I S S H A	5	5	5,730
光村印刷	-	1	1,821
TAKARA & COMPANY	1	1	2,317
Aシックス	24	23	31,396
ツツミ	0.800	0.900	1,775
小松ウオール工業	0.800	0.900	1,865
ヤマハ	14	16	99,372
河合楽器製作所	0.800	0.900	2,713
クリナップ	2	-	-
ピジョン	15	17	67,596
オリバー	-	0.700	2,607
キングジム	2	2	2,016
リンテック	5	6	17,299
イトーキ	4	6	2,574
任天堂	15	17	697,740
三菱鉛筆	4	4	7,473
タカラスタンダード	5	5	10,124
コクヨ	11	13	21,610
ナカバヤシ	2	-	-
グローブライド	1	1	2,870
オカムラ	8	9	9,959
美津濃	2	2	6,513

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電気・ガス業(1.5%)			
東京電力ホールディングス	198	226	98,884
中部電力	76	86	132,174
関西電力	101	107	136,563
中国電力	34	39	57,771
北陸電力	24	26	21,606
東北電力	58	71	72,491
四国電力	22	25	22,425
九州電力	51	58	49,985
北海道電力	23	26	13,805
沖縄電力	4	5	10,647
電源開発	19	22	57,087
エフオン	1	1	919
イーレックス	4	4	5,920
レノバ	3	4	5,320
東京瓦斯	48	54	129,893
大阪瓦斯	48	55	103,312
東邦瓦斯	12	14	57,260
北海道瓦斯	1	1	2,400
広島ガス	5	5	1,966
西部瓦斯	2	3	7,552
静岡ガス	7	8	7,727
メタウォーター	1	1	5,740
陸運業(4.1%)			
S B Sホールディングス	2	2	4,540
東武鉄道	26	30	107,700
相鉄ホールディングス	8	9	24,633
東急	67	71	133,075
京浜急行電鉄	34	36	66,211
小田急電鉄	39	42	97,459
京王電鉄	13	14	85,848
京成電鉄	18	19	77,517
富士急行	3	3	13,182
新京成電鉄	0.200	0.700	1,673
東日本旅客鉄道	44	50	450,700
西日本旅客鉄道	22	25	220,919
東海旅客鉄道	22	23	489,110
西武ホールディングス	31	38	63,817
鴻池運輸	4	4	6,619
西日本鉄道	6	7	20,540

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
ハマキョウレックス	1	2	6,974
サカイ引越センター	1	1	9,090
近鉄グループホールディングス	23	26	139,073
阪急阪神ホールディングス	31	35	143,779
南海電気鉄道	10	12	33,984
京阪ホールディングス	10	12	57,060
神戸電鉄	0.600	0.600	2,373
名古屋鉄道	18	22	67,736
山陽電気鉄道	1	1	4,005
日本通運	9	9	55,955
ヤマトホールディングス	41	47	90,954
山九	6	7	38,250
丸全昭和運輸	1	2	6,078
センコーグループホールディングス	13	14	12,831
トナミホールディングス	0.600	0.600	2,913
ニッコンホールディングス	9	9	23,078
日本石油輸送	0.500	0.500	1,547
福山通運	3	3	12,223
セイノーホールディングス	17	20	27,088
エスライン	-	1	1,674
神奈川中央交通	0.600	0.700	2,747
日立物流	5	4	15,239
丸和運輸機関	1	2	5,577
C&Fロジホールディングス	2	2	3,415
九州旅客鉄道	19	24	86,880
S Gホールディングス	22	28	62,857
海運業(0.2%)			
日本郵船	19	22	39,459
商船三井	14	17	43,861
川崎汽船	7	8	12,333
N S ユナイテッド海運	1	1	2,766
飯野海運	11	12	4,569
乾汽船	2	1	1,905
空運業(0.5%)			
日本航空	43	48	145,127
ANAホールディングス	43	49	160,982
パスコ	0.300	0.600	1,159
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	0.700	0.800	6,224
日新	2	2	3,882
三菱倉庫	8	8	24,718

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三井倉庫ホールディングス	2	3	5,387
住友倉庫	8	9	14,256
澁澤倉庫	1	1	3,106
東陽倉庫	5	5	1,798
日本トランスシティ	5	5	2,814
ケイヒン	1	1	1,887
中央倉庫	1	1	1,809
安田倉庫	1	2	2,206
東洋埠頭	1	1	1,784
宇徳	2	3	1,785
上組	14	15	34,896
キューソー流通システム	0.600	0.900	1,694
近鉄エクスプレス	4	5	10,812
東海運	-	5	1,663
エーアイティー	1	1	1,824
日本コンセプト	1	-	-
情報・通信業(9.3%)			
NEC ネットズエスアイ	2	2	10,972
クロスキャット	-	1	1,786
システナ	8	9	16,374
デジタルアーツ	1	1	7,658
日鉄ソリューションズ	3	4	14,007
コア	1	1	1,739
ソフトクリエイトホールディングス	1	1	2,119
T I S	8	9	66,216
電算システム	0.900	1	2,862
グリー	16	17	7,814
コーエーテックホールディングス	5	5	17,556
三菱総合研究所	1	1	4,944
ボルテージ	2	3	1,774
電算	0.700	0.800	1,800
AGS	2	2	1,742
ファインデックス	2	2	2,035
ヒト・コミュニケーションズ	1	-	-
ブレインパッド	0.500	0.700	3,563
K L a b	4	5	4,098
ポルトワイン・ビートルホールディングス	3	3	3,325
ネクソン	62	79	144,746
アイスタイル	6	7	2,730
エムアップ	0.800	0.800	2,184
エイチーム	1	1	1,687

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エニグモ	－	2	1,658
テクノスジャパン	2	3	1,736
コロプラ	7	9	8,617
オルトプラス	－	2	1,923
ブロードリーフ	12	13	7,217
クロス・マーケティンググループ	－	5	2,150
デジタルハーツホールディングス	1	1	1,737
システム情報	－	2	1,672
メディアドウホールディングス	0.800	0.900	2,772
じげん	2	6	3,022
サイバーリンクス	1	－	－
フィックスターズ	2	3	4,047
CARTA HOLDINGS	1	1	1,758
オプティム	0.500	0.700	3,255
セレス	0.900	1	1,792
SHIFT	－	0.700	5,054
ティーガイア	2	2	5,785
セック	0.400	0.500	1,835
豆蔵ホールディングス	1	1	3,573
テクマトリックス	1	2	5,660
プロシップ	1	1	1,804
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	58	6	12,321
GMOペイメントゲートウェイ	4	4	34,730
ザッパラス	4	4	1,668
インターネットイニシアティブ	4	4	13,694
さくらインターネット	3	3	1,845
GMOクラウド	0.500	0.700	1,735
SRAホールディングス	1	1	3,868
MINORISソリューションズ	0.900	－	－
朝日ネット	2	2	1,853
eBASE	－	1	2,898
アバント	－	2	1,922
アドソル日進	1	1	2,442
フリービット	1	2	1,686
コムチュア	1	3	6,999
サイバーコム	－	0.900	1,710
アステリア	－	3	1,639
アイル	－	1	1,826
マークラインズ	－	1	2,797
メディカル・データ・ビジョン	2	2	1,942
gumi	3	3	2,613

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
モバイルファクトリー	0.600	1	1,850
テラスカイ	－	1	3,245
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1	1	1,820
PCIホールディングス	0.600	0.800	1,800
パイプドHD	1	－	－
PR TIMES	－	0.500	1,290
ランドコンピュータ	1	1	1,795
ダブルスタンダード	－	0.400	1,608
オープンドア	1	1	1,694
マイネット	0.800	－	－
アカツキ	0.900	1	4,730
Ubicomホールディングス	－	1	1,582
LINE	7	6	34,368
チェンジ	－	0.600	2,556
シンクロ・フード	2	3	1,415
オークネット	1	1	2,024
AOI TYO HOLDINGS	2	2	2,074
マクロミル	4	5	5,916
ビーグリー	1	1	2,108
オロ	－	0.700	2,334
プロトコーポレーション	－	2	3,347
野村総合研究所	15	39	104,280
サイバネットシステム	2	－	－
CEホールディングス	2	3	1,713
日本システム技術	1	－	－
インテージホールディングス	3	3	2,926
東邦システムサイエンス	1	2	1,814
ソースネクスト	9	13	5,306
インフォコム	1	3	8,403
ラクスル	－	1	5,167
FIG	4	6	1,814
イーソル	－	1	1,878
アルテリア・ネットワークス	2	3	5,886
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	－	1	1,707
フォーカスシステムズ	1	1	1,694
クレスコ	0.700	1	3,303
フジ・メディア・ホールディングス	25	26	38,224
オービック	8	9	141,911
ジャストシステム	3	4	23,085
TDCソフト	2	2	2,229
Zホールディングス	159	382	161,966

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トレンドマイクロ	13	12	73,036
I Dホールディングス	1	1	1,791
日本オラクル	4	5	54,492
アルファシステムズ	0.800	0.900	2,546
フューチャー	3	3	6,011
CAC Holdings	1	1	2,295
S Bテクノロジー	1	1	2,363
トーセ	1	1	1,687
オービックビジネスコンサルタント	2	2	11,662
伊藤忠テクノソリューションズ	11	12	42,227
アイティフォー	3	3	2,546
東計電算	-	0.400	1,812
エックスネット	1	1	1,844
大塚商会	13	15	73,235
サイボウズ	2	3	7,421
電通国際情報サービス	1	1	8,423
デジタルガレージ	4	5	20,375
イーエムシステムズ	2	3	3,506
ウェザーニューズ	0.800	0.900	3,460
C I J	1	2	1,810
ビジネスエンジニアリング	0.800	0.500	1,590
日本エンタープライズ	8	6	1,766
WOWOW	1	1	3,461
スカラ	2	2	1,701
IMAGICA GROUP	2	3	1,751
ネットワンシステムズ	8	10	26,150
システムソフト	14	18	1,748
アルゴグラフィックス	1	2	8,820
マーベラス	3	4	2,889
エイベックス	4	4	5,956
日本ユニシス	7	8	32,625
兼松エレクトロニクス	1	1	5,085
東京放送ホールディングス	16	17	32,266
日本テレビホールディングス	22	23	33,971
朝日放送グループホールディングス	2	2	2,016
テレビ朝日ホールディングス	6	7	15,607
スカパーJ S A Tホールディングス	18	18	8,582
テレビ東京ホールディングス	2	2	5,439
日本BS放送	1	1	1,727
ビジョン	0.800	2	2,899
USEN-NEXT HOLDINGS	1	1	1,852

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ワイヤレスゲート	3	-	-
コネクシオ	1	1	2,449
日本通信	21	21	4,665
日本電信電話	167	372	1,034,615
KDD I	215	207	708,390
ソフトバンク	194	253	376,172
光通信	2	2	67,193
NTTドコモ	175	206	644,986
エムティーアイ	2	2	1,749
GMOインターネット	8	11	22,836
KADOKAWA	7	7	12,337
学研ホールディングス	0.800	0.900	6,444
ゼンリン	4	5	8,176
昭文社	3	-	-
インプレスホールディングス	10	10	1,743
アイネット	1	1	2,055
松竹	1	1	24,966
東宝	16	16	64,629
東映	1	1	13,960
エヌ・ティ・ティ・データ	65	74	107,961
ビジネスブレイン太田昭和	0.800	0.600	1,682
D T S	2	6	13,578
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11	11	59,024
シーイーシー	2	3	5,814
カプコン	10	13	45,260
アイ・エス・ビー	0.800	0.900	2,089
ジャステック	1	1	1,879
S C S K	6	6	39,936
日本システムウエア	0.900	0.900	2,060
アイネス	3	2	4,536
T K C	2	2	12,720
富士ソフト	3	3	14,814
N S D	4	9	17,046
コナミホールディングス	10	10	44,187
福井コンピュータホールディングス	0.900	1	3,443
J B C Cホールディングス	1	1	3,661
ミロク情報サービス	2	2	6,625
ソフトバンクグループ	102	221	1,223,457
卸売業(5.0%)			
高千穂交易	1	1	1,793
伊藤忠食品	0.600	0.700	3,409

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エレマテック	1	2	2,555
JALUX	0.700	0.800	1,812
あらた	1	2	9,999
トーメンデバイス	0.600	0.500	1,985
東京エレクトロニクス デバイス	0.900	1	2,780
フィールズ	2	3	1,570
双日	135	154	52,873
アルフレッサ ホールディングス	27	31	67,798
横浜冷凍	6	7	7,308
ラサ商事	1	2	1,806
アルコニックス	2	3	3,711
神戸物産	3	9	43,262
あい ホールディングス	3	4	6,924
ディーブイエックス	1	1	1,744
ダイワボウホールディングス	2	2	15,048
マクニカ・富士エレクトロニクス	6	6	11,490
ラクト・ジャパン	0.500	1	3,940
バイタルケーエスケイ・ホールディングス	4	5	5,549
八洲電機	1	2	1,942
レスターホールディングス	1	2	5,347
ジュテックホールディングス	0.900	1	1,851
大光	2	-	-
OCHIホールディングス	1	1	1,758
TOKAIホールディングス	13	14	14,592
黒谷	-	3	1,728
Cominix	1	2	1,790
三洋貿易	1	2	3,374
ビューティガレージ	0.900	0.900	1,828
ウイン・パートナーズ	1	2	2,122
シップヘルスケアホールディングス	5	4	20,835
明治電機工業	0.900	1	1,728
コメダホールディングス	5	6	13,060
富士興産	2	2	1,827
協栄産業	1	1	1,792
小野建	2	2	3,182
佐鳥電機	1	2	1,808
エコートレーディング	2	-	-
伯東	1	1	2,029
コンドーテック	1	2	2,565
ナガイレーベン	3	4	9,372
三菱食品	2	3	9,089

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
松田産業	1	2	2,998
第一興商	3	4	20,139
メディバルホールディングス	26	30	66,591
S P K	0.600	0.700	1,836
萩原電気ホールディングス	0.900	1	2,525
アズワン	1	1	17,233
スズデン	-	1	1,839
シモジマ	1	1	1,876
ドウシシャ	2	2	4,076
小津産業	0.800	1	1,689
高速	1	1	2,043
丸文	2	2	1,728
ハピネット	2	2	2,930
日本ライフライン	7	8	11,644
エクセル	0.900	-	-
マルカ	0.800	1	2,069
I DOM	8	7	4,725
進和	1	1	3,707
ダイトロン	1	1	2,316
シークス	3	3	4,888
田中商事	2	2	1,770
オーハシテクニカ	1	1	2,371
白銅	0.900	1	1,689
伊藤忠商事	171	195	509,700
丸紅	241	291	229,981
高島	-	0.900	1,704
長瀬産業	13	15	22,560
蝶理	1	1	3,780
豊田通商	27	31	115,128
三共生興	4	4	2,305
兼松	9	10	13,374
三井物産	202	246	474,657
日本紙パルプ商事	1	1	6,176
日立ハイテク	7	9	77,794
カメイ	3	3	3,949
東都水産	-	0.600	1,713
OUGホールディングス	0.600	0.700	1,820
スターゼン	0.900	1	4,405
山善	9	10	10,965
椿本興業	0.600	0.500	1,995
住友商事	145	176	291,301

ニッセイ国内株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
内田洋行	1	1	7,224
三菱商事	172	196	560,132
第一実業	1	1	4,942
キャノンマーケティングジャパン	7	8	21,848
西華産業	1	1	2,080
佐藤商事	2	2	2,113
菱洋エレクトロ	2	2	5,384
東京産業	2	3	1,755
ユアサ商事	2	2	8,964
神鋼商事	0.600	0.700	1,673
小林産業	5	-	-
阪和興業	4	5	12,979
正栄食品工業	1	1	6,714
カナデン	2	2	3,006
菱電商事	1	2	3,288
フルサト工業	1	1	2,434
岩谷産業	5	6	22,630
すてきナイスグループ	1	-	-
昭光通商	2	2	1,700
イワキ	3	3	1,861
三愛石油	6	6	7,341
稲畑産業	5	6	8,921
ワキタ	5	6	6,120
東邦ホールディングス	7	9	20,178
サンゲツ	7	7	13,821
ミツウロコグループホールディングス	3	4	4,686
シナネンホールディングス	1	1	2,584
伊藤忠エネクス	5	6	5,704
サンリオ	7	7	15,539
サンワテクノス	1	2	1,782
リョーサン	2	3	7,480
新光商事	2	4	3,484
トーホー	1	1	2,272
三信電気	2	1	2,424
東陽テクニカ	2	3	3,321
モスフードサービス	3	3	11,055
加賀電子	2	2	6,398
ソーダニッカ	2	2	1,687
立花エレテック	1	2	3,614
PALTAC	4	4	22,590
三谷産業	5	5	1,800

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
西本Wisemttacホールディングス	0.600	0.500	1,572
ヤマシタヘルスケアホールディングス	-	0.800	1,677
国際紙パルプ商事	5	6	1,900
ヤマタネ	1	1	2,066
丸紅建材リース	0.800	1	1,829
日鉄物産	1	2	9,150
泉州電業	0.800	0.900	2,678
トラスコ中山	5	5	13,670
オートバックスセブン	9	10	16,005
モリト	2	2	1,821
加藤産業	3	4	15,246
イノテック	1	1	1,846
イエローハット	2	5	8,718
J Kホールディングス	2	2	1,857
日伝	2	2	4,855
北沢産業	5	6	1,683
杉本商事	1	1	2,838
因幡電機産業	3	8	20,920
バイテックホールディングス	1	-	-
東テク	0.800	0.900	2,207
ミスミグループ本社	30	35	93,401
タキヒヨー	0.800	1	1,825
蔵王産業	1	1	1,740
スズケン	11	11	47,659
ジェコス	1	1	1,964
グローセル	3	-	-
小売業(4.5%)			
ローソン	6	7	44,162
サンエー	1	2	10,488
カワチ薬品	1	2	4,598
エービーシー・マート	3	4	29,788
ハードオフコーポレーション	1	2	1,760
アスクル	2	2	9,758
ゲオホールディングス	3	5	6,125
アダストリア	3	3	8,213
ジーフット	2	2	1,777
くら寿司	1	1	8,100
キャンドウ	1	1	2,120
バルグループホールディングス	1	1	4,802
エディオン	10	12	12,953
サーラコーポレーション	5	5	3,448

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
ハローズ	0.900	1	3,007
フジオフードシステム	—	2	3,991
あみやき亭	0.500	0.600	2,049
ひらまつ	4	6	1,628
大黒天物産	0.600	0.700	2,334
ハニーズホールディングス	2	2	3,355
アルペン	1	2	3,990
クオールホールディングス	3	4	5,690
ジンズホールディングス	1	1	11,115
ビックカメラ	13	16	17,928
DCMホールディングス	13	15	15,764
ペッパーフードサービス	1	2	1,911
MonotaRO	15	19	52,436
東京一番フーズ	—	3	1,824
DDホールディングス	0.700	1	1,852
きちりホールディングス	2	2	1,782
アークランドサードホールディングス	1	2	4,020
J. フロント リテイリング	31	33	42,919
ドトール・日レスホールディングス	4	4	9,382
マツモトキヨシホールディングス	10	11	44,950
ブロンコビリー	1	1	3,795
ZOZO	26	19	33,081
物語コーポレーション	0.600	0.700	5,887
ココカラファイン	2	2	14,790
三越伊勢丹ホールディングス	45	48	39,168
Hamee	1	0.600	956
ウエルシアホールディングス	6	8	51,875
クリエイトSDホールディングス	3	4	12,769
丸善CHIホールディングス	—	5	1,835
ミサワ	3	2	2,012
ティーライフ	1	2	1,698
チムニー	0.700	0.900	2,002
シュッピン	2	1	1,860
ネクステージ	3	4	4,012
ジョイフル本田	7	8	10,217
鳥貴族	0.800	0.900	2,380
キリン堂ホールディングス	1	1	1,856
ホットランド	1	1	2,454
すかいらーくホールディングス	22	31	58,184
SFPホールディングス	—	1	2,559
綿半ホールディングス	0.900	1	1,830

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エイト・スーパーマーケット・ホールディングス	7	8	7,767
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	2	1,804
BEENOS	—	1	1,777
あさひ	2	2	2,656
日本調剤	0.900	0.800	3,080
コスモス薬品	1	1	28,188
オンリー	—	2	1,789
セブン&アイ・ホールディングス	102	109	429,240
薬王堂	1	—	—
クワイエット・レストランズ・ホールディングス	6	7	16,897
ツルハホールディングス	5	6	77,287
サンマルクホールディングス	1	2	4,771
フェリシモ	1	1	1,695
トリドールホールディングス	3	3	9,572
TOKYO BASE	2	3	1,645
JMホールディングス	0.900	1	3,172
サツドラホールディングス	0.800	1	1,815
パロックジャパンリミテッド	2	1	1,865
クスリのアオキホールディングス	2	2	16,400
スシローグローバルホールディングス	2	3	27,280
LIXILビバ	2	2	6,566
メディカルシステムネットワーク	—	3	1,790
ノジマ	4	5	10,685
カッパ・クリエイト	3	3	5,647
ライトオン	2	3	1,767
良品計画	3	37	64,765
三城ホールディングス	3	—	—
アドヴァン	3	4	5,357
アルビス	0.900	1	2,367
コナカ	3	4	1,800
G-7ホールディングス	0.700	1	4,019
イオン北海道	2	2	2,326
コジマ	3	4	2,352
ヒマラヤ	1	2	1,832
コーナン商事	3	4	9,640
エコス	0.900	1	1,838
ワタミ	3	3	3,887
マルシェ	1	2	1,838
パ・パフィック・インターナショナルホールディングス	14	61	120,663
西松屋チェーン	5	6	5,526
ゼンショーホールディングス	11	13	32,990

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
幸楽苑ホールディングス	1	1	3,328
サイゼリヤ	4	4	10,497
V Tホールディングス	8	11	4,802
魚力	1	—	—
ユニテッドアローズ	2	2	7,989
ハイデイ日高	3	4	7,628
京都きもの友禅	2	5	1,787
コロナイド	8	9	20,497
ピーシーデポコーポレーション	3	3	2,157
壱番屋	1	2	10,860
トップカルチャー	5	—	—
P L A N T	1	3	1,763
スギホールディングス	5	5	30,408
薬王堂ホールディングス	—	1	2,616
ヴィア・ホールディングス	3	3	2,230
スクロール	3	5	1,788
ヨンドシーホールディングス	2	2	6,431
ファミリーマート	6	22	56,179
木曽路	3	3	10,533
S R S ホールディングス	2	3	3,425
千趣会	—	5	2,641
ケーヨー	4	5	3,112
上新電機	2	3	6,656
日本瓦斯	4	4	16,412
ロイヤルホールディングス	4	4	10,427
東天紅	—	1	1,751
いなげや	2	3	4,749
島忠	5	5	15,926
チヨダ	2	2	4,231
ライフコーポレーション	1	2	5,436
リンガーハット	3	3	8,183
Mr M a x H D	3	3	1,797
テンアライド	3	4	1,783
A O K I ホールディングス	4	5	5,706
オークワ	3	4	6,441
コメリ	3	4	9,498
青山商事	4	5	7,458
しまむら	2	3	25,476
はせがわ	3	4	1,817
高島屋	19	20	22,766

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
松屋	4	5	4,345
エイチ・ツー・オー リテイリング	12	13	12,448
近鉄百貨店	0.900	1	3,762
パルコ	2	—	—
丸井グループ	20	25	60,934
アクシアル リテイリング	2	2	8,498
イオン	94	107	247,710
イズミ	5	5	18,952
平和堂	5	5	10,596
フジ	3	3	6,201
ヤオコー	2	3	18,560
ゼビオホールディングス	3	3	3,740
ケーズホールディングス	25	27	35,532
O l y m p i c グループ	2	—	—
Genky DrugStores	1	1	2,336
総合メディカルホールディングス	2	2	6,112
ブックオフグループホールディングス	—	1	1,666
アインホールディングス	3	3	23,052
元気寿司	0.700	0.700	2,034
ヤマダ電機	74	85	50,668
アークランドサカモト	4	4	5,196
ニトリホールディングス	10	12	200,376
グルメ杵屋	1	2	2,322
愛眼	5	7	1,766
吉野家ホールディングス	8	9	23,266
松屋フーズホールディングス	1	1	5,798
サガミホールディングス	3	3	4,895
関西スーパーマーケット	1	2	2,302
王将フードサービス	1	2	13,503
プレナス	2	3	5,983
ミニストップ	1	2	3,196
アークス	4	5	10,915
パローホールディングス	5	6	11,166
藤久	2	—	—
ベルク	1	1	7,826
大 庄	1	1	2,439
ファーストリテイリング	3	3	220,668
サンドラッグ	9	10	34,597
サックスパー ホールディングス	2	2	1,924
やまや	0.700	0.800	1,764

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
ベルーナ	6	6	3,684
銀行業(5.6%)			
島根銀行	2	2	1,705
じもとホールディングス	16	18	1,946
めぶきフィナンシャルグループ	127	145	34,070
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3	3	4,579
九州フィナンシャルグループ	40	46	18,860
ゆうちょ銀行	69	79	80,035
富山第一銀行	5	6	2,063
コンコルディア・フィナンシャルグループ	156	164	69,216
西日本フィナンシャルホールディングス	15	19	13,026
関西みらいフィナンシャルグループ	11	16	9,282
三十三フィナンシャルグループ	2	2	3,967
第四北越フィナンシャルグループ	4	4	12,475
新生銀行	18	20	34,814
あおぞら銀行	13	16	50,601
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,709	1,929	1,085,753
りそなホールディングス	269	307	135,128
三井住友トラスト・ホールディングス	48	53	212,053
三井住友フィナンシャルグループ	173	193	727,318
千葉銀行	87	96	58,322
群馬銀行	49	55	19,670
武蔵野銀行	3	4	6,959
千葉興業銀行	6	7	2,556
筑波銀行	10	11	2,293
七十七銀行	7	9	14,877
青森銀行	2	2	5,660
秋田銀行	1	1	3,398
山形銀行	2	3	4,237
岩手銀行	1	1	4,577
東邦銀行	22	25	6,099
みちのく銀行	1	1	2,399
ふくおかフィナンシャルグループ	19	23	43,565
静岡銀行	61	69	52,119
十六銀行	3	3	7,248
スルガ銀行	25	28	12,513
八十二銀行	44	67	27,242
山梨中央銀行	3	3	3,026
大垣共立銀行	3	5	12,276
福井銀行	2	2	3,720
北國銀行	2	2	9,077

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
清水銀行	1	1	2,336
富山銀行	0.500	0.800	1,574
滋賀銀行	4	5	14,694
南都銀行	2	4	11,632
百五銀行	22	25	7,963
京都銀行	8	10	42,420
紀陽銀行	8	9	15,731
ほくほくフィナンシャルグループ	16	18	18,849
広島銀行	36	41	21,528
山陰合同銀行	14	16	10,109
中国銀行	15	24	22,822
鳥取銀行	1	1	1,835
伊予銀行	32	40	21,400
百十四銀行	2	3	6,006
四国銀行	3	4	3,943
阿波銀行	4	4	10,911
大分銀行	1	1	3,636
宮崎銀行	1	1	4,466
佐賀銀行	1	1	2,551
十八銀行	1	-	-
沖縄銀行	2	2	8,632
琉球銀行	5	6	6,831
セブン銀行	82	93	29,858
みずほフィナンシャルグループ	3,336	3,808	604,377
山口フィナンシャルグループ	30	35	22,645
長野銀行	0.900	1	1,759
名古屋銀行	2	2	7,774
北洋銀行	37	42	9,579
愛知銀行	0.900	1	3,395
中京銀行	1	1	2,642
大光銀行	0.900	1	1,757
愛媛銀行	3	4	4,304
京葉銀行	10	11	6,783
栃木銀行	12	13	2,619
北日本銀行	0.800	0.900	1,858
東和銀行	4	4	3,792
トモニホールディングス	19	21	7,378
フィデアホールディングス	23	27	3,291
池田泉州ホールディングス	26	32	6,053
証券、商品先物取引業(0.9%)			
F P G	7	8	8,342

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
SBIホールディングス	29	31	77,060
ジャフコ	4	4	20,124
大和証券グループ本社	197	224	120,816
野村ホールディングス	432	493	278,362
岡三証券グループ	20	23	9,392
丸三証券	7	8	4,191
東洋証券	8	12	1,788
東証証券フィナンシャル・ホールディングス	29	32	10,368
光世証券	1	3	1,832
水戸証券	7	8	1,798
いちよし証券	5	5	3,198
松井証券	12	16	14,352
だいがう証券ビジネス	0.200	2	1,806
マネックスグループ	22	21	5,296
カブドットコム証券	18	-	-
極東証券	3	3	2,869
岩井コスモホールディングス	2	2	3,294
藍澤証券	4	5	3,465
マネーパートナーズグループ	5	-	-
スパークス・グループ	-	9	2,541
保険業(2.3%)			
かんぽ生命保険	9	9	18,027
SOMPOホールディングス	43	52	230,140
アニコムホールディングス	2	2	8,993
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	64	73	273,995
ソニーフィナンシャルホールディングス	20	23	54,901
第一生命ホールディングス	138	158	258,438
東京海上ホールディングス	89	100	613,825
T&Dホールディングス	75	83	101,817
アドバンスクリエイト	0.500	0.700	1,271
その他金融業(1.2%)			
全国保証	7	7	35,945
日本モーゲージサービス	1	0.800	1,780
アルヒ	2	4	8,136
プレミアグループ	0.500	1	3,088
クレディセゾン	17	19	35,946
芙蓉総合リース	2	2	20,068
みずほリース	4	4	14,168
東京センチュリー	4	5	28,728
日本証券金融	10	12	6,175
アイフル	37	42	12,925

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リコーリース	1	2	9,273
イオンフィナンシャルサービス	15	17	31,286
アコム	49	56	29,388
ジャックス	2	3	7,657
オリエントコーポレーション	66	75	12,144
日立キャピタル	5	6	20,361
アプラスフィナンシャル	18	21	1,746
オリックス	163	175	337,452
三菱UFJリース	55	71	49,698
九州リースサービス	-	3	1,812
日本取引所グループ	66	80	159,192
イー・ギャランティ	2	3	3,885
アサックス	2	2	1,775
NECキャピタルソリューション	1	1	2,678
不動産業(2.6%)			
いちご	31	35	14,137
日本駐車場開発	29	30	4,482
スター・マイカ・ホールディングス	-	1	2,258
ヒューリック	51	59	78,876
三栄建築設計	1	1	1,788
スター・マイカ	1	-	-
野村不動産ホールディングス	16	17	46,767
三重交通グループホールディングス	5	5	3,311
サムティ	3	4	7,444
ディア・ライフ	3	3	2,048
コーセーアールイー	-	2	1,754
日本商業開発	1	1	3,187
プレサンスコーポレーション	3	4	5,874
ユニゾホールディングス	3	4	24,528
THEグローバル社	2	3	1,712
日本管理センター	1	1	2,534
サンセイランディック	1	2	1,640
エストラスト	1	2	1,732
フージャースホールディングス	5	5	3,903
オープンハウス	4	8	25,110
東急不動産ホールディングス	66	76	59,588
飯田グループホールディングス	20	23	38,048
イーブランド	2	2	1,696
ムゲンエステート	1	2	1,544
ハウスドゥ	1	1	1,785
アグレ都市デザイン	2	3	1,809

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
ジェイ・エス・ビー	－	0.300	1,551
テンポイノベーション	1	1	1,810
パーク24	14	15	39,435
パラカ	0.900	－	－
三井不動産	130	138	406,722
三菱地所	172	196	420,296
平和不動産	4	5	17,493
東京建物	26	30	52,754
ダイビル	7	7	9,950
京阪神ビルディング	4	4	6,637
住友不動産	55	63	251,370
テーオーシー	5	5	4,642
東京楽天地	0.400	0.500	2,795
レオパレス21	30	36	14,826
スターツコーポレーション	3	3	9,830
フジ住宅	3	3	2,171
空港施設	2	3	1,778
明和地所	2	2	1,750
ゴールドクレスト	1	2	4,171
エスリード	1	1	2,068
日神グループホールディングス	3	4	2,185
日本エスコン	4	5	4,569
タカラレーベン	11	12	6,272
AVANTIA	1	1	1,710
イオンモール	12	14	25,564
毎日コムネット	－	1	1,721
ファースト住建	1	1	1,872
カチタス	2	3	13,912
トーセイ	3	3	5,296
穴吹興産	0.500	1	1,637
サンフロンティア不動産	3	3	4,929
エフ・ジェー・ネクスト	2	2	2,661
グランディハウス	3	3	1,719
日本空港ビルディング	7	8	46,013
サービス業(5.2%)			
日本工営	1	1	5,976
LIFULL	9	9	4,816
ジェイエイシーリクルートメント	1	1	2,907
日本M&Aセンター	17	20	75,440
メンバーズ	－	1	1,754
UTグループ	－	3	8,604

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
タケエイ	2	2	2,636
ビーネックスグループ	1	3	3,335
コシダカホールディングス	6	6	9,704
パソナグループ	2	2	3,828
CDS	1	1	1,797
リンクアンドモチベーション	4	6	3,042
GCA	2	3	2,643
エス・エム・エス	8	8	19,731
サニーサイドアップグループ	－	1	1,547
パーソルホールディングス	23	27	47,235
リニカル	1	1	1,688
クックパッド	7	9	2,954
アイ・ケイ・ケイ	2	2	1,852
学情	1	1	2,017
スタジオアリス	1	1	2,563
シミックホールディングス	1	1	2,400
NJS	1	1	1,793
総合警備保障	9	10	59,724
カカコム	17	20	58,017
セントケア・ホールディング	2	3	1,744
ルネサンス	1	1	2,539
ディップ	3	3	12,312
オプトホールディング	1	1	2,908
新日本科学	3	2	1,957
ツクイ	5	6	4,140
ベネフィット・ワン	3	7	14,511
エムスリー	50	59	183,593
ツカダ・グローバルホールディング	2	3	1,721
アウトソーシング	12	15	14,740
ウェルネット	2	2	1,798
ワールドホールディングス	0.700	1	1,953
ディー・エヌ・エー	12	13	20,920
博報堂DYホールディングス	33	37	54,545
ぐるなび	3	4	3,971
タカミヤ	2	2	1,728
ジャパンバストレスキューシステム	1	2	1,806
ファンコミュニケーションズ	6	7	3,270
ライク	1	0.900	1,715
ビジネス・ブレイクスルー	4	4	1,872
エスパール	－	5	4,196
WDBホールディングス	1	1	3,165

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
バリユーコマース	1	1	3,648
インフォーマート	13	29	22,230
J Pホールディングス	6	8	2,626
E P Sホールディングス	3	4	5,166
プレステージ・インターナショナル	4	10	10,067
アミューズ	1	1	3,955
ドリームインキュベータ	0.900	-	-
クイック	1	1	2,454
T A C	6	8	1,762
ケネディクス	20	25	17,001
電通グループ	29	28	94,640
ティクアンドギヴ・ニーズ	0.900	-	-
ぴあ	0.700	0.800	3,108
イオンファンタジー	0.800	1	2,222
シーティーエス	2	3	2,250
ネグシィーズグループ	0.800	1	1,720
みらかホールディングス	6	7	21,325
アルプス技研	2	2	4,708
日本空調サービス	2	2	2,108
オリエンタルランド	28	28	398,675
ダスキン	6	7	20,993
明光ネットワークジャパン	3	3	2,931
ファルコホールディングス	1	1	2,896
秀英予備校	3	4	1,772
ラウンドワン	7	7	7,090
リゾートトラスト	10	12	20,001
ビー・エム・エル	3	3	11,567
りらいあコミュニケーションズ	4	4	7,080
リソー教育	12	12	4,736
ユー・エス・エス	29	30	57,273
東京個別指導学院	-	1	1,167
サイバーエージェント	14	15	68,796
楽天	110	126	120,016
クリーク・アンド・リパー社	1	1	1,708
テー・オー・ダブリュー	2	2	1,889
山田コンサルティンググループ	-	1	2,015
セントラルスポーツ	0.900	1	2,976
フルキャストホールディングス	2	2	6,650
エン・ジャパン	2	4	16,728
リソルホールディングス	0.400	0.400	1,658
テクノプロ・ホールディングス	4	5	41,742

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
インターワークス	2	3	1,775
アイ・アールジャパンホールディングス	-	1	8,107
K e e P e r 技研	1	1	1,680
三機サービス	-	1	1,791
G u n o s y	1	1	1,970
イー・ガーディアン	1	1	2,679
リブセンス	5	6	1,798
ジャパンマテリアル	6	8	12,591
ベクトル	2	3	4,076
ウチヤマホールディングス	3	3	1,698
チャーム・ケア・コーポレーション	-	2	2,157
キャリアリンク	4	3	1,868
I B J	0.800	1	2,319
アサンテ	1	1	2,062
N・フィールド	1	3	1,686
バリユーHR	-	0.600	2,067
M&Aキャピタルパートナーズ	0.600	1	7,125
ライドオンエクスプレスホールディングス	1	1	1,665
E R Iホールディングス	1	2	1,761
アビスト	0.500	0.700	1,773
シグマクシス	1	1	3,163
ウィルグループ	1	1	1,791
エスコロー・エージェント・ジャパン	5	8	1,823
日本ビューホテル	1	-	-
リクルートホールディングス	170	194	885,364
エラン	1	1	2,630
日本郵政	195	222	223,612
ベルシステム24ホールディングス	4	4	6,786
鎌倉新書	1	2	3,296
一蔵	2	2	1,682
L I T A L I C O	-	0.900	2,228
エアトリ	0.700	1	1,593
アトラエ	-	0.700	1,963
ストライク	0.700	1	4,730
ソラスト	5	7	7,950
セラク	2	1	1,839
インソース	0.800	1	3,760
バイカレント・コンサルティング	1	1	12,608
M S - J a p a n	1	1	1,641
グレイステクノロジー	0.800	1	3,846
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1	2	6,426

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
フルテック	1	1	1,808
日総工産	0.700	2	1,636
キュービーネットホールディングス	1	1	2,508
RPAホールディングス	-	1	1,854
スプリックス	0.700	1	1,666
リログループ	13	14	38,287
東祥	1	1	3,362
エイチ・アイ・エス	4	4	10,437
ラックランド	0.700	0.800	1,703
共立メンテナンス	3	4	18,180
イチネンホールディングス	2	3	4,125
建設技術研究所	1	1	4,218
スペース	1	1	2,077
燦ホールディングス	0.600	1	1,876
東京テアトル	1	1	1,710
ナガワ	0.700	0.900	5,958
よみうりランド	0.500	0.600	2,457
東京都競馬	1	1	6,615
常磐興産	1	1	1,783
カナモト	3	4	11,677
東京ドーム	8	11	10,637
西尾レントオール	2	2	8,192
トランス・コスモス	2	2	6,895
乃村工藝社	5	11	13,699
藤田観光	0.900	1	2,960
KNT-CTホールディングス	1	1	1,948
日本管財	2	2	5,512
トーカイ	2	2	6,401
白洋舎	0.500	0.700	1,936
セコム	25	28	277,660

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セントラル警備保障	1	1	7,098
丹青社	4	5	5,859
メイテック	3	3	19,176
応用地質	2	2	4,112
船井総研ホールディングス	4	5	16,693
進学会ホールディングス	2	3	1,836
いであ	1	-	-
学究社	1	1	1,755
ベネッセホールディングス	8	9	26,568
イオンディライト	2	3	12,408
ナック	1	1	1,691
ニチイ学館	3	3	5,202
ダイセキ	4	4	13,445
ステップ	1	1	1,812
合計	株数・金額	28,825	33,485 67,041,297
	銘柄数<比率>	1,840	1,860 <98.3%>

(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
	百万円	百万円
国内 TOPIX	1,107	-

(注) 単位未満は切り捨てています。

投資信託財産の構成

2020年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	67,041,297	97.8
コール・ローン等、その他	1,498,347	2.2
投資信託財産総額	68,539,644	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

(2020年2月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	68,539,644,735円
コーポレート債	1,329,651,106
株式(評価額)	67,041,297,600
未収入金	6,565,600
未収配当金	108,315,429
差入委託証拠金	53,815,000
(B)負債	314,337,370
未払金	17,881,300
未払解約金	296,452,837
その他未払費用	3,233
(C)純資産総額(A-B)	68,225,307,365
元本	37,895,533,054
次期繰越損益金	30,329,774,311
(D)受益権総口数	37,895,533,054口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,004円

(注1) 期首元本額 34,475,094,643円
 期中追加設定元本額 14,196,038,295円
 期中一部解約元本額 10,775,599,884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	6,326,072,571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)	4,354,685,255円
ニッセイ日本バランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	4,063,446円
DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型)	1,533,145,263円
DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	5,401,509,272円
DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	3,653,662,525円
ニッセイ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)	8,430,005円
ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定)	35,457,287円
ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定)	33,985,449円
DCニッセイ国内株式インデックス	308,410,353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	14,991,687,269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)	708,282,393円
DCニッセイターゲットデートファンド2055	95,609,361円
DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	86,255,178円
DCニッセイターゲットデートファンド2045	69,742,388円
DCニッセイターゲットデートファンド2035	126,906,078円
DCニッセイターゲットデートファンド2025	31,936,187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)	49,469,361円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式)	5,859,103円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート)	4,160,513円
ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券)	1,135,532円
ニッセイ・インデックスパッケージ(国内・株式/リート/債券)	3,585,333円
<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	19,339,643円
DCニッセイターゲットデートファンド2060	9,914,628円
DCニッセイターゲットデートファンド2050	7,978,547円
DCニッセイターゲットデートファンド2040	12,198,373円
DCニッセイターゲットデートファンド2030	12,051,741円

損益の状況

当期(2019年2月21日~2020年2月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	1,509,558,501円
受取配当金	1,509,685,711
受取利息	46,015
その他収益金	911,555
支払利息	△ 1,084,780
(B)有価証券売買損益	2,694,096,667
売買益	6,804,968,518
売買損	△ 4,110,871,851
(C)先物取引等損益	110,770,160
取引益	315,518,540
取引損	△ 204,748,380
(D)信託報酬等	△ 67,872
(E)当期損益金(A+B+C+D)	4,314,357,456
(F)前期繰越損益金	23,841,312,270
(G)追加信託差損益金	10,206,215,225
(H)解約差損益金	△ 8,032,110,640
(I)合計(E+F+G+H)	30,329,774,311
次期繰越損益金(I)	30,329,774,311

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (G)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。

(注3) (H)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

ニッセイ国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第 19 期

(計算期間：2019年2月21日～2020年2月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

国内の公社債

運用方法

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



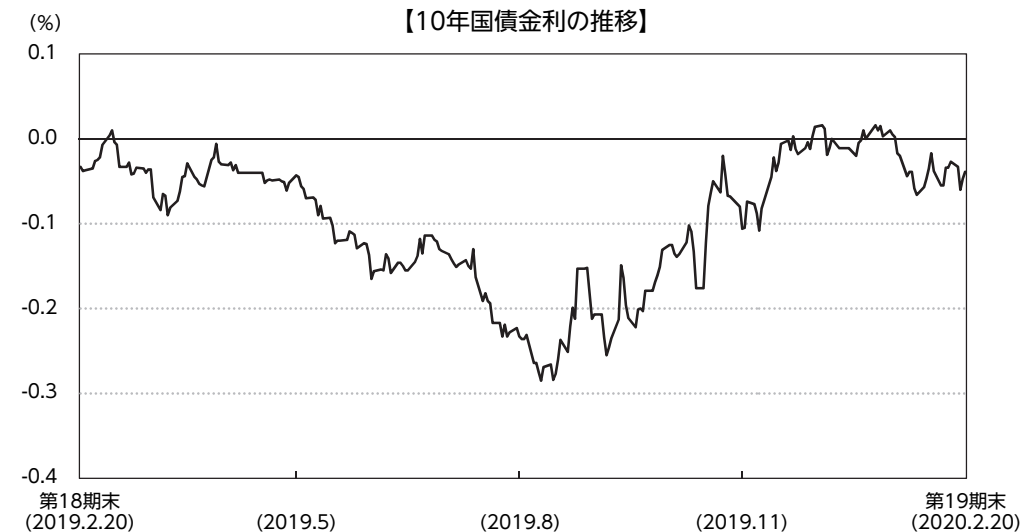
ニッセイアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2019年2月21日～2020年2月20日

国内債券市況



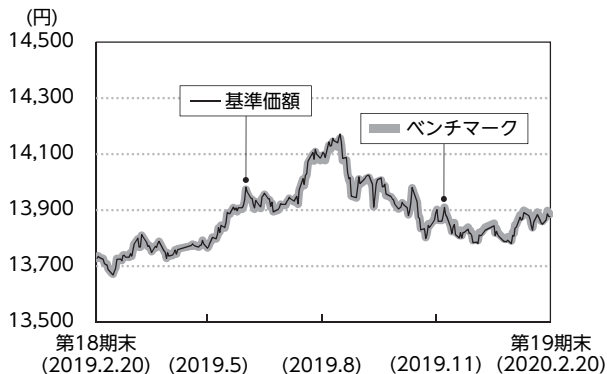
(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の10年国債金利は小幅に低下しました。

期初以降、2019年1月の米連邦公開市場委員会（FOMC）で当面利上げを停止することが明確に示されたことなどから国内金利は低下基調となり、その後も3月のFOMCで想定以上にハト派（金融緩和推進派）姿勢が示されたことなどをを受けてさらに低下しました。4月になると米中通商協議の進展や日銀による国債買入れオペ（公開市場操作）の減額等から一時上昇に転じましたが、5月中旬の米国による中国通信機器最大手の華為技術（ファーウェイ）に対する禁輸措置をきっかけに投資家心理が一段と悪化し、金利は再び低下基調となりました。また8月に入ると、米国による対中制裁関税「第4弾」の発動が発表され、米中貿易摩擦の激化懸念が増大したことや欧米の追加緩和期待の高まりを受けて、国内金利も大幅に低下しました。

しかし、9月以降は米経済指標の上振れから海外金利が上昇基調に転じる中、黒田日銀総裁による金利上昇指向を示唆する発言などから国内金利も上昇に転じ、その後も12月まで米中貿易協議の進展期待や日銀の追加緩和期待等から上下に振れながらも上昇しました。2020年1月には、中国で発生した新型コロナウイルスが世界的に拡大したこと等から投資家のリスク回避姿勢が強まり、国内金利は低下基調となりました。結局、期初よりもやや低い水準で当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・ 期初から2019年8月にかけて、主要中央銀行の緩和的な金融政策姿勢や米中貿易摩擦の激化懸念等を背景に投資家心理が悪化したことなどから、金利が低下（債券価格は上昇）したこと

<下落要因>

- ・ 2019年9月から12月にかけて、日銀による金利上昇指向を示唆する発言や米中貿易協議の進展等を背景に投資家心理が改善したことなどから、金利が上昇したこと

ポートフォリオ

ニッセイアセットマネジメント株式会社と株式会社ニッセイ基礎研究所が共同開発したクオンツモデルを利用して、ポートフォリオのデュレーション、残存期間別構成比等を調整し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目標に運用を行いました。

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

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+1.1%となり、ベンチマーク騰落率（+1.2%）にほぼ連動しました。

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。

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
15期(2016年2月22日)	13,389	4.4	13,376	4.2	99.0	25,320
16期(2017年2月20日)	13,369	△0.1	13,372	△0.0	99.3	28,941
17期(2018年2月20日)	13,502	1.0	13,506	1.0	99.0	29,566
18期(2019年2月20日)	13,728	1.7	13,736	1.7	99.0	33,405
19期(2020年2月20日)	13,877	1.1	13,894	1.2	99.2	41,491

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

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)2019年2月20日	13,728	—	13,736	—	99.0
2月末	13,705	△0.2	13,716	△0.1	98.7
3月末	13,806	0.6	13,812	0.6	99.2
4月末	13,759	0.2	13,769	0.2	99.3
5月末	13,846	0.9	13,854	0.9	99.2
6月末	13,935	1.5	13,938	1.5	99.2
7月末	13,950	1.6	13,954	1.6	99.2
8月末	14,148	3.1	14,144	3.0	98.9
9月末	13,993	1.9	13,994	1.9	99.4
10月末	13,927	1.4	13,935	1.5	99.4
11月末	13,876	1.1	13,889	1.1	99.3
12月末	13,829	0.7	13,847	0.8	99.2
2020年1月末	13,889	1.2	13,905	1.2	98.9
(期末)2020年2月20日	13,877	1.1	13,894	1.2	99.2

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2019年2月21日～2020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)	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	0.000	

(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（13,878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

2019年2月21日～2020年2月20日

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	39,253,515	31,202,967

(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

2019年2月21日～2020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342回 利付国債（10年）	3,160,976	第397回 利付国債（2年）	2,492,704
第100回 利付国債（20年）	2,734,139	第110回 利付国債（20年）	2,207,236
第117回 利付国債（20年）	2,587,875	第94回 利付国債（20年）	2,157,418
第133回 利付国債（5年）	2,582,551	第392回 利付国債（2年）	2,148,111
第397回 利付国債（2年）	2,496,343	第328回 利付国債（10年）	1,944,198
第131回 利付国債（5年）	2,055,421	第338回 利付国債（10年）	1,857,733
第350回 利付国債（10年）	2,043,308	第127回 利付国債（5年）	1,733,375
第333回 利付国債（10年）	1,930,587	第125回 利付国債（20年）	1,644,901
第403回 利付国債（2年）	1,873,658	第61回 利付国債（20年）	1,633,928
第67回 利付国債（20年）	1,828,536	第129回 利付国債（5年）	1,511,880

(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

2020年2月20日現在

国内（邦貨建）公社債

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	37,217,000 (5,031,000)	41,150,055 (5,063,290)	99.2 (12.2)	—	63.6 (0.2)	24.9 (3.7)	10.6 (8.3)
合計	37,217,000 (5,031,000)	41,150,055 (5,063,290)	99.2 (12.2)	—	63.6 (0.2)	24.9 (3.7)	10.6 (8.3)

(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) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 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。

(国内公社債の内訳)

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第397回 利付国債（2年）	0.1000	2021/ 2 / 1	1,000	1,002
	第403回 利付国債（2年）	0.1000	2021/ 8 / 1	1,861,000	1,867,848
	第404回 利付国債（2年）	0.1000	2021/ 9 / 1	1,556,000	1,562,068
	第129回 利付国債（5年）	0.1000	2021/ 9 / 20	972,000	975,917
	第131回 利付国債（5年）	0.1000	2022/ 3 / 20	1,025,000	1,030,545
	第133回 利付国債（5年）	0.1000	2022/ 9 / 20	2,557,000	2,574,208
	第139回 利付国債（5年）	0.1000	2024/ 3 / 20	1,536,000	1,552,051
	第 2 回 利付国債（40年）	2.2000	2049/ 3 / 20	45,000	67,954
	第 4 回 利付国債（40年）	2.2000	2051/ 3 / 20	2,000	3,080
	第 8 回 利付国債（40年）	1.4000	2055/ 3 / 20	702,000	939,598
	第 11 回 利付国債（40年）	0.8000	2058/ 3 / 20	49,000	56,313
	第 12 回 利付国債（40年）	0.5000	2059/ 3 / 20	78,000	81,322
	第328回 利付国債（10年）	0.6000	2023/ 3 / 20	1,006,000	1,029,610
	第333回 利付国債（10年）	0.6000	2024/ 3 / 20	2,294,000	2,365,481
	第338回 利付国債（10年）	0.4000	2025/ 3 / 20	723,000	743,706
	第342回 利付国債（10年）	0.1000	2026/ 3 / 20	3,055,000	3,102,749
	第350回 利付国債（10年）	0.1000	2028/ 3 / 20	1,975,000	2,011,241
	第 18 回 利付国債（30年）	2.3000	2035/ 3 / 20	497,000	658,390

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

債券種別	銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額
		%		千円	千円
国債証券	第 26 回 利付国債 (30年)	2.4000	2037/ 3 /20	321,000	440,867
	第 30 回 利付国債 (30年)	2.3000	2039/ 3 /20	93,000	129,119
	第 34 回 利付国債 (30年)	2.2000	2041/ 3 /20	1,028,000	1,437,935
	第 37 回 利付国債 (30年)	1.9000	2042/ 9 /20	287,000	389,037
	第 38 回 利付国債 (30年)	1.8000	2043/ 3 /20	357,000	478,237
	第 49 回 利付国債 (30年)	1.4000	2045/12/20	937,000	1,191,189
	第 54 回 利付国債 (30年)	0.8000	2047/ 3 /20	1,733,000	1,947,528
	第 67 回 利付国債 (20年)	1.9000	2024/ 3 /20	1,659,000	1,799,500
	第 85 回 利付国債 (20年)	2.1000	2026/ 3 /20	731,000	832,068
	第100回 利付国債 (20年)	2.2000	2028/ 3 /20	1,999,000	2,376,131
	第110回 利付国債 (20年)	2.1000	2029/ 3 /20	12,000	14,377
	第117回 利付国債 (20年)	2.1000	2030/ 3 /20	2,075,000	2,522,868
	第125回 利付国債 (20年)	2.2000	2031/ 3 /20	218,000	271,259
	第143回 利付国債 (20年)	1.6000	2033/ 3 /20	2,574,000	3,088,207
	第144回 利付国債 (20年)	1.5000	2033/ 3 /20	638,000	757,172
第160回 利付国債 (20年)	0.7000	2037/ 3 /20	2,621,000	2,851,464	
	合計	-	-	-	41,150,055

投資信託財産の構成

2020年2月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	41,150,055	99.0
コール・ローン等、その他	418,776	1.0
投資信託財産総額	41,568,832	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ国内債券インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年2月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	41,568,832,755円
コール・ローン等	280,062,031
公社債(評価額)	41,150,055,968
未収利息	124,917,545
前払費用	13,797,211
(B)負債	77,182,117
未払解約金	77,181,665
その他未払費用	452
(C)純資産総額(A-B)	41,491,650,638
元本	29,898,975,550
次期繰越損益金	11,592,675,088
(D)受益権総口数	29,898,975,550口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,877円

(注1) 期首元本額 24,333,886,950円
 期中追加設定元本額 11,018,164,996円
 期中一部解約元本額 5,453,076,396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) 1,654,940,660円
 DCニッセイ国内債券インデックス 7,770,497,141円
 ニッセイ日本バランス(成長型)SA (適格機関投資家限定) 2,853,739円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(債券重視型) 4,586,078,792円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) 7,037,661,852円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) 1,785,990,396円
 ニッセイ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) 30,817,567円
 ニッセイインデックスバランス(標準型)SA (適格機関投資家限定) 55,453,617円
 ニッセイインデックスバランス(成長型)SA (適格機関投資家限定) 23,865,298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 6,014,703,816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) 936,112,672円

損益の状況

当期(2019年2月21日~2020年2月20日)

項目	当期
(A)配当等収益	328,373,027円
受取利息	328,628,769
支払利息	△ 255,742
(B)有価証券売買損益	41,275,448
売買益	405,078,370
売買損	△ 363,802,922
(C)信託報酬等	△ 18,088
(D)当期損益金(A+B+C)	369,630,387
(E)前期繰越損益金	9,071,159,756
(F)追加信託差損益金	4,270,495,395
(G)解約差損益金	△ 2,118,610,450
(H)合計(D+E+F+G)	11,592,675,088
次期繰越損益金(H)	11,592,675,088

(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 26 期

(計算期間：2020年5月21日～2020年11月20日)

運用方針

主に日本を除く主要先進国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）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

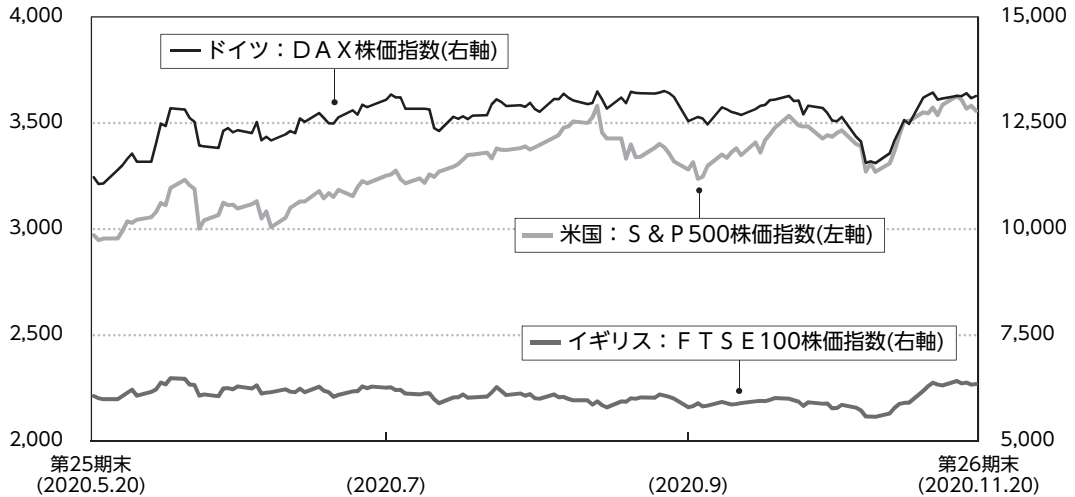
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2020年5月21日～2020年11月20日

海外株式市況

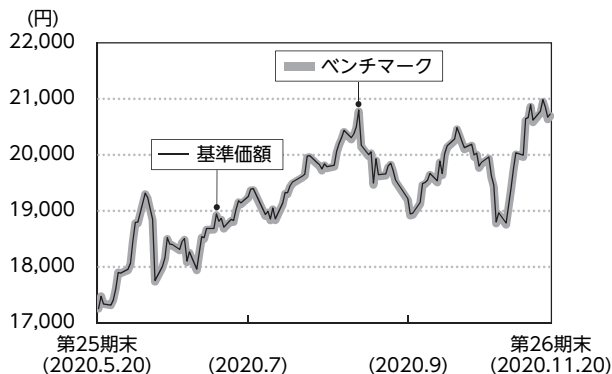
【海外主要株価指数の推移】



(注) 各指数はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の海外株式市場は、期初から8月にかけて新型コロナウイルスのワクチン開発への期待感や経済活動の再開に加え、堅調な経済指標を背景に上昇しました。9月以降は同ウイルスの感染再拡大や米中対立悪化等を受けて下落する場面もありましたが、追加財政刺激策や米大統領選の結果が好感されたこともあり上昇基調で推移し、結局、前期末と比較すると上昇して当期末を迎えました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・新型コロナウイルスのワクチン開発への期待感や経済活動の再開に加え、堅調な経済指標、追加財政刺激策や米大統領選の結果が好感されたことなどをを受けて海外株式市場が上昇基調となったこと

<下落要因>

- ・新型コロナウイルスの感染再拡大や米中対立悪化等を受けて海外株式市場が軟調に推移したこと

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+20.1%となり、ベンチマーク騰落率(+19.9%)にほぼ連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	△	騰落率				
22期(2018年11月20日)	16,899	△ 2.4	16,598	△ 2.5	94.2	3.3	2.4	149,718
23期(2019年5月20日)	17,740	5.0	17,404	4.9	94.7	2.5	2.5	172,115
24期(2019年11月20日)	19,016	7.2	18,631	7.1	94.4	2.9	2.6	211,043
25期(2020年5月20日)	17,256	△ 9.3	16,893	△ 9.3	95.1	2.3	2.4	227,678
26期(2020年11月20日)	20,729	20.1	20,257	19.9	94.9	2.8	2.2	300,923

(注1) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

(注2) 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。以下同じです。

(注3) 先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	△	騰落率			
(期首)2020年5月20日	17,256	-	16,893	-	95.1	2.3	2.4
5月末	17,890	3.7	17,511	3.7	95.3	3.4	2.4
6月末	18,251	5.8	17,845	5.6	94.8	2.7	2.4
7月末	18,858	9.3	18,438	9.1	95.1	2.3	2.4
8月末	20,306	17.7	19,851	17.5	94.2	3.3	2.2
9月末	19,507	13.0	19,068	12.9	95.0	2.6	2.2
10月末	18,966	9.9	18,539	9.7	95.3	2.2	2.2
(期末)2020年11月20日	20,729	20.1	20,257	19.9	94.9	2.8	2.2

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2020年5月21日～2020年11月20日

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託証券)	0円 (0) (0) (0) (0)	0.001% (0.000) (0.000) (0.001) (0.000)	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
有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (投資信託証券)	1 (1) (0) (0)	0.004 (0.004) (0.000) (0.000)	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税：有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用 (保管費用) (その他)	4 (3) (1)	0.021 (0.016) (0.006)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 ・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	5	0.027	

(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（19,355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

2020年5月21日～2020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 20,423 (10,299)	千米ドル 180,640 (△ 122)	百株 6,723	千米ドル 15,911
	カナダ	3,570 (△ 130)	千カナダ・ドル 12,626 (△ 487)	1,965	千カナダ・ドル 1,120
	オーストラリア	7,026 (263)	千オーストラリア・ドル 10,017	5,313	千オーストラリア・ドル 1,674
	香港	5,645 (△ 1,294)	千香港ドル 19,969	3,420	千香港ドル 5,615
	シンガポール	2,635	千シンガポール・ドル 1,192	3,356	千シンガポール・ドル 639
	ニュージーランド	606	千ニュージーランド・ドル 501	495	千ニュージーランド・ドル 171
	イギリス	17,518 (4,193)	千イギリス・ポンド 9,148 (280)	13,455	千イギリス・ポンド 1,803
	イスラエル	239	千イスラエル・シケル 828	4	千イスラエル・シケル 10
	スイス	1,174 (0.21)	千スイス・フラン 8,893 (△ 49)	210	千スイス・フラン 439
	デンマーク	420	千デンマーク・クローネ 16,823	114	千デンマーク・クローネ 2,958
	ノルウェー	479	千ノルウェー・クローネ 6,383	70	千ノルウェー・クローネ 1,076
	スウェーデン	2,266 (144)	千スウェーデン・クローナ 38,237	419	千スウェーデン・クローナ 2,898

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

		買付		売付		
		株数	金額	株数	金額	
外国	ユーロ	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ	
		アイルランド	120	1,054	1,001	140
		オランダ	1,185 (10)	4,020	47	190
		ベルギー	188	1,679	1	13
		ルクセンブルグ	100	87	1	0.910
		フランス	1,641 (197)	7,506 (△ 2)	202	743
		ドイツ	1,842 (236)	8,281 (△ 220)	149	238
		ポルトガル	328 (1,552)	166	1,552	14
		スペイン	2,772 (10,668)	1,927 (△ 4)	4,251	394
		イタリア	4,075	2,162	564	30
		フィンランド	538 (265)	741	398	336
		オーストリア	47	111	11	24
		その他	11	86	-	-

(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) 新株予約権証券

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	アメリカ	証券	千米ドル	証券	千米ドル
		6,624	41	6,624	28

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(3) 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	0.807	68	0.342	30
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2	385	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	219	—	—
PROLOGIS INC	4	411	—	—
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	7	54	0.483	3
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.870	132	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.640	58	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.958	33	0.060	1
DUKE REALTY CORP	2	87	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	2	122	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.319	68	0.006	1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.385	29	0.186	14
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5	144	—	—
WELLTOWER INC	3	162	—	—
HOST HOTELS AND RESORTS INC	3	41	—	—
KIMCO REALTY CORP	—	—	24	282
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.640	73	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	1	53	—	—
PUBLIC STORAGE	0.850	176	—	—
REGENCY CENTERS CORP	1	44	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1	107	—	—
SL GREEN REALTY CORP	—	—	4	199
SUN COMMUNITIES INC	0.866	124	—	—
UDR INC	1	61	—	—
VENTAS INC	2	79	—	—
VORNADO REALTY TRUST	1	35	0.433	16
WP CAREY INC	0.976	64	—	—
REALTY INCOME CORP	2	171	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.894	55	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.645	66	0.012	1
DIGITAL REALTY TRUST INC	4	722	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4	80	—	—
IRON MOUNTAIN INC	1	45	—	—
AGNC INVESTMENT CORP	4	56	0.054	0.707
AMERICAN TOWER REIT INC	2	616	—	—
EQUINIX INC	0.674	509	—	—

外国

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	買付		売付	
	□数	金額	□数	金額
(アメリカ)	千□	千米ドル	千□	千米ドル
VEREIT	5	37	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.551	165	—	—
INVITATION HOMES INC	2	79	0.035	0.917
VICI PROPERTIES INC	2	50	—	—
(カナダ)		千カナダ・ドル		千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.570	11	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.605	28	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	—	—	8	87
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1	17	0.724	10
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	0.856	11	0.254	3
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル		千オーストラリア・ドル
DEXUS	8	74	—	—
GPT GROUP	11	45	2	10
GOODMAN GROUP	10	170	0.757	13
STOCKLAND	11	43	4	15
MIRVAC GROUP	27	61	—	—
VICINITY CENTRES	63	90	17	27
SCENTRE GROUP	25	57	11	26
(香港)		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	12	782	1	91
(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	24	76	1	3
		(△ 4)		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	12	21	—	—
	(△ 166)			
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	16	31	—	—
	(120)	(△ 43)		
SUNTEC REIT	10	15	1	2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	168	323	1	2
		(△ 1)		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	13	26	0.100	0.196
		(△0.753)		
(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	20	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	4	25	—	—
SEGRO PLC	13	122	—	—

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
KLEPIERRE	0.982	14 (△ 9)	0.019	0.335
外国 GECINA SA	0.247	27	0.003	0.345
COVIVIO	0.510	31	0.026	1
ICADE	0.226	12	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.807	34	0.068	3

(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。

(4) 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 43,170	百万円 41,565	百万円 —	百万円 —

(注1) 外貨建取引の金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）における国内の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

主要な売買銘柄

2020年5月21日～2020年11月20日

(1) 株式

銘柄	買付			銘柄	売付		
	株数	金額	平均単価		株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC	52	887,251	16,901	BANK OF AMERICA CORP	36	97,066	2,673
MICROSOFT CORP	37	827,954	21,886	ORACLE CORP	12	73,850	6,005
AMAZON.COM INC	2	799,330	317,446	APPLE INC	2	70,868	34,219
FACEBOOK INC-A	13	361,934	27,153	INGENICO GROUP	3	61,963	16,153
ALPHABET INC-CL A	1	309,285	159,015	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	2	49,579	16,909
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	12	252,470	20,767	ALPHABET INC-CL C	0.311	48,547	156,100
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	10	244,535	24,334	WABCO HOLDINGS INC	2	43,678	14,706
NVIDIA CORP	5	241,409	44,888	POLARIS INC	3	32,006	9,551
JOHNSON & JOHNSON	14	230,032	15,470	FLEX LTD	29	31,254	1,067
SALESFORCE.COM INC	8	224,511	25,382	GRUBHUB INC	5	29,777	5,680

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 新株予約権証券

買付				売付			
銘柄	証券数	金額	平均単価	銘柄	証券数	金額	平均単価
	証券	千円	円		証券	千円	円
OCCIDENTAL PETROLEUM-CW27-WI	6,624	4,305	649	OCCIDENTAL PETROLEUM-CW27-WI	6,624	3,000	453

(注1) 金額は受渡代金です。

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

組入有価証券明細表

2020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	330	363	6,237	647,934	資本財
ABBOTT LABORATORIES	1,018	1,117	12,403	1,288,461	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	1,015	1,116	11,124	1,155,609	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	25	28	765	79,525	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC	365	401	9,773	1,015,268	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	442	486	3,690	383,361	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	22	-	-	-	資本財
ADOBE INC	278	304	14,184	1,473,481	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	39	43	636	66,101	小売
ADVANCED MICRO DEVICES INC	609	739	6,327	657,298	半導体・半導体製造装置
AERCAP HOLDINGS NV	69	81	318	33,034	資本財
AES CORP	382	424	885	92,007	公益事業
AFLAC INC	420	427	1,870	194,313	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	177	195	2,123	220,622	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	127	139	3,769	391,589	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	92	102	1,035	107,568	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	61	67	842	87,569	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	126	138	1,694	176,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	43	47	2,081	216,216	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	8	8	528	54,917	保険
ALLEGION PLC	53	58	672	69,818	資本財
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	25	-	-	-	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	141	157	828	86,113	公益事業
ALLSTATE CORP	185	196	1,975	205,213	保険
ALLY FINANCIAL INC	218	236	708	73,572	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	64	72	901	93,695	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ALPHABET INC-CL A	168	187	33,054	3,433,658	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	181	192	33,960	3,527,842	メディア・娯楽
ALTICE USA INC- A	81	196	625	64,990	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	1,076	1,175	4,709	489,188	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	242	267	83,461	8,669,962	小売
AMCOR PLC	941	1,001	1,193	123,959	素材
AMERCO	5	6	269	28,022	運輸
AMEREN CORPORATION	141	155	1,221	126,919	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	61	-	-	-	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	285	313	2,584	268,518	公益事業
AMERICAN EXPRESS CO	400	433	4,942	513,473	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	43	47	426	44,332	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	502	543	2,096	217,788	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	104	114	1,792	186,225	公益事業
AMERIPRISE FINANCIAL INC	72	76	1,408	146,270	各種金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	89	96	982	102,011	ヘルスケア機器・サービス
AMERITRADE HOLDING CORP	154	-	-	-	各種金融
AMETEK INC	130	144	1,710	177,715	資本財
AMGEN INC	342	371	8,347	867,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	170	187	2,381	247,344	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES INC	212	233	3,175	329,869	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	48	53	1,747	181,580	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	145	159	4,960	515,306	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	134	145	2,961	307,631	保険
APACHE CORP	215	-	-	-	エネルギー
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	-	109	488	50,724	各種金融
APPLE INC	2,557	10,949	129,907	13,494,788	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	531	577	4,461	463,468	半導体・半導体製造装置
APTIV PLC	147	169	1,958	203,457	自動車・自動車部品
ARAMARK	144	144	510	52,982	消費者サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	231	254	886	92,136	保険
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	319	350	1,712	177,924	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	30	35	976	101,421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	45	49	437	45,430	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	107	119	1,390	144,421	保険
ASSURANT INC	34	37	506	52,642	保険
AT&T INC	4,208	4,504	12,738	1,323,281	電気通信サービス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	80	77	333	34,593	保険
ATMOS ENERGY CORP	68	76	731	75,979	公益事業
AUTODESK INC	126	138	3,555	369,316	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	48	53	476	49,470	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	249	271	4,719	490,219	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	13	14	1,670	173,482	小売
AVALARA INC	-	50	823	85,531	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	-	292	776	80,680	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVERY DENNISON CORP	48	52	774	80,460	素材
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	122	135	382	39,758	素材
BAKER HUGHES COMPANY	375	417	763	79,351	エネルギー
BALL CORP	179	206	2,022	210,110	素材
BANK OF AMERICA CORP	4,915	4,928	13,296	1,381,240	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	477	502	1,934	200,940	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	278	321	2,533	263,168	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	155	183	4,264	442,985	ヘルスケア機器・サービス
BEIGENE LTD-ADR	22	25	722	75,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	756	877	20,151	2,093,322	各種金融
BEST BUY CO INC	135	146	1,740	180,791	小売
BIOGEN INC	103	102	2,506	260,372	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	103	113	856	88,932	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	12	13	794	82,578	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	86	94	888	92,314	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	66	96	6,473	672,466	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	379	423	2,484	258,134	各種金融
BOEING CO	307	338	6,971	724,230	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	24	25	5,192	539,378	小売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	81	87	769	79,931	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	118	130	493	51,269	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	802	902	3,087	320,710	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,349	1,429	8,877	922,208	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	228	252	9,715	1,009,243	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	66	72	1,064	110,576	ソフトウェア・サービス
BROWN & BROWN INC	137	150	715	74,325	保険
BROWN-FORMAN CORP -CL B	177	195	1,563	162,419	食品・飲料・タバコ
BUNGE LIMITED	82	91	536	55,711	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	38	41	974	101,187	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	81	86	815	84,677	運輸
CABLE ONE INC	–	3	609	63,288	メディア・娯楽
CABOT OIL & GAS CORP	235	249	427	44,443	エネルギー
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	160	175	1,970	204,707	ソフトウェア・サービス
CAMPBELL SOUP CO	96	114	565	58,785	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	267	288	2,449	254,480	各種金融
CAPRI HOLDINGS LIMITED	86	–	–	–	耐久消費財・アパレル
CARDINAL HEALTH INC	169	185	971	100,880	ヘルスケア機器・サービス
CARLYLE GROUP INC/THE	–	89	248	25,817	各種金融
CARMAX INC	95	103	975	101,369	小売
CARNIVAL CORP	241	301	548	57,027	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	472	520	2,034	211,395	資本財
CATALENT INC	–	98	1,025	106,556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	317	342	5,914	614,368	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	64	69	622	64,706	各種金融
CBRE GROUP INC	182	212	1,242	129,075	不動産
CDK GLOBAL INC	70	77	369	38,396	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	82	90	1,197	124,428	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELANESE CORP-SERIES A	69	74	999	103,826	素材
CENTENE CORP	336	365	2,328	241,839	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	289	321	753	78,318	公益事業
CENTURYLINK INC	570	597	587	60,987	電気通信サービス
CERNER CORP	180	190	1,390	144,438	ヘルスケア機器・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	126	135	436	45,363	素材
CHARLES SCHWAB CORP	663	915	4,310	447,760	各種金融
CHARTER COMMUNICATIONS-CL A	86	91	5,949	618,001	メディア・娯楽
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	69	71	855	88,829	ソフトウェア・サービス
CHENIERE ENERGY INC	133	143	793	82,418	エネルギー
CHEVRON CORP	1,088	1,178	10,106	1,049,876	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	15	16	2,189	227,474	消費者サービス
CHUBB LTD	260	284	4,198	436,178	保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	141	155	1,340	139,259	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	214	232	4,767	495,255	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	88	97	760	78,956	保険
CINTAS CORP	50	55	2,055	213,553	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	2,440	2,665	10,974	1,140,080	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CITIGROUP INC	1,255	1,314	6,854	712,021	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	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	249	269	883	91,771	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	74	73	890	92,486	ソフトウェア・サービス
CLOROX CO	72	79	1,612	167,482	家庭用品・パーソナル用品
CME GROUP INC	206	226	3,759	390,568	各種金融
CMS ENERGY CORP	166	182	1,103	114,653	公益事業
COCA-COLA CO	2,344	2,578	13,698	1,422,956	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	132	130	556	57,796	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	97	107	770	80,044	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP	314	340	2,595	269,591	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	469	514	4,394	456,457	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP	2,615	2,876	14,233	1,478,593	メディア・娯楽
COMERICA INC	82	88	451	46,895	銀行
CONAGRA BRANDS INC	280	307	1,112	115,575	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	115	123	705	73,303	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	629	674	2,662	276,550	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	191	211	1,627	169,033	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	96	106	2,166	225,009	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	49	-	-	-	エネルギー
COOPER COS INC/THE	28	33	1,116	116,029	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	120	133	1,515	157,386	商業・専門サービス
CORNING INC	442	480	1,746	181,474	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	431	471	1,743	181,085	素材
COSTAR GROUP INC	21	24	2,222	230,879	商業・専門サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	254	278	10,688	1,110,280	食品・生活必需品小売り
COTY INC-CL A	178	-	-	-	家庭用品・パーソナル用品
COUPA SOFTWARE INC	-	42	1,324	137,573	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	-	90	1,295	134,568	ソフトウェア・サービス
CROWN HOLDINGS INC	78	85	824	85,638	素材
CSX CORP	429	488	4,476	465,049	運輸
CUMMINS INC	83	92	2,166	225,039	資本財
CVS HEALTH CORP	748	825	5,453	566,504	ヘルスケア機器・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	21	24	268	27,936	ソフトウェア・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	203	228	99	10,302	食品・生活必需品小売り
DANAHER CORP	360	402	9,097	945,007	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	70	81	899	93,438	消費者サービス
DATADOG INC - CLASS A	-	83	740	76,955	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	52	53	576	59,872	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	
DEERE & CO	172	188	4,805	499,152	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	93	152	1,044	108,465	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	92	101	383	39,837	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	128	138	676	70,311	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	220	-	-	-	エネルギー
DEXCOM INC	52	58	1,929	200,414	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	87	98	389	40,478	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	180	195	1,496	155,505	各種金融
DISCOVERY INC-A	89	96	241	25,096	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	211	207	468	48,620	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP	146	154	523	54,369	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	61	109	2,414	250,864	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	147	158	3,357	348,809	小売
DOLLAR TREE INC	136	149	1,415	147,072	小売
DOMINION ENERGY INC	475	530	4,233	439,751	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	22	24	949	98,634	消費者サービス
DOVER CORP	83	91	1,136	118,016	資本財
DOW INC	428	469	2,597	269,827	素材
DR HORTON INC	202	218	1,638	170,179	耐久消費財・アパレル
DROPBOX INC-CLASS A	139	157	297	30,858	ソフトウェア・サービス
DTE ENERGY COMPANY	111	122	1,587	164,928	公益事業
DUKE ENERGY CORP	422	465	4,266	443,197	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	425	464	2,879	299,102	素材
DXC TECHNOLOGY CO	146	-	-	-	ソフトウェア・サービス
DYNATRACE INC	-	115	415	43,190	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL	128	-	-	-	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	81	87	379	39,421	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	77	85	828	86,058	素材
EATON CORP PLC	238	252	2,986	310,230	資本財
EATON VANCE CORP	63	-	-	-	各種金融
EBAY INC	444	442	2,203	228,859	小売
ECOLAB INC	149	161	3,395	352,773	素材
EDISON INTERNATIONAL	206	239	1,525	158,440	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	119	390	3,329	345,918	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	228	252	744	77,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	167	181	2,183	226,851	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	497	544	7,804	810,747	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
EMERSON ELECTRIC CO	349	377	2,914	302,757	資本財
ENTERGY CORP	115	127	1,388	144,248	公益事業
EOG RESOURCES INC	333	365	1,659	172,437	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	31	35	1,175	122,063	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	70	76	1,336	138,812	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	238	255	632	65,679	各種金融
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	14	16	386	40,117	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	125	148	637	66,237	公益事業
ESTEE LAUDER COS INC	127	141	3,434	356,804	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	23	24	584	60,677	保険
EVERGY INC	132	144	775	80,575	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	187	213	1,878	195,142	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	84	95	1,076	111,833	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORP	558	616	2,609	271,068	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	80	85	1,063	110,497	小売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASHINGTON INC	103	105	955	99,222	運輸
EXXON MOBIL CORP	2,434	2,670	9,987	1,037,519	エネルギー
F5 NETWORKS INC	34	37	608	63,204	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	1,385	1,518	41,444	4,305,234	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	21	23	754	78,346	各種金融
FAIR ISAAC CORP	-	18	880	91,463	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	329	359	1,726	179,394	資本財
FEDEX CORP	143	157	4,416	458,737	運輸
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	158	174	622	64,665	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	354	390	5,771	599,546	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	407	450	1,165	121,123	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	97	108	1,431	148,704	銀行
FIRSTENERGY CORP	311	346	1,005	104,485	公益事業
FISERV INC	333	359	4,068	422,611	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	50	52	1,376	142,976	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	292	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLIR SYSTEMS INC	76	82	308	32,066	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLOWSERVE CORP	74	-	-	-	資本財
FMC CORP	74	81	945	98,207	素材
FORD MOTOR CO	2,250	2,475	2,183	226,784	自動車・自動車部品
FORTINET INC	83	86	1,014	105,414	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	173	191	1,367	142,059	資本財

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	80	87	743	77,192	資本財
FOX CORP - CLASS A	202	208	578	60,117	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	100	115	314	32,721	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	166	183	383	39,813	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	835	915	1,933	200,857	素材
GAP INC	125	-	-	-	小売
GARMIN LTD	76	90	1,030	107,065	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	51	57	868	90,177	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	141	154	2,312	240,211	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	5,030	5,528	5,340	554,770	資本財
GENERAL MILLS INC	348	382	2,371	246,351	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	740	814	3,486	362,163	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	83	91	898	93,362	小売
GILEAD SCIENCES INC	727	792	4,803	498,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	173	189	3,606	374,647	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	57	62	585	60,869	保険
GODADDY INC - CLASS A	99	105	802	83,370	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	183	206	4,629	480,866	各種金融
GRUBHUB INC	52	-	-	-	小売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	47	52	621	64,571	ソフトウェア・サービス
HALLIBURTON CO	502	553	886	92,069	エネルギー
HANESBRANDS INC	208	-	-	-	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	89	-	-	-	自動車・自動車部品
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	205	224	1,036	107,639	保険
HASBRO INC	75	82	759	78,888	耐久消費財・アパレル
HCA HEALTHCARE INC	155	170	2,573	267,350	ヘルスケア機器・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	93	101	566	58,828	資本財
HEICO CORP	24	27	365	37,918	資本財
HEICO CORP-CLASS A	43	45	535	55,650	資本財
HENRY SCHEIN INC	84	88	565	58,694	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	85	93	1,393	144,767	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	157	174	821	85,343	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	739	806	845	87,845	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	153	174	1,797	186,773	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	86	-	-	-	エネルギー
HOLOGIC INC	154	162	1,139	118,405	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	627	679	18,407	1,912,173	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	411	443	8,989	933,799	資本財
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	686	777	327	34,061	不動産
HORMEL FOODS CORP	168	185	926	96,225	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	223	247	583	60,638	資本財
HP INC	851	902	1,850	192,246	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUMANA INC	76	83	3,395	352,755	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON BANCSHARES INC	594	645	770	80,089	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	23	25	412	42,867	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	45	-	-	-	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	-	50	696	72,379	メディア・娯楽
IDEX CORP	43	47	932	96,828	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	49	53	2,452	254,751	ヘルスケア機器・サービス
IHS MARKIT LTD	219	240	2,224	231,093	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	185	199	4,133	429,383	資本財
ILLUMINA INC	84	92	2,776	288,455	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	105	116	951	98,886	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	119	223	989	102,757	資本財
INGREDION INC	38	41	318	33,046	食品・飲料・タバコ
INSULET CORP	35	41	1,097	113,969	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	2,503	2,673	12,194	1,266,745	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	321	345	3,486	362,146	各種金融
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	509	561	6,577	683,251	ソフトウェア・サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	58	54	607	63,089	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	214	236	1,162	120,777	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	226	251	543	56,439	メディア・娯楽
INTUIT INC	149	164	5,943	617,450	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	66	73	5,401	561,070	ヘルスケア機器・サービス
INVESCO LTD	221	244	390	40,571	各種金融
IONIS PHARMACEUTICALS INC	77	83	423	44,001	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IPG PHOTONICS CORP	21	23	468	48,691	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IQVIA HOLDINGS INC	95	121	2,056	213,608	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	44	48	778	80,856	ソフトウェア・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	76	82	867	90,092	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	128	140	717	74,490	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	129	142	347	36,095	資本財
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	32	34	494	51,366	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	52	55	739	76,822	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	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	145	-	-	-	各種金融
JM SMUCKER CO	65	71	838	87,108	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	1,515	1,663	24,479	2,542,979	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	446	472	2,159	224,340	資本財
JONES LANG LASALLE INC	29	32	439	45,610	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	1,805	1,923	22,231	2,309,425	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	190	208	456	47,412	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	59	61	1,154	119,958	運輸
KELLOGG CO	147	162	1,059	110,050	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	-	225	669	69,564	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	566	619	967	100,549	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	107	117	1,387	144,127	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	197	215	3,054	317,271	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	1,176	1,288	1,855	192,746	エネルギー
KKR & CO INC -A	284	318	1,224	127,213	各種金融
KLA CORPORATION	90	97	2,387	248,016	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	78	84	353	36,736	運輸
KOHL'S CORP	91	-	-	-	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	386	424	1,352	140,455	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	460	494	1,620	168,341	食品・生活必需品小売り
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	127	136	2,670	277,376	資本財
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	55	61	1,220	126,738	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	83	91	4,010	416,561	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDING INC	84	92	665	69,164	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	198	217	1,272	132,212	消費者サービス
LEAR CORP	32	35	504	52,367	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	76	-	-	-	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	77	85	859	89,254	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	161	173	1,326	137,825	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	20	22	656	68,220	資本財
LIBERTY BROADBAND-A	-	15	237	24,648	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	61	69	1,093	113,621	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-A	90	125	288	30,017	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	246	225	504	52,361	電気通信サービス
LIBERTY MEDIA CORP - RIGHT	13	-	-	-	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	50	53	230	23,948	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	94	112	481	50,061	メディア・娯楽

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	
LIBERTY MEDIA GROUP-C	117	130	535	55,607	メディア・娯楽
LINCOLN NATIONAL CORP	111	119	535	55,593	保険
LINDE PLC	309	332	8,403	873,002	素材
LIVE NATION INC	87	103	692	71,938	メディア・娯楽
LKQ CORP	175	182	643	66,810	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	146	159	6,000	623,360	資本財
LOEWS CORP	153	159	684	71,054	保険
LOWE'S COS INC	442	476	7,135	741,186	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	63	78	2,695	279,968	耐久消費財・アパレル
LYONDELLBASELL INDU-CL A	152	169	1,391	144,531	素材
M&T BANK CORP	72	80	964	100,144	銀行
MANPOWER GROUP	32	-	-	-	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	452	-	-	-	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	373	412	1,610	167,325	エネルギー
MARKEL CORP	7	8	875	90,918	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	21	23	1,274	132,355	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL INC	159	174	2,109	219,121	消費者サービス
MARSH & MCLENNAN COS INC	290	322	3,695	383,939	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	36	39	1,059	110,015	素材
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	365	420	1,856	192,879	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	163	166	919	95,566	資本財
MASIMO CORPORATION	-	32	797	82,801	ヘルスケア機器・サービス
MASTERCARD INC-CLASS A	516	564	18,847	1,957,881	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	32	155	2,056	213,628	メディア・娯楽
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	155	168	1,367	142,053	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	71	78	1,433	148,929	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	433	469	10,108	1,050,088	消費者サービス
MCKESSON CORP	103	102	1,754	182,290	ヘルスケア機器・サービス
MEDTRONIC PLC	771	846	9,401	976,579	ヘルスケア機器・サービス
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED-ADR	125	136	256	26,601	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	25	28	3,872	402,271	小売
MERCK & CO INC	1,465	1,594	12,816	1,331,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	446	483	2,201	228,729	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	13	15	1,733	180,089	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM MIRAGE	278	294	801	83,226	消費者サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	137	155	1,982	205,931	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	637	701	4,335	450,412	半導体・半導体製造装置

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	
MICROSOFT CORP	4,171	4,549	96,648	10,039,895	ソフトウェア・サービス
MIDDLEBY CORP	32	-	-	-	資本財
MODERNA INC	-	171	1,595	165,745	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOHAWK INDUSTRIES INC	35	38	488	50,744	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	-	37	780	81,073	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	109	119	526	54,688	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	828	901	5,190	539,196	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	27	30	777	80,721	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	231	248	2,078	215,872	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	97	106	2,922	303,606	各種金融
MORGAN STANLEY	697	890	5,218	542,053	各種金融
MOSAIC CO/THE	207	228	447	46,527	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	99	107	1,821	189,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	48	53	2,153	223,658	各種金融
MYLAN NV	295	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	66	71	897	93,247	各種金融
NATIONAL-OILWELL INC	219	245	301	31,339	エネルギー
NETAPP INC	130	139	725	75,325	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	252	277	13,464	1,398,654	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	50	55	486	50,517	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWELL BRANDS INC	233	256	522	54,310	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	471	506	3,108	322,944	素材
NEWS CORP - CLASS A	225	246	432	44,877	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	281	1,237	9,293	965,448	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	206	227	364	37,910	商業・専門サービス
NIKE INC	717	783	10,338	1,073,971	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	215	247	584	60,668	公益事業
NOBLE ENERGY INC	274	-	-	-	エネルギー
NORDSON CORP	-	34	699	72,694	資本財
NORDSTROM INC	62	-	-	-	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	152	163	3,956	410,990	運輸
NORTHERN TRUST CORP	115	124	1,165	121,063	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	92	99	3,094	321,455	資本財
NORTONLIFELOCK INC	357	352	658	68,423	ソフトウェア・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	121	-	-	-	消費者サービス
NRG ENERGY INC	143	152	471	48,929	公益事業
NUCOR CORP	172	189	998	103,722	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
NVIDIA CORP	334	388	20,880	2,169,094	半導体・半導体製造装置
NVR INC	2	2	931	96,777	耐久消費財・アパレル
NXP SEMICONDUCTORS NV	161	176	2,668	277,214	半導体・半導体製造装置
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	514	569	761	79,073	エネルギー
OGE ENERGY CORP	114	128	431	44,791	公益事業
OKTA INC	61	73	1,708	177,528	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	56	60	1,250	129,938	運輸
OMNICOM GROUP	126	136	813	84,459	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	236	260	724	75,248	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	238	278	928	96,497	エネルギー
ORACLE CORP	1,321	1,294	7,307	759,109	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	43	46	2,114	219,634	小売
OTIS WORLDWIDE CORP	236	260	1,721	178,800	資本財
OWENS CORNING	62	68	497	51,651	資本財
PACCAR INC	199	218	1,968	204,520	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	54	59	775	80,591	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	56	61	1,755	182,311	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	73	81	2,179	226,377	資本財
PAYCHEX INC	185	204	1,879	195,236	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	28	31	1,236	128,398	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	642	704	13,447	1,396,973	ソフトウェア・サービス
PELTON INTERACTIVE INC-A	-	123	1,302	135,291	耐久消費財・アパレル
PENTAIR PLC	90	104	554	57,616	資本財
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	254	263	339	35,250	銀行
PEPSICO INC	802	876	12,562	1,305,029	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	63	70	922	95,826	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PERRIGO CO PLC	74	85	419	43,574	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	3,185	3,508	12,695	1,318,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PG&E CORP	-	676	830	86,309	公益事業
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	895	984	7,627	792,371	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	254	275	1,691	175,742	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	64	71	597	62,021	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	168	254	1,680	174,519	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	95	102	994	103,340	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	252	268	3,492	362,807	銀行
POLARIS INC	33	-	-	-	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	136	149	2,134	221,722	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PPL CORPORATION	417	487	1,426	148,167	公益事業
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	158	172	843	87,597	保険
PROCTER & GAMBLE CO	1,436	1,563	21,818	2,266,500	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	336	369	3,479	361,470	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	230	250	1,894	196,826	保険
PTC INC	63	69	694	72,192	ソフトウェア・サービス
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	290	320	1,844	191,597	公益事業
PULTE GROUP INC	149	169	739	76,863	耐久消費財・アパレル
PVH CORP	42	-	-	-	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	67	72	1,059	110,085	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	657	710	10,482	1,088,916	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	77	84	1,036	107,686	ヘルスケア機器・サービス
RALPH LAUREN CORP	28	30	244	25,349	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	70	76	686	71,265	各種金融
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	846	956	6,803	706,779	資本財
REGENERON PHARMACEUTICALS	46	63	3,273	340,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	549	603	932	96,906	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	35	42	499	51,921	保険
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	25	31	551	57,330	保険
REPUBLIC SERVICES INC	129	141	1,418	147,356	商業・専門サービス
RESMED INC	83	91	1,932	200,728	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	43	46	1,373	142,705	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	64	71	445	46,300	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	66	73	1,834	190,544	資本財
ROKU INC	52	64	1,647	171,172	メディア・娯楽
ROLLINS INC	84	92	545	56,672	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	59	65	2,699	280,445	資本財
ROSS STORES INC	207	224	2,473	256,986	小売
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	102	112	836	86,893	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC	75	82	733	76,178	素材
S&P GLOBAL INC	140	152	5,151	535,110	各種金融
SABRE CORP	159	-	-	-	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	479	568	15,035	1,561,839	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	43	47	633	65,810	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHLUMBERGER LTD	799	878	1,796	186,670	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY	136	145	815	84,752	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEAGEN INC	69	76	1,336	138,876	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
SEALED AIR CORP	89	98	442	45,984	素材
SEI INVESTMENTS COMPANY	71	76	414	43,007	各種金融
SEMPRA ENERGY	162	185	2,411	250,474	公益事業
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	91	100	479	49,758	資本財
SERVICENOW INC	108	120	6,191	643,173	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	47	51	3,769	391,598	素材
SIGNATURE BANK	31	33	351	36,520	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	907	704	451	46,940	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	98	105	1,463	152,034	半導体・半導体製造装置
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	-	242	671	69,762	ソフトウェア・サービス
SMITH (A.O.) CORP	78	85	482	50,170	資本財
SNAP INC - A	428	564	2,386	247,879	メディア・娯楽
SNAP-ON INC	31	32	552	57,421	資本財
SOUTHERN CO	605	669	4,087	424,638	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	74	91	419	43,598	運輸
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	59	-	-	-	資本財
SPLUNK INC	89	100	2,002	208,005	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	200	229	4,396	456,667	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	131	146	1,005	104,418	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	87	97	1,817	188,825	資本財
STARBUCKS CORP	679	737	7,213	749,339	消費者サービス
STATE STREET CORP	208	221	1,534	159,443	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	121	131	470	48,886	素材
STERIS PLC	48	53	1,042	108,303	ヘルスケア機器・サービス
STRYKER CORP	193	213	4,988	518,166	ヘルスケア機器・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	29	32	1,140	118,487	銀行
SYNCHRONY FINANCIAL	334	332	1,000	103,899	各種金融
SYNOPSIS INC	86	94	2,097	217,935	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	279	305	2,196	228,156	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	133	142	1,983	206,081	各種金融
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	65	71	1,189	123,568	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	158	-	-	-	耐久消費財・アパレル
TARGA RESOURCES CORP	134	-	-	-	エネルギー
TARGET CORP	291	315	5,409	561,935	小売
TE CONNECTIVITY LTD	192	208	2,319	240,908	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TECHNIPFMC PLC	247	-	-	-	エネルギー
TELADOC HEALTH INC	-	44	855	88,857	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	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	20	23	905	94,025	資本財
TELEFLEX INC	26	29	1,095	113,771	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	96	103	1,106	114,914	半導体・半導体製造装置
TESLA, INC.	77	468	23,396	2,430,406	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	628	692	647	67,215	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	538	579	9,113	946,708	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	129	142	648	67,354	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	230	249	11,303	1,174,159	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	62	68	905	94,085	小売
TJX COS INC	694	756	4,659	484,071	小売
T-MOBILE US INC	247	352	4,550	472,715	電気通信サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	68	72	957	99,420	小売
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	-	25	2,084	216,497	ソフトウェア・サービス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	-	52	309	32,168	各種金融
TRANE TECHNOLOGIES PLC	135	151	2,224	231,030	資本財
TRANSDIGM GROUP INC	27	32	1,924	199,900	資本財
TRANSUNION	108	120	1,162	120,769	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	148	159	2,129	221,223	保険
TRIMBLE INC	142	157	911	94,720	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	59	-	-	-	メディア・娯楽
TRUIST FINANCIAL CORP	772	853	4,000	415,613	銀行
TWILIO INC - A	68	77	2,285	237,427	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	424	496	2,163	224,763	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	22	25	1,036	107,700	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	169	185	1,158	120,328	食品・飲料・タバコ
UBER TECHNOLOGIES INC	249	605	2,983	309,929	運輸
UGI CORP	121	133	479	49,845	公益事業
ULTA BEAUTY INC	32	33	927	96,364	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	108	-	-	-	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C-W/I	113	-	-	-	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	402	431	8,820	916,305	運輸
UNITED AIRLINES HOLDINGS, INC.	34	-	-	-	運輸
UNITED PARCEL SERVICE INC	405	445	7,417	770,566	運輸
UNITED RENTALS INC	42	45	984	102,272	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	545	598	20,180	2,096,357	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	45	48	652	67,792	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	112	-	-	-	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	
US BANCORP	854	856	3,705	384,904	銀行
VAIL RESORTS INC	23	25	703	73,129	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	236	257	1,317	136,891	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	52	57	993	103,199	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	75	85	2,320	241,013	ヘルスケア機器・サービス
VERISIGN INC	60	65	1,299	134,997	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	89	97	2,005	208,380	商業・専門サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,383	2,617	15,759	1,637,089	電気通信サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	148	163	3,462	359,709	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VF CORP	195	209	1,780	184,994	耐久消費財・アパレル
VIACOMCBS INC	325	356	1,193	123,947	メディア・娯楽
VIATRIS INC	-	759	1,375	142,844	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VISA INC-CLASS A SHARES	985	1,065	22,115	2,297,406	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	211	278	515	53,542	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	47	52	787	81,796	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	77	80	461	47,919	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	76	83	1,172	121,807	素材
WABCO HOLDINGS INC	29	-	-	-	資本財
WABTEC CORP	105	114	829	86,167	資本財
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	435	468	1,773	184,266	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	818	894	13,605	1,413,303	食品・生活必需品小売り
WALT DISNEY CO	1,037	1,141	16,173	1,680,104	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	152	167	1,770	183,943	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	245	267	3,224	334,966	商業・専門サービス
WATERS CORP	36	39	884	91,866	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	36	40	1,010	105,007	小売
WEC ENERGY GROUP INC	183	199	1,905	197,938	公益事業
WELLS FARGO & CO	2,313	2,459	6,433	668,306	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	42	46	1,302	135,286	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	171	189	808	83,945	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	242	259	559	58,120	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	22	-	-	-	素材
WESTROCK CO-WHEN ISSUED	148	162	693	72,013	素材
WEYERHAEUSER CO	427	470	1,365	141,800	不動産
WHIRLPOOL CORP	36	39	756	78,552	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	702	767	1,547	160,796	エネルギー
WILLIS TOWERS WATSON PLC	74	81	1,662	172,700	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	
WIX.COM LTD	28	32	842	87,468	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	94	109	2,538	263,682	ソフトウェア・サービス
WR BERKLEY CORP	84	89	600	62,349	保険
WW GRAINGER INC	26	28	1,207	125,410	資本財
WYNN RESORTS LTD	55	61	608	63,220	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	302	332	2,303	239,312	公益事業
XEROX HOLDINGS CORP	111	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XILINX INC	144	153	2,040	211,998	半導体・半導体製造装置
XPO LOGISTICS INC	54	58	622	64,681	運輸
XYLEM INC	103	113	1,074	111,599	資本財
YUM! BRANDS INC	174	189	1,996	207,434	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	30	33	1,198	124,458	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC - C W/I	74	88	969	100,681	メディア・娯楽
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	118	130	1,914	198,854	ヘルスケア機器・サービス
ZIONS BANCORP, N.A.	95	100	385	40,043	銀行
ZOETIS INC	274	300	4,996	518,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	-	100	4,163	432,473	ソフトウェア・サービス
ZSCALER INC	-	45	628	65,251	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	173,094 609	197,094 590	1,971,641 -	204,814,075 <68.1%>
(カナダ)			千カナダ・ドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD	138	152	1,341	106,543	素材
AIR CANADA	76	91	199	15,811	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	311	383	771	61,293	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	500	542	2,345	186,269	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	163	178	321	25,520	公益事業
ATCO LTD -CL 'I'	45	49	186	14,834	公益事業
AURORA CANNABIS INC	53	-	-	-	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B2GOLD CORP	-	645	478	38,017	素材
BANK OF MONTREAL	368	404	3,733	296,560	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	702	766	4,827	383,422	銀行
BARRICK GOLD CORP	1,023	1,122	3,542	281,381	素材
BAUSCH HEALTH COMPANIES INC	182	204	523	41,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	94	106	604	48,033	電気通信サービス
BLACKBERRY LTD	297	343	240	19,113	ソフトウェア・サービス
BOMBARDIER INC	1,258	-	-	-	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	772	847	4,516	358,722	各種金融

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAE INC	155	168	523	41,559	資本財
CAMECO CORP	226	246	317	25,235	エネルギー
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	257	281	3,085	245,050	銀行
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	418	455	6,513	517,403	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	680	745	2,081	165,332	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	80	87	3,854	306,182	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	33	36	585	46,540	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	77	85	267	21,233	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	121	145	454	36,064	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	87	96	562	44,713	素材
CENOVUS ENERGY INC	597	655	396	31,471	エネルギー
CGI INC	136	144	1,317	104,683	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	124	129	223	17,773	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	11	12	1,976	157,029	ソフトウェア・サービス
CRONOS GROUP INC	110	124	117	9,323	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	172	187	937	74,498	小売
EMERA INC	143	160	881	70,054	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	100	106	383	30,451	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	1,167	1,284	4,890	388,419	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	15	17	747	59,342	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	396	370	621	49,352	素材
FORTIS INC	257	300	1,590	126,369	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	108	119	1,999	158,797	素材
GEORGE WESTON LTD	45	49	478	38,012	食品・生活必需品小売り
GILDAN ACTIVEWEAR INC	119	126	426	33,885	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC	164	182	549	43,667	保険
HUSKY ENERGY INC	194	-	-	-	エネルギー
HYDRO ONE LTD	195	216	615	48,904	公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	61	66	383	30,469	保険
IGM FINANCIAL INC	51	54	185	14,739	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	148	159	360	28,639	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	81	90	1,341	106,580	保険
INTER PIPELINE LTD	243	270	333	26,460	エネルギー
KEYERA CORP	124	137	302	24,032	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	719	784	769	61,140	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	156	166	878	69,798	素材
LOBLAW COS LTD	104	112	723	57,434	食品・生活必需品小売り

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	
LUNDIN MINING CORP	380	411	362	28,771	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	167	181	1,437	114,183	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,121	1,225	2,666	211,798	保険
METHANEX CORP	38	-	-	-	素材
METRO INC	146	161	972	77,221	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	196	212	1,499	119,096	銀行
NUTRIEN LTD	332	360	2,109	167,555	素材
ONEX CORPORATION	50	53	369	29,339	各種金融
OPEN TEXT CORP	156	174	969	77,014	ソフトウェア・サービス
OVINTIV INC	145	-	-	-	エネルギー
PAN AMERICAN SILVER CORP	-	133	528	41,945	素材
PARKLAND CORP	86	95	385	30,640	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	317	347	1,094	86,948	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	330	357	1,045	83,011	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	122	-	-	-	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	107	117	380	30,212	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERN	164	180	1,408	111,872	消費者サービス
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	-	69	587	46,652	商業・専門サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC	210	228	1,367	108,605	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	826	900	9,364	743,787	銀行
SAPUTO INC	141	155	531	42,200	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	280	302	698	55,457	メディア・娯楽
SHOPIFY INC - CLASS A	59	67	8,574	681,035	ソフトウェア・サービス
STARS GROUP INC/THE	130	-	-	-	消費者サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	339	370	2,180	173,195	保険
SUNCOR ENERGY INC	882	962	1,938	153,976	エネルギー
TC ENERGY CORP	539	595	3,301	262,232	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CL B	276	295	573	45,527	素材
THOMSON REUTERS CORP	118	110	1,164	92,484	商業・専門サービス
TMX GROUP LTD	-	36	461	36,683	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	1,043	1,143	7,820	621,214	銀行
WEST FRASER TIMBER CO LTD	30	-	-	-	素材
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	257	283	1,516	120,416	素材
WSP GLOBAL INC	61	72	677	53,851	資本財
YAMANA GOLD INC	-	596	411	32,711	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,945 83	24,420 80	121,709 -	9,667,384 <3.2%>

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	オーストラリアドル	千円	
AFTERPAY LTD	-	136	1,336	101,046	ソフトウェア・サービス
AGL ENERGY LTD	394	444	576	43,566	公益事業
ALUMINA LTD	1,540	-	-	-	素材
AMP LTD	2,087	2,316	403	30,472	各種金融
AMPOL LTD	151	169	482	36,488	エネルギー
ARISTOCRAT LEISURE LTD	341	373	1,291	97,644	消費者サービス
ASX LTD	124	132	1,083	81,892	各種金融
AURIZON HOLDINGS LTD	1,370	1,410	569	43,089	運輸
AUSNET SERVICES	1,591	1,516	284	21,493	公益事業
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP	1,661	1,839	4,129	312,191	銀行
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	364	-	-	-	銀行
BHP GROUP LIMITED	1,723	1,875	6,848	517,739	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	303	341	604	45,729	素材
BORAL LTD	737	-	-	-	素材
BRAMBLES LTD	935	1,015	1,105	83,594	商業・専門サービス
CHALLENGER LTD	334	-	-	-	各種金融
CIMIC GROUP LIMITED	69	78	182	13,803	資本財
COCA-COLA AMATIL LIMITED	336	382	481	36,418	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD	34	44	1,039	78,589	ヘルスケア機器・サービス
COLES GROUP LTD	674	872	1,574	119,035	食品・生活必需品小売り
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,031	1,135	8,958	677,258	銀行
COMPUTERSHARE LIMITED	317	355	480	36,303	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD	270	289	273	20,695	消費者サービス
CSL LIMITED	263	289	8,968	678,054	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EVOLUTION MINING LTD	-	1,077	596	45,060	素材
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	36	-	-	-	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD	814	1,079	1,830	138,379	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	389	-	-	-	小売
INCITEC PIVOT LTD	1,098	-	-	-	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	1,404	1,562	853	64,500	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	266	290	1,168	88,311	素材
MACQUARIE GROUP LTD	201	219	3,026	228,776	各種金融
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	76	85	529	40,046	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,700	1,896	553	41,863	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,696	2,068	4,695	355,001	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	453	521	1,476	111,600	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	-	485	686	51,877	素材

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	オーストラリアドル	千円	
OIL SEARCH LTD	841	1,318	491	37,193	エネルギー
ORICA LTD	265	300	510	38,603	素材
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,063	1,193	568	42,961	エネルギー
QANTAS AIRWAYS LTD	495	642	337	25,484	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	789	970	970	73,365	保険
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	102	127	842	63,675	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	34	38	534	40,387	メディア・娯楽
RIO TINTO LTD	219	239	2,368	179,091	素材
SANTOS LTD	1,080	1,178	707	53,459	エネルギー
SEEK LTD	210	238	606	45,882	メディア・娯楽
SONIC HEALTHCARE LTD	293	304	1,041	78,763	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	2,956	3,249	747	56,505	素材
SUNCORP GROUP LTD	800	903	851	64,377	保険
TABCORP HOLDINGS LTD	1,333	1,582	649	49,065	消費者サービス
TELSTRA CORP LTD	2,553	2,888	895	67,693	電気通信サービス
TPG TELECOM LTD	247	-	-	-	電気通信サービス
TPG TELECOM LTD	-	285	219	16,582	電気通信サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	432	475	470	35,550	食品・飲料・タバコ
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	84	80	234	17,701	エネルギー
WESFARMERS LIMITED	674	744	3,681	278,302	小売
WESTPAC BANKING CORP	2,092	2,337	4,651	351,635	銀行
WISETECH GLOBAL LTD	87	96	295	22,373	ソフトウェア・サービス
WOODSIDE PETROLEUM LTD	572	648	1,412	106,768	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	744	813	3,105	234,759	食品・生活必需品小売り
WORLEY LIMITED	208	-	-	-	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	42,988 58	44,964 53	82,284 -	6,220,708 <2.1%>
(香港)			千香港ドル		
AIA GROUP LTD	6,974	7,642	67,409	903,281	保険
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	177	195	1,706	22,863	半導体・半導体製造装置
BANK OF EAST ASIA	774	860	1,379	18,484	銀行
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,150	2,380	5,855	78,467	銀行
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	770	1,091	2,945	39,472	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,489	1,639	7,162	95,981	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,579	1,709	9,921	132,944	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	395	435	1,742	23,345	公益事業
CLP HOLDINGS LTD	946	1,046	7,691	103,062	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,228	1,358	8,325	111,557	消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,191	1,311	2,773	37,171	不動産
HANG SENG BANK LTD	443	488	6,472	86,731	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	866	996	3,123	41,858	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	5,880	6,847	8,312	111,392	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	693	761	28,191	377,766	各種金融
KERRY PROPERTIES LTD	405	450	933	12,512	不動産
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	-	460	1,589	21,296	ヘルスケア機器・サービス
MTR CORP	937	1,057	4,531	60,723	運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,656	1,009	4,072	54,564	不動産
NWS HOLDINGS LTD	950	-	-	-	資本財
PCCW LTD	3,020	3,330	1,581	21,195	電気通信サービス
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	810	885	3,649	48,907	公益事業
SANDS CHINA LTD	1,405	1,557	5,304	71,077	消費者サービス
SINO LAND CO	1,860	2,060	2,053	27,521	不動産
SJM HOLDINGS LTD	1,130	1,270	1,191	15,962	消費者サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	920	830	8,850	118,593	不動産
SWIRE PACIFIC LTD	288	328	1,531	20,522	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD	698	772	1,856	24,879	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	795	875	9,143	122,526	資本財
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	380	-	-	-	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LTD	5,505	6,045	4,062	54,434	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	707	1,067	4,167	55,850	不動産
WHEELOCK & CO LTD	490	-	-	-	不動産
WYNN MACAU LTD	905	1,033	1,429	19,158	消費者サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	440	-	-	-	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	50,863 34	51,793 31	218,963 -	2,934,105 <1.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND LTD	1,516	1,751	521	40,314	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	249	297	225	17,393	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,332	-	-	-	運輸
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,031	1,134	2,769	213,950	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	3,397	3,760	308	23,820	消費者サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	56	61	125	9,708	小売
KEPPEL CORP LTD	837	943	478	36,938	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,904	2,093	2,049	158,309	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	
(シンガポール)		百株	百株	シンガポールドル	千円	
SATS LTD		466	-	-	-	運輸
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		542	-	-	-	資本財
SINGAPORE AIRLINES LTD		317	874	354	27,415	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		465	506	459	35,496	各種金融
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		962	-	-	-	メディア・娯楽
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD		926	995	389	30,057	資本財
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		4,768	5,229	1,249	96,554	電気通信サービス
UNITED OVERSEAS BANK LTD		722	744	1,667	128,815	銀行
UOL Group Limited		271	298	220	17,060	不動産
VENTURE CORP LTD		158	175	331	25,580	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,108	1,191	506	39,107	食品・飲料・タバコ
YANGZIJANG SHIPBUILDING		1,325	1,580	145	11,230	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,352 20	21,631 16	11,801 -	911,753 <0.3%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
A2 MILK CO LTD		423	469	682	48,953	食品・飲料・タバコ
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		594	827	638	45,822	運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		331	363	1,215	87,215	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		487	-	-	-	素材
MERCURY NZ LTD		412	464	273	19,618	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		738	829	494	35,521	公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD		238	259	402	28,894	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,109	1,232	559	40,119	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,334 8	4,445 7	4,265 -	306,145 <0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
3I GROUP PLC		555	612	677	93,214	各種金融
ADMIRAL GROUP PLC		109	121	357	49,200	保険
ANGLO AMERICAN PLC		586	770	1,632	224,815	素材
ANTOFAGASTA PLC		217	245	269	37,070	素材
ASHTAD GROUP PLC		262	284	890	122,637	資本財
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		204	223	446	61,508	食品・飲料・タバコ
ASTRAZENECA PLC		755	829	6,736	927,506	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		530	611	341	46,970	メディア・娯楽
AVEVA GROUP PLC		37	41	173	23,917	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC		2,249	2,448	771	106,192	保険
BAE SYSTEMS PLC		1,846	2,029	1,030	141,912	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BARCLAYS PLC	9,939	10,888	1,512	208,231	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	588	646	421	58,082	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS-UNIT	68	79	380	52,383	耐久消費財・アパレル
BHP GROUP PLC	1,209	1,326	2,151	296,229	素材
BP PLC	11,673	12,830	3,126	430,497	エネルギー
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,321	1,449	4,029	554,812	食品・飲料・タバコ
BT GROUP PLC	4,859	5,639	721	99,380	電気通信サービス
BUNZL PLC	194	212	505	69,654	資本財
BURBERRY GROUP PLC	234	256	411	56,640	耐久消費財・アパレル
CARNIVAL PLC	89	-	-	-	消費者サービス
CENTRICA PLC	3,388	-	-	-	公益事業
COCA-COLA HBC AG-CDI	114	126	282	38,896	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	913	1,124	1,518	209,008	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	73	81	507	69,927	素材
DCC PLC	56	62	343	47,356	資本財
DIAGEO PLC	1,350	1,478	4,405	606,551	食品・飲料・タバコ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	782	852	258	35,614	保険
EASYJET PLC	93	-	-	-	運輸
EVRAZ PLC	296	318	120	16,595	素材
EXPERIAN PLC	523	574	1,686	232,137	商業・専門サービス
FERGUSON PLC	130	141	1,143	157,500	資本財
G4S PLC	905	-	-	-	商業・専門サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,875	3,173	4,427	609,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLENCORE PLC	6,134	6,299	1,199	165,132	素材
GVC HOLDINGS PLC	336	367	356	49,109	消費者サービス
HALMA PLC	217	239	581	80,010	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARGREAVES LANSDOWN PLC	190	208	306	42,134	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	-	108	281	38,811	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	11,710	12,860	4,935	679,551	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	546	598	901	124,115	食品・飲料・タバコ
INFORMA PLC	727	963	561	77,246	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	99	110	494	68,051	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	93	102	616	84,917	商業・専門サービス
ITV PLC	2,098	-	-	-	メディア・娯楽
JD SPORTS FASHION PLC	251	276	221	30,471	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	109	121	292	40,241	素材
KINGFISHER PLC	1,202	1,321	384	52,997	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,426	3,791	978	134,671	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	40,320	44,527	1,585	218,248	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	181	200	1,620	223,122	各種金融
M&G PLC	1,481	1,650	318	43,864	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,116	-	-	-	小売
MEGGITT PLC	447	-	-	-	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,811	3,082	487	67,098	資本財
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	192	-	-	-	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC/WI	276	304	513	70,689	素材
MORRISON WM SUPERMARKETS	1,370	1,498	279	38,415	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	2,006	2,220	2,072	285,282	公益事業
NATWEST GROUP PLC	2,784	3,031	474	65,279	銀行
NEXT PLC	76	83	560	77,148	小売
NMC HEALTH PLC	47	47	0.005	0.653	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	261	289	674	92,812	小売
PEARSON PLC	447	475	303	41,794	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	183	201	583	80,350	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	1,492	1,647	2,106	290,082	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	408	449	3,026	416,728	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,117	1,221	2,170	298,867	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,075	1,176	606	83,503	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	645	707	3,334	459,093	素材
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,013	1,237	121	16,784	資本財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,405	2,590	3,176	437,305	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,147	2,335	2,761	380,213	エネルギー
RSA INSURANCE GROUP PLC	592	642	434	59,840	保険
SAGE GROUP PLC	624	686	466	64,248	ソフトウェア・サービス
SAINSBURY (J) PLC	1,013	1,106	245	33,810	食品・生活必需品小売り
SCHRODERS PLC	70	78	232	32,051	各種金融
SEVERN TRENT PLC	137	152	374	51,509	公益事業
SMITH & NEPHEW PLC	504	551	798	109,965	ヘルスケア機器・サービス
SMITHS GROUP PLC	226	252	386	53,183	資本財
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	42	46	537	74,020	資本財
SSE PLC	598	662	902	124,263	公益事業
ST JAMES'S PLACE PLC	313	339	367	50,645	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC	1,566	1,681	737	101,563	銀行
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,353	1,451	392	53,991	各種金融

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
TAYLOR WIMPEY PLC		1,902	2,300	385	53,057	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC		5,640	6,204	1,464	201,699	食品・生活必需品小売り
TUI AG-DI		254	-	-	-	消費者サービス
UNILEVER PLC		639	738	3,297	453,942	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC		393	436	400	55,106	公益事業
VODAFONE GROUP PLC		15,472	16,981	2,064	284,309	電気通信サービス
WEIR GROUP PLC/THE		149	-	-	-	資本財
WHITBREAD PLC		76	126	387	53,318	消費者サービス
WPP PLC		731	781	578	79,698	メディア・娯楽
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	172,799 93	181,055 84	94,627 -	13,028,336 <4.3%>	
(イスラエル)				千イスラエル・シケル		
AZRIELI GROUP		24	27	525	16,321	不動産
BANK HAPOALIM BM		658	719	1,602	49,750	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		847	909	1,699	52,763	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		14	16	659	20,458	資本財
ICL GROUP LTD		403	440	609	18,931	素材
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		670	730	820	25,472	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		84	91	662	20,578	銀行
NICE LTD		35	39	3,094	96,051	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,739 8	2,974 8	9,675 -	300,328 <0.1%>	
(スイス)				千スイス・フラン		
ABB LTD		1,062	1,165	2,861	326,450	資本財
ADECCO GROUP AG-REG		88	98	513	58,552	商業・専門サービス
ALCON INC		239	310	1,782	203,391	ヘルスケア機器・サービス
BALOISE HOLDING AG		27	29	466	53,197	保険
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		-	20	201	23,042	銀行
BARRY CALLEBAUT AG-REG		1	1	377	43,094	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.60	0.68	537	61,327	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.05	0.06	504	57,501	食品・飲料・タバコ
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		300	330	2,480	282,951	耐久消費財・アパレル
CLARIANT AG		113	127	228	26,019	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG		1,468	1,524	1,692	193,114	各種金融
DUFREY AG-REG		23	-	-	-	小売
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		4	5	417	47,683	素材
GEBERIT AG-REG		21	23	1,299	148,308	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	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
GIVAUDAN-REG	5	5	2,129	242,927	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	129	142	703	80,221	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	32	34	660	75,397	運輸
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	283	329	1,527	174,221	素材
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	-	102	769	87,794	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONZA GROUP AG	42	47	2,748	313,523	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA	1,713	1,878	19,561	2,231,812	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG	1,236	1,402	11,092	1,265,517	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARGESA HOLDING SA-BR	22	-	-	-	各種金融
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10	11	1,117	127,545	各種金融
ROCHE HOLDING AG	404	443	13,553	1,546,311	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	12	13	341	39,011	資本財
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	22	24	620	70,817	資本財
SGS SOCIETE GENERALE SURVEILLANCE	3	3	1,009	115,144	商業・専門サービス
SIKA AG-BEARER	73	89	2,112	240,975	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	31	34	771	88,034	ヘルスケア機器・サービス
STRAUMANN HOLDING AG	5	6	685	78,159	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG	15	17	399	45,604	耐久消費財・アパレル
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	19	20	809	92,318	保険
SWISS PRIME SITE-REG	45	50	426	48,608	不動産
SWISS RE AG	171	187	1,520	173,422	保険
SWISSCOM AG	15	16	805	91,936	電気通信サービス
TEMENOS GROUP AG-REG	37	42	475	54,281	ソフトウェア・サービス
THE SWATCH GROUP AG-REG	32	37	168	19,205	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG	2,221	2,312	3,029	345,592	各種金融
VIFOR PHARMA AG	26	28	357	40,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	86	95	3,478	396,891	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	10,052 39	11,017 39	84,238 -	9,610,722 <3.2%>
(デンマーク)			千デンマーク・クローネ		
A P MOLLER - MAERSK A/S	3	4	4,713	78,006	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S	2	2	2,209	36,562	運輸
AMBU A/S-B	-	102	2,044	33,840	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG AS-B	61	65	6,160	101,949	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S	60	66	4,322	71,531	素材
COLOPLAST-B	68	74	6,986	115,632	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	372	433	4,442	73,529	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		
(デンマーク)		百株	百株	デンマーク・クローネ	千円	
DEMANT A/S		62	67	1,460	24,171	ヘルスケア機器・サービス
DSV PANALPINA A/S		123	131	13,232	219,003	運輸
GENMAB A/S		37	41	9,368	155,047	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GN STORE NORD A/S		-	80	3,763	62,287	ヘルスケア機器・サービス
H LUNDBECK A/S		40	44	846	14,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S		91	-	-	-	商業・専門サービス
NOVO-NORDISK A/S		1,017	1,086	45,825	758,411	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S		122	130	4,846	80,207	素材
ORSTED A/S		108	119	13,216	218,737	公益事業
PANDORA A/S		57	62	3,841	63,581	耐久消費財・アパレル
TRYGVESTA AS		71	78	1,410	23,349	保険
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		108	124	14,824	245,352	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,410 17	2,716 18	143,517 -	2,375,212 <0.8%>	
(ノルウェー)				ノルウェー・クローネ		
ADEVINTA ASA-B		-	152	2,046	23,590	メディア・娯楽
AKER BP ASA		62	-	-	-	エネルギー
DNB ASA		548	601	9,446	108,915	銀行
EQUINOR ASA		574	628	8,584	98,982	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		117	129	2,533	29,207	保険
MOWI ASA		254	280	4,939	56,949	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		771	844	2,895	33,380	素材
ORKLA ASA		437	477	4,109	47,387	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-B SHS		58	63	1,941	22,383	メディア・娯楽
TELENOR ASA		428	477	7,252	83,620	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		102	111	4,017	46,320	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,356 10	3,765 10	47,765 -	550,738 <0.2%>	
(スウェーデン)				スウェーデン・クローナ		
ALFA LAVAL AB		180	199	4,082	49,311	資本財
ASSA ABLOY AB		578	636	13,769	166,334	資本財
ATLAS COPCO AB		222	245	9,474	114,455	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		386	425	18,760	226,624	資本財
BOLIDEN AB		153	169	4,681	56,547	素材
ELECTROLUX AB		130	144	2,967	35,851	耐久消費財・アパレル
EPIROC AB-A		383	418	6,042	72,988	資本財
EPIROC AB-B		222	246	3,396	41,029	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	
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
EQT AB	-	150	2,950	35,639	各種金融
ESSITY AKTIEBOLAG-B	350	385	10,436	126,072	家庭用品・パーソナル用品
EVOLUTION GAMING GROUP	-	79	5,193	62,733	消費者サービス
HENNES & MAURITZ AB	463	507	8,775	106,009	小売
HEXAGON AB-B SHS	151	178	12,615	152,389	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUSQVARNA AB-B SHS	237	265	2,429	29,354	耐久消費財・アパレル
ICA GRUPPEN AB	53	63	2,631	31,785	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	89	98	2,551	30,817	各種金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	-	93	2,152	26,000	資本財
INVESTOR AB	261	284	17,037	205,807	各種金融
KINNEVIK AB - B	134	148	5,950	71,879	各種金融
LUNDBERGS AB-B SHS	41	47	2,128	25,716	各種金融
LUNDIN ENERGY AB	109	116	2,423	29,281	エネルギー
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	57	-	-	-	電気通信サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	-	199	4,770	57,633	資本財
NORDEA BANK ABP	1,872	2,047	15,089	182,280	銀行
SANDVIK AB	646	712	13,338	161,134	資本財
SECURITAS AB	180	201	2,915	35,223	商業・専門サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	940	1,031	9,413	113,710	銀行
SKANSKA AB-B SHS	196	216	4,452	53,784	資本財
SKF AB	217	241	4,866	58,786	資本財
SVENSKA CELLULOSA AB	-	379	5,101	61,624	素材
SVENSKA HANDELSBANKEN	898	987	8,418	101,694	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	521	569	8,863	107,074	銀行
SWEDISH MATCH AB	97	102	7,268	87,801	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB	297	328	3,538	42,749	電気通信サービス
TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON	1,774	1,841	19,214	232,105	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB	1,624	1,610	5,839	70,536	電気通信サービス
VOLVO AB	852	941	18,817	227,317	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,328 32	16,319 36	272,358 -	3,290,085 <1.1%>
(ユーロ/アイルランド)			千ユーロ		
AIB GROUP PLC	454	-	-	-	銀行
BANK OF IRELAND GROUP PLC	546	-	-	-	銀行
CRH PLC	454	493	1,639	202,245	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC.	45	97	1,380	170,268	消費者サービス
KERRY GROUP PLC-A	91	100	1,201	148,175	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	
(ユーロ/アイルランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
KINGSPAN GROUP PLC		88	97	727	89,767	資本財
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		130	142	514	63,400	素材
小計	株数・金額	1,811	930	5,463	673,857	
	銘柄数<比率>	7	5	-	<0.2%>	
(ユーロ/オランダ)						
ABN AMRO BANK NV		243	272	246	30,416	銀行
ADYEN NV		6	11	1,821	224,632	ソフトウェア・サービス
AEGON NV		1,015	1,113	333	41,073	保険
AIRBUS SE		336	372	3,323	409,912	資本財
AKZO NOBEL NV		117	122	1,063	131,138	素材
ALTICE NV - A-W/I		360	404	174	21,566	電気通信サービス
ASML HOLDING NV		245	268	9,556	1,178,714	半導体・半導体製造装置
CNH INDUSTRIAL NV		585	650	578	71,373	資本財
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		332	364	348	43,044	食品・飲料・タバコ
EXOR NV		61	68	387	47,850	各種金融
FERRARI NV		69	79	1,432	176,694	自動車・自動車部品
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		630	691	894	110,284	自動車・自動車部品
GALAPAGOS NV		26	27	281	34,698	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HEINEKEN HOLDING NV		66	73	582	71,840	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN NV		149	164	1,480	182,576	食品・飲料・タバコ
ING GROEP NV-CVA		2,235	2,462	1,894	233,711	銀行
JUST EAT TAKEAWAY		66	80	720	88,804	小売
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		632	694	1,632	201,352	食品・生活必需品小売り
KONINKLIJKE DSM NV		104	108	1,543	190,359	素材
KONINKLIJKE PHILIPS NV		520	576	2,514	310,105	ヘルスケア機器・サービス
NN GROUP NV		178	181	624	77,000	保険
PROSUS		280	307	2,701	333,193	小売
QIAGEN NV		130	144	576	71,058	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANDSTAD NV		67	74	370	45,735	商業・専門サービス
ROYAL KPN NV		2,125	2,313	599	73,984	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV		393	402	1,223	150,930	半導体・半導体製造装置
UNILEVER NV		845	923	4,577	564,573	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		40	43	193	23,867	エネルギー
WOLTERS KLUWER NV		157	172	1,229	151,648	商業・専門サービス
小計	株数・金額	12,021	13,169	42,906	5,292,143	
	銘柄数<比率>	29	29	-	<1.8%>	

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	
(ユーロ/ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AGEAS	101	109	447	55,213	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	438	482	2,660	328,087	食品・飲料・タバコ
ARGENX SE	-	28	633	78,083	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT NV	30	34	169	20,862	食品・生活必需品小売り
ELIA GROUP SA/NV	-	19	185	22,844	公益事業
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	45	72	581	71,715	各種金融
KBC GROEP NV	142	157	893	110,199	銀行
PROXIMUS	90	100	173	21,408	電気通信サービス
SOFINA	-	9	236	29,116	各種金融
SOLVAY SA	42	47	421	51,958	素材
TELENET GROUP HOLDING NV	28	30	102	12,683	メディア・娯楽
UCB SA	72	79	724	89,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE	113	123	441	54,508	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,106 10	1,293 13	7,670 -	946,031 <0.3%>
(ユーロ/ルクセンブルグ)					
ARCELORMITTAL	376	452	622	76,801	素材
TENARIS SA	261	283	177	21,888	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	637 2	736 2	800 -	98,689 <0.0%>
(ユーロ/フランス)					
ACCOR	99	120	354	43,763	消費者サービス
ADP	18	20	232	28,672	運輸
AIR LIQUIDE	272	299	4,153	512,231	素材
ALSTOM RGPT	110	121	530	65,429	資本財
ALSTOM SA - RIGHTS	-	121	52	6,467	資本財
AMUNDI SA	35	38	262	32,401	各種金融
ARKEMA	39	43	398	49,132	素材
ATOS SE	56	61	430	53,075	ソフトウェア・サービス
AXA SA	1,112	1,219	2,308	284,717	保険
BIOMERIEUX	23	26	311	38,378	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS	646	707	2,888	356,222	銀行
BOLLORE	550	585	198	24,537	メディア・娯楽
BOUYGUES	130	144	484	59,728	資本財
BUREAU VERITAS SA	171	189	405	50,001	商業・専門サービス
CAPGEMINI SA	91	101	1,185	146,221	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	348	379	536	66,160	食品・生活必需品小売り

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	
CASINO GUICHARD PERRACHON	31	-	-	-	食品・生活必需品小売り
CIE DE SAINT-GOBAIN	283	327	1,290	159,201	資本財
CNP ASSURANCES	98	107	136	16,795	保険
CREDIT AGRICOLE SA	665	721	640	78,961	銀行
DANONE	355	390	2,064	254,593	食品・飲料・タバコ
DASSAULT AVIATION SA	1	1	139	17,163	資本財
DASSAULT SYSTEMES SA	75	83	1,305	160,963	ソフトウェア・サービス
EDENRED	141	155	705	86,982	ソフトウェア・サービス
EDF	351	395	470	58,013	公益事業
EIFFAGE	45	54	449	55,450	資本財
ENGIE	1,053	1,155	1,393	171,856	公益事業
ESSILORLUXOTTICA	163	180	2,056	253,595	耐久消費財・アパレル
EURAZEO	23	25	133	16,486	各種金融
EUROFINS SCIENTIFIC	6	83	605	74,694	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	103	-	-	-	メディア・娯楽
FAURECIA	43	48	195	24,072	自動車・自動車部品
GETLINK SE - REGR	270	293	425	52,486	運輸
HERMES INTERNATIONAL	18	20	1,698	209,492	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	8	9	165	20,438	電気通信サービス
INGENICO GROUP	35	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPSEN	21	23	198	24,490	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JC DECAUX SA	51	56	110	13,685	メディア・娯楽
KERING	43	47	2,930	361,417	耐久消費財・アパレル
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	-	53	185	22,865	消費者サービス
LEGRAND SA	154	168	1,211	149,415	資本財
L'OREAL SA	144	158	4,939	609,243	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	159	175	8,577	1,057,981	耐久消費財・アパレル
MICHELIN (C.G.D.E.)	98	106	1,143	141,093	自動車・自動車部品
NATIXIS	547	597	150	18,592	各種金融
ORANGE S.A.	1,164	1,277	1,326	163,612	電気通信サービス
ORPEA	-	33	352	43,502	ヘルスケア機器・サービス
PERNOD-RICARD	122	134	2,158	266,186	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	337	366	717	88,473	自動車・自動車部品
PUBLICIS GROUPE	126	137	523	64,567	メディア・娯楽
REMY COINTREAU	12	14	217	26,838	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	111	123	384	47,468	自動車・自動車部品
SAFRAN SA	188	202	2,434	300,281	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	
SANOFI	649	714	6,116	754,376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	15	17	533	65,827	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	318	349	4,145	511,284	資本財
SCOR REGROUPE	93	99	286	35,366	保険
SEB SA	12	14	210	25,943	耐久消費財・アパレル
SOCIETE GENERALE	466	508	823	101,581	銀行
SODEXO	51	55	392	48,356	消費者サービス
SUEZ	201	223	360	44,468	公益事業
TELEPERFORMANCE	34	37	1,029	126,977	商業・専門サービス
THALES SA	61	67	527	65,074	資本財
TOTAL SE	1,378	1,560	5,322	656,505	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT	52	57	461	56,899	メディア・娯楽
VALEO SA	140	145	450	55,556	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	312	342	629	77,620	公益事業
VINCI SA	297	327	2,838	350,094	資本財
VIVENDI SA	481	524	1,337	164,954	メディア・娯楽
WENDEL	16	18	168	20,760	各種金融
WORLDLINE SA	73	86	640	78,968	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	15,426 68	17,062 68	82,444 -	10,168,723 <3.4%>
(ユーロ/ドイツ)					
ADIDAS AG	103	120	3,391	418,252	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE	239	263	5,124	632,030	保険
AROUNDTOWN SA	717	740	409	50,478	不動産
BASF SE	526	579	3,350	413,227	素材
BAYER AG	565	620	2,880	355,284	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	189	209	1,551	191,314	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	33	35	197	24,341	自動車・自動車部品
BEIERSDORF AG	57	63	616	76,037	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG	87	96	613	75,621	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	23	25	297	36,666	ヘルスケア機器・サービス
COMMERZBANK AG	567	622	307	37,906	銀行
CONTINENTAL AG	63	69	768	94,817	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	97	108	502	62,006	素材
DAIMLER AG	525	540	2,977	367,193	自動車・自動車部品
DELIVERY HERO SE	65	81	811	100,080	小売
DEUTSCHE BANK AG	1,130	1,240	1,115	137,600	各種金融

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE BOERSE AG	109	119	1,615	199,248	各種金融
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	134	189	179	22,177	運輸
DEUTSCHE POST AG	575	628	2,458	303,292	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,934	2,113	3,138	387,060	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	208	216	920	113,523	不動産
E.ON SE	1,289	1,425	1,290	159,161	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	116	130	308	37,999	素材
FRAPORT AG	25	30	140	17,387	運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA	240	263	990	122,200	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB AG -PFD	38	42	204	25,203	素材
GEA GROUP AG	89	96	275	33,970	資本財
HANNOVER RUECK SE	34	37	548	67,634	保険
HEIDELBERGCEMENT AG	84	93	543	67,015	素材
HENKEL AG & CO KGAA	60	66	522	64,417	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL KGAA-VORZUG	101	110	966	119,252	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	14	16	129	15,990	資本財
INFINEON TECHNOLOGIES AG	718	789	2,137	263,592	半導体・半導体製造装置
KION GROUP AG	37	40	273	33,680	資本財
KNORR-BREMSE AG	28	30	327	40,425	資本財
LANXESS	46	51	278	34,306	素材
LEG IMMOBILIEN AG	-	43	517	63,841	不動産
MERCK KGAA	74	81	1,044	128,803	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METRO AG	104	114	92	11,407	食品・生活必需品小売り
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	30	33	657	81,057	資本財
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	82	88	2,082	256,901	保険
NEMETSCHKE SE	-	36	232	28,696	ソフトウェア・サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PREF	86	93	529	65,354	自動車・自動車部品
PUMA AG	48	52	442	54,563	耐久消費財・アパレル
RWE AG	334	404	1,377	169,920	公益事業
SAP SE	565	659	6,554	808,451	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	20	22	831	102,507	ヘルスケア機器・サービス
SCOUT24 AG	-	67	436	53,777	メディア・娯楽
SIEMENS AG	440	482	5,302	654,059	資本財
SIEMENS ENERGY AG	-	241	584	72,047	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	86	94	350	43,216	ヘルスケア機器・サービス
SYMRISE AG	74	81	852	105,126	素材
TEAMVIEWER AG	-	82	314	38,791	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/ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		564	700	163	20,109	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG		238	261	123	15,282	素材
UNIPER SE		115	127	357	44,078	公益事業
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		59	67	221	27,302	電気通信サービス
VOLKSWAGEN AG		20	22	358	44,156	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG		105	116	1,775	218,950	自動車・自動車部品
VONOVIA SE		299	327	1,895	233,801	不動産
WIRECARD AG		67	-	-	-	ソフトウェア・サービス
ZALANDO SE		80	95	756	93,304	小売
小計	株数・金額	14,383	16,313	70,017	8,635,912	
	銘柄数<比率>	57	61	-	<2.9%>	
(ユーロ/ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,476	1,765	785	96,893	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		287	313	276	34,067	エネルギー
JERONIMO MARTINS		142	154	215	26,598	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	1,906	2,233	1,277	157,559	
	銘柄数<比率>	3	3	-	<0.1%>	
(ユーロ/スペイン)						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		147	170	435	53,669	資本財
AENA SME SA		40	43	627	77,340	運輸
AMADEUS IT GROUP SA		247	284	1,692	208,801	ソフトウェア・サービス
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA		3,818	4,178	1,492	184,072	銀行
BANCO DE SABADELL SA		3,211	-	-	-	銀行
BANCO SANTANDER SA		9,532	10,489	2,437	300,677	銀行
BANCO SANTANDER SA - RIGHTS		-	10,489	104	12,937	銀行
BANKIA SA		689	-	-	-	銀行
BANKINTER SA		383	425	179	22,164	銀行
CAIXABANK		2,048	2,215	485	59,824	銀行
CELLNEX TELECOM SAU		146	201	1,045	128,896	電気通信サービス
ENAGAS SA		144	155	310	38,298	公益事業
ENDESA SA		183	201	498	61,480	公益事業
FERROVIAL S.A.		287	313	723	89,243	資本財
FERROVIAL SA-RTS		287	-	-	-	資本財
FERROVIAL SA-RTS		-	313	7	920	資本財
GRIFOLS SA		171	188	474	58,511	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA		3,544	3,744	4,253	524,660	公益事業
INDITEX SA		627	685	1,849	228,163	小売

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ/スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
MAPFRE SA		615	649	102	12,647	保険
NATURGY ENERGY GROUP SA		170	187	357	44,113	公益事業
RED ELECTRICA DE ESPANA		247	272	450	55,593	公益事業
REPSOL SA		817	941	729	89,956	エネルギー
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY		137	150	415	51,215	資本財
TELEFONICA SA		2,715	3,105	1,075	132,676	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,219	39,409	19,749	2,435,866	
		23	22	-	<0.8%>	
(ユーロ/イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI SPA		630	696	980	120,955	保険
ATLANTIA SPA		290	316	463	57,159	運輸
DIASORIN SPA		-	15	271	33,486	ヘルスケア機器・サービス
ENEL SPA		4,689	5,136	4,193	517,253	公益事業
ENI-ENTE NAZIONALE IDROCARBURI SPA		1,455	1,598	1,291	159,281	エネルギー
FINECOBANK SPA		348	383	477	58,926	銀行
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		-	156	162	20,067	電気通信サービス
INTESA SANPAOLO		8,588	10,386	1,925	237,515	銀行
LEONARDO SPA		229	245	139	17,216	資本財
MEDIOBANCA SPA		357	395	299	36,894	銀行
MONCLER SPA		103	121	495	61,067	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA		-	237	363	44,868	ソフトウェア・サービス
PIRELLI & C SPA		233	252	105	13,066	自動車・自動車部品
POSTE ITALIANE SPA		312	347	302	37,355	保険
PRYSMIAN SPA		140	151	385	47,521	資本財
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		60	65	301	37,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAM SPA		1,183	1,282	599	73,931	公益事業
TELECOM ITALIA SPA		8,564	8,642	311	38,373	電気通信サービス
TERNA SPA		814	892	563	69,555	公益事業
UNICREDIT SPA		1,148	1,336	1,122	138,490	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	29,152	32,663	14,757	1,820,161	
		17	20	-	<0.6%>	
(ユーロ/フィンランド)						
ELISA OYJ		83	91	415	51,285	電気通信サービス
FORTUM OYJ		257	280	493	60,845	公益事業
KONE OYJ		196	214	1,511	186,426	資本財
NELES OYJ		60	-	-	-	資本財
NESTE OYJ		242	266	1,433	176,837	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
(ユーロ/フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
NOKIA OYJ		3,250	3,566	1,159	142,996	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ		71	-	-	-	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B		60	65	261	32,214	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ		257	297	1,089	134,373	保険
STORA ENSO OYJ		326	363	496	61,267	素材
UPM-KYMMENE OYJ		303	336	891	109,965	素材
WARTSILA OYJ		254	284	221	27,360	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,363 12	5,768 10	7,974 -	983,573 <0.3%>	
(ユーロ/オーストリア)						
ANDRITZ AG		42	46	157	19,443	資本財
ERSTE GROUP BANK AG		173	177	421	52,005	銀行
OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A		38	43	242	29,955	公益事業
OMV AG		83	89	253	31,284	エネルギー
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING		84	92	146	18,063	銀行
VOESTALPINE AG		66	73	190	23,449	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	488 6	523 6	1,412 -	174,203 <0.1%>	
(ユーロ/その他)						
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA		122	134	957	118,049	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	122 1	134 1	957 -	118,049 <0.0%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	112,639 235	130,238 240	255,430 -	31,504,773 <10.5%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	634,904 1,246	692,436 1,212	- -	285,514,371 <94.9%>	

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

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

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

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

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国（外貨建）投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当期末	
	□数	□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	8	9	905	94,055
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	23	26	4,428	460,032
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6	7	1,305	135,632
PROLOGIS INC	42	46	4,661	484,208
ANNALY MORTGAGE MANAGEMENT	84	91	721	74,907
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7	8	1,505	156,404
CAMDEN PROPERTY TRUST	5	6	596	61,933
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	9	10	427	44,392
DUKE REALTY CORP	20	23	897	93,203
EQUITY RESIDENTIAL	21	23	1,402	145,656
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	4	1,040	108,138
FEDERAL REALTY INVS TRUST	4	4	408	42,440
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28	33	1,035	107,577
WELLTOWER INC	23	26	1,719	178,596
HOST HOTELS AND RESORTS INC	40	44	642	66,782
KIMCO REALTY CORP	24	—	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6	7	902	93,794
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	12	14	495	51,500
PUBLIC STORAGE	9	9	2,264	235,242
REGENCY CENTERS CORP	9	10	509	52,897
SIMON PROPERTY GROUP INC	17	19	1,557	161,754
SL GREEN REALTY CORP	4	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC	5	6	866	90,059
UDR INC	16	18	722	75,036
VENTAS INC	21	23	1,143	118,826
VORNADO REALTY TRUST	9	10	407	42,350
WP CAREY INC	9	10	761	79,068
REALTY INCOME CORP	18	21	1,318	136,935
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9	10	661	68,702
EXTRA SPACE STORAGE INC	7	8	919	95,475
DIGITAL REALTY TRUST INC	12	16	2,423	251,730
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	29	33	643	66,852
IRON MOUNTAIN INC	16	18	475	49,393
AGNC INVESTMENT CORP	32	36	548	56,997
AMERICAN TOWER REIT INC	25	28	6,677	693,655
EQUINIX INC	4	5	4,084	424,321
VEREIT	61	67	498	51,738
SBA COMMUNICATIONS CORP	6	7	2,099	218,065
INVITATION HOMES INC	31	34	963	100,054

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首(前期末)		当期末	
		□数	□数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千米ドル	千円
VICI PROPERTIES INC		27	29	765	79,503
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	763 40	816 38	53,406 -	5,547,918 <1.8%>
(カナダ)				千カナダ・ドル	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTM		4	4	118	9,444
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		4	5	260	20,667
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		8	-	-	-
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		9	9	169	13,495
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		6	6	105	8,408
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	33 5	26 4	654 -	52,015 <0.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリア・ドル	
DEXUS		68	76	754	57,048
GPT GROUP		124	133	610	46,166
GOODMAN GROUP		98	107	2,010	152,014
STOCKLAND		147	155	700	52,950
MIRVAC GROUP		244	272	734	55,542
VICINITY CENTRES		213	259	434	32,866
SCENTRE GROUP		322	337	937	70,875
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,219 7	1,342 7	6,183 -	467,464 <0.2%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		120	131	9,104	121,993
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	120 1	131 1	9,104 -	121,993 <0.0%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		170	193	575	44,446
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		154	-	-	-
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		148	284	562	43,490
SUNTEC REIT		112	121	184	14,244
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		-	166	330	25,531
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		123	136	273	21,153
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	707 5	903 5	1,926 -	148,867 <0.0%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド	
BRITISH LAND CO PLC		50	56	268	37,019
LAND SECURITIES GROUP PLC		39	44	304	41,903
SEGRO PLC		61	74	680	93,723
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	152 3	175 3	1,253 -	172,646 <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	
KLEPIERRE	11	12	221	27,342	
GECINA SA	2	2	367	45,330	
COVIVIO	2	3	235	29,050	
ICADE	1	2	129	16,030	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7	8	491	60,659	
小計	口数・金額	26	29	1,446	178,413
	銘柄数<比率>	5	5	-	<0.1%>
合計	口数・金額	3,023	3,424	-	6,689,318
	銘柄数<比率>	66	63	-	<2.2%>

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
外 S&P 500 EMINI FUTURE	6,173	-
国 FTSE 100	609	-
DJ EURO STOXX 50	1,535	-

(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

2020年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	285,514,371	94.4
投資信託証券	6,689,318	2.2
コール・ローン等、その他	10,407,347	3.4
投資信託財産総額	302,611,037	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103.88円、1カナダ・ドル79.43円、1オーストラリア・ドル75.60円、1香港ドル13.40円、1シンガポール・ドル77.26円、1ニュージーランド・ドル71.77円、1イギリス・ポンド137.68円、1イスラエル・シケル31.04円、1スイス・フラン114.09円、1デンマーク・クローネ16.55円、1ノルウェー・クローネ11.53円、1スウェーデン・クローナ12.08円、1ユーロ123.34円です。

(注2) 外貨建純資産 (298,461,197千円) の投資信託財産総額 (302,611,037千円) に対する比率は98.6%です。

(注3) 評価額の単位未満は切り捨てています。

ニッセイ外国株式インデックスマザーファンド

資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	306,891,719,190円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,040,961,296
株 式(評価額)	285,514,371,822
投 資 信 託 証 券(評価額)	6,689,318,591
未 収 入 金	4,823,966,528
未 収 配 当 金	314,895,056
差 入 委 託 証 拠 金	4,508,205,897
(B)負債	5,967,885,625
未 払 金	4,320,272,953
未 払 解 約 金	1,647,606,579
そ の 他 未 払 費 用	6,093
(C)純 資 産 総 額(A-B)	300,923,833,565
元 本	145,169,780,539
次 期 繰 越 損 益 金	155,754,053,026
(D)受 益 権 総 口 数	145,169,780,539口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,729円

- (注1) 期首元本額 131,943,832,341円
 期中追加設定元本額 28,609,736,237円
 期中一部解約元本額 15,383,788,039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) 854,059,755円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型) 3,771,468,504円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型) 2,859,153,135円
 ニッセイ外国株式インデックスSA(適格機関投資家限定) 1,680,106,235円
 ニッセイ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) 2,902,320円
 ニッセイインデックスバランス(標準型)SA(適格機関投資家限定) 16,628,124円
 ニッセイインデックスバランス(成長型)SA(適格機関投資家限定) 20,292,993円
 ニッセイ外国株式インデックスファンドII(適格機関投資家限定) 11,039,104,952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
 DCニッセイ外国株式インデックス 20,965,866,221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) 986,387,028円
 DCニッセイターゲットデートファンド2055 98,693,841円
 DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型) 133,359,257円
 DCニッセイターゲットデートファンド2045 98,739,969円
 DCニッセイターゲットデートファンド2035 218,778,176円
 DCニッセイターゲットデートファンド2025 48,776,845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) 52,991,843円
 ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式) 5,819,342円
 ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート) 5,624,058円
 ニッセイ・インデックスパッケージ(内外・株式/リート/債券) 1,588,705円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックス
 バランスファンド(8資産均等型) 18,159,475円
 DCニッセイターゲットデートファンド2060 26,453,761円
 DCニッセイターゲットデートファンド2050 20,935,466円
 DCニッセイターゲットデートファンド2040 70,913,550円
 DCニッセイターゲットデートファンド2030 104,875,929円
 ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-02(適格機関投資家限定) 263,829,859円
 ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-06(適格機関投資家限定) 303,405,272円
 <購入・換金手数料なし>ニッセイ世界株式ファンド(GDP型バスケット) 49,172,147円
 ニッセイ海外資産インデックス・バランスファンド2020-09(適格機関投資家限定) 277,586,748円

損益の状況

当期(2020年5月21日~2020年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	2,153,865,118円
受 取 配 当 金	2,153,302,624
受 取 そ の 他 利 益 金 息	66,915
支 払 利 益 金 息	1,586,085
支 払 利 益 金 息	△ 1,090,506
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	44,530,857,785
売 買 損 益	55,265,769,048
売 買 損 益	△ 10,734,911,263
(C)先 物 取 引 等 損 益	1,588,745,824
取 引 損 益	1,859,740,408
取 引 損 益	△ 270,994,584
(D)信 託 報 酬 等	△ 57,174,540
(E)当期損益金(A+B+C+D)	48,216,294,187
(F)前期繰越損益金	95,734,936,131
(G)追加信託差損益金	26,381,333,209
(H)解約差損益金	△ 14,578,510,501
(I)合 計(E+F+G+H)	155,754,053,026
次 期 繰 越 損 益 金(I)	155,754,053,026

- (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 28 期

(計算期間：2020年5月21日～2020年11月20日)

運用方針

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

主要運用 対象

日本を除く主要国の国債

運用方法

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



ニッセイアセットマネジメント株式会社

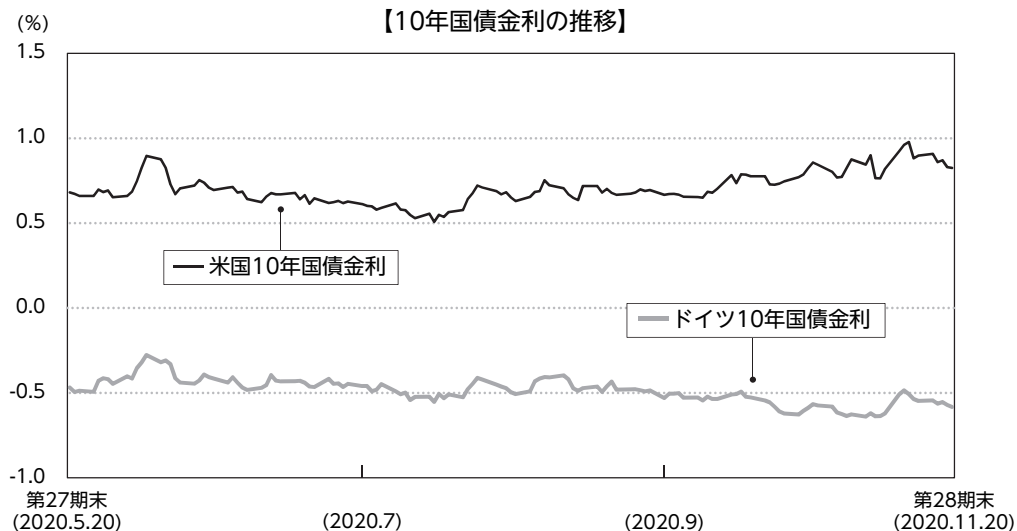
東京都千代田区丸の内1-6-6

運用経過

2020年5月21日～2020年11月20日

投資環境

海外債券市況

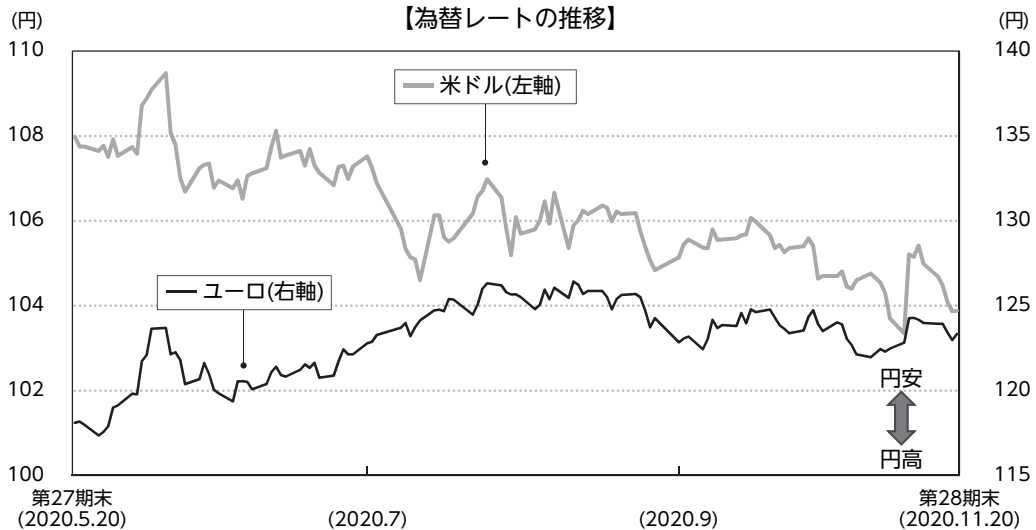


(注) 10年国債金利はブルームバーグのデータを使用しています。

当期の米国10年国債金利は、期初以降、新型コロナウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感などが上昇要因となる一方、同ウイルスの感染再拡大に対する警戒感などもあったことから上下に推移し、結局、期初を上回る水準で当期末を迎えました。

当期のドイツ10年国債金利は、期初以降、新型コロナウイルスの治療薬開発や欧州連合（EU）の復興基金への期待感などが上昇要因となる一方、同ウイルスの感染再拡大への警戒感が低下要因となり、結局、期初を下回る水準で当期末を迎えました。

■為替市況

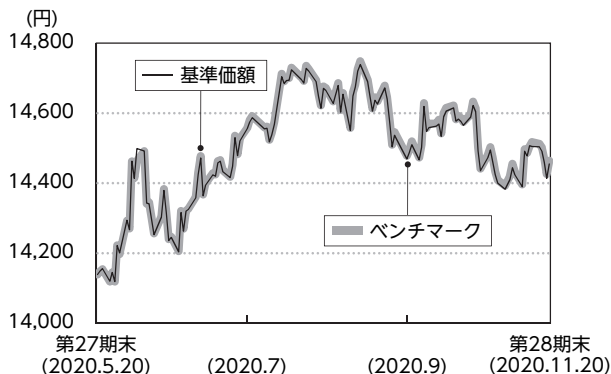


(注) 為替レートは対顧客電信売買相場仲値のデータを使用しています。

当期の米ドル/円レートは下落しました。期初以降、新型コロナウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感等から上昇する場面もありましたが、米中対立懸念や同ウイルスの感染再拡大への懸念などもあり、米ドルはおおむね下落基調で推移しました。

当期のユーロ/円レートは上昇しました。期初以降、欧米における新型コロナウイルスの治療薬開発や経済活動再開への期待感などから上昇しました。その後、6月に入ると同ウイルスの感染拡大第2波への警戒感などから下落しましたが、7月以降は欧州復興基金への期待感などもあり上昇基調となりました。9月から当期末にかけてはイギリス・EU間の通商交渉への観測などを背景に、ユーロは上下しつつもおおむね横ばいで推移しました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは前期末の基準価額にあわせて再指数化しています。

■ 基準価額の主な変動要因

<上昇要因>

- ・ 期初から8月にかけて、新型コロナウイルスの治療薬開発や欧州復興基金への期待感などからユーロが対円で上昇したこと

<下落要因>

- ・ 9月頃、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念などを背景とした投資家のリスク回避姿勢により、ユーロが対円で下落したこと

ポートフォリオ

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

ベンチマークとの差異

当期の基準価額騰落率は+2.2%となり、ベンチマーク騰落率(+2.3%)にほぼ連動しました。

今後の運用方針

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	期中	ベンチ マーク	期中	債券 組入比率	純資産 総額
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	百万円
24期(2018年11月20日)	13,234	△0.0	13,366	△0.0	99.1	17,768
25期(2019年5月20日)	13,428	1.5	13,563	1.5	99.1	19,686
26期(2019年11月20日)	13,803	2.8	13,945	2.8	99.1	24,872
27期(2020年5月20日)	14,139	2.4	14,296	2.5	99.0	26,883
28期(2020年11月20日)	14,455	2.2	14,625	2.3	99.1	32,658

(注) ベンチマークは設定時を10,000として指数化しています。

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)2020年5月20日	14,139	—	14,296	—	99.0
5月末	14,201	0.4	14,355	0.4	100.9
6月末	14,425	2.0	14,591	2.1	99.6
7月末	14,568	3.0	14,737	3.1	99.2
8月末	14,551	2.9	14,719	3.0	99.5
9月末	14,619	3.4	14,791	3.5	99.1
10月末	14,400	1.8	14,569	1.9	99.2
(期末)2020年11月20日	14,455	2.2	14,625	2.3	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

1万口当たりの費用明細

2020年5月21日～2020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	0.018%	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)	(0.018)	海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	<ul style="list-style-type: none"> ・ 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	0.018	

(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（14,495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

2020年5月21日～2020年11月20日

公社債

		買付額	売付額	
外国	アメリカ	千米ドル 34,214	千米ドル 12,425	
	カナダ	千カナダ・ドル 2,592	千カナダ・ドル 1,069	
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 4,088	千オーストラリア・ドル 347	
	シンガポール	千シンガポール・ドル 481	千シンガポール・ドル 222	
	イギリス	千イギリス・ポンド 3,722	千イギリス・ポンド 969	
	イスラエル	千イスラエル・シェケル 1,252	千イスラエル・シェケル 103	
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 2,361	千デンマーク・クローネ -	
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 1,223	千ノルウェー・クローネ 1,169	
	スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 2,053	千スウェーデン・クローナ -	
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 9,673	千メキシコ・ペソ 3,201	
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 1,461	千マレーシア・リンギット 457	
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 2,182	千ポーランド・ズロチ 838	
	ユーロ	アイルランド	千ユーロ 458	千ユーロ -
		オランダ	1,134	279
		ベルギー	1,170	303
		フランス	5,885	1,067
		ドイツ	4,960	1,405
		スペイン	3,318	842
		イタリア	5,510	1,970
フィンランド		366	-	
オーストリア	792	260		

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 地域は発行通貨によって区分しています。以下同じです。

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

主要な売買銘柄

2020年5月21日～2020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	165,133	US TREASURY	240,207
US TREASURY	164,991	US TREASURY	182,629
US TREASURY	157,250	US TREASURY	181,270
US TREASURY	144,425	US TREASURY	179,155
US TREASURY	138,065	US TREASURY	163,903
US TREASURY	135,731	US TREASURY	94,113
US TREASURY	125,466	FRANCE (GOVT OF)	71,655
US TREASURY	110,886	US TREASURY	58,221
US TREASURY	107,960	BUONI POLIENNALI DEL TES	52,745
US TREASURY	98,709	BUONI POLIENNALI DEL TES	45,981

(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

2020年11月20日現在

外国（外貨建）公社債

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	122,640	134,720	13,994,787	42.9	—	18.7	15.9	8.2
	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ	7,330	8,163	648,428	2.0	—	0.9	0.6	0.5
	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア	10,180	11,434	864,482	2.6	—	1.9	0.6	0.2
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール	1,610	1,835	141,780	0.4	—	0.3	0.1	0.1
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	12,020	15,488	2,132,511	6.5	—	5.1	1.1	0.4
	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル						
イスラエル	3,910	4,546	141,117	0.4	—	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	
	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	%	%	%	%	%	
デンマーク	8,750	10,971	181,577	0.6	—	0.4	0.1	0.1	
	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ							
ノルウェー	5,710	6,091	70,238	0.2	—	0.1	0.1	—	
	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ							
スウェーデン	7,920	8,836	106,739	0.3	—	0.2	0.1	0.1	
	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ							
メキシコ	45,710	51,116	262,739	0.8	—	0.4	0.2	0.1	
	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット							
マレーシア	5,890	6,381	161,974	0.5	—	0.3	0.1	0.1	
	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ							
ポーランド	6,780	7,453	205,646	0.6	—	0.3	0.2	0.1	
	千ユーロ	千ユーロ							
ユーロ	アイルランド	1,920	2,227	274,772	0.8	—	0.6	0.2	0.1
	オランダ	4,280	5,223	644,253	2.0	—	1.3	0.5	0.2
	ベルギー	5,250	6,685	824,600	2.5	—	1.9	0.4	0.2
	フランス	22,580	27,782	3,426,640	10.5	—	7.3	2.4	0.9
	ドイツ	16,690	20,187	2,489,941	7.6	—	4.7	2.0	1.0
	スペイン	13,240	16,248	2,004,115	6.1	—	4.0	1.6	0.5
	イタリア	20,900	25,088	3,094,383	9.5	—	6.0	2.3	1.1
	フィンランド	1,480	1,679	207,125	0.6	—	0.4	0.2	0.1
	オーストリア	3,200	4,011	494,746	1.5	—	1.0	0.4	0.1
合計	—	—	32,372,603	99.1	—	56.0	29.3	13.8	

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

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

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

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

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

(外国公社債の内訳)

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	6.0000	2026/02/15	100	128	13,393
	US TREASURY	6.1250	2027/11/15	120	165	17,195
	US TREASURY	5.5000	2028/08/15	90	122	12,766
	US TREASURY	5.2500	2028/11/15	120	162	16,901
	US TREASURY	5.2500	2029/02/15	80	109	11,344
	US TREASURY	5.3750	2031/02/15	120	173	18,057
	US TREASURY	2.0000	2021/11/15	1,990	2,026	210,564
	US TREASURY	2.6250	2021/12/15	1,770	1,817	188,765
	US TREASURY	2.1250	2021/12/31	1,710	1,747	181,574
	US TREASURY	2.0000	2022/02/15	2,170	2,220	230,622
	US TREASURY	2.3750	2022/03/15	1,720	1,770	183,914
	US TREASURY	1.7500	2022/03/31	1,670	1,706	177,252
	US TREASURY	1.7500	2022/05/15	2,290	2,343	243,487
	US TREASURY	1.7500	2022/06/15	1,960	2,008	208,654
	US TREASURY	2.1250	2022/06/30	1,930	1,990	206,791
	US TREASURY	1.6250	2022/08/15	2,380	2,440	253,472
	US TREASURY	1.6250	2022/08/31	2,030	2,082	216,321
	US TREASURY	1.7500	2022/09/30	1,940	1,996	207,429
	US TREASURY	1.6250	2022/11/15	1,700	1,748	181,637
	US TREASURY	1.6250	2022/12/15	1,290	1,328	137,998
	US TREASURY	2.1250	2022/12/31	1,200	1,249	129,758
	US TREASURY	2.0000	2023/02/15	1,820	1,893	196,659
	US TREASURY	1.5000	2023/02/28	1,140	1,173	121,942
	US TREASURY	1.5000	2023/03/31	1,290	1,329	138,144
	US TREASURY	1.7500	2023/05/15	2,160	2,242	232,979
	US TREASURY	0.2500	2023/06/15	1,500	1,501	156,014
	US TREASURY	1.3750	2023/06/30	1,390	1,432	148,820
	US TREASURY	2.5000	2023/08/15	2,170	2,305	239,508
	US TREASURY	0.1250	2023/09/15	1,580	1,575	163,706
	US TREASURY	1.3750	2023/09/30	1,580	1,632	169,586
	US TREASURY	2.7500	2023/11/15	1,950	2,096	217,780
	US TREASURY	2.2500	2023/12/31	1,200	1,275	132,470
	US TREASURY	2.7500	2024/02/15	1,930	2,086	216,713
	US TREASURY	2.1250	2024/03/31	1,260	1,338	139,078
	US TREASURY	2.5000	2024/05/15	2,170	2,338	242,880
	US TREASURY	2.0000	2024/06/30	1,240	1,317	136,841
	US TREASURY	2.3750	2024/08/15	2,290	2,468	256,404

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千米ドル	千円
アメリカ	%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券					
US TREASURY	2.1250	2024/09/30	1,290	1,380	143,432
US TREASURY	2.2500	2024/11/15	2,250	2,423	251,734
US TREASURY	2.2500	2024/12/31	1,400	1,510	156,951
US TREASURY	2.0000	2025/02/15	2,210	2,365	245,716
US TREASURY	2.6250	2025/03/31	1,430	1,571	163,275
US TREASURY	2.1250	2025/05/15	2,130	2,297	238,713
US TREASURY	2.7500	2025/06/30	1,540	1,708	177,478
US TREASURY	2.0000	2025/08/15	2,490	2,680	278,484
US TREASURY	3.0000	2025/09/30	1,530	1,723	179,002
US TREASURY	2.2500	2025/11/15	1,570	1,713	178,004
US TREASURY	2.6250	2025/12/31	630	700	72,783
US TREASURY	1.6250	2026/02/15	1,280	1,359	141,255
US TREASURY	2.2500	2026/03/31	840	920	95,657
US TREASURY	1.6250	2026/05/15	1,390	1,478	153,575
US TREASURY	1.8750	2026/06/30	600	646	67,189
US TREASURY	1.5000	2026/08/15	1,340	1,416	147,197
US TREASURY	1.6250	2026/09/30	680	724	75,234
US TREASURY	2.0000	2026/11/15	1,190	1,294	134,447
US TREASURY	1.7500	2026/12/31	620	665	69,165
US TREASURY	2.2500	2027/02/15	1,160	1,282	133,176
US TREASURY	0.6250	2027/03/31	590	592	61,549
US TREASURY	2.3750	2027/05/15	1,500	1,673	173,829
US TREASURY	0.5000	2027/06/30	910	904	93,994
US TREASURY	2.2500	2027/08/15	1,950	2,164	224,799
US TREASURY	0.3750	2027/09/30	840	826	85,841
US TREASURY	2.2500	2027/11/15	790	878	91,249
US TREASURY	2.7500	2028/02/15	930	1,068	111,016
US TREASURY	2.8750	2028/05/15	1,000	1,161	120,646
US TREASURY	2.8750	2028/08/15	990	1,153	119,789
US TREASURY	3.1250	2028/11/15	980	1,164	120,917
US TREASURY	2.6250	2029/02/15	960	1,105	114,851
US TREASURY	2.3750	2029/05/15	800	907	94,234
US TREASURY	1.6250	2029/08/15	680	729	75,817
US TREASURY	1.7500	2029/11/15	580	629	65,373
US TREASURY	1.5000	2030/02/15	1,010	1,073	111,467
US TREASURY	0.6250	2030/08/15	1,590	1,557	161,839
US TREASURY	4.5000	2036/02/15	120	177	18,482
US TREASURY	5.0000	2037/05/15	100	158	16,474

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	
				千米ドル	千円
アメリカ	%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券					
US TREASURY	4.3750	2038/02/15	100	150	15,640
US TREASURY	4.5000	2038/05/15	110	168	17,485
US TREASURY	3.5000	2039/02/15	130	178	18,583
US TREASURY	4.2500	2039/05/15	190	285	29,695
US TREASURY	4.5000	2039/08/15	190	294	30,604
US TREASURY	4.3750	2039/11/15	200	306	31,840
US TREASURY	4.6250	2040/02/15	200	316	32,826
US TREASURY	1.1250	2040/05/15	820	789	81,973
US TREASURY	1.1250	2040/08/15	720	690	71,777
US TREASURY	3.8750	2040/08/15	190	275	28,652
US TREASURY	4.2500	2040/11/15	200	304	31,637
US TREASURY	4.7500	2041/02/15	210	339	35,297
US TREASURY	3.1250	2041/11/15	190	251	26,147
US TREASURY	3.1250	2042/02/15	240	318	33,111
US TREASURY	3.0000	2042/05/15	200	260	27,070
US TREASURY	2.7500	2042/08/15	280	351	36,519
US TREASURY	2.7500	2042/11/15	360	451	46,928
US TREASURY	3.1250	2043/02/15	350	465	48,343
US TREASURY	2.8750	2043/05/15	470	602	62,549
US TREASURY	3.6250	2043/08/15	390	558	57,981
US TREASURY	3.7500	2043/11/15	380	554	57,570
US TREASURY	3.6250	2044/02/15	480	688	71,560
US TREASURY	3.3750	2044/05/15	460	637	66,237
US TREASURY	3.1250	2044/08/15	510	681	70,807
US TREASURY	3.0000	2044/11/15	470	616	64,067
US TREASURY	2.5000	2045/02/15	530	640	66,540
US TREASURY	3.0000	2045/05/15	440	578	60,106
US TREASURY	2.8750	2045/08/15	440	567	58,945
US TREASURY	3.0000	2045/11/15	320	422	43,845
US TREASURY	2.5000	2046/02/15	480	581	60,403
US TREASURY	2.5000	2046/05/15	480	581	60,430
US TREASURY	2.2500	2046/08/15	510	590	61,333
US TREASURY	2.8750	2046/11/15	440	570	59,247
US TREASURY	3.0000	2047/02/15	450	596	62,015
US TREASURY	3.0000	2047/05/15	340	451	46,910
US TREASURY	2.7500	2047/08/15	510	648	67,417
US TREASURY	2.7500	2047/11/15	520	662	68,813
US TREASURY	3.0000	2048/02/15	600	799	83,007

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	
					千米ドル	千円
アメリカ		%		千米ドル	千米ドル	千円
国債証券	US TREASURY	3.1250	2048/05/15	610	830	86,311
	US TREASURY	3.0000	2048/08/15	680	907	94,312
	US TREASURY	3.3750	2048/11/15	690	983	102,147
	US TREASURY	3.0000	2049/02/15	730	977	101,502
	US TREASURY	2.8750	2049/05/15	730	956	99,348
	US TREASURY	2.2500	2049/08/15	750	871	90,542
	US TREASURY	2.3750	2049/11/15	650	775	80,564
	US TREASURY	2.0000	2050/02/15	790	871	90,553
	US TREASURY	1.3750	2050/08/15	1,090	1,036	107,673
	US TREASURY	6.2500	2030/05/15	110	165	17,169
	US TREASURY	0.6250	2030/05/15	1,280	1,256	130,576
	US TREASURY	4.3750	2040/05/15	200	307	31,986
	US TREASURY	4.3750	2041/05/15	180	279	29,037
	US TREASURY	3.7500	2041/08/15	200	287	29,901
	US TREASURY	1.2500	2050/05/15	910	838	87,145
小計		-	-	-	-	13,994,787
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	60	91	7,257
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2021/11/01	120	121	9,625
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2022/02/01	110	111	8,871
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2022/03/01	230	230	18,332
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2022/05/01	170	173	13,749
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2022/06/01	170	176	14,020
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2022/08/01	260	259	20,651
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2022/09/01	340	344	27,362
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2022/11/01	460	459	36,525
	CANADIAN GOVERNMENT	1.7500	2023/03/01	370	382	30,370
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2023/06/01	200	206	16,372
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2023/09/01	370	387	30,776
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2024/03/01	150	159	12,667
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2024/04/01	120	119	9,511
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5000	2024/06/01	160	172	13,679
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2024/09/01	200	208	16,582
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2025/03/01	200	207	16,482
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2025/06/01	170	184	14,630
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2025/09/01	550	552	43,870
	CANADIAN GOVERNMENT	0.2500	2026/03/01	90	89	7,075
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/06/01	180	190	15,107

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千カナダ・ドル	千円
カナダ		%		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.0000	2027/06/01	180	185	14,750
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0000	2027/06/01	60	88	7,054
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/06/01	160	177	14,069
	CANADIAN GOVERNMENT	2.2500	2029/06/01	170	193	15,343
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2029/06/01	140	199	15,856
	CANADIAN GOVERNMENT	1.2500	2030/06/01	580	609	48,429
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5000	2030/12/01	130	126	10,085
	CANADIAN GOVERNMENT	5.7500	2033/06/01	170	269	21,414
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0000	2037/06/01	130	211	16,792
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0000	2041/06/01	150	232	18,430
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5000	2045/12/01	220	332	26,442
	CANADIAN GOVERNMENT	2.7500	2048/12/01	200	274	21,812
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0000	2051/12/01	360	433	34,424
小計		-	-	-	-	648,428
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0000	2021/12/21	260	265	20,068
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.7500	2022/07/15	360	393	29,753
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2022/11/21	410	427	32,325
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5000	2023/04/21	500	564	42,702
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2024/04/21	660	719	54,389
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.2500	2024/11/21	280	280	21,223
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2025/04/21	500	566	42,811
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.2500	2025/11/21	360	359	27,150
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.2500	2026/04/21	510	617	46,648
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.5000	2026/09/21	400	402	30,411
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.7500	2027/04/21	440	559	42,291
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2027/11/21	420	483	36,585
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.2500	2028/05/21	450	504	38,138
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2028/11/21	470	546	41,320
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2029/04/21	490	591	44,733
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2029/11/21	490	573	43,392
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5000	2030/05/21	530	610	46,189
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2030/12/21	440	444	33,631
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5000	2031/06/21	360	380	28,800
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0000	2031/11/21	360	361	27,330
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.2500	2032/05/21	280	287	21,753
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5000	2033/04/21	210	294	22,298
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2035/06/21	140	168	12,738

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
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	3.7500	2037/04/21	180	242	18,348
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.2500	2039/06/21	150	191	14,483
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.7500	2041/05/21	100	119	9,010
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0000	2047/03/21	200	251	18,997
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.7500	2051/06/21	230	224	16,953
小計		-	-	-	-	864,482
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	1.7500	2022/04/01	70	71	5,518
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.1250	2022/09/01	140	147	11,365
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2023/07/01	220	233	18,069
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0000	2024/09/01	170	186	14,409
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2025/06/01	90	97	7,543
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.1250	2026/06/01	70	75	5,857
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5000	2027/03/01	110	128	9,947
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.6250	2028/05/01	60	67	5,238
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2029/07/01	110	127	9,864
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.8750	2030/09/01	100	117	9,107
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.3750	2033/09/01	100	127	9,812
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.2500	2036/08/01	90	103	7,987
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.3750	2039/07/01	50	59	4,577
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2042/04/01	60	76	5,889
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.7500	2046/03/01	110	144	11,133
SINGAPORE GOVERNMENT	1.8750	2050/03/01	60	70	5,459	
小計		-	-	-	-	141,780
イギリス				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	
国債証券	UK TREASURY	4.5000	2034/09/07	210	319	43,986
	UK TREASURY	4.5000	2042/12/07	280	484	66,772
	UK TREASURY	4.2500	2036/03/07	280	426	58,709
	UK TREASURY	4.2500	2046/12/07	260	461	63,588
	UK TREASURY	4.2500	2027/12/07	200	257	35,513
	UK TREASURY	4.2500	2032/06/07	270	385	53,090
	UK TREASURY	4.2500	2039/09/07	200	321	44,266
	UK TREASURY	4.2500	2040/12/07	240	392	54,017
	UK TREASURY	4.2500	2055/12/07	260	522	71,961
	UK TREASURY	4.7500	2030/12/07	250	359	49,477
	UK TREASURY	4.0000	2022/03/07	210	220	30,426
	UK TREASURY	4.0000	2060/01/22	190	387	53,416
	UK TREASURY	4.7500	2038/12/07	230	386	53,166

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						千円	千円
イギリス		%		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
国債証券	UK TREASURY	5.0000	2025/03/07	230	279	38,504	
	UK TREASURY	6.0000	2028/12/07	160	233	32,167	
	UK TREASURY	0.5000	2061/10/22	160	140	19,356	
	UK TREASURY	0.1250	2023/01/31	510	511	70,418	
	UK TREASURY	0.1250	2026/01/30	250	250	34,521	
	UK TREASURY	0.1250	2028/01/31	250	248	34,271	
	UK TREASURY	0.3750	2030/10/22	400	401	55,231	
	UK TREASURY	0.6250	2025/06/07	410	421	58,039	
	UK TREASURY	0.6250	2050/10/22	250	230	31,792	
	UK TREASURY	1.5000	2026/07/22	230	249	34,294	
	UK TREASURY	1.5000	2047/07/22	300	341	47,013	
	UK TREASURY	1.2500	2027/07/22	280	301	41,444	
	UK TREASURY	1.2500	2041/10/22	240	257	35,464	
	UK TREASURY	1.6250	2028/10/22	250	278	38,322	
	UK TREASURY	1.6250	2054/10/22	190	229	31,649	
	UK TREASURY	1.6250	2071/10/22	110	149	20,605	
	UK TREASURY	1.0000	2024/04/22	350	362	49,897	
	UK TREASURY	1.7500	2022/09/07	350	361	49,740	
	UK TREASURY	1.7500	2049/01/22	170	205	28,302	
	UK TREASURY	1.7500	2057/07/22	290	368	50,785	
	UK TREASURY	2.2500	2023/09/07	220	234	32,235	
	UK TREASURY	2.7500	2024/09/07	170	187	25,873	
	UK TREASURY	2.0000	2025/09/07	180	197	27,155	
	UK TREASURY	0.8750	2029/10/22	240	252	34,786	
	UK TREASURY	3.5000	2068/07/22	220	449	61,886	
	UK TREASURY	3.2500	2044/01/22	320	478	65,838	
	UK TREASURY	3.7500	2052/07/22	210	375	51,670	
	UK TREASURY	3.5000	2045/01/22	340	532	73,270	
	UK TREASURY	4.2500	2049/12/07	190	352	48,514	
	UK TREASURY	0.6250	2035/07/31	150	148	20,488	
	UK TREASURY	0.5000	2022/07/22	400	403	55,569	
	UK TREASURY	0.7500	2023/07/22	320	326	45,000	
	UK TREASURY	1.7500	2037/09/07	370	428	58,997	
	UK TREASURY	2.5000	2065/07/22	230	370	51,006	
小計		-	-	-	-	2,132,511	
イスラエル				千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル		
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1.2500	2022/11/30	710	734	22,810	
	ISRAEL FIXED BOND	1.5000	2023/11/30	650	684	21,242	

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
イスラエル		%		千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	3.7500	2024/03/31	300	342	10,624
	ISRAEL FIXED BOND	1.7500	2025/08/31	490	524	16,275
	ISRAEL FIXED BOND	6.2500	2026/10/30	250	336	10,447
	ISRAEL FIXED BOND	2.0000	2027/03/31	280	310	9,638
	ISRAEL FIXED BOND	2.2500	2028/09/28	270	304	9,456
	ISRAEL FIXED BOND	1.0000	2030/03/31	210	215	6,685
	ISRAEL FIXED BOND	1.5000	2037/05/31	180	183	5,684
	ISRAEL FIXED BOND	5.5000	2042/01/31	290	510	15,834
	ISRAEL FIXED BOND	3.7500	2047/03/31	280	400	12,418
小計		-	-	-	-	141,117
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	3.0000	2021/11/15	920	952	15,767
	KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2022/11/15	910	926	15,327
	KINGDOM OF DENMARK	1.5000	2023/11/15	920	979	16,211
	KINGDOM OF DENMARK	1.7500	2025/11/15	950	1,063	17,595
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2027/11/15	1,240	1,330	22,023
	KINGDOM OF DENMARK	0.5000	2029/11/15	1,550	1,686	27,915
	KINGDOM OF DENMARK	4.5000	2039/11/15	1,900	3,639	60,229
	KINGDOM OF DENMARK	0.2500	2052/11/15	360	393	6,506
小計		-	-	-	-	181,577
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	2.0000	2023/05/24	1,180	1,231	14,194
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0000	2024/03/14	880	957	11,039
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2025/03/13	600	633	7,308
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5000	2026/02/19	560	588	6,788
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2027/02/17	640	685	7,905
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0000	2028/04/26	560	614	7,084
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.7500	2029/09/06	630	684	7,888
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.3750	2030/08/19	660	696	8,027
小計		-	-	-	-	70,238
スウェーデン				千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2022/06/01	1,620	1,717	20,746
	SWEDISH GOVERNMENT	1.5000	2023/11/13	1,370	1,447	17,482
	SWEDISH GOVERNMENT	2.5000	2025/05/12	1,070	1,208	14,601
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0000	2026/11/12	950	1,022	12,351
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2028/05/12	860	920	11,117
	SWEDISH GOVERNMENT	0.7500	2029/11/12	900	970	11,719
	SWEDISH GOVERNMENT	0.1250	2031/05/12	450	455	5,504

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千スイーデン・クローナ	千スイーデン・クローナ
スウェーデン		%				千円
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	3.5000	2039/03/30	700	1,093	13,215
小計		-	-	-	-	106,739
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.2500	2021/12/09	3,150	3,241	16,658
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5000	2022/06/09	4,550	4,685	24,085
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2023/12/07	6,440	7,042	36,200
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2024/12/05	6,840	8,104	41,656
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.7500	2026/03/05	2,970	3,040	15,627
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5000	2027/06/03	4,140	4,601	23,650
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2029/05/31	4,640	5,513	28,340
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2031/05/29	2,050	2,332	11,986
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2034/11/23	1,520	1,714	8,811
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0000	2036/11/20	1,100	1,472	7,570
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5000	2038/11/18	2,660	3,128	16,082
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.7500	2042/11/13	2,870	3,137	16,125
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0000	2047/11/07	2,780	3,101	15,943
小計		-	-	-	-	262,739
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	3.6200	2021/11/30	310	316	8,026
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4180	2022/08/15	470	483	12,280
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.4800	2023/03/15	560	580	14,742
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.1810	2024/07/15	490	526	13,352
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9550	2025/09/15	350	379	9,625
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.3920	2026/04/15	140	155	3,935
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.9000	2026/11/30	300	325	8,268
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8920	2027/03/15	510	554	14,075
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7330	2028/06/15	200	216	5,504
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8850	2029/08/15	290	316	8,034
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.4980	2030/04/15	220	251	6,391
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2320	2031/06/30	260	293	7,440
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8440	2033/04/15	410	442	11,235
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.8280	2034/07/05	220	236	6,000
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.2540	2035/05/31	110	122	3,108
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7620	2037/04/07	180	211	5,369
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.8930	2038/06/08	130	153	3,893
	MALAYSIA GOVERNMENT	3.7570	2040/05/22	200	208	5,288
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9350	2043/09/30	130	150	3,812
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.7360	2046/03/15	160	180	4,584

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額		評価額	
						千円	邦貨換算金額
マレーシア		%		千円・シリング	千円・シリング	千円	
国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.9210	2048/07/06	170	195	4,966	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4.0650	2050/06/15	80	80	2,037	
小計		-	-	-	-	161,974	
ポーランド				千円・ズロチ	千円・ズロチ		
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.2500	2022/04/25	640	660	18,223	
	POLAND GOVERNMENT BOND	-	2022/07/25	350	349	9,651	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2022/09/23	470	519	14,333	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2023/01/25	460	484	13,365	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.0000	2023/10/25	420	468	12,924	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2024/04/25	990	1,070	29,529	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3.2500	2025/07/25	760	860	23,743	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2026/07/25	700	775	21,397	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5000	2027/07/25	460	512	14,131	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2028/04/25	510	579	15,983	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.7500	2029/04/25	130	181	5,013	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.7500	2029/10/25	690	790	21,796	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.2500	2030/10/25	200	201	5,551	
	小計		-	-	-	-	205,646
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
アイルランド							
国債証券	IRISH TREASURY	0.2000	2030/10/18	100	104	12,908	
	IRISH TREASURY	0.2000	2027/05/15	100	104	12,887	
	IRISH TREASURY	0.4000	2035/05/15	70	74	9,193	
	IRISH TREASURY	0.8000	2022/03/15	110	112	13,826	
	IRISH TREASURY	1.0000	2026/05/15	180	195	24,120	
	IRISH TREASURY	1.1000	2029/05/15	130	146	18,055	
	IRISH TREASURY	1.3000	2033/05/15	70	82	10,205	
	IRISH TREASURY	1.3500	2031/03/18	90	105	12,966	
	IRISH TREASURY	1.5000	2050/05/15	80	106	13,137	
	IRISH TREASURY	1.7000	2037/05/15	90	114	14,170	
	IRISH TREASURY	2.0000	2045/02/18	130	185	22,905	
	IRISH TREASURY	2.4000	2030/05/15	140	176	21,772	
	IRISH TREASURY	0.0000	2022/10/18	80	80	9,989	
	IRISH TREASURY	0.9000	2028/05/15	150	165	20,361	
	IRISH TREASURY	3.4000	2024/03/18	120	136	16,796	
	IRISH TREASURY	3.9000	2023/03/20	110	121	15,013	
	IRISH TREASURY	5.4000	2025/03/13	170	214	26,461	
小計		-	-	-	-	274,772	

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						
オランダ						
国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2022/01/15	230	231	28,600
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.2500	2022/07/15	230	241	29,768
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2023/01/15	210	230	28,418
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.7500	2023/07/15	270	287	35,519
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2024/01/15	240	245	30,287
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0000	2024/07/15	220	242	29,868
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2025/07/15	230	240	29,657
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2026/07/15	260	277	34,239
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2027/01/15	180	187	23,085
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2027/07/15	230	251	31,035
	NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5000	2028/01/15	190	274	33,918
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.7500	2028/07/15	230	254	31,367
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.2500	2029/07/15	180	192	23,785
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2030/07/15	220	230	28,451
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5000	2033/01/15	200	272	33,640
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0000	2037/01/15	240	412	50,828
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5000	2040/01/15	140	160	19,772
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.7500	2042/01/15	240	448	55,371
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.7500	2047/01/15	250	447	55,183
	NETHERLANDS GOVERNMENT	0.0000	2052/01/15	90	92	11,452
小計						
-						
-						
-						
-						
644,253						
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2022/03/28	210	223	27,548
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2022/09/28	240	262	32,345
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2023/06/22	200	215	26,578
	BELGIUM KINGDOM	0.2000	2023/10/22	140	143	17,726
	BELGIUM KINGDOM	2.6000	2024/06/22	230	257	31,765
	BELGIUM KINGDOM	0.5000	2024/10/22	200	209	25,833
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2025/06/22	270	288	35,573
	BELGIUM KINGDOM	4.5000	2026/03/28	170	217	26,819
	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2026/06/22	230	251	30,971
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2027/06/22	220	240	29,622
	BELGIUM KINGDOM	0.0000	2027/10/22	130	134	16,643
	BELGIUM KINGDOM	5.5000	2028/03/28	290	421	51,961
	BELGIUM KINGDOM	0.8000	2028/06/22	220	242	29,903
	BELGIUM KINGDOM	0.9000	2029/06/22	250	279	34,493
	BELGIUM KINGDOM	0.1000	2030/06/22	190	198	24,543

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ベルギー						
国債証券	BELGIUM KINGDOM	1.0000	2031/06/22	230	262	32,399
	BELGIUM KINGDOM	4.0000	2032/03/28	120	179	22,167
	BELGIUM KINGDOM	1.2500	2033/04/22	120	142	17,617
	BELGIUM KINGDOM	3.0000	2034/06/22	130	187	23,073
	BELGIUM KINGDOM	5.0000	2035/03/28	290	508	62,677
	BELGIUM KINGDOM	1.4500	2037/06/22	70	87	10,771
	BELGIUM KINGDOM	1.9000	2038/06/22	140	186	23,052
	BELGIUM KINGDOM	0.4000	2040/06/22	80	84	10,452
	BELGIUM KINGDOM	4.2500	2041/03/28	270	494	61,027
	BELGIUM KINGDOM	3.7500	2045/06/22	150	277	34,192
	BELGIUM KINGDOM	1.6000	2047/06/22	160	214	26,487
	BELGIUM KINGDOM	1.7000	2050/06/22	110	153	18,916
	BELGIUM KINGDOM	2.2500	2057/06/22	90	147	18,249
	BELGIUM KINGDOM	2.1500	2066/06/22	100	171	21,185
小計		-	-	-	-	824,600
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2022/02/25	440	443	54,740
	FRANCE (GOVT OF)	3.0000	2022/04/25	700	736	90,897
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2022/05/25	480	485	59,830
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2022/10/25	560	592	73,042
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2023/02/25	80	81	10,022
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2023/03/25	770	782	96,550
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2023/05/25	860	913	112,669
	FRANCE (GOVT OF)	4.2500	2023/10/25	660	756	93,361
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2024/03/25	600	614	75,737
	FRANCE (GOVT OF)	2.2500	2024/05/25	520	574	70,858
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2024/11/25	580	637	78,610
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2025/03/25	670	689	85,039
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2025/05/25	610	642	79,263
	FRANCE (GOVT OF)	6.0000	2025/10/25	470	627	77,343
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2025/11/25	530	574	70,859
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2026/02/25	330	340	42,039
	FRANCE (GOVT OF)	3.5000	2026/04/25	680	835	103,051
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2026/05/25	610	648	79,973
	FRANCE (GOVT OF)	0.2500	2026/11/25	560	588	72,633
	FRANCE (GOVT OF)	1.0000	2027/05/25	540	596	73,550
	FRANCE (GOVT OF)	2.7500	2027/10/25	720	888	109,631

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名		利率	償還年月日	額面金額	評価額	
					千ユーロ	千円
ユーロ		%		千ユーロ	千ユーロ	千円
フランス						
国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/05/25	700	767	94,716
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2028/11/25	600	660	81,498
	FRANCE (GOVT OF)	5.5000	2029/04/25	610	924	113,990
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2029/05/25	500	541	66,781
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2029/11/25	610	633	78,094
	FRANCE (GOVT OF)	2.5000	2030/05/25	750	960	118,505
	FRANCE (GOVT OF)	0.0000	2030/11/25	370	382	47,213
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2031/05/25	730	872	107,643
	FRANCE (GOVT OF)	5.7500	2032/10/25	490	850	104,843
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2034/05/25	550	657	81,061
	FRANCE (GOVT OF)	4.7500	2035/04/25	440	757	93,460
	FRANCE (GOVT OF)	1.2500	2036/05/25	530	640	79,044
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2038/10/25	400	692	85,363
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2039/06/25	410	544	67,156
	FRANCE (GOVT OF)	0.5000	2040/05/25	150	162	20,067
	FRANCE (GOVT OF)	4.5000	2041/04/25	560	1,067	131,717
	FRANCE (GOVT OF)	3.2500	2045/05/25	380	661	81,593
	FRANCE (GOVT OF)	2.0000	2048/05/25	410	603	74,472
	FRANCE (GOVT OF)	1.5000	2050/05/25	440	592	73,080
	FRANCE (GOVT OF)	0.7500	2052/05/25	280	315	38,926
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2055/04/25	250	547	67,571
	FRANCE (GOVT OF)	4.0000	2060/04/25	250	581	71,771
	FRANCE (GOVT OF)	1.7500	2066/05/25	200	311	38,360
小計		-	-	-	-	3,426,640
ドイツ						
国債証券	BUNDESobligation	0.0000	2022/04/08	310	313	38,616
	BUNDESobligation	0.0000	2022/10/07	300	304	37,522
	BUNDESobligation	0.0000	2023/04/14	270	275	33,923
	BUNDESobligation	0.0000	2023/10/13	290	296	36,587
	BUNDESobligation	0.0000	2024/10/18	330	339	41,933
	BUNDESobligation	0.0000	2025/04/11	300	310	38,249
	BUNDESobligation	0.0000	2025/10/10	270	280	34,544
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2022/01/04	330	340	41,957
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2022/07/04	400	416	51,336
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2022/09/04	410	426	52,613
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/02/15	320	336	41,486
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2023/05/15	330	348	43,019

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額	
				千ユーロ	千円
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円
ドイツ					
国債証券					
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0000	2023/08/15	340	366	45,158
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7500	2024/02/15	570	617	76,147
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5000	2024/05/15	680	734	90,626
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2024/08/15	340	362	44,762
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2025/02/15	420	443	54,641
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0000	2025/08/15	420	455	56,211
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2026/02/15	470	501	61,864
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2026/08/15	440	459	56,646
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2027/02/15	470	499	61,628
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2027/08/15	440	477	58,858
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2027/11/15	330	346	42,721
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5000	2028/02/15	380	413	51,061
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2028/08/15	380	408	50,352
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.2500	2029/02/15	400	430	53,150
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2029/08/15	410	433	53,462
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.2500	2030/01/04	170	280	34,608
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/02/15	380	401	49,560
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	100	105	13,069
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2030/08/15	430	454	56,074
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2034/07/04	380	661	81,598
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2035/05/15	310	327	40,453
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0000	2037/01/04	410	713	87,958
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.2500	2039/07/04	290	549	67,792
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2040/07/04	310	633	78,143
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.2500	2042/07/04	290	523	64,538
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2044/07/04	430	723	89,241
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5000	2046/08/15	470	812	100,239
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.2500	2048/08/15	380	537	66,323
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.0000	2050/08/15	250	263	32,481
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2021/12/10	240	241	29,821
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2022/03/11	210	211	26,141
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2022/06/10	220	222	27,440
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.0000	2022/09/16	80	81	9,999
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5000	2027/07/04	200	298	36,810
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.6250	2028/01/04	250	366	45,170
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.7500	2028/07/04	220	314	38,756
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5000	2031/01/04	320	524	64,630
小計	-	-	-	-	2,489,941

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	0.0500	2021/10/31	310	311	38,459
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.8500	2022/01/31	340	366	45,151
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4000	2022/04/30	320	324	40,029
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4500	2022/10/31	280	285	35,244
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4000	2023/01/31	330	373	46,075
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2023/04/30	320	324	40,005
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.3500	2023/07/30	330	337	41,687
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4000	2023/10/31	320	366	45,263
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8000	2024/01/31	270	316	39,026
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8000	2024/04/30	310	356	43,985
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.2500	2024/07/30	250	257	31,721
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7500	2024/10/31	370	417	51,541
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.0000	2025/01/31	330	336	41,495
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6000	2025/04/30	320	349	43,127
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6500	2025/07/30	340	422	52,067
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.1500	2025/10/31	360	406	50,108
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2026/04/30	340	383	47,300
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9000	2026/07/30	340	462	57,021
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3000	2026/10/31	390	428	52,822
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5000	2027/04/30	300	334	41,302
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8000	2027/07/30	280	299	36,931
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2027/10/31	330	368	45,431
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/04/30	340	379	46,853
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4000	2028/07/30	320	358	44,202
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2028/10/31	270	383	47,313
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0000	2029/01/31	400	600	74,115
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4500	2029/04/30	320	361	44,563
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6000	2029/10/31	320	338	41,724
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5000	2030/04/30	330	345	42,583
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9500	2030/07/30	350	415	51,206
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2500	2030/10/31	370	413	50,977
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.7500	2032/07/30	340	560	69,147
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.3500	2033/07/30	290	366	45,148
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.8500	2035/07/30	300	363	44,790
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2000	2037/01/31	320	510	62,924
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9000	2040/07/30	280	506	62,513
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2000	2040/10/31	180	199	24,584

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	4.7000	2041/07/30	320	574	70,802
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.1500	2044/10/31	220	434	53,645
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9000	2046/10/31	260	389	48,088
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7000	2048/10/31	210	308	38,054
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0000	2050/10/31	200	206	25,527
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.4500	2066/07/30	220	401	49,549
	小計		-	-	-	-
イタリア						
国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.3500	2021/11/01	240	241	29,846
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1500	2021/12/15	280	287	35,521
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2022/04/15	840	861	106,225
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0000	2022/07/15	200	204	25,260
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9000	2022/08/01	270	276	34,062
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/09/01	270	298	36,814
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2022/09/15	290	299	36,999
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5000	2022/11/01	500	557	68,776
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0500	2023/01/15	30	30	3,735
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2023/03/15	480	494	61,018
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2023/05/01	480	537	66,275
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2023/08/01	370	421	51,934
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.6500	2023/10/15	750	770	95,091
	BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0000	2023/11/01	180	229	28,308
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.0000	2024/01/15	40	40	4,971
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2024/03/01	350	404	49,884
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8500	2024/05/15	500	536	66,112
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.7500	2024/09/01	300	344	42,484
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5000	2024/12/01	540	597	73,673
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.3500	2025/02/01	220	224	27,661
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2025/03/01	440	536	66,131
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5000	2025/06/01	820	878	108,308
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2025/12/01	560	616	76,011
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5000	2026/02/01	70	71	8,833
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5000	2026/03/01	380	468	57,808
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6000	2026/06/01	550	595	73,502
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2500	2026/12/01	580	618	76,277
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2000	2027/06/01	250	281	34,753
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0500	2027/08/01	500	559	69,012

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	6.5000	2027/11/01	400	569	70,278
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0000	2028/02/01	360	402	49,704
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2028/09/01	360	480	59,225
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2028/12/01	300	356	44,010
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0000	2029/08/01	300	364	44,994
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.2500	2029/11/01	450	637	78,633
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5000	2030/03/01	380	482	59,499
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.3500	2030/04/01	340	365	45,084
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9500	2030/08/01	250	259	31,962
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2030/12/01	350	385	47,548
	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9000	2031/04/01	90	92	11,389
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0000	2031/05/01	440	677	83,532
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6500	2032/03/01	380	418	51,630
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.7500	2033/02/01	310	488	60,225
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2033/09/01	280	334	41,210
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2034/08/01	390	595	73,444
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.3500	2035/03/01	220	290	35,835
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.4500	2036/03/01	190	202	24,951
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2500	2036/09/01	240	283	34,928
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0000	2037/02/01	420	601	74,230
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.9500	2038/09/01	230	297	36,632
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2039/08/01	340	558	68,891
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1000	2040/03/01	200	264	32,577
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0000	2040/09/01	330	547	67,488
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8000	2041/03/01	160	174	21,537
	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.7500	2044/09/01	270	455	56,178
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.2500	2046/09/01	250	349	43,115
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7000	2047/03/01	270	345	42,636
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.4500	2048/03/01	240	348	43,010
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.8500	2049/09/01	200	311	38,481
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.4500	2050/09/01	240	295	36,422
	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7000	2051/09/01	120	125	15,467
	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8000	2067/03/01	140	184	22,789
	BUONI POLIENNALI DEL TES	7.2500	2026/11/01	180	255	31,530
	小計	-	-	-	-	3,094,383
フィンランド						
国債証券	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2022/04/15	80	80	9,967

ニッセイ外国債券インデックスマザーファンド

銘柄名	利率	償還年月日	額面金額	評価額		
				千ユーロ	千円	
ユーロ	%		千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド						
国債証券						
	FINNISH GOVERNMENT	1.6250	2022/09/15	70	73	9,008
	FINNISH GOVERNMENT	1.5000	2023/04/15	70	73	9,100
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2023/09/15	90	91	11,329
	FINNISH GOVERNMENT	2.0000	2024/04/15	140	153	18,885
	FINNISH GOVERNMENT	4.0000	2025/07/04	90	109	13,549
	FINNISH GOVERNMENT	0.8750	2025/09/15	80	86	10,617
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2026/04/15	100	106	13,115
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2027/09/15	100	107	13,262
	FINNISH GOVERNMENT	2.7500	2028/07/04	140	176	21,708
	FINNISH GOVERNMENT	0.5000	2029/09/15	100	108	13,421
	FINNISH GOVERNMENT	0.0000	2030/09/15	50	52	6,419
	FINNISH GOVERNMENT	0.7500	2031/04/15	60	67	8,304
	FINNISH GOVERNMENT	1.1250	2034/04/15	80	95	11,743
	FINNISH GOVERNMENT	0.1250	2036/04/15	60	62	7,762
	FINNISH GOVERNMENT	0.2500	2040/09/15	50	53	6,598
	FINNISH GOVERNMENT	2.6250	2042/07/04	70	112	13,828
	FINNISH GOVERNMENT	1.3750	2047/04/15	50	68	8,502
小計						
		-	-	-	-	207,125
オーストリア						
国債証券						
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.6500	2022/04/20	130	138	17,022
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2022/09/20	110	111	13,747
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4000	2022/11/22	150	162	20,040
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2023/07/15	240	244	30,166
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.7500	2023/10/20	170	182	22,492
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.6500	2024/10/21	280	306	37,769
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2000	2025/10/20	180	196	24,291
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.8500	2026/03/15	150	195	24,051
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2026/10/20	200	216	26,718
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2027/04/20	150	160	19,850
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6.2500	2027/07/15	130	190	23,519
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2028/02/20	160	175	21,655
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5000	2029/02/20	160	173	21,412
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2030/02/20	150	156	19,248
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4000	2034/05/23	130	177	21,920
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.1500	2037/03/15	210	361	44,550
	REPUBLIC OF AUSTRIA	0.0000	2040/10/20	40	40	4,983
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.1500	2044/06/20	100	176	21,807

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
オーストリア					
国債証券					
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2047/02/20	110	152	18,863
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7500	2051/03/20	60	72	8,904
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8000	2062/01/26	60	147	18,193
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5000	2086/11/02	40	68	8,405
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1000	2117/09/20	90	203	25,131
小計	-	-	-	-	494,746
ユーロ小計	-	-	-	-	13,460,580
合計	-	-	-	-	32,372,603

投資信託財産の構成

2020年11月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	32,372,603	98.9
コール・ローン等、その他	376,227	1.1
投資信託財産総額	32,748,830	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103.88円、1カナダ・ドル79.43円、1オーストラリア・ドル75.60円、1シンガポール・ドル77.26円、1イギリス・ポンド137.68円、1イスラエル・シェケル31.04円、1デンマーク・クローネ16.55円、1ノルウェー・クローネ11.53円、1スウェーデン・クローナ12.08円、1メキシコ・ペソ5.14円、1マレーシア・リングギット25.38円、1ポーランド・ズロチ27.59円、1ユーロ123.34円です。

(注2) 外貨建純資産（32,615,187千円）の投資信託財産総額（32,748,830千円）に対する比率は99.6%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

(2020年11月20日現在)

項目	当期末
(A)資産	32,780,636,764円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	197,941,405
公 社 債(評価額)	32,372,603,021
未 収 入 金	31,806,192
未 収 利 息	164,814,898
前 払 費 用	13,471,248
(B)負債	122,350,745
未 払 金	32,114,574
未 払 解 約 金	90,235,999
そ の 他 未 払 費 用	172
(C)純 資 産 総 額(A - B)	32,658,286,019
元 本	22,593,334,379
次 期 繰 越 損 益 金	10,064,951,640
(D)受 益 権 総 口 数	22,593,334,379口
1万口当たり基準価額(C / D)	14,455円

(注1)	期首元本額	19,013,517,824円
	期中追加設定元本額	5,435,391,147円
	期中一部解約元本額	1,855,574,592円
(注2)	当マザーファンドの当期末元本額におけるペビエファンド別内訳は、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)	2,334,887,551円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(標準型)	3,866,542,648円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(株式重視型)	1,302,630,172円
	ニッセイ外国債券インデックスS A(適格機関投資家限定)	758,947,512円
	ニッセイインデックスバランス(債券重視型)	
	S A(適格機関投資家限定)	3,966,949円
	ニッセイインデックスバランス(標準型)	
	S A(適格機関投資家限定)	11,348,657円
	ニッセイインデックスバランス(成長型)	
	S A(適格機関投資家限定)	9,906,781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	10,287,697,386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)	1,348,446,447円
	DCニッセイ外国債券インデックス	1,310,372,857円
	DCニッセイターゲットデートファンド2055	46,718,492円
	DCニッセイワールドセレクトファンド(安定型)	911,353,650円
	DCニッセイターゲットデートファンド2045	47,289,025円
	DCニッセイターゲットデートファンド2035	106,427,690円
	DCニッセイターゲットデートファンド2025	33,342,256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)	72,331,508円
	ニッセイ・インデックスパッケージジ(内外・株式/リート/債券)	5,350,294円
	<購入・換金手数料なし>ニッセイ・インデックスバランスファンド(8資産均等型)	24,383,814円
	DCニッセイターゲットデートファンド2060	12,556,140円
	DCニッセイターゲットデートファンド2050	10,025,784円
	DCニッセイターゲットデートファンド2040	34,004,065円
	DCニッセイターゲットデートファンド2030	54,804,701円

損益の状況

当期(2020年5月21日~2020年11月20日)

項目	当期
(A)配 当 等 収 益	299,437,915円
受 取 利 息	299,476,632
支 払 利 息	△ 38,717
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	313,464,001
売 買 益	1,128,844,066
売 買 損	△ 815,380,065
(C)信 託 報 酬 等	△ 5,511,109
(D)当 期 損 益 金(A + B + C)	607,390,807
(E)前 期 繰 越 損 益 金	7,869,584,698
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	2,424,003,038
(G)解 約 差 損 益 金	△ 836,026,903
(H)合 計(D + E + F + G)	10,064,951,640
次 期 繰 越 損 益 金(H)	10,064,951,640

- (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。

指数に関して

■ ファンドのベンチマーク等について

- ・ T O P I X（東証株価指数）（配当込み）

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・ノウハウおよびT O P I Xの商標または標章に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。なお、当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、株式会社東京証券取引所は、当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

- ・ N O M U R A－B P I 総合

N O M U R A－B P I 総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

- ・ M S C I コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）

M S C I コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスです。同インデックスに関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同インデックスの内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同インデックスをもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

- ・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）

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